

2024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）	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	2023年度末		2024年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
国 債	15,936,171	55.7	16,111,483	57.8
地 方 債	121,805	0.4	120,531	0.4
社 債	1,874,903	6.5	1,894,346	6.8
うち公社・公団債	402,652	1.4	382,956	1.4
株 式	4,036,229	14.1	3,638,572	13.1
外 国 証 券	5,400,341	18.9	4,757,817	17.1
公 社 債	3,742,801	13.1	3,200,907	11.5
株 式 等	1,657,540	5.8	1,556,909	5.6
そ の 他 の 証 券	1,261,978	4.4	1,343,549	4.8
合 計	28,631,430	100.0	27,866,301	100.0

(2) 有価証券残存期間別残高

(単位：百万円)

区 分	2023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	430,560	1,234,083	1,872,503	1,823,358	2,031,639	21,239,284	28,631,430	
国 債	104,089	372,120	277,510	894,008	1,051,930	13,236,511	15,936,171	
地 方 債	509	21,795	2,904	2	3,889	92,704	121,805	
社 債	74,065	203,840	272,447	174,096	182,032	968,419	1,874,903	
株 式	-	-	-	-	-	4,036,229	4,036,229	
外 国 証 券	251,377	571,713	705,095	555,421	673,729	2,643,003	5,400,341	
公 社 債	239,581	520,081	590,175	406,756	498,901	1,487,304	3,742,801	
株 式 等	11,795	51,632	114,920	148,665	174,827	1,155,698	1,657,540	
そ の 他 の 証 券	519	64,612	614,544	199,829	120,057	262,416	1,261,978	
買 入 金 銭 債 権	3,422	14,980	29,448	18,371	3,332	136,654	206,210	
譲 渡 性 預 金	90,994	-	-	-	-	-	90,994	
そ の 他	-	-	-	-	-	8,872	8,872	

区 分	2024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	598,109	1,007,278	1,822,888	1,883,023	1,966,913	20,588,087	27,866,301	
国 債	147,188	372,139	218,067	1,008,462	1,047,023	13,318,601	16,111,483	
地 方 債	4,779	17,329	2,904	1	3,888	91,628	120,531	
社 債	65,486	195,489	321,390	189,823	120,590	1,001,566	1,894,346	
株 式	-	-	-	-	-	3,638,572	3,638,572	
外 国 証 券	352,498	394,952	506,283	523,915	662,531	2,317,635	4,757,817	
公 社 債	328,066	354,210	381,098	321,553	543,380	1,272,598	3,200,907	
株 式 等	24,432	40,742	125,184	202,361	119,150	1,045,037	1,556,909	
そ の 他 の 証 券	28,155	27,367	774,242	160,821	132,879	220,082	1,343,549	
買 入 金 銭 債 権	1,403	14,233	32,735	19,842	4,101	129,404	201,720	
譲 渡 性 預 金	90,993	-	-	-	-	-	90,993	
そ の 他	-	-	-	-	-	8,682	8,682	

