

デリバティブ取引情報

金利関連取引

(単位：百万円)

	平成19年9月末			平成20年9月末		
	契約額等	時価	評価損益	契約額等	時価	評価損益
金融商品取引所						
金利先物	1,181,682	△369	△369	250,950	△81	△81
店頭						
金利スワップ	19,885,637	23,476	23,250	18,381,023	24,807	24,456
キャップ	187,358	△129	706	102,943	△99	389
フロアー	18,542	△70	98	50,458	341	515
スワップション	30,490	72	49	504,100	△19	188
合計	/	22,980	23,735	/	24,947	25,467

(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、「銀行業における金融商品会計基準適用に関する会計上及び監査上の取扱い」(日本公認会計士協会業種別監査委員会報告第24号)等に基づき、ヘッジ会計を適用し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。

通貨関連取引

(単位：百万円)

	平成19年9月末			平成20年9月末		
	契約額等	時価	評価損益	契約額等	時価	評価損益
店頭						
通貨スワップ	3,509,176	3,340	△1,712	3,403,158	△606	22,329
為替予約	1,668,233	38,672	38,672	1,607,048	△201	△201
通貨オプション	3,148,638	△9,835	5,808	2,649,069	41,474	52,770
合計	/	32,178	42,768	/	40,666	74,898

(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、「銀行業における外貨建取引等の会計処理に関する会計上及び監査上の取扱い」(日本公認会計士協会業種別監査委員会報告第25号)等に基づきヘッジ会計を適用している通貨スワップ取引等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。

株式関連取引

(単位：百万円)

	平成19年9月末			平成20年9月末		
	契約額等	時価	評価損益	契約額等	時価	評価損益
金融商品取引所						
株式指数先物	—	—	—	2,259	△4	△4
合計	/	—	—	/	△4	△4

(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。

債券関連取引

(単位：百万円)

	平成19年9月末			平成20年9月末		
	契約額等	時価	評価損益	契約額等	時価	評価損益
金融商品取引所						
債券先物	144,113	461	461	64,086	200	200
債券先物オプション	—	—	—	14,906	11	△54
合計	/	461	461	/	212	146

(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。

商品関連取引

平成19年9月末、平成20年9月末とも該当ありません。

クレジットデリバティブ取引

平成19年9月末、平成20年9月末とも該当ありません。