

2017年度第2四半期（上半期）報告補足資料

※資料中、「第2四半期（上半期）」は「4月1日～9月30日」を表しております。

1. 有価証券関係（一般勘定）		
(1) 有価証券明細表	2頁
(2) 有価証券残存期間別残高	2頁
(3) 業種別国内株式保有明細表	3頁
2. 貸付金関係（一般勘定）		
(1) 貸付金残存期間別残高	4頁
(2) 貸付金企業規模別内訳	4頁
(3) 貸付金担保別内訳	4頁
(4) 貸付金業種別内訳	5頁
3. 海外投融資関係（一般勘定）		
(1) 資産別明細	6頁
(2) 外貨建資産の通貨別構成	6頁
(3) 海外投融資の地域別構成	7頁
4. デリバティブ取引の時価情報（一般勘定）		
(1) 差損益の内訳	8頁
(2) 時価情報（ヘッジ会計非適用分）	8頁
(3) 時価情報（ヘッジ会計適用分）	11頁

1. 有価証券関係（一般勘定）

(1) 有価証券明細表

(単位：百万円、%)

区 分	2016年度末		2017年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
国 債	13,967,855	47.1	13,933,186	45.7
地 方 債	109,098	0.4	118,122	0.4
社 債	1,975,300	6.7	1,921,736	6.3
うち公社・公団債	445,919	1.5	404,304	1.3
株 式	3,474,743	11.7	3,711,301	12.2
外 国 証 券	9,512,246	32.1	10,232,160	33.6
公 社 債	8,260,182	27.9	8,807,549	28.9
株 式 等	1,252,063	4.2	1,424,610	4.7
そ の 他 の 証 券	620,006	2.1	545,028	1.8
合 計	29,659,250	100.0	30,461,535	100.0

(2) 有価証券残存期間別残高

(単位：百万円)

区 分	2016年度末							合 計
	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 (期間の定め ないものを 含む)		
有 価 証 券	520,493	1,344,770	1,352,622	1,079,153	2,897,918	22,464,291	29,659,250	
国 債	36,262	346,870	152,306	297,985	910,335	12,224,094	13,967,855	
地 方 債	3,627	6,794	30,515	4,381	21,582	42,196	109,098	
社 債	162,816	224,979	216,739	142,690	394,343	833,731	1,975,300	
株 式	-	-	-	-	-	3,474,743	3,474,743	
外 国 証 券	315,351	671,420	907,718	602,022	1,514,610	5,501,122	9,512,246	
公 社 債	311,838	666,258	906,513	583,178	1,494,081	4,298,312	8,260,182	
株 式 等	3,513	5,162	1,204	18,844	20,529	1,202,809	1,252,063	
そ の 他 の 証 券	2,434	94,704	45,342	32,074	57,046	388,403	620,006	
買 入 金 銭 債 権	3,066	2,077	541	2,576	-	183,951	192,213	
譲 渡 性 預 金	49,998	-	-	-	-	-	49,998	
そ の 他	-	-	-	-	-	50,191	50,191	

区 分	2017年度第2四半期(上半期)末							合 計
	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 (期間の定め ないものを 含む)		
有 価 証 券	554,881	1,406,570	1,324,535	1,173,882	3,479,797	22,521,866	30,461,535	
国 債	164,083	293,503	82,806	344,913	1,091,323	11,956,555	13,933,186	
地 方 債	2,916	18,006	18,942	4,357	21,507	52,392	118,122	
社 債	93,996	235,844	187,362	130,824	349,668	924,040	1,921,736	
株 式	-	-	-	-	-	3,711,301	3,711,301	
外 国 証 券	291,452	775,429	978,823	671,122	1,931,833	5,583,499	10,232,160	
公 社 債	286,989	771,297	973,425	651,855	1,906,803	4,217,178	8,807,549	
株 式 等	4,463	4,131	5,397	19,267	25,029	1,366,321	1,424,610	
そ の 他 の 証 券	2,433	83,787	56,601	22,665	85,464	294,076	545,028	
買 入 金 銭 債 権	5,064	-	833	2,541	-	180,325	188,765	
譲 渡 性 預 金	49,996	-	-	-	-	-	49,996	
そ の 他	-	-	-	-	-	55,767	55,767	

