

## 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19年度第2四半期(上半期)末		平成20年度第2四半期(上半期)末		平成19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	1,813,722	52,206	1,415,553	73,396	1,467,657	315,779
一般勘定	178,926	1,511	98,572	1,927	70,343	5,995
特別勘定	1,634,796	50,694	1,316,981	71,468	1,397,313	309,784

(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19年度第2四半期(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	-	-	-	-	-	
平成20年度第2四半期(上半期)末	満期保有目的の債券	175,959	175,287	672	1,699	2,371
	公 社 債	123,418	121,658	1,759	611	2,371
	外 国 公 社 債	52,541	53,628	1,087	1,087	-
	責任準備金対応債券	5,159,413	5,286,955	127,542	128,497	954
	公 社 債	5,159,413	5,286,955	127,542	128,497	954
	子会社・関連会社株式	-	-	-	-	-
	その他有価証券	15,348,599	16,112,969	764,370	1,362,153	597,782
	公 社 債	6,083,543	6,188,305	104,762	122,504	17,742
	株 式	3,065,074	4,082,476	1,017,401	1,160,768	143,366
	外 国 証 券	6,020,398	5,691,487	328,911	76,863	405,774
	公 社 債	5,357,931	5,121,382	236,548	48,813	285,362
	株 式 等	662,467	570,104	92,362	28,049	120,412
	その他の証券	159,582	130,700	28,881	2,016	30,898
	買入金銭債権	-	-	-	-	-
	譲渡性預金	20,000	20,000	-	-	-
	その他	-	-	-	-	-
	合 計	20,683,972	21,575,213	891,240	1,492,349	601,108
	公 社 債	11,366,375	11,596,920	230,545	251,613	21,068
	株 式	3,065,074	4,082,476	1,017,401	1,160,768	143,366
	外 国 証 券	6,072,940	5,745,116	327,824	77,950	405,774
公 社 債	5,410,472	5,175,011	235,461	49,901	285,362	
株 式 等	662,467	570,104	92,362	28,049	120,412	
その他の証券	159,582	130,700	28,881	2,016	30,898	
買入金銭債権	-	-	-	-	-	
譲渡性預金	20,000	20,000	-	-	-	
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	174,034	176,400	2,365	4,011		1,645	
	公 社 債	123,140	123,084	56	1,589		1,645
外国公社債	50,894	53,316	2,421	2,421		-	
責任準備金対応債券	4,927,142	5,078,369	151,227	155,763		4,535	
	公 社 債	4,927,142	5,078,369	151,227	155,763		4,535
子会社・関連会社株式	-	-	-	-		-	
その他の有価証券	15,323,877	16,821,851	1,497,973	1,854,028		356,054	
	公 社 債	6,910,185	7,136,478	226,292	235,085		8,792
	株 式 等	2,988,492	4,276,199	1,287,706	1,408,762		121,056
	外 国 証 券	5,135,282	5,129,440	5,842	204,446		210,288
	公 社 債	4,498,342	4,489,772	8,570	133,324		141,894
	株 式 等	636,939	639,668	2,728	71,122		68,394
	そ の 他 の 証 券	204,933	194,749	10,183	5,733		15,916
	買 入 金 銭 債 権	44,983	44,983	-	-		-
	譲 渡 性 預 金	40,000	40,000	-	-		-
	そ の 他	-	-	-	-		-
合 計	20,425,054	22,076,621	1,651,566	2,013,802		362,236	
公 社 債	11,960,467	12,337,931	377,464	392,438		14,973	
株 式 等	2,988,492	4,276,199	1,287,706	1,408,762		121,056	
外 国 証 券	5,186,177	5,182,757	3,420	206,868		210,288	
公 社 債	4,549,237	4,543,089	6,148	135,745		141,894	
株 式 等	636,939	639,668	2,728	71,122		68,394	
そ の 他 の 証 券	204,933	194,749	10,183	5,733		15,916	
買 入 金 銭 債 権	44,983	44,983	-	-		-	
譲 渡 性 預 金	40,000	40,000	-	-		-	
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、帳簿価額及び時価は平成19年度第2四半期(上半期)末が1,750百万円、平成20年度第2四半期(上半期)末が1,593百万円、平成19年度末が1,543百万円です。

