

2022年度決算関係補足資料

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（ヘッジ会計適用分・非適用分の内訳）	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年度末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
国 債	15,469,602	48.8	15,254,703	56.5
地 方 債	106,012	0.3	117,628	0.4
社 債	1,827,166	5.8	1,702,676	6.3
うち公社・公団債	386,821	1.2	414,373	1.5
株 式	3,292,713	10.4	3,207,944	11.9
外 国 証 券	10,143,485	32.0	5,930,212	22.0
公 社 債	8,620,159	27.2	4,454,788	16.5
株 式 等	1,523,325	4.8	1,475,424	5.5
そ の 他 の 証 券	858,702	2.7	798,919	3.0
合 計	31,697,684	100.0	27,012,086	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	351,058	1,244,295	1,670,421	1,431,769	2,052,744	20,261,795	27,012,086	
国 債	106,774	366,768	408,535	678,159	1,150,088	12,544,377	15,254,703	
地 方 債	2,758	11,717	6,599	2,906	291	93,355	117,628	
社 債	99,947	229,614	222,170	101,153	134,383	915,407	1,702,676	
株 式	-	-	-	-	-	3,207,944	3,207,944	
外 国 証 券	125,758	597,545	750,643	533,905	633,099	3,289,260	5,930,212	
公 社 債	115,718	576,713	691,704	388,440	486,701	2,195,509	4,454,788	
株 式 等	10,040	20,832	58,938	145,464	146,397	1,093,750	1,475,424	
そ の 他 の 証 券	15,820	38,648	282,472	115,645	134,882	211,450	798,919	
買 入 金 銭 債 権	2,997	21,958	23,175	9,166	5,591	161,665	224,555	
譲 渡 性 預 金	70,997	-	-	-	-	-	70,997	
そ の 他	-	-	-	-	-	6,727	6,727	

(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年度末	
		金 額	占 率	金 額	占 率
水 産 ・ 農 林 業		253	0.0	249	0.0
鉱 業		200	0.0	200	0.0
建 設 業		106,940	3.2	105,329	3.3
製 造 業	食 料 品	193,957	5.9	219,146	6.8
	織 維 製 品	19,699	0.6	20,793	0.6
	パ ル プ ・ 紙	2,935	0.1	2,658	0.1
	化 学	172,474	5.2	171,356	5.3
	医 薬 品	74,608	2.3	100,977	3.1
	石 油 ・ 石 炭 製 品	3,357	0.1	3,555	0.1
	ゴ ム 製 品	15,131	0.5	19,424	0.6
	ガ ラ ス ・ 土 石 製 品	97,476	3.0	107,765	3.4
	鉄 鋼	44,293	1.3	34,402	1.1
	非 鉄 金 属	11,202	0.3	12,077	0.4
	金 属 製 品	32,942	1.0	32,076	1.0
	機 械	228,622	6.9	219,057	6.8
	電 気 機 器	734,986	22.3	700,083	21.8
	輸 送 用 機 器	186,635	5.7	165,788	5.2
	精 密 機 器	151,965	4.6	148,682	4.6
そ の 他 製 品	75,665	2.3	85,966	2.7	
電 気 ・ ガ ス 業		38,835	1.2	37,210	1.2
運 輸 ・ 情 報 通 信 業	陸 運 業	203,888	6.2	178,867	5.6
	海 運 業	29	0.0	28	0.0
	空 運 業	2,963	0.1	3,327	0.1
	倉 庫 ・ 運 輸 関 連 業	4,390	0.1	4,520	0.1
	情 報 ・ 通 信 業	91,986	2.8	102,384	3.2
商 業	卸 売 業	139,254	4.2	153,258	4.8
	小 売 業	114,287	3.5	114,908	3.6
金 融 ・ 保 険 業	銀 行 業	156,537	4.8	163,620	5.1
	証 券 ・ 商 品 先 物 取 引 業	1,266	0.0	618	0.0
	保 険 業	4,682	0.1	6,143	0.2
	そ の 他 金 融 業	26,304	0.8	31,486	1.0
不 動 産 業		16,760	0.5	16,633	0.5
サ ー ビ ス 業		338,176	10.3	245,345	7.6
合 計		3,292,713	100.0	3,207,944	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	
								2021年度末
	固定金利	326,399	339,132	394,564	202,637	181,428	365,696	1,809,860
	一般貸付計	346,171	388,148	424,015	232,317	201,725	707,301	2,299,685
2022年度末	変動金利	10,643	78,216	49,560	72,781	43,437	354,114	608,753
	固定金利	437,306	323,212	344,854	217,918	150,282	382,420	1,855,994
	一般貸付計	447,949	401,428	394,415	290,699	193,719	736,534	2,464,747

