

2019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）	.....	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	2018年度末		2019年度末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
国 債	13,674,544	45.7	13,698,904	46.2
地 方 債	129,427	0.4	129,433	0.4
社 債	1,956,735	6.5	2,042,503	6.9
うち公社・公団債	418,607	1.4	414,124	1.4
株 式	3,395,945	11.4	2,786,892	9.4
外 国 証 券	10,122,795	33.9	10,073,956	34.0
公 社 債	8,933,476	29.9	9,088,395	30.7
株 式 等	1,189,319	4.0	985,560	3.3
そ の 他 の 証 券	610,282	2.0	896,944	3.0
合 計	29,889,730	100.0	29,628,634	100.0

(2) 有価証券残存期間別残高

(単位：百万円)

区 分	2018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	571,899	1,439,737	1,416,762	1,607,610	3,209,364	21,644,357	29,889,730	
国 債	154,093	117,533	276,096	453,345	1,229,401	11,444,074	13,674,544	
地 方 債	1,716	27,195	5,747	15,073	9,210	70,484	129,427	
社 債	99,421	175,236	207,558	207,202	212,166	1,055,149	1,956,735	
株 式	-	-	-	-	-	3,395,945	3,395,945	
外 国 証 券	295,102	1,062,532	868,594	891,096	1,560,423	5,445,046	10,122,795	
公 社 債	290,829	1,061,628	848,430	860,939	1,520,199	4,351,449	8,933,476	
株 式 等	4,273	903	20,164	30,156	40,224	1,093,597	1,189,319	
そ の 他 の 証 券	21,565	57,239	58,764	40,893	198,161	233,657	610,282	
買 入 金 銭 債 権	-	1,307	3,354	3,590	6,407	184,532	199,193	
譲 渡 性 預 金	69,995	-	-	-	-	-	69,995	
そ の 他	-	-	-	-	-	24,747	24,747	
区 分	2019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	586,329	1,101,503	1,444,372	2,251,872	3,520,952	20,723,604	29,628,634	
国 債	74,467	22,774	250,094	734,136	1,504,395	11,113,036	13,698,904	
地 方 債	23,981	4,267	4,820	17,769	2,913	75,680	129,433	
社 債	95,622	163,504	227,448	227,484	179,534	1,148,909	2,042,503	
株 式	-	-	-	-	-	2,786,892	2,786,892	
外 国 証 券	379,004	889,591	911,662	1,203,671	1,306,577	5,383,449	10,073,956	
公 社 債	376,404	882,767	895,198	1,158,912	1,245,286	4,529,824	9,088,395	
株 式 等	2,599	6,824	16,464	44,758	61,290	853,624	985,560	
そ の 他 の 証 券	13,254	21,365	50,345	68,811	527,531	215,636	896,944	
買 入 金 銭 債 権	-	3,352	1,037	22,823	13,991	179,941	221,147	
譲 渡 性 預 金	110,994	-	-	-	-	-	110,994	
そ の 他	-	-	-	-	-	34,274	34,274	

