



# デリバティブ取引情報

## ●取引の状況に関する事項

### (1) 取引の内容

債券関係取引：債券先物取引、債券上場オプション取引、債券店頭オプション取引、外国債券先物取引  
株式関係取引：株価指数先物取引、株価指数オプション取引  
金利関係取引：円短期金利先物取引、金利スワップ取引、金利キャップ取引、金利フロアー取引  
通貨関連取引：為替予約取引、通貨オプション取引

### (2) 取組方針および利用目的

当行のデリバティブ取引は、貸出金、有価証券等に係る市場リスクのヘッジ、実質的な調達コストの削減及び運用利回りの向上を図ることを主目的としており、短期的な売買差益の獲得を目的とする取引は、当行の体力の範囲内で管理可能な取引枠や損失限度額を定めて取り組むことを基本方針としております。

### (3) リスクの内容

デリバティブ取引が内包する代表的なリスクは信用リスクと市場リスクであります。信用リスクとは、取引相手の倒産等により契約不履行となることで被る可能性のある損失額、市場リスクとは、金利・為替等の市場の変動により被る可能性のある損失額です。

当行が利用しているデリバティブ取引に関しては、将来の金利・株価に係るリスクが想定されますが、大部分の取引はヘッジ目的で行っており、当該取引の評価損はヘッジ対象のオンバランス取引の評価益と相殺されます。

また、トレーディング等による収益獲得を目的とした取引は、厳格に限度額及びリスク管理を行っております。当行では、時価の変動が大きく、経営に重大な影響を及ぼすような取引は行っておりません。

### (4) リスク管理体制

当行には、デリバティブ取引に関して、取引の目的・内容・保有リスク及び損失限度額・リスク額等について定めた社内ルールがあり、これに基づいて厳格に取引及びリスク管理を行っております。

また、市場部門において、フロントオフィス（実際に取引を行う部署）とバックオフィス（事務を担当する部署）を分離し、内部牽制機能の充実を図っております。さらに、総合企画部ALM室内において当該取引情報を定期的に経営陣に報告する内部体制をとっております。

### (5) 定量的情報「取引の時価等に関する事項」についての補足説明

「取引の時価等に関する事項」における契約額等は、デリバティブ取引における名目上の契約額又は計算上の想定元本であり、それ自体がデリバティブ取引のリスク量を示すものではありません。

## ●取引の時価等に関する事項

### 1.金利関連取引

(金額単位：百万円)

		平成9年3月期			平成10年3月期				
		契約額等	うち1年超	時 価	評価損益	契約額等	うち1年超	時 価	評価損益
金利スワップ	受取固定・支払変動	30,000	26,000		26,000	10,000	26,173	173	
	受取変動・支払固定	35,424	30,546		38,546	32,060	36,661	1,884	
	受取変動・支払変動								
合 計								1,711	

(注) 時価の算定  
店頭取引につきましては、割引現在価格やオプション価格計算モデル等により算出しております。

### 2.通貨関連取引

(金額単位：百万円)

店 頭	通貨スワップ	平成9年3月期			平成10年3月期				
		契約額	うち1年超	時 価	評価損益	契約額	うち1年超	時 価	評価損益
	うち米ドル								
	うち英ポンド								
	うち独マルク								
	その他								

(注) 先物為替予約、通貨オプション等につきましては、期末日に引直しを行い、その損益を損益計算書に計上しておりますので、上記記載から除いております。引直しを行っている通貨関連のデリバティブ取引の契約額等は次のとおりであります。

(金額単位：百万円)

区 分	種 類	平成9年3月期		平成10年3月期	
		為 替 予 約	売 建	為 替 予 約	売 建
			6,114		6,036
			1,693		420
	合 計				

### 3.債券関連取引

(金額単位：百万円)

債 券 先 物	種 類	平成9年3月期			平成10年3月期				
		契約額等	うち1年超	時 価	評価損益	契約額等	うち1年超	時 価	評価損益
	売 建				11,727		11,716	11	
	買 建								
合 計								11	

(注) 時価の算定  
取引所取引につきましては、東京証券取引所等における最終の価格によっております。  
店頭取引につきましては、オプション価格計算モデル等により算出しております。

## ●オフバランス取引情報

該当する項目は、ございません。