

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14年度上半期末		平成14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	1,963,381	141,729	1,391,351	130,967
一般勘定	10,545	7	314,016	20,249	550	-
特別勘定	1,283,756	166,568	1,649,365	121,480	1,390,801	130,967

(注) 1. 本表には、「金銭の信託」等の売買目的有価証券を含みます。
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みます。

(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	うち差益		
				うち差益	うち差損	
平成15年度上半期末	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
	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	-	-	-	-	-
	合 計	17,908,684	18,910,812	1,002,128	1,319,342	317,214
	平成14年度上半期末	公 社 債	9,356,935	9,502,722	145,787	201,939
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		-	-	-	-	-
満期保有目的の債券		-	-	-	-	-
公 社 債		-	-	-	-	-
責任準備金対応債券		895,454	949,690	54,235	54,235	-
公 社 債		895,454	949,690	54,235	54,235	-
子会社・関連会社株式		-	-	-	-	-
その他有価証券		16,436,856	17,031,533	594,676	1,112,473	517,797
公 社 債		8,796,458	9,125,957	329,499	332,513	3,013
株 式		3,826,766	3,857,371	30,604	469,980	439,375
外 国 証 券	3,510,173	3,763,890	253,716	308,743	55,026	
公 社 債	3,291,811	3,589,693	297,881	306,123	8,242	
株 式 等	218,361	174,197	44,164	2,619	46,784	
その他の証券	130,464	111,320	19,144	1,236	20,380	
買入金銭債権	72,993	72,993	-	-	-	
譲渡性預金	100,000	100,000	-	-	-	
その他	-	-	-	-	-	
合 計	17,332,311	17,981,223	648,912	1,166,709	517,797	
公 社 債	9,691,912	10,075,647	383,735	386,749	3,013	
株 式	3,826,766	3,857,371	30,604	469,980	439,375	
外 国 証 券	3,510,173	3,763,890	253,716	308,743	55,026	
公 社 債	3,291,811	3,589,693	297,881	306,123	8,242	
株 式 等	218,361	174,197	44,164	2,619	46,784	
その他の証券	130,464	111,320	19,144	1,236	20,380	
買入金銭債権	72,993	72,993	-	-	-	
譲渡性預金	100,000	100,000	-	-	-	
その他	-	-	-	-	-	

区 分	帳簿価額	時価	差損益	
			うち差益	うち差損
満期保有目的の債券	-	-	-	-
公 社 債	-	-	-	-
責任準備金対応債券	964,489	1,137,426	172,937	-
公 社 債	964,489	1,137,426	172,937	-
子会社・関連会社株式	-	-	-	-
その他の有価証券	17,037,602	17,359,310	321,707	573,403
公 社 債	8,687,485	9,013,766	326,280	2,175
株 式	3,277,500	3,126,121	151,379	489,123
外国証券	4,318,432	4,479,289	160,856	65,392
公 社 債	4,006,864	4,221,973	215,109	7,738
株 式 等	311,568	257,315	54,253	57,653
その他の証券	218,189	204,139	14,049	16,711
買入金銭債権	80,993	80,993	-	-
譲渡性預金	455,000	455,000	-	-
その他	-	-	-	-
合 計	18,002,092	18,496,737	494,644	573,403
公 社 債	9,651,975	10,151,193	499,217	2,175
株 式	3,277,500	3,126,121	151,379	489,123
外国証券	4,318,432	4,479,289	160,856	65,392
公 社 債	4,006,864	4,221,973	215,109	7,738
株 式 等	311,568	257,315	54,253	57,653
その他の証券	218,189	204,139	14,049	16,711
買入金銭債権	80,993	80,993	-	-
譲渡性預金	455,000	455,000	-	-
その他	-	-	-	-

平成14年度末

- (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14年度上半期末が4,933百万円、平成14年度末が1,802百万円です。

