

2018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）	8頁
(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	2017年度末		2018年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
国 債	13,887,258	46.1	13,688,755	45.1
地 方 債	119,575	0.4	131,548	0.4
社 債	1,906,605	6.3	1,976,309	6.5
うち公社・公団債	399,483	1.3	420,043	1.4
株 式	3,696,766	12.3	3,694,650	12.2
外 国 証 券	9,942,625	33.0	10,372,209	34.2
公 社 債	8,520,524	28.3	9,075,556	29.9
株 式 等	1,422,100	4.7	1,296,652	4.3
そ の 他 の 証 券	543,845	1.8	476,863	1.6
合 計	30,096,677	100.0	30,340,335	100.0

(2) 有価証券残存期間別残高

(単位：百万円)

区 分	2017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	633,072	1,339,683	1,099,213	1,291,978	3,370,154	22,362,575	30,096,677	
国 債	178,397	275,514	77,149	380,021	1,135,715	11,840,458	13,887,258	
地 方 債	4,926	26,098	4,150	5,734	20,076	58,589	119,575	
社 債	87,277	232,202	166,433	143,435	331,788	945,468	1,906,605	
株 式	-	-	-	-	-	3,696,766	3,696,766	
外 国 証 券	316,437	773,639	798,759	739,477	1,795,454	5,518,856	9,942,625	
公 社 債	311,734	772,340	789,199	724,955	1,759,192	4,163,101	8,520,524	
株 式 等	4,702	1,299	9,560	14,521	36,261	1,355,755	1,422,100	
そ の 他 の 証 券	46,033	32,227	52,720	23,309	87,118	302,435	543,845	
買 入 金 銭 債 権	2,013	-	3,060	-	-	186,034	191,108	
譲 渡 性 預 金	49,995	-	-	-	-	-	49,995	
そ の 他	-	-	-	-	-	59,348	59,348	
区 分	2018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	541,385	1,817,216	1,087,679	1,491,470	3,215,532	22,187,051	30,340,335	
国 債	73,390	263,820	109,096	438,867	1,191,452	11,612,126	13,688,755	
地 方 債	3,723	28,311	7,974	6,772	18,079	66,687	131,548	
社 債	93,723	234,282	165,583	148,829	329,675	1,004,215	1,976,309	
株 式	-	-	-	-	-	3,694,650	3,694,650	
外 国 証 券	321,389	1,243,327	769,310	838,730	1,616,569	5,582,881	10,372,209	
公 社 債	315,651	1,243,327	750,406	808,523	1,585,514	4,372,133	9,075,556	
株 式 等	5,737	-	18,904	30,207	31,055	1,210,748	1,296,652	
そ の 他 の 証 券	49,158	47,475	35,714	58,269	59,754	226,490	476,863	
買 入 金 銭 債 権	-	-	6,818	-	-	188,033	194,851	
譲 渡 性 預 金	79,994	-	-	-	-	-	79,994	
そ の 他	-	-	-	-	-	90,642	90,642	

