

2019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）	12頁

	& \$ % ,		& \$ % - & fl ₺	
	13,674,544	45.7	13,844,533	45.1
	129,427	0.4	128,276	0.4
	1,956,735	6.5	2,047,813	6.7
	418,607	1.4	425,559	1.4
	3,395,945	11.4	3,283,040	10.7
	10,122,795	33.9	10,554,422	34.4
	8,933,476	29.9	9,502,852	30.9
	1,189,319	4.0	1,051,569	3.4
	610,282	2.0	862,647	2.8
	29,889,730	100.0	30,720,734	100.0

	& \$ % ,						
					% \$	% \$ fl ₺	
	571,899	1,439,737	1,416,762	1,607,610	3,209,364	21,644,357	29,889,730
	154,093	117,533	276,096	453,345	1,229,401	11,444,074	13,674,544
	1,716	27,195	5,747	15,073	9,210	70,484	129,427
	99,421	175,236	207,558	207,202	212,166	1,055,149	1,956,735
	-	-	-	-	-	3,395,945	3,395,945
	295,102	1,062,532	868,594	891,096	1,560,423	5,445,046	10,122,795
	290,829	1,061,628	848,430	860,939	1,520,199	4,351,449	8,933,476
	4,273	903	20,164	30,156	40,224	1,093,597	1,189,319
	21,565	57,239	58,764	40,893	198,161	233,657	610,282
	-	1,307	3,354	3,590	6,407	184,532	199,193
	69,995	-	-	-	-	-	69,995
	-	-	-	-	-	24,747	24,747

	& \$ % - & fl ₺						
					% \$	% \$ fl ₺	
	656,425	1,321,218	1,351,282	1,973,970	3,433,329	21,984,507	30,720,734
	190,271	44,002	292,571	553,345	1,219,487	11,544,855	13,844,533
	10,394	18,904	4,294	19,287	4,914	70,482	128,276
	103,156	156,100	241,025	225,535	211,952	1,110,043	2,047,813
	-	-	-	-	-	3,283,040	3,283,040
	341,331	1,064,146	793,446	1,082,222	1,511,685	5,761,590	10,554,422
	337,910	1,059,640	777,127	1,043,162	1,464,750	4,820,260	9,502,852
	3,421	4,506	16,318	39,059	46,934	941,329	1,051,569
	11,272	38,064	19,945	93,579	485,289	214,495	862,647
	-	3,639	-	10,416	9,806	181,827	205,689
	110,993	-	-	-	-	-	110,993
	-	-	-	-	-	55,198	55,198

fl ₺

% \$

(3) 業種別国内株式保有明細表

(単位：百万円、%)