・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14年度上半期末	平成14年度末
満期保有目的の債券	-	-	-
非上場外国債券	-	-	-
その他	-	-	-
責任準備金対応債券	-	-	-
子会社・関連会社株式	27,929	31,612	29,568
非上場国内株式(店頭売買株式を除く)	19,715	19,346	19,778
非上場外国株式(店頭売買株式を除く)	8,214	12,266	9,790
その他の有価証券	234,089	208,494	251,088
非上場国内株式(店頭売買株式を除く)	75,180	68,057	106,143
非上場外国株式(店頭売買株式を除く)	134,291	128,758	135,910
非上場外国債券	0	0	0
その他	24,617	11,679	9,033
合 計	262,018	240,107	280,656

- (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	
				うち差益	うち差損
平成15年度上半期末	12,325	12,325	-	-	-
平成14年度上半期末	66,560	66,560	-	-	-
平成14年度末	2,352	2,352	-	-	-

(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。

・売買目的の金銭の信託

(単位：百万円)

区分	平成15年度上半期末		平成14年度上半期末		平成14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	10,545	7	61,627	20,363	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みます。

・満期保有目的の債券・責任準備金対応債券・その他有価証券の金銭の信託

(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	
				うち差益	うち差損
満期保有目的の債券	-	-	-	-	-
責任準備金対応債券	-	-	-	-	-
その他有価証券	-	-	-	-	-
区分	平成14年度上半期末				
	帳簿価額	時価	差損益	うち差益	
				うち差益	うち差損
満期保有目的の債券	-	-	-	-	-
責任準備金対応債券	-	-	-	-	-
その他有価証券	-	-	-	-	-
区分	平成14年度末				
	帳簿価額	時価	差損益	うち差益	
				うち差益	うち差損
満期保有目的の債券	-	-	-	-	-
責任準備金対応債券	-	-	-	-	-
その他有価証券	-	-	-	-	-

(注) 「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、帳簿価格および時価は平成15年度上半期末が1,779百万円、平成14年度上半期末が4,933百万円、平成14年度末が1,802百万円です。

(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 15 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、通貨スワップ取引
- ・株式関連：株価指数先物取引、株価指数オプション取引
- ・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 15 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、金利スワップ及び通貨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エーション・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15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14年度上半期末		平成14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	9,382	141	7,924	123
通 貨 ス ワ ッ プ	31	2	36	1	34	1
為 替 予 約	30,916	1,398	19,028	206	31,579	347
通 貨 オ ブ シ ョ ン	2,991	56	1,500	14	3,049	28
株 式 信 用 取 引	-	-	1	0	-	-
株 価 指 数 オ ブ シ ョ ン	538	17	-	-	-	-
債 券 オ ブ シ ョ ン	942	5	1,071	4	960	2
ク レ ジ ャ ッ ト ・ デ リ バ ッ テ ィ ブ	10	1	10	1	10	1
合 計	41,909	1,552	31,030	371	43,559	504

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「統合リスク管理部」が一元的に把握し、毎月の「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14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	2,997	46,890	-	-	-	43,893
ヘッジ会計非適用分	2,354	5,976	781	7	25	7,568	7,354	4,050	36	5,540	8	8,890
合 計	3,553	109,056	781	7	25	111,846	10,351	50,940	36	5,540	8	35,003

区 分	平成14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	2,746	53,282	-	-	-	50,536
ヘッジ会計非適用分	6,993	5,362	677	381	20	1,356
合 計	9,739	58,645	677	381	20	49,180

(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14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 46,890百万円)及びヘッジ会計非適用分の差損益(8,890百万円)の合計 38,000百万円
平成14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 53,282百万円)及びヘッジ会計非適用分の差損益(1,356百万円)の合計 51,926百万円

