

2022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）	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	2021年度末		2022年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
国 債	15,469,602	48.8	15,574,880	54.1
地 方 債	106,012	0.3	113,114	0.4
社 債	1,827,166	5.8	1,784,315	6.2
うち公社・公団債	386,821	1.2	398,013	1.4
株 式	3,292,713	10.4	3,039,725	10.6
外 国 証 券	10,143,485	32.0	7,518,784	26.1
公 社 債	8,620,159	27.2	6,011,751	20.9
株 式 等	1,523,325	4.8	1,507,033	5.2
そ の 他 の 証 券	858,702	2.7	769,373	2.7
合 計	31,697,684	100.0	28,800,194	100.0

（2）有価証券残存期間別残高

（単位：百万円）

区 分	2021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	400,142	1,165,600	2,561,824	1,689,698	3,011,504	22,868,914	31,697,684	
国 債	1,764	220,014	648,700	486,786	1,695,678	12,416,657	15,469,602	
地 方 債	1,595	3,327	18,949	2,906	201	79,032	106,012	
社 債	79,833	194,914	306,617	141,107	127,312	977,381	1,827,166	
株 式	-	-	-	-	-	3,292,713	3,292,713	
外 国 証 券	315,734	718,489	1,345,338	1,006,587	861,563	5,895,770	10,143,485	
公 社 債	310,447	708,595	1,290,592	914,054	724,984	4,671,486	8,620,159	
株 式 等	5,287	9,894	54,746	92,533	136,578	1,224,284	1,523,325	
そ の 他 の 証 券	1,213	28,854	242,217	52,310	326,748	207,358	858,702	
買 入 金 銭 債 権	3,358	5,650	42,053	6,413	7,791	174,627	239,896	
譲 渡 性 預 金	82,997	-	-	-	-	-	82,997	
そ の 他	-	-	-	-	-	12,164	12,164	
区 分	2022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	415,641	1,226,400	2,130,149	1,224,299	2,607,473	21,196,230	28,800,194	
国 債	49,342	284,838	670,454	358,119	1,573,397	12,638,727	15,574,880	
地 方 債	2,778	4,987	13,404	2,906	297	88,740	113,114	
社 債	88,660	234,804	262,561	97,823	112,574	987,890	1,784,315	
株 式	-	-	-	-	-	3,039,725	3,039,725	
外 国 証 券	274,467	652,895	957,901	664,536	736,612	4,232,372	7,518,784	
公 社 債	264,363	631,074	911,647	538,840	571,822	3,094,003	6,011,751	
株 式 等	10,103	21,821	46,253	125,695	164,789	1,138,369	1,507,033	
そ の 他 の 証 券	392	48,875	225,827	100,913	184,592	208,773	769,373	
買 入 金 銭 債 権	3,359	21,053	21,516	5,216	7,101	169,783	228,030	
譲 渡 性 預 金	75,997	-	-	-	-	-	75,997	
そ の 他	-	-	-	-	-	6,414	6,414	

（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	2021年度末		2022年度 第2四半期(上半期)末		
	金 額	占 率	金 額	占 率	
水 産 ・ 農 林 業	253	0.0	248	0.0	
鉱 業	200	0.0	200	0.0	
建 設 業	106,940	3.2	99,923	3.3	
製 造 業	食 料 品	193,957	5.9	198,517	6.5
	織 維 製 品	19,699	0.6	20,485	0.7
	パ ル プ ・ 紙	2,935	0.1	2,732	0.1
	化 学	172,474	5.2	167,570	5.5
	医 薬 品	74,608	2.3	93,682	3.1
	石 油 ・ 石 炭 製 品	3,357	0.1	3,495	0.1
	ゴ ム 製 品	15,131	0.5	16,350	0.5
	ガ ラ ス ・ 土 石 製 品	97,476	3.0	105,074	3.5
	鉄 鋼	44,293	1.3	32,510	1.1
	非 鉄 金 属	11,202	0.3	10,859	0.4
	金 属 製 品	32,942	1.0	29,898	1.0
	機 械	228,622	6.9	193,172	6.4
	電 気 機 器	734,986	22.3	611,579	20.1
	輸 送 用 機 器	186,635	5.7	162,970	5.4
精 密 機 器	151,965	4.6	162,549	5.3	
そ の 他 製 品	75,665	2.3	75,494	2.5	
電 気 ・ ガ ス 業	38,835	1.2	39,996	1.3	
運 輸 ・ 情 報 通 信 業	陸 運 業	203,888	6.2	210,355	6.9
	海 運 業	29	0.0	26	0.0
	空 運 業	2,963	0.1	3,195	0.1
	倉 庫 ・ 運 輸 関 連 業	4,390	0.1	4,214	0.1
	情 報 ・ 通 信 業	91,986	2.8	91,066	3.0
商 業	卸 売 業	139,254	4.2	124,877	4.1
	小 売 業	114,287	3.5	114,189	3.8
金 融 ・ 保 険 業	銀 行 業	156,537	4.8	155,443	5.1
	証 券、商 品 先 物 取 引 業	1,266	0.0	999	0.0
	保 険 業	4,682	0.1	5,854	0.2
	そ の 他 金 融 業	26,304	0.8	28,248	0.9
不 動 産 業	16,760	0.5	17,664	0.6	
サ ー ビ ス 業	338,176	10.3	256,276	8.4	
合 計	3,292,713	100.0	3,039,725	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。

