

(デリバティブ取引関係)

1. 当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	当連結会計年度(平成13年3月31日現在)			
		契約額等		時価	評価損益
		うち1年超			
取引所	金利先物				
	売建	1,101,977	17,858	437	437
	買建	5,697,426	485,657	8,991	8,991
	金利オプション				
店	売建	248,680	-	10	10
	買建	109,340	-	6	6
	金利先渡契約				
	売建	6,884,618	-	649	649
買建	1,777,431	-	841	841	
店頭	金利スワップ	135,767,183	83,730,613	69,662	69,662
	受取固定・支払変動	65,115,663	40,064,077	1,573,923	1,573,923
	受取変動・支払固定	64,847,289	39,778,519	1,644,551	1,644,551
	受取変動・支払変動	5,165,148	3,359,612	1,674	1,674
	スワップション				
	売建	400,466	248,801	12,247	12,247
	買建	326,828	240,727	6,547	6,547
	キャップ				
	売建	3,207,128	2,358,919	4,459	4,459
	買建	2,107,655	1,535,957	4,673	4,673
	フロアー				
	売建	151,911	140,436	2,833	2,833
買建	283,412	230,219	5,098	5,098	
その他	売建	32,799	29,850	99	99
	買建	141,681	93,760	490	490
合計				63,553	63,553

- (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。
 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2,848百万円(利益)であります。
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。

(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(平成13年3月31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	10,574,656	4,808,279	69,281	69,281
	為替予約	787,136	187,702	13,451	13,451
	通貨オプション				
	売建	19,804	6,453	1,583	1,583
その他	買建	22,702	5,554	1,466	1,466
	売建	-	-	-	-
	買建	-	-	-	-
	合計			82,850	82,850

- (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。
 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650百万円(利益)であります。
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. 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	当連結会計年度末 (平成13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		
店頭	売建	-	
	買建	-	
	為替予約	48,193,991	
	通貨オプション		
	売建	1,877,037	
	買建	1,606,427	
その他	売建	-	
	買建	-	

(3) 株式関連取引

(金額単位：百万円)

区分	種類	当連結会計年度(平成13年3月31日現在)			
		契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
取引所	株式指数先物				
	売建	3,039	-	137	137
	買建	-	-	-	-
	株式指数オプション				
店頭	売建	-	-	-	-
	買建	-	-	-	-
	有価証券店頭オプション				
	売建	-	-	-	-
	買建	-	-	-	-
	有価証券店頭指数等スワップ	45,202	16,039	805	805
その他	売建	79,457	61,219	10,685	10,685
	買建	34,947	-	1,072	1,072
合計				8,944	8,944

- (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。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。

(4)債券関連取引

(金額単位：百万円)

区分	種 類	当連結会計年度(平成13年3月31日現在)			
		契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		
取引所	債券先物				
	売建	2,000	2,000	8	8
	買建	-	-	-	-
	債券先物オプション				
	売建	-	-	-	-
	買建	-	-	-	-
店頭	債券店頭オプション				
	売建	21,981	19,850	0	0
	買建	25,457	18,562	0	0
	その他				
	売建	-	-	-	-
	買建	-	-	-	-
	合 計			8	8

- (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。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定しております。

(5)商品関連取引

(金額単位：百万円)

区分	種 類	当連結会計年度(平成13年3月31日現在)			
		契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		
店頭	商品オプション				
	売建	2,707	2,707	56	56
	買建	2,707	2,707	4	4
	合 計			51	51

- (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。

(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	当連結会計年度(平成13年3月31日現在)			
		契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		
店頭	クレジット・デフォルト・オプション				
	売建	42,389	33,782	366	366
	買建	55,966	43,746	465	465
	その他				
	売建	32,669	14,500	8,276	8,276
	買建	62,942	58,978	7,334	7,334
	合 計			842	842

- (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. 「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。

2. 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		
	プット	(3,309)	-	956	2,353
	買建				
	コール	2,546	-	88	88
	プット	(-)	-		
	買建				
	コール	19,356	11,356		
	プット	(266)	-	156	110
	プット	2,546	-	68	68
	プット	(-)	-		
	キャップ				
売建	76,931	32,658			
買建	(67)		493	426	
買建	249,635	200,907			
買建	(1,913)		1,132	780	
フローアー					
売建	55,026	47,088			
買建	(1,543)		2,025	481	
買建	2,054	1,031			
買建	(5)		10	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. 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	
	プット	(1,495)	3,131
	買建		
	コール	118,000	
	プット	(2,841)	143
		143,939	
		(555)	646
	キャップ		
売建	3,262,039		
買建	(15,723)	10,897	
	1,834,494		
	(7,413)	9,546	
フローアー			
売建	284,086		
買建	(3)	2,020	
	329,676		
	(1,706)	3,597	
その他			
売建	45,730		
買建	(349)	79	
	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	(-)
	プット	(-)
	買建	
コール	(-)	
プット	(-)	
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	(-)	-	-	-
店頭	買建	(-)	-	-	-
	コール	-	-	-	-
	プット	(-)	-	-	-
	売建	(-)	-	-	-
	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	58	-	-	-	
(22)	(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	(-)	-
買建			
コール	1,858	67	
プット	(49)	-	
		(-)	-
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	-	-	
	(-)	-	

(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 引	債券先物				
	売建	416,719	-	419,622	2,902
	買建	47,866	-	48,035	168
所	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。