

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16年度上半期末		平成17年度上半期末		平成16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	1,229,985	24,951	1,424,293	118,347	1,264,596	9,649
一般勘定	1,550	-	5,346	592	4,666	100
特別勘定	1,228,435	24,951	1,418,946	117,755	1,259,929	9,548

- (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」には期初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	うち差益		
				うち差益	うち差損	
平成16年度上半期末	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 等	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
平成17年度上半期末	公 社 債	9,408,121	9,576,832	168,711	197,364	28,653
	株 式 等	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	-	-	-	-	-
	満期保有目的の債券	179,631	175,471	4,160	760	4,920
	公 社 債	121,748	119,729	2,018	760	2,778
	外 国 公 社 債	57,883	55,741	2,141	-	2,141
	責任準備金対応債券	3,896,716	3,978,565	81,848	96,978	15,130
	公 社 債	3,896,716	3,978,565	81,848	96,978	15,130
	子会社・関連会社株式	-	-	-	-	-
	その他の有価証券	14,632,977	16,727,824	2,094,846	2,209,381	114,534
	公 社 債	5,604,359	5,683,271	78,912	88,117	9,204
株 式 等	2,920,432	4,645,075	1,724,643	1,800,703	76,060	
外 国 証 券	5,721,568	6,001,666	280,098	308,838	28,740	
公 社 債	5,319,301	5,544,298	224,997	250,999	26,002	
株 式 等	402,266	457,367	55,100	57,838	2,737	
その他の証券	219,621	230,814	11,192	11,721	529	
買入金銭債権	101,995	101,995	-	-	-	
譲渡性預金	65,000	65,000	-	-	-	
その他の	-	-	-	-	-	
合 計	18,709,325	20,881,860	2,172,535	2,307,120	134,585	
平成17年度上半期末	公 社 債	9,622,823	9,781,566	158,742	185,856	27,113
	株 式 等	2,920,432	4,645,075	1,724,643	1,800,703	76,060
	外 国 証 券	5,779,451	6,057,408	277,956	308,838	30,882
	公 社 債	5,377,185	5,600,040	222,855	250,999	28,144
	株 式 等	402,266	457,367	55,100	57,838	2,737
	その他の証券	219,621	230,814	11,192	11,721	529
	買入金銭債権	101,995	101,995	-	-	-
	譲渡性預金	65,000	65,000	-	-	-
	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
満期保有目的の債券	176,460	172,761	3,699	1,329	5,028
公 社 債	121,469	120,582	886	1,329	2,215
外 国 公 社 債	54,990	52,178	2,812	-	2,812
責任準備金対応債券	3,648,697	3,778,289	129,592	137,344	7,752
公 社 債	3,648,697	3,778,289	129,592	137,344	7,752
子会社・関連会社株式	-	-	-	-	-
その他の有価証券	14,659,063	16,246,810	1,587,747	1,757,575	169,827
公 社 債	5,792,130	5,926,807	134,677	136,606	1,929
株 式	2,923,025	4,196,548	1,273,523	1,387,462	113,939
外 国 証 券	5,541,707	5,718,540	176,832	225,206	48,373
公 社 債	5,141,797	5,294,663	152,865	194,431	41,565
株 式 等	399,909	423,876	23,967	30,774	6,807
その他の証券	219,202	221,917	2,714	8,299	5,585
買入金銭債権	122,997	122,997	-	-	-
譲渡性預金	60,000	60,000	-	-	-
その他の	-	-	-	-	-
合 計	18,484,221	20,197,861	1,713,640	1,896,248	182,608
公 社 債	9,562,297	9,825,680	263,382	275,280	11,898
株 式	2,923,025	4,196,548	1,273,523	1,387,462	113,939
外 国 証 券	5,596,697	5,770,718	174,020	225,206	51,185
公 社 債	5,196,788	5,346,841	150,053	194,431	44,377
株 式 等	399,909	423,876	23,967	30,774	6,807
その他の証券	219,202	221,917	2,714	8,299	5,585
買入金銭債権	122,997	122,997	-	-	-
譲渡性預金	60,000	60,000	-	-	-
その他の	-	-	-	-	-

(注) 1. 本表には、C D (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16年度上半期末が1,481百万円、平成17年度上半期末が1,564百万円、平成16年度末が1,441百万円です。

・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16年度上半期末	平成17年度上半期末	平成16年度末
満期保有目的の債券	-	-	-
非上場外国公社債	-	-	-
その他の	-	-	-
責任準備金対応債券	-	-	-
子会社・関連会社株式	28,931	29,049	28,929
非上場国内株式(店頭売買株式を除く)	20,717	20,835	20,715
非上場外国株式(店頭売買株式を除く)	8,214	8,214	8,214
その他の有価証券	358,488	515,079	380,932
非上場国内株式(店頭売買株式を除く)	80,990	69,352	69,751
非上場外国株式(店頭売買株式を除く)	126,546	221,563	126,555
非上場外国公社債	0	0	0
その他の	150,950	224,162	184,626
合 計	387,419	544,128	409,862

