

## 金利関連取引

(単位:億円)

区分	種類	平成11年3月末				平成12年3月末				
		契約額等	時価	評価損益	契約額等	時価	評価損益			
		うち1年超				うち1年超				
店頭	金利スワップ	受取固定・支払変動	2,429	1,509	190	190	1,316	861	90	90
		受取変動・支払固定	7,773	6,038	264	264	5,533	3,942	132	132
		受取変動・支払変動	625	549	1	1	343	329	0	0
キャップ	売建		260	197			253	233		
			( 1 )		0	1	( 1 )		0	0
	買建		371	307			353	181		
			( 8 )		1	6	( 4 )		1	2
スワップション	売建		158	53						
			( 0 )		0	0	( )			
	買建									
			( )				( )			
合計		/	/	/	77	/	/	/	43	

(注)1.時価の算定

店頭取引については、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います。

2.( )内は、貸借対照表に計上したオプション料です。

3.取引所取引および店頭取引における金利先渡契約取引及び金利オプション取引は、該当ありません。

4.平成12年3月期の金利スワップの残存期間別想定元本額および平均金利は、次のとおりです。

## 円金利スワップ(金利スワップ取引中シェア96%)

(単位:億円、%)

残存期間	1年以内	1年超 3年以内	3年超 5年以内	5年超
受取固定・支払変動スワップ想定元本	455	281	320	260
平均受取固定金利	2.13	1.15	4.36	3.69
平均支払変動金利	0.29	0.45	1.62	2.27
受取変動・支払固定スワップ想定元本	1,575	2,695	1,032	82
平均受取変動金利	0.24	0.58	1.00	1.26
平均支払固定金利	2.68	2.06	1.86	2.55
受取変動・支払変動スワップ想定元本	14	110	9	49
平均受取変動金利	0.16	2.08	0.93	3.09
平均支払変動金利	0.16	2.11	0.93	1.71
想定元本額合計	2,044	3,088	1,362	391

5.特定取引(トレーディング取引)に含まれるデリバティブ取引については、時価評価を行い、その評価損益を損益計算書に計上していますので上記記載から除いています。

特定取引(トレーディング取引)に含まれるデリバティブ取引の契約額等は、次のとおりです。

(単位:億円)

区分	種類	平成11年3月末		平成12年3月末		
		契約額等	時価	契約額等	時価	
取引所	金利先物	売建	14	14	59	59
		買建	74	74	15	15
店頭	金利先渡契約	売建	180	0		
		買建				
	金利スワップ	受取固定・支払変動	15,149	526	11,652	287
		受取変動・支払固定	16,917	489	12,606	242
		受取変動・支払変動	1,047	1	1,259	1
キャップ	売建		3,787		2,826	
			( 92 )	11	( 63 )	13
	買建		3,348		2,337	
			( 77 )	12	( 52 )	12
フロアー	売建		( )		( )	
			21		30	
	買建		( 0 )	0	( 0 )	0
スワップション	売建		158		83	
			( 0 )	0	( 0 )	0
	買建		158			
			( 0 )	0	( )	

(注)1.( )内は、契約額等に係る当初の受払オプション料です。

2.取引所取引における金利オプション取引および店頭取引における金利オプション取引は、該当ありません。

3.特定取引における金利スワップの残存期間別想定元本額及び平均金利は、次のとおりです。

円金利スワップ(金利スワップ取引中シェア99%)

(単位:億円、%)

残存期間	1年以内		1年超 3年以内		3年超 5年以内		5年超	
	受取固定・支払変動スワップ想定元本	3,732		5,413		1,995		376
平均受取固定金利	2.24		1.94		2.30		3.08	
平均支払変動金利	0.25		0.63		1.25		1.61	
受取変動・支払固定スワップ想定元本	4,988		5,488		1,751		291	
平均受取変動金利	0.24		0.59		1.14		1.47	
平均支払固定金利	1.80		1.69		1.98		2.21	
受取変動・支払変動スワップ想定元本	649		450		106		52	
平均受取変動金利	1.32		1.27		1.29		1.68	
平均支払変動金利	1.37		1.35		1.37		1.81	
想定元本額合計	9,369		11,353		3,852		721	