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14年度上半期末					平成14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	-	-	-	-	52,428	-	52,445	17	-	-	-	-	-	-	-
	買建	-	-	-	-	65,157	17,473	65,163	5	-	-	-	-	-	-	-
店 頭	海外金利先物															
	買建	-	-	-	-	180,553	99,726	182,128	1,575	-	169,383	140,171	170,491	1,108	-	-
	金利スワップ															
店 頭	固定金利受取/変動金利支払	445,456	403,178	3,927	3,927	1,198	479,316	408,447	10,361	10,361	2,997	449,559	382,590	9,365	9,365	2,746
	固定金利支払/変動金利受取	202,400	66,800	374	374	-	458,900	316,400	1,573	1,573	-	342,900	202,400	733	733	-
	合 計				3,553	1,198				10,351	2,997				9,739	2,746

(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14年度上半期末	受取側固定スワップ想定元本	70,869	150,271	253,176	5,000	-	-	479,316
	平均受取固定金利	1.15	1.65	0.68	0.71	-	-	1.05
	平均支払変動金利	0.08	0.08	0.08	0.08	-	-	0.08
	支払側固定スワップ想定元本	142,500	285,400	18,000	13,000	-	-	458,900
	平均支払固定金利	0.16	0.30	0.44	0.81	-	-	0.28
	平均受取変動金利	0.08	0.08	0.08	0.09	-	-	0.08
合 計		213,369	435,671	271,176	18,000	-	-	938,216
平成14年度末	受取側固定スワップ想定元本	66,969	132,460	245,130	5,000	-	-	449,559
	平均受取固定金利	1.21	1.66	0.59	0.71	-	-	1.00
	平均支払変動金利	0.08	0.07	0.07	0.08	-	-	0.07
	支払側固定スワップ想定元本	140,500	202,400	-	-	-	-	342,900
	平均支払固定金利	0.14	0.29	-	-	-	-	0.23
	平均受取変動金利	0.08	0.07	-	-	-	-	0.08
合 計		207,469	334,860	245,130	5,000	-	-	792,459

(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14年度上半期末				平成14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	1,664,980	1,714,964	49,983	46,890	2,691,573	2,749,410	57,837	53,282
	(米ドル)	1,686,078	1,609,452	76,626	74,418	760,539	775,449	14,910	13,978	1,376,953	1,403,836	26,883	25,233
	(ユーロ)	1,123,021	1,093,610	29,411	26,032	708,052	734,555	26,502	24,801	1,045,776	1,074,235	28,459	25,908
	(英ポンド)	94,086	92,160	1,926	1,632	90,204	95,499	5,294	4,938	155,731	155,789	57	82
	(スウェーデンクローネ)	44,921	44,960	39	113	58,943	61,331	2,388	2,312	62,560	64,001	1,441	1,327
	(加ドル)	40,363	39,178	1,184	1,093	39,265	40,015	749	721	35,118	36,005	886	859
	(豪ドル)	9,099	9,068	31	23	7,765	7,903	137	137	15,198	15,305	106	35
	(ポーランドズロチ)	19	19	0	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	(シンガポールドル)	0	0	0	-	38	38	0	-	20	20	0	-
	(スイフラン)	-	-	-	-	84	85	1	-	203	206	2	-
	(香港ドル)	-	-	-	-	68	67	0	-	4	4	0	-
	(デンマーククローネ)	-	-	-	-	12	12	0	-	5	5	0	-
	(ルウェーグロネ)	-	-	-	-	5	5	0	-	-	-	-	-
	買建	94,024	92,001	2,023	6	237,835	237,772	63	0	466,420	466,209	210	-
	(ユーロ)	39,239	38,301	938	6	111,786	111,280	505	0	169,037	168,601	436	-
	(米ドル)	31,481	30,562	919	-	90,439	90,661	222	-	221,980	222,258	278	-
	(英ポンド)	12,950	12,917	32	-	29,156	29,377	220	-	64,489	64,512	22	-
	(豪ドル)	5,416	5,375	40	-	2,064	2,044	19	-	10,912	10,837	74	-
	(加ドル)	2,894	2,808	85	-	110	110	0	-	-	-	-	-
	(スウェーデンクローネ)	1,028	1,054	26	-	4,062	4,080	17	-	-	-	-	-
	(ポーランドズロチ)	993	960	32	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	(香港ドル)	20	20	0	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	(スイフラン)	-	-	-	-	132	133	1	-	-	-	-	-
	(シンガポールドル)	-	-	-	-	50	50	0	-	-	-	-	-
	(ルウェーグロネ)	-	-	-	-	21	21	0	-	-	-	-	-
	(デンマーククローネ)	-	-	-	-	7	7	0	-	-	-	-	-
(ニュージーランドドル)	-	-	-	-	3	3	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				-				-				
(46)		1	45	-	(-)				(-)				
(ユーロ)	6,459				-				-				
(46)		1	45	-	(-)				(-)				
プット	286,262				150,024				304,979				
(951)		2,865	1,914	-	(1,000)	106	893	-	(693)	96	596	-	
(米ドル)	180,714				93,077				187,872				
(581)		2,429	1,847	-	(835)	100	735	-	(588)	94	493	-	
(ユーロ)	105,548				56,947				117,106				
(369)		436	66	-	(165)	6	158	-	(104)	1	103	-	
合計													
			109,056	103,079			50,940	46,890			58,645	53,282	