(注) 本表には、C D (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16年度上半期末	3,031	3,031	-	-	-
平成17年度上半期末	6,911	6,911	592	785	193
平成16年度末	6,108	6,108	100	173	73

(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まれています。

・運用目的の金銭の信託

(単位：百万円)

区 分	平成16年度上半期末		平成17年度上半期末		平成16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	1,550	-	5,346	592	4,666	100

(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16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17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	1,564	1,564	-	-	-

区 分	平成16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	1,441	1,441	-	-	-

(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 17 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、債券先渡契約取引
- ・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 17 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、通貨オプション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17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16年度上半期末		平成17年度上半期末		平成16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	3,644	44	2,286	25	3,302	38
為替予約	33,080	350	35,778	432	32,968	362
通貨オプション	1,006	9	8,070	164	3,061	27
債券先渡契約	-	-	847	1	811	0
債券オプション	330	0	124	0	41	0
クレジット・デリバティブ	10	1	10	1	10	1
合 計	38,071	405	47,116	626	40,196	430

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16年度上半期末						平成17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	1,703	46,923	-	-	-	45,219	336	72,914	-	-	-	72,577
ヘッジ会計非適用分	881	3,945	193	112	18	3,352	95	4,843	329	28	11	4,436
合 計	2,584	50,869	193	112	18	48,572	431	77,757	329	28	11	77,013

区 分	平成16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	2,020	83,787	-	-	-	81,766
ヘッジ会計非適用分	488	2,769	37	67	15	2,235
合 計	2,509	86,556	37	67	15	84,002

(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17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 72,914百万円)及びヘッジ会計非適用分の差損益(4,436百万円)の合計 77,350百万円

平成16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 83,787百万円)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(2,235百万円)の合計 86,023百万円

時価情報

(a) 金利関連

(単位:百万円)

区 分	種 類	平成16年度上半期末					平成17年度上半期末					平成16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	282,682	184,997	2,925	2,925	1,703	226,614	178,594	426	426	336	263,455	152,905	2,608	2,608	2,020
	固定金利支払/変動金利受取	81,800	15,000	334	334	-	2,000	2,000	4	4	-	66,800	-	98	98	-
	合 計				2,584	1,703			431	336				2,509	2,020	

(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	282,682
	平均受取固定金利	1.76	0.64	0.71	1.03	1.13	1.09
	平均支払変動金利	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	364,482
平成17年度上半期末	受取側固定スワップ想定元本	48,020	46,263	73,340	31,900	23,700	226,614
	平均受取固定金利	0.78	0.45	0.75	1.10	1.03	0.78
	平均支払変動金利	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	-	-	2,000	-	-	2,000
	平均支払固定金利	-	-	0.07	-	-	0.07
	平均受取変動金利	-	-	0.59	-	-	0.59
	合 計	48,020	46,263	75,340	31,900	23,700	228,614
平成16年度末	受取側固定スワップ想定元本	110,550	52,600	71,660	20,900	4,200	263,455
	平均受取固定金利	1.77	0.39	0.76	1.13	0.76	1.15
	平均支払変動金利	0.06	0.06	0.06	0.07	0.07	0.06
	支払側固定スワップ想定元本	66,800	-	-	-	-	66,800
	平均支払固定金利	0.36	-	-	-	-	0.36
	平均受取変動金利	0.07	-	-	-	-	0.07
	合 計	177,350	52,600	71,660	20,900	4,200	330,255

(b) 通貨関連

(単位: 百万円)

