

2021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

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	2020年度末		2021年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
国 債	14,672,138	45.1	14,988,718	45.2
地 方 債	107,735	0.3	104,514	0.3
社 債	1,960,238	6.0	1,976,053	6.0
うち公社・公団債	393,526	1.2	376,140	1.1
株 式	3,569,109	11.0	3,751,024	11.3
外 国 証 券	11,402,677	35.1	11,384,510	34.3
公 社 債	9,811,240	30.2	9,677,538	29.2
株 式 等	1,591,436	4.9	1,706,972	5.1
そ の 他 の 証 券	818,392	2.5	956,802	2.9
合 計	32,530,293	100.0	33,161,624	100.0

(2) 有価証券残存期間別残高

(単位：百万円)

区 分	2020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 (期間の定めのないものを含む)		
有 価 証 券	491,377	1,189,420	1,799,772	2,336,468	3,470,970	23,242,285	32,530,293	
国 債	16,079	116,456	385,869	713,515	2,012,050	11,428,166	14,672,138	
地 方 債	2,799	4,312	12,879	6,305	2,908	78,531	107,735	
社 債	58,145	176,507	234,358	210,394	143,479	1,137,353	1,960,238	
株 式	-	-	-	-	-	3,569,109	3,569,109	
外 国 証 券	413,632	873,430	1,047,910	1,310,705	977,002	6,779,996	11,402,677	
公 社 債	410,667	859,597	1,020,003	1,259,084	886,601	5,375,286	9,811,240	
株 式 等	2,965	13,833	27,906	51,620	90,401	1,404,709	1,591,436	
そ の 他 の 証 券	720	18,714	118,754	95,546	335,529	249,127	818,392	
買 入 金 銭 債 権	-	3,351	27,707	23,082	9,449	188,548	252,140	
譲 渡 性 預 金	70,997	-	-	-	-	-	70,997	
そ の 他	-	-	-	-	-	7,716	7,716	
区 分	2021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 (期間の定めのないものを含む)		
有 価 証 券	463,813	1,186,599	2,352,465	2,134,624	3,167,432	23,856,689	33,161,624	
国 債	12,366	153,984	477,750	711,315	1,677,271	11,956,031	14,988,718	
地 方 債	1,473	2,817	16,778	4,907	6	78,531	104,514	
社 債	64,739	187,151	271,178	164,202	140,733	1,148,049	1,976,053	
株 式	-	-	-	-	-	3,751,024	3,751,024	
外 国 証 券	383,364	824,414	1,285,714	1,200,333	992,409	6,698,274	11,384,510	
公 社 債	378,658	812,549	1,241,316	1,143,837	885,529	5,215,646	9,677,538	
株 式 等	4,706	11,864	44,398	56,495	106,879	1,482,627	1,706,972	
そ の 他 の 証 券	1,870	18,231	301,043	53,865	357,012	224,779	956,802	
買 入 金 銭 債 権	3,368	2,649	43,519	14,194	9,173	183,327	256,233	
譲 渡 性 預 金	102,995	-	-	-	-	-	102,995	
そ の 他	-	-	-	-	-	11,703	11,703	

