

## (デリバティブ取引関係)

## 1. 当中間連結会計期間末の取引の時価等に関する事項

## (1) 金利関連取引

(金額単位：百万円)

区分	種 類	当中間連結会計期間末 (平成12年9月30日現在)		
		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おります。  
 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おります。  
 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おります。なお、この未実現損益は1,189百万円(利益)であります。

## (2) 通貨関連取引

(金額単位：百万円)

区分	種 類	当中間連結会計期間末 (平成12年9月30日現在)		
		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	-	-	-

(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おります。  
 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おります。  
 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おります。なお、この未実現損益は468百万円(利益)であります。

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おります。

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、下記のとおりであります。

(金額単位：百万円)

区分	種 類	当中間連結会計期間末 (平成12年9月30日現在)	
		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

(金額単位：百万円)

区分	種 類	当中間連結会計期間末 (平成12年9月30日現在)		
		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おります。  
 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おります。

## (4)債券関連取引

(金額単位：百万円)

区分	種 類	当中間連結会計期間末 (平成12年9月30日現在)		
		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おります。  
 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おります。

## (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

(金額単位：百万円)

区分	種 類	当中間連結会計期間末 (平成12年9月30日現在)		
		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

(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おります。  
 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おります。

## 2. 前中間連結会計期間末の取引の時価等に関する事項

## (1) 金利関連取引

(金額単位：百万円)

区分	種 類	前中間連結会計期間末(平成11年9月30日現在)			
		契約額等	うち1年超	時 価	評価損益
取 引 所	金利先物				
	売建	14,277,039	143,457	14,241,732	35,306
	買建	12,884,073	50,418	12,858,304	25,768
	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	5	-	5	0
	買建	2,700	-	2,782	81
	金利スワップ	72,314,014	27,885,458	75,573	75,573
	うち受取固定・支払変動	35,710,048	13,405,696	565,158	565,158
	うち受取変動・支払固定	35,752,991	13,717,846	490,182	490,182
	うち受取変動・支払変動	489,595	400,536	816	816
	スワップション				
	売建				
	コール	258,846	141,299		
	( 3,683)			1,716	1,966
	プット	2,894	-		
	( - )			18	18
	買建				
	コール	59,737	16,240		
	( 266)			32	233
	プット	2,894	-		
	( - )			18	18
	キャップ				
	売建	85,222	45,222		
( 158)			253	94	
買建	258,409	199,844			
( 1,983)			1,588	395	
フロアー					
売建	59,243	51,679			
( 1,213)			1,994	780	
買建	12,574	12,574			
( 6)			16	9	
その他					
売建	5,347	-			
( - )			0	0	
買建	5,347	-			
( - )			0	0	
合 計				85,664	

## (注) 1. 時価の算定

取引所取引につきましては、東京金融先物取引所等における最終の価格によっております。店頭取引につきましては、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おります。

2. ( ) 内は中間連結貸借対照表に計上したオプション料であります。

3. 金利スワップの時価及び評価損益には、中間連結貸借対照表及び中間連結損益計算書に計上した経過利息部分の70,843百万円が含まれております。

従って、金利スワップの時価及び評価損益として記載している75,573百万円のうち、未実現損益相当額は、この経過利息部分を控除した4,729百万円(利益)となります。

4. スワップションにおけるコール/プットは、以下の定義によっております。

コール：受取変動・支払固定の金利スワップを取組む権利

プット：受取固定・支払変動の金利スワップを取組む権利

## 5. 金利スワップの残存期間別想定元本は次のとおりであります。

(金額単位：百万円)

残存期間	前中間連結会計期間末(平成11年9月30日現在)		
	1年以内	1年超5年以内	5年超
金利スワップ 想定元本合計	44,428,555	23,524,797	4,360,660
うち受取固定・支払変動	22,304,352	11,473,475	1,932,221
うち受取変動・支払固定	22,035,145	11,353,829	2,364,017
うち受取変動・支払変動	89,058	370,798	29,738

## 6. 特定取引(トレーディング取引)に含まれますデリバティブ取引につきましては、時価評価を行い、その評価損益を中間連結損益計算書に計上しておりますので上記記載から除いております。

特定取引に含まれますデリバティブ取引の契約額等は下記のとおりであります。

(金額単位：百万円)

