

連結時価情報

有価証券関係

中間連結貸借対照表の「有価証券」のほか、「現金預け金」中の譲渡性預け金、並びに「買入金銭債権」中のコマーシャル・ペーパー及び貸付債権信託受益権等を含めて記載しています。

中間財務諸表における注記事項である「子会社株式及び関連会社株式で時価のあるもの」については、以下の「4.」に合わせて記載しています。

1. 満期保有目的の債券で時価のあるもの

(単位:百万円)

種類	平成12年9月末				
	中間連結貸借 対照表計上額	時価	差額	うち益	うち損
国債	65	65	0	0	0
地方債	—	—	—	—	—
社債	49	49	0	0	—
その他	42,724	42,114	609	—	609
合計	42,839	42,229	609	0	610

(注)時価は、当中間連結会計期間末日における市場価格等に基づいています。

2. その他有価証券で時価のあるもの

当中間連結会計期間においては、その他有価証券のうち時価のあるものについて時価評価を行っていません。
なお、その他有価証券で時価のあるものに係る中間連結貸借対照表計上額等は次のとおりです。

(単位:百万円)

種類	平成12年9月末				
	中間連結貸借 対照表計上額	時価	差額	うち益	うち損
株式	2,958,557	3,419,904	461,347	778,976	317,629
債券	6,813,036	6,788,417	24,618	14,797	39,416
国債	5,936,840	5,906,145	30,695	3,455	34,150
地方債	294,686	297,747	3,060	5,911	2,850
社債	581,509	584,525	3,015	5,431	2,415
その他	907,593	1,070,179	162,586	177,874	15,287
合計	10,679,187	11,278,502	599,315	971,648	372,333

(注)時価は、株式については当中間連結会計期間前1カ月の市場価格の平均に基づいて算定された額に、また、それ以外については当中間連結会計期間末日における市場価格等に、それぞれ基づいています。

3. 時価のない有価証券の主な内容及び中間連結貸借対照表計上額

(単位:百万円)

		平成12年9月末
満期保有目的の債券	非上場外国証券	30,785
	非上場外国証券	326,936
その他有価証券	非上場債券	211,481
	非上場株式(店頭売買株式を除く)	82,739
	その他	10,164

4. 子会社株式及び関連会社株式で時価のあるもの(単体)

(単位:百万円)

種類	平成12年9月末		
	中間貸借 対照表計上額	時価	差額
子会社株式	37,426	27,556	9,869
関連会社株式	9,297	9,366	69
合計	46,723	36,923	9,800

(注)時価は、当中間会計期間末日における市場価格等に基づいています。

金銭の信託関係

1. 満期保有目的の金銭の信託

該当ありません。

2. その他の金銭の信託(運用目的及び満期保有目的以外の金銭の信託)

当中間連結会計期間においては、その他の金銭の信託のうち時価のあるものについて、時価評価を行っていません。

なお、その他の金銭の信託に係る中間連結貸借対照表計上額等は次のとおりです。

(単位:百万円)

種類	平成12年9月末			
	中間連結 貸借対照表計上額	時価	差額	
その他の金銭の信託	56,186	53,071	3,114	
				うち益
				563
				うち損
				3,678

(注)時価は、当中間連結会計期間末日における市場価格等に基づいています。

その他有価証券評価差額金相当額

当中間連結会計期間において、その他有価証券及びその他の金銭の信託について時価評価を行った場合における、その他有価証券評価差額金相当額は次のとおりです。

(単位:百万円)

	平成12年9月末
差額(時価 - 中間連結貸借対照表計上額)	596,200
その他有価証券	599,315
その他の金銭の信託	3,114
()繰延税金負債相当額	231,621
その他有価証券評価差額金相当額(持分相当額調整前)	364,578
()少数株主持分相当額	3,899
(+)持分法適用会社が所有するその他有価証券に係る評価差額金相当額のうち親会社持分相当額	750
その他有価証券評価差額金相当額	361,429

デリバティブ取引関連

1. 金利関連取引

(単位：百万円)

区分	種類	平成12年9月末		
		契約額等	時価	評価損益
取引所	金利先物	12,279,207	605	605
	金利オプション	30,000	1	0
店頭	金利先渡契約	10,700,158	7	7
	金利スワップ	129,537,016	21,883	21,883
	スワップション	987,842	5,982	5,746
	キャップ	5,669,707	1,746	11,494
	フロアー	451,395	2,169	196
	その他	104,613	60	60
	合計		16,875	28,381

(注) 上記取引については時価評価を行い、評価損益を中間連結損益計算書に計上しています。なお、ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引は、上記記載から除いています。

また、一部の在外連結子会社において、現地の会計基準に従って処理している金利関連取引は、上記記載から除いています。なお、この未実現損益は1,189百万円(利益)です。

2. 通貨関連取引

(単位：百万円)

区分	種類	平成12年9月末		
		契約額等	時価	評価損益
店頭	通貨スワップ	10,466,477	67,600	67,600
	為替予約	1,182,680	7,592	7,592
	通貨オプション	43,740	818	818
	その他	—	—	—
	合計		60,826	60,826

(注) 上記取引については時価評価を行い、評価損益を中間連結損益計算書に計上しています。なお、ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引は、上記記載から除いています。

また、一部の在外連結子会社において、現地の会計基準に従って処理している通貨関連取引は、上記記載から除いています。なお、この未実現損益は468百万円(利益)です。

また、先物為替予約、通貨オプション等のうち、中間連結会計期間末日に引直しを行い、その損益を中間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中間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9月末
		契約額等
取引所	通貨先物	—
	通貨オプション	—
店頭	為替予約	48,028,324
	通貨オプション	2,711,666
	その他	—

3. 株式関連取引

(単位：百万円)

区分	種類	平成12年9月末		
		契約額等	時価	評価損益
取引所	株式指数先物	52,811	3,266	3,266
	株式指数オプション	—	—	—
店頭	有価証券店頭オプション	—	—	—
	有価証券店頭指数等スワップ	115,204	1,485	1,485
	その他	218,453	4,937	4,228
	合計		3,156	6,009

(注) 上記取引については時価評価を行い、評価損益を中間連結損益計算書に計上しています。なお、ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引は、上記記載から除いています。

4. 債券関連取引

(単位：百万円)

区分	種類	平成12年9月末		
		契約額等	時価	評価損益
取引所	債券先物	47,318	9	9
	債券先物オプション	—	—	—
店頭	債券店頭オプション	46,218	0	0
	その他	—	—	—
	合計		9	9

(注) 上記取引については時価評価を行い、評価損益を中間連結損益計算書に計上しています。なお、ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引は、上記記載から除いています。

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

(単位：百万円)

区分	種類	平成12年9月末		
		契約額等	時価	評価損益
店頭	クレジット・デフォルト・オプション	—	—	—
	その他	154,467	7,003	7,003
	合計		7,003	7,003

(注) 上記取引については時価評価を行い、評価損益を中間連結損益計算書に計上しています。なお、ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引は、上記記載から除いています。