

# デリバティブ取引情報

## ■金利関連取引（単体・連結）

（単位：億円）

	取引所	金利先物	単体				連結（参考）				
			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	
平成13年3月末	取引所	金利先物	売建	31	—	△0	△0	31	—	△0	△0
			買建	198	16	0	0	198	16	0	0
	店頭	金利スワップ	受取固定・支払変動	10,100	6,507	277	277	10,100	6,507	277	277
			受取変動・支払固定	11,435	6,390	△231	△231	11,435	6,390	△231	△231
			受取変動・支払変動	1,460	1,198	3	3	1,460	1,198	3	3
	キャップ	売建	買建	2,496	1,885	3	47	2,496	1,885	3	47
			買建	1,861	1,331	3	△37	1,861	1,331	3	△37
	フロアー	売建	買建	100	100	4	△3	100	100	4	△3
			買建	143	143	6	4	143	143	6	4
	スワップション	売建	買建	30	—	0	0	30	—	0	0
買建			—	—	—	—	—	—	—	—	
合計			／	／	50	60	／	／	50	60	
平成14年3月末	取引所	金利先物	売建	40	—	△0	△0	40	—	△0	△0
			買建	6	—	△0	△0	6	—	△0	△0
	店頭	金利スワップ	受取固定・支払変動	8,132	5,177	222	222	8,132	5,177	222	222
			受取変動・支払固定	9,092	5,006	△156	△156	9,092	5,006	△156	△156
			受取変動・支払変動	1,536	895	0	0	1,536	895	0	0
	キャップ	売建	買建	2,267	1,647	2	14	2,267	1,647	2	14
			買建	2,080	1,552	2	△7	2,080	1,552	2	△7
	フロアー	売建	買建	120	120	5	△4	120	120	5	△4
			買建	175	170	7	5	175	170	7	5
	スワップション	売建	買建	0	0	0	△0	0	0	0	△0
買建			—	—	—	—	—	—	—	—	
合計			／	／	68	74	／	／	68	74	

(注) 1. 上記取引については、時価評価を行い、評価損益を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. 時価の算定  
 取引所取引については、東京金融先物取引所等における最終の価格によっております。  
 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おります。

## ■通貨関連取引（単体・連結）

（単位：億円）

	取引所	通貨スワップ	単体				連結（参考）			
			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
平成13年3月末	店頭	通貨スワップ	1,979	1,663	△22	△22	1,979	1,663	△22	△22
		為替予約	／	／	／	／	／	／	／	／
		買建	／	／	／	／	／	／	／	／
合計			／	／	△22	△22	／	／	△22	△22
平成14年3月末	店頭	通貨スワップ	3,628	2,995	△32	△32	3,628	2,995	△32	△32
		為替予約	／	／	／	／	1	—	0	0
		買建	／	／	／	／	9	—	△0	△0
合計			／	／	△32	△32	／	／	△32	△32

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益を損益計算書に計上しております。  
 なお、下記(注)3.の取引は、上記記載から除いております。  
 また、ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。  
 2. 時価の算定  
 割引現在価値等により算定しております。  
 3. 期間損益計算を行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。  
 期間損益計算を行っている通貨スワップ取引の契約額等は、下記のとおりであります。

（単位：億円）

	単体	連結（参考）		
		契約額等	時価	評価損益
平成13年3月末 通貨スワップ	422	△16	△16	△16
平成14年3月末 通貨スワップ	614	△9	△9	△9

また、同様に、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おりますので、上記記載から除いております。  
 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、次頁のとおりであります。  
 なお、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、連結の記載から除外しております。

(単位：億円)

				単体		連結(参考)	
				契約額等		契約額等	
平成13年3月末	店頭	為替予約	売建	2,957		2,964	
			買建	2,861		2,869	
	通貨オプション	売建	5,809		5,809		
		買建	6,217		6,217		
平成14年3月末	店頭	為替予約	売建	4,240		4,249	
			買建	4,757		4,766	
	通貨オプション	売建	12,867		12,867		
		買建	13,715		13,715		

(注)取引所取引はありません。

## ■株式関連取引(単体・連結)

(単位：億円)

				単体				連結(参考)			
				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
平成13年3月末	取引所	株式指数先物	売建	—	—	—	—	1	—	△0	△0
			買建	—	—	—	—	—	—	—	—
			合計	/	/	—	—	/	/	△0	△0
平成14年3月末	取引所	株式指数先物	売建	—	—	—	—	1	—	0	0
			買建	—	—	—	—	—	—	—	—
			合計	/	/	—	—	/	/	0	0

(注) 1. 店頭取引はありません。  
2. 上記取引については、時価評価を行い、評価損益を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ありません。  
3. 時価の算定  
取引所取引については、東京証券取引所等における最終の価格によっております。

## ■債券関連取引(単体・連結)

(単位：億円)

				単体				連結(参考)			
				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
平成13年3月末	取引所	債券先物	売建	52	—	△0	△0	84	—	0	0
			買建	11	—	△0	△0	13	—	△0	△0
		債券先物オプション	売建	—	—	—	—	—	—	—	—
			買建	—	—	—	—	—	—	—	—
		合計	/	/	△0	△0	/	/	0	0	
平成14年3月末	取引所	債券先物	売建	2	—	△0	△0	27	—	△0	△0
			買建	—	—	—	—	12	—	0	0
		債券先物オプション	売建	—	—	—	—	—	—	—	—
			買建	—	—	—	—	5	—	0	0
		合計	/	/	△0	△0	/	/	△0	△0	

(注) 1. 店頭取引はありません。  
2. 上記取引については、時価評価を行い、評価損益を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ありません。  
3. 時価の算定  
取引所取引については、東京証券取引所等における最終の価格によっております。

## ■商品関連取引/クレジットデリバティブ取引(単体・連結)

平成13年3月末、平成14年3月末 該当ありません。

## ■トレーディング取引のVaR実績値(連結)

(単位：億円)

		最大値	最小値	平均値
平成13年3月期	VaR値	5	0	2
平成14年3月期	VaR値	4	0	2

(注) VaRの範囲、前提等  
1. 対象範囲：当行及びコスモ証券株式会社のトレーディング取引  
(ただし、コスモ証券株式会社のオプション性リスク、株式関連リスクを除く)  
2. 対象期間：平成13年3月期は平成12年4月1日から平成13年3月31日まで、平成14年3月期は平成13年4月1日から平成14年3月31日まで  
3. 信頼水準：片側99%  
4. 保有期間：10日