

## 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18年度上半期末		平成19年度上半期末		平成18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	1,620,544	46,916	1,813,722	52,206	1,722,316	2,950
一般勘定	29,593	2,429	178,926	1,511	30,803	1,632
特別勘定	1,590,951	44,486	1,634,796	50,694	1,691,512	1,318

(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	-	-	-	-	-
	その他の有価証券	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	-	-	-	-	-	
平成19年度上半期末	満期保有目的の債券	181,576	176,411	5,165	320	5,485
	公 社 債	122,861	119,643	3,218	320	3,538
	外 国 公 社 債	58,714	56,767	1,947	-	1,947
	責任準備金対応債券	4,909,618	4,966,390	56,772	70,931	14,159
	公 社 債	4,909,618	4,966,390	56,772	70,931	14,159
	子会社・関連会社株式	-	-	-	-	-
	その他の有価証券	15,239,107	18,296,382	3,057,275	3,183,825	126,549
	公 社 債	6,573,473	6,662,863	89,390	98,767	9,377
	株 式	2,992,494	5,549,798	2,557,303	2,619,333	62,030
	外 国 証 券	5,283,633	5,670,797	387,163	441,179	54,015
	公 社 債	4,675,217	4,830,545	155,328	206,211	50,883
	株 式 等	608,416	840,251	231,835	234,967	3,132
	その他の証券	203,571	226,989	23,417	24,543	1,126
	買入金銭債権	155,933	155,933	-	-	-
	譲渡性預金	30,000	30,000	-	-	-
	その他	-	-	-	-	-
	合 計	20,330,301	23,439,183	3,108,882	3,255,077	146,195
	公 社 債	11,605,953	11,748,897	142,944	170,019	27,075
	株 式	2,992,494	5,549,798	2,557,303	2,619,333	62,030
	外 国 証 券	5,342,348	5,727,565	385,216	441,179	55,962
公 社 債	4,733,932	4,887,313	153,381	206,211	52,830	
株 式 等	608,416	840,251	231,835	234,967	3,132	
その他の証券	203,571	226,989	23,417	24,543	1,126	
買入金銭債権	155,933	155,933	-	-	-	
譲渡性預金	30,000	30,000	-	-	-	
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	182,711	176,581	6,129	306	6,436
公 社 債	122,583	119,278	3,304	306	3,611
外 国 公 社 債	60,127	57,303	2,824	-	2,824
責任準備金対応債券	4,796,242	4,888,316	92,074	96,378	4,304
公 社 債	4,796,242	4,888,316	92,074	96,378	4,304
子会社・関連会社株式	-	-	-	-	-
その他の有価証券	15,132,601	18,658,322	3,525,721	3,587,064	61,343
公 社 債	6,916,880	7,001,850	84,970	94,060	9,090
株 式	2,973,562	6,037,300	3,063,738	3,091,770	28,032
外 国 証 券	4,779,847	5,127,119	347,271	371,050	23,778
公 社 債	4,219,528	4,423,007	203,478	226,017	22,538
株 式 等	560,319	704,112	143,792	145,032	1,240
その他の証券	242,347	272,089	29,741	30,183	442
買入金銭債権	119,962	119,962	-	-	-
譲渡性預金	100,000	100,000	-	-	-
その他	-	-	-	-	-
合 計	20,111,554	23,723,221	3,611,666	3,683,750	72,083
公 社 債	11,835,706	12,009,446	173,739	190,745	17,005
株 式	2,973,562	6,037,300	3,063,738	3,091,770	28,032
外 国 証 券	4,839,975	5,184,422	344,447	371,050	26,603
公 社 債	4,279,656	4,480,310	200,654	226,017	25,363
株 式 等	560,319	704,112	143,792	145,032	1,240
その他の証券	242,347	272,089	29,741	30,183	442
買入金銭債権	119,962	119,962	-	-	-
譲渡性預金	100,000	100,000	-	-	-
その他	-	-	-	-	-

(注) 1. 本表には、C D (譲渡性預金)等、金融商品取引法上の有価証券として取り扱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18年度上半期末が1,689百万円、平成19年度上半期末が1,750百万円、平成18年度末が1,761百万円です。

・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18年度上半期末	平成19年度上半期末	平成18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	30,152	78,735	33,466
非上場国内株式(店頭売買株式を除く)	19,384	66,315	21,315
非上場外国株式(店頭売買株式を除く)	6,820	6,820	6,820
その他	3,948	5,600	5,331
その他の有価証券	761,234	1,133,401	1,026,866
非上場国内株式(店頭売買株式を除く)	69,332	160,487	63,602
非上場外国株式(店頭売買株式を除く)	338,893	603,678	603,622
非上場外国公社債	0	0	0
その他	353,008	369,235	359,641
合 計	791,387	1,212,137	1,060,332

(注) 本表には、C D (譲渡性預金)等、金融商品取引法上の有価証券として取り扱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	
				うち差益	うち差損
平成18年度上半期末	31,282	31,282	2,429	1,152	3,582
平成19年度上半期末	31,391	31,391	1,362	2,973	4,336
平成18年度末	32,564	32,564	1,632	2,142	3,775