(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	2018年度末		2019年度末		
	金 額	占 率	金 額	占 率	
水 産 ・ 農 林 業	1,335	0.0	716	0.0	
鉱 業	552	0.0	200	0.0	
建 設 業	115,051	3.4	98,486	3.5	
製 造 業	食 料 品	207,215	6.1	172,860	6.2
	織 維 製 品	26,342	0.8	19,433	0.7
	パ ル プ ・ 紙	3,565	0.1	2,949	0.1
	化 学	189,937	5.6	164,130	5.9
	医 薬 品	65,930	1.9	68,347	2.5
	石 油 ・ 石 炭 製 品	3,913	0.1	2,576	0.1
	ゴ ム 製 品	24,760	0.7	18,058	0.6
	ガ ラ ス ・ 土 石 製 品	98,892	2.9	79,927	2.9
	鉄 鋼	48,609	1.4	23,138	0.8
	非 鉄 金 属	15,415	0.5	9,865	0.4
	金 属 製 品	35,345	1.0	27,248	1.0
	機 械	190,797	5.6	178,284	6.4
	電 気 機 器	573,859	16.9	479,729	17.2
	輸 送 用 機 器	183,591	5.4	141,022	5.1
	精 密 機 器	157,847	4.6	149,300	5.4
	そ の 他 製 品	68,430	2.0	59,452	2.1
電 気 ・ ガ ス 業	123,635	3.6	91,894	3.3	
運 輸 ・ 情 報 通 信 業	陸 運 業	378,360	11.1	281,543	10.1
	海 運 業	45	0.0	32	0.0
	空 運 業	4,904	0.1	3,169	0.1
	倉 庫 ・ 運 輸 関 連 業	4,474	0.1	3,953	0.1
	情 報 ・ 通 信 業	95,870	2.8	52,364	1.9
商 業	卸 売 業	133,503	3.9	108,226	3.9
	小 売 業	111,988	3.3	93,903	3.4
金 融 ・ 保 険 業	銀 行 業	233,134	6.9	162,225	5.8
	証 券、商 品 先 物 取 引 業	283	0.0	218	0.0
	保 険 業	3,331	0.1	3,724	0.1
	そ の 他 金 融 業	27,325	0.8	23,670	0.8
不 動 産 業	18,442	0.5	17,826	0.6	
サ ー ビ ス 業	249,252	7.3	248,411	8.9	
合 計	3,395,945	100.0	2,786,892	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
	2018年度末						
変動金利	425	9,106	20,497	7,084	2,618	87,180	126,912
固定金利	292,448	312,130	372,426	263,580	304,030	336,246	1,880,863
一般貸付計	292,873	321,236	392,924	270,665	306,649	423,427	2,007,776
2019年度末							
変動金利	4,251	25,670	18,312	9,774	1,713	306,184	365,906
固定金利	253,671	357,475	361,668	329,174	232,174	318,468	1,852,631
一般貸付計	257,922	383,146	379,980	338,948	233,887	624,652	2,218,538

### （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		2018年度末		2019年度末		
		金額	占 率	金額	占 率	
大 企 業	貸付先数	213	66.1	215	64.2	
	金 額	1,478,341	86.0	1,636,633	84.2	
中 堅 企 業	貸付先数	7	2.2	7	2.1	
	金 額	4,607	0.3	4,038	0.2	
中 小 企 業	貸付先数	102	31.7	113	33.7	
	金 額	236,564	13.8	302,872	15.6	
国内企業向け 貸付計		貸付先数 金 額	322 1,719,513	100.0 100.0	335 1,943,544	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	資本金10億円 以上	常用する 従業員 50名超	常用する 従業員 100名超	資本金10億円 以上	常用する 従業員 100名超	資本金10億円 以上
中 堅 企 業	かつ	資本金3億円超 10億円未満	かつ	かつ	資本金5千万円超 10億円未満	かつ	資本金1億円超 10億円未満
中 小 企 業	資本3億円以下又は 常用する従業員300名以下	資本5千万円以下又は 常用する従業員50名以下		資本5千万円以下又は 常用する従業員100名以下		資本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	2018年度末		2019年度末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
担 保 貸 付	13,212	0.7	2,406	0.1
有価証券担保貸付	11,571	0.6	950	0.0
不動産・動産・ 財団担保貸付	1,640	0.1	1,455	0.1
指名債権担保貸付	-	-	-	-
保 証 貸 付	132,224	6.6	119,612	5.4
信 用 貸 付	1,862,339	92.8	2,096,520	94.5
そ の 他	-	-	-	-
一 般 貸 付 計	2,007,776	100.0	2,218,538	100.0
うち劣後特約付 貸	232,663	11.6	213,410	9.6

