

# デリバティブ取引情報(連結)

## 取り扱い商品、取り組み方針について

当行では、お客さまのヘッジニーズ、運用・調達ニーズの多様化・高度化に対応した金融商品を競争力ある価格で提供すること、預貸金業務や有価証券保有等に付随して発生する市場リスクをコントロールすること、また、積極的な市場取引の推進を通じて収益力の向上を図ることを目的として、デリバティブ取引を行っています。

取り組みに際しては、金利・通貨等の相場の短期的な変動により利益を得ることを目的とするトレーディング取引については、東京・ニューヨーク・ロンドン・シンガポール・その他の海外支店に設置された特定取引部署が、与えられた限度額の範囲内で積極的かつ機動的に取引を行っています。また、預貸金等の銀行業務に付随して発生する市場リスクの調整取引については、経営会議等で審議された方針に基づき、ALM部署がリスク量の調整取引（ALMオペレーション）を行っています。

また、連結子会社のうち、スワップハウス等デリバティブ取引を専門的に行う海外連結子会社においては、当行の特定取引部署に準じた目的・方針にて取引を行っています。その他の連結子会社におけるデリバティブ取引は、業務に付随して発生する市場リスクのコントロールを目的としています。

## デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益

### (1) 金利関連取引

(単位：百万円)

区分	種類	平成12年3月末			
		契約額等	うち1年超	時価	評価損益
取引所	金利先物				
	売建	11,123,048	52,429	11,074,094	48,953
	買建	10,099,803	—	10,058,766	41,036
	金利オプション				
	売建				
	コール	—	—	—	—
	プット	(—)	—	—	—
	買建	(—)	—	—	—
	コール	—	—	—	—
	プット	(—)	—	—	—
店頭	金利先渡契約				
	売建	2,160	—	2,111	49
	買建	1,506	—	1,510	4
	金利スワップ	48,250,014	22,256,360	125,780	125,780
	うち受取変動・支払変動	27,361,147	11,051,720	499,210	499,210
	うち受取変動・支払固定	20,031,787	10,429,396	372,856	372,856
	うち受取変動・支払変動	508,746	427,421	395	395
	スワップション				
	売建				
	コール	98,150	48,200		
	プット	(3,309)	—	956	2,353
	買建	2,546	—	88	88
	コール	(—)			
	プット	19,356	11,356	156	110
	プット	(266)	—	68	68
	プット	2,546	—		
	プット	(—)			
キャップ					
売建	76,931	32,658	493	426	
買建	(67)	200,907	1,132	780	
買建	249,635				
買建	(1,913)				
フロアー					
売建	55,026	47,088	2,025	481	
買建	(1,543)	1,031	10	5	
買建	2,054				
買建	(5)				
その他					
売建	—	—	—	—	
買建	(—)	—	—	—	
買建	(—)	—	—	—	
買建	(—)	—	—	—	
合計				134,332	

(注)1. 時価の算定

取引所取引については、東京金融先物取引所等における最終の価格によっています。  
店頭取引については、割引現在価値やオプション価格計算モデル等により算定しています。

2. ( )内は連結貸借対照表に計上したオプション料です。
3. 金利スワップの時価及び評価損益には、連結貸借対照表及び連結損益計算書に計上した経過利息部分の205,785百万円が含まれています。
4. スワップションにおけるコール/プットは、次の定義によっています。  
コール：受取変動・支払固定の金利スワップを取り組む権利  
プット：受取固定・支払変動の金利スワップを取り組む権利
5. 金利スワップの残存期間別想定元本は次のとおりです。

(単位：百万円)

残存期間	平成12年3月末		
	1年内	1年超5年以内	5年超
金利スワップ想定元本合計	25,993,653	18,638,574	3,617,785
うち受取固定・支払変動	16,309,427	9,537,209	1,514,511
うち受取変動・支払固定	9,602,391	8,382,812	2,046,583
うち受取変動・支払変動	81,325	370,730	56,690

6. 特定取引(トレーディング取引)に含まれるデリバティブ取引については、時価評価を行い、その評価損益を連結損益計算書に計上していますので、上記記載から除いています。