(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	2017年度末		2018年度 第2四半期(上半期)末		
	金 額	占 率	金 額	占 率	
水 産 ・ 農 林 業	1,291	0.0	1,349	0.0	
鉱 業	200	0.0	200	0.0	
建 設 業	123,115	3.3	117,296	3.2	
製 造 業	食 料 品	228,596	6.2	214,842	5.8
	織 維 製 品	34,907	0.9	31,379	0.8
	パ ル プ ・ 紙	3,772	0.1	3,972	0.1
	化 学	208,605	5.6	206,701	5.6
	医 薬 品	67,519	1.8	73,130	2.0
	石 油 ・ 石 炭 製 品	6,386	0.2	6,163	0.2
	ゴ ム 製 品	28,554	0.8	24,973	0.7
	ガ ラ ス ・ 土 石 製 品	113,081	3.1	120,451	3.3
	鉄 鋼	58,817	1.6	58,680	1.6
	非 鉄 金 属	19,063	0.5	19,385	0.5
	金 属 製 品	45,837	1.2	42,125	1.1
	機 械	247,753	6.7	220,928	6.0
	電 気 機 器	671,531	18.2	630,325	17.1
	輸 送 用 機 器	219,804	5.9	209,943	5.7
	精 密 機 器	140,598	3.8	157,459	4.3
	そ の 他 製 品	68,856	1.9	71,303	1.9
電 気 ・ ガ ス 業	103,212	2.8	110,213	3.0	
運 輸 ・ 情 報 通 信 業	陸 運 業	323,356	8.7	365,424	9.9
	海 運 業	52	0.0	59	0.0
	空 運 業	6,313	0.2	4,803	0.1
	倉 庫 ・ 運 輸 関 連 業	5,150	0.1	5,040	0.1
	情 報 ・ 通 信 業	100,913	2.7	100,903	2.7
商 業	卸 売 業	154,385	4.2	156,991	4.2
	小 売 業	131,832	3.6	130,060	3.5
金 融 ・ 保 険 業	銀 行 業	290,914	7.9	278,746	7.5
	証 券 ・ 商 品 先 物 取 引 業	1,307	0.0	459	0.0
	保 険 業	21,774	0.6	21,640	0.6
	そ の 他 金 融 業	26,629	0.7	28,757	0.8
不 動 産 業	19,779	0.5	19,276	0.5	
サ ー ビ ス 業	222,847	6.0	261,657	7.1	
合 計	3,696,766	100.0	3,694,650	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
2017年度末	変動金利	7,762	5,560	35,559	10,311	6,731	74,601	140,526
	固定金利	321,793	282,068	384,969	350,956	345,141	378,520	2,063,449
	一般貸付計	329,555	287,629	420,528	361,268	351,872	453,122	2,203,976
2018年度 第2四半期 (上半期)末	変動金利	368	5,346	22,052	6,211	7,740	73,686	115,405
	固定金利	305,607	294,357	391,405	283,714	371,783	321,087	1,967,955
	一般貸付計	305,975	299,703	413,457	289,925	379,523	394,774	2,083,360

（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		2017年度末		2018年度 第2四半期(上半期)末	
		貸付先数	占 率	貸付先数	占 率
大 企 業	貸付先数	223	67.6	218	67.1
	金 額	1,604,877	84.9	1,554,758	87.0
中 堅 企 業	貸付先数	9	2.7	7	2.2
	金 額	3,908	0.2	3,961	0.2
中 小 企 業	貸付先数	98	29.7	100	30.8
	金 額	281,689	14.9	229,176	12.8
国内企業向け 貸付計		貸付先数 金 額	330 100.0 1,890,475 100.0	325 100.0 1,787,896 100.0	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10億円 以上	常用する 従業員 100名超 かつ	資本金10億円 以上	常用する 従業員 100名超 かつ	資本金10億円 以上
中 堅 企 業		資本金3億円超 10億円未満		資本金5千万円超 10億円未満		資本金5千万円超 10億円未満		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		2017年度末		2018年度 第2四半期(上半期)末	
		金 額	占 率	金 額	占 率
担 保 貸 付		10,993	0.5	12,933	0.6
	有 価 証 券 担 保 貸 付	9,644	0.4	11,764	0.6
	不動産・動産・財団 担 保 貸 付	1,152	0.1	1,169	0.1
	指 名 債 権 担 保 貸 付	196	0.0	-	-
保 証 貸 付		63,820	2.9	56,160	2.7
信 用 貸 付		2,128,719	96.6	2,013,881	96.7
そ の 他		442	0.0	384	0.0
一 般 貸 付 計		2,203,976	100.0	2,083,360	100.0
	うち劣後特約付 貸 付	286,364	13.0	253,025	12.1

