

デリバティブ取引

< 平成13年3月期 >

通貨関連

(単位：百万円 未満切捨)

| 区分 | 種類 | 平成13年3月期 | | | |
|-----------|-------------|----------|-------|-----|------|
| | | 契約額等 | | 時価 | 評価損益 |
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引以外の取引 | 通貨スワップ取引 | | | | |
| | 米ドル受取・日本円支払 | 3,788 | 3,788 | 211 | 211 |
| 合計 | | 3,788 | 3,788 | 211 | 211 |

(注) 1. 時価の算定方法：時価及び評価損益は、取引先金融機関等から提示された価格等に基づき算定しております。

(注) 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引は除いております。

金利関連

(単位：百万円 未満切捨)

| 区分 | 種類 | 平成13年3月期 | | | |
|-----------|-----------|----------|--------|-----|------|
| | | 契約額等 | | 時価 | 評価損益 |
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引以外の取引 | 金利スワップ取引 | | | | |
| | 受取固定・支払変動 | 1,000 | 1,000 | 39 | 39 |
| | 受取変動・支払固定 | 19,664 | 16,816 | 665 | 665 |
| 市場取引以外の取引 | オプション取引 | | | | |
| | キャップ | 6,500 | 2,500 | 1 | 8 |
| 合計 | | 27,164 | 20,316 | 703 | 714 |

(注) 1. 時価の算定方法：時価及び評価損益は、取引先金融機関等から提示された価格等に基づき算定しております。

(注) 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引は除いております。

< 平成12年3月期 >

通貨関連

(単位：百万円 未満切捨)

| 区分 | 種類 | 12年3月期 | | | |
|-----------|-------------|--------|-------|----|------|
| | | 契約額等 | | 時価 | 評価損益 |
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引以外の取引 | 通貨スワップ取引 | | | | |
| | 日本円受取・米ドル支払 | 400 | 400 | 29 | 29 |
| 合計 | | 400 | 400 | 29 | 29 |

(注) 時価の算定方法：時価及び評価損益は、取引先金融機関等から提示された価格等に基づき算定しております。

金利関連

(単位：百万円 未満切捨)

| 区分 | 種類 | 12年3月期 | | | |
|-----------|-------------|---------|--------|-------|-------|
| | | 契約額等 | | 時価 | 評価損益 |
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引以外の取引 | 金利スワップ取引 | | | | |
| | 受取固定・支払変動 | 35,210 | 26,400 | 876 | 876 |
| | 受取変動・支払固定 | 76,712 | 35,666 | 514 | 514 |
| | 受取変動・支払変動 | 2,123 | 1,061 | 26 | 26 |
| | 金利通貨スワップ取引 | | | | |
| | 日本円受取・米ドル支払 | | | | |
| | 受取固定・支払変動 | 7,200 | 7,200 | 1,016 | 1,016 |
| | 米ドル受取・日本円支払 | | | | |
| | 受取固定・支払変動 | 2,123 | 2,123 | 52 | 52 |
| | 受取固定・支払固定 | 743 | 743 | 22 | 22 |
| オプション取引 | | | | | |
| キャップ | 63,840 | 8,340 | 188 | 188 | |
| 合計 | | 187,952 | 81,534 | 1,290 | 1,290 |

(注) 時価の算定方法：時価及び評価損益は、取引先金融機関等から提示された価格等に基づき算定しております。