区分	種類	前中間連結会計期間末 (平成11年9月30日現在)	
		契約額等	時価
取引所	金利先物		
	売建	874,546	872,977
	買建	764,310	764,196
	金利オプション		
	売建		
	コール	4,962	
	プット	( 12)	14
	買建	( - )	-
	コール	-	-
	プット	( - )	-
店頭	金利先渡契約		
	売建	41,331	41,293
	買建	30,843	30,827
	金利スワップ	123,601,679	62,443
	うち受取固定・支払変動	41,289,358	540,918
	うち受取変動・支払固定	48,760,515	533,068
	うち受取変動・支払変動	2,393,724	4,465
	スワップション	728,222	7,898
	売建		
	コール	175,190	
	プット	( 2,019)	1,072
	買建	148,000	3,838
	コール	( 1,958)	
	プット	235,850	117
	プット	( 3,122)	
	プット	153,500	
	プット	( 783)	1,923
	キャップ		
	売建	3,394,804	
	買建	(16,911)	6,812
	買建	2,007,868	5,993
	買建	( 7,668)	
	フロアー		
売建	433,736		
買建	( 1)	2,816	
買建	308,499	2,969	
買建	( 1,319)		
その他	203,005	126	
売建	42,720		
買建	( 293)	106	
買建	46,950		
買建	( 18)	63	

- (注) 1. ( )内は契約額等に係る当初の受払オプション料であります。  
2. 一部海外連結子会社の取引については、取引別の総額には算入しておりますが、内訳には算入しておりません。

## (2)通貨関連取引

(金額単位：百万円)

区分	種 類	前中間連結会計期間末(平成11年9月30日現在)			
		契約額等		時 価	評価損益
			うち1年超		
店 頭	通貨スワップ	2,976,210	1,206,041	11,489	11,489
	うち米ドル	2,070,042	640,896	10,694	10,694
	うち英ポンド	122,786	60,168	21	21
	うちユーロ	113,259	113,259	0	0
	そ の 他	670,121	391,717	774	774
	その他 うち米ドル	878	-	16	16
合 計					11,473

(注) 1. 時価の算定

割引現在価値等により算定しております。

2. 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、中間連結貸借対照表及び中間連結損益計算書に計上した経過利息部分の 3,718百万円が含まれております。

従って、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として記載している 11,473百万円のうち、未実現損益相当額は、この経過利息部分を控除した 7,754百万円(損失)となります。

3. 特定取引(トレーディング取引)に含まれますデリバティブ取引につきましては、時価評価を行い、その評価損益を中間連結損益計算書に計上しておりますので上記記載から除いております。

特定取引に含まれますデリバティブ取引の契約額等は下記のとおりであります。

(金額単位：百万円)

区分	種 類	前中間連結会計期間末 (平成11年9月30日現在)	
		契約額等	時 価
店 頭	通貨スワップ	11,953,010	12,046
	うち米ドル	2,390,647	65,357
	うち英ポンド	732	255
	うちユーロ	110,170	596
	そ の 他	318,724	30,183
	為替予約	770,057	8,615
	通貨オプション	17,807	712

(注) 一部海外連結子会社の取引については、取引別の総額には算入しておりますが、内訳には算入しておりません。

4. 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については、上記記載から除いております。

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あります。

(金額単位：百万円)

区分	種 類	前中間連結会計期間末 (平成11年9月30日現在)
		契約額等
取	通貨先物	
	売建	-
引	買建	-
	通貨オプション	
所	売建	
	コール	-
	プット	(           -           )
	買建	
	コール	-
	プット	(           -           )
		(           -           )
店	為替予約	47,263,448
	通貨オプション	
頭	売建	1,290,307
	買建	(           23,701           )
		1,103,207
		(           26,422           )
	その他	
	売建	-
	買建	-

(注) ( )内は中間連結貸借対照表に計上したオプション料であります。

## (3) 株式関連取引

(金額単位：百万円)

区分	種 類	前中間連結会計期間末(平成11年9月30日現在)			
		契約額等	うち1年超	時 価	評価損益
取	株式指数先物				
	売建	-	-	-	-
引	買建	-	-	-	-
	株式指数オプション				
所	売建				
	コール	-	-	-	-
	プット	( - )	-	-	-
	買建	( - )	-	-	-
	コール	-	-	-	-
	プット	( - )	-	-	-
店	有価証券店頭オプション				
	売建				
	コール	-	-	-	-
	プット	( - )	-	-	-
	買建	( - )	-	-	-
	コール	-	-	-	-
頭	プット	( - )	-	-	-
	有価証券店頭指数等スワップ				
株	株価指数変化率受取・	-	-	-	-
	短期変動金利支払	-	-	-	-
短	短期変動金利受取・	-	-	-	-
	株価指数変化率支払	-	-	-	-
期	その他				
	売建	-	-	-	-
間	買建	( - )	-	-	-
	買建	188	-	-	-
接	合 計	( 45)		65	19
					14