（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		2017年度末		2018年度 第2四半期(上半期)末	
		金 額	占 率	金 額	占 率
国内向け	製 造 業	335,034	15.2	328,512	15.8
	食 料	42,666	1.9	42,440	2.0
	織 維	2,873	0.1	2,997	0.1
	木 材 ・ 木 製 品	200	0.0	500	0.0
	パ ル プ ・ 紙	10,596	0.5	10,472	0.5
	印 刷	12,538	0.6	12,528	0.6
	化 学	19,776	0.9	18,736	0.9
	石 油 ・ 石 炭	12,260	0.6	10,260	0.5
	窯 業 ・ 土 石	29,338	1.3	29,115	1.4
	鉄 鋼	68,000	3.1	71,410	3.4
	非 鉄 金 属	6,258	0.3	6,026	0.3
	金 属 製 品	504	0.0	1,006	0.0
	はん用・生産用・業務用機械	35,078	1.6	34,767	1.7
	電 気 機 械	69,678	3.2	65,051	3.1
	輸 送 用 機 械	15,811	0.7	14,488	0.7
	そ の 他 の 製 造 業	9,452	0.4	8,710	0.4
	農 業 、 林 業	-	-	-	-
	漁 業	-	-	-	-
	鉱業、採石業、砂利採取業	-	-	-	-
	建 設 業	10,212	0.5	9,611	0.5
	電気・ガス・熱供給・水道業	459,096	20.8	445,927	21.4
	情 報 通 信 業	60,566	2.7	41,761	2.0
	運 輸 業 、 郵 便 業	248,850	11.3	244,894	11.8
	卸 売 業	398,969	18.1	383,132	18.4
	小 売 業	11,137	0.5	10,079	0.5
	金 融 業 、 保 険 業	368,454	16.7	308,303	14.8
	不 動 産 業	120,239	5.5	130,173	6.2
	物 品 賃 貸 業	104,476	4.7	102,422	4.9
	学術研究、専門・技術サービス業	844	0.0	1,297	0.1
	宿 泊 業	-	-	-	-
	飲 食 業	-	-	-	-
	生活関連サービス業・娯楽業	3,805	0.2	3,604	0.2
	教 育 、 学 習 支 援 業	-	-	-	-
医 療 ・ 福 祉	150	0.0	1,150	0.1	
そ の 他 の サ ー ビ ス	3,690	0.2	3,447	0.2	
地 方 公 共 団 体	23,809	1.1	22,628	1.1	
個人（住宅・消費・納税資金等）	442	0.0	384	0.0	
そ の 他	200	0.0	133	0.0	
合 計	2,149,978	97.5	2,037,464	97.8	
海外向け	政 府 等	-	-	-	-
	金 融 機 関	11,544	0.5	8,544	0.4
	商 工 業 等	42,453	1.9	37,351	1.8
	合 計	53,998	2.5	45,896	2.2
一 般 貸 付 計		2,203,976	100.0	2,083,360	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	2017年度末		2018年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
公 社 債	7,670,095	70.3	8,256,232	72.9
株 式	854,472	7.8	835,733	7.4
現 預 金 ・ そ の 他	413,569	3.8	345,825	3.1
小 計	8,938,137	82.0	9,437,791	83.4

②円貨額が確定した外貨建資産

（単位：百万円、％）

区 分	2017年度末		2018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	301,575	2.8	331,089	2.9
小 計	301,575	2.8	331,089	2.9

③円貨建資産

（単位：百万円、％）

区 分	2017年度末		2018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	36,545	0.3	28,901	0.3
公 社 債 (円建外債) ・ そ の 他	1,627,922	14.9	1,521,244	13.4
小 計	1,664,467	15.3	1,550,145	13.7

④合 計

（単位：百万円、％）

区 分	2017年度末		2018年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
海 外 投 融 資	10,904,181	100.0	11,319,026	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	2017年度末		2018年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
米 ド ル	4,665,738	52.2	5,087,175	53.9
ユ ー ロ	2,236,863	25.0	2,272,993	24.1
オーストラリアドル	655,013	7.3	639,870	6.8
イギリスポンド	269,558	3.0	280,383	3.0
ニュージーランドドル	208,633	2.3	204,417	2.2
ポーランドズロチ	192,438	2.2	172,810	1.8
カナダドル	207,727	2.3	170,314	1.8
そ の 他 共 計	8,938,137	100.0	9,437,791	100.0

(3) 海外投融資の地域別構成

(単位：百万円、%)