(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18年度上半期末		平成19年度上半期末		平成18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	29,593	2,429	29,640	1,362	30,803	1,632

(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19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	1,750	1,750	-	-	-
区 分	平成18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	1,761	1,761	-	-	-

(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等を行っております。

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 19 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通りです。

- ・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 19 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
- ・外貨建定期預金をヘッジ対象、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19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18年度上半期末		平成19年度上半期末		平成18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	2,312	22	2,365	21	2,190	21
為替予約	29,149	330	37,128	594	22,288	264
通貨オプション	6,187	143	5,974	141	-	-
債券先渡契約	514	1	743	1	1,066	1
債券オプション	388	0	484	1	199	0
クレジット・デリバティブ	90	0	180	1	100	0
合 計	38,641	499	46,877	760	25,844	288

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、四半期毎の「ALM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ことにより的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18年度上半期末						平成19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	1,062	33,497	-	-	-	34,559	1,227	15,667	-	-	-	16,894
ヘッジ会計非適用分	2	12,265	16	283	4	11,995	4	4,012	2,086	865	5	1,049
合 計	1,064	45,763	16	283	4	46,555	1,222	19,679	2,086	865	5	17,944

区 分	平成18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	1,017	22,930	-	-	-	23,948
ヘッジ会計非適用分	16	991	48	266	12	704
合 計	1,033	23,921	48	266	12	24,653

(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19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 15,667百万円)及びヘッジ会計非適用分の差損益(1,049百万円)の合計 16,716百万円  
 平成18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 22,930百万円)及びヘッジ会計非適用分の差損益(704百万円)の合計 23,635百万円

時価情報

(a) 金利関連

(単位:百万円)

区 分	種 類	平成18年度上半期末					平成19年度上半期末					平成18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	-	85,041	-	85,037	4	-	7,448	-	7,448	0	-
	買建	-	-	-	-	-	12,383	-	12,383	-	-	-	-	-	-	-
店 頭	金利スワップ															
	固定金利受取/変動金利支払	226,228	195,048	1,054	1,054	1,062	209,569	191,219	1,244	1,244	1,227	219,028	191,478	1,033	1,033	1,017
	固定金利支払/変動金利受取	5,000	5,000	11	11	-	27,000	27,000	16	16	-	-	-	-	-	-
	合 計				1,064	1,062				1,222	1,227			1,033	1,017	

(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19年度上半期末	受取側固定スワップ想定元本	18,350	78,465	52,710	47,300	12,744	209,569
	平均受取固定金利	0.64	0.78	1.08	1.35	1.68	1.03
	平均支払変動金利	0.83	0.97	0.89	0.87	0.89	0.91
	支払側固定スワップ想定元本	-	27,000	-	-	-	27,000
	平均支払固定金利	-	1.09	-	-	-	1.09
	平均受取変動金利	-	1.01	-	-	-	1.01
合 計	18,350	105,465	52,710	47,300	12,744	236,569	
平成18年度末	受取側固定スワップ想定元本	27,550	71,640	46,180	55,700	17,958	219,028
	平均受取固定金利	0.36	0.76	0.98	1.20	1.75	0.95
	平均支払変動金利	0.62	0.66	0.63	0.62	0.62	0.63
	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	27,550	71,640	46,180	55,700	17,958	219,028	

## (b) 通貨関連

(単位: 百万円)

