

## デリバティブ取引

< 平成14年3月期 >

### 通貨関連

(単位:百万円 未満切捨)

区分	種類	平成14年3月期		時価	評価損益
		契約額等	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	4,352	4,352	694	694
	合計	4,352	4,352	694	694

(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14年3月期		時価	評価損益
		契約額等	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	34	34
	受取変動・支払固定	17,386	14,880	656	656
	受取変動・支払変動	250	250	4	4
	オプション取引 キャップ	3,700	1,700	1	1
	合計	22,336	17,830	693	693

(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		時価	評価損益
		契約額等	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		時価	評価損益
		契約額等	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
	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。