(4) 貸付金業種別内訳

(単位：百万円、%)

区 分	2021年度末		2022年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
製 造 業	248,359	10.8	224,904	9.7
食 料	34,113	1.5	29,665	1.3
織 維	1,710	0.1	1,748	0.1
木 材 ・ 木 製 品	500	0.0	500	0.0
パ ル プ ・ 紙	11,600	0.5	10,510	0.5
印 刷	20,000	0.9	18,750	0.8
化 学	35,740	1.6	35,492	1.5
石 油 ・ 石 炭	3,680	0.2	2,090	0.1
窯 業 ・ 土 石	18,678	0.8	18,642	0.8
鉄 鋼	53,243	2.3	44,241	1.9
非 鉄 金 属	3,397	0.1	4,348	0.2
金 属 製 品	957	0.0	1,000	0.0
はん用・生産用・業務用機械	23,105	1.0	23,290	1.0
電 気 機 械	14,396	0.6	14,230	0.6
輸 送 用 機 械	17,707	0.8	15,691	0.7
そ の 他 の 製 造 業	9,531	0.4	4,703	0.2
農 業 、 林 業	-	-	-	-
漁 業	-	-	-	-
鉱 業 、 採 石 業 、 砂 利 採 取 業	-	-	-	-
建 設 業	14,515	0.6	14,500	0.6
電 気 ・ ガ ス ・ 熱 供 給 ・ 水 道 業	461,963	20.1	462,625	19.9
情 報 通 信 業	65,798	2.9	67,255	2.9
運 輸 業 、 郵 便 業	246,048	10.7	235,925	10.2
卸 売 業	270,789	11.8	260,433	11.2
小 売 業	9,999	0.4	8,996	0.4
金 融 業 、 保 険 業	587,693	25.6	594,246	25.6
不 動 産 業	142,348	6.2	144,434	6.2
物 品 賃 貸 業	94,500	4.1	89,472	3.9
学術研究、専門・技術サービス業	4,450	0.2	4,450	0.2
宿 泊 業	-	-	-	-
飲 食 業	-	-	-	-
生活関連サービス業・娯楽業	8,822	0.4	11,002	0.5
教 育 、 学 習 支 援 業	-	-	-	-
医 療 ・ 福 祉	1,000	0.0	2,470	0.1
そ の 他 の サ ー ビ ス	3,607	0.2	3,154	0.1
地 方 公 共 団 体	14,367	0.6	13,186	0.6
個人（住宅・消費・納税資金等）	-	-	-	-
そ の 他	-	-	-	-
合 計	2,174,266	94.5	2,137,058	92.1
海 外 向 け				
政 府 等	4,600	0.2	4,708	0.2
金 融 機 関	-	-	-	-
商 工 業 等	120,819	5.3	177,861	7.7
合 計	125,419	5.5	182,569	7.9
一 般 貸 付 計	2,299,685	100.0	2,319,628	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	2021年度末		2022年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
公 社 債	7,915,570	71.4	5,145,024	61.6
株 式	1,247,213	11.2	1,151,835	13.8
現 預 金 ・ そ の 他	358,127	3.2	409,787	4.9
小 計	9,520,911	85.8	6,706,646	80.3

②円貨額が確定した外貨建資産

（単位：百万円、％）

区 分	2021年度末		2022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	249,723	2.3	146,646	1.8
小 計	249,723	2.3	146,646	1.8

