

(デリバティブ取引関係)

三井住友銀行
(旧会社名 さくら銀行)

デリバティブ取引の契約額、時価及び評価損益

(1) 金利関連取引		(金額単位：百万円)			
区分	種類	当連結会計年度末(平成13年3月31日)			
		契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
取引所	金利先物				
	売建	59,123	-	431	431
	買建	262,802	-	2,151	2,151
	金利オプション				
	売建	2,029,981	-	825	655
	買建	622,669	-	519	258
店頭	金利先渡契約				
	売建	1,039,613	10,000	344	344
	買建	1,629,713	-	1,589	1,589
	金利スワップ				
	受取固定・支払変動	43,061,905	25,195,263	755,835	755,835
	受取変動・支払固定	40,592,544	24,860,084	773,704	773,704
	受取変動・支払変動等	2,160,512	769,755	17,494	17,494
	その他				
	売建	3,267,592	2,954,530	23,119	6,253
	買建	2,444,194	2,191,101	27,933	19,066
合計				30,380	21,161

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益を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. 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。

3. 店頭取引中のその他はキャップ、フロア、スワップション取引であります。

(2) 通貨関連取引

(金額単位：百万円)

区分	種類	当連結会計年度末（平成13年3月31日）			
		契約額等	うち1年超	時価	評価損益
店頭	通貨スワップ	4,309,192	3,169,586	1,482	1,482
合計				1,482	1,482

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益を連結損益計算書に計上しております。

なお、下記注3.の取引は、上記記載から除いております。

2. 時価の算定

割引現在価値等により算定しております。

3. 「銀行業において『新外為経理基準』を継続適用した場合の当面の監査上の取扱い」

(日本公認会計士協会平成12年4月10日)に基づき、期間損益計算を行っている通貨スワップ取引については、上記記載から除いております。

期間損益計算を行っている通貨スワップ取引の契約額等は、下記のとおりであります。

(金額単位：百万円)

種類	当連結会計年度末 (平成13年3月31日)		
	契約額等	時価	評価損益
通貨スワップ	1,833,414	69,269	69,269

また、同様に、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示に反映されているもの又は当該外貨建金銭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	当連結会計年度末 (平成13年3月31日)
		契約額等
店頭	為替予約	
	売建	4,296,653
	買建	5,633,384
	通貨オプション	
	売建	694,904
	買建	689,497

(3) 債券関連取引 (金額単位: 百万円)

区分	種類	当連結会計年度末(平成13年3月31日)			
		契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
取引所	債券先物				
	売 建	188	-	6	6
	買 建	23,066	-	112	112
	合 計			106	106

- (注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益を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. 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。

(4) クレジットデリバティブ取引

(金額単位：百万円)

区分	種類	当連結会計年度末（平成13年3月31日）			
		契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
店頭	その他				
	売 建	147	-	4	4
	買 建	147	-	6	6
合計				2	2

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い評価損益を連結損益計算書に計上しております。

2. 時価の算定

取引対象物の価格、契約期間、その他当該取引に係る契約を構成する要素に基づき算定しております。

デリバティブ取引の契約額、時価及び評価損益（前連結会計年度末）

三井住友銀行
(旧会社名 さくら銀行)

(1) 金利関連取引

(金額単位：百万円)

区分	種類	前連結会計年度末（平成12年3月31日）			
		契約額等	うち1年超	時価	評価損益
取引所	金利先物				
	売建	9,784,429	670,310	9,765,752	18,677
	買建	5,657,962	249,452	5,651,207	6,754
	金利オプション				
	売建				
	コール	13,776,338	-		
		(3,441)		556	2,884
	プット	12,329,538	-		
		(2,609)		1,786	822
	買建				
	コール	6,025,776	-		
		(1,059)		407	652
	プット	5,323,445	-		
		(1,720)		1,581	139
店頭	金利スワップ				
	受取固定・支払変動	34,478,328	15,236,759	573,908	573,908
	受取変動・支払固定	24,638,127	8,588,126	267,975	267,975
	受取変動・支払変動等	25,024	17,796	135	135
	その他				
	売建	609,287	599,271		
		(2,688)		1,148	1,539
	買建	123,982	113,966		
		(1,429)		827	603
	合計				321,572