特定取引に含まれるデリバティブ取引の契約額等は下記のとおりです。

(単位：百万円)

区分	種類	平成12年3月末	
		契約額等	時価
取引所	金利先物		
	売建	376,132	376,065
	買建	2,993,460	2,993,271
	金利オプション		
	売建		
	コール	—	—
	プット	(—)	—
	買建	(—)	—
	コール	—	—
	プット	(—)	—
店頭	金利先渡契約		
	売建	4,459,803	4,459,860
	買建	463,020	462,888
	金利スワップ	123,131,402	5,904
	うち受取固定・支払変動	62,619,490	705,951
	うち受取変動・支払固定	56,298,809	708,757
	うち受取変動・支払変動	3,358,339	1,964
	スワップション		
	売建		
	コール	125,840	
	(1,495)		3,131
	プット	173,210	
	(1,623)		2,516
	買建		
	コール	118,000	
	(2,841)		143
	プット	143,939	
(555)		646	
キャップ			
売建	3,262,039		
(15,723)		10,897	
買建	1,834,494		
(7,413)		9,546	
フローアー			
売建	284,086		
(3)		2,020	
買建	329,676		
(1,706)		3,597	
その他			
売建	45,730		
(349)		79	
買建	125,263		
(—)		198	

(注)1 内は契約額等に係る当初の受払オプション料です。

## (2) 通貨関連取引

(単位：百万円)

区分	種類	平成12年3月末			
		契約額等	うち1年超	時価	評価損益
店頭	通貨スワップ	2,854,232	1,541,624	883	883
	うち米ドル	2,207,137	1,254,151	2,309	2,309
	うち英ポンド	86,458	59,235	1,216	1,216
	うちユーロ	5,043	—	15	15
	その他	555,592	228,236	193	193
	その他				
	うち米ドル	1,092	—	68	68
合計					815

(注)1. 時価の算定

割引現在価値等により算定しています。

- 通貨スワップ及びその他の通貨関連デリバティブ取引の時価及び評価損益には、連結貸借対照表及び連結損益計算書に計上した経過利息部分の6,731百万円が含まれています。
  - 特定取引(トレーディング取引)に含まれるデリバティブ取引については、時価評価を行い、その評価損益を連結損益計算書に計上していますので、上記記載から除いています。
- 特定取引に含まれるデリバティブ取引の契約額等は下記のとおりです。

(単位：百万円)

区分	種類	平成12年3月末	
		契約額等	時価
店頭	通貨スワップ	9,046,589	64,124
	うち米ドル	7,919,579	64,433
	うちユーロ	343,486	39
	うちスイスフラン	3,171	200
	その他	780,360	68
	為替予約	565,868	16,132
	通貨オプション	5,557	1,321

- 先物為替予約、通貨オプション等のうち、連結会計年度末日に引直しを行い、その損益を連結損益計算書に計上しているもの、及び外貨建金銭債権債務等に付されたもので当該外貨建金銭債権債務等の連結貸借対照表表示に反映されているもの又は当該外貨建債権債務等が連結手続上消去されたものについては、上記記載から除いています。

引直しを行っている通貨関連のデリバティブ取引の契約額等は下記のとおりです。

(単位：百万円)

区分	種類	平成12年3月末
		契約額等
取引所	通貨先物	
	売建	—
	買建	—
	通貨オプション	
	売建	
	コール	—
		(—)
	ブット	—
		(—)
	買建	
コール	—	
	(—)	
ブット	—	
	(—)	
店頭	為替予約	41,745,624
	通貨オプション	
	売建	1,179,988
		(14,341)
	買建	964,387
	(17,199)	
	その他	
売建	—	
買建	—	

(注)( )内は連結貸借対照表に計上したオプション料です。

### (3) 株式関連取引

(単位：百万円)