(注)「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号)に基づく有価証券として取り扱うものを含んでいます。

(3) 業種別国内株式保有明細表

(単位：百万円、%)

区 分	2016年度末		2017年度 第2四半期(上半期)末		
	金 額	占 率	金 額	占 率	
水 産 ・ 農 林 業	242	0.0	1,159	0.0	
鉱 業	200	0.0	2,229	0.1	
建 設 業	108,340	3.1	122,574	3.3	
製 造 業	食 料 品	224,692	6.5	230,013	6.2
	織 維 製 品	31,442	0.9	34,322	0.9
	パ ル プ ・ 紙	3,419	0.1	3,603	0.1
	化 学	182,076	5.2	209,275	5.6
	医 薬 品	55,602	1.6	58,563	1.6
	石 油 ・ 石 炭 製 品	4,633	0.1	6,687	0.2
	ゴ ム 製 品	25,804	0.7	27,398	0.7
	ガ ラ ス ・ 土 石 製 品	119,314	3.4	109,381	2.9
	鉄 鋼	62,363	1.8	62,540	1.7
	非 鉄 金 属	17,929	0.5	20,869	0.6
	金 属 製 品	46,294	1.3	48,443	1.3
	機 械	204,880	5.9	230,168	6.2
	電 気 機 器	553,055	15.9	655,386	17.7
	輸 送 用 機 器	219,540	6.3	220,074	5.9
	精 密 機 器	106,092	3.1	116,230	3.1
	そ の 他 製 品	79,704	2.3	79,761	2.1
電 気 ・ ガ ス 業	102,152	2.9	108,125	2.9	
運 輸 ・ 情 報 通 信 業	陸 運 業	319,236	9.2	320,870	8.6
	海 運 業	55	0.0	53	0.0
	空 運 業	3,209	0.1	6,038	0.2
	倉 庫 ・ 運 輸 関 連 業	4,642	0.1	5,251	0.1
	情 報 ・ 通 信 業	92,337	2.7	94,821	2.6
商 業	卸 売 業	140,751	4.1	151,231	4.1
	小 売 業	112,405	3.2	123,828	3.3
金 融 ・ 保 険 業	銀 行 業	416,199	12.0	389,471	10.5
	証 券、商 品 先 物 取 引 業	5,378	0.2	2,517	0.1
	保 険 業	21,657	0.6	23,214	0.6
	そ の 他 金 融 業	24,712	0.7	26,155	0.7
不 動 産 業	20,947	0.6	18,462	0.5	
サ ー ビ ス 業	165,429	4.8	202,577	5.5	
合 計	3,474,743	100.0	3,711,301	100.0	

(注) 業種区分は、「証券コード協議会」の「業種別分類項目」に準拠しています。

2. 貸付金関係（一般勘定）

（1）貸付金残存期間別残高

（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 (期間の定めのないものを含む)	合 計
		2016年度末	変 動 金 利	4,165	20,402	20,115	6,500	
	固 定 金 利	269,345	347,924	338,646	370,821	407,408	416,206	2,150,352
	一般貸付計	273,511	368,326	358,761	377,321	413,799	484,300	2,276,021
2017年度 第2四半期 (上半期)末	変 動 金 利	23,702	19,059	4,172	8,597	6,988	70,625	133,146
	固 定 金 利	260,563	316,997	359,938	370,108	361,986	412,164	2,081,758
	一般貸付計	284,266	336,056	364,111	378,705	368,975	482,789	2,214,904

（2）貸付金企業規模別内訳＜国内企業向け＞

（単位：件、百万円、%）

区 分		2016年度末		2017年度 第2四半期(上半期)末	
		金額	占 率	金額	占 率
大 企 業	貸付先数	225	67.4	224	68.1
	金 額	1,667,247	84.9	1,626,862	85.2
中 堅 企 業	貸付先数	11	3.3	10	3.0
	金 額	12,083	0.6	4,228	0.2
中 小 企 業	貸付先数	98	29.3	95	28.9
	金 額	284,440	14.5	277,765	14.6
国内企業向け 貸付計	貸付先数 金 額	334 1,963,771	100.0 100.0	329 1,908,857	100.0 100.0

