

(デリバティブ取引関係)

1. 当中間連結会計期間(平成14年9月30日現在)

(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<br>(平成14年9月30日現在) |         |         |
|-----|---------|-----------------------------|---------|---------|
|     |         | 契約額等                        | 時 価     | 評価損益    |
| 取引所 | 金利先物    | 47,730,166                  | 3,798   | 3,798   |
|     | 金利オプション | 2,716,792                   | 120     | 120     |
| 店頭  | 金利先渡契約  | 23,372,432                  | 151     | 151     |
|     | 金利スワップ  | 305,873,922                 | 162,410 | 162,410 |
|     | スワップション | 2,531,030                   | 8,681   | 8,681   |
|     | キャップ    | 9,899,508                   | 1,672   | 1,672   |
|     | フロアー    | 778,929                     | 2,816   | 2,816   |
|     | その他     | 268,511                     | 2,831   | 2,831   |
|     | 合 計     |                             | 159,152 | 159,152 |

(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323百万円(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<br>(平成14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  | 15,871,917                  | 47,872 | 47,872 |
|    | 為替予約    | 3,337,288                   | 2,436  | 2,436  |
|    | 通貨オプション | 11,416                      | 294    | 294    |
|    | その他     | 992,078                     | 5,966  | 5,966  |
|    | 合 計     |                             | 39,173 | 39,173 |

(注) 1. 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及び下記注2.の取引は、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1,467百万円(利益)であります。  
2. 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     | 当中間連結会計期間<br>(平成14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    | 37,056,131                  |
|     | 通貨オプション | 4,899,909                   |

## (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<br>(平成14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        | 1,790                       | 7     | 7     |
|     | 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 | 12,314                      | 585   | 585   |
|     | その他           | 130,616                     | 1,754 | 1,754 |
|     | 合 計           |                             | 1,176 | 1,176 |

(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<br>(平成14年9月30日現在) |     |      |
|-----|-----------|-----------------------------|-----|------|
|     |           | 契約額等                        | 時 価 | 評価損益 |
| 取引所 | 債券先物      | 264,916                     | 77  | 77   |
|     | 債券先物オプション | -                           | -   | -    |
| 店頭  | 債券店頭オプション | 25,635                      | 0   | 0    |
|     | 合 計       |                             | 78  | 78   |

(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

(金額単位 百万円)

| 区分 | 種 類     | 当中間連結会計期間<br>(平成14年9月30日現在) |     |      |
|----|---------|-----------------------------|-----|------|
|    |         | 契約額等                        | 時 価 | 評価損益 |
| 店頭 | 商品スワップ  | 31,698                      | 471 | 471  |
|    | 商品オプション | 9,502                       | 33  | 33   |
|    | 合 計     |                             | 505 | 505  |

(注) 1. 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. 商品はオイルに係るものです。

## (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               | 当中間連結会計期間<br>(平成14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 | 80,159                      | 538 | 538  |
|    | その他               | 93,644                      | 13  | 13   |
|    | 合 計               |                             | 525 | 525  |

(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(平成13年9月30日現在)

### (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<br>(平成13年9月30日現在) |        |        |
|-----|---------|-----------------------------|--------|--------|
|     |         | 契約額等                        | 時 価    | 評価損益   |
| 取引所 | 金利先物    | 15,784,133                  | 12,301 | 12,301 |
|     | 金利オプション | 2,071,050                   | 74     | 74     |
| 店頭  | 金利先渡契約  | 10,511,217                  | 409    | 409    |
|     | 金利スワップ  | 225,489,844                 | 38,406 | 38,406 |
|     | スワップション | 2,354,919                   | 6,084  | 6,084  |
|     | キャップ    | 8,653,370                   | 2,877  | 2,877  |
|     | フロアー    | 1,115,479                   | 4,701  | 4,701  |
|     | その他     | 402,087                     | 3,620  | 3,620  |
|     | 合 計     |                             | 48,096 | 48,096 |