区 分		2018年度末		2019年度 第2四半期(上半期)末	
		金 額	占 率	金 額	占 率
水 産 ・ 農 林 業		1,335	0.0	1,273	0.0
鉱 業		552	0.0	528	0.0
建 設 業		115,051	3.4	114,640	3.5
製 造 業	食 料 品	207,215	6.1	211,929	6.5
	織 維 製 品	26,342	0.8	25,072	0.8
	パ ル プ ・ 紙	3,565	0.1	3,075	0.1
	化 学	189,937	5.6	183,162	5.6
	医 薬 品	65,930	1.9	69,978	2.1
	石 油 ・ 石 炭 製 品	3,913	0.1	3,327	0.1
	ゴ ム 製 品	24,760	0.7	23,749	0.7
	ガ ラ ス ・ 土 石 製 品	98,892	2.9	91,202	2.8
	鉄 鋼	48,609	1.4	35,158	1.1
	非 鉄 金 属	15,415	0.5	12,682	0.4
	金 属 製 品	35,345	1.0	35,904	1.1
	機 械	190,797	5.6	202,139	6.2
	電 気 機 器	573,859	16.9	570,036	17.4
	輸 送 用 機 器	183,591	5.4	178,408	5.4
	精 密 機 器	157,847	4.6	148,011	4.5
	そ の 他 製 品	68,430	2.0	68,448	2.1
電 気 ・ ガ ス 業		123,635	3.6	107,515	3.3
運 輸 ・ 情 報 通 信 業	陸 運 業	378,360	11.1	358,370	10.9
	海 運 業	45	0.0	41	0.0
	空 運 業	4,904	0.1	4,371	0.1
	倉 庫 ・ 運 輸 関 連 業	4,474	0.1	4,175	0.1
	情 報 ・ 通 信 業	95,870	2.8	51,991	1.6
商 業	卸 売 業	133,503	3.9	131,387	4.0
	小 売 業	111,988	3.3	106,217	3.2
金 融 ・ 保 険 業	銀 行 業	233,134	6.9	212,314	6.5
	証 券、商 品 先 物 取 引 業	283	0.0	254	0.0
	保 険 業	3,331	0.1	3,574	0.1
	そ の 他 金 融 業	27,325	0.8	27,499	0.8
不 動 産 業		18,442	0.5	20,126	0.6
サ ー ビ ス 業		249,252	7.3	276,469	8.4
合 計		3,395,945	100.0	3,283,040	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	(期間の定めのないものを含む)	
2018年度末	変動金利	425	9,106	20,497	7,084	2,618	87,180	126,912
	固定金利	292,448	312,130	372,426	263,580	304,030	336,246	1,880,863
	一般貸付計	292,873	321,236	392,924	270,665	306,649	423,427	2,007,776
2019年度 第2四半期 (上半期)末	変動金利	4,974	18,138	14,454	7,508	1,808	99,783	146,667
	固定金利	253,785	333,086	368,515	265,622	331,532	310,827	1,863,370
	一般貸付計	258,760	351,224	382,969	273,131	333,340	410,611	2,010,038

（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		2018年度末		2019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	213	66.1	213	65.3
	金 額	1,478,341	86.0	1,478,576	85.8
中 堅 企 業	貸付先数	7	2.2	7	2.1
	金 額	4,607	0.3	4,163	0.2
中 小 企 業	貸付先数	102	31.7	106	32.5
	金 額	236,564	13.8	241,413	14.0
国内企業向け 貸付計		322	100.0	326	100.0
		1,719,513	100.0	1,724,153	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	2018年度末		2019年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
担 保 貸 付	13,212	0.7	2,681	0.1
有 価 証 券 付 担 保 貸 付	11,571	0.6	1,188	0.1
不 動 産・動 産・ 財 団 担 保 貸 付 指 込 債 権 付	1,640	0.1	1,492	0.1
保 証 貸 付	132,224	6.6	125,943	6.3
信 用 貸 付	1,862,339	92.8	1,881,413	93.6
そ の 他	-	-	-	-
一 般 貸 付 計	2,007,776	100.0	2,010,038	100.0
うち劣後特約付 貸	232,663	11.6	198,352	9.9