（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		2018年度末		2019年度末	
		金 額	占 率	金 額	占 率
国内向け	製 造 業	325,358	16.2	276,090	12.4
	食 料	43,029	2.1	40,407	1.8
	織 維	2,956	0.1	1,673	0.1
	木 材 ・ 木 製 品	500	0.0	500	0.0
	パ ル プ ・ 紙	10,680	0.5	10,660	0.5
	印 刷	12,518	0.6	12,502	0.6
	化 学	21,047	1.0	26,771	1.2
	石 油 ・ 石 炭	10,260	0.5	8,860	0.4
	窯 業 ・ 土 石	29,168	1.5	19,022	0.9
	鉄 鋼	79,550	4.0	82,547	3.7
	非 鉄 金 属	5,902	0.3	4,626	0.2
	金 属 製 品	958	0.0	961	0.0
	はん用・生産用・業務用機械	24,199	1.2	20,391	0.9
	電 気 機 械	60,087	3.0	20,534	0.9
	輸 送 用 機 械	15,331	0.8	17,589	0.8
	そ の 他 の 製 造 業	9,167	0.5	9,042	0.4
	農 業 、 林 業	-	-	-	-
	漁 業	-	-	-	-
	鉱業、採石業、砂利採取業	-	-	-	-
	建 設 業	8,852	0.4	9,260	0.4
	電気・ガス・熱供給・水道業	434,447	21.6	447,376	20.2
	情 報 通 信 業	41,266	2.1	47,786	2.2
	運 輸 業 、 郵 便 業	249,361	12.4	251,547	11.3
	卸 売 業	328,398	16.4	300,862	13.6
	小 売 業	9,694	0.5	12,505	0.6
	金 融 業 、 保 険 業	293,218	14.6	554,499	25.0
	不 動 産 業	138,663	6.9	141,549	6.4
	物 品 賃 貸 業	102,091	5.1	98,872	4.5
	学術研究、専門・技術サービス業	200	0.0	200	0.0
	宿 泊 業	-	-	-	-
	飲 食 業	-	-	-	-
	生活関連サービス業・娯楽業	3,831	0.2	4,623	0.2
教 育 、 学 習 支 援 業	-	-	-	-	
医 療 ・ 福 祉	1,150	0.1	1,000	0.0	
そ の 他 の サ ー ビ ス	3,204	0.2	2,819	0.1	
地 方 公 共 団 体	21,448	1.1	19,088	0.9	
個人（住宅・消費・納税資金等）	-	-	-	-	
そ の 他	133	0.0	66	0.0	
合 計	1,961,319	97.7	2,168,147	97.7	
海外向け	政 府 等	-	-	3,304	0.1
	金 融 機 関	8,544	0.4	5,000	0.2
	商 工 業 等	37,912	1.9	42,086	1.9
	合 計	46,456	2.3	50,391	2.3
一 般 貸 付 計	2,007,776	100.0	2,218,538	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	2018年度末		2019年度末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
公 社 債	8,132,626	74.7	8,287,407	73.4
株 式	785,620	7.2	643,359	5.7
現 預 金 ・ そ の 他	212,957	2.0	640,851	5.7
小 計	9,131,204	83.8	9,571,618	84.8

②円貨額が確定した外貨建資産 (単位：百万円、%)

区 分	2018年度末		2019年度末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
公 社 債	-	-	-	-
現 預 金 ・ そ の 他	290,596	2.7	272,311	2.4
小 計	290,596	2.7	272,311	2.4

③円貨建資産 (単位：百万円、%)

区 分	2018年度末		2019年度末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
非 居 住 者 貸 付	29,942	0.3	30,043	0.3
公 社 債 (円建外債) ・ そ の 他	1,439,637	13.2	1,412,739	12.5
小 計	1,469,579	13.5	1,442,783	12.8

④合 計 (単位：百万円、%)