区分	種類	平成18年度上半期末				平成19年度上半期末				平成18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	2,398,671	2,435,240	36,568	33,519	2,774,785	2,798,599	23,814	15,708	2,063,010	2,088,155	25,144	22,934
	(米ドル)	1,311,329	1,321,981	10,652	8,475	1,430,080	1,443,695	13,614	13,504	1,062,384	1,075,276	12,891	12,425
	(ユーロ)	834,754	850,358	15,603	15,322	931,815	945,476	13,661	7,164	738,483	751,535	13,052	11,437
	(英ポンド)	175,260	184,436	9,175	8,865	318,165	312,333	5,832	6,694	192,677	190,797	1,880	1,967
	(加ドル)	37,574	38,121	547	467	38,295	40,270	1,974	1,873	32,940	33,948	1,008	922
	(豪ドル)	9,232	9,190	42	38	29,949	30,885	935	418	5,810	6,134	324	317
	(スウェーデン)	28,718	29,344	626	427	21,890	21,294	596	557	27,329	27,117	212	201
	(スイス)	1,802	1,807	5	-	4,588	4,644	56	-	65	66	0	-
	(ルウェーグ)	-	-	-	-	-	-	-	-	3,278	3,237	41	-
	(シンガポール)	-	-	-	-	-	-	-	-	32	33	0	-
	(デンマーク)	-	-	-	-	-	-	-	-	7	7	0	-
	買建	516,280	518,142	1,861	21	938,027	944,980	6,953	41	165,857	167,079	1,222	3
	(米ドル)	294,648	295,640	991	-	453,885	453,805	80	-	65,735	65,744	8	-
	(ユーロ)	189,329	189,100	228	21	286,568	291,738	5,170	37	68,023	68,833	810	3
	(英ポンド)	13,040	13,248	208	0	145,454	146,153	698	3	13,916	14,056	140	0
	(豪ドル)	3,720	3,717	2	-	23,500	24,500	1,000	-	120	125	5	-
	(スイス)	3,992	4,014	21	-	9,490	9,461	29	-	2,007	2,028	20	-
	(加ドル)	2,751	2,753	2	0	7,218	7,376	158	-	2	2	0	-
	(中国元)	5,160	5,972	811	-	6,079	6,144	64	-	6,023	6,112	88	-
	(スウェーデン)	369	374	5	-	2,439	2,368	71	-	3,072	3,025	46	-
	(オランダ)	1,648	1,690	41	-	1,829	1,857	28	-	2,162	2,229	66	-
	(シンガポール)	826	841	14	-	768	758	10	-	900	912	12	-
	(ルウェーグ)	534	528	5	-	676	699	23	-	3,759	3,875	115	-
	(香港)	253	253	0	-	115	115	0	-	131	130	0	-
	(デンマーク)	5	5	0	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	(タイバーツ)	-	-	-	-	-	-	-	-	2	2	0	-
	通貨オプション												
	売建												
	コール	309,369				298,740				-			
(ユーロ)	(4,404)	7,908	3,504	-	(3,327)	4,566	1,238	-	(-)	-	-	-	
(米ドル)					153,413				-				
	(-)				(1,870)	4,132	2,261		(-)	-	-	-	
買建	309,369				145,326				-				
	(4,404)	7,908	3,504	-	(1,456)	434	1,022		(-)	-	-	-	
プット	309,369				298,740				-				
(ユーロ)	(8,144)	592	7,552	-	(5,268)	3,689	1,579		(-)	-	-	-	
(米ドル)					153,413				-				
	(-)				(2,478)	1,046	1,431		(-)	-	-	-	
	309,369				145,326				-				
	(8,144)	592	7,552	-	(2,790)	2,642	147		(-)	-	-	-	
合計			45,763	33,497			19,679	15,667			23,921	22,930	

- (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18年度上半期末				平成19年度上半期末				平成18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	34,898	34,835	63	-	33,521	35,549	2,028	-	4,710	4,720	9	-
	外貨建株価指数先物												
買建	2,245	2,292	46	-	3,945	4,003	58	-	3,291	3,330	38	-	
合計			16	-			2,086	-			48	-	

- (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18年度上半期末				平成19年度上半期末				平成18年度末			
		契約額等	時価	差損益	うち1年超 うち1年未満 適用分	契約額等	時価	差損益	うち1年超 うち1年未満 適用分	契約額等	時価	差損益	うち1年超 うち1年未満 適用分
取引所	円建債券先物												
	売建	-	-	-	-	62,506	62,207	299	-	1,339	1,341	2	-
	買建	14,948	14,962	14	-	19,235	19,161	73	-	8,450	8,451	1	-
	外貨建債券先物												
	売建	118,606	118,989	383	-	120,402	120,115	287	-	126,244	125,998	246	-
	買建	150,868	151,362	494	-	381,527	381,792	264	-	81,520	81,384	136	-
	円建債券先物オプション												
買建													
コール	2,720	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
プット	(3)	3	0	-	(-)	-	-	-	(-)	-	-	-	-
ブット	-	-	-	-	6,700	-	-	-	-	-	-	-	-
ブット	(-)	-	-	-	(13)	13	0	-	(-)	-	-	-	-
店頭	外貨建債券先渡契約												
	売建	-	-	-	-	33,121	33,065	55	-	40,669	40,615	54	-
	買建	51,439	51,594	155	-	41,275	41,332	56	-	65,972	66,075	103	-
	債券店頭オプション												
	売建												
	コール	2,552	-	-	-	-	-	-	-	7,447	-	-	-
	プット	(3)	1	2	-	(-)	-	-	-	(27)	21	5	-
	ブット	14,301	-	-	-	4,016	-	-	-	-	-	-	-
	ブット	(125)	106	18	-	(3)	5	1	-	(-)	-	-	-
	買建												
コール	19,395	-	-	-	44,478	-	-	-	5,066	-	-	-	
プット	(27)	7	19	-	(132)	110	22	-	(8)	3	4	-	
ブット	2,552	-	-	-	-	-	-	-	7,447	-	-	-	
ブット	(4)	5	1	-	(-)	-	-	-	(34)	32	2	-	
合計				283				865				266	

(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18年度上半期末				平成19年度上半期末				平成18年度末						
		契約額等	うち1年超	時価	差損益	うち1年超 うち1年未満 適用分	契約額等	うち1年超	時価	差損益	うち1年超 うち1年未満 適用分	契約額等	うち1年超	時価	差損益	うち1年超 うち1年未満 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	3,000	2,000	5	5	-	10,000	10,000	8	8	-	4,000	4,000	4	4	-
	オプション買建	6,000	6,000	0	0	-	8,000	8,000	2	2	-	6,000	6,000	16	16	-
合計				4					5					12		

(注) 差損益欄には、時価を記載しています。