

(添付資料)

有価証券の時価等

(単位：百万円)

期 別 種 類	1 1 年 9 月 中 間 期 (平成11年9月30日現在)			1 0 年 9 月 中 間 期 (平成10年9月30日現在)			1 1 年 3 月 期 (平成11年3月31日現在)			
	貸 対 価	借 表 額	時 価	貸 対 価	借 表 額	時 価	貸 対 価	借 表 額	時 価	評 価 損 益
(1) 流動資産に 属するもの										
株 式	343		793	548		864	631		1,031	400
債 券										
そ の 他										
小 計	343		793	548		864	631		1,031	400
(2) 固定資産に 属するもの										
株 式	35,403		59,160	25,250		37,852	31,746		48,308	16,562
債 券										
そ の 他										
小 計	35,403		59,160	25,250		37,852	31,746		48,308	16,562
合 計	35,746		59,953	25,798		38,716	32,377		49,339	16,962

(注) 1. 時価等の算定方法

上 場 有 価 証 券 主に東京証券取引所の最終価格
 店 頭 売 買 有 価 証 券 日本証券業協会の公表売買価格等
 証 券 投 資 信 託 基準価格
 非 上 場 債 券 証券業協会発表の公社債店頭基準気配銘柄の利回り、
 残存償還期間等に基づき算定した価格

2. 株式には、自己株式を含んで表示している。

なお、評価損益は次のとおりである。

	1 1 年 9 月 中 間 期	1 0 年 9 月 中 間 期	1 1 年 3 月 期
・ 流動資産に属するもの	0 百万円	0 百万円	0 百万円
・ 固定資産に属するもの	34 百万円	0 百万円	0 百万円

3. 開示の対象から除いた有価証券の貸借対照表計上額

	1 1 年 9 月 中 間 期	1 0 年 9 月 中 間 期	1 1 年 3 月 期
(流動資産)			
・ コマースシャルペーパー	26,170 百万円	百万円	百万円
・ 貸付債権信託受益権		9,011	
・ 追加型公社債投資信託 (MMF)	21,011		
(固定資産)			
・ 非上場株式 (店頭売買株式を除く)	55,725	52,027	55,505
(うち子会社および関連会社株式)	(51,115)	(48,201)	(50,715)

(添付資料)

1. 取引の状況に関する事項

当社は、為替予約取引および通貨オプション取引を利用している。これら取引の利用に関しては社内管理規程を設けており、当該デリバティブ利用の目的を外貨建債権債務に係る将来の為替相場の変動リスクを回避する目的に限定している。また、社内管理規程に定められた方針に基づき、デリバティブ取引の実行および管理は理財本部長の責任権限のもと財務部にて一元的に行い、定期的に社長、監査役および担当役員に実施状況を報告している。

当社の利用するデリバティブ取引自体は、その時価が為替相場変動の影響を受けるリスクを有しているが、その目的は外貨建債権債務に係る為替変動リスクのヘッジを効果的に行うことにあるため、通常、当該デリバティブ取引の時価の変動はヘッジ対象である債権債務のそれを相殺する関係にある。また、当社のデリバティブ取引の契約先はいずれも信用度の高い銀行であるため、相手方の契約不履行によるリスクは極めて少ないと認識している。

なお、当社では特定の長期債権債務に係る為替予約(通貨スワップを含む)を除き、1年を超える長期契約および投機を目的とした取引は行わない方針である。

2. 取引の時価等に関する事項

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益

通貨関連

(単位:百万円)

区分	種類	11年9月中間期 (平成11年9月30日現在)				10年9月中間期 (平成10年9月30日現在)				11年3月期 (平成11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	
		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	5,887	77	5,858	29	6,642	554	6,772	130	7,482	554	7,549	67	
	ドイツマルク	-	-	-	-	7,128	-	7,165	37	-	-	-	-	
	ユーロ	4,962	-	4,977	15	-	-	-	-	3,040	-	2,957	83	
	通貨オプション取引													
	買 建													
	ブ ッ ト													
	米ドル	10,000千米ドル (23)	(-)	-	14	9	(-)	(-)	-	-	(-)	(-)	-	-
	ユーロ	10,000千ユーロ (23)	(-)	-	11	12	(-)	(-)	-	-	(-)	(-)	-	-
合 計	-	-	-	7	13,770	554	13,937	167	-	-	-	16		

(注) 1. 輸出取引にかかる為替予約である。

2. 時価の算定方法

為替予約取引...先物為替相場によっている。

通貨オプション取引...主たる取引銀行から提示された価格によっている。

3. 当該為替予約残高は、翌期の外貨建売上に伴うキャッシュフローを包括的にヘッジするためのものであり、期末の外貨建債権への振り当ては行っていない。

4. 通貨オプション取引における括弧書きは、支払オプション料(貸借対照表「前渡金(流動資産その他)」計上)である。