③円貨建資産

（単位：百万円、％）

区 分	2021年度末		2022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	32,479	0.3	35,607	0.4
公 社 債 (円建外債)・その他	1,289,699	11.6	1,462,057	17.5
小 計	1,322,179	11.9	1,497,664	17.9

④合 計

（単位：百万円、％）

区 分	2021年度末		2022年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
海 外 投 融 資	11,092,814	100.0	8,350,957	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	2021年度末		2022年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
米 ド ル	4,767,764	50.1	3,272,189	48.8
ユ ー ロ	2,043,939	21.5	1,508,607	22.5
オーストラリアドル	1,164,665	12.2	908,291	13.5
カナダドル	511,586	5.4	337,683	5.0
中 国 元	233,784	2.5	192,508	2.9
イギリスポンド	323,165	3.4	179,249	2.7
ニュージーランドドル	101,797	1.1	96,818	1.4
そ の 他 共 計	9,520,911	100.0	6,706,646	100.0

(3) 海外投融資の地域別構成

(単位：百万円、%)

区 分	2021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	4,295,205	42.3	3,655,019	42.4	640,186	42.0	17,033	13.6
ヨーロッパ	2,997,139	29.5	2,582,955	30.0	414,183	27.2	40,033	31.9
オセアニア	930,971	9.2	900,036	10.4	30,935	2.0	42,960	34.3
アジア	433,859	4.3	330,364	3.8	103,495	6.8	8,006	6.4
中南米	1,273,940	12.6	939,677	10.9	334,263	21.9	17,385	13.9
中 東	261	0.0	-	-	261	0.0	-	-
アフリカ	-	-	-	-	-	-	-	-
国際機関	212,106	2.1	212,106	2.5	-	-	-	-
合 計	10,143,485	100.0	8,620,159	100.0	1,523,325	100.0	125,419	100.0
区 分	2022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	2,782,337	37.0	2,187,185	36.4	595,151	39.5	34,300	18.8
ヨーロッパ	2,151,904	28.6	1,751,088	29.1	400,816	26.6	57,488	31.5
オセアニア	773,605	10.3	744,144	12.4	29,460	2.0	66,230	36.3
アジア	336,350	4.5	253,868	4.2	82,482	5.5	8,745	4.8
中南米	1,292,251	17.2	893,392	14.9	398,859	26.5	15,804	8.7
中 東	261	0.0	-	-	261	0.0	-	-
アフリカ	-	-	-	-	-	-	-	-
国際機関	182,071	2.4	182,071	3.0	-	-	-	-
合 計	7,518,784	100.0	6,011,751	100.0	1,507,033	100.0	182,569	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	2021年度末						2022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	68	△ 477,894	-	-	-	△ 477,826	△ 25,264	△ 279,319	-	-	-	△ 304,584
ヘッジ会計非適用分	16,630	△ 15,307	△ 10,220	△ 3,224	130	△ 11,991	43,156	△ 7,384	885	△ 1,511	△ 84	35,061
合 計	16,699	△ 493,202	△ 10,220	△ 3,224	130	△ 489,817	17,891	△ 286,703	885	△ 1,511	△ 84	△ 269,522

（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。

2021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△464,255百万円）及び
 ヘッジ会計非適用分の差損益（△11,991百万円）の合計△476,246百万円
 2022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△255,686百万円）及び
 ヘッジ会計非適用分の差損益（35,061百万円）の合計△220,624百万円

（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	2021年度末				2022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	10,150	10,150	163	163	10,000	10,000	△ 338	△ 338
	固定金利支払/変動金利受取	10,000	10,000	△ 163	△ 163	13,750	13,750	684	684
	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	-	-	-	-	60,000	60,000		
		(-)	(-)	-	-	(211)	(211)	169	41
	固定金利支払/変動金利受取	-	-	-	-	60,000	60,000		
		(-)	(-)	-	-	(211)	(211)	246	△ 34
	買建								
固定金利受取/変動金利支払	-	-	-	-	6,000	6,000			
	(-)	(-)	-	-	(201)	(201)	186	△ 14	
固定金利支払/変動金利受取	1,340,000	1,030,000	24,329	16,630	886,000	761,000	49,504	42,817	
	(7,698)	(7,216)			(6,687)	(5,694)			
合 計				16,630				43,156	