(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		2020年度末		2021年度 第2四半期(上半期)末	
		金 額	占 率	金 額	占 率
水 産 ・ 農 林 業		266	0.0	263	0.0
鉱 業		200	0.0	200	0.0
建 設 業		119,215	3.3	125,255	3.3
製 造 業	食 料 品	184,173	5.2	218,109	5.8
	織 維 製 品	23,338	0.7	24,280	0.6
	パ ル プ ・ 紙	3,830	0.1	3,237	0.1
	化 学	212,174	5.9	207,019	5.5
	医 薬 品	87,967	2.5	87,336	2.3
	石 油 ・ 石 炭 製 品	3,324	0.1	3,178	0.1
	ゴ ム 製 品	15,100	0.4	17,229	0.5
	ガ ラ ス ・ 土 石 製 品	108,791	3.0	101,235	2.7
	鉄 鋼	36,139	1.0	43,635	1.2
	非 鉄 金 属	13,969	0.4	12,293	0.3
	金 属 製 品	48,079	1.3	43,537	1.2
	機 械	249,106	7.0	252,666	6.7
	電 気 機 器	731,687	20.5	820,095	21.9
	輸 送 用 機 器	190,618	5.3	189,858	5.1
	精 密 機 器	168,390	4.7	201,521	5.4
そ の 他 製 品	68,351	1.9	73,544	2.0	
電 気 ・ ガ ス 業		67,031	1.9	53,703	1.4
運 輸 ・ 情 報 通 信 業	陸 運 業	278,117	7.8	259,877	6.9
	海 運 業	51	0.0	67	0.0
	空 運 業	3,113	0.1	3,388	0.1
	倉 庫 ・ 運 輸 関 連 業	4,617	0.1	4,660	0.1
	情 報 ・ 通 信 業	83,762	2.3	94,908	2.5
商 業	卸 売 業	142,684	4.0	146,402	3.9
	小 売 業	120,546	3.4	121,210	3.2
金 融 ・ 保 険 業	銀 行 業	207,608	5.8	186,131	5.0
	証 券 ・ 商 品 先 物 取 引 業	1,786	0.1	1,920	0.1
	保 険 業	4,325	0.1	4,637	0.1
	そ の 他 金 融 業	29,575	0.8	32,201	0.9
不 動 産 業		18,737	0.5	19,639	0.5
サ ー ビ ス 業		342,425	9.6	397,775	10.6
合 計		3,569,109	100.0	3,751,024	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
		2020年度末	変動金利	9,928	19,985	38,724	13,547	
	固定金利	315,760	339,671	358,971	287,638	232,373	347,202	1,881,617
	一般貸付計	325,688	359,657	397,695	301,186	244,278	655,476	2,283,983
2021年度 第2四半期 (上半期)末	変動金利	15,183	48,229	26,596	25,879	10,201	317,885	443,976
	固定金利	327,792	338,634	372,651	298,584	176,612	359,654	1,873,931
	一般貸付計	342,975	386,863	399,248	324,464	186,814	677,540	2,317,907

### （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		2020年度末		2021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	209	62.8	213	62.6
	金 額	1,688,707	83.6	1,700,753	82.9
中 堅 企 業	貸付先数	7	2.1	8	2.4
	金 額	4,103	0.2	5,370	0.3
中 小 企 業	貸付先数	117	35.1	119	35.0
	金 額	326,916	16.2	345,614	16.8
国内企業向け 貸付計	貸付先数	333	100.0	340	100.0
	金 額	2,019,726	100.0	2,051,738	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	2020年度末		2021年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
担 保 貸 付	2,546	0.1	2,634	0.1
有 価 証 券 担 保 貸 付	1,130	0.0	1,381	0.1
不 動 産・動 産・ 財 団 担 保 貸 付	1,415	0.1	1,252	0.1
指 名 債 権 担 保 貸 付	-	-	-	-
保 証 貸 付	99,406	4.4	92,628	4.0
信 用 貸 付	2,182,031	95.5	2,222,644	95.9
そ の 他	-	-	-	-
一 般 貸 付 計	2,283,983	100.0	2,317,907	100.0
うち劣後特約付 貸	241,551	10.6	245,447	10.6

