

## デリバティブ取引

### 1. 取引の状況に関する事項

#### (1) 取引の内容

資金調達に伴う利息について金利スワップを行っているほか、外貨建取引について為替予約を付している。

#### (2) 取引に対する取組方針

金利スワップは調達した資金の範囲内、為替予約は当該外貨建取引の範囲内で利用しており、投機目的のデリバティブ取引は行わない方針である。

#### (3) 利用目的

金利スワップは、将来の資金調達コストの上昇を回避することを、為替予約取引は自国通貨によるキャッシュフローを確定させることを目的にしている。

#### (4) リスクの内容

金利スワップには、金利水準の変動、為替予約取引には、為替相場の変動によるリスクがある。

#### (5) リスク管理体制

デリバティブ取引の執行は、財務担当役員を座長とする会議の決定に基づき財務部が行っている。また、取引状況について財務担当役員へ定期的に報告する体制となっている。

### 2. 取引の時価に関する事項

当連結会計年度（平成 13 年 3 月 31 日現在）

該当事項なし。

なお、金利スワップ取引及び為替予約取引を行っているが、いずれもヘッジ会計を適用しているため、注記の対象から除外している。