

2017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）	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）	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	2016年度末		2017年度末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
国 債	13,967,855	47.1	13,887,258	46.1
地 方 債	109,098	0.4	119,575	0.4
社 債	1,975,300	6.7	1,906,605	6.3
うち公社・公団債	445,919	1.5	399,483	1.3
株 式	3,474,743	11.7	3,696,766	12.3
外 国 証 券	9,512,246	32.1	9,942,625	33.0
公 社 債	8,260,182	27.9	8,520,524	28.3
株 式 等	1,252,063	4.2	1,422,100	4.7
そ の 他 の 証 券	620,006	2.1	543,845	1.8
合 計	29,659,250	100.0	30,096,677	100.0

(2) 有価証券残存期間別残高

(単位：百万円)

区 分	2016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	520,493	1,344,770	1,352,622	1,079,153	2,897,918	22,464,291	29,659,250	
国 債	36,262	346,870	152,306	297,985	910,335	12,224,094	13,967,855	
地 方 債	3,627	6,794	30,515	4,381	21,582	42,196	109,098	
社 債	162,816	224,979	216,739	142,690	394,343	833,731	1,975,300	
株 式	-	-	-	-	-	3,474,743	3,474,743	
外 国 証 券	315,351	671,420	907,718	602,022	1,514,610	5,501,122	9,512,246	
公 社 債	311,838	666,258	906,513	583,178	1,494,081	4,298,312	8,260,182	
株 式 等	3,513	5,162	1,204	18,844	20,529	1,202,809	1,252,063	
そ の 他 の 証 券	2,434	94,704	45,342	32,074	57,046	388,403	620,006	
買 入 金 銭 債 権	3,066	2,077	541	2,576	-	183,951	192,213	
譲 渡 性 預 金	49,998	-	-	-	-	-	49,998	
そ の 他	-	-	-	-	-	50,191	50,191	
区 分	2017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	633,072	1,339,683	1,099,213	1,291,978	3,370,154	22,362,575	30,096,677	
国 債	178,397	275,514	77,149	380,021	1,135,715	11,840,458	13,887,258	
地 方 債	4,926	26,098	4,150	5,734	20,076	58,589	119,575	
社 債	87,277	232,202	166,433	143,435	331,788	945,468	1,906,605	
株 式	-	-	-	-	-	3,696,766	3,696,766	
外 国 証 券	316,437	773,639	798,759	739,477	1,795,454	5,518,856	9,942,625	
公 社 債	311,734	772,340	789,199	724,955	1,759,192	4,163,101	8,520,524	
株 式 等	4,702	1,299	9,560	14,521	36,261	1,355,755	1,422,100	
そ の 他 の 証 券	46,033	32,227	52,720	23,309	87,118	302,435	543,845	
買 入 金 銭 債 権	2,013	-	3,060	-	-	186,034	191,108	
譲 渡 性 預 金	49,995	-	-	-	-	-	49,995	
そ の 他	-	-	-	-	-	59,348	59,348	