区 分	2018年度末		2019年度末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
海 外 投 融 資	10,891,380	100.0	11,286,713	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	2018年度末		2019年度末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
米 ド ル	4,699,602	51.5	4,651,934	48.6
ユ ー ロ	2,353,535	25.8	2,637,312	27.6
オーストラリアドル	598,275	6.6	699,244	7.3
イギリスポンド	304,560	3.3	302,948	3.2
カナダドル	160,055	1.8	215,930	2.3
中 国 元	135,956	1.5	209,548	2.2
メキシコペソ	236,425	2.6	188,095	2.0
そ の 他 共 計	9,131,204	100.0	9,571,618	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	
2018年度末	北 米	4,192,980	41.4	3,892,340	43.6	300,640	25.3	8,864	19.1
	ヨーロッパ	3,263,628	32.2	3,020,627	33.8	243,001	20.4	5,464	11.8
	オセアニア	726,696	7.2	687,722	7.7	38,974	3.3	5,000	10.8
	アジア	291,551	2.9	174,600	2.0	116,950	9.8	1,255	2.7
	中南米	1,500,896	14.8	1,011,520	11.3	489,375	41.1	25,872	55.7
	中 東	178	0.0	-	-	178	0.0	-	-
	アフリカ	198	0.0	-	-	198	0.0	-	-
	国際機関	146,665	1.4	146,665	1.6	-	-	-	-
	合 計	10,122,795	100.0	8,933,476	100.0	1,189,319	100.0	46,456	100.0
2019年度末	北 米	4,147,818	41.2	3,916,856	43.1	230,962	23.4	6,258	12.4
	ヨーロッパ	3,399,520	33.7	3,079,499	33.9	320,021	32.5	12,555	24.9
	オセアニア	739,451	7.3	709,931	7.8	29,520	3.0	8,304	16.5
	アジア	411,998	4.1	310,903	3.4	101,095	10.3	2,308	4.6
	中南米	1,216,710	12.1	912,925	10.0	303,785	30.8	20,964	41.6
	中 東	176	0.0	-	-	176	0.0	-	-
	アフリカ	-	-	-	-	-	-	-	-
	国際機関	158,279	1.6	158,279	1.7	-	-	-	-
	合 計	10,073,956	100.0	9,088,395	100.0	985,560	100.0	50,391	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	2018年度末						2019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	13,289	△ 5,068	-	-	-	8,220	40,848	26,754	-	-	-	67,602
ヘッジ会計非適用分	△ 8,118	△ 14,724	△ 6,842	5,255	78	△ 24,350	3,245	34,472	7,735	557	194	46,206
合 計	5,170	△ 19,792	△ 6,842	5,255	78	△ 16,130	44,093	61,227	7,735	557	194	113,808

（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。

2018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△12,770百万円）及び

ヘッジ会計非適用分の差損益（△24,350百万円）の合計△37,121百万円

2019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22,029百万円）及び

ヘッジ会計非適用分の差損益（46,206百万円）の合計68,235百万円

##### （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	2018年度末				2019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	31,000	31,000	805	805	10,000	10,000	978	978
	固定金利支払／変動金利受取	62,000	46,000	△ 849	△ 849	40,250	40,250	△ 1,035	△ 1,035
	外貨建金利スワップ								
	固定金利支払／変動金利受取	114,319	58,824	△ 1,549	△ 1,549	-	-	-	-
	円建金利スワップション 買建								
	固定金利受取／変動金利支払	-	-	-	-	830,000	460,000		
	(-)	(-)			(18,202)	(11,993)	27,507	9,305	
固定金利支払／変動金利受取	1,430,000	1,270,000	761	△ 6,524	1,560,000	1,110,000	312	△ 6,003	
	(7,285)	(6,064)			(6,316)	(3,454)			
合 計				△ 8,118				3,245	

（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	2018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	-	-	-	-	21,000	10,000	31,000
平均受取固定金利	-	-	-	-	0.25	0.64	0.37
平均支払変動金利	-	-	-	-	0.00	0.01	0.01
円建支払側固定スワップ想定元本	16,000	-	32,000	-	-	14,000	62,000
平均支払固定金利	△ 0.14	-	0.03	-	-	0.69	0.14
平均受取変動金利	0.01	-	△ 0.00	-	-	0.01	0.00
外貨建支払側固定スワップ想定元本	55,495	55,495	-	-	-	3,329	114,319
平均支払固定金利	2.92	2.96	-	-	-	3.00	2.94
平均受取変動金利	2.61	2.61	-	-	-	2.72	2.61
合 計	71,495	55,495	32,000	-	21,000	27,329	207,319
区 分	2019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	-	-	4,700	-	600	34,950	40,250
平均支払固定金利	-	-	△ 0.00	-	0.09	0.28	0.25
平均受取変動金利	-	-	△ 0.00	-	△ 0.00	△ 0.05	△ 0.04
外貨建支払側固定スワップ想定元本	-	-	-	-	-	-	-
平均支払固定金利	-	-	-	-	-	-	-
平均受取変動金利	-	-	-	-	-	-	-
合 計	-	-	4,700	-	600	44,950	50,250