（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		2018年度末		2019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	325,358	16.2	275,268	13.7
	食 料	43,029	2.1	35,429	1.8
	織 維	2,956	0.1	1,996	0.1
	木 材 ・ 木 製 品	500	0.0	500	0.0
	パ ル プ ・ 紙	10,680	0.5	10,570	0.5
	印 刷	12,518	0.6	12,507	0.6
	化 学	21,047	1.0	24,877	1.2
	石 油 ・ 石 炭	10,260	0.5	10,260	0.5
	窯 業 ・ 土 石	29,168	1.5	29,042	1.4
	鉄 鋼	79,550	4.0	79,548	4.0
	非 鉄 金 属	5,902	0.3	5,703	0.3
	金 属 製 品	958	0.0	1,009	0.1
	はん用・生産用・業務用機械	24,199	1.2	24,711	1.2
	電 気 機 械	60,087	3.0	15,487	0.8
	輸 送 用 機 械	15,331	0.8	15,019	0.7
	そ の 他 の 製 造 業	9,167	0.5	8,604	0.4
	農 業 、 林 業	-	-	-	-
	漁 業	-	-	-	-
	鉱業、採石業、砂利採取業	-	-	-	-
	建 設 業	8,852	0.4	8,111	0.4
	電気・ガス・熱供給・水道業	434,447	21.6	454,345	22.6
	情 報 通 信 業	41,266	2.1	41,376	2.1
	運 輸 業 、 郵 便 業	249,361	12.4	250,151	12.4
	卸 売 業	328,398	16.4	302,832	15.1
	小 売 業	9,694	0.5	9,707	0.5
	金 融 業 、 保 険 業	293,218	14.6	349,076	17.4
	不 動 産 業	138,663	6.9	137,099	6.8
	物 品 賃 貸 業	102,091	5.1	105,431	5.2
	学術研究、専門・技術サービス業	200	0.0	200	0.0
	宿 泊 業	-	-	-	-
	飲 食 業	-	-	-	-
	生活関連サービス業・娯楽業	3,831	0.2	3,649	0.2
教 育 、 学 習 支 援 業	-	-	-	-	
医 療 ・ 福 祉	1,150	0.1	1,150	0.1	
そ の 他 の サ ー ビ ス	3,204	0.2	2,961	0.1	
地 方 公 共 団 体	21,448	1.1	20,268	1.0	
個人(住宅・消費・納税資金等)	-	-	-	-	
そ の 他	133	0.0	66	0.0	
合 計	1,961,319	97.7	1,961,696	97.6	
海外 向け	政 府 等	-	-	-	-
	金 融 機 関 等	8,544	0.4	8,544	0.4
	商 工 業 等	37,912	1.9	39,797	2.0
	合 計	46,456	2.3	48,341	2.4
一 般 貸 付 計		2,007,776	100.0	2,010,038	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	2018年度末		2019年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
公 社 債	8,132,626	74.7	8,714,535	77.0
株 式	785,620	7.2	745,484	6.6
現 預 金 ・ そ の 他	212,957	2.0	208,438	1.8
小 計	9,131,204	83.8	9,668,457	85.5

②円貨額が確定した外貨建資産 (単位：百万円、%)

区 分	2018年度末		2019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	290,596	2.7	271,274	2.4
小 計	290,596	2.7	271,274	2.4

③円貨建資産 (単位：百万円、%)

区 分	2018年度末		2019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	29,942	0.3	32,311	0.3
公 社 債 (円建外債) ・ そ の 他	1,439,637	13.2	1,338,390	11.8
小 計	1,469,579	13.5	1,370,702	12.1

④合 計 (単位：百万円、%)

区 分	2018年度末		2019年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
海 外 投 融 資	10,891,380	100.0	11,310,434	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	2018年度末		2019年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
米 ド ル	4,699,602	51.5	4,695,600	48.6
ユ ー ロ	2,353,535	25.8	2,778,518	28.7
オーストラリアドル	598,275	6.6	596,214	6.2
イギリスポンド	304,560	3.3	286,246	3.0
カナダドル	160,055	1.8	224,009	2.3
中 国 元	135,956	1.5	202,493	2.1
メキシコペソ	236,425	2.6	198,599	2.1
そ の 他 共 計	9,131,204	100.0	9,668,457	100.0

(3) 海外投融資の地域別構成

(単位：百万円、%)