(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	2016年度末		2017年度末		
	金 額	占 率	金 額	占 率	
水 産 ・ 農 林 業	242	0.0	1,291	0.0	
鉱 業	200	0.0	200	0.0	
建 設 業	108,340	3.1	123,115	3.3	
製 造 業	食 料 品	224,692	6.5	228,596	6.2
	織 維 製 品	31,442	0.9	34,907	0.9
	パ ル プ ・ 紙	3,419	0.1	3,772	0.1
	化 学	182,076	5.2	208,605	5.6
	医 薬 品	55,602	1.6	67,519	1.8
	石 油 ・ 石 炭 製 品	4,633	0.1	6,386	0.2
	ゴ ム 製 品	25,804	0.7	28,554	0.8
	ガ ラ ス ・ 土 石 製 品	119,314	3.4	113,081	3.1
	鉄 鋼	62,363	1.8	58,817	1.6
	非 鉄 金 属	17,929	0.5	19,063	0.5
	金 属 製 品	46,294	1.3	45,837	1.2
	機 械	204,880	5.9	247,753	6.7
	電 気 機 器	553,055	15.9	671,531	18.2
	輸 送 用 機 器	219,540	6.3	219,804	5.9
	精 密 機 器	106,092	3.1	140,598	3.8
	そ の 他 製 品	79,704	2.3	68,856	1.9
電 気 ・ ガ ス 業	102,152	2.9	103,212	2.8	
運 輸 ・ 情 報 通 信 業	陸 運 業	319,236	9.2	323,356	8.7
	海 運 業	55	0.0	52	0.0
	空 運 業	3,209	0.1	6,313	0.2
	倉 庫 ・ 運 輸 関 連 業	4,642	0.1	5,150	0.1
	情 報 ・ 通 信 業	92,337	2.7	100,913	2.7
商 業	卸 売 業	140,751	4.1	154,385	4.2
	小 売 業	112,405	3.2	131,832	3.6
金 融 ・ 保 險 業	銀 行 業	416,199	12.0	290,914	7.9
	証 券 ・ 商 品 先 物 取 引 業	5,378	0.2	1,307	0.0
	保 險 業	21,657	0.6	21,774	0.6
	そ の 他 金 融 業	24,712	0.7	26,629	0.7
不 動 産 業	20,947	0.6	19,779	0.5	
サ ー ビ ス 業	165,429	4.8	222,847	6.0	
合 計	3,474,743	100.0	3,696,766	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	
2016年度末	変動金利	4,165	20,402	20,115	6,500	6,390	68,094	125,669
	固定金利	269,345	347,924	338,646	370,821	407,408	416,206	2,150,352
	一般貸付計	273,511	368,326	358,761	377,321	413,799	484,300	2,276,021
2017年度末	変動金利	7,762	5,560	35,559	10,311	6,731	74,601	140,526
	固定金利	321,793	282,068	384,969	350,956	345,141	378,520	2,063,449
	一般貸付計	329,555	287,629	420,528	361,268	351,872	453,122	2,203,976

（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		2016年度末		2017年度末	
		金額	占 率	金額	占 率
大 企 業	貸付先数	225	67.4	223	67.6
	金 額	1,667,247	84.9	1,604,877	84.9
中 堅 企 業	貸付先数	11	3.3	9	2.7
	金 額	12,083	0.6	3,908	0.2
中 小 企 業	貸付先数	98	29.3	98	29.7
	金 額	284,440	14.5	281,689	14.9
国内企業向け 貸付計	貸付先数 金 額	334 1,963,771	100.0 100.0	330 1,890,475	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	常用する従業員 101名超かつ 資本金3億円超 10億円未満	常用する従業員 101名超かつ 資本金5千万円超 10億円未満	常用する従業員 101名超かつ 資本金5千万円超 10億円未満	常用する従業員 101名超かつ 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	2016年度末		2017年度末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
担 保 貸 付	3,667	0.2	10,993	0.5
有価証券担保貸付	2,338	0.1	9,644	0.4
不動産・動産・財 団担保貸付	1,301	0.1	1,152	0.1
指名債権担保貸付	27	0.0	196	0.0
保 証 貸 付	83,113	3.7	63,820	2.9
信 用 貸 付	2,188,565	96.2	2,128,719	96.6
そ の 他	675	0.0	442	0.0
一 般 貸 付 計	2,276,021	100.0	2,203,976	100.0
うち劣後特約付 貸	302,800	13.3	286,364	13.0