（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		2020年度末		2021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	270,245	11.8	266,661	11.5
	食 料	43,049	1.9	42,561	1.8
	織 維	1,824	0.1	1,757	0.1
	木 材 ・ 木 製 品	500	0.0	500	0.0
	パ ル プ ・ 紙	10,600	0.5	10,500	0.5
	印 刷	22,500	1.0	21,250	0.9
	化 学	27,865	1.2	36,081	1.6
	石 油 ・ 石 炭	7,860	0.3	7,270	0.3
	窯 業 ・ 土 石	18,791	0.8	18,703	0.8
	鉄 鋼	66,245	2.9	60,244	2.6
	非 鉄 金 属	3,985	0.2	3,882	0.2
	金 属 製 品	964	0.0	1,016	0.0
	はん用・生産用・業務用機械	22,495	1.0	23,085	1.0
	電 気 機 械	15,273	0.7	12,943	0.6
	輸 送 用 機 械	19,173	0.8	18,541	0.8
	そ の 他 の 製 造 業	9,116	0.4	8,323	0.4
	農 業 、 林 業	-	-	-	-
	漁 業	-	-	-	-
	鉱業、採石業、砂利採取業	-	-	-	-
	建 設 業	14,077	0.6	13,379	0.6
	電気・ガス・熱供給・水道業	452,713	19.8	464,687	20.0
	情 報 通 信 業	61,006	2.7	66,948	2.9
	運 輸 業 、 郵 便 業	250,994	11.0	253,239	10.9
	卸 売 業	303,944	13.3	281,569	12.1
	小 売 業	11,557	0.5	10,475	0.5
	金 融 業 、 保 険 業	596,675	26.1	620,546	26.8
	不 動 産 業	135,914	6.0	133,393	5.8
	物 品 賃 貸 業	93,647	4.1	87,881	3.8
	学術研究、専門・技術サービス業	500	0.0	500	0.0
	宿 泊 業	-	-	-	-
	飲 食 業	-	-	-	-
	生活関連サービス業・娯楽業	3,477	0.2	7,485	0.3
	教 育 、 学 習 支 援 業	-	-	-	-
医 療 ・ 福 祉	4,715	0.2	4,543	0.2	
そ の 他 の サ ー ビ ス	2,313	0.1	4,060	0.2	
地 方 公 共 団 体	16,727	0.7	15,547	0.7	
個人（住宅・消費・納税資金等）	-	-	-	-	
そ の 他	-	-	-	-	
合 計	2,218,510	97.1	2,230,918	96.2	
海外向け	政 府 等	4,218	0.2	4,023	0.2
	金 融 機 関	-	-	-	-
	商 工 業 等	61,255	2.7	82,966	3.6
	合 計	65,473	2.9	86,989	3.8
一 般 貸 付 計		2,283,983	100.0	2,317,907	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. 海外投融资関係（一般勘定）

#### （1）資産別明細

##### ①外貨建資産 （単位：百万円、％）

区 分	2020年度末		2021年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
公 社 債	9,017,236	74.1	8,885,038	72.7
株 式	1,196,647	9.8	1,245,418	10.2
現 預 金 ・ そ の 他	214,984	1.8	254,623	2.1
小 計	10,428,868	85.7	10,385,080	84.9

##### ②円貨額が確定した外貨建資産 （単位：百万円、％）

区 分	2020年度末		2021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	272,336	2.2	251,592	2.1
小 計	272,336	2.2	251,592	2.1

##### ③円貨建資産 （単位：百万円、％）

区 分	2020年度末		2021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	25,948	0.2	32,868	0.3
公社債（円建外債）・その他	1,437,739	11.8	1,556,529	12.7
小 計	1,463,688	12.0	1,589,398	13.0

##### ④合 計 （単位：百万円、％）

区 分	2020年度末		2021年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
海 外 投 融 資	12,164,893	100.0	12,226,071	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	2020年度末		2021年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
米 ド ル	5,085,454	48.8	5,176,877	49.8
ユ ー ロ	2,255,928	21.6	2,112,322	20.3
オーストラリアドル	1,226,547	11.8	1,219,177	11.7
カナダドル	434,031	4.2	503,330	4.8
イギリスポンド	331,737	3.2	330,874	3.2
中 国 元	301,325	2.9	323,465	3.1
メキシコペソ	183,055	1.8	183,201	1.8
そ の 他 共 計	10,428,868	100.0	10,385,080	100.0

## (3) 海外投融資の地域別構成

(単位：百万円、%)