・時価のない有価証券の帳簿価額は以下のとおりです。

(単位：百万円)

区 分	平成19年度 第2四半期(上半期)末	平成20年度 第2四半期(上半期)末	平成19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	78,735	124,303	82,634
非上場国内株式(店頭売買株式を除く)	66,315	106,325	66,325
非上場外国株式(店頭売買株式を除く)	6,820	8,070	6,879
そ の 他	5,600	9,907	9,429
その他の有価証券	1,133,401	1,399,717	1,271,109
非上場国内株式(店頭売買株式を除く)	160,487	166,388	166,239
非上場外国株式(店頭売買株式を除く)	603,678	875,093	731,095
非上場外国公社債	0	0	0
そ の 他	369,235	358,234	373,775
合 計	1,212,137	1,524,020	1,353,744

(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19年度第2四半期(上半期)末	31,391	31,391	1,362	2,973	4,336
平成20年度第2四半期(上半期)末	23,337	23,337	1,657	6,223	7,881
平成19年度末	25,223	25,223	6,117	2,045	8,162

(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19年度第2四半期(上半期)末		平成20年度第2四半期(上半期)末		平成19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	29,640	1,362	21,744	1,657	23,680	6,117

(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19年度第2四半期(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	1,750	1,750	-	-	-
区 分	平成20年度第2四半期(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	1,593	1,593	-	-	-
区 分	平成19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	1,543	1,543	-	-	-

(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20年度第2四半期(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20年度第2四半期(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
- ・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20年度第2四半期(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19年度第2四半期(上半期)末		平成20年度第2四半期(上半期)末		平成19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	2,365	21	2,084	18	2,618	36
為替予約	37,128	594	36,481	2,283	28,073	661
通貨オプション	5,974	141	6,493	364	-	-
債券先渡契約	743	1	428	0	611	1
債券オプション	484	1	1,204	4	1,185	1
クレジット・デリバティブ	180	1	20	0	60	0
合 計	46,877	760	46,713	2,671	32,549	700

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19年度第2四半期(上半期)末						平成20年度第2四半期(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	1,227	15,667	-	-	-	16,894	184	166,903	-	-	-	166,718
ヘッジ会計非適用分	4	4,012	2,086	865	5	1,049	6	30,915	1,431	434	29	29,896
合 計	1,222	19,679	2,086	865	5	17,944	177	197,818	1,431	434	29	196,614

区 分	平成19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	1,307	20,348	-	-	-	21,655
ヘッジ会計非適用分	39	4,196	17	259	2	4,475
合 計	1,347	24,544	17	259	2	26,130

(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19年度第2四半期(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20年度第2四半期(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166,903百万円)及びヘッジ会計非適用分の差損益(29,896百万円)の合計196,799百万円

平成19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20,348百万円)及びヘッジ会計非適用分の差損益(4,475百万円)の合計24,823百万円

時価情報

(a) 金利関連

(単位:百万円)

区 分	種 類	平成19年度第2四半期(上半期)末						平成20年度第2四半期(上半期)末						平成19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				うち1年超		うち1年超				うち1年超	
取 引 所	金利先物 売建	85,041	-	85,037	4	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	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	209,569	191,219	1,244	1,244	1,227	193,446	139,181	188	188	184	236,870	200,910	1,401	1,401	1,307			
	固定金利支払/変動金利受取	27,000	27,000	16	16	-	15,000	-	10	10	-	25,000	25,000	53	53	-			
	合 計				1,222	1,227				177	184				1,347	1,307			