(注) 1. 時価の算定

取引所取引につきましては、東京証券取引所等における最終の価格によっております。  
店頭取引につきましては、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  
おります。

2. ( )内は中間連結貸借対照表に計上したオプション料であります。

3. 特定取引(トレーディング取引)に含まれますデリバティブ取引につきましては、時価評価を行い、その評価損益を中間連結損益計算書に計上しておりますので上記記載から除いております。

特定取引に含まれますデリバティブ取引の契約額等は下記のとおりであります。

(金額単位:百万円)

区分	種 類	前中間連結会計期間末 (平成11年9月30日現在)	
		契約額等	時 価
取引所	株式指数先物		
	売建	-	-
	買建	37,460	37,460
	株式指数オプション		
	売建		
	コール	-	-
	プット	( - )	-
店頭	買建		
	コール	-	-
	プット	( - )	-
	有価証券店頭オプション		
	売建		
	コール	63,158	8,261
	プット	701	225
買建			
コール	18,032	911	
プット	3,405	116	
有価証券店頭指数等スワップ	121,808	1,050	
その他			
売建	-	-	
コール	( - )	-	
プット	( - )	-	
買建	-	-	
コール	( - )	-	
プット	( - )	-	

(注) ( )内は契約額等に係る当初の受払オプション料であります。

## (4)債券関連取引

(金額単位：百万円)

区分	種 類	前中間連結会計期間末(平成11年9月30日現在)			
		契約額等	うち1年超	時 価	評価損益
取	債券先物				
	売建	52,729	-	54,103	1,374
引	買建	14,578	-	14,515	63
	債券先物オプション				
所	売建				
	コール	17,582	-		
		( 94)		61	32
	プット	-	-		
		( - )		-	-
	買建				
所	コール	12,513	-		
		( 41)		13	28
所	プット	2,352	-		
		( 11)		6	4
店	債券店頭オプション				
	売建				
	コール	143,124	-		
		( 555)		2,009	1,454
	プット	-	-		
		( - )		-	-
店	買建				
	コール	-	-		
店		( - )		-	-
	プット	50,019	-		
店		( 785)		231	553
	その他				
店	売建	-	-	-	-
	買建	-	-	-	-
合 計					3,445

(注) 1. 時価の算定

取引所取引につきましては、東京証券取引所等における最終の価格によっております。

店頭取引につきましては、オプション価格計算モデル等により算出しております。

2. ( )内は中間連結貸借対照表に計上したオプション料であります。

3. 特定取引（トレーディング取引）に含まれますデリバティブ取引につきましては、時価評価を行い、その評価損益を中間連結損益計算書に計上しておりますので上記記載から除いております。

特定取引に含まれますデリバティブ取引の契約額等は下記のとおりであります。

（金額単位：百万円）

区分	種 類	前中間連結会計期間末 (平成11年9月30日現在)	
		契約額等	時 価
取引所	債券先物 売建	3,958	3,958
	買建	166,265	168,956
	債券先物オプション 売建		
	コール	-	-
	プット	( - )	-
	買建		
	コール	-	-
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あります。

#### (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

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おります。

特定取引（トレーディング取引）に含まれますデリバティブ取引につきましては、時価評価を行い、その評価損益を中間連結損益計算書に計上しております。

特定取引に含まれますデリバティブ取引の契約額等は下記のとおりであります。

（金額単位：百万円）

区分	種 類	前中間連結会計期間末 (平成11年9月30日現在)	
		契約額等	時 価
店頭	売建	23,968	335
	買建	264,407	13,138

(注) 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おります。

## 3. 前連結会計年度の取引の時価等に関する事項

## (1) 金利関連取引

(金額単位：百万円)

区分	種 類	前連結会計年度(平成12年3月31日現在)			
		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
	うち受取固定・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	956	2,353
	プット	( 3,309)	-	88	88
	買建	2,546	-	156	110
	コール	( - )	-	68	68
	プット	19,356	11,356	-	-
	買建	( 266)	-	-	-
	コール	2,546	-	-	-
	プット	( - )	-	-	-
キャップ					
売建	76,931	32,658	493	426	
買建	( 67)	-	1,132	780	
買建	249,635	200,907	-	-	
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

取引所取引につきましては、東京金融先物取引所等における最終の価格によっております。店頭取引につきましては、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おります。