（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		2021年度末		2022年度末		
		金額	占 率	金額	占 率	
大 企 業	貸付先数	205	60.1	204	60.7	
	金 額	1,625,276	81.9	1,659,429	81.7	
中 堅 企 業	貸付先数	7	2.1	5	1.5	
	金 額	4,477	0.2	4,044	0.2	
中 小 企 業	貸付先数	129	37.8	127	37.8	
	金 額	354,972	17.9	367,663	18.1	
国内企業向け 貸付計		貸付先数 金 額	341 1,984,726	100.0 100.0	336 2,031,138	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	
	常用する 従業員 300名超 かつ	資本金10億円 以上 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10億円 以上 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10億円 以上 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10億円 以上 資本金1億円超 10億円未満
大 企 業	常用する 従業員 300名超 かつ	資本金10億円 以上 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10億円 以上 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10億円 以上 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10億円 以上 資本金1億円超 10億円未満
中 堅 企 業								
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	2021年度末		2022年度末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
担 保 貸 付	2,360	0.1	2,217	0.1
有価証券担保貸付	1,354	0.1	1,318	0.1
不動産・動産・ 財団担保貸付	1,006	0.0	899	0.0
指名債権担保貸付	-	-	-	-
保 証 貸 付	90,063	3.9	86,273	3.5
信 用 貸 付	2,207,261	96.0	2,376,255	96.4
そ の 他	-	-	-	-
一 般 貸 付 計	2,299,685	100.0	2,464,747	100.0
うち劣後特約付 貸	222,562	9.7	247,058	10.0

（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	2021年度末		2022年度末		
	金 額	占 率	金 額	占 率	
製 造 業	食 料	248,359	10.8	220,580	8.9
	織 維	34,113	1.5	27,479	1.1
	木 材 ・ 木 製 品	1,710	0.1	676	0.0
	パ ル プ ・ 紙	500	0.0	500	0.0
	印 刷	11,600	0.5	10,920	0.4
	化 学	20,000	0.9	17,500	0.7
	石 油 ・ 石 炭	35,740	1.6	34,972	1.4
	窯 業 ・ 土 石	3,680	0.2	2,000	0.1
	鉄 鋼	18,678	0.8	19,195	0.8
	非 鉄 金 属	53,243	2.3	44,968	1.8
	金 属 製 品	3,397	0.1	5,288	0.2
	はん用・生産用・業務用機械	957	0.0	950	0.0
	電 気 機 械	23,105	1.0	22,222	0.9
	輸 送 用 機 械	14,396	0.6	14,438	0.6
	そ の 他 の 製 造 業	17,707	0.8	12,864	0.5
そ の 他 の 製 造 業	9,531	0.4	6,606	0.3	
国 内 向 け	農 業 、 林 業	-	-	-	-
	漁 業	-	-	-	-
	鉱 業 、 採 石 業 、 砂 利 採 取 業	-	-	-	-
	建 設 業	14,515	0.6	15,762	0.6
	電 気 ・ ガ ス ・ 熱 供 給 ・ 水 道 業	461,963	20.1	485,134	19.7
	情 報 通 信 業	65,798	2.9	67,124	2.7
	運 輸 業 、 郵 便 業	246,048	10.7	229,873	9.3
	卸 売 業	270,789	11.8	216,433	8.8
	小 売 業	9,999	0.4	8,909	0.4
	金 融 業 、 保 険 業	587,693	25.6	719,225	29.2
	不 動 産 業	142,348	6.2	147,019	6.0
	物 品 賃 貸 業	94,500	4.1	91,577	3.7
	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	11,507	0.5
	教 育 、 学 習 支 援 業	-	-	-	-
	医 療 ・ 福 祉	1,000	0.0	2,463	0.1
	そ の 他 の サ ー ビ ス	3,607	0.2	2,701	0.1
	地 方 公 共 団 体	14,367	0.6	12,006	0.5
個 人 (住 宅 ・ 消 費 ・ 納 税 資 金 等)	-	-	-	-	
そ の 他	-	-	-	-	
合 計	2,174,266	94.5	2,234,768	90.7	
海 外 向 け	政 府 等	4,600	0.2	4,484	0.2
	金 融 機 関	-	-	-	-
	商 工 業 等	120,819	5.3	225,494	9.1
合 計	125,419	5.5	229,978	9.3	
一 般 貸 付 計	2,299,685	100.0	2,464,747	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年度末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
公 社 債	7,915,570	71.4	3,345,415	50.7
株 式	1,247,213	11.2	1,169,397	17.7
現 預 金 ・ そ の 他	358,127	3.2	422,964	6.4
小 計	9,520,911	85.8	4,937,777	74.8

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年度末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
公 社 債	-	-	-	-
現 預 金 ・ そ の 他	249,723	2.3	27,881	0.4
小 計	249,723	2.3	27,881	0.4