（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	2016年度末		2017年度末		
	金 額	占 率	金 額	占 率	
製 造 業	食 料	357,511	15.7	335,034	15.2
	織 維	36,782	1.6	42,666	1.9
	木 材 ・ 木 製 品	2,025	0.1	2,873	0.1
	パ ル プ ・ 紙	500	0.0	200	0.0
	印 刷	19,876	0.9	10,596	0.5
	化 学	13,775	0.6	12,538	0.6
	石 油 ・ 石 炭	21,774	1.0	19,776	0.9
	窯 業 ・ 土 石	18,070	0.8	12,260	0.6
	鉄 鋼	29,157	1.3	29,338	1.3
	非 鉄 金 属	82,300	3.6	68,000	3.1
	金 属 製 品	6,803	0.3	6,258	0.3
	はん用・生産用・業務用機械	611	0.0	504	0.0
	電 気 機 械	36,756	1.6	35,078	1.6
	輸 送 用 機 械	72,858	3.2	69,678	3.2
	そ の 他 の 製 造 業	11,976	0.5	15,811	0.7
	そ の 他 の 製 造 業	4,244	0.2	9,452	0.4
国 内 向 け	農 業 、 林 業	-	-	-	-
	漁 業	-	-	-	-
	鉱 業 、 採 石 業 、 砂 利 採 取 業	-	-	-	-
	建 設 業	10,054	0.4	10,212	0.5
	電 気 ・ ガ ス ・ 熱 供 給 ・ 水 道 業	377,353	16.6	459,096	20.8
	情 報 通 信 業	55,673	2.4	60,566	2.7
	運 輸 業 、 郵 便 業	250,411	11.0	248,850	11.3
	卸 売 業	466,615	20.5	398,969	18.1
	小 売 業	11,226	0.5	11,137	0.5
	金 融 業 、 保 険 業	444,127	19.5	368,454	16.7
	不 動 産 業	119,709	5.3	120,239	5.5
	物 品 賃 貸 業	107,851	4.7	104,476	4.7
	学 術 研 究 、 専 門 ・ 技 術 サ ー ビ ス 業	954	0.0	844	0.0
	宿 泊 業	-	-	-	-
	飲 食 業	-	-	-	-
	生 活 関 連 サ ー ビ ス 業 ・ 娯 楽 業	3,163	0.1	3,805	0.2
	教 育 、 学 習 支 援 業	-	-	-	-
	医 療 ・ 福 祉	150	0.0	150	0.0
	そ の 他 の サ ー ビ ス	3,100	0.1	3,690	0.2
	地 方 公 共 団 体	26,169	1.1	23,809	1.1
個 人 (住 宅 ・ 消 費 ・ 納 税 資 金 等)	675	0.0	442	0.0	
そ の 他	266	0.0	200	0.0	
合 計	2,235,013	98.2	2,149,978	97.5	
海 外 向 け	政 府 等	2,700	0.1	-	-
	金 融 機 関	11,544	0.5	11,544	0.5
	商 工 業 等	26,763	1.2	42,453	1.9
	合 計	41,008	1.8	53,998	2.5
一 般 貸 付 計	2,276,021	100.0	2,203,976	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	2016年度末		2017年度末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
公 社 債	7,503,550	72.5	7,670,095	70.3
株 式	675,410	6.5	854,472	7.8
現 預 金 ・ そ の 他	228,808	2.2	413,569	3.8
小 計	8,407,769	81.2	8,938,137	82.0

②円貨額が確定した外貨建資産

（単位：百万円、％）

区 分	2016年度末		2017年度末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
公 社 債	-	-	-	-
現 預 金 ・ そ の 他	354,058	3.4	301,575	2.8
小 計	354,058	3.4	301,575	2.8

③円貨建資産

（単位：百万円、％）

区 分	2016年度末		2017年度末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
非 居 住 者 貸 付	22,666	0.2	36,545	0.3
公社債（円建外債）・その他	1,569,179	15.2	1,627,922	14.9
小 計	1,591,846	15.4	1,664,467	15.3

④合 計

（単位：百万円、％）

区 分	2016年度末		2017年度末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
海 外 投 融 資	10,353,674	100.0	10,904,181	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	2016年度末		2017年度末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
米 ド ル	4,673,054	55.6	4,665,738	52.2
ユ ー ロ	1,721,716	20.5	2,236,863	25.0
オーストラリアドル	679,085	8.1	655,013	7.3
イギリスポンド	254,239	3.0	269,558	3.0
ニュージーランドドル	200,635	2.4	208,633	2.3
カナダドル	238,371	2.8	207,727	2.3
ポーランドズロチ	147,097	1.7	192,438	2.2
そ の 他 共 計	8,407,769	100.0	8,938,137	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						非居住者貸付		
			公社債		株式等				
	金額	占率	金額	占率	金額	占率	金額	占率	
2016 年度末	北 米	4,109,374	43.2	3,840,644	46.5	268,729	21.5	10,263	25.0
	ヨーロッパ	2,665,186	28.0	2,461,926	29.8	203,260	16.2	10,369	25.3
	オセアニア	837,203	8.8	794,624	9.6	42,579	3.4	5,000	12.2
	アジア	216,677	2.3	109,851	1.3	106,826	8.5	1,500	3.7
	中南米	1,504,340	15.8	874,219	10.6	630,121	50.3	11,175	27.3
	中 東	-	-	-	-	-	-	-	-
	アフリカ	23,089	0.2	22,543	0.3	546	0.0	-	-
	国際機関	156,373	1.6	156,373	1.9	-	-	2,700	6.6
	合 計	9,512,246	100.0	8,260,182	100.0	1,252,063	100.0	41,008	100.0
2017 年度末	北 米	4,019,420	40.4	3,644,056	42.8	375,364	26.4	9,731	18.0
	ヨーロッパ	3,168,884	31.9	2,936,942	34.5	231,941	16.3	11,112	20.6
	オセアニア	814,234	8.2	775,313	9.1	38,921	2.7	5,000	9.3
	アジア	255,259	2.6	121,359	1.4	133,899	9.4	2,130	3.9
	中南米	1,493,860	15.0	852,399	10.0	641,461	45.1	26,024	48.2
	中 東	18,126	0.2	18,126	0.2	-	-	-	-
	アフリカ	21,610	0.2	21,099	0.2	511	0.0	-	-
	国際機関	151,228	1.5	151,228	1.8	-	-	-	-
	合 計	9,942,625	100.0	8,520,524	100.0	1,422,100	100.0	53,998	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	2016年度末						2017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	△ 23,531	△ 136,742	1,246	△ 717	-	△ 159,745	△ 12,843	178,877	△ 24	-	-	166,008
ヘッジ会計非適用分	△ 14,517	△ 11,690	△ 2,678	763	554	△ 27,569	△ 8,379	△ 5,452	△ 968	△ 453	639	△ 14,613
合 計	△ 38,049	△ 148,433	△ 1,432	46	554	△ 187,314	△ 21,223	173,424	△ 993	△ 453	639	151,394