（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	2021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	-	150	-	-	-	10,000	10,150
平均受取固定金利	-	0.16	-	-	-	0.64	0.63
平均支払変動金利	-	0.07	-	-	-	△ 0.06	△ 0.06
円建支払側固定スワップ想定元本	-	-	-	-	-	10,000	10,000
平均支払固定金利	-	-	-	-	-	0.64	0.64
平均受取変動金利	-	-	-	-	-	△ 0.06	△ 0.06
合 計	-	150	-	-	-	20,000	20,150
区 分	2022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	-	-	-	-	-	0.09	0.09
円建支払側固定スワップ想定元本	-	-	-	-	-	13,750	13,750
平均支払固定金利	-	-	-	-	-	0.68	0.68
平均受取変動金利	-	-	-	-	-	0.07	0.07
合 計	-	-	-	-	-	23,750	23,750

②通貨関連

(単位：百万円)

区分	種類	2021年度末			2022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	△ 1,522	△ 1,522	14,205	△ 3,252	△ 3,252
	為替予約						
	売建	408,500	△ 10,982	△ 10,982	451,794	△ 6,677	△ 6,677
	(米ドル)	163,173	△ 1,346	△ 1,346	164,296	△ 4,716	△ 4,716
	(ユーロ)	13,396	△ 654	△ 654	107,132	△ 1,978	△ 1,978
	(オーストラリアドル)	76,742	△ 5,487	△ 5,487	77,315	14	14
	(イギリスポンド)	31,680	△ 1,432	△ 1,432	56,541	△ 0	△ 0
	(カナダドル)	19,540	△ 960	△ 960	14,315	△ 180	△ 180
	(その他)	103,967	△ 1,100	△ 1,100	32,192	185	185
	買建	265,622	△ 2,458	△ 2,458	214,496	2,545	2,545
	(米ドル)	165,748	△ 3,600	△ 3,600	139,469	2,876	2,876
	(ユーロ)	28,075	729	729	32,002	△ 78	△ 78
	(イギリスポンド)	9,265	44	44	21,016	36	36
	(オーストラリアドル)	12,083	5	5	9,998	△ 214	△ 214
	(カナダドル)	-	-	-	2,189	-	-
	(その他)	50,449	361	361	9,819	△ 75	△ 75
	通貨オプション						
	売建						
	プット	10,561			-		
	(227)		66	160	(-)	-	-
	(ユーロ)	10,561			-		
	(227)		66	160	(-)	-	-
	コール	10,581			-		
	(-)		-	-	(-)	-	-
	(米ドル)	10,581			-		
	(-)		-	-	(-)	-	-
	買建						
プット	239,967			-			
(837)		333	△ 503	(-)	-	-	
(米ドル)	130,202			-			
(256)		0	△ 256	(-)	-	-	
(ユーロ)	109,765			-			
(580)		333	△ 246	(-)	-	-	
コール	52,905			-			
(-)		-	-	(-)	-	-	
(米ドル)	52,905			-			
(-)		-	-	(-)	-	-	
合 計			△ 15,307			△ 7,384	

- (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	2021年度末			2022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	28,465	△ 2,931	△ 2,931	-	-	-
	買建	-	-	-	9,993	△ 666	△ 666
	外貨建株価指数先物						
	売建	31,036	△ 2,789	△ 2,789	19,930	1,658	1,658
	円建株価指数オプション						
買建	316,049			307,768			
プット	(6,479)	2,919	△ 3,559	(4,921)	5,117	195	
外貨建株価指数オプション							
買建	31,983			-			
プット	(1,591)	650	△ 940	(-)	-	-	
店頭	国内株式先渡契約						
売建	-	-	-	8,283	△ 302	△ 302	
合計				△ 10,220			885

- (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。

④債券関連

(単位：百万円)

区分	種類	2021年度末			2022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	25,398	99	99	-	-	-
	買建	3,606	△ 13	△ 13	-	-	-
	外貨建債券先物						
売建	316,975	10,921	10,921	220,820	5,374	5,374	
買建	432,600	△ 12,578	△ 12,578	193,625	△ 6,694	△ 6,694	
店頭	外貨建債券先渡契約						
	売建	87,693	2,357	2,357	3,858	160	160
	買建	126,811	△ 3,872	△ 3,872	3,704	△ 185	△ 185
	円建債券店頭オプション						
	売建						
	コール	19,200			30,442		
	(48)		16	31	(26)	47	△ 21
	プット	41,988			109,522		
	(181)		246	△ 64	(557)	493	64
	買建						
コール	41,988			109,522			
(154)		41	△ 112	(513)	316	△ 196	
プット	19,200			30,442			
(53)		60	7	(32)	20	△ 12	
合計				△ 3,224			△ 1,511