区 分	2017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	4,019,420	40.4	3,644,056	42.8	375,364	26.4	9,731	18.0
ヨーロッパ	3,168,884	31.9	2,936,942	34.5	231,941	16.3	11,112	20.6
オセアニア	814,234	8.2	775,313	9.1	38,921	2.7	5,000	9.3
アジア	255,259	2.6	121,359	1.4	133,899	9.4	2,130	3.9
中南米	1,493,860	15.0	852,399	10.0	641,461	45.1	26,024	48.2
中 東	18,126	0.2	18,126	0.2	-	-	-	-
アフリカ	21,610	0.2	21,099	0.2	511	0.0	-	-
国際機関	151,228	1.5	151,228	1.8	-	-	-	-
合 計	9,942,625	100.0	8,520,524	100.0	1,422,100	100.0	53,998	100.0
区 分	2018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	4,409,056	42.5	4,045,065	44.6	363,991	28.1	9,457	20.6
ヨーロッパ	3,211,641	31.0	2,974,265	32.8	237,376	18.3	4,521	9.9
オセアニア	805,044	7.8	763,291	8.4	41,752	3.2	5,000	10.9
アジア	284,293	2.7	174,833	1.9	109,459	8.4	969	2.1
中南米	1,485,415	14.3	941,808	10.4	543,607	41.9	25,948	56.5
中 東	10,756	0.1	10,509	0.1	246	0.0	-	-
アフリカ	219	0.0	-	-	219	0.0	-	-
国際機関	165,783	1.6	165,783	1.8	-	-	-	-
合 計	10,372,209	100.0	9,075,556	100.0	1,296,652	100.0	45,896	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	2017年度末						2018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	△ 12,843	178,877	△ 24	-	-	166,008	△ 23,347	△ 151,429	-	-	-	△ 174,777
ヘッジ会計非適用分	△ 8,379	△ 5,452	△ 968	△ 453	639	△ 14,613	△ 3,133	△ 12,499	△ 2,949	△ 1,080	357	△ 19,306
合 計	△ 21,223	173,424	△ 993	△ 453	639	151,394	△ 26,481	△ 163,928	△ 2,949	△ 1,080	357	△ 194,083

（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。
 2017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162,282百万円、株式関連△24百万円）及びヘッジ会計非適用分の差損益（△14,613百万円）の合計147,643百万円
 2018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△153,980百万円）及びヘッジ会計非適用分の差損益（△19,306百万円）の合計△173,286百万円

（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	2017年度末				2018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	121,000	121,000	986	986	21,000	21,000	△ 115	△ 115
	固定金利支払/変動金利受取	61,000	34,000	△ 2	△ 2	49,000	33,000	361	361
	金利スワップション								
	売建								
	固定金利受取/変動金利支払	10,000	-	19	△ 0	-	-	-	-
	(19)	(-)			(-)	(-)			
	固定金利支払/変動金利受取	10,000	-	0	38	70,000	-	551	△ 365
	(39)	(-)			(186)	(-)			
	買建								
固定金利支払/変動金利受取	1,130,000	705,000	2,268	△ 9,401	1,170,000	995,000	3,787	△ 3,014	
(11,670)	(4,579)			(6,801)	(5,400)				
合 計				△ 8,379				△ 3,133	

（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	2017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	-	-	-	-	21,000	100,000	121,000	
平均受取固定金利	-	-	-	-	0.25	0.67	0.60	
平均支払変動金利	-	-	-	-	0.02	△ 0.00	0.00	
支払側固定スワップ想定元本	27,000	16,000	10,000	-	-	8,000	61,000	
平均支払固定金利	△ 0.13	△ 0.14	0.09	-	-	0.82	0.03	
平均受取変動金利	0.01	0.00	0.02	-	-	0.01	0.01	
合 計	27,000	16,000	10,000	-	21,000	108,000	182,000	
区 分	2018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	-	-	-	-	21,000	-	21,000	
平均受取固定金利	-	-	-	-	0.25	-	0.25	
平均支払変動金利	-	-	-	-	0.02	-	0.02	
支払側固定スワップ想定元本	16,000	-	10,000	-	-	23,000	49,000	
平均支払固定金利	△ 0.14	-	0.09	-	-	0.87	0.38	
平均受取変動金利	0.02	-	0.02	-	-	0.00	0.01	
合 計	16,000	-	10,000	-	21,000	23,000	70,000	

②通貨関連

(単位：百万円)

