

## 【 1 3 . デリバティブ取引】

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

(単位：百万円)

対象物の種類	取引の種類	平成14年度中間期 (平成14年9月30日現在)			平成13年度中間期 (平成13年9月30日現在)			平成13年度 (平成14年3月31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	先物為替予約取引									
	売 建	836	9	9	476	477	1	1,562	1,619	57
	買 建	-	-	-	1,307	1,316	9	-	-	-
	オプション取引									
	売 建	2,900	25	25	-	-	-	-	-	-
	買 建	2,900	10	10	-	-	-	-	-	-
金利	債券先物取引									
	売 建	15,355	323	323	-	-	-	13,458	55	55
	買 建	9,858	216	216	-	-	-	5,014	9	9
	スワップ取引									
	受取変動・支払変動	15,000	87	87	15,000	18	18	15,000	12	12
合 計		-	-	170	-	-	26	-	-	5

- (注) 1.当社グループでは、外貨建債権債務に係る将来の為替相場の変動によるリスクをヘッジする目的で、実需の範囲内で特定の外貨建債権債務を対象とした為替予約取引及び通貨オプション取引を利用しており、また、金融資産・負債に係る将来の金利変動リスクをヘッジする目的で金利スワップ取引及び金利オプション取引を利用しており、投機目的ではこれらを利用していません。
- 2.為替予約取引の時価は、先物為替相場により算出しており、通貨オプション取引、金利スワップ取引及び金利オプション取引の時価は、取引相手の金融機関から提示された価格によっている。
- 3.通貨オプション取引、金利スワップ取引及び金利オプション取引における契約額等は、想定元本を表している。想定元本額は、当社グループの通貨オプション取引、金利スワップ取引及び金利オプション取引の規模を示すものであり、市場リスク及び信用リスクを表す指標ではない。また、評価損益は必ずしも、当社グループが実際の取引で受け払いする金額を表したものではない。
- 4.先物為替予約取引の時価については、平成13年度中間期及び平成13年度においては想定元本を含めた金額を記載していたが、平成14年度中間期より想定元本を除いた金額を記載する方法に変更した。
- 5.ヘッジ会計が適用されているものについては、記載対象から除いている。