区 分	2020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	4,721,218	41.4	4,049,280	41.3	671,937	42.2	12,085	18.5
ヨーロッパ	3,471,185	30.4	2,984,625	30.4	486,560	30.6	19,397	29.6
オセアニア	1,158,518	10.2	1,130,271	11.5	28,247	1.8	11,388	17.4
アジア	507,080	4.4	402,555	4.1	104,525	6.6	2,829	4.3
中南米	1,304,415	11.4	1,004,650	10.2	299,765	18.8	19,771	30.2
中 東	400	0.0	-	-	400	0.0	-	-
アフリカ	-	-	-	-	-	-	-	-
国際機関	239,857	2.1	239,857	2.4	-	-	-	-
合 計	11,402,677	100.0	9,811,240	100.0	1,591,436	100.0	65,473	100.0
区 分	2021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	4,783,773	42.0	4,064,629	42.0	719,143	42.1	14,157	16.3
ヨーロッパ	3,463,306	30.4	2,906,718	30.0	556,587	32.6	27,433	31.5
オセアニア	1,043,427	9.2	1,016,965	10.5	26,462	1.6	18,908	21.7
アジア	522,294	4.6	425,759	4.4	96,535	5.7	7,911	9.1
中南米	1,308,552	11.5	1,000,654	10.3	307,898	18.0	18,578	21.4
中 東	345	0.0	-	-	345	0.0	-	-
アフリカ	-	-	-	-	-	-	-	-
国際機関	262,810	2.3	262,810	2.7	-	-	-	-
合 計	11,384,510	100.0	9,677,538	100.0	1,706,972	100.0	86,989	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	2020年度末						2021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	18,451	△ 314,225	-	-	-	△ 295,773	24,053	△ 101,139	-	-	-	△ 77,085
ヘッジ会計非適用分	△ 13,205	△ 7,702	△ 1,028	2,458	39	△ 19,438	△ 6,249	△ 2,147	△ 2,818	△ 6,737	251	△ 17,702
合 計	5,245	△ 321,927	△ 1,028	2,458	39	△ 315,212	17,803	△ 103,287	△ 2,818	△ 6,737	251	△ 94,788

（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。

2020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△306,695百万円）及び  
 ヘッジ会計非適用分の差損益（△19,438百万円）の合計△326,133百万円  
 2021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△93,676百万円）及び  
 ヘッジ会計非適用分の差損益（△17,702百万円）の合計△111,379百万円

##### （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	2020年度末				2021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	10,000	10,000	510	510	10,000	10,000	601	601
	固定金利支払/変動金利受取	17,600	17,600	△ 217	△ 217	16,850	16,850	△ 514	△ 514
	円建金利スワップション								
	売建	20,000	-			12,000	-		
	固定金利受取/変動金利支払	(236)	(-)	13	222	(104)	(-)	61	42
	買建								
固定金利受取/変動金利支払	480,000 (12,300)	10,000 (70)	1,724	△ 10,575	84,000 (1,914)	- (-)	112	△ 1,801	
固定金利支払/変動金利受取	1,895,000 (9,216)	1,095,000 (6,243)	6,072	△ 3,143	1,630,000 (8,830)	910,000 (6,757)	4,253	△ 4,577	
合 計				△ 13,205				△ 6,249	

（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	2020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	-	-	-	-	-	10,000	10,000
平均受取固定金利	-	-	-	-	-	0.64	0.64
平均支払変動金利	-	-	-	-	-	△ 0.06	△ 0.06
円建支払側固定スワップ想定元本	-	-	-	-	2,600	15,000	17,600
平均支払固定金利	-	-	-	-	0.07	0.45	0.40
平均受取変動金利	-	-	-	-	△ 0.06	△ 0.06	△ 0.06
合 計	-	-	-	-	2,600	25,000	27,600
区 分	2021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	-	-	-	-	-	10,000	10,000
平均受取固定金利	-	-	-	-	-	0.64	0.64
平均支払変動金利	-	-	-	-	-	△ 0.05	△ 0.05
円建支払側固定スワップ想定元本	-	-	-	-	-	16,850	16,850
平均支払固定金利	-	-	-	-	-	0.55	0.55
平均受取変動金利	-	-	-	-	-	△ 0.04	△ 0.04
合 計	-	-	-	-	-	26,850	26,850

②通貨関連

(単位：百万円)