（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。

2016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△140,284百万円、株式関連1,246百万円）及びヘッジ会計非適用分の差損益（△27,569百万円）の合計△166,608百万円

2017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162,282百万円、株式関連△24百万円）及びヘッジ会計非適用分の差損益（△14,613百万円）の合計147,643百万円

（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	2016年度末				2017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	金利スワップ										
	固定金利受取／変動金利支払	170	-	1	1	121,000	121,000	986	986		
	固定金利支払／変動金利受取	44,100	44,100	71	71	61,000	34,000	△ 2	△ 2		
	金利スワップション										
	売建										
	固定金利受取／変動金利支払	-	-	-	-	10,000	-	19	△ 0		
	固定金利支払／変動金利受取	350,000	-	67	1,604	10,000	-	0	38		
	(1,672)	(-)			(39)	(-)					
買建											
固定金利支払／変動金利受取	1,150,000	855,000	2,019	△ 16,194	1,130,000	705,000	2,268	△ 9,401			
(18,214)	(14,947)			(11,670)	(4,579)						
合 計				△ 14,517					△ 8,379		

（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	2016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		
受取側固定スワップ想定元本	170	-	-	-	-	-	170	
平均受取固定金利	1.23	-	-	-	-	-	1.23	
平均支払変動金利	0.03	-	-	-	-	-	0.03	
支払側固定スワップ想定元本	-	43,000	-	-	-	1,100	44,100	
平均支払固定金利	-	△ 0.13	-	-	-	1.08	△ 0.10	
平均受取変動金利	-	0.01	-	-	-	0.03	0.01	
合 計	170	43,000	-	-	-	1,100	44,270	
区 分	2017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		
受取側固定スワップ想定元本	-	-	-	-	21,000	100,000	121,000	
平均受取固定金利	-	-	-	-	0.25	0.67	0.60	
平均支払変動金利	-	-	-	-	0.02	△ 0.00	0.00	
支払側固定スワップ想定元本	27,000	16,000	10,000	-	-	8,000	61,000	
平均支払固定金利	△ 0.13	△ 0.14	0.09	-	-	0.82	0.03	
平均受取変動金利	0.01	0.00	0.02	-	-	0.01	0.01	
合 計	27,000	16,000	10,000	-	21,000	108,000	182,000	

②通貨関連

(単位：百万円)