（注）1. 業種の区分は以下のとおりです。

2. 貸付先数とは、各貸付先を名寄せした結果の債務者数をいい、貸付件数ではありません。

業 種	①右の②、③、④を除く全業種	②小売業、飲食業		③サービス業		④卸売業	
大 企 業	常用する 従業員 300名超 かつ 資本金10億円 以上	常用する 従業員 50名超 かつ 資本金5千万円超 10億円未満	常用する 従業員 100名超 かつ 資本金5千万円以下 又は 常用する従業員100名以下	常用する 従業員 100名超 かつ 資本金5千万円以下 又は 常用する従業員100名以下	常用する 従業員 100名超 かつ 資本金1億円超 10億円未満	常用する 従業員 100名超 かつ 資本金1億円超 10億円未満	常用する 従業員 100名超 かつ 資本金1億円超 10億円未満
中 堅 企 業	常用する 従業員 300名超 かつ 資本金3億円超 10億円未満	常用する 従業員 50名超 かつ 資本金5千万円超 10億円未満	常用する 従業員 100名超 かつ 資本金5千万円以下 又は 常用する従業員100名以下	常用する 従業員 100名超 かつ 資本金5千万円以下 又は 常用する従業員100名以下	常用する 従業員 100名超 かつ 資本金1億円超 10億円未満	常用する 従業員 100名超 かつ 資本金1億円超 10億円未満	常用する 従業員 100名超 かつ 資本金1億円超 10億円未満
中 小 企 業	資本金3億円以下又は 常用する従業員300名以下	資本金5千万円以下又は 常用する従業員50名以下	資本金5千万円以下又は 常用する従業員100名以下	資本金5千万円以下又は 常用する従業員100名以下	資本金1億円以下又は 常用する従業員100名以下	資本金1億円以下又は 常用する従業員100名以下	資本金1億円以下又は 常用する従業員100名以下

（3）貸付金担保別内訳

（単位：百万円、%）

区 分	2016年度末		2017年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
担 保 貸 付	3,667	0.2	8,944	0.4
有 価 証 券 担 保 貸 付	2,338	0.1	7,458	0.3
不 動 産・動 産・ 財 団 担 保 貸 付	1,301	0.1	1,454	0.1
指 名 債 権 担 保 貸 付	27	0.0	31	0.0
保 証 貸 付	83,113	3.7	82,137	3.7
信 用 貸 付	2,188,565	96.2	2,123,262	95.9
そ の 他	675	0.0	560	0.0
一 般 貸 付 計	2,276,021	100.0	2,214,904	100.0
うち劣後特約付 貸	302,800	13.3	302,307	13.6

（注）保険約款貸付は含んでいません。

(4) 貸付金業種別内訳

(単位：百万円、%)

区 分	2016年度末		2017年度 第2四半期(上半期)末		
	金 額	占 率	金 額	占 率	
製 造 業	食 料	36,782	1.6	40,062	1.8
	織 維	2,025	0.1	1,899	0.1
	木 材 ・ 木 製 品	500	0.0	500	0.0
	パ ル プ ・ 紙	19,876	0.9	14,732	0.7
	印 刷	13,775	0.6	13,174	0.6
	化 学	21,774	1.0	21,822	1.0
	石 油 ・ 石 炭	18,070	0.8	18,070	0.8
	窯 業 ・ 土 石	29,157	1.3	28,805	1.3
	鉄 鋼	82,300	3.6	71,300	3.2
	非 鉄 金 属	6,803	0.3	6,529	0.3
	金 属 製 品	611	0.0	613	0.0
	はん用・生産用・業務用機械	36,756	1.6	34,738	1.6
	電 気 機 械	72,858	3.2	73,277	3.3
	輸 送 用 機 械	11,976	0.5	15,963	0.7
	そ の 他 の 製 造 業	4,244	0.2	3,991	0.2
国 内 向 け	農 業 、 林 業	-	-	-	-
	漁 業	-	-	-	-
	鉱 業 、 採 石 業 、 砂 利 採 取 業	-	-	-	-
	建 設 業	10,054	0.4	10,016	0.5
	電 気 ・ ガ ス ・ 熱 供 給 ・ 水 道 業	377,353	16.6	439,851	19.9
	情 報 通 信 業	55,673	2.4	55,418	2.5
	運 輸 業 、 郵 便 業	250,411	11.0	249,318	11.3
	卸 売 業	466,615	20.5	425,209	19.2
	小 売 業	11,226	0.5	11,459	0.5
	金 融 業 、 保 険 業	444,127	19.5	377,792	17.1
	不 動 産 業	119,709	5.3	116,834	5.3
	物 品 賃 貸 業	107,851	4.7	111,717	5.0
	学 術 研 究 、 専 門 ・ 技 術 サービス 業	954	0.0	900	0.0
	宿 泊 業	-	-	-	-
	飲 食 業	-	-	-	-
	生 活 関 連 サービス 業 ・ 娯 楽 業	3,163	0.1	2,951	0.1
	教 育 、 学 習 支 援 業	-	-	-	-
	医 療 ・ 福 祉	150	0.0	150	0.0
	そ の 他 の サ ー ビ ス	3,100	0.1	3,933	0.2
	地 方 公 共 団 体	26,169	1.1	24,989	1.1
個 人 (住 宅 ・ 消 費 ・ 納 税 資 金 等)	675	0.0	560	0.0	
そ の 他	266	0.0	200	0.0	
合 計	2,235,013	98.2	2,176,781	98.3	
海 外 向 け	政 府 等	2,700	0.1	-	-
	金 融 機 関	11,544	0.5	11,544	0.5
	商 工 業 等	26,763	1.2	26,578	1.2
	合 計	41,008	1.8	38,123	1.7
一 般 貸 付 計	2,276,021	100.0	2,214,904	100.0	

