

2. 有価証券等の時価情報

(1) 売買目的有価証券の評価損益

(単位：百万円)

区 分	平成15年度上半期末		平成16年度上半期末		平成15年度末	
	貸借対照表計上額	当期の損益に 含まれた評価損益	貸借対照表計上額	当期の損益に 含まれた評価損益	貸借対照表計上額	当期の損益に 含まれた評価損益
売買目的有価証券	1,294,302	166,560	1,229,985	24,951	1,234,233	247,321
一般勘定	10,545	7	1,550	-	550	-
特別勘定	1,283,756	166,568	1,228,435	24,951	1,233,683	247,321

(注) 1. 本表には、「金銭の信託」等の売買目的有価証券を含めています。
2. 「当期の損益に含まれた評価損益」には期始の振戻損益を含めています。

(2) 有価証券の時価情報(売買目的有価証券以外の有価証券のうち時価のあるもの)

(単位：百万円)

区 分	帳簿価額	時 価	差損益	平成15年度上半期末	
				うち差益	うち差損
満期保有目的の債券	120,771	117,686	3,084	412	3,497
公 社 債	120,771	117,686	3,084	412	3,497
外 国 公 社 債	-	-	-	-	-
責任準備金対応債券	1,144,713	1,188,506	43,792	49,637	5,844
公 社 債	1,144,713	1,188,506	43,792	49,637	5,844
子会社・関連会社株式	-	-	-	-	-
その他の有価証券	16,643,199	17,604,619	961,419	1,269,292	307,872
公 社 債	8,091,450	8,196,529	105,079	151,889	46,809
株 式	3,205,505	3,934,453	728,948	899,650	170,701
外 国 証 券	4,993,414	5,133,703	140,288	214,639	74,350
公 社 債	4,671,466	4,834,772	163,305	204,639	41,333
株 式 等	321,947	298,930	23,016	9,999	33,016
その他の証券	209,834	196,938	12,896	3,114	16,010
買入金銭債権	52,994	52,994	-	-	-
譲渡性預金	90,000	90,000	-	-	-
その他の	-	-	-	-	-
合 計	17,908,684	18,910,812	1,002,128	1,319,342	317,214
公 社 債	9,356,935	9,502,722	145,787	201,939	56,151
株 式	3,205,505	3,934,453	728,948	899,650	170,701
外 国 証 券	4,993,414	5,133,703	140,288	214,639	74,350
公 社 債	4,671,466	4,834,772	163,305	204,639	41,333
株 式 等	321,947	298,930	23,016	9,999	33,016
その他の証券	209,834	196,938	12,896	3,114	16,010
買入金銭債権	52,994	52,994	-	-	-
譲渡性預金	90,000	90,000	-	-	-
その他の	-	-	-	-	-
満期保有目的の債券	178,131	173,224	4,906	795	5,702
公 社 債	121,191	118,049	3,142	795	3,937
外 国 公 社 債	56,940	55,175	1,764	-	1,764
責任準備金対応債券	3,583,214	3,641,700	58,486	76,707	18,221
公 社 債	3,583,214	3,641,700	58,486	76,707	18,221
子会社・関連会社株式	-	-	-	-	-
その他の有価証券	14,551,834	15,883,174	1,331,339	1,526,763	195,424
公 社 債	5,703,715	5,817,082	113,367	119,860	6,493
株 式	2,951,396	3,952,183	1,000,786	1,154,756	153,969
外 国 証 券	5,484,465	5,700,333	215,868	245,474	29,606
公 社 債	5,116,665	5,311,217	194,551	217,486	22,934
株 式 等	367,800	389,116	21,316	27,988	6,672
その他の証券	210,259	211,576	1,316	6,671	5,354
買入金銭債権	101,996	101,996	-	-	-
譲渡性預金	100,000	100,000	-	-	-
その他の	-	-	-	-	-
合 計	18,313,180	19,698,099	1,384,918	1,604,267	219,348
公 社 債	9,408,121	9,576,832	168,711	197,364	28,653
株 式	2,951,396	3,952,183	1,000,786	1,154,756	153,969
外 国 証 券	5,541,405	5,755,509	214,103	245,474	31,371
公 社 債	5,173,605	5,366,392	192,787	217,486	24,698
株 式 等	367,800	389,116	21,316	27,988	6,672
その他の証券	210,259	211,576	1,316	6,671	5,354
買入金銭債権	101,996	101,996	-	-	-
譲渡性預金	100,000	100,000	-	-	-
その他の	-	-	-	-	-

