

(デリバティブ取引関係)

1. 当中間連結会計期間(平成15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 (平成15年9月30日現在)		
		契約額等	時 価	評価損益
取引所	金利先物	213,646,304	7,059	7,059
	金利オプション	2,815,783	314	314
店頭	金利先渡契約	19,588,774	764	764
	金利スワップ	378,671,001	286,193	286,193
	金利スワップション	6,857,851	30,654	30,654
	キャップ	8,861,038	1,313	1,313
	フロアー	506,180	888	888
	その他	249,262	2,642	2,642
	合計		266,116	266,116

(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、繰延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78百万円(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 (平成15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	16,370,428	65,930	149,520
	通貨スワップション	1,563,973	20,038	20,038
	為替予約	33,529,491	125,004	125,004
	通貨オプション	6,553,725	7,407	7,407
	その他	18,119	46	46
	合計		46,397	37,193

(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、繰延ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引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。
 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 178百万円(損失)であります。
 2. 従来、引直し対象の為替予約、通貨オプション等は、当中間連結会計期間から上記に含めて記載
 しております。

(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 (平成15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	30	0	0
	株式指数オプション	5	1	1
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	-	-	-
	その他	10,481	0	0
	合計		0	0

(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、繰延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 (平成15年9月30日現在)		
		契約額等	時 価	評価損益
取引所	債券先物	868,606	848	848
	債券先物オプション	65,081	104	104
店頭	債券店頭オプション	2,364,407	6,965	6,965
	合計		7,919	7,919

(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、繰延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 (平成15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	134,986	2,680	2,680
	商品オプション	10,426	23	23
	合計		2,704	2,704

(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、繰延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. 商品は燃料及び金属に係るものです。

(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 (平成15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	63,884	1,096	1,096
	その他	79,260	176	176
	合計		1,272	1,272

(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、繰延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. 前連結会計年度(平成15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15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	59,749,099	4,547,691	103,623	103,623
	買建	57,633,988	5,676,922	109,474	109,474
	金利オプション				
	売建	1,230,739	-	76	76
店頭	買建	600,964	205,802	99	99
	金利先渡契約				
	売建	13,389,231	590,000	1,076	1,076
	買建	3,469,855	455,000	500	500
	金利スワップ	305,031,482	214,079,553	250,498	250,498
	受取固定・支払変動	146,600,794	101,347,568	3,300,127	3,300,127
	受取変動・支払固定	139,298,388	98,710,883	3,040,142	3,040,142
	受取変動・支払変動	18,990,156	13,890,272	850	850
	金利スワップション				
	売建	1,720,503	798,669	35,707	35,707
	買建	1,523,512	1,106,731	26,355	26,355
	キャップ				
	売建	5,352,002	3,331,808	4,194	4,194
	買建	3,616,992	2,536,627	6,682	6,682
	フロアー				
	売建	317,281	207,279	7,673	7,673
	買建	351,199	195,322	9,027	9,027
	その他				
	売建	42,316	36,551	6,526	6,526
	買建	250,660	92,669	6,603	6,603
合 計				251,467	251,467

(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818百万円(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	前連結会計年度(平成15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	16,433,656	8,831,238	39,389	39,389
	通貨スワップション				
	売建	330,238	330,238	3,173	3,173
	買建	865,005	865,005	13,724	13,724
	為替予約	2,935,846	547,699	1,518	1,518
	通貨オプション				
	売建	56,586	13,166	1,375	1,375
	買建	60,441	21,575	1,585	1,585
	その他				
	売建	15,310	2,855	153	153
	買建	-	-	-	-
合 計				26,956	26,956

(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371百万円(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 (平成15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	37,271,679
	通貨オプション	
	売建	3,001,518
	買建	3,195,840

(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15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	-	-	-	-
店頭	買建	-	-	-	-
	有価証券店頭オプション				
	売建	0	-	0	0
	買建	0	-	0	0
	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	477	-	0	0
	買建	477	-	0	0
合 計				0	0

(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定しております。

(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15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	債券先物				
	売建	119,032	-	388	388
	買建	129,712	-	67	67
	債券先物オプション				
	売建	4,000	-	8	8
店頭	買建	-	-	-	-
	債券店頭オプション				
	売建	16,010	15,617	0	0
	買建	4,719	3,125	0	0
	合計			463	463

- (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15年3月31日現在)			
		契 約 額 等	うち1年超	時 価	評 価 損 益
店頭	商品スワップ				
	固定価格受取・	31,049	27,358	1,607	1,607
	変動価格支払				
	変動価格受取・	31,049	27,358	2,376	2,376
	固定価格支払				
	商品オプション				
	売建	6,369	4,063	1,493	1,493
	買建	6,369	4,063	1,521	1,521
	合計			797	797

- (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. 商品はオイル及び金属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	前連結会計年度(平成15年3月31日現在)			
		契 約 額 等	うち1年超	時 価	評 価 損 益
店頭	クレジットデフォルトオプション				
	売建	39,823	22,790	1,767	1,767
	買建	35,625	18,592	3,153	3,153
	その他				
	売建	5,722	1,099	4,915	4,915
	買建	86,567	79,546	276	276
	合計			6,578	6,578

- (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。