(注) 1. 保険約款貸付は含んでいません。
2. 国内向けの業種区分は日本銀行の「貸出先別貸出金(業種別、設備資金新規貸出)」の業種区分に準拠しています。

3. 海外投融資関係（一般勘定）

（1）資産別明細

①外貨建資産

（単位：百万円、％）

区 分	2016年度末		2017年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
公 社 債	7,503,550	72.5	7,984,239	72.3
株 式	675,410	6.5	876,263	7.9
現 預 金 ・ そ の 他	228,808	2.2	228,578	2.1
小 計	8,407,769	81.2	9,089,081	82.3

②円貨額が確定した外貨建資産

（単位：百万円、％）

区 分	2016年度末		2017年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
公 社 債	-	-	-	-
現 預 金 ・ そ の 他	354,058	3.4	348,592	3.2
小 計	354,058	3.4	348,592	3.2

③円貨建資産

（単位：百万円、％）

区 分	2016年度末		2017年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
非 居 住 者 貸 付	22,666	0.2	20,216	0.2
公社債（円建外債）・その他	1,569,179	15.2	1,582,659	14.3
小 計	1,591,846	15.4	1,602,875	14.5

④合 計

（単位：百万円、％）

区 分	2016年度末		2017年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
海 外 投 融 資	10,353,674	100.0	11,040,549	100.0

（注）「円貨額が確定した外貨建資産」は、為替予約等が付されていることにより決済時の円貨額が確定し、当該円貨額を資産の貸借対照表価額としているものです。

（2）外貨建資産の通貨別構成

（単位：百万円、％）

区 分	2016年度末		2017年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
米 ド ル	4,673,054	55.6	4,963,306	54.6
ユ ー ロ	1,721,716	20.5	2,009,209	22.1
オーストラリアドル	679,085	8.1	670,487	7.4
イギリスポンド	254,239	3.0	266,524	2.9
カナダドル	238,371	2.8	236,511	2.6
ニュージーランドドル	200,635	2.4	209,871	2.3
メキシコペソ	217,141	2.6	200,852	2.2
そ の 他 共 計	8,407,769	100.0	9,089,081	100.0

(3) 海外投融資の地域別構成

(単位：百万円、%)