- (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14年度上半期末				平成14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	-	1,562	1,578	16	-	9,529	9,081	448	-
店頭	外貨建株価指数先物												
	買建	1,095	1,064	30	-	-	-	-	-	7,711	7,482	229	-
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	-			16	-			677	-

- (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。

(その他)国内株式信用売

(単位:百万円)

種 類	平成15年度上半期末				平成14年度上半期末				平成14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
国内株式信用売	-	-	-	-	193	173	20	-	-	-	-	-

(注) 1. 差損益欄には、契約額と時価との差額を記載しています。
2. 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14年度上半期末				平成14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	円建債券先物												
	売建	2,073	2,054	19	-	33,395	33,415	19	-	-	-	-	-
	買建	4,507	4,520	12	-	148,982	149,245	262	-	95,566	95,707	140	-
	外貨建債券先物												
	売建	-	-	-	-	60,786	62,665	1,878	-	44,268	44,153	114	-
	買建	-	-	-	-	358,579	365,110	6,530	-	30,397	30,514	116	-
	債券先物オプション												
	買建	-	-	-	-	9,700	-	-	-	-	-	-	-
	ブット	(-)	-	-	-	(23)	15	7	-	(-)	-	-	-
	外貨建債券先物オプション												
売建	-	-	-	-	48,119	-	-	-	-	-	-	-	
ブット	(-)	-	-	-	(464)	239	225	-	(-)	-	-	-	
買建	-	-	-	-	60,763	-	-	-	-	-	-	-	
コール	(-)	-	-	-	(621)	1,052	430	-	(-)	-	-	-	
店 頭	債券店頭オプション												
	売建	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	コール	4,220	-	-	-	27,610	-	-	-	11,014	-	-	-
	ブット	(66)	65	0	-	(35)	74	39	-	(38)	36	1	-
	買建	28,416	598	188	-	23,396	127	12	-	37,024	81	38	-
	コール	(410)	-	-	-	(139)	-	-	-	(120)	-	-	-
	ブット	13,247	135	13	-	28,520	120	6	-	37,024	47	28	-
	買建	(149)	-	-	-	(126)	-	-	-	(76)	-	-	-
	ブット	4,220	59	20	-	27,610	154	30	-	11,014	64	1	-
	コール	(80)	-	-	-	(123)	-	-	-	(65)	-	-	-
外貨建債券店頭オプション													
買建	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
コール	44,131	335	182	-	(-)	-	-	-	(-)	-	-	-	
合 計			7	-			5,540	-			381	-	

(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14年度上半期末				平成14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	クレジット・フォルト・スワップ プロテクション売建	1,000	25	25	-	1,000	8	8	-	1,000	20	20	-
合 計		1,000	25	25	-	1,000	8	8	-	1,000	20	20	-

(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。