③円貨建資産

(単位：百万円、%)

区 分	2021年度末		2022年度末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
非 居 住 者 貸 付	32,479	0.3	35,913	0.5
公社債（円建外債）・その他	1,289,699	11.6	1,599,936	24.2
小 計	1,322,179	11.9	1,635,849	24.8

④合 計

(単位：百万円、%)

区 分	2021年度末		2022年度末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
海 外 投 融 資	11,092,814	100.0	6,601,508	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年度末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
米 ド ル	4,767,764	50.1	2,522,477	51.1
オーストラリアドル	1,164,665	12.2	914,427	18.5
ユ ー ロ	2,043,939	21.5	890,921	18.0
イギリスポンド	323,165	3.4	172,040	3.5
カナダドル	511,586	5.4	115,921	2.3
ニュージーランドドル	101,797	1.1	78,371	1.6
中 国 元	233,784	2.5	72,904	1.5
そ の 他 共 計	9,520,911	100.0	4,937,777	100.0

(3) 海外投融資の地域別構成

(単位：百万円、%)

区 分	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	
2021年度末	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
2022年度末	北 米	2,034,652	34.3	1,428,359	32.1	606,292	41.1	41,098	17.9
	ヨーロッパ	1,592,890	26.9	1,224,281	27.5	368,608	25.0	78,316	34.1
	オセアニア	721,325	12.2	692,642	15.5	28,682	1.9	77,958	33.9
	アジア	210,608	3.6	155,378	3.5	55,230	3.7	8,855	3.9
	中南米	1,195,865	20.2	779,517	17.5	416,348	28.2	23,750	10.3
	中 東	261	0.0	-	-	261	0.0	-	-
	アフリカ	-	-	-	-	-	-	-	-
	国際機関	174,608	2.9	174,608	3.9	-	-	-	-
	合 計	5,930,212	100.0	4,454,788	100.0	1,475,424	100.0	229,978	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	△ 25,897	△ 71,887	-	-	-	△ 97,785
ヘッジ会計非適用分	16,630	△ 15,307	△ 10,220	△ 3,224	130	△ 11,991	14,266	△ 7,027	△ 2,345	418	405	5,716
合 計	16,699	△ 493,202	△ 10,220	△ 3,224	130	△ 489,817	△ 11,631	△ 78,915	△ 2,345	418	405	△ 92,068

（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△56,613百万円）及びヘッジ会計非適用分の差損益（5,716百万円）の合計△50,896百万円

（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	10,000	10,000	338	338
	円建金利スワップション 買建 固定金利支払／変動金利受取	1,340,000 (7,698)	1,030,000 (7,216)	24,329	16,630	1,580,000 (19,754)	635,000 (7,108)	34,020	14,266
合 計					16,630				14,266

（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	-	-	-	-	-	0.10	0.10
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	-	-	-	-	-	0.10	0.10
合 計	-	-	-	-	-	20,000	20,000

②通貨関連

(単位：百万円)

区分	種類	2021年度末			2022年度末		
		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	-	-	-
	為替予約						
	売建	408,500	△ 10,982	△ 10,982	369,137	△ 4,514	△ 4,514
	(米ドル)	163,173	△ 1,346	△ 1,346	116,964	△ 870	△ 870
	(オーストラリアドル)	76,742	△ 5,487	△ 5,487	76,562	980	980
	(ユーロ)	13,396	△ 654	△ 654	52,526	△ 2,045	△ 2,045
	(イギリスポンド)	31,680	△ 1,432	△ 1,432	49,145	△ 2,390	△ 2,390
	(カナダドル)	19,540	△ 960	△ 960	18,506	△ 94	△ 94
	(その他)	103,967	△ 1,100	△ 1,100	55,432	△ 94	△ 94
	買建	265,622	△ 2,458	△ 2,458	84,560	229	229
	(米ドル)	165,748	△ 3,600	△ 3,600	59,013	47	47
	(イギリスポンド)	9,265	44	44	2,630	49	49
	(ユーロ)	28,075	729	729	2,301	54	54
	(カナダドル)	-	-	-	1,624	-	-
	(オーストラリアドル)	12,083	5	5	1,414	8	8
	(その他)	50,449	361	361	17,574	70	70
	通貨オプション						
	売建						
	ブット	10,561			-		
	(ユーロ)	(227)	66	160	(-)	-	-
	コール	10,581			49,272		
	(米ドル)	(-)	-	-	(311)	115	195
	(ユーロ)	10,581			49,272		
	(米ドル)	(-)	-	-	(311)	115	195
	買建						
	ブット	239,967			188,951		
	(米ドル)	(837)	333	△ 503	(4,283)	1,345	△ 2,938
(オーストラリアドル)	130,202	0	△ 256	138,564	829	△ 2,279	
(ユーロ)	(256)	-	-	(3,109)			
(その他)	-	-	-	50,387	515	△ 659	
コール	109,765			-			
(ユーロ)	(580)	333	△ 246	(-)	-	-	
ブット	52,905			-			
(米ドル)	(-)	-	-	(-)	-	-	
(ユーロ)	52,905			-			
(米ドル)	(-)	-	-	(-)	-	-	
合 計			△ 15,307			△ 7,027	

