

## 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17年度上半期末		平成18年度上半期末		平成17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	1,424,293	118,347	1,620,544	46,916	1,633,459	223,494
一般勘定	5,346	592	29,593	2,429	32,207	1,889
特別勘定	1,418,946	117,755	1,590,951	44,486	1,601,251	221,605

(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	うち差益		
				うち差益	うち差損	
平成17年度上半期末	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	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	-	-	-	-	-
	合 計	18,709,325	20,881,860	2,172,535	2,307,120	134,585
	公 社 債	9,622,823	9,781,566	158,742	185,856	27,113
	株 式	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	-	-	-	-	-	
平成18年度上半期末	満期保有目的の債券	182,436	175,291	7,145	357	7,502
	公 社 債	122,304	118,274	4,030	357	4,387
	外 国 公 社 債	60,131	57,016	3,115	-	3,115
	責任準備金対応債券	4,707,447	4,757,090	49,643	60,958	11,315
	公 社 債	4,707,447	4,757,090	49,643	60,958	11,315
	子会社・関連会社株式	-	-	-	-	-
	その他有価証券	14,835,807	17,947,310	3,111,503	3,170,302	58,799
	公 社 債	6,304,486	6,362,129	57,643	73,108	15,465
	株 式	2,959,906	5,638,719	2,678,813	2,703,985	25,172
	外 国 証 券	5,002,609	5,355,632	353,022	371,119	18,097
	公 社 債	4,469,940	4,709,777	239,837	256,273	16,435
	株 式 等	532,669	645,855	113,185	114,846	1,661
	その他の証券	230,843	252,866	22,023	22,088	64
	買入金銭債権	172,962	172,962	-	-	-
	譲渡性預金	165,000	165,000	-	-	-
	その他	-	-	-	-	-
	合 計	19,725,691	22,879,693	3,154,001	3,231,618	77,617
	公 社 債	11,134,238	11,237,495	103,256	134,425	31,168
	株 式	2,959,906	5,638,719	2,678,813	2,703,985	25,172
	外 国 証 券	5,062,741	5,412,649	349,907	371,119	21,212
公 社 債	4,530,072	4,766,794	236,722	256,273	19,551	
株 式 等	532,669	645,855	113,185	114,846	1,661	
その他の証券	230,843	252,866	22,023	22,088	64	
買入金銭債権	172,962	172,962	-	-	-	
譲渡性預金	165,000	165,000	-	-	-	
その他	-	-	-	-	-	

区 分	帳簿価額	時価	差損益			
			うち差益	うち差損		
平成17年度末	満期保有目的の債券	182,018	173,223	8,795	79	8,875
	公 社 債	122,026	117,446	4,580	79	4,660
	外 国 公 社 債	59,992	55,776	4,215	-	4,215
	責任準備金対応債券	4,229,463	4,273,708	44,245	59,538	15,293
	公 社 債	4,229,463	4,273,708	44,245	59,538	15,293
	子会社・関連会社株式	-	-	-	-	-
	その他の有価証券	14,755,042	17,854,410	3,099,367	3,208,542	109,174
	公 社 債	6,136,573	6,134,832	1,740	44,043	45,784
	株 式	2,865,209	5,695,211	2,830,002	2,840,359	10,356
	外 国 証 券	5,205,085	5,451,941	246,856	299,733	52,877
	公 社 債	4,745,547	4,898,788	153,241	204,169	50,928
	株 式 等	459,538	553,153	93,614	95,564	1,949
	その他の証券	248,182	272,431	24,249	24,405	155
	買入金銭債権	169,992	169,992	-	-	-
	譲渡性預金	130,000	130,000	-	-	-
	その他	-	-	-	-	-
	合 計	19,166,524	22,301,342	3,134,817	3,268,161	133,343
	公 社 債	10,488,062	10,525,987	37,924	103,662	65,737
	株 式	2,865,209	5,695,211	2,830,002	2,840,359	10,356
	外 国 証 券	5,265,077	5,507,718	242,640	299,733	57,093
	公 社 債	4,805,539	4,954,565	149,025	204,169	55,144
	株 式 等	459,538	553,153	93,614	95,564	1,949
	その他の証券	248,182	272,431	24,249	24,405	155
買入金銭債権	169,992	169,992	-	-	-	
譲渡性預金	130,000	130,000	-	-	-	
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17年度上半期末が1,564百万円、平成18年度上半期末が1,689百万円、平成17年度末が1,647百万円です。