区分	種類	2017年度末			2018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	2,486,021	19,645	19,645	1,499,064	△ 12,861	△ 12,861
	(米ドル)	1,185,073	1,876	1,876	574,316	△ 5,922	△ 5,922
	(ユーロ)	739,523	9,606	9,606	399,347	△ 4,281	△ 4,281
	(オーストラリアドル)	260,895	6,061	6,061	168,752	△ 279	△ 279
	(イギリスポンド)	29,672	308	308	60,799	△ 1,218	△ 1,218
	(カナダドル)	81,880	803	803	53,514	△ 182	△ 182
	(その他)	188,975	989	989	242,333	△ 975	△ 975
	買建	2,390,220	△ 29,000	△ 29,000	1,197,643	3,687	3,687
	(米ドル)	1,131,508	△ 7,486	△ 7,486	666,877	27	27
	(ユーロ)	805,963	△ 17,312	△ 17,312	271,465	2,568	2,568
	(オーストラリアドル)	207,906	△ 3,152	△ 3,152	65,617	△ 22	△ 22
	(イギリスポンド)	11,133	△ 30	△ 30	44,284	707	707
	(カナダドル)	57,305	△ 290	△ 290	19,651	158	158
	(その他)	176,402	△ 728	△ 728	129,747	248	248
	通貨オプション						
	売建						
	プット	251,112			105,157		
	(米ドル)	(11,351)	9,466	1,885	(620)	442	177
	(イギリスポンド)	251,112	9,466	1,885	105,157		
	(イギリスポンド)	(11,351)			(620)	442	177
	買建						
	コール	10,076			-		
	(米ドル)	(-)	-	-	(-)	-	-
	(イギリスポンド)	10,076			-		
	(イギリスポンド)	(-)	-	-	(-)	-	-
	プット	719,375			518,139		
(米ドル)	(14,112)	16,130	2,017	(9,274)	5,771	△ 3,503	
(イギリスポンド)	708,956	16,130	2,070	518,139			
(イギリスポンド)	(14,059)			(9,274)	5,771	△ 3,503	
(イギリスポンド)	10,418			-			
(イギリスポンド)	(53)	-	△ 53	(-)	-	-	
合計			△ 5,452			△ 12,499	

- (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	2017年度末			2018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	外貨建株価指数先物 買建	-	-	-	1,017	15	15
	円建株価指数オプション 買建						
	プット	149,967 (4,391)	3,538	△ 853	158,436 (3,439)	1,256	△ 2,182
	外貨建株価指数オプション 買建						
	コール	- (-)	-	-	15,504 (297)	594	296
	プット	49,761 (1,394)	1,278	△ 115	61,726 (1,439)	361	△ 1,078
合計				△ 968		△ 2,949	

(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	2017年度末			2018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	16,603	18	18	-	-	-
	買建	-	-	-	9,010	△ 5	△ 5
	外貨建債券先物 売建	467,001	△ 5,904	△ 5,904	711,180	7,266	7,266
	買建	527,241	5,431	5,431	766,524	△ 7,967	△ 7,967
	外貨建債券先物オプション 買建						
	コール	50,995 (351)	531	179	(-)	-	-
プット	50,995 (298)	39	△ 258	(-)	-	-	
店頭	外貨建債券先渡契約 売建	80,181	△ 512	△ 512	134,023	839	839
	買建	108,853	277	277	154,037	△ 615	△ 615
	円建債券店頭オプション 売建						
	コール	4,977 (29)	41	△ 12	25,010 (51)	17	33
	プット	92,197 (422)	274	147	96,711 (586)	1,018	△ 431
	買建						
コール	92,197 (269)	458	189	96,711 (427)	219	△ 208	
プット	4,977 (44)	36	△ 8	25,010 (72)	79	7	
合計				△ 453		△ 1,080	

(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	2017年度末				2018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	32,000	29,000	617	617	30,000	21,000	420	420
	プロテクション買建	1,000	1,000	22	22	3,000	3,000	△ 62	△ 62
合計					639				357

(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	2017年度末				2018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	4,000	4,000	△ 7	△ 7	4,500	4,500	△ 13	△ 13
	固定金利受取/変動金利支払	保険負債	600,000	600,000	△ 10,484	△ 10,484	700,000	700,000	△ 21,523	△ 21,523
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	16,800	15,300	137	137	15,300	15,300	101	101
	固定金利支払/変動金利受取	借入金	283,000	283,000	△ 2,489	△ 2,489	283,000	283,000	△ 1,911	△ 1,911
合計						△ 12,843				△ 23,347