区 分	2016年度末							
	外国証券		公社債		株式等		非居住者貸付	
	金額	占率	金額	占率	金額	占率	金額	占率
北 米	4,109,374	43.2	3,840,644	46.5	268,729	21.5	10,263	25.0
ヨ ー ロ ッ パ	2,665,186	28.0	2,461,926	29.8	203,260	16.2	10,369	25.3
オセアニア	837,203	8.8	794,624	9.6	42,579	3.4	5,000	12.2
ア ジ ア	216,677	2.3	109,851	1.3	106,826	8.5	1,500	3.7
中 南 米	1,504,340	15.8	874,219	10.6	630,121	50.3	11,175	27.3
中 東	-	-	-	-	-	-	-	-
ア フ リ カ	23,089	0.2	22,543	0.3	546	0.0	-	-
国 際 機 関	156,373	1.6	156,373	1.9	-	-	2,700	6.6
合 計	9,512,246	100.0	8,260,182	100.0	1,252,063	100.0	41,008	100.0
区 分	2017年度第2四半期(上半期)末							
	外国証券		公社債		株式等		非居住者貸付	
	金額	占率	金額	占率	金額	占率	金額	占率
北 米	4,402,246	43.0	4,010,844	45.5	391,401	27.5	10,005	26.2
ヨ ー ロ ッ パ	3,002,581	29.3	2,765,859	31.4	236,721	16.6	10,192	26.7
オセアニア	848,504	8.3	805,585	9.1	42,918	3.0	5,000	13.1
ア ジ ア	278,578	2.7	144,979	1.6	133,598	9.4	1,825	4.8
中 南 米	1,532,920	15.0	913,605	10.4	619,315	43.5	11,099	29.1
中 東	15,372	0.2	15,372	0.2	-	-	-	-
ア フ リ カ	15,051	0.1	14,397	0.2	653	0.0	-	-
国 際 機 関	136,905	1.3	136,905	1.6	-	-	-	-
合 計	10,232,160	100.0	8,807,549	100.0	1,424,610	100.0	38,123	100.0

(注) 地域区分は発行会社及び貸付先企業の国籍等に基づいています。

4. デリバティブ取引の時価情報（一般勘定）

（1）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	2016年度末						2017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	△ 23,531	△ 136,742	1,246	△ 717	-	△ 159,745	△ 18,665	△ 96,720	△ 7,097	-	-	△ 122,483
ヘッジ会計非適用分	△ 14,517	△ 11,690	△ 2,678	763	554	△ 27,569	△ 11,448	△ 16,671	△ 40	△ 536	883	△ 27,813
合 計	△ 38,049	△ 148,433	△ 1,432	46	554	△ 187,314	△ 30,113	△ 113,391	△ 7,138	△ 536	883	△ 150,296

（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。

2016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△140,284百万円、株式関連1,246百万円）及び
 ヘッジ会計非適用分の差損益（△27,569百万円）の合計△166,608百万円
 2017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△91,112百万円、株式関連△7,097百万円）及び
 ヘッジ会計非適用分の差損益（△27,813百万円）の合計△126,023百万円

（2）時価情報（ヘッジ会計非適用分）

①金利関連

（単位：百万円）

区 分	種 類	2016年度末				2017年度第2四半期(上半期)末			
		契約額等		時価	差損益	契約額等		時価	差損益
			うち1年超				うち1年超		
店 頭	金利スワップ								
	固定金利受取/変動金利支払	170	-	1	1	10,085	10,000	△ 17	△ 17
	固定金利支払/変動金利受取	44,100	44,100	71	71	58,100	31,100	25	25
	金利スワップション								
	売建								
	固定金利支払/変動金利受取	350,000 (1,672)	- (-)	67	1,604	255,000 (1,001)	- (-)	0	1,001
買建									
固定金利支払/変動金利受取	1,150,000 (18,214)	855,000 (14,947)	2,019	△ 16,194	1,130,000 (14,948)	855,000 (9,713)	2,490	△ 12,457	
合 計				△ 14,517				△ 11,448	

（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、スワップ取引については時価を記載し、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。

（参考）金利スワップ残存期間別残高

（単位：百万円、%）

区 分	2016年度末						
	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
受取側固定スワップ想定元本	170	-	-	-	-	-	170
平均受取固定金利	1.23	-	-	-	-	-	1.23
平均支払変動金利	0.03	-	-	-	-	-	0.03
支払側固定スワップ想定元本	-	43,000	-	-	-	1,100	44,100
平均支払固定金利	-	△ 0.13	-	-	-	1.08	△ 0.10
平均受取変動金利	-	0.01	-	-	-	0.03	0.01
合 計	170	43,000	-	-	-	1,100	44,270
区 分	2017年度第2四半期(上半期)末						
	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
受取側固定スワップ想定元本	85	-	-	-	10,000	-	10,085
平均受取固定金利	1.23	-	-	-	0.23	-	0.23
平均支払変動金利	△ 0.00	-	-	-	0.02	-	0.02
支払側固定スワップ想定元本	27,000	16,000	10,000	-	-	5,100	58,100
平均支払固定金利	△ 0.13	△ 0.14	0.09	-	-	0.70	△ 0.02
平均受取変動金利	0.01	0.04	0.02	-	-	0.03	0.02
合 計	27,085	16,000	10,000	-	10,000	5,100	68,185