- (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	-	-	-
	外貨建株価指数先物 売建	31,036	△ 2,789	△ 2,789	-	-	-
	円建株価指数オプション 買建 プット	316,049 (6,479)	2,919	△ 3,559	330,195 (4,081)	2,169	△ 1,912
	外貨建株価指数オプション 買建 プット	31,983 (1,591)	650	△ 940	39,690 (588)	155	△ 433
合計				△ 10,220			△ 2,345

- (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	2021年度末			2022年度末		
		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	-	-	-
	買建	432,600	△ 12,578	△ 12,578	-	-	-
店頭	外貨建債券先渡契約 売建	87,693	2,357	2,357	-	-	-
	買建	126,811	△ 3,872	△ 3,872	-	-	-
	円建債券店頭オプション 売建 コール	19,200 (48)	16	31	29,124 (25)	72	△ 47
	プット	41,988 (181)	246	△ 64	95,842 (341)	102	239
	買建 コール	41,988 (154)	41	△ 112	95,842 (296)	554	257
	プット	19,200 (53)	60	7	29,124 (33)	0	△ 32
合計				△ 3,224			418

- (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	9,200	7,200	150	150	68,000	26,600	446	446
	プロテクション買建	3,000	-	△ 20	△ 20	7,000	7,000	△ 40	△ 40
合計					130				405

(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	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	△ 96	△ 96
	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	△ 27,059	△ 27,059
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	53	53
	固定金利支払/変動金利受取	借入金	325,000	181,000	503	503	245,000	245,000	1,204	1,204
合計						68				△ 25,897

(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	2,300	10,600	-	-	700,000	718,900	
平均受取固定金利	△ 0.02	1.19	0.10	-	-	0.47	0.46	
平均支払変動金利	0.06	0.07	△ 0.00	-	-	0.03	0.03	
円建支払側固定スワップ想定元本	-	181,000	64,000	-	-	-	245,000	
平均支払固定金利	-	0.09	0.41	-	-	-	0.17	
平均受取変動金利	-	0.14	0.14	-	-	-	0.14	
合計	6,000	183,300	74,600	-	-	700,000	963,900	

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	310,111	297,161	△ 15,273	△ 15,273
	(米ドル)		115,499	104,077	△ 8,735	△ 8,735	207,737	205,890	△ 11,073	△ 11,073
	(ユーロ)		65,382	59,351	△ 4,488	△ 4,488	82,801	71,698	△ 5,074	△ 5,074
	(イギリスポンド)		11,927	11,927	△ 415	△ 415	19,572	19,572	873	873
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	2,243,706	-	△ 57,587	△ 57,587
	(米ドル)		2,940,436	-	△ 273,968	△ 273,968	998,694	-	△ 42,438	△ 42,438
	(オーストラリアドル)		806,327	-	△ 92,374	△ 92,374	640,128	-	1,316	1,316
	(ユーロ)		1,302,139	-	△ 47,364	△ 47,364	480,482	-	△ 14,633	△ 14,633
	(カナダドル)		412,680	-	△ 34,194	△ 34,194	36,023	-	△ 769	△ 769
	(イギリスポンド)		154,103	-	△ 9,791	△ 9,791	34,167	-	△ 1,325	△ 1,325
	(その他)		223,525	-	△ 16,791	△ 16,791	54,210	-	262	262
	買建		151,085	-	10,230	10,230	94,813	-	973	973
	(ユーロ)		477	-	22	22	42,573	-	1,035	1,035
	(米ドル)		109,969	-	7,484	7,484	36,963	-	△ 26	△ 26
	(カナダドル)		7,823	-	160	160	13,472	-	△ 67	△ 67
	(イギリスポンド)		618	-	3	3	567	-	26	26
	(オーストラリアドル)		10,488	-	475	475	67	-	△ 1	△ 1
(その他)	21,707	-	2,082	2,082	1,169	-	8	8		
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	-	-	-	5,000	-	-	-
	(米ドル)		73,000	-	-	-	5,000	-	-	-
	(その他)	150,000	-	-	-	-	-	-	-	
	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	-	-	22,878	12,958	-	-	
(ユーロ)	24,491		23,608	-	-	22,878	12,958	-	-	
			2,385	-	-	-	-	-	-	
合 計									△ 71,887	

(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年度末ともに期末残高がないため、記載していません。