区分	種類	平成12年3月末			
		契約額等	うち1年超	時価	評価損益
取引所	株式指数先物				
	売建	—	—	—	—
	買建	—	—	—	—
	株式指数オプション				
	売建				
	コール	—	—	—	—
	プット	(—)	—	—	—
	買建	—	—	—	—
	コール	(—)	—	—	—
	プット	(—)	—	—	—
店頭	有価証券店頭オプション				
	売建				
	コール	—	—	—	—
	プット	(—)	—	—	—
	買建	—	—	—	—
	コール	(—)	—	—	—
	プット	(—)	—	—	—
	有価証券店頭指数等 スワップ				
	株価指数変化率受取・ 短期変動金利支払	—	—	—	—
	短期変動金利受取・ 株価指数変化率支払	—	—	—	—
その他					
売建	—	—	—	—	
買建	58	—	—	—	
合計	(22)		9	13	

(注) 1. 時価の算定

店頭取引については、割引現在価値やオプション価格計算モデル等により算出しています。

2.( )内は連結貸借対照表に計上したオプション料です。

3. 特定取引(トレーディング取引)に含まれるデリバティブ取引については、時価評価を行い、その評価損益を連結損益計算書に計上していますので、前記記載から除いています。

特定取引に含まれるデリバティブ取引の契約額等は下記のとおりです。

(単位：百万円)

区分	種類	平成12年3月末	
		契約額等	時価
取引所	株式指数先物		
	売建	—	—
	買建	48,554	51,294
	株式指数オプション		
	売建		
	コール	—	—
	プット	—	—
	買建		
	コール	1,858	67
	プット	—	—
店頭	有価証券店頭オプション		
	売建		
	コール	74,558	8,824
	プット	14,135	95
	買建		
	コール	36,269	1,197
	プット	22,497	170
	有価証券店頭指数等		
スワップ	126,759	905	
その他	売建	—	—
	買建	—	—
	買建	(—)	(—)

(注 X )内は契約額等に係る当初の受払オプション料です。

## (4) 債券関連取引

(単位：百万円)

区分	種類	平成12年3月末			
		契約額等	うち1年超	時価	評価損益
取引所	債券先物				
	売建	416,719	—	419,622	2,902
	買建	47,866	—	48,035	168
	債券先物オプション				
	売建				
	コール	—	—	—	—
	プット	(—)	—	—	—
	買建	(—)	—	—	—
	コール	—	—	—	—
	プット	(—)	—	—	—
店頭	債券店頭オプション				
	売建				
	コール	—	—	—	—
	プット	(—)	—	—	—
	買建	(—)	—	—	—
	コール	—	—	—	—
	プット	(—)	—	—	—
	その他				
	売建	—	—	—	—
	買建	—	—	—	—
合計				2,734	

(注)1. 時価の算定

取引所取引については、東京証券取引所等における最終の価格によっています。

2. ( )内は連結貸借対照表に計上したオプション料です。

3. 特定取引(トレーディング取引)に含まれるデリバティブ取引については、時価評価を行い、その評価損益を連結損益計算書に計上していますので、前記記載から除いています。

特定取引に含まれるデリバティブ取引の契約額等は下記のとおりです。

(単位：百万円)

区分	種類	平成12年3月末	
		契約額等	時価
取引所	債券先物		
	売建	6,548	6,575
	買建	4,804	4,862
	債券先物オプション		
	売建		
	コール	—	—
	プット	(—)	—
	買建		
	コール	—	—
	プット	(—)	—
店頭	債券店頭オプション		
	売建		
	コール	—	—
	プット	(—)	—
	買建		
	コール	—	—
	プット	(—)	—
	その他		
	売建	—	—
	買建	—	—

(注)( )内は契約額等に係る当初の受払オプション料です。

## (5) 商品関連取引

商品関連取引には該当ありません。

## (6) クレジットデリバティブ取引

特定取引以外の取引は保証に準じた取引であり、記載対象から除いています。

特定取引(トレーディング取引)に含まれるデリバティブ取引については、時価評価を行い、その評価損益を連結損益計算書に計上しています。

特定取引に含まれるデリバティブ取引の契約額等は下記のとおりです。

(単位：百万円)

区分	種類	平成12年3月末	
		契約額等	時価
店頭	売建	15,828	25
	買建	117,465	9,890

(注)1. 時価の算定

取引対象物の価格、契約期間等の構成要素に基づき算定しています。

2. 「売建」は信用リスクの引受取引、「買建」は信用リスクの引渡取引です。