②通貨関連

(単位：百万円)

区分	種類	2016年度末			2017年度第2四半期(上半期)末		
		契約額等	時価	差損益	契約額等	時価	差損益
店頭	為替予約						
	売建	918,930	△ 13,729	△ 13,729	2,089,565	△ 30,731	△ 30,731
	(米ドル)	387,025	△ 6,038	△ 6,038	943,088	△ 9,452	△ 9,452
	(ユーロ)	272,761	△ 4,075	△ 4,075	487,723	△ 12,388	△ 12,388
	(オーストラリアドル)	73,766	△ 3,146	△ 3,146	184,072	△ 2,650	△ 2,650
	(イギリスポンド)	21,983	205	205	151,245	△ 3,576	△ 3,576
	(カナダドル)	33,681	△ 122	△ 122	139,503	△ 1,734	△ 1,734
	(その他)	129,711	△ 552	△ 552	183,932	△ 928	△ 928
	買建	998,303	6,000	6,000	2,095,826	18,444	18,444
	(米ドル)	576,403	4,135	4,135	1,001,971	11,421	11,421
	(ユーロ)	329,726	△ 520	△ 520	642,174	4,227	4,227
	(カナダドル)	16,164	△ 153	△ 153	133,166	865	865
	(オーストラリアドル)	16,946	524	524	96,711	204	204
	(イギリスポンド)	6,896	△ 22	△ 22	87,900	1,165	1,165
	(その他)	52,165	2,036	2,036	133,902	559	559
	通貨オプション						
	売建						
	コール	93,491			-		
	(690)		-	690	(-)	-	-
	(米ドル)	93,491			-		
	(690)		-	690	(-)	-	-
	買建						
	コール	-			126,661		
	(-)		-	-	(965)	2,213	1,248
	(米ドル)	-			90,127		
	(-)		-	-	(398)	890	492
	(ユーロ)	-			36,533		
(-)		-	-	(566)	1,322	756	
プット	521,866			712,751			
(7,321)		2,668	△ 4,652	(12,082)	6,449	△ 5,632	
(米ドル)	412,966			663,475			
(6,656)		2,445	△ 4,210	(11,877)	6,449	△ 5,428	
(ユーロ)	108,899			26,570			
(664)		223	△ 441	(85)	-	△ 85	
(イギリスポンド)	-			22,705			
(-)		-	-	(118)	-	△ 118	
合計			△ 11,690			△ 16,671	

- (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. 差損益欄には、為替予約については時価を記載し、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。
4. 上表において、残存期間1年超の取引はありません。

③株式関連

(単位：百万円)

区分	種類	2016年度末			2017年度第2四半期(上半期)末		
		契約額等	時価	差損益	契約額等	時価	差損益
取引所	円建株価指数先物 買建	15,387	△ 158	△ 158	9,877	506	506
	外貨建株価指数先物 売建	5,942	△ 217	△ 217	-	-	-
	買建	10,935	49	49	-	-	-
	円建株価指数オプション 買建	80,000			29,982		
	プット	(2,362)	10	△ 2,352	(941)	394	△ 547
合計				△ 2,678			△ 40

(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、先物取引については時価を記載し、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。

④債券関連

(単位：百万円)

区分	種類	2016年度末			2017年度第2四半期(上半期)末		
		契約額等	時価	差損益	契約額等	時価	差損益
取引所	円建債券先物 売建	9,298	△ 18	△ 18	6,052	38	38
	買建	4,499	9	9	-	-	-
	外貨建債券先物 売建	203,592	△ 619	△ 619	567,961	4,851	4,851
	買建	103,911	974	974	602,720	△ 5,170	△ 5,170
	外貨建債券先物オプション 買建	-			57,717		
	コール	(-)	-	-	(185)	21	△ 164
店頭	外貨建債券先渡契約 売建	-	-	-	40,708	300	300
	買建	-	-	-	127,639	△ 373	△ 373
	円建債券店頭オプション 売建	18,784			43,216		
	コール	(47)	90	△ 42	(325)	54	270
	プット	99,556	496	197	163,880	640	470
		(693)			(1,110)		
	買建	99,556			163,880		
コール	(453)	675	222	(875)	226	△ 648	
プット	18,784	160	41	43,216	284	△ 110	
	(119)			(395)			
合計				763			△ 536