区分	種類	2016年度末			2017年度末		
		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	918,930	△ 13,729	△ 13,729	2,486,021	19,645	19,645
	(米ドル)	387,025	△ 6,038	△ 6,038	1,185,073	1,876	1,876
	(ユーロ)	272,761	△ 4,075	△ 4,075	739,523	9,606	9,606
	(オーストラリアドル)	73,766	△ 3,146	△ 3,146	260,895	6,061	6,061
	(カナダドル)	33,681	△ 122	△ 122	81,880	803	803
	(イギリスポンド)	21,983	205	205	29,672	308	308
	(その他)	129,711	△ 552	△ 552	188,975	989	989
	買建	998,303	6,000	6,000	2,390,220	△ 29,000	△ 29,000
	(米ドル)	576,403	4,135	4,135	1,131,508	△ 7,486	△ 7,486
	(ユーロ)	329,726	△ 520	△ 520	805,963	△ 17,312	△ 17,312
	(オーストラリアドル)	16,946	524	524	207,906	△ 3,152	△ 3,152
	(カナダドル)	16,164	△ 153	△ 153	57,305	△ 290	△ 290
	(イギリスポンド)	6,896	△ 22	△ 22	11,133	△ 30	△ 30
	(その他)	52,165	2,036	2,036	176,402	△ 728	△ 728
	通貨オプション						
	売建						
	コール	93,491			-		
	(米ドル)	(690)	-	690	(-)	-	-
	プット	-			251,112		
	(米ドル)	(-)	-	-	(11,351)	9,466	1,885
	買建						
	コール	-			10,076		
	(米ドル)	(-)	-	-	(-)	-	-
	プット	521,866			719,375		
	(米ドル)	(7,321)	2,668	△ 4,652	(14,112)	16,130	2,017
	(イギリスポンド)	412,966	2,445	△ 4,210	708,956	16,130	2,070
(ユーロ)	(6,656)			(14,059)			
	-			10,418			
	(-)	-	-	(53)	-	△ 53	
	108,899			-			
	(664)	223	△ 441	(-)	-	-	
合計			△ 11,690			△ 5,452	

- (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	2016年度末			2017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 買建	15,387	△ 158	△ 158	-	-	-
	外貨建株価指数先物 売建	5,942	△ 217	△ 217	-	-	-
	買建	10,935	49	49	-	-	-
	円建株価指数オプション 買建						
	プット	80,000 (2,362)	10	△ 2,352	149,967 (4,391)	3,538	△ 853
	外貨建株価指数オプション 買建						
	プット	- (-)	-	-	49,761 (1,394)	1,278	△ 115
	合 計			△ 2,678			△ 968

- (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	2016年度末			2017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	9,298	△ 18	△ 18	16,603	18	18
	買建	4,499	9	9	-	-	-
	外貨建債券先物 売建	203,592	△ 619	△ 619	467,001	△ 5,904	△ 5,904
	買建	103,911	974	974	527,241	5,431	5,431
	外貨建債券先物オプション 買建						
	コール	- (-)	-	-	50,995 (351)	531	179
	プット	- (-)	-	-	50,995 (298)	39	△ 258
	外貨建債券先渡契約 売建	-	-	-	80,181	△ 512	△ 512
	買建	-	-	-	108,853	277	277
	円建債券店頭オプション 売建						
コール	18,784 (47)	90	△ 42	4,977 (29)	41	△ 12	
プット	99,556 (693)	496	197	92,197 (422)	274	147	
買建							
コール	99,556 (453)	675	222	92,197 (269)	458	189	
プット	18,784 (119)	160	41	4,977 (44)	36	△ 8	
合 計			763			△ 453	

- (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	2016年度末				2017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	クレジット・デフォルト・スワップ プロテクション売建	28,000	25,000	674	674	32,000	29,000	617	617
	プロテクション買建	11,385	11,385	△ 119	△ 119	1,000	1,000	22	22
合 計					554				639

(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	2016年度末				2017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		
原則的処理 方法	金利スワップ 固定金利受取/変動金利支払	貸付金	3,000	3,000	△ 18	△ 18	4,000	4,000	△ 7	△ 7
	固定金利受取/変動金利支払	保険負債	600,000	600,000	△ 20,541	△ 20,541	600,000	600,000	△ 10,484	△ 10,484
金利スワップ の特例 処理	金利スワップ 固定金利受取/変動金利支払	貸付金	19,800	16,800	189	189	16,800	15,300	137	137
	固定金利支払/変動金利受取	借入金	283,000	283,000	△ 3,161	△ 3,161	283,000	283,000	△ 2,489	△ 2,489
合 計						△ 23,531				△ 12,843

