

オフバランス取引情報 金融派生商品及び為替予約

(単位：億円)

	平成 8/3 期		平成 9/3 期		平成 10/3 期	
	契約金額・想定元本額	与信相当額	契約金額・想定元本額	与信相当額	契約金額・想定元本額	与信相当額
金利スワップ	619,963	14,590	679,554	12,692	779,782	17,631
通貨スワップ	62,847	10,896	61,408	6,478	61,775	7,367
為替予約	403,186	20,661	403,753	18,871	317,126	17,777
金利オプション(買)	4,087	83	42,985	336	49,040	467
通貨オプション(買)	5,115	127	16,201	901	7,175	301
その他金融派生商品	67,768	857	25,157	49	53,923	391
一括清算ネットिंग 契約による与信相当額削減効果						9,481
合計	1,162,969	47,217	1,229,061	39,328	1,268,823	34,454

注) 1. 上記与信相当額は、平成 9/3 期までにつきましては、自己資本比率(国際統一基準)のカレント・エクスポージャー方式(一部オリジナル・エクスポージャー方式)により算出しております。平成 10/3 期につきましては、全面的にカレント・エクスポージャー方式により算出しております。

2. また、与信相当額の算出に当たっては、一部の取引についてネットティング(お取引先毎に、締結したすべてのオフバランス取引の時価評価額を相殺し、相殺後の金額を与信相当額とするもの)を採用しています。なお、ネットティングによる与信相当額削減効果については、平成 10/3 期より開示しております。

3. いずれの年度も連結ベースの計数となっております。

4. 国際統一基準の対象となっていない取引所取引、原契約期間が14日以内の外国為替関連取引等の契約金額・想定元本額は次の通りです。

(単位：億円)

	平成 8/3 期	平成 9/3 期	平成 10/3 期
	契約金額・想定元本額	契約金額・想定元本額	契約金額・想定元本額
為替予約	65,357	23,429	55,602
金利オプション(売)	44,148	142,339	98,980
金利オプション(買)	31,998	87,652	56,471
通貨オプション(売)	5,650	11,071	8,870
通貨オプション(買)	276	163	16
その他金融派生商品	910,297	739,563	833,886
合計	1,057,730	1,004,219	1,053,828

与信関連取引

(単位：億円)

	平成 8/3 期	平成 9/3 期	平成 10/3 期
	契約金額	契約金額	契約金額
コミットメント	73,145	87,637	103,603
保証取引	22,351	22,821	20,107
その他	4,266	3,115	4,395
合計	99,763	113,574	128,106