

金利スワップ取引

- コスト・アット・リスク分析を活用し、国債発行計画における利払いコストと金利リスクをともに削減するように金利スワップ取引を実施。

○ 取引状況 (19 年 4 月～9 月)

年 限	受 け		払 い	
	回数	金額	回数	金額
3 年以下	1 回	700 億円	—	—
3 年超 7 年以下	1 回	500 億円	2 回	1,200 億円
7 年超 10 年以下	3 回	1,600 億円	—	—
10 年超	—	—	3 回	500 億円
合 計	5 回	2,800 億円	5 回	1,700 億円

(注) 19 年度下期の取引状況は 20 年 4 月に開示予定。

- これまでの取引について、市場関係者からは、マーケットへのインパクトはニュートラルとの評価。
- 金利スワップ取引におけるカウンター・パーティー・リスクに関して、よりきめ細かなリスク管理を実現する方策について検討。