区 分	帳簿価額	時価	差損益	うち差益		
				うち差益	うち差損	
平成15年度末	満期保有目的の債券	175,176	171,637	3,539	576	4,115
	公 社 債	120,912	118,031	2,881	576	3,457
	外 国 公 社 債	54,263	53,606	657	-	657
	責任準備金対応債券	1,665,815	1,696,593	30,778	41,514	10,735
	公 社 債	1,665,815	1,696,593	30,778	41,514	10,735
	子会社・関連会社株式	-	-	-	-	-
	そ の 他 有 価 証 券	15,897,425	17,202,692	1,305,267	1,517,984	212,716
	公 社 債	7,293,862	7,397,906	104,043	132,305	28,262
	株 式	2,989,663	4,038,698	1,049,035	1,164,448	115,412
	外 国 証 券	5,253,549	5,412,904	159,354	216,504	57,149
	公 社 債	4,907,159	5,059,469	152,310	198,704	46,394
	株 式 等	346,390	353,434	7,044	17,799	10,755
	そ の 他 の 証 券	192,350	185,185	7,165	4,726	11,891
	買 入 金 銭 債 権	72,998	72,998	-	-	-
	譲 渡 性 預 金	95,000	95,000	-	-	-
	そ の 他	-	-	-	-	-
	合 計	17,738,416	19,070,924	1,332,507	1,560,075	227,567
	公 社 債	9,080,590	9,212,531	131,940	174,396	42,455
	株 式	2,989,663	4,038,698	1,049,035	1,164,448	115,412
	外 国 証 券	5,307,813	5,466,510	158,697	216,504	57,807
公 社 債	4,961,423	5,113,075	151,652	198,704	47,052	
株 式 等	346,390	353,434	7,044	17,799	10,755	
そ の 他 の 証 券	192,350	185,185	7,165	4,726	11,891	
買 入 金 銭 債 権	72,998	72,998	-	-	-	
譲 渡 性 預 金	95,000	95,000	-	-	-	
そ の 他	-	-	-	-	-	

- (注) 1. 本表には、CD(譲渡性預金)等、証券取引法上の有価証券に準じた取扱いを行うことが適当と認められるものを含んでいます。
2. 「金銭の信託」のうち売買目的有価証券以外に区分されるものがありますが、資産内容が預金であるため本表に含めていません。
なお、帳簿価額および時価は平成15年度上半期末が1,779百万円、平成16年度上半期末が1,481百万円、平成15年度末が1,641百万円です。

・時価のない有価証券の帳簿価額は次のとおりです。

(単位：百万円)

区 分	平成15年度上半期末	平成16年度上半期末	平成15年度末
満期保有目的の債券	-	-	-
非上場外国公社債	-	-	-
そ の 他	-	-	-
責任準備金対応債券	-	-	-
子会社・関連会社株式	27,929	28,931	28,929
非上場国内株式(店頭売買株式を除く)	19,715	20,717	20,715
非上場外国株式(店頭売買株式を除く)	8,214	8,214	8,214
そ の 他 有 価 証 券	234,089	358,488	312,536
非上場国内株式(店頭売買株式を除く)	75,180	80,990	80,475
非上場外国株式(店頭売買株式を除く)	134,291	126,546	133,405
非上場外国公社債	0	0	0
そ の 他	24,617	150,950	98,655
合 計	262,018	387,419	341,466

(注) 本表には、CD(譲渡性預金)等、証券取引法上の有価証券に準じた取扱いを行うことが適当と認められるものを含んでいます。

(3) 金銭の信託の時価情報

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額	時価	差損益	
			うち差益	うち差損
平成15年度上半期末	12,325	12,325	-	-
平成16年度上半期末	3,031	3,031	-	-
平成15年度末	2,191	2,191	-	-