(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年以下	3年超 5年以下	5年超 7年以下	7年超 10年以下	10年超	合計
	平成19年度第2四半期(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20年度第2四半期(上半期)末							
受取側固定スワップ想定元本	54,265	35,050	55,000	29,900	19,231	-	193,446
平均受取固定金利	0.82	0.84	1.17	1.59	1.52	-	1.11
平均支払変動金利	0.96	0.97	0.95	0.95	0.97	-	0.96
支払側固定スワップ想定元本	15,000	-	-	-	-	-	15,000
平均支払固定金利	1.08	-	-	-	-	-	1.08
平均受取変動金利	0.98	-	-	-	-	-	0.98
合 計	69,265	35,050	55,000	29,900	19,231	-	208,446
平成19年度末							
受取側固定スワップ想定元本	35,960	91,180	41,000	49,900	18,830	-	236,870
平均受取固定金利	0.71	0.90	1.23	1.34	1.54	-	1.07
平均支払変動金利	0.97	1.01	0.97	0.95	0.96	-	0.98
支払側固定スワップ想定元本	-	25,000	-	-	-	-	25,000
平均支払固定金利	-	1.07	-	-	-	-	1.07
平均受取変動金利	-	0.98	-	-	-	-	0.98
合 計	35,960	116,180	41,000	49,900	18,830	-	261,870

(b) 通貨関連

(単位：百万円)

区分	種類	平成19年度第2四半期(上半期)末				平成20年度第2四半期(上半期)末				平成19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	2,774,785	2,798,599	23,814	15,708	3,182,530	2,991,285	191,245	167,334	2,428,213	2,407,454	20,758	20,337	
	(米ドル)	1,430,080	1,443,695	13,614	13,504	1,691,402	1,627,554	63,848	53,720	1,209,966	1,194,171	15,795	12,099	
	(ユーロ)	931,815	945,476	13,661	7,164	1,095,611	1,002,378	93,233	84,291	900,867	905,987	5,119	1,177	
	(英ポンド)	318,165	312,333	5,832	6,694	261,299	237,886	23,413	20,871	239,286	231,154	8,131	7,555	
	(加ドル)	38,295	40,270	1,974	1,873	54,191	52,013	2,177	1,237	34,848	32,788	2,059	1,930	
	(豪ドル)	29,949	30,885	935	418	46,537	41,705	4,831	3,765	12,046	11,776	270	210	
	(スウェーデン)	21,890	21,294	596	557	15,226	13,239	1,987	1,837	18,915	19,193	278	279	
	(デンマーク)	-	-	-	-	10,344	9,247	1,097	994	24	24	0	-	
	(ルウェーグ)	-	-	-	-	4,666	4,009	656	616	45	45	0	-	
	(スイス)	4,588	4,644	56	-	2,831	2,833	2	-	7,187	7,270	83	-	
	(台湾ドル)	-	-	-	-	414	413	1	-	-	-	-	-	
	(香港ドル)	-	-	-	-	3	3	0	-	3,015	3,032	17	-	
	(シンガポール)	-	-	-	-	-	-	-	-	2,009	2,008	0	-	
	買建	938,027	944,980	6,953	41	465,615	453,996	11,618	431	379,179	382,965	3,785	10	
	(米ドル)	453,885	453,805	80	-	218,255	215,157	3,097	167	156,372	156,533	161	7	
	(ユーロ)	286,568	291,738	5,170	37	146,618	142,241	4,377	209	148,748	152,878	4,129	2	
	(英ポンド)	145,454	146,153	698	3	50,015	47,844	2,170	17	36,968	37,326	358	-	
	(豪ドル)	23,500	24,500	1,000	-	27,143	25,999	1,144	-	6,101	6,154	52	-	
	(スイス)	9,490	9,461	29	-	7,440	7,321	119	-	11,273	11,493	219	-	
	(中国元)	6,079	6,144	64	-	6,535	6,052	483	-	6,227	5,716	511	-	
	(加ドル)	7,218	7,376	158	-	5,042	5,035	7	-	4,680	4,294	385	-	
	(ポンド)	1,829	1,857	28	-	1,874	1,850	23	-	1,953	1,966	13	-	
	(ルウェーグ)	676	699	23	-	998	906	91	14	747	726	20	-	
	(デンマーク)	-	-	-	-	782	701	81	21	-	-	-	-	
(シンガポール)	768	758	10	-	768	743	24	-	5,871	5,635	236	-		
(香港ドル)	115	115	0	-	83	89	5	-	167	171	4	-		
(スウェーデン)	2,439	2,368	71	-	35	32	2	-	66	67	1	-		
(トルコリラ)	-	-	-	-	21	20	0	-	-	-	-	-		
通貨オプション														
売建														
コール	298,740				324,681				-					
(米ドル)	(3,327)	4,566	1,238	-	(7,732)	3,564	4,168	-	(-)	-	-	-		
(ユーロ)	145,326				169,658				-					
(ユーロ)	(1,456)	434	1,022	-	(4,466)	3,140	1,326	-	(-)	-	-	-		
(ユーロ)	153,413				155,023				-					
(ユーロ)	(1,870)	4,132	2,261	-	(3,266)	424	2,841	-	(-)	-	-	-		
買建														
プット	298,740				324,681				-					
(米ドル)	(5,268)	3,689	1,579	-	(11,972)	25,995	14,023	-	(-)	-	-	-		
(米ドル)	145,326				169,658				-					
(ユーロ)	(2,790)	2,642	147	-	(5,639)	6,233	593	-	(-)	-	-	-		
(ユーロ)	153,413				155,023				-					
(ユーロ)	(2,478)	1,046	1,431	-	(6,332)	19,762	13,430	-	(-)	-	-	-		
合計			19,679	15,667			197,818	166,903			24,544	20,348		

