

デリバティブ取引の契約額、時価及び評価損益

取引の時価等に関する事項

(当連結会計年度)

(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	31,653,308	10,386,242	385,162	385,162
		買建	35,499,788	12,938,286	387,515	387,515
	金利オプション	売建	8,224,799	421,994	7,307	3,255
		買建	6,486,581	578,949	10,165	5,682
店頭	金利先渡契約	売建	27,079,298	6,220,724	29,800	29,800
		買建	22,619,539	5,657,425	28,396	28,396
	金利スワップ	受取固定・支払変動	259,626,266	145,525,033	6,021,782	6,021,782
		受取変動・支払固定	262,599,202	145,215,353	6,164,663	6,164,663
		受取変動・支払変動	10,375,720	5,251,600	1,633	1,633
		受取固定・支払固定	2,626,411	1,995,516	3,125	3,125
	金利オプション	売建	8,824,099	5,742,276	11,403	9,753
		買建	7,087,622	4,739,979	63,914	45,046
合計						96,645

(注) 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) 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
店頭	通貨スワップ		17,372,314	225,082	101,465

(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2.の取引は、上記記載から除いております。
 2. 「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、期間損益計算を行な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。

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

(金額単位：百万円)

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
通貨スワップ	1,576,084	10,348	5,114

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。

引直を行な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(平成13年3月31日現在)	
			契約額等	
取引所	通貨先物	売建	1,469	
		買建	209	
店頭	為替予約	売建	24,321,306	
		買建	28,970,975	
	通貨オプション	売建	4,608,183	
		買建	4,571,896	

(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	うち一年超	時価	評価損益
取引所	株式指数先物	売建	69,338	-	1,002	1,002
		買建	15,981	-	224	224
	株式指数先物オプション	売建	35,494	-	128	12
		買建	12,046	-	293	35
店頭	株式店頭オプション	売建	6,182	1,300	372	102
		買建	15,555	4,673	986	717
合計						1,415

(注) 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。

(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	うち一年超	時価	評価損益
取引所	債券先物	売建	621,019	-	876	876
		買建	441,976	-	944	944
	債券先物オプション	売建	503,069	-	204	402
		買建	440,881	-	898	415
店頭	債券店頭オプション	売建	86,079	-	217	18
		買建	89,530	3,315	702	590
合計						1,457

(注) 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。

(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	うち1年超	時価	評価損益
取引所	商品先物	売建	-	-	-	-
		買建	-	-	-	-
店頭	商品先渡契約	売建	-	-	-	-
		買建	-	-	-	-
	商品スワップ		-	-	-	-
	商品オプション	売建	5,031	496	330	101
買建		5,031	496	330	82	
合計						18

- (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. 商品はオイル、銅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		当連結会計年度(平成13年3月31日現在)			
			契約額等	うち1年超	時価	評価損益
店頭	クレジットデリバティブ	売建	64,101	60,021	313	528
		買建	124,363	113,189	1,016	1,019
合計						490

- (注) 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。

(7)ウェザーデリバティブ取引

(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	うち1年超	時価	評価損益
店頭	ウェザー・デリバティブ (オプション系)	売建	595	-	38	33
		買建	595	-	31	7
合計						26

- (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. 取引は降水量等に係るものであります。

関連当事者との取引

当連結会計年度(平成12年4月1日から平成13年3月31日まで)

関連当事者との取引について記載すべき重要なものはありません。