(注) 本表記載の時価相当額の算定は、金銭の信託の受託者が合理的に算定した価格によっています。
差損益には金銭の信託内で設定しているデリバティブ取引に係る差損益も含んでいます。

・運用目的の金銭の信託

(単位：百万円)

区 分	平成15年度上半期末		平成16年度上半期末		平成15年度末	
	貸借対照表計上額	当期の損益に含まれた評価損益	貸借対照表計上額	当期の損益に含まれた評価損益	貸借対照表計上額	当期の損益に含まれた評価損益
運用目的の金銭の信託	10,545	7	1,550	-	550	-

(注) 「当期の損益に含まれた評価損益」には期始の振戻損益を含めています。

・満期保有目的・責任準備金対応・その他の金銭の信託

(単位：百万円)

区 分	平成15年度上半期末				
	帳簿価額	時価	差損益	うち差益	うち差損
満期保有目的の金銭の信託	-	-	-	-	-
責任準備金対応の金銭の信託	-	-	-	-	-
その他の金銭の信託	1,779	1,779	-	-	-
区 分	平成16年度上半期末				
	帳簿価額	時価	差損益	うち差益	うち差損
満期保有目的の金銭の信託	-	-	-	-	-
責任準備金対応の金銭の信託	-	-	-	-	-
その他の金銭の信託	1,481	1,481	-	-	-

区 分	平成15年度末				
	帳簿価額	時価	差損益	うち差益	うち差損
満期保有目的の金銭の信託	-	-	-	-	-
責任準備金対応の金銭の信託	-	-	-	-	-
その他の金銭の信託	1,641	1,641	-	-	-

(注) 「その他の金銭の信託」には資産内容が預金である金銭の信託を記載しています。

(4) デリバティブ取引の運用状況

当社では、有価証券投資に係る市場リスクのヘッジを目的とした有価証券関連のデリバティブ取引、外貨建資産に係る為替リスクのヘッジを目的とした通貨関連のデリバティブ取引、貸付金の収益の安定および向上を目的とした金利スワップ関連取引を行っております。

当社が利用しているデリバティブ取引には、現物資産と同様に市場リスク（金利・為替等市場の変動が収益に影響を及ぼすリスク）と信用リスク（取引相手が倒産等により契約不履行に陥るリスク）があります。例えば、金利スワップ取引では、金利の変動による市場リスクだけでなく、取引相手のデフォルトによる信用リスクも認識する必要があります。

また、一般的には、デリバティブ取引には、流動性の高さ、取引コストの低さ、リスク特性の変更が可能であることなどの利点がある一方で、レバレッジ、商品特性等に起因する現物資産にはないリスクも存在していることに留意し、きめ細かな管理を行う必要があると考えております。

取引の内容

平成 16 年度上半期に当社が利用していたデリバティブ取引は以下のとおりです。

- ・金利関連：金利先物取引、金利スワップ取引
- ・通貨関連：為替予約取引、通貨オプション取引
- ・株式関連：株価指数先物取引
- ・債券関連：債券先物取引、債券オプション取引
- ・その他：クレジット・デリバティブ取引

取組方針

当社では、保有資産の残高を踏まえ、必要な範囲内でデリバティブ取引を用いることとし、主に保有している現物資産に係る市場リスクのヘッジを目的とした取引を行っております。従って、投機的なデリバティブ取引は行わない方針です。

デリバティブ取引に対するヘッジ会計の適用

当社では、平成 16 年度上半期において、以下の取引についてヘッジ会計を適用しております。

- ・貸付金をヘッジ対象、金利スワップをヘッジ手段とする取引
- ・公社債をヘッジ対象、金利スワップをヘッジ手段とする取引
- ・外貨建債券をヘッジ対象、為替予約をヘッジ手段とする取引