区 分	2018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	4,192,980	41.4	3,892,340	43.6	300,640	25.3	8,864	19.1
ヨーロッパ	3,263,628	32.2	3,020,627	33.8	243,001	20.4	5,464	11.8
オセアニア	726,696	7.2	687,722	7.7	38,974	3.3	5,000	10.8
アジア	291,551	2.9	174,600	2.0	116,950	9.8	1,255	2.7
中南米	1,500,896	14.8	1,011,520	11.3	489,375	41.1	25,872	55.7
中 東	178	0.0	-	-	178	0.0	-	-
アフリカ	198	0.0	-	-	198	0.0	-	-
国際機関	146,665	1.4	146,665	1.6	-	-	-	-
合 計	10,122,795	100.0	8,933,476	100.0	1,189,319	100.0	46,456	100.0
区 分	2019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	4,235,777	40.1	3,944,002	41.5	291,774	27.7	9,570	19.8
ヨーロッパ	3,703,129	35.1	3,474,074	36.6	229,054	21.8	6,680	13.8
オセアニア	696,251	6.6	660,117	6.9	36,133	3.4	5,000	10.3
アジア	430,577	4.1	319,814	3.4	110,762	10.5	1,294	2.7
中南米	1,333,587	12.6	950,095	10.0	383,492	36.5	25,796	53.4
中 東	175	0.0	-	-	175	0.0	-	-
アフリカ	177	0.0	-	-	177	0.0	-	-
国際機関	154,747	1.5	154,747	1.6	-	-	-	-
合 計	10,554,422	100.0	9,502,852	100.0	1,051,569	100.0	48,341	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	2018年度末						2019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	13,289	△ 5,068	-	-	-	8,220	34,524	5,965	-	-	-	40,490
ヘッジ会計非適用分	△ 8,118	△ 14,724	△ 6,842	5,255	78	△ 24,350	△ 5,422	△ 831	△ 3,967	△ 1,967	△ 4,536	△ 16,725
合 計	5,170	△ 19,792	△ 6,842	5,255	78	△ 16,130	29,102	5,134	△ 3,967	△ 1,967	△ 4,536	23,764

（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。
 2018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△12,770百万円）及びヘッジ会計非適用分の差損益（△24,350百万円）の合計△37,121百万円
 2019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△5,205百万円）及びヘッジ会計非適用分の差損益（△16,725百万円）の合計△21,931百万円

（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	2018年度末				2019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	円建金利スワップ								
	固定金利受取／変動金利支払	31,000	31,000	805	805	43,000	43,000	1,133	1,133
	固定金利支払／変動金利受取	62,000	46,000	△ 849	△ 849	18,700	18,700	△ 1,408	△ 1,408
	外貨建金利スワップ								
	固定金利支払／変動金利受取	114,319	58,824	△ 1,549	△ 1,549	3,237	3,237	△ 918	△ 918
	円建金利スワップション								
	売建								
	固定金利受取／変動金利支払	-	-	-	-	15,000	-	26	28
	固定金利支払／変動金利受取	(-)	(-)	-	-	(55)	(-)	26	28
	買建								
固定金利受取／変動金利支払	-	-	-	-	15,000	-	15	42	
固定金利支払／変動金利受取	(-)	(-)	-	-	(58)	(-)	15	42	
買建									
固定金利受取／変動金利支払	-	-	-	-	505,000	135,000	12,207	2,380	
固定金利支払／変動金利受取	(-)	(-)	-	-	(9,827)	(3,618)	12,207	2,380	
固定金利支払／変動金利受取	1,430,000	1,270,000	761	△ 6,524	1,671,000	1,316,000	606	△ 6,680	
	(7,285)	(6,064)	761	△ 6,524	(7,287)	(5,121)	606	△ 6,680	
合 計				△ 8,118				△ 5,422	

（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	2018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
円建受取側固定スワップ想定元本	-	-	-	-	21,000	10,000	31,000
平均受取固定金利	-	-	-	-	0.25	0.64	0.37
平均支払変動金利	-	-	-	-	0.00	0.01	0.01
円建支払側固定スワップ想定元本	16,000	-	32,000	-	-	14,000	62,000
平均支払固定金利	△ 0.14	-	0.03	-	-	0.69	0.14
平均受取変動金利	0.01	-	△ 0.00	-	-	0.01	0.00
外貨建支払側固定スワップ想定元本	55,495	55,495	-	-	-	3,329	114,319
平均支払固定金利	2.92	2.96	-	-	-	3.00	2.94
平均受取変動金利	2.61	2.61	-	-	-	2.72	2.61
合 計	71,495	55,495	32,000	-	21,000	27,329	207,319
区 分	2019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
円建受取側固定スワップ想定元本	-	-	20,000	-	11,000	12,000	43,000
平均受取固定金利	-	-	△ 0.13	-	0.27	0.55	0.16
平均支払変動金利	-	-	△ 0.05	-	△ 0.05	△ 0.01	△ 0.04
円建支払側固定スワップ想定元本	-	-	4,700	-	-	14,000	18,700
平均支払固定金利	-	-	△ 0.00	-	-	0.69	0.51
平均受取変動金利	-	-	0.00	-	-	△ 0.01	△ 0.01
外貨建支払側固定スワップ想定元本	-	-	-	-	-	3,237	3,237
平均支払固定金利	-	-	-	-	-	3.00	3.00
平均受取変動金利	-	-	-	-	-	2.19	2.19
合 計	-	-	24,700	-	11,000	29,237	64,937

