

デ リ バ テ ィ ブ 取 引

(単位:百万円 未満切捨)

対象物の種類	取引の種類	当 中 間 期 (平成13年9月30日現在)			前 期 (平成13年3月31日現在)			前 中 間 期 (平成12年9月30日現在)		
		契約額等	時 価	評価損益	契約額等	時 価	評価損益	契約額等	時 価	評価損益
通 貨	通貨スワップ取引	-	-	-	-	-	-	10,692	563	563
	日本円受取・米ドル支払 米ドル受取・日本円支払	4,110	425	425	3,788	211	211	3,481	40	40
金 利	金利スワップ取引									
	受取固定・支払変動	1,000	40	40	1,000	39	39	-	-	-
	受取変動・支払固定	18,496	740	740	19,664	665	665	-	-	-
	支払変動・受取変動	250	5	5	-	-	-	-	-	-
	オプション取引 キャップ	2,700	0	0	6,500	1	8	-	-	-
		26,557	360	360	30,952	492	502	14,173	604	604

(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。
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。