ヘッジ会計の適用にあたっては、「金融商品に係る会計基準の設定に関する意見書」等における適用要件を満たすため、方針文書・規程等を整備するとともに、これらの方針・規程等に基づき、ヘッジ対象のリスクの種類および選択したヘッジ手段を明確にし、また事前有効性の確認、事後有効性の検証を行う等、社内体制を整備して運営しております。

リスク管理体制

当社では、デリバティブ取引について、ヘッジ対象の現物資産と一体で日々の損益を管理するとともに、ポジション等に係るリスク・リミットの設定やバリュー・アット・リスク（VaR：最大損失予想額）等の定期的な測定等により、厳正な市場リスク管理を行っております。

一方、取引所取引以外の店頭（相対）のデリバティブ取引における信用リスクについては、取引の相手先ごとに取引の上限枠を設定することなどにより管理を行っております。なお、平成16年度上半期末の店頭デリバティブ取引の信用リスク相当額（カレント・エクスポージャー方式による再構築コスト）は次表の通りです。

（単位：億円）

区 分	平成15年度上半期末		平成16年度上半期末		平成15年度末	
	契約金額・ 想定元本額	信用リスク 相当額	契約金額・ 想定元本額	信用リスク 相当額	契約金額・ 想定元本額	信用リスク 相当額
金利スワップ	6,478	70	3,644	44	4,621	50
通貨スワップ	31	2	-	-	-	-
為替予約	30,916	1,398	33,080	350	35,374	1,435
通貨オプション	2,991	56	1,006	9	3,900	56
株価指数オプション	538	17	-	-	-	-
債券オプション	942	5	330	0	-	-
クレジット・デリバティブ	10	1	10	1	10	1
合 計	41,909	1,552	38,071	405	43,905	1,543

資産運用におけるリスク管理に関しては、これらのデリバティブ取引も含めて、社内規程を策定し、リスク管理の基本方針・具体的取組内容を明確に定めております。デリバティブ取引に関するリスク管理は、担当所管において厳格に行うとともに、全体のリスクの状況については、リスク管理の専門組織である「リスク管理統括部」が一元的に把握し、「運用リスク管理委員会」にも定期的に報告しており、リスクのコントロールには細心の注意を払っております。

定量的情報に関する補足説明

当社のデリバティブ取引は、主に保有している現物資産に係る市場リスクのヘッジを目的としていることから、デリバティブ取引自体の想定元本額（契約額）や含み損益額に加えて、ヘッジ対象である現物資産の状況を勘案するとよりの確に状況が把握できます。

すなわち、デリバティブ取引の契約額等をヘッジ対象の現物資産の残高と合わせて見ることによって現物資産のうちどの程度がデリバティブ取引によってヘッジされているのか、また、デリバティブ取引の含み損益をヘッジ対象の現物資産の含み損益と合わせて見ることによってデリバティブ取引で市場の変化による運用収益の変動がどの程度回避されているのか、等がわかります。

(5) デリバティブ取引の時価情報(ヘッジ会計適用・非適用分の合算値)

差損益の内訳(ヘッジ会計適用分・非適用分の内訳)

(単位:百万円)

区 分	平成15年度上半期末						平成16年度上半期末					
	金利関連	通貨関連	株式関連	債券関連	その他	合計	金利関連	通貨関連	株式関連	債券関連	その他	合計
ヘッジ会計適用分	1,198	103,079	-	-	-	104,278	1,703	46,923	-	-	-	45,219
ヘッジ会計非適用分	2,354	5,976	781	7	25	7,568	881	3,945	193	112	18	3,352
合 計	3,553	109,056	781	7	25	111,846	2,584	50,869	193	112	18	48,572

区 分	平成15年度末					
	金利関連	通貨関連	株式関連	債券関連	その他	合計
ヘッジ会計適用分	1,332	100,245	-	-	-	101,578
ヘッジ会計非適用分	1,270	5,034	89	219	22	6,198
合 計	2,602	105,280	89	219	22	107,776