(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		2023年度末		2024年度 第2四半期(上半期)末	
		金 額	占 率	金 額	占 率
水 産 ・ 農 林 業		290	0.0	173	0.0
鉱 業		200	0.0	200	0.0
建 設 業		151,577	3.8	147,272	4.0
製 造 業	食 料 品	261,579	6.5	260,086	7.1
	織 維 製 品	18,942	0.5	21,347	0.6
	パ ル プ ・ 紙	3,200	0.1	2,980	0.1
	化 学	199,429	4.9	197,602	5.4
	医 薬 品	105,893	2.6	78,790	2.2
	石 油 ・ 石 炭 製 品	6,024	0.1	4,490	0.1
	ゴ ム 製 品	22,566	0.6	17,675	0.5
	ガ ラ ス ・ 土 石 製 品	163,975	4.1	140,872	3.9
	鉄 鋼	36,369	0.9	29,376	0.8
	非 鉄 金 属	18,375	0.5	20,549	0.6
	金 属 製 品	41,416	1.0	50,353	1.4
	機 械	263,066	6.5	231,084	6.4
	電 気 機 器	919,168	22.8	813,442	22.4
	輸 送 用 機 器	282,731	7.0	209,580	5.8
	精 密 機 器	200,275	5.0	187,262	5.1
そ の 他 製 品	88,314	2.2	100,328	2.8	
電 気 ・ ガ ス 業		48,628	1.2	45,365	1.2
運 輸 ・ 情 報 通 信 業	陸 運 業	160,167	4.0	145,200	4.0
	海 運 業	32	0.0	-	-
	空 運 業	3,726	0.1	2,562	0.1
	倉 庫 ・ 運 輸 関 連 業	4,955	0.1	4,220	0.1
	情 報 ・ 通 信 業	115,170	2.9	111,666	3.1
商 業	卸 売 業	220,031	5.5	224,701	6.2
	小 売 業	122,747	3.0	109,293	3.0
金 融 ・ 保 険 業	銀 行 業	239,483	5.9	199,003	5.5
	証 券、商 品 先 物 取 引 業	597	0.0	564	0.0
	保 険 業	7,200	0.2	7,847	0.2
	そ の 他 金 融 業	46,354	1.1	37,126	1.0
不 動 産 業		23,572	0.6	18,909	0.5
サ ー ビ ス 業		260,161	6.4	218,639	6.0
合 計		4,036,229	100.0	3,638,572	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
2023年度末	変動金利	52,847	88,862	103,452	73,406	76,940	471,490	867,000
	固定金利	551,237	475,628	257,522	180,132	150,049	392,627	2,007,197
	一般貸付計	604,084	564,491	360,974	253,539	226,989	864,118	2,874,198
2024年度 第2四半期 (上半期)末	変動金利	58,644	84,947	141,402	62,016	81,783	459,762	888,557
	固定金利	532,243	504,792	265,975	151,654	200,323	358,558	2,013,548
	一般貸付計	590,887	589,739	407,378	213,671	282,107	818,321	2,902,105

（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		2023年度末		2024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	199	61.2	201	61.8	
	貸付金額	1,900,854	82.3	1,918,090	82.7	
中 堅 企 業	貸付先数	6	1.8	5	1.5	
	貸付金額	5,323	0.2	4,144	0.2	
中 小 企 業	貸付先数	120	36.9	119	36.6	
	貸付金額	402,428	17.4	397,802	17.1	
国内企業向け 貸付計		貸付先数 金額	325 2,308,606	100.0 100.0	325 2,320,037	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		2023年度末		2024年度 第2四半期(上半期)末	
		金 額	占 率	金 額	占 率
担 保 貸 付		2,904	0.1	3,010	0.1
	有価証券 担保貸付	1,913	0.1	1,881	0.1
	不動産・動産・ 財団担保貸付	990	0.0	1,128	0.0
	指名債権 担保貸付	-	-	-	-
保 証 貸 付		100,723	3.5	91,266	3.1
信 用 貸 付		2,770,570	96.4	2,807,829	96.8
そ の 他		-	-	-	-
一 般 貸 付 計		2,874,198	100.0	2,902,105	100.0
	うち劣後特約 貸付	264,514	9.2	263,642	9.1