(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時価を記載し、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。

⑤その他

(単位：百万円)

区分	種類	2016年度末				2017年度第2四半期(上半期)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
店頭	クレジット・デフォルト・スワップ プロテクション売建	28,000	25,000	674	674	37,500	35,500	901	901
	プロテクション買建	11,385	11,385	△ 119	△ 119	2,000	2,000	△ 17	△ 17
合計					554				883

(注) 差損益欄には、時価を記載しています。

(3) 時価情報 (ヘッジ会計適用分)

①金利関連

(単位：百万円)

ヘッジ会計の方法	種類	主なヘッジ対象	2016年度末				2017年度第2四半期(上半期)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
原則的処理方法	金利スワップ 固定金利受取/変動金利支払	貸付金	3,000	3,000	△ 18	△ 18	3,000	3,000	△ 13	△ 13
	固定金利受取/変動金利支払	保険負債	600,000	600,000	△ 20,541	△ 20,541	600,000	600,000	△ 15,888	△ 15,888
金利スワップの特例処理	金利スワップ 固定金利受取/変動金利支払	貸付金	19,800	16,800	189	189	19,800	15,300	164	164
	固定金利支払/変動金利受取	借入金	283,000	283,000	△ 3,161	△ 3,161	283,000	283,000	△ 2,927	△ 2,927
合計						△ 23,531				△ 18,665

(注) 差損益欄には、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	2016年度末							合計
	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		
受取側固定スワップ想定元本	3,000	4,500	7,000	6,000	2,300	600,000	622,800	
平均受取固定金利	1.62	△ 0.00	0.17	△ 0.02	1.19	0.43	0.43	
平均支払変動金利	0.02	△ 0.00	0.02	0.03	0.06	0.02	0.02	
支払側固定スワップ想定元本	-	-	139,000	144,000	-	-	283,000	
平均支払固定金利	-	-	0.28	0.42	-	-	0.35	
平均受取変動金利	-	-	0.11	0.11	-	-	0.11	
合計	3,000	4,500	146,000	150,000	2,300	600,000	905,800	

区分	2017年度第2四半期(上半期)末							合計
	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		
受取側固定スワップ想定元本	4,500	5,000	5,000	6,000	2,300	600,000	622,800	
平均受取固定金利	1.20	0.14	△ 0.02	△ 0.02	1.19	0.43	0.43	
平均支払変動金利	0.01	△ 0.02	△ 0.01	△ 0.00	0.06	0.00	0.00	
支払側固定スワップ想定元本	-	-	139,000	144,000	-	-	283,000	
平均支払固定金利	-	-	0.28	0.42	-	-	0.35	
平均受取変動金利	-	-	0.11	0.11	-	-	0.11	
合計	4,500	5,000	144,000	150,000	2,300	600,000	905,800	

②通貨関連

(単位：百万円)