2. ( ) 内は連結貸借対照表に計上したオプション料であります。

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おります。

## 4. スワップションにおけるコール/プットは、以下の定義によっております。

コール：受取変動・支払固定の金利スワップを取組む権利

プット：受取固定・支払変動の金利スワップを取組む権利

## 5. 金利スワップの残存期間別想定元本は次のとおりであります。

(金額単位:百万円)

残存期間	前連結会計年度 (平成12年3月31日現在)		
	1年以内	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)に含まれますデリバティブ取引につきましては、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おりますので、上記記載から除いております。

特定取引に含まれますデリバティブ取引の契約額等は下記のとおりであります。

(金額単位:百万円)

区分	種類	前連結会計年度 (平成12年3月31日現在)	
		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) ( )内は契約額等に係る当初の受払オプション料であります。

## (2)通貨関連取引

(金額単位：百万円)

区分	種 類	前連結会計年度(平成12年3月31日現在)			
		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 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おります。

- 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おります。
- 特定取引(トレーディング取引)に含まれますデリバティブ取引につきましては、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おりますので、上記記載から除いております。

特定取引に含まれますデリバティブ取引の契約額等は下記のとおりであります。

(金額単位：百万円)

区分	種 類	前連結会計年度 (平成12年3月31日現在)	
		契約額等	時 価
店 頭	通貨スワップ	9,046,598	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

4. 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おります。

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、下記のとおりであります。

(金額単位：百万円)

区分	種 類	前連結会計年度 (平成12年3月31日現在)
		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 (            ) - (            ) - (            ) 買建 コール (            ) - (            ) - (            ) -	-
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あります。

## (3) 株式関連取引

(金額単位：百万円)

区分	種 類	前連結会計年度(平成12年3月31日現在)			
		契約額等	うち1年超	時 価	評価損益
取	株式指数先物				
	売建	-	-	-	-
引	買建	-	-	-	-
	株式指数オプション				
所	売建				
	コール	-	-	-	-
	プット	( - )	-	-	-
	買建	( - )	-	-	-
	コール	-	-	-	-
	プット	( - )	-	-	-
店	有価証券店頭オプション				
	売建				
	コール	-	-	-	-
	プット	( - )	-	-	-
	買建	( - )	-	-	-
	コール	-	-	-	-
頭	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	-		
		( 22)		9	13
	合 計				13

(注) 1. 時価の算定

店頭取引につきましては、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おります。

2. ( ) 内は連結貸借対照表に計上したオプション料であります。

3. 特定取引(トレーディング取引)に含まれますデリバティブ取引につきましては、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おりますので、上記記載から除いております。

特定取引に含まれますデリバティブ取引の契約額等は下記のとおりであります。

(金額単位:百万円)

区分	種 類	前連結会計年度 (平成12年3月31日現在)	
		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	( - )	-
店頭	買建		
	コール	1,858	67
	プット	( 49)	-
	買建		
	コール	-	-
	プット	( - )	-
	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	-	-	
コール	( - )	-	
プット	-	-	
買建	-	-	
コール	( - )	-	
プット	-	-	

(注) ( )内は契約額等に係る当初の受払オプション料であります。

## (4)債券関連取引

(金額単位：百万円)

区分	種 類	前連結会計年度(平成12年3月31日現在)			
		契約額等	うち1年超	時 価	評価損益
取	債券先物				
	売建	416,719	-	419,622	2,902
引	買建	47,866	-	48,035	168
	債券先物オプション				
所	売建				
	コール	-	-	-	-
	プット	( - )	-	-	-
	買建				
	コール	-	-	-	-
	プット	( - )	-	-	-
店	債券店頭オプション				
	売建				
	コール	-	-	-	-
	プット	( - )	-	-	-
	買建				
	コール	-	-	-	-
頭	プット	( - )	-	-	-
	買建				
その他	売建	-	-	-	-
	買建	-	-	-	-
合 計					2,734

(注) 1. 時価の算定

取引所取引につきましては、東京証券取引所等における最終の価格によっております。

2. ( )内は連結貸借対照表に計上したオプション料であります。

3. 特定取引(トレーディング取引)に含まれますデリバティブ取引につきましては、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おりますので、上記記載から除いております。

特定取引に含まれますデリバティブ取引の契約額等は下記のとおりであります。

(金額単位:百万円)

区分	種 類	前連結会計年度 (平成12年3月31日現在)	
		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あります。

#### (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

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おります。

特定取引(トレーディング取引)に含まれますデリバティブ取引につきましては、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おります。

特定取引に含まれますデリバティブ取引の契約額等は下記のとおりであります。

(金額単位:百万円)

区分	種 類	前連結会計年度 (平成12年3月31日現在)	
		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おります。

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あります。