(注) 上表のうち損益計算書に計上されている金額は以下のとおりです。

平成15年度上半期末: ヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ適用分の差損益(通貨関連103,079百万円)及びヘッジ会計非適用分のうちヘッジ会計の中止に伴う繰延ヘッジ損益の未償却額を除いた差損益(7,568百万円)の合計110,648百万円

平成16年度上半期末: ヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ適用分の差損益(通貨関連 46,923百万円)及びヘッジ会計非適用分のうちヘッジ会計の中止に伴う繰延ヘッジ損益の未償却額を除いた差損益(3,352百万円)の合計 50,276百万円

平成15年度末: ヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ適用分の差損益(通貨関連100,245百万円)及びヘッジ会計非適用分のうちヘッジ会計の中止に伴う繰延ヘッジ損益の未償却額を除いた差損益(6,198百万円)の合計106,443百万円

時価情報

(a) 金利関連

(単位:百万円)

区 分	種 類	平成15年度上半期末					平成16年度上半期末					平成15年度末				
		契約額等		時価	差損益	うちヘッジ会計適用分	契約額等		時価	差損益	うちヘッジ会計適用分	契約額等		時価	差損益	うちヘッジ会計適用分
		うち1年超					うち1年超					うち1年超				
取引所	金利先物 売建	-	-	-	-	-	16,449	11,461	16,455	6	-	-	-	-	-	-
店頭	金利スワップ 固定金利受取/変動金利支払	445,456	403,178	3,927	3,927	1,198	282,682	184,997	2,925	2,925	1,703	244,708	217,537	3,073	3,073	1,332
	固定金利支払/変動金利受取	202,400	66,800	374	374	-	81,800	15,000	334	334	-	217,400	81,800	471	471	-
	合 計				3,553	1,198					2,584	1,703			2,602	1,332

(注) 差損益欄には、先物取引については契約額と時価との差額を記載し、スワップ取引については時価を記載しています。

(参考) 金利スワップ残存期間別残高

(単位:百万円、%)

区 分	1年以下	1年超	3年超	5年超	7年超	10年超	合計	
		3年以下	5年以下	7年以下	10年以下			
平成15年度上半期末	受取側固定スワップ想定元本	42,278	263,940	127,730	4,000	3,500	4,008	445,456
	平均受取固定金利	1.61	1.04	0.62	0.70	0.60	1.41	0.97
	平均支払変動金利	0.07	0.07	0.07	0.07	0.07	0.07	0.07
	支払側固定スワップ想定元本	135,600	66,800	-	-	-	-	202,400
	平均支払固定金利	0.25	0.36	-	-	-	-	0.29
	平均受取変動金利	0.07	0.07	-	-	-	-	0.07
合 計	177,878	330,740	127,730	4,000	3,500	4,008	647,856	
平成16年度上半期末	受取側固定スワップ想定元本	97,685	78,047	81,150	12,600	9,500	3,699	282,682
	平均受取固定金利	1.76	0.64	0.71	1.03	1.13	1.41	1.09
	平均支払変動金利	0.06	0.06	0.06	0.06	0.06	0.06	0.06
	支払側固定スワップ想定元本	66,800	-	15,000	-	-	-	81,800
	平均支払固定金利	0.36	-	0.62	-	-	-	0.41
	平均受取変動金利	0.06	-	0.06	-	-	-	0.06
合 計	164,485	78,047	96,150	12,600	9,500	3,699	364,482	
平成15年度末	受取側固定スワップ想定元本	27,171	135,850	66,933	7,400	3,500	3,853	244,708
	平均受取固定金利	0.99	1.53	0.53	0.83	0.60	1.41	1.16
	平均支払変動金利	0.06	0.06	0.07	0.06	0.07	0.06	0.06
	支払側固定スワップ想定元本	135,600	66,800	15,000	-	-	-	217,400
	平均支払固定金利	0.25	0.36	0.62	-	-	-	0.31
	平均受取変動金利	0.07	0.07	0.07	-	-	-	0.07
合 計	162,771	202,650	81,933	7,400	3,500	3,853	462,108	

(b) 通貨関連

(単位：百万円)