（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	2023年度末		2024年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
製 造 業	196,533	6.8	185,598	6.4
食 料	35,818	1.2	35,142	1.2
織 維	540	0.0	552	0.0
木 材 ・ 木 製 品	-	-	-	-
パ ル プ ・ 紙	2,716	0.1	2,581	0.1
印 刷	15,000	0.5	13,750	0.5
化 学	28,672	1.0	22,400	0.8
石 油 ・ 石 炭	500	0.0	500	0.0
窯 業 ・ 土 石	21,213	0.7	21,088	0.7
鉄 鋼	31,737	1.1	31,645	1.1
非 鉄 金 属	7,184	0.2	7,018	0.2
金 属 製 品	540	0.0	780	0.0
はん用・生産用・業務用機械	23,583	0.8	22,379	0.8
電 気 機 械	9,939	0.3	9,950	0.3
輸 送 用 機 械	12,816	0.4	12,024	0.4
そ の 他 の 製 造 業	6,272	0.2	5,786	0.2
農 業 、 林 業	-	-	-	-
漁 業	-	-	-	-
鉱 業 、 採 石 業 、 砂 利 採 取 業	-	-	-	-
建 設 業	15,532	0.5	16,258	0.6
電 気 ・ ガ ス ・ 熱 供 給 ・ 水 道 業	501,023	17.4	503,500	17.3
情 報 通 信 業	57,156	2.0	41,859	1.4
運 輸 業 、 郵 便 業	228,930	8.0	224,868	7.7
卸 売 業	179,210	6.2	168,307	5.8
小 売 業	9,038	0.3	8,734	0.3
金 融 業 、 保 険 業	1,068,210	37.2	1,093,506	37.7
不 動 産 業	156,272	5.4	153,090	5.3
物 品 賃 貸 業	82,966	2.9	73,614	2.5
学 術 研 究 、 専 門 ・ 技 術 サービス 業	6,120	0.2	6,201	0.2
宿 泊 業	-	-	-	-
飲 食 業	-	-	-	-
生 活 関 連 サービス 業 ・ 娯 楽 業	6,954	0.2	6,760	0.2
教 育 、 学 習 支 援 業	-	-	-	-
医 療 ・ 福 祉	1,788	0.1	2,689	0.1
そ の 他 の サービス	1,875	0.1	1,505	0.1
地 方 公 共 団 体	9,645	0.3	8,465	0.3
個 人 (住 宅 ・ 消 費 ・ 納 税 資 金 等)	-	-	-	-
そ の 他	-	-	-	-
合 計	2,521,259	87.7	2,494,961	86.0
海 外 向 け				
政 府 等	6,795	0.2	5,261	0.2
金 融 機 関	-	-	-	-
商 工 業 等	346,143	12.0	401,883	13.8
合 計	352,939	12.3	407,144	14.0
一 般 貸 付 計	2,874,198	100.0	2,902,105	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	2023年度末		2024年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
公 社 債	2,807,267	44.0	2,392,408	41.4
株 式	1,363,963	21.4	1,260,353	21.8
現 預 金 ・ そ の 他	575,968	9.0	602,674	10.4
小 計	4,747,199	74.5	4,255,435	73.6

②円貨額が確定した外貨建資産

（単位：百万円、％）

区 分	2023年度末		2024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	20,190	0.3	15,254	0.3
小 計	20,190	0.3	15,254	0.3

③円貨建資産

（単位：百万円、％）

区 分	2023年度末		2024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	32,260	0.5	51,958	0.9
公 社 債 (円 建 外 債) ・ そ の 他	1,575,320	24.7	1,461,611	25.3
小 計	1,607,580	25.2	1,513,569	26.2

④合 計

（単位：百万円、％）

区 分	2023年度末		2024年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
海 外 投 融 資	6,374,971	100.0	5,784,260	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	2023年度末		2024年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
米 ド ル	2,779,553	58.6	2,625,031	61.7
ユ ー ロ	744,208	15.7	688,657	16.2
オーストラリアドル	771,303	16.2	504,126	11.8
イギリスポンド	170,489	3.6	185,813	4.4
カナダドル	74,948	1.6	76,651	1.8
インドルピー	25,865	0.5	36,881	0.9
ニュージーランドドル	39,920	0.8	21,686	0.5
そ の 他 共 計	4,747,199	100.0	4,255,435	100.0

(3) 海外投融资の地域別構成

(単位：百万円、%)