## ②通貨関連

(単位：百万円)

区分	種類	2018年度末			2019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	1,396,821	△ 3,796	△ 3,796	2,222,430	20,995	20,995
	(ユーロ)	415,446	1,820	1,820	1,021,163	1,671	1,671
	(米ドル)	548,856	△ 5,787	△ 5,787	830,641	△ 3,330	△ 3,330
	(オーストラリアドル)	99,060	628	628	108,816	7,711	7,711
	(イギリスポンド)	27,726	△ 732	△ 732	58,753	2,858	2,858
	(カナダドル)	13,979	17	17	22,248	802	802
	(その他)	291,752	256	256	180,807	11,282	11,282
	買建	959,220	△ 1,237	△ 1,237	937,288	10,117	10,117
	(ユーロ)	243,773	△ 3,310	△ 3,310	449,081	758	758
	(米ドル)	466,740	2,126	2,126	390,509	10,409	10,409
	(オーストラリアドル)	8,142	△ 42	△ 42	29,087	55	55
	(イギリスポンド)	-	-	-	22,647	△ 800	△ 800
	(カナダドル)	3,606	-	-	3,697	-	-
	(その他)	236,956	△ 11	△ 11	42,265	△ 305	△ 305
	通貨オプション						
	売建						
	プット	100,900			41,021		
	(イギリスポンド)	(2,914)	276	2,638	(39)	87	△ 48
	(米ドル)	-	-	-	41,021		
		(-)	-	-	(39)	87	△ 48
	買建						
	プット	821,224			648,053		
(米ドル)	(16,676)	4,348	△ 12,327	(10,392)	13,800	3,407	
(イギリスポンド)	779,801	3,968	△ 12,255	607,032	13,675	4,660	
	(16,223)			(9,015)			
	41,422	379	△ 72	41,021	125	△ 1,252	
	(452)			(1,377)			
合計			△ 14,724			34,472	

- (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	2018年度末			2019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	-	-	-	24,992	△ 3,065	△ 3,065
	外貨建株価指数先物 売建	-	-	-	89,745	△ 9,335	△ 9,335
	円建株価指数オプション 買建 プット	150,000 (6,363)	1,625	△ 4,738	149,961 (4,213)	23,842	19,628
	外貨建株価指数オプション 買建 プット	59,028 (2,280)	177	△ 2,103	20,745 (1,401)	1,910	508
合計				△ 6,842			7,735

- (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	2018年度末			2019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 買建	48,974 -	△ 74 -	△ 74 -	- 3,647	- 14	- 14
	外貨建債券先物 売建 買建	271,908 380,803	△ 3,705 8,423	△ 3,705 8,423	445,448 557,925	△ 6,283 6,724	△ 6,283 6,724
店頭	外貨建債券先渡契約 売建 買建	5,814 26,979	△ 51 209	△ 51 209	88,387 83,442	△ 1,146 1,466	△ 1,146 1,466
	円建債券店頭オプション 売建 コール	40,490 (34)	58	△ 24	- (-)	-	-
	プット	173,973 (252)	59	193	37,350 (218)	329	△ 110
	買建 コール	173,973 (192)	519	326	37,350 (205)	98	△ 107
	プット	40,490 (43)	1	△ 41	- (-)	-	-
	合計				5,255		