・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17年度上半期末	平成18年度上半期末	平成17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	29,049	30,152	26,154
非上場国内株式(店頭売買株式を除く)	20,835	19,384	19,334
非上場外国株式(店頭売買株式を除く)	8,214	6,820	6,820
その他	-	3,948	-
その他の有価証券	515,079	761,234	661,661
非上場国内株式(店頭売買株式を除く)	69,352	69,332	69,953
非上場外国株式(店頭売買株式を除く)	221,563	338,893	309,779
非上場外国公社債	0	0	0
その他	224,162	353,008	281,928
合 計	544,128	791,387	687,815

(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)

区 分	貸借対照表計上額	時価	差損益		
			うち差益	うち差損	
平成17年度上半期末	6,911	6,911	592	785	193
平成18年度上半期末	31,282	31,282	2,429	1,152	3,582
平成17年度末	33,854	33,854	1,889	2,114	224

(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ります。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17年度上半期末		平成18年度上半期末		平成17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	5,346	592	29,593	2,429	32,207	1,889

(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18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	1,689	1,689	-	-	-
区 分	平成17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	1,647	1,647	-	-	-

(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 18 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 18 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
- ・外貨預金をヘッジ対象、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・リミットの設定やトラッキング・エラー、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18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17年度上半期末		平成18年度上半期末		平成17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	2,286	25	2,312	22	2,205	17
為替予約	35,778	432	29,149	330	32,843	399
通貨オプション	8,070	164	6,187	143	-	-
債券先渡契約	847	1	514	1	633	0
債券オプション	124	0	388	0	469	0
クレジット・デリバティブ	10	1	90	0	90	0
合 計	47,116	626	38,641	499	36,241	418

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」等に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17年度上半期末						平成18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	336	72,914	-	-	-	72,577	1,062	33,497	-	-	-	34,559
ヘッジ会計非適用分	95	4,843	329	28	11	4,436	2	12,265	16	283	4	11,995
合 計	431	77,757	329	28	11	77,013	1,064	45,763	16	283	4	46,555

区 分	平成17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	3,681	29,507	-	-	-	33,189
ヘッジ会計非適用分	28	3,054	289	51	13	2,831
合 計	3,710	32,562	289	51	13	36,021

(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18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 33,497百万円)及びヘッジ会計非適用分の差損益(11,995百万円)の合計 45,493百万円  
 平成17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 29,507百万円)及びヘッジ会計非適用分の差損益(2,831百万円)の合計 32,339百万円

時価情報

(a) 金利関連

(単位:百万円)

区 分	種 類	平成17年度上半期末					平成18年度上半期末					平成17年度末				
		契約額等	うち1年超	時価	差損益	うちヘッジ会計適用分	契約額等	うち1年超	時価	差損益	うちヘッジ会計適用分	契約額等	うち1年超	時価	差損益	うちヘッジ会計適用分
取 引 所	金利先物 売建	-	-	-	-	-	4,975	-	4,974	1	-	4,978	-	4,976	2	-
	買建	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	4,963	4	-
店 頭	金利スワップ 固定金利受取/変動金利支払	226,614	178,594	426	426	336	226,228	195,048	1,054	1,054	1,062	220,557	193,657	3,708	3,708	3,681
	固定金利支払/変動金利受取	2,000	2,000	4	4	-	5,000	5,000	11	11	-	-	-	-	-	-
合 計					431	336				1,064	1,062			3,710	3,681	