区 分	2023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	2,000,733	37.0	1,300,525	34.7	700,207	42.2	67,722	19.2
ヨ ー ロ ッ パ	1,366,133	25.3	943,933	25.2	422,199	25.5	130,784	37.1
オセアニア	554,941	10.3	541,279	14.5	13,661	0.8	110,333	31.3
ア ジ ア	117,948	2.2	64,516	1.7	53,432	3.2	7,745	2.2
中 南 米	1,197,330	22.2	729,642	19.5	467,687	28.2	30,965	8.8
中 東	350	0.0	-	-	350	0.0	-	-
ア フ リ カ	-	-	-	-	-	-	5,386	1.5
国 際 機 関	162,902	3.0	162,902	4.4	-	-	-	-
合 計	5,400,341	100.0	3,742,801	100.0	1,657,540	100.0	352,939	100.0
区 分	2024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	1,795,427	37.7	1,182,926	37.0	612,500	39.3	104,482	25.7
ヨ ー ロ ッ パ	1,193,987	25.1	810,391	25.3	383,595	24.6	137,108	33.7
オセアニア	374,496	7.9	362,196	11.3	12,300	0.8	103,670	25.5
ア ジ ア	109,892	2.3	58,455	1.8	51,436	3.3	7,438	1.8
中 南 米	1,134,309	23.8	637,812	19.9	496,496	31.9	49,183	12.1
中 東	402	0.0	-	-	402	0.0	-	-
ア フ リ カ	177	0.0	-	-	177	0.0	5,261	1.3
国 際 機 関	149,123	3.1	149,123	4.7	-	-	-	-
合 計	4,757,817	100.0	3,200,907	100.0	1,556,909	100.0	407,144	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	2023年度末						2024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	△ 43,226	△ 119,893	-	-	-	△ 163,120	△ 41,997	△ 47,487	-	-	-	△ 89,485
ヘッジ会計非適用分	△ 6,058	△ 13,456	△ 7,267	△ 333	752	△ 26,363	△ 13,616	2,807	△ 261	188	698	△ 10,182
合 計	△ 49,285	△ 133,349	△ 7,267	△ 333	752	△ 189,483	△ 55,614	△ 44,679	△ 261	188	698	△ 99,667

(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。
 2023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△31,166百万円）及び
 ヘッジ会計非適用分の差損益（△26,363百万円）の合計△57,529百万円
 2024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17,031百万円）及び
 ヘッジ会計非適用分の差損益（△10,182百万円）の合計6,848百万円

(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	2023年度末				2024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	△ 689	△ 689	54,100	54,100	121	121
	固定金利支払/変動金利受取	10,000	10,000	689	689	65,000	55,200	△ 26	△ 26
	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	1,240,000 (20,468)	1,180,000 (20,119)	14,410	△ 6,058	1,180,000 (20,119)	1,060,000 (19,055)	6,407	△ 13,711
	合 計				△ 6,058				△ 13,616

(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	2023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	-	-	-	-	-	10,000	10,000	
平均受取固定金利	-	-	-	-	-	0.63	0.63	
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	-	-	-	-	-	10,000	10,000	
平均支払固定金利	-	-	-	-	-	0.63	0.63	
平均受取変動金利	-	-	-	-	-	0.05	0.05	
合 計	-	-	-	-	-	20,000	20,000	
区 分	2024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	-	35,200	18,900	-	-	-	54,100	
平均受取固定金利	-	0.47	0.66	-	-	-	0.54	
平均支払変動金利	-	0.23	0.18	-	-	-	0.21	
円建支払側固定スワップ想定元本	9,800	20,700	33,500	-	-	1,000	65,000	
平均支払固定金利	0.31	0.44	0.60	-	-	1.57	0.52	
平均受取変動金利	0.23	0.23	0.23	-	-	0.23	0.23	
合 計	9,800	55,900	52,400	-	-	1,000	119,100	

②通貨関連

(単位：百万円)