区分	種類	平成15年度上半期末				平成16年度上半期末				平成15年度末			
		契約額等	時価	差損益	うちヘッジ会計適用分	契約額等	時価	差損益	うちヘッジ会計適用分	契約額等	時価	差損益	うちヘッジ会計適用分
店頭	為替予約												
	売建	2,997,591	2,888,451	109,139	103,086	3,099,033	3,150,872	51,838	46,941	3,240,566	3,131,423	109,142	100,263
	(米ドル)	1,686,078	1,609,452	76,626	74,418	1,560,268	1,580,460	20,191	19,113	1,707,709	1,653,630	54,078	50,719
	(ユーロ)	1,123,021	1,093,610	29,411	26,032	1,261,959	1,288,571	26,612	23,294	1,313,602	1,262,582	51,020	46,691
	(英ポンド)	94,086	92,160	1,926	1,632	174,265	175,408	1,143	1,017	120,965	119,608	1,357	409
	(スウェーデンクローネ)	44,921	44,960	39	113	45,918	47,670	1,751	1,506	45,590	43,559	2,030	1,829
	(加ドル)	40,363	39,178	1,184	1,093	43,673	45,448	1,774	1,707	42,759	42,563	196	168
	(豪ドル)	9,099	9,068	31	23	12,502	12,868	366	301	9,930	9,472	458	445
	(スイスフラン)	-	-	-	-	224	224	0	-	-	-	-	-
	(香港ドル)	-	-	-	-	132	130	1	-	7	7	0	-
	(シンガポールドル)	0	0	0	-	36	36	0	-	-	-	-	-
	(デンマーククローネ)	-	-	-	-	30	30	0	-	-	-	-	-
	(ルウェーグロネ)	-	-	-	-	22	22	0	-	-	-	-	-
	(ノルランドズロフ)	19	19	0	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	買建	94,024	92,001	2,023	6	208,995	210,166	1,171	17	296,839	292,380	4,459	17
	(ユーロ)	39,239	38,301	938	6	133,206	134,129	922	17	94,340	92,176	2,163	2
	(米ドル)	31,481	30,562	919	-	39,549	39,637	87	0	151,567	150,699	868	15
	(英ポンド)	12,950	12,917	32	-	28,695	28,723	27	-	49,996	48,592	1,404	-
	(豪ドル)	5,416	5,375	40	-	3,841	3,874	33	-	520	505	14	-
	(スウェーデンクローネ)	1,028	1,054	26	-	1,481	1,541	60	-	234	227	6	-
	(スイスフラン)	-	-	-	-	1,225	1,234	8	-	59	59	0	-
	(ノルランドズロフ)	993	960	32	-	627	650	22	-	-	-	-	-
	(ルウェーグロネ)	-	-	-	-	337	345	7	-	4	4	0	-
	(加ドル)	2,894	2,808	85	-	29	30	0	-	87	85	2	-
	(香港ドル)	20	20	0	-	-	-	-	-	11	11	0	-
	(シンガポールドル)	-	-	-	-	-	-	-	-	8	8	0	-
(デンマーククローネ)	-	-	-	-	-	-	-	-	5	5	0	-	
(ノルランドズロフ)	-	-	-	-	-	-	-	-	2	2	0	-	
通貨オプション													
売建													
コール	6,459				-				-				
(74)		2	71	-	(-)				(-)				
(ユーロ)	6,459				-				-				
(74)		2	71	-	(-)				(-)				
買建													
コール	6,459				-				6,341				
(46)		1	45	-	(-)				(23)	0	23	-	
(ユーロ)	6,459				-				-				
(46)		1	45	-	(-)				(-)				
(米ドル)	-				-				6,341				
(-)					(-)				(23)	0	23	-	
プット	286,262				100,665				383,697				
(951)		2,865	1,914	-	(205)	3	202	-	(1,258)	1,878	620	-	
(米ドル)	180,714				64,075				247,599				
(581)		2,429	1,847	-	(130)	2	127	-	(912)	1,161	249	-	
(ユーロ)	105,548				36,589				136,097				
(369)		436	66	-	(74)	0	74	-	(346)	717	371	-	
合計				109,056	103,079			50,869	46,923			105,280	100,245