(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2,544百万円(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     | 前中間連結会計期間<br>(平成13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  | 25,097,961                  | 49,795 | 49,795 |
|    | 為替予約    | 961,549                     | 13,461 | 13,461 |
|    | 通貨オプション | 92,163                      | 207    | 207    |
|    | 合 計     |                             | 63,049 | 63,049 |

(注) 1. 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及び下記注2.の取引は、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708百万円(利益)であります。  
 2. 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     | 前中間連結会計期間<br>(平成13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    | 46,447,828                  |
|     | 通貨オプション | 5,587,019                   |

## (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<br>(平成13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        | 17,038                      | 7   | 7    |
|     | 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 | 14,827                      | 503 | 503  |
|     | その他           | 143,751                     | 917 | 917  |
|     | 合 計           |                             | 406 | 406  |

(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       | 前中間連結会計期間<br>(平成13年9月30日現在) |     |      |
|-----|-----------|-----------------------------|-----|------|
|     |           | 契約額等                        | 時 価 | 評価損益 |
| 取引所 | 債券先物      | 61,742                      | 36  | 36   |
|     | 債券先物オプション | 8,400                       | 24  | 24   |
| 店頭  | 債券店頭オプション | 47,117                      | 43  | 43   |
|     | 合 計       |                             | 31  | 31   |

(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

(金額単位 百万円)

| 区分 | 種 類     | 前中間連結会計期間<br>(平成13年9月30日現在) |     |      |
|----|---------|-----------------------------|-----|------|
|    |         | 契約額等                        | 時 価 | 評価損益 |
| 店頭 | 商品オプション | 10,338                      | 43  | 43   |
|    | 合 計     |                             | 43  | 43   |

(注) 1. 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. 商品はオイルに係るものであります。

## (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               | 前中間連結会計期間<br>(平成13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 | 97,556                      | 92    | 92    |
|    | その他               | 230,325                     | 4,940 | 4,940 |
|    | 合 計               |                             | 4,848 | 4,848 |

(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。

### 3．前連結会計年度(平成14年3月31日現在)

#### (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14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        | 8,943,374             | 542,286     | 3,429     | 3,429     |
|     | 買建        | 6,928,597             | 341,900     | 3,190     | 3,190     |
|     | 金利オプション   |                       |             |           |           |
|     | 売建        | 574,331               | -           | 22        | 22        |
|     | 買建        | 701,914               | -           | 48        | 48        |
| 店頭  | 金利先渡契約    |                       |             |           |           |
|     | 売建        | 9,174,207             | 580,000     | 13        | 13        |
|     | 買建        | 3,024,390             | 780,000     | 248       | 248       |
|     | 金利スワップ    | 268,046,524           | 169,004,153 | 37,188    | 37,188    |
|     | 受取固定・支払変動 | 128,429,893           | 79,655,118  | 2,593,978 | 2,593,978 |
|     | 受取変動・支払固定 | 124,541,252           | 76,679,066  | 2,548,948 | 2,548,948 |
|     | 受取変動・支払変動 | 14,722,791            | 12,361,681  | 5,459     | 5,459     |
|     | スワップション   |                       |             |           |           |
|     | 売建        | 1,118,152             | 523,065     | 21,895    | 21,895    |
|     | 買建        | 952,425               | 592,115     | 19,321    | 19,321    |
|     | キャップ      |                       |             |           |           |
|     | 売建        | 5,446,040             | 4,319,041   | 7,950     | 7,950     |
|     | 買建        | 4,622,975             | 3,586,333   | 11,040    | 11,040    |
|     | フロアー      |                       |             |           |           |
|     | 売建        | 400,233               | 235,877     | 9,240     | 9,240     |
|     | 買建        | 621,113               | 325,744     | 12,622    | 12,622    |
|     | その他       |                       |             |           |           |
|     | 売建        | 14,352                | 13,852      | 9,170     | 9,170     |
|     | 買建        | 188,333               | 62,889      | 2,390     | 2,390     |
|     | 合 計       |                       |             | 34,335    | 34,335    |