区分	種類	2023年度末			2024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	609,204	△ 10,055	△ 10,055	622,214	3,719	3,719
	(米ドル)	190,554	△ 3,608	△ 3,608	256,165	4,670	4,670
	(オーストラリアドル)	159,727	△ 2,922	△ 2,922	134,231	△ 2,920	△ 2,920
	(ユーロ)	115,704	△ 1,869	△ 1,869	116,534	2,306	2,306
	(イギリスポンド)	86,747	△ 1,257	△ 1,257	77,911	△ 506	△ 506
	(カナダドル)	31,355	△ 449	△ 449	27,347	309	309
	(その他)	25,115	52	52	10,024	△ 140	△ 140
	買建	247,154	171	171	137,250	330	330
	(米ドル)	147,589	150	150	92,332	△ 177	△ 177
	(オーストラリアドル)	5,163	34	34	15,012	394	394
	(ユーロ)	42,745	△ 104	△ 104	9,855	△ 22	△ 22
	(イギリスポンド)	23,309	65	65	6,920	35	35
	(カナダドル)	5,434	71	71	2,992	-	-
	(その他)	22,911	△ 45	△ 45	10,136	99	99
	通貨オプション						
	売建						
	プット	2,943			58,371		
	(オーストラリアドル)	(-)	-	-	(244)	7	237
	(その他)	2,943			35,545	3	116
	(ユーロ)	(-)	-	-	(120)		
	(イギリスポンド)	(-)	-	-	(124)	3	120
	コール	2,788			49,150		
	(米ドル)	(10)	-	10	(217)	15	202
	(イギリスポンド)	(-)	-	-	(59)	12	46
	(オーストラリアドル)	(-)	-	-	(147)	0	147
	(その他)	2,788			(10)	2	8
	(ユーロ)	(10)	-	10	(-)	-	-
	買建						
	プット	194,510			83,325		
	(オーストラリアドル)	(3,577)	15	△ 3,562	(747)	71	△ 676
	(ユーロ)	(-)	-	-	(337)	29	△ 308
	(イギリスポンド)	1,632	12	△ 1	6,377	8	△ 19
	(カナダドル)	(14)	-	-	(28)	0	△ 32
	(米ドル)	(-)	-	-	5,730	0	△ 32
	(その他)	(-)	-	-	(32)	0	△ 32
(ユーロ)	(-)	-	-	3,876	-	-	
(イギリスポンド)	(-)	-	-	(-)	-	-	
(オーストラリアドル)	190,019			-			
(その他)	(3,563)	2	△ 3,561	(-)	-	-	
コール	2,858			38,097			
(オーストラリアドル)	(-)	-	-	(348)	32	△ 315	
(ユーロ)	(-)	-	-	(-)	-	-	
(イギリスポンド)	(-)	-	-	(-)	-	-	
(カナダドル)	(-)	-	-	(-)	-	-	
(米ドル)	5,177			150,889			
(その他)	(43)	22	△ 20	(1,211)	205	△ 1,005	
(ユーロ)	757			121,012			
(イギリスポンド)	(13)	22	8	(929)	181	△ 747	
(オーストラリアドル)	(-)	-	-	14,136	0	△ 231	
(その他)	(-)	-	-	(232)	0	△ 231	
(ユーロ)	(-)	-	-	12,506	22	△ 23	
(イギリスポンド)	(-)	-	-	(45)	22	△ 23	
(オーストラリアドル)	4,420			3,234			
(その他)	(29)	0	△ 29	(2)	0	△ 2	
合計			△ 13,456			2,807	

- (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	2023年度末			2024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 買建	-	-	-	17,383	442	442
	外貨建株価指数先物 売建	-	-	-	10,104	△ 306	△ 306
	買建	-	-	-	15,119	282	282
	円建株価指数オプション 売建	-	-	-	66,544	-	-
	プット	(-)	-	-	(2,765)	606	2,158
	買建 コール	-	-	-	35,590	-	-
	プット	(-)	-	-	(894)	1,232	337
		458,503 (10,083)	3,193	△ 6,890	414,434 (9,332)	6,156	△ 3,176
	外貨建株価指数オプション 買建	20,883	53	△ 376	-	-	-
	プット	(429)			(-)		
合計				△ 7,267		△ 261	

(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	2023年度末			2024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	-	-	-	8,665	△ 13	△ 13
	外貨建債券先物 売建	40,811	△ 309	△ 309	122,181	329	329
	買建	93,712	△ 14	△ 14	245,807	△ 188	△ 188
	外貨建債券先物オプション 売建	-	-	-	5,644	-	-
	プット	(-)	-	-	(7)	10	△ 2
店頭	外貨建債券先渡契約 売建	13,967	5	5	6,913	12	12
	買建	22,284	62	62	7,157	△ 5	△ 5
	円建債券店頭オプション 売建	-	-	-	62,966	-	-
	コール	74,630 (88)	351	△ 262	(66)	15	50
	プット	-	-	-	7,619	-	-
		(-)	-	-	(25)	16	9
	買建 コール	-	-	-	7,619	-	-
	プット	(-)	-	-	(22)	20	△ 2
	74,630 (117)	301	184	62,966 (80)	79	△ 1	
合計				△ 333		188	