(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	2016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
受取側固定スワップ想定元本	3,000	4,500	7,000	6,000	2,300	600,000	622,800
平均受取固定金利	1.62	△ 0.00	0.17	△ 0.02	1.19	0.43	0.43
平均支払変動金利	0.02	△ 0.00	0.02	0.03	0.06	0.02	0.02
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	-	-	0.11	0.11	-	-	0.11
合 計	3,000	4,500	146,000	150,000	2,300	600,000	905,800
区 分	2017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
受取側固定スワップ想定元本	1,500	3,000	8,000	6,000	2,300	600,000	620,800
平均受取固定金利	0.37	0.46	0.04	△ 0.02	1.19	0.43	0.42
平均支払変動金利	0.01	△ 0.02	0.03	△ 0.00	0.07	0.01	0.01
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	-	0.12	0.12	-	-	-	0.12
合 計	1,500	142,000	152,000	6,000	2,300	600,000	903,800

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	2016年度末				2017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	266,142	252,943	3,541	3,541	273,422	250,038	16,595	16,595	
	(米ドル)		204,574	191,375	△ 953	△ 953	199,735	176,351	17,303	17,303	
	(ユーロ)		61,568	61,568	4,494	4,494	61,568	61,568	△ 1,226	△ 1,226	
	(イギリスポンド)		-	-	-	-	12,119	12,119	517	517	
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		5,215,748	-	△ 140,242	△ 140,242	5,252,956	-	163,366	163,366	
	(米ドル)		2,948,262	-	△ 81,896	△ 81,896	2,792,212	-	100,027	100,027	
	(ユーロ)		1,090,351	-	△ 8,294	△ 8,294	1,422,032	-	28,035	28,035	
	(オーストラリアドル)		415,851	-	△ 22,627	△ 22,627	360,649	-	15,883	15,883	
	(イギリスポンド)		125,768	-	△ 1,271	△ 1,271	132,251	-	2,504	2,504	
	(カナダドル)		138,358	-	△ 8,876	△ 8,876	112,785	-	7,260	7,260	
	(その他)		497,156	-	△ 17,274	△ 17,274	433,024	-	9,654	9,654	
	買建		27,390	-	△ 42	△ 42	118,466	-	△ 2,217	△ 2,217	
	(米ドル)		18,150	-	△ 157	△ 157	118,253	-	△ 2,214	△ 2,214	
	(ユーロ)		3,000	-	△ 43	△ 43	83	-	△ 1	△ 1	
	(イギリスポンド)		60	-	△ 1	△ 1	62	-	△ 0	△ 0	
	(オーストラリアドル)		0	-	0	0	-	-	-	-	
	(その他)		6,178	-	159	159	67	-	△ 1	△ 1	
	通貨オプション										
	売建										
	コール		-	-	-	-	93,057	-	-	-	-
	(米ドル)		(-)	(-)	-	-	(1,686)	(-)	824	861	
	買建										
	プット		-	-	-	-	93,057	-	-	-	-
(米ドル)	(-)	(-)	-	-	(1,686)	(-)	1,958	271			
為替予約等の振当処理											
為替予約											
売建		外貨建定期預金	314,849	-	-	-	262,693	-	-	-	
(オーストラリアドル)			122,516	-	-	-	119,405	-	-	-	
(米ドル)			81,866	-	-	-	32,904	-	-	-	
(その他)			110,465	-	-	-	110,383	-	-	-	
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	38,521	38,521	-	-	38,081	38,081	-	-	
(米ドル)			32,557	32,557	-	-	32,116	32,116	-	-	
(ユーロ)			5,964	5,964	-	-	5,964	5,964	-	-	
合 計						△ 136,742				178,877	

(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. 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。

4. 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、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。(注3.を除く)

③株式関連

(単位：百万円)

ヘッジ会計の方法	種 類	主なヘッジ対象	2016年度末				2017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		
ヘッジ対象に係る損益を認識する方法	国内株式先渡契約 売建	国内株式	26,264	-	1,246	1,246	9,559	-	△ 24	△ 24
合 計						1,246				△ 24

(注) 差損益欄には、時価を記載しています。

④債券関連

(単位：百万円)

ヘッジ会計の方法	種 類	主なヘッジ対象	2016年度末				2017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		
原則的処理方法	外貨建債券店頭オプション 売建	外貨建債券	62,192	-	1,030	△ 127	-	-	-	-
	コール		(902)	(-)			(-)	(-)		
	買建 プット		62,192	-	313	△ 589	(-)	(-)	-	-
合 計						△ 717				-

(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. 差損益欄にはオプション料と時価との差額を記載しています。

⑤その他

2016年度末、2017年度末ともに期末残高がないため、記載していません。