(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490百万円(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)

|    |         | (金額単位：百万円)            |           |        |         |
|----|---------|-----------------------|-----------|--------|---------|
| 区分 | 種 類     | 前連結会計年度（平成14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  | 15,732,720            | 8,809,028 | 46,698 | 46,698  |
|    | 為替予約    | 1,319,768             | 336,625   | 2,439  | 2,439   |
|    | 通貨オプション |                       |           |        |         |
|    | 売建      | 11,641                | 2,362     | 877    | 877     |
|    | 買建      | 10,956                | 4,209     | 931    | 931     |
|    | その他     |                       |           |        |         |
|    | 売建      | 293,341               | 293,341   | 3,163  | 3,163   |
|    | 買建      | 457,727               | 457,727   | 6,145  | 6,145   |
|    | 合計      |                       |           | 46,102 | 46,102  |

(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及び下記注3．の取引は、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715百万円(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     | 前連結会計年度<br>(平成14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      | -                         |
| 店頭  | 買建      | -                         |
|     | 為替予約    | 42,123,544                |
|     | 通貨オプション |                           |
|     | 売建      | 3,161,699                 |
|     | 買建      | 3,736,356                 |

(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14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            | 55                     | -      | 0     | 0       |
|     | 買建            | 211                    | -      | 0     | 0       |
|     | 株式指数オプション     |                        |        |       |         |
|     | 売建            | -                      | -      | -     | -       |
| 店頭  | 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 |                        |        |       |         |
|     | 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・     | 11,664                 | -      | 25    | 25      |
|     | 株価指数変化率支払     |                        |        |       |         |
|     | その他           |                        |        |       |         |
|     | 売建            | 98,375                 | 21,566 | 4,531 | 4,531   |
|     | 買建            | 69,016                 | -      | 796   | 796     |
|     | 合 計           |                        |        | 3,709 | 3,709   |

- (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       | 前連結会計年度(平成14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        | 13,300                | -      | 78  | 78      |
|     | 買建        | 13,300                | -      | 90  | 90      |
|     | 債券先物オプション |                       |        |     |         |
|     | 売建        | -                     | -      | -   | -       |
| 店頭  | 買建        | 5,000                 | -      | 11  | 11      |
|     | 債券店頭オプション |                       |        |     |         |
|     | 売建        | 23,064                | 17,384 | 11  | 11      |
|     | 買建        | 28,155                | 4,953  | 0   | 0       |
|     | 合計        |                       |        | 11  | 11      |

- (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     | 前連結会計年度(平成14年3月31日現在) |       |       |         |
|----|---------|-----------------------|-------|-------|---------|
|    |         | 契 約 額 等               |       | 時 価   | 評 価 損 益 |
|    |         |                       | うち1年超 |       |         |
| 店頭 | 商品スワップ  |                       |       |       |         |
|    | 固定価格受取・ | 1,918                 | 1,796 | 504   | 504     |
|    | 変動価格支払  |                       |       |       |         |
|    | 変動価格受取・ | 1,918                 | 1,796 | 361   | 361     |
|    | 固定価格支払  |                       |       |       |         |
|    | 商品オプション |                       |       |       |         |
|    | 売建      | 5,026                 | 4,469 | 1,070 | 1,070   |
|    | 買建      | 5,026                 | 4,469 | 1,107 | 1,107   |
|    | 合計      |                       |       | 180   | 180     |

- (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. 商品はオイルに係るものです。

## (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               | 前連結会計年度(平成14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                | 51,166                | 43,807 | 774    | 774     |
|    | 買建                | 49,684                | 37,903 | 1,428  | 1,428   |
|    | その他               |                       |        |        |         |
|    | 売建                | 16,354                | 14,514 | 2,584  | 2,584   |
|    | 買建                | 223,044               | 80,496 | 14,895 | 14,895  |
|    | 合計                |                       |        | 12,965 | 12,965  |

- (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。