## 通貨関連取引

(単位:億円)

区分	種類	平成11年3月末				平成12年3月末			
		契約額等		時価 評価損益		契約額等		時価 評価損益	
		うち1年超				うち1年超			
店頭	通貨スワップ	3,002	842	29	29	1,341	125	16	16
	うち米ドル	2,400	384	33	33	953	125	15	15
	英ポンド	15	15	3	3				
	スイスフラン	5		1	1				
	香港ドル	580	442	2	2	388		0	0
	その他								

(注)1.時価の算定  
割引現在価値により算定しています。

2.特定取引(トレーディング取引)に含まれるデリバティブ取引については、時価評価を行い、その評価損益を損益計算書に計上していますので上記記載から除いています。  
特定取引に含まれるデリバティブ取引の契約額等は、次のとおりです。

(単位:億円)

区分	種類	平成11年3月末		平成12年3月末	
		契約額等	時価	契約額等	時価
店頭	通貨スワップ	922	1	756	1
	うち米ドル	679	6	662	2
	独マルク	14	1	7	2
	スイスフラン	138	2	81	1
	その他	89	0	5	0

3.先物為替予約、通貨オプション等については、期末日に引直しを行い、その損益を損益計算書に計上していますので上記記載から除いています。  
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、次のとおりです。

(単位:億円)

区分	種類	平成11年3月末		平成12年3月末	
		契約額等	時価	契約額等	時価
店頭	為替予約	売建	15,490	5,955	
		買建	11,788	6,106	
通貨オプション	売建	コール	2,876	4,078	
			( 55 )	( 33 )	
	プット	2,785	4,006		
		( 85 )	( 68 )		
	買建	コール	2,997	4,074	
			( 67 )	( 41 )	
	プット	3,159	4,227		
		( 98 )	( 107 )		
その他	売建				
	買建				

(注)1.( )内は、貸借対照表に計上したオプション料です。  
2.取引所取引は、該当ありません。

## 株式関連取引

該当ありません。

## 債券関連取引

(単位:億円)

区分	種類	平成11年3月末				平成12年3月末			
		契約額等	うち1年超	時価	評価損益	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
店頭	債券店頭	売建	コール	-	-	-	-	-	-
			オプション	(-)	-	-	(-)	-	-
	買建	コール	-	-	-	-	-	-	
		オプション	(-)	-	-	(-)	-	-	
	その他	売建	-	-	-	-	-	-	
		買建	-	-	-	-	-	-	
合計		/	/	/	0	/	/	/	

(注)1.時価の算定

店頭取引については、オプション価格計算モデル等により算定しています。

2.( )内は、貸借対照表に計上したオプション料です。

3.取引所取引は該当ありません。

4.特定取引(トレーディング取引)に含まれるデリバティブ取引については、時価評価を行い、その評価損益を損益計算書に計上していますので、上記記載から除いています。

特定取引に含まれるデリバティブ取引の契約額等は、次のとおりです。

(単位:億円)

区分	種類	平成11年3月末		平成12年3月末		
		契約額等	時価	契約額等	時価	
取引所	債券先物	売建	152	155	138	138
		買建	156	159	163	163
店頭	債券先物	売建	コール	-	-	-
			オプション	(-)	-	(-)
	買建	コール	-	-	-	-
		オプション	(-)	-	(-)	-
	その他	売建	-	-	-	-
		買建	-	-	-	-
合計		/	/	/	/	

(注)1.( )内は、契約額等に係る当初の受払オプション料であります。

2.店頭取引は、該当ありません。

## 商品関連取引/クレジットデリバティブ取引

該当ありません。