ヘッジ会計の方法	種 類	主なヘッジ対象	2016年度末				2017年度第2四半期(上半期)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	
原則的処理方法	通貨スワップ	外貨建債券	266,142	252,943	3,541	3,541	274,039	255,962	△ 5,607	△ 5,607	
	(米ドル)		204,574	191,375	△ 953	△ 953	207,917	189,840	△ 3,286	△ 3,286	
	(ユーロ)		61,568	61,568	4,494	4,494	61,568	61,568	△ 2,323	△ 2,323	
	(イギリスポンド)		-	-	-	-	4,554	4,554	2	2	
ヘッジ対象に係る損益を認識する方法	為替予約	外貨建債券									
	売建		5,215,748	-	△ 140,242	△ 140,242	5,405,632	-	△ 96,101	△ 96,101	
	(米ドル)		2,948,262	-	△ 81,896	△ 81,896	2,962,372	-	△ 16,239	△ 16,239	
	(ユーロ)		1,090,351	-	△ 8,294	△ 8,294	1,277,968	-	△ 28,002	△ 28,002	
	(オーストラリアドル)		415,851	-	△ 22,627	△ 22,627	417,096	-	△ 17,369	△ 17,369	
	(イギリスポンド)		125,768	-	△ 1,271	△ 1,271	128,181	-	△ 4,701	△ 4,701	
	(カナダドル)		138,358	-	△ 8,876	△ 8,876	113,828	-	△ 9,017	△ 9,017	
	(その他)		497,156	-	△ 17,274	△ 17,274	506,185	-	△ 20,770	△ 20,770	
	買建		27,390	-	△ 42	△ 42	292,957	-	7,357	7,357	
	(オーストラリアドル)		0	-	0	0	71,534	-	4,467	4,467	
	(米ドル)		18,150	-	△ 157	△ 157	70,061	-	1,846	1,846	
	(カナダドル)		-	-	-	-	3,291	-	44	44	
	(ユーロ)		3,000	-	△ 43	△ 43	810	-	19	19	
	(イギリスポンド)		60	-	△ 1	△ 1	7	-	0	0	
	(その他)		6,178	-	159	159	147,251	-	978	978	
	通貨オプション										
	売建										
	コール		-				100,746				
	(米ドル)		(-)	(-)	-	-	(2,077)	(-)	3,206	△ 1,128	
			-				100,746				
	(-)	(-)	-	-	(2,077)	(-)	3,206	△ 1,128			
買建											
プット	-				100,746						
(米ドル)	(-)	(-)	-	-	(2,098)	(-)	857	△ 1,240			
	-				100,746						
	(-)	(-)	-	-	(2,098)	(-)	857	△ 1,240			
為替予約等の振当処理	為替予約	外貨建定期預金									
	売建		314,849	-	-	-	309,722	-	-	-	
	(オーストラリアドル)		122,516	-	-	-	119,422	-	-	-	
	(米ドル)		81,866	-	-	-	79,873	-	-	-	
	(その他)		110,465	-	-	-	110,427	-	-	-	
	通貨スワップ		外貨建社債(負債)	476,277	476,277	-	-	476,277	476,277	-	-
	(米ドル)			476,277	476,277	-	-	476,277	476,277	-	-
	通貨スワップ		外貨建貸付金	38,521	38,521	-	-	38,087	38,087	-	-
	(米ドル)			32,557	32,557	-	-	32,122	32,122	-	-
	(ユーロ)			5,964	5,964	-	-	5,964	5,964	-	-
合 計											
					△ 136,742				△ 96,720		

(注) 1. 各期末の為替相場は先物相場を使用しています。

2. 為替予約及び通貨スワップの振当処理によるものは、ヘッジ対象とされている外貨建定期預金、外貨建社債(負債)及び外貨建貸付金と一体処理されているため、その時価は、当該外貨建定期預金、外貨建社債(負債)及び外貨建貸付金の時価を含めて記載しています。

3. 差損益欄には、為替予約及び通貨スワップ取引については時価を記載し、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。(注2.を除く)

③株式関連

(単位：百万円)

ヘッジ会計の方法	種 類	主なヘッジ対象	2016年度末				2017年度第2四半期(上半期)末			
			契約額等		時価	差損益	契約額等		時価	差損益
				うち1年超				うち1年超		
ヘッジ対象に係る損益を認識する方法	国内株式先渡契約 売建	国内株式	26,264	-	1,246	1,246	28,098	-	△ 7,097	△ 7,097
合 計						1,246				△ 7,097

(注) 差損益欄には、時価を記載しています。

④債券関連

(単位：百万円)

ヘッジ会計の方法	種 類	主なヘッジ対象	2016年度末				2017年度第2四半期(上半期)末			
			契約額等		時価	差損益	契約額等		時価	差損益
				うち1年超				うち1年超		
原則的処理方法	外貨建債券店頭オプション 売建	外貨建債券	62,192	-	1,030	△ 127	-	-	-	-
	コール		(902)				(-)			
	買建 プット		62,192	-	313	△ 589	-	-	-	-
			(902)				(-)			
合 計						△ 717				-

(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. 差損益欄にはオプション料と時価との差額を記載しています。

⑤その他

2016年度末、2017年度第2四半期(上半期)末ともに期末残高がないため、記載していません。