- (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	2021年度末				2022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	9,200	7,200	150	150	42,400	28,350	△ 28	△ 28
	プロテクション買建	3,000	-	△ 20	△ 20	11,000	8,000	△ 56	△ 56
合計					130				△ 84

(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	2021年度末				2022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	14,600	10,600	△ 34	△ 34	10,600	10,600	△ 106	△ 106
	固定金利受取／変動金利支払	保険負債	700,000	700,000	△ 481	△ 481	700,000	700,000	△ 26,202	△ 26,202
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	8,300	8,300	81	81	8,300	2,300	63	63
	固定金利支払／変動金利受取	借入金	325,000	181,000	503	503	325,000	181,000	981	981
合計						68				△ 25,264

(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	2021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		
円建受取側固定スワップ想定元本	4,000	6,000	2,900	10,000	-	700,000	722,900	
平均受取固定金利	0.12	△ 0.02	0.97	0.10	-	0.47	0.46	
平均支払変動金利	0.07	0.10	0.07	0.00	-	0.06	0.06	
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	148,000	6,000	183,900	10,000	-	700,000	1,047,900	
区分	2022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		
円建受取側固定スワップ想定元本	6,000	-	2,900	10,000	-	700,000	718,900	
平均受取固定金利	△ 0.02	-	0.97	0.10	-	0.47	0.46	
平均支払変動金利	0.10	-	0.06	△ 0.01	-	0.10	0.09	
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	150,000	-	183,900	10,000	-	700,000	1,043,900	

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	2021年度末				2022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	192,809	175,356	△ 13,639	△ 13,639	231,114	218,078	△ 23,633	△ 23,633
	(米ドル)		115,499	104,077	△ 8,735	△ 8,735	143,705	143,504	△ 22,624	△ 22,624
	(ユーロ)		65,382	59,351	△ 4,488	△ 4,488	67,530	54,696	△ 3,479	△ 3,479
	(イギリスポンド)		11,927	11,927	△ 415	△ 415	19,877	19,877	2,470	2,470
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		5,839,213	-	△ 474,485	△ 474,485	4,250,585	-	△ 268,787	△ 268,787
	(米ドル)		2,940,436	-	△ 273,968	△ 273,968	1,772,161	-	△ 223,214	△ 223,214
	(ユーロ)		1,302,139	-	△ 47,364	△ 47,364	1,403,049	-	△ 45,610	△ 45,610
	(オーストラリアドル)		806,327	-	△ 92,374	△ 92,374	638,618	-	689	689
	(カナダドル)		412,680	-	△ 34,194	△ 34,194	273,393	-	△ 2,230	△ 2,230
	(イギリスポンド)		154,103	-	△ 9,791	△ 9,791	47,894	-	152	152
	(その他)		223,525	-	△ 16,791	△ 16,791	115,467	-	1,426	1,426
	買建		151,085	-	10,230	10,230	452,331	-	13,100	13,100
	(ユーロ)		477	-	22	22	354,893	-	5,920	5,920
	(米ドル)		109,969	-	7,484	7,484	95,145	-	7,223	7,223
	(オーストラリアドル)		10,488	-	475	475	1,567	-	△ 55	△ 55
	(イギリスポンド)		618	-	3	3	724	-	12	12
	(カナダドル)		7,823	-	160	160	-	-	-	-
(その他)	21,707	-	2,082	2,082	-	-	-	-		
為替予約等の振当処理	為替予約	外貨建定期預金								
	売建		223,000	-	-	-	123,000	-	-	-
	(米ドル)		73,000	-	-	-	73,000	-	-	-
	(その他)	150,000	-	-	-	50,000	-	-	-	
	通貨スワップ	外貨建社債(負債)								
	(米ドル)		368,715	368,715	-	-	368,715	368,715	-	-
	通貨スワップ	外貨建貸付金								
(米ドル)	26,877		23,608	-	-	23,923	13,335	-	-	
(ユーロ)	24,491		23,608	-	-	23,923	13,335	-	-	
(その他)	2,385		-	-	-	-	-	-	-	
合 計						△ 477,894			△ 279,319	

(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に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

2021年度末、2022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

2021年度末、2022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

2021年度末、2022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。