(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	3,391	226,614
	平均受取固定金利	0.78	0.45	0.75	1.10	1.03	1.41	0.78
	平均支払変動金利	0.06	0.06	0.06	0.06	0.06	0.07	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	3,391	228,614
平成18年度上半期末	受取側固定スワップ想定元本	31,180	73,405	43,670	53,200	24,773	-	226,228
	平均受取固定金利	0.43	0.74	0.83	1.14	1.66	-	0.91
	平均支払変動金利	0.41	0.42	0.42	0.39	0.44	-	0.41
	支払側固定スワップ想定元本	-	5,000	-	-	-	-	5,000
	平均支払固定金利	-	0.46	-	-	-	-	0.46
	平均受取変動金利	-	0.86	-	-	-	-	0.86
合 計		31,180	78,405	43,670	53,200	24,773	-	231,228
平成17年度末	受取側固定スワップ想定元本	26,900	55,860	67,010	33,000	34,550	3,237	220,557
	平均受取固定金利	0.44	0.54	0.82	1.14	1.18	1.41	0.81
	平均支払変動金利	0.09	0.10	0.10	0.10	0.08	0.09	0.10
	支払側固定スワップ想定元本	-	-	-	-	-	-	-
	平均支払固定金利	-	-	-	-	-	-	-
	平均受取変動金利	-	-	-	-	-	-	-
合 計		26,900	55,860	67,010	33,000	34,550	3,237	220,557

## (b) 通貨関連

(単位: 百万円)

区分	種類	平成17年度上半期末				平成18年度上半期末				平成17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	3,133,347	3,204,190	70,842	68,460	2,398,671	2,435,240	36,568	33,519	2,849,162	2,884,496	35,333	29,510	
	(米ドル)	1,692,521	1,736,645	44,124	41,148	1,311,329	1,321,981	10,652	8,475	1,423,374	1,423,621	247	262	
	(ユーロ)	1,032,129	1,050,756	18,626	19,218	834,754	850,358	15,603	15,322	1,069,623	1,100,765	31,141	25,921	
	(英ポンド)	296,699	301,640	4,941	5,387	175,260	184,436	9,175	8,865	229,504	234,017	4,512	4,158	
	(加ドル)	60,386	62,317	1,931	1,717	37,574	38,121	547	467	61,890	61,098	792	807	
	(スウェーデン)	42,139	43,230	1,091	867	28,718	29,344	626	427	31,142	31,956	814	730	
	(豪ドル)	9,150	9,277	127	120	9,232	9,190	42	38	24,452	23,829	622	230	
	(スイス)	-	-	-	-	1,802	1,807	5	-	5,690	5,709	19	-	
	(香港ドル)	321	321	0	-	-	-	-	-	129	129	0	-	
	(ノルウェー)	-	-	-	-	-	-	-	-	3,355	3,368	13	-	
	買建	444,539	443,825	713	1,359	516,280	518,142	1,861	21	435,141	437,913	2,771	2	
	(米ドル)	238,755	240,899	2,144	1,359	294,648	295,640	991	-	189,177	189,180	2	0	
	(ユーロ)	146,247	143,693	2,554	-	189,329	189,100	228	21	179,402	181,680	2,278	2	
	(英ポンド)	48,455	47,578	877	-	13,040	13,248	208	0	31,680	31,702	22	-	
	(中国元)	5,153	5,596	442	-	5,160	5,972	811	-	5,174	5,852	677	-	
	(スイス)	1,717	1,728	11	-	3,992	4,014	21	-	7,196	7,345	148	-	
	(豪ドル)	74	77	2	-	3,720	3,717	2	-	15,445	15,149	296	-	
	(加ドル)	84	90	5	-	2,751	2,753	2	0	138	137	1	-	
	(ノルウェー)	2,094	2,186	91	-	1,648	1,690	41	-	5,258	5,176	82	-	
	(シンガポール)	605	615	10	-	826	841	14	-	690	698	7	-	
	(ルーマニア)	489	494	5	-	534	528	5	-	502	518	16	-	
	(スウェーデン)	368	368	0	-	369	374	5	-	354	351	2	-	
	(香港ドル)	492	496	4	-	253	253	0	-	121	120	0	-	
	(デンマーク)	-	-	-	-	5	5	0	-	-	-	-	-	
	通貨オプション													
	売建													
	コール	306,025				309,369				-				
	(米ドル)	(4,022)	6,994	2,972	2,972	(4,404)	7,908	3,504	-	(-)	-	-	-	
	買建	306,025				309,369				-				
	(米ドル)	(4,022)	6,994	2,972	2,972	(4,404)	7,908	3,504	-	(-)	-	-	-	
	コール	3,395				-				-				
	(米ドル)	(5)	3	1	-	(-)	-	-	-	(-)	-	-	-	
	プット	497,583				309,369				-				
	(米ドル)	(5,002)	1,774	3,227	2,840	(8,144)	592	7,552	-	(-)	-	-	-	
	(ユーロ)	336,133				309,369				-				
	(ユーロ)	(4,640)	1,774	2,866	2,840	(8,144)	592	7,552	-	(-)	-	-	-	
	(ユーロ)	161,450				-				-				
(ユーロ)	(362)	0	361	-	(-)	-	-	-	(-)	-	-	-		
合計			77,757	72,914			45,763	33,497			32,562	29,507		