- (注) 1. 括弧内には、貸借対照表に計上したオプション料を記載しています。
 2. 各期末の為替相場は先物相場を使用しています。
 3. 為替予約等により決済時における円貨額が確定しており、貸借対照表において当該円貨額で表示されている外貨建金銭債権債務等に係る当該為替予約等は、開示の対象より除いています。
 4. 差損益欄には、先渡取引については契約額と時価との差額を記載し、オプション取引についてはオプション料と時価との差額を記載しています。
 5. 上表において、残存期間1年超の取引はありません。

(c) 株式関連

(単位：百万円)

区分	種類	平成15年度上半期末				平成16年度上半期末				平成15年度末			
		契約額等	時価	差損益	うちヘッジ会計適用分	契約額等	時価	差損益	うちヘッジ会計適用分	契約額等	時価	差損益	うちヘッジ会計適用分
取引所	円建株価指数先物												
	買建	1,925	1,909	16	-	9,684	9,503	181	-	1,917	1,993	75	-
店頭	外貨建株価指数先物												
	買建	1,095	1,064	30	-	1,469	1,456	12	-	1,451	1,466	14	-
店頭	株価指数オプション												
	売建												
	コール	29,038				-				-			
(727)		983	255	-	(-)				(-)				
買建													
プット	24,840				-				-				
(727)		249	478	-	(-)				(-)				
合計				781	-			193	-			89	-

- (注) 1. 括弧内には、貸借対照表に計上したオプション料を記載しています。
 2. 差損益欄には、先物取引については契約額と時価との差額を記載し、オプション取引についてはオプション料と時価との差額を記載しています。
 3. 上表において、残存期間1年超の取引はありません。

(d) 債券関連

(単位:百万円)

区分	種類	平成15年度上半期末				平成16年度上半期末				平成15年度末			
		契約額等	時価	差損益	うちVPP会計適用分	契約額等	時価	差損益	うちVPP会計適用分	契約額等	時価	差損益	うちVPP会計適用分
取引所	円建債券先物												
	売建	2,073	2,054	19	-	1,797	1,793	3	-	-	-	-	-
	買建	4,507	4,520	12	-	1,779	1,793	14	-	20,222	20,219	3	-
	外貨建債券先物												
店頭	売建	-	-	-	-	28,830	28,880	50	-	101,937	102,491	553	-
	買建	-	-	-	-	49,401	49,318	83	-	119,053	119,391	337	-
店頭	債券店頭オプション												
	売建												
	コール	4,220				-				-			
	(66)	(66)	65	0	-	(-)				(-)			
	プット	28,416				16,505				-			
	(410)	(410)	598	188	-	(55)	52	2	-	(-)			
	買建												
	コール	13,247				16,505				-			
	(149)	(149)	135	13	-	(3)	3	0	-	(-)			
	プット	4,220				-				-			
(80)	(80)	59	20	-	(-)				(-)				
外貨建債券店頭オプション													
買建													
コール	44,131				-				-				
(152)	(152)	335	182	-	(-)				(-)				
合計				7				112				219	

- (注) 1.括弧内には、貸借対照表に計上したオプション料を記載しています。
2.差損益欄には、先物取引については契約額と時価との差額を記載し、オプション取引についてはオプション料と時価との差額を記載しています。
3.上表において、残存期間1年超の取引はありません。

(e) その他

(単位:百万円)

区分	種類	平成15年度上半期末				平成16年度上半期末				平成15年度末			
		契約額等	時価	差損益	うちVPP会計適用分	契約額等	時価	差損益	うちVPP会計適用分	契約額等	時価	差損益	うちVPP会計適用分
店頭	外貨建てフォワード・スワップ オプション売建	1,000	25	25	-	1,000	18	18	-	1,000	22	22	-
合計		1,000	25	25	-	1,000	18	18	-	1,000	22	22	-

- (注) 1.差損益欄には、時価を記載しています。
2.上表は、全て残存期間1年超の取引です。