(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. 店頭取引中のその他はキャップ、フロア、スワップション取引であります。

4. 金利スワップの時価および評価損益には、損益計上している経過利息部分343,651百万円が含まれております。

- ５．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	前連結会計年度末 (平成12年3月31日)	
		契約額等	時価
取引所	金利先物		
	売建	422,513	422,244
	買建	585,857	583,533
	金利オプション		
	売建		
	コール	1,891,590	
		(260)	23
	プット	2,560,186	
		(446)	231
	買建		
	コール	736,133	
		(173)	27
	プット	1,332,250	
		(279)	126
店頭	金利先渡契約		
	売 建	678,521	678,458
	買 建	1,324,902	1,325,226
	金利スワップ		
	受取固定・支払変動	34,706,694	385,949
	受取変動・支払固定	32,590,848	506,149
	受取変動・支払変動等	1,636,745	13,467
	そ の 他		
	売 建	3,411,883	
		(9,329)	21,935
	買 建	3,077,923	
		(4,886)	58,646

(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。

三井住友銀行
(旧会社名 さくら銀行)

(2) 通貨関連取引

(金額単位：百万円)

区分	種類	前連結会計年度末(平成12年3月31日)			
		契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
店頭	通貨スワップ	2,779,199	1,179,058	54,273	54,273
	うち米ドル	1,866,061	935,342	43,375	43,375
	うちその他	913,137	243,715	10,897	10,897

(注) 1. 時価の算定

割引現在価値により算定しております。

2. 通貨スワップの時価および評価損益には、損益計上している経過利息部分 6,647百万円が含まれております。

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	前連結会計年度末(平成12年3月31日)	
		契約額等	時 価
店頭	通貨スワップ	3,887,543	5,539
	うち米ドル	2,599,267	15,018
	うち独マルク	554,556	2,833
	うちその他	733,720	12,312

4. 先物為替予約、通貨オプション等につきましては、当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	前連結会計年度末 (平成12年3月31日)	
		契約額等	
取引所	通貨先物		
	売 建	356	
	買 建	20	
店頭	為替予約		
	売 建	2,185,551	
	買 建	3,697,674	
	通貨オプション		
	売 建		
		コール	188,930
			(4,105)
		プット	170,453
			(3,600)
	買 建		
		コール	156,601
			(2,368)
		プット	178,950
			(4,473)

(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		前連結会計年度末（平成12年3月31日）				
			契約額等	うち1年超	時価	評価損益	
店 頭	有価証券店頭オプション						
	売 建	コール	198	-			
			(1)			0	
		プット	-	-			
			-			-	
	買 建	コール	198	-			
			(1)			0	
		プット	-	-			
			-			-	
	株式関連スワップ		897,438	-	18,554	18,554	
合 計					18,554		

- (注) 1. 時価の算定
東京証券取引所等における最終価格に基づき時価算定モデル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		前連結会計年度末(平成12年3月31日)	
			契約額等	時価
取引	株式指数先物			
	売 建		1,536	1,530
			101	101
場所	株式指数オプション			
	売 建	コール	11,740	
			(36)	37
		プット	21,880	
			(26)	31
	買 建	コール	4,578	
			(53)	97
		プット	1,902	
			(53)	30

- (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	前連結会計年度末(平成12年3月31日)			
		契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
取引所	債券先物				
	売建	74,904	-	76,182	1,277
	買建	-	-	-	-
合 計					1,277

(注) 1. 時価の算定

東京証券取引所等における最終価格によっております。

２．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、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	前連結会計年度末 (平成12年3月31日)	
		契約額等	時価
取引所	債券先物		
	売建	28,726	28,818
	買建	35,094	35,147
	債券先物オプション		
	売建		
	コール	838	2
		(5)	
	プット	8,580	7
		(11)	
	買建		
	コール	4,477	11
		(16)	
	プット	37,370	14
		(90)	
店頭	債券店頭オプション		
	売建		
	コール	-	-
		-	
	プット	21,670	118
		(251)	
	買建		
	コール	29,272	106
		(167)	
	プット	7,837	14
		(51)	

(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。