

## デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益

### (1) 通貨関連

(単位：百万円)

区分	種類	平成 12 年 9 月中間期 (平成 12 年 9 月 20 日現在)				平成 11 年 9 月中間期 (平成 11 年 9 月 20 日現在)				平成 12 年 3 月期 (平成 12 年 3 月 20 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
			うち1年超				うち1年超				うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売 建												
	米ドル	1,223		1,218	4	483		455	27	934		922	12
	スターリングポンド					162		159	3	28		27	1
	合 計	1,223		1,218	4	646		615	31	963		949	13

(注)1 中間期末の時価は、中間会計期間末の先物相場を使用している。

2 「外貨建取引等会計基準」により外貨建金銭債権債務等に振り当てたデリバティブ取引については、注記の対象から除いている。

### (2) 金利関連

(単位：百万円)

区分	種類	平成 12 年 9 月中間期 (平成 12 年 9 月 20 日現在)				平成 11 年 9 月中間期 (平成 11 年 9 月 20 日現在)				平成 12 年 3 月期 (平成 12 年 3 月 20 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
			うち1年超				うち1年超				うち1年超		
市場取引以外の取引	スワップ取引 受取変動・支払 固定	5,000	5,000	135	135	5,000	5,000	181	181	5,000	5,000	147	147
	オプション取引 キャップ(買建)	1,000 ( 14)	0	0	13	1,000 ( 28)	1,000	1	26	1,000 ( 21)	1,000	0	20
	フロア(売建)	1,000 ( 15)	0	24	8	-	-	-	-	1,000 ( 23)	1,000	24	0
	合 計	7,000 ( 29)	5,000	110	157	6,000 ( 28)	6,000	179	207	7,000 ( 44)	7,000	122	168

(注)1 スワップ取引及びオプション取引の期末の時価は、取引銀行から提示された価格によっている。

2 スワップ取引及びオプション取引の契約額等は想定元本額を記載し、この金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスク量を示すものではない。

3 オプション取引における括弧書きは、中間貸借対照表に計上したオプション料である。