

# デリバティブ取引関係

・前連結会計年度

## 1. 通貨関連

(単位：百万円)

区分	種類	前 期 (平成12年3月)			
		契約額等		時 価	評価損益
			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	8,024	-	8,097	73
	ドイツマルク	1,691	-	1,578	113
	スターリングポンド	21	-	20	-
	合 計	-	-	-	40

(注)

1. 時価の算定方法

為替予約取引

先物為替相場によっております。

2. 「外貨建取引等会計処理基準」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、開示の対象から除いております。

## 2. 金利関連

(単位：百万円)

区分	種類	前 期 (平成12年3月)			
		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	2,000	2,000	117	117
	支払固定・受取変動	69,591	47,591	1,644	1,644
	合 計	-	-	-	1,526

(注) 時価の算定方法

当該スワップ取引に係る契約を約定した金融機関等から当該取引について提示された価格によっております。

・当連結会計年度

ヘッジ会計を適用しているため、該当事項はない。