区分	種類	平成16年度上半期末				平成17年度上半期末				平成16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	3,099,033	3,150,872	51,838	46,941	3,133,347	3,204,190	70,842	68,460	3,088,276	3,174,613	86,337	83,796
	(米ドル)	1,560,268	1,580,460	20,191	19,113	1,692,521	1,736,645	44,124	41,148	1,611,082	1,652,837	41,754	39,908
	(ユーロ)	1,261,959	1,288,571	26,612	23,294	1,032,129	1,050,756	18,626	19,218	1,227,054	1,259,603	32,549	32,286
	(英ポンド)	174,265	175,408	1,143	1,017	296,699	301,640	4,941	5,387	140,078	148,424	8,346	8,088
	(加ドル)	43,673	45,448	1,774	1,707	60,386	62,317	1,931	1,717	53,255	55,604	2,349	2,200
	(スウェーデンクローネ)	45,918	47,670	1,751	1,506	42,139	43,230	1,091	867	44,317	45,571	1,253	1,227
	(豪ドル)	12,502	12,868	366	301	9,150	9,277	127	120	9,123	9,207	84	83
	(香港ドル)	132	130	1	-	321	321	0	-	-	-	-	-
	(スイフラン)	224	224	0	-	-	-	-	-	118	118	0	-
	(シンガポールドル)	36	36	0	-	-	-	-	-	28	28	0	-
	(デンマーククローネ)	30	30	0	-	-	-	-	-	15	15	0	-
	(ルウェーグ)	22	22	0	-	-	-	-	-	2,634	2,624	9	-
	(ノルウェーランドス)	-	-	-	-	-	-	-	-	566	575	8	-
	(ニュージーランドドル)	-	-	-	-	-	-	-	-	1	1	0	-
	買建	208,995	210,166	1,171	17	444,539	443,825	713	1,359	208,601	208,686	85	8
	(米ドル)	39,549	39,637	87	0	238,755	240,899	2,144	1,359	86,279	86,818	538	8
	(ユーロ)	133,206	134,129	922	17	146,247	143,693	2,554	-	106,323	105,702	621	0
	(英ポンド)	28,695	28,723	27	-	48,455	47,578	877	-	3,816	3,867	51	-
	(中国元)	-	-	-	-	5,153	5,596	442	-	5,125	5,188	62	-
	(ノルウェーランドス)	627	650	22	-	2,094	2,186	91	-	1,578	1,598	20	-
	(スイフラン)	1,225	1,234	8	-	1,717	1,728	11	-	1,490	1,505	14	-
	(シンガポールドル)	-	-	-	-	605	615	10	-	634	644	10	-
	(香港ドル)	-	-	-	-	492	496	4	-	93	95	2	-
	(ルウェーグ)	337	345	7	-	489	494	5	-	3,017	3,021	3	-
	(スウェーデンクローネ)	1,481	1,541	60	-	368	368	0	-	73	73	0	-
	(加ドル)	29	30	0	-	84	90	5	-	45	45	0	-
(豪ドル)	3,841	3,874	33	-	74	77	2	-	122	125	2	-	
通貨オプション													
売建													
コール	-	-	-	-	306,025	-	-	-	-	-	-	-	
(米ドル)	(-)	-	-	-	(4,022)	6,994	2,972	2,972	(-)	-	-	-	
買建													
コール	-	-	-	-	(4,022)	6,994	2,972	2,972	(-)	-	-	-	
(米ドル)	(-)	-	-	-	3,395	(5)	3	1	(-)	-	-	-	
プット	100,665	-	-	-	497,583	-	-	-	306,123	-	-	-	
(米ドル)	(205)	3	202	-	(5,002)	1,774	3,227	2,840	(309)	4	305	-	
(ユーロ)	64,075	2	127	-	336,133	1,774	2,866	2,840	196,416	2	232	-	
(ユーロ)	(130)	2	127	-	(4,640)	1,774	2,866	2,840	(234)	2	232	-	
(ユーロ)	36,589	0	74	-	161,450	0	361	-	109,707	2	73	-	
(ユーロ)	(74)	0	74	-	(362)	0	361	-	(75)	2	73	-	
合計			50,869	46,923			77,757	72,914			86,556	83,787	

- (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16年度上半期末				平成17年度上半期末				平成16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	9,684	9,503	181	-	4,311	4,633	322	-	5,771	5,772	1	-
	外貨建株価指数先物												
買建	1,469	1,456	12	-	1,748	1,755	6	-	3,119	3,080	39	-	
合計			193	-			329	-			37	-	

- (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16年度上半期末				平成17年度上半期末				平成16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	1,797	1,793	3	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	買建	1,779	1,793	14	-	13,819	13,765	54	-	2,201	2,230	29	-
	外貨建債券先物												
	売建	28,830	28,880	50	-	47,091	46,532	559	-	60,748	60,533	215	-
	買建	49,401	49,318	83	-	46,079	45,669	409	-	23,016	22,951	65	-
店頭	外貨建債券先渡契約												
	売建	-	-	-	-	22,973	22,814	158	-	21,826	21,736	90	-
	買建	-	-	-	-	61,783	61,512	270	-	59,333	59,125	207	-
	債券店頭オプション												
店頭	売建												
	コール	-	-	-	-	1,009	-	-	-	-	-	-	-
	プット	(-)	-	-	-	(4)	4	0	-	(-)	-	-	-
	買建	16,505	52	2	-	5,209	19	9	-	2,099	2	5	-
	コール	(55)				(10)				(7)			
	プット	16,505	3	0	-	5,209	-	1	-	2,099	1	0	-
店頭	買建	(3)				(1)				(1)			
	コール	-				1,009				-			
	プット	(-)				(5)	4	0	-	(-)			
合計				112	-			28	-			67	-

- (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、先物取引および先渡契約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16年度上半期末				平成17年度上半期末				平成16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 オプション売建												
		1,000	18	18	-	1,000	11	11	-	1,000	15	15	-
合計		1,000	18	18	-	1,000	11	11	-	1,000	15	15	-

- (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。