

デリバティブ取引の時価等

(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末 (平成12年9月30日現在)		
			契約額等	時価	評価損益
取引所	金利先物	売建	36,921,465	14,728	14,728
		買建	41,978,171	57,443	57,443
	金利オプション	売建	7,114,105	2,644	576
		買建	5,204,833	4,709	1,051
店頭	金利先渡契約	売建	22,235,383	5,232	5,232
		買建	19,639,400	5,250	5,250
	金利スワップ		541,128,766	57,990	57,990
	金利オプション	売建	11,192,775	37,173	46,319
		買建	7,697,367	62,774	42,845
合計					17,140

(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) 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末 (平成12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		20,715,317	53,170	3,952

(注) 1. 上記取引については時価評価を行ない、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。
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	当中間連結会計期間末 (平成12年9月30日現在)		
	契約額等	時価	評価損益
通貨スワップ	1,761,199	1,776	3,848

また、同様に、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		当中間連結会計期間末 (平成12年9月30日現在)	
			契約額等	
取引所	通貨先物	売建	1,187	
		買建	266	
	通貨オプション	売建	-	
		買建	-	
店頭	為替予約	売建	18,747,400	
		買建	22,593,416	
	通貨オプション	売建	4,218,117	
		買建	3,631,767	
	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		当中間連結会計期間末 (平成12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	売建	37,983	294	294
		買建	9,218	136	136
	株式指数先物 オプション	売建	35,312	312	119
		買建	53,839	247	28
店頭	株式店頭オプション	売建	1,030	39	12
		買建	4,137	476	252
	株式店頭指数等スワップ		-	-	-
	その他	売建	-	-	-
買建		-	-	-	
合計					489

(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末 (平成12年9月30日現在)		
			契約額等	時価	評価損益
取引所	債券指数先物	売建	699,450	2,789	2,789
		買建	983,939	11,067	11,067
	債券先物オプション	売建	964,500	199	261
		買建	861,354	598	194
店頭	債券店頭オプション	売建	210,014	35	363
		買建	76,108	401	96
	その他	売建	-	-	-
		買建	-	-	-
合計					7,362

(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末 (平成12年9月30日現在)		
			契約額等	時価	評価損益
取引所	商品先物	売建	-	-	-
		買建	-	-	-
	商品スワップ	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	4,247	278	73
		買建	4,247	278	112
	その他	売建	-	-	-
買建		-	-	-	
合計					39

(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。

(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末 (平成12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・スワップ	売建	34,493	15	0
		買建	484,696	10	12
	クレジット・デフォルト・オプション	売建	5,934	4	4
		買建	1,057	4	4
	その他	売建	-	-	-
		買建	-	-	-
合計					12

(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。

(7)ウェザーデリバティブ取引

(金額単位：百万円)

区分	種類		当中間連結会計期間末 (平成12年9月30日現在)		
			契約額等	時価	評価損益
店頭	ウェザー・デリバティブ(スワップ系)		-	-	-
	ウェザー・デリバティブ(オプション系)	売建	135	5	17
		買建	135	2	7
	その他	売建	-	-	-
		買建	-	-	-
合計					9

(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。