(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	2023年度末			2024年度第2四半期(上半期)末				
		契約額等	うち1年超	時価	契約額等	うち1年超	時価		
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	74,400	42,000	752	752	70,000	33,000	698	698
合計					752				698

(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	2023年度末				2024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	円建金利スワップ 固定金利受取/変動金利支払	貸付金	10,600	10,600	△ 135	△ 135	10,600	10,600	△ 155	△ 155
	固定金利受取/変動金利支払	保険負債	700,000	700,000	△ 44,291	△ 44,291	700,000	700,000	△ 43,157	△ 43,157
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	2,300	2,300	30	30	2,300	2,300	17	17
	固定金利支払/変動金利受取	借入金	245,000	245,000	1,169	1,169	245,000	245,000	1,297	1,297
合 計						△ 43,226				△ 41,997

(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	2023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	-	2,900	10,000	-	50,000	650,000	712,900	
平均受取固定金利	-	0.97	0.10	-	0.14	0.49	0.46	
平均支払変動金利	-	0.22	0.07	-	0.06	0.08	0.08	
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	-	0.15	0.15	-	-	-	0.15	
合 計	-	183,900	74,000	-	50,000	650,000	957,900	
区 分	2024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	-	2,900	10,000	-	155,000	545,000	712,900	
平均受取固定金利	-	0.97	0.10	-	0.22	0.54	0.46	
平均支払変動金利	-	0.41	0.23	-	0.22	0.28	0.27	
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	-	0.25	0.25	-	-	-	0.25	
合 計	-	183,900	74,000	-	155,000	545,000	957,900	

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	2023年度末				2024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	755,553	724,883	△ 88,727	△ 88,727	813,387	763,781	△ 64,518	△ 64,518
	(米ドル)		550,187	537,205	△ 61,534	△ 61,534	598,388	565,937	△ 39,150	△ 39,150
	(ユーロ)		172,839	155,150	△ 23,294	△ 23,294	177,559	160,405	△ 21,346	△ 21,346
	(イギリスポンド)		27,215	27,215	△ 3,652	△ 3,652	26,904	26,904	△ 4,028	△ 4,028
	(カナダドル)		4,360	4,360	△ 181	△ 181	9,583	9,583	83	83
	(オーストラリアドル)		950	950	△ 63	△ 63	950	950	△ 76	△ 76
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		1,139,616	-	△ 31,173	△ 31,173	775,556	-	17,030	17,030
	(米ドル)		549,072	-	△ 16,172	△ 16,172	428,982	-	20,782	20,782
	(オーストラリアドル)		425,188	-	△ 8,780	△ 8,780	211,136	-	△ 5,769	△ 5,769
	(ユーロ)		136,283	-	△ 5,461	△ 5,461	106,546	-	3,418	3,418
	(イギリスポンド)		11,521	-	△ 286	△ 286	11,110	-	△ 338	△ 338
	(カナダドル)		1,834	-	△ 25	△ 25	1,431	-	18	18
	(その他)		15,715	-	△ 446	△ 446	16,348	-	△ 1,081	△ 1,081
	買建		573	-	7	7	611	-	1	1
	(米ドル)		417	-	5	5	593	-	1	1
	(イギリスポンド)		7	-	0	0	6	-	0	0
	(ユーロ)		30	-	0	0	6	-	△ 0	△ 0
	(オーストラリアドル)		29	-	△ 0	△ 0	4	-	0	0
	(その他)		89	-	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		10,001	-	-	-	5,001	-	-	-
	(米ドル)		10,001	-	-	-	5,001	-	-	-
	通貨スワップ		368,715	260,550	-	-	368,715	260,550	-	-
	(米ドル)		368,715	260,550	-	-	368,715	260,550	-	-
	通貨スワップ		10,260	10,260	-	-	10,260	10,260	-	-
(米ドル)	10,260	10,260	-	-	10,260	10,260	-	-		
合計									△ 47,487	

(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

2023年度末、2024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

2023年度末、2024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

2023年度末、2024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。