区分	種類	2020年度末			2021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	通貨スワップ (米ドル)	14,205	△ 315	△ 315	14,205	△ 1,114	△ 1,114
	為替予約						
	売建	288,176	△ 1,246	△ 1,246	374,199	50	50
	(米ドル)	88,857	△ 1,048	△ 1,048	116,086	△ 1,415	△ 1,415
	(オーストラリアドル)	77,417	43	43	75,809	1,351	1,351
	(ユーロ)	58,947	925	925	41,562	252	252
	(イギリスポンド)	19,317	△ 839	△ 839	31,603	387	387
	(カナダドル)	6,478	△ 327	△ 327	15,068	17	17
	(その他)	37,158	△ 0	△ 0	94,068	△ 543	△ 543
	買建	230,063	△ 2,313	△ 2,313	309,766	1,077	1,077
	(米ドル)	159,658	△ 298	△ 298	181,699	1,660	1,660
	(ユーロ)	55,553	△ 1,908	△ 1,908	39,005	△ 536	△ 536
	(イギリスポンド)	9,952	△ 89	△ 89	22,771	△ 226	△ 226
	(オーストラリアドル)	-	-	-	10,116	△ 46	△ 46
	(カナダドル)	-	-	-	2,500	△ 0	△ 0
	(その他)	4,899	△ 17	△ 17	53,672	225	225
	通貨オプション						
	売建						
	プット	108,807			-		
	(159)		0	158	(-)	-	-
	(米ドル)	108,807			-		
	(159)		0	158	(-)	-	-
	買建						
	プット	512,231			352,102		
	(4,631)		645	△ 3,985	(3,326)	815	△ 2,510
	(米ドル)	512,231			258,977		
	(4,631)		645	△ 3,985	(2,345)	215	△ 2,130
(オーストラリアドル)	-			51,576			
(-)		-	-	(770)	540	△ 229	
(中国元)	-			41,548			
(-)		-	-	(210)	58	△ 151	
コール	-			71,192			
(-)		-	-	(874)	1,224	350	
(米ドル)	-			71,192			
(-)		-	-	(874)	1,224	350	
合 計			△ 7,702			△ 2,147	

- (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	2020年度末			2021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	-	-	-	13,979	334	334
	買建	5,176	104	104	13,670	△ 119	△ 119
	外貨建株価指数先物						
	買建	4,546	21	21	11,077	△ 319	△ 319
	円建株価指数オプション						
買建	269,963			317,644			
プット	(5,199)	4,044	△ 1,155	(7,505)	4,676	△ 2,829	
外貨建株価指数オプション							
買建	-			20,429			
プット	(-)	-	-	(618)	732	114	
	合計			△ 1,028		△ 2,818	

- (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	2020年度末			2021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	18,270	△ 20	△ 20	77,728	227	227
	買建	-	-	-	9,111	△ 28	△ 28
	外貨建債券先物						
売建	567,017	8,802	8,802	576,387	5,853	5,853	
買建	702,387	△ 6,486	△ 6,486	862,792	△ 12,185	△ 12,185	
店頭	外貨建債券先渡契約						
	売建	41,532	137	137	82,765	△ 33	△ 33
	買建	78,944	△ 133	△ 133	120,987	△ 310	△ 310
	円建債券店頭オプション						
	売建						
	コール	6,555			20,125		
	(33)		31	2	(54)	29	24
	プット	36,871			106,418		
(134)		35	98	(266)	424	△ 158	
買建							
コール	36,871			106,418			
(107)		170	63	(221)	74	△ 146	
プット	6,555			20,125			
(37)		32	△ 4	(63)	82	19	
	合計			2,458		△ 6,737	

- (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	2020年度末				2021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	12,000	11,000	255	255	18,400	18,400	376	376
	プロテクション買建	11,300	11,300	△ 215	△ 215	8,700	8,700	△ 124	△ 124
合計					39				251