②通貨関連

(単位：百万円)

区分	種類	2018年度末			2019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	1,396,821	△ 3,796	△ 3,796	1,414,899	516	516
	(ユーロ)	415,446	1,820	1,820	598,735	7,199	7,199
	(米ドル)	548,856	△ 5,787	△ 5,787	494,277	△ 5,672	△ 5,672
	(オーストラリアドル)	99,060	628	628	119,131	△ 994	△ 994
	(イギリスポンド)	27,726	△ 732	△ 732	33,200	35	35
	(カナダドル)	13,979	17	17	22,200	△ 187	△ 187
	(その他)	291,752	256	256	147,352	136	136
	買建	959,220	△ 1,237	△ 1,237	429,341	1,143	1,143
	(米ドル)	466,740	2,126	2,126	224,449	1,757	1,757
	(ユーロ)	243,773	△ 3,310	△ 3,310	136,701	△ 818	△ 818
	(イギリスポンド)	-	-	-	9,500	112	112
	(オーストラリアドル)	8,142	△ 42	△ 42	3,416	8	8
	(カナダドル)	3,606	-	-	-	-	-
	(その他)	236,956	△ 11	△ 11	55,273	82	82
	通貨オプション						
	売建						
	コール	-			295,675		
	(ユーロ)	(-)	-	-	(1,260)	808	451
	(米ドル)	-			295,675		
	(イギリスポンド)	(-)	-	-	(1,260)	808	451
	プット	100,900			98,109		
	(ユーロ)	(2,914)	276	2,638	(3,455)	2,009	1,445
(米ドル)	100,900			98,109			
(イギリスポンド)	(2,914)	276	2,638	(3,455)	2,009	1,445	
買建							
プット	821,224			750,371			
(ユーロ)	(16,676)	4,348	△ 12,327	(11,110)	6,722	△ 4,387	
(米ドル)	779,801			709,543			
(イギリスポンド)	(16,223)	3,968	△ 12,255	(9,733)	5,532	△ 4,200	
(その他)	41,422			40,827			
(ユーロ)	(452)	379	△ 72	(1,377)	1,190	△ 186	
合計			△ 14,724			△ 831	

- (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	2018年度末			2019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 売建	-	-	-	56,477	△ 859	△ 859
	円建株価指数オプション 買建 プット	150,000 (6,363)	1,625	△ 4,738	149,980 (3,990)	882	△ 3,107
	外貨建株価指数オプション 買建 プット	59,028 (2,280)	177	△ 2,103	- (-)	-	-
合計				△ 6,842			△ 3,967

- (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	2018年度末			2019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	48,974	△ 74	△ 74	81,237	6	6
	外貨建債券先物 売建 買建	271,908 380,803	△ 3,705 8,423	△ 3,705 8,423	316,064 553,052	979 △ 2,470	979 △ 2,470
	外貨建債券先物オプション 売建 コール	- (-)	-	-	7,068 (21)	21	△ 0
	買建 プット	- (-)	-	-	55,551 (205)	80	△ 125
店頭	外貨建債券先渡契約 売建 買建	5,814 26,979	△ 51 209	△ 51 209	94,122 101,228	△ 64 37	△ 64 37
	円建債券店頭オプション 売建 コール	40,490 (34)	58	△ 24	40,802 (36)	13	22
	プット	173,973 (252)	59	193	131,537 (195)	456	△ 260
	買建 コール	173,973 (192)	519	326	131,537 (165)	104	△ 61
	プット	40,490 (43)	1	△ 41	40,802 (45)	14	△ 31
	合計				5,255		