- (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19年度第2四半期(上半期)末				平成20年度第2四半期(上半期)末				平成19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	33,521	35,549	2,028	-	15,504	14,237	1,267	-	17,001	16,944	57	-	
	外貨建株価指数先物													
	買建	3,945	4,003	58	-	4,877	4,713	164	-	2,462	2,502	40	-	
合計				2,086	-			1,431	-			17	-	

- (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19年度第2四半期(上半期)末				平成20年度第2四半期(上半期)末				平成19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	62,506	62,207	299	-	42,456	42,362	93	-	54,079	54,100	20	-
	買建	19,235	19,161	73	-	685	687	1	-	7,900	8,009	109	-
	外貨建債券先物												
	売建	120,402	120,115	287	-	73,080	73,216	136	-	73,226	73,779	553	-
	買建	381,527	381,792	264	-	233,363	234,155	792	-	119,831	120,745	914	-
円建債券先物オプション	買建												
	ブット	6,700 (13)	13	0	-	- (-)	-	-	-	- (-)	-	-	-
店頭	外貨建債券先渡契約												
	売建	33,121	33,065	55	-	-	-	-	-	19,579	19,903	324	-
	買建	41,275	41,332	56	-	42,850	42,643	207	-	41,547	41,721	174	-
	債券店頭オプション												
	売建												
	コール	- (-)	-	-	-	16,406 (80)	78	2	-	26,776 (52)	65	13	-
	ブット	4,016 (3)	5	1	-	43,843 (140)	183	42	-	32,499 (112)	106	5	-
	買建												
	コール	44,478 (132)	110	22	-	43,843 (121)	71	50	-	32,499 (99)	78	21	-
	ブット	- (-)	-	-	-	16,406 (95)	75	19	-	26,776 (58)	47	11	-
合計			865	-			434	-			259	-	

- (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、先物取引及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19年度第2四半期(上半期)末				平成20年度第2四半期(上半期)末				平成19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
店頭	クレジット・フォルト・スワップ															
	オプション売建	10,000	10,000	8	8	-	2,000	2,000	29	29	-	4,000	4,000	51	51	-
	オプション買建	8,000	8,000	2	2	-	-	-	-	-	-	2,000	2,000	48	48	-
合計				5	-				29	-				2	-	

- (注) 差損益欄には、時価を記載しています。