(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	2020年度末				2021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	14,250	14,250	74	74	14,200	10,200	68	68
	固定金利受取／変動金利支払	保険負債	700,000	700,000	18,998	18,998	700,000	700,000	24,297	24,297
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	12,300	8,300	124	124	8,300	8,300	107	107
	固定金利支払／変動金利受取	借入金	325,000	325,000	△ 746	△ 746	325,000	325,000	△ 419	△ 419
合計						18,451				24,053

(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	2020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	4,000	10,250	2,300	10,000	-	700,000	726,550
平均受取固定金利	△ 0.05	0.04	1.19	0.10	-	0.47	0.45
平均支払変動金利	△ 0.05	0.00	0.08	△ 0.08	-	△ 0.05	△ 0.05
円建支払側固定スワップ想定元本	-	144,000	181,000	-	-	-	325,000
平均支払固定金利	-	0.42	0.09	-	-	-	0.23
平均受取変動金利	-	0.14	0.14	-	-	-	0.14
合計	4,000	154,250	183,300	10,000	-	700,000	1,051,550
区分	2021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	4,000	6,200	2,300	10,000	-	700,000	722,500
平均受取固定金利	0.12	△ 0.01	1.19	0.10	-	0.47	0.46
平均支払変動金利	0.06	△ 0.06	0.06	△ 0.08	-	△ 0.07	△ 0.07
円建支払側固定スワップ想定元本	-	144,000	181,000	-	-	-	325,000
平均支払固定金利	-	0.42	0.09	-	-	-	0.23
平均受取変動金利	-	0.13	0.13	-	-	-	0.13
合計	4,000	150,200	183,300	10,000	-	700,000	1,047,500

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	2020年度末				2021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	196,770	185,116	△ 7,530	△ 7,530	192,985	171,556	△ 7,462	△ 7,462
	(米ドル)		114,235	108,781	△ 3,676	△ 3,676	114,286	99,572	△ 4,149	△ 4,149
	(ユーロ)		70,488	64,288	△ 3,478	△ 3,478	66,704	59,988	△ 3,147	△ 3,147
	(イギリスポンド)		12,046	12,046	△ 375	△ 375	11,994	11,994	△ 165	△ 165
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		6,454,969	-	△ 306,980	△ 306,980	6,690,031	-	△ 94,212	△ 94,212
	(米ドル)		3,160,414	-	△ 177,109	△ 177,109	3,313,914	-	△ 109,305	△ 109,305
	(ユーロ)		1,344,897	-	△ 42,286	△ 42,286	1,318,749	-	14,212	14,212
	(オーストラリアドル)		835,833	-	△ 43,597	△ 43,597	862,515	-	2,720	2,720
	(カナダドル)		344,654	-	△ 24,746	△ 24,746	417,056	-	△ 599	△ 599
	(イギリスポンド)		162,460	-	△ 3,242	△ 3,242	163,564	-	1,760	1,760
	(その他)		606,709	-	△ 15,997	△ 15,997	614,232	-	△ 3,002	△ 3,002
	買建		11,563	-	285	285	26,922	-	536	536
	(米ドル)		7,928	-	229	229	18,889	-	406	406
	(カナダドル)		49	-	1	1	5,726	-	112	112
	(オーストラリアドル)		3,585	-	53	53	2,082	-	22	22
	(ユーロ)		-	-	-	-	224	-	△ 4	△ 4
為替予約等の振当処理	為替予約	外貨建定期預金								
	売建		242,002	-	-	-	223,000	-	-	-
	(米ドル)		92,002	-	-	-	73,000	-	-	-
	(その他)	150,000	-	-	-	150,000	-	-	-	
	通貨スワップ	外貨建社債(負債)	476,277	368,715	-	-	368,715	368,715	-	-
	(米ドル)		476,277	368,715	-	-	368,715	368,715	-	-
	通貨スワップ	外貨建貸付金	30,366	30,366	-	-	28,635	25,056	-	-
	(米ドル)		25,594	25,594	-	-	25,056	25,056	-	-
	(ユーロ)		4,771	4,771	-	-	3,578	-	-	-
合計					△ 314,225				△ 101,139	

(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

2020年度末、2021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

2020年度末、2021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

2020年度末、2021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。