- (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	2018年度末				2019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	クレジット・デフォルト・スワップ プロテクション売建	24,000	11,500	208	208	20,000	3,000	114	114
	プロテクション買建	5,800	5,800	△ 130	△ 130	117,620	117,620	△ 4,651	△ 4,651
合計					78				△ 4,536

(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	2018年度末				2019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	円建金利スワップ 固定金利受取／変動金利支払	貸付金	14,450	14,450	116	116	14,400	14,400	221	221
	固定金利受取／変動金利支払	保険負債	700,000	700,000	15,672	15,672	700,000	700,000	36,678	36,678
金利スワップの特例処理	円建金利スワップ 固定金利受取／変動金利支払	貸付金	15,300	15,300	203	203	15,300	13,300	233	233
	固定金利支払／変動金利受取	借入金	283,000	283,000	△ 2,703	△ 2,703	283,000	283,000	△ 2,608	△ 2,608
合計						13,289				34,524

(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	2018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
円建受取側固定スワップ想定元本	-	7,000	10,450	2,300	10,000	700,000	729,750
平均受取固定金利	-	0.17	0.04	1.19	0.10	0.47	0.45
平均支払変動金利	-	△ 0.01	0.03	0.07	△ 0.08	0.00	0.00
円建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	154,450	2,300	10,000	700,000	1,012,750
区分	2019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
円建受取側固定スワップ想定元本	2,000	9,000	6,400	2,300	10,000	700,000	729,700
平均受取固定金利	0.63	0.05	△ 0.01	1.19	0.10	0.47	0.45
平均支払変動金利	△ 0.05	△ 0.00	△ 0.05	0.07	△ 0.09	△ 0.04	△ 0.04
円建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	2,000	148,000	150,400	2,300	10,000	700,000	1,012,700

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	2018年度末				2019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	通貨スワップ	外貨建債券	256,613	212,995	7,701	7,701	247,537	214,508	11,171	11,171	
	(米ドル)		181,959	149,098	5,178	5,178	168,505	144,349	5,541	5,541	
	(ユーロ)		62,543	51,786	1,720	1,720	66,926	58,052	4,229	4,229	
	(イギリスポンド)		12,110	12,110	803	803	12,106	12,106	1,399	1,399	
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		4,970,497	-	△ 12,710	△ 12,710	5,328,907	-	△ 5,214	△ 5,214	
	(米ドル)		2,408,422	-	△ 34,423	△ 34,423	2,499,272	-	△ 30,575	△ 30,575	
	(ユーロ)		1,591,097	-	26,561	26,561	1,834,762	-	24,285	24,285	
	(オーストラリアドル)		341,336	-	△ 1,842	△ 1,842	352,032	-	△ 4,178	△ 4,178	
	(イギリスポンド)		141,192	-	△ 3,380	△ 3,380	138,715	-	2,240	2,240	
	(カナダドル)		62,405	-	△ 36	△ 36	89,122	-	△ 2,057	△ 2,057	
	(その他)		426,043	-	409	409	415,003	-	5,069	5,069	
	買建		16,165	-	△ 59	△ 59	1,193	-	9	9	
	(米ドル)		15,458	-	△ 53	△ 53	1,165	-	9	9	
	(ユーロ)		341	-	△ 5	△ 5	28	-	△ 0	△ 0	
	(オーストラリアドル)		291	-	△ 0	△ 0	-	-	-	-	
	(その他)		73	-	△ 0	△ 0	-	-	-	-	
	為替予約等の振当処理		為替予約	外貨建定期預金							
売建		252,646	-		-	-	233,923	-	-	-	
(米ドル)		103,525	-		-	-	84,636	-	-	-	
(オーストラリアドル)		79,522	-		-	-	-	-	-	-	
(その他)		69,597	-		-	-	149,287	-	-	-	
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	37,142		33,598	-	-	36,658	33,113	-	-
(米ドル)		31,178	27,633		-	-	30,693	27,149	-	-	
(ユーロ)		5,964	5,964		-	-	5,964	5,964	-	-	
合計					△ 5,068				5,965		

(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ています。(注2.を除く)

③株式関連

2018年度末、2019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。

④債券関連

2018年度末、2019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

2018年度末、2019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。