- (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17年度上半期末				平成18年度上半期末				平成17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	4,311	4,633	322	-	34,898	34,835	63	-	10,862	11,142	279	-
	外貨建株価指数先物												
買建	1,748	1,755	6	-	2,245	2,292	46	-	1,030	1,040	10	-	
合計			329	-			16	-			289	-	

- (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17年度上半期末				平成18年度上半期末				平成17年度末			
		契約額等	時価	差損益	うち1年超 うち1年超 うち1年超 うち1年超	契約額等	時価	差損益	うち1年超 うち1年超 うち1年超 うち1年超	契約額等	時価	差損益	うち1年超 うち1年超 うち1年超 うち1年超
取引	円建債券先物 買建	13,819	13,765	54	-	14,948	14,962	14	-	7,947	7,874	73	-
	外貨建債券先物 売建	47,091	46,532	559	-	118,606	118,989	383	-	103,535	103,211	323	-
	買建	46,079	45,669	409	-	150,868	151,362	494	-	30,352	30,259	92	-
所	円建債券先物オプション 買建	-	-	-	-	2,720	-	-	-	-	-	-	-
	コール	(-)	-	-	-	(3)	3	0	-	(-)	-	-	-
店頭	外貨建債券先渡契約 売建	22,973	22,814	158	-	-	-	-	-	11,761	11,745	16	-
	買建	61,783	61,512	270	-	51,439	51,594	155	-	51,588	51,504	83	-
	債券店頭オプション 売建 コール	1,009 (4)	4	0	-	2,552 (3)	1	2	-	(-)	-	-	-
店頭	ブット	5,209 (10)	19	9	-	14,301 (125)	106	18	-	23,493 (228)	347	118	-
	買建 コール	5,209 (1)	-	1	-	19,395 (27)	7	19	-	23,493 (29)	5	24	-
	ブット	1,009 (5)	4	0	-	2,552 (4)	5	1	-	(-)	-	-	-
合計				28	-			283	-			51	-

- (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17年度上半期末				平成18年度上半期末				平成17年度末						
		契約額等	うち1年超	時価	差損益	契約額等	うち1年超	時価	差損益	契約額等	うち1年超	時価	差損益			
														うち1年超	うち1年超	うち1年超
店頭	クレジット・デフォルト・スワップ オプション売建	1,000	1,000	11	11	-	3,000	2,000	5	5	-	5,000	4,000	9	9	-
	オプション買建	-	-	-	-	-	6,000	6,000	0	0	-	4,000	4,000	4	4	-
	合計	1,000	1,000	11	11	-	9,000	8,000	4	4	-	9,000	8,000	13	13	-

- (注) 差損益欄には、時価を記載しています。