- (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	2018年度末				2019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	24,000	11,500	208	208	17,500	7,000	150	150
	プロテクション買建	5,800	5,800	△ 130	△ 130	40,066	40,066	44	44
合計					78				194

(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	2018年度末				2019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	円建金利スワップ 固定金利受取/変動金利支払	貸付金	14,450	14,450	116	116	14,350	14,350	158	158
	固定金利受取/変動金利支払	保険負債	700,000	700,000	15,672	15,672	700,000	700,000	42,230	42,230
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	15,300	15,300	203	203	15,300	12,300	167	167
	固定金利支払/変動金利受取	借入金	283,000	283,000	△ 2,703	△ 2,703	283,000	144,000	△ 1,708	△ 1,708
合計						13,289				40,848

(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	2018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	-	7,000	10,450	2,300	10,000	700,000	729,750
平均受取固定金利	-	0.17	0.04	1.19	0.10	0.47	0.45
平均支払変動金利	-	△ 0.01	0.03	0.07	△ 0.08	0.00	0.00
円建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	-	0.13	0.13	-	-	-	0.13
合計	-	146,000	154,450	2,300	10,000	700,000	1,012,750
区分	2019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	3,000	8,000	6,350	2,300	10,000	700,000	729,650
平均受取固定金利	0.46	0.04	△ 0.01	1.19	0.10	0.47	0.45
平均支払変動金利	△ 0.04	0.03	△ 0.01	0.07	△ 0.10	△ 0.04	△ 0.04
円建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	0.13	0.13	-	-	-	-	0.13
合計	142,000	152,000	6,350	2,300	10,000	700,000	1,012,650

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	2018年度末				2019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	通貨スワップ	外貨建債券	256,613	212,995	7,701	7,701	230,320	212,466	4,725	4,725
	(米ドル)		181,959	149,098	5,178	5,178	148,990	133,183	59	59
	(ユーロ)		62,543	51,786	1,720	1,720	69,227	67,181	3,376	3,376
	(イギリスポンド)		12,110	12,110	803	803	12,101	12,101	1,289	1,289
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		4,970,497	-	△ 12,710	△ 12,710	5,430,501	-	31,536	31,536
	(米ドル)		2,408,422	-	△ 34,423	△ 34,423	2,599,200	-	△ 63,756	△ 63,756
	(ユーロ)		1,591,097	-	26,561	26,561	1,559,276	-	△ 2,621	△ 2,621
	(オーストラリアドル)		341,336	-	△ 1,842	△ 1,842	374,676	-	36,802	36,802
	(イギリスポンド)		141,192	-	△ 3,380	△ 3,380	286,852	-	15,306	15,306
	(カナダドル)		62,405	-	△ 36	△ 36	91,583	-	6,221	6,221
	(その他)		426,043	-	409	409	518,912	-	39,582	39,582
	買建		16,165	-	△ 59	△ 59	226,362	-	△ 9,507	△ 9,507
	(イギリスポンド)		-	-	-	-	136,055	-	△ 5,176	△ 5,176
	(米ドル)		15,458	-	△ 53	△ 53	3,316	-	9	9
	(ユーロ)		341	-	△ 5	△ 5	718	-	2	2
	(オーストラリアドル)		291	-	△ 0	△ 0	-	-	-	-
	(その他)		73	-	△ 0	△ 0	86,272	-	△ 4,342	△ 4,342
為替予約等の振当処理	為替予約	外貨建定期預金								
	売建		252,646	-	-	-	239,165	-	-	-
	(米ドル)		103,525	-	-	-	89,727	-	-	-
	(オーストラリアドル)		79,522	-	-	-	-	-	-	-
	(その他)	69,597	-	-	-	149,437	-	-	-	
	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	37,142	33,598	-	-	32,605	32,605	-	-
	(米ドル)		31,178	27,633	-	-	26,641	26,641	-	-
	(ユーロ)		5,964	5,964	-	-	5,964	5,964	-	-
合 計									△ 5,068	26,754

(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

2018年度末、2019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

2018年度末、2019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

2018年度末、2019年度末ともに期末残高がないため、記載していません。