(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	2017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	1,500	3,000	8,000	6,000	2,300	600,000	620,800	
平均受取固定金利	0.37	0.46	0.04	△ 0.02	1.19	0.43	0.42	
平均支払変動金利	0.01	△ 0.02	0.03	△ 0.00	0.07	0.01	0.01	
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	-	0.12	0.12	-	-	-	0.12	
合計	1,500	142,000	152,000	6,000	2,300	600,000	903,800	
区分	2018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	-	7,000	10,500	-	2,300	700,000	719,800	
平均受取固定金利	-	0.17	0.04	-	1.19	0.47	0.46	
平均支払変動金利	-	0.02	0.05	-	0.07	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	-	0.13	0.13	-	-	-	0.13	
合計	-	146,000	154,500	-	2,300	700,000	1,002,800	

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	2017年度末				2018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	273,422	250,038	16,595	16,595	276,164	245,832	2,550	2,550	
	(米ドル)		199,735	176,351	17,303	17,303	201,506	173,861	3,403	3,403	
	(ユーロ)		61,568	61,568	△ 1,226	△ 1,226	62,543	59,856	△ 1,597	△ 1,597	
	(イギリスポンド)		12,119	12,119	517	517	12,114	12,114	745	745	
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		5,252,956	-	163,366	163,366	5,415,288	-	△ 154,959	△ 154,959	
	(米ドル)		2,792,212	-	100,027	100,027	2,898,198	-	△ 123,941	△ 123,941	
	(ユーロ)		1,422,032	-	28,035	28,035	1,550,756	-	△ 8,481	△ 8,481	
	(オーストラリアドル)		360,649	-	15,883	15,883	367,566	-	△ 4,765	△ 4,765	
	(イギリスポンド)		132,251	-	2,504	2,504	124,083	-	△ 1,671	△ 1,671	
	(カナダドル)		112,785	-	7,260	7,260	86,379	-	△ 2,770	△ 2,770	
	(その他)		433,024	-	9,654	9,654	388,303	-	△ 13,329	△ 13,329	
	買建		118,466	-	△ 2,217	△ 2,217	33,400	-	979	979	
	(米ドル)		118,253	-	△ 2,214	△ 2,214	28,403	-	816	816	
	(ユーロ)		83	-	△ 1	△ 1	3,665	-	119	119	
	(カナダドル)		-	-	-	-	70	-	2	2	
	(イギリスポンド)		62	-	△ 0	△ 0	42	-	1	1	
	(その他)		67	-	△ 1	△ 1	1,218	-	40	40	
	通貨オプション										
	売建										
	コール		93,057	-	-	-	-	-	-	-	-
	(米ドル)		(1,686)	(-)	824	861	(-)	(-)	-	-	-
	買建		93,057	-	-	-	-	-	-	-	-
	プット		(1,686)	(-)	1,958	271	(-)	(-)	-	-	-
(米ドル)	93,057	-	-	-	-	-	-	-	-		
	(1,686)	(-)	1,958	271	(-)	(-)	-	-	-		
為替予約等の振当処理	為替予約	外貨建定期預金									
	売建		262,693	-	-	-	292,554	-	-	-	
	(米ドル)		32,904	-	-	-	143,498	-	-	-	
	(オーストラリアドル)		119,405	-	-	-	79,498	-	-	-	
	(その他)		110,383	-	-	-	69,557	-	-	-	
	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	38,081	38,081	-	-	37,623	37,623	-	-
	(米ドル)			32,116	32,116	-	-	31,659	31,659	-	-
	(ユーロ)			5,964	5,964	-	-	5,964	5,964	-	-
合 計					178,877				△ 151,429		

(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に含めて記載しています。

4. 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3.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	2017年度末				2018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	9,559	-	△ 24	△ 24	-	-	-	-
合 計						△ 24				-

(注) 差損益欄には、時価を記載しています。

④債券関連

2017年度末、2018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。

⑤その他

2017年度末、2018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。