

部外秘

ETFカバードコール総合管理台帳(残高表)

本店営業部

03/01/31現在

取引開始日: 01/08/01 8,360

承認番号 取引開始日 担当者 部店 顧客コード 顧客名 数量 買付単価 限月 権利価格 ! 売却単価 数量 受取プレミアム合計 ETF売却利益 合計損益

(略)

0 2001/11/	0 - 0		3,000	8,950	3	8,500	210	3	4,262,095	-7,792,788	-3,530,693
0 2001/11/	0 - 111111	(株)	3,000	11,649	2	8,500	245	3	5,327,330	0	5,327,330
			2,000	9,820	2	8,500	245	2			
0 2001/11/	0 - 222222		3,000	12,073	3	8,500	230	3	4,035,598	1,443,129	5,478,727
0 2001/11/	0 - 333333		3,000	12,100	3	8,500	215	3	6,727,165	-3,576,972	3,150,193
			2,000	11,550	3	8,500	215	2			
0 2001/12/	0 - 444444		14,000	11,920	2	8,500	245	14	20,560,083	8,237,007	28,797,090
			3,000	9,703	2	8,500	245	3			
			4,000	8,656	2	8,500	245	4			
0 2001/12/	0 - 555555		14,000	11,920	2	8,500	245	14	20,792,817	7,303,632	28,096,449
			3,000	9,637	2	8,500	245	3			
			4,000	8,570	2	8,500	245	4			
0 2001/12/	0 - 666666		2,000	11,160	3	8,500	215	2	1,075,960	1,876,567	2,952,527
0 2001/12/	0 - 777777		3,000	11,750	3	8,500	210	3	3,651,575	1,255,178	4,906,753
0 2001/12/	0 - 888888		2,000	11,690	3	8,500	270	2	2,155,595	2,340,410	4,496,005

(略)

											107,719,670
									223,582,623	総受取プレミアム	
									9.6%	-5.0%	4.6%
		223,000	10,433				建玉計 215	2,326,637,000	買付簿価計	-19.9%	
								-462,357,000	ETF評価損益		内信用買残
								48,530,000	建玉プレミアム計		746,399,000
		内信用残高	82,000	9,102				手数料累計	126,970,043		4,426,010