

2020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	2019年度末		2020年度末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
国 債	13,698,904	46.2	14,672,138	45.1
地 方 債	129,433	0.4	107,735	0.3
社 債	2,042,503	6.9	1,960,238	6.0
うち公社・公団債	414,124	1.4	393,526	1.2
株 式	2,786,892	9.4	3,569,109	11.0
外 国 証 券	10,073,956	34.0	11,402,677	35.1
公 社 債	9,088,395	30.7	9,811,240	30.2
株 式 等	985,560	3.3	1,591,436	4.9
そ の 他 の 証 券	896,944	3.0	818,392	2.5
合 計	29,628,634	100.0	32,530,293	100.0

（2）有価証券残存期間別残高

（単位：百万円）

（単位：百万円）

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	
区 分		2020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		491,377	1,189,420	1,799,772	2,336,468	3,470,970	23,242,285	32,530,293
	国 債	16,079	116,456	385,869	713,515	2,012,050	11,428,166	14,672,138
	地 方 債	2,799	4,312	12,879	6,305	2,908	78,531	107,735
	社 債	58,145	176,507	234,358	210,394	143,479	1,137,353	1,960,238
	株 式	-	-	-	-	-	3,569,109	3,569,109
	外 国 証 券	413,632	873,430	1,047,910	1,310,705	977,002	6,779,996	11,402,677
	公 社 債	410,667	859,597	1,020,003	1,259,084	886,601	5,375,286	9,811,240
	株 式 等	2,965	13,833	27,906	51,620	90,401	1,404,709	1,591,436
そ の 他 の 証 券	720	18,714	118,754	95,546	335,529	249,127	818,392	
買 入 金 銭 債 権	-	3,351	27,707	23,082	9,449	188,548	252,140	
譲 渡 性 預 金	70,997	-	-	-	-	-	70,997	
そ の 他	-	-	-	-	-	7,716	7,716	

（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		2019年度末		2020年度末	
		金 額	占 率	金 額	占 率
水 産 ・ 農 林 業		716	0.0	266	0.0
鉱 業		200	0.0	200	0.0
建 設 業		98,486	3.5	119,215	3.3
製 造 業	食 料 品	172,860	6.2	184,173	5.2
	織 維 製 品	19,433	0.7	23,338	0.7
	パ ル プ ・ 紙	2,949	0.1	3,830	0.1
	化 学	164,130	5.9	212,174	5.9
	医 薬 品	68,347	2.5	87,967	2.5
	石 油 ・ 石 炭 製 品	2,576	0.1	3,324	0.1
	ゴ ム 製 品	18,058	0.6	15,100	0.4
	ガ ラ ス ・ 土 石 製 品	79,927	2.9	108,791	3.0
	鉄 鋼	23,138	0.8	36,139	1.0
	非 鉄 金 属	9,865	0.4	13,969	0.4
	金 属 製 品	27,248	1.0	48,079	1.3
	機 械	178,284	6.4	249,106	7.0
	電 気 機 器	479,729	17.2	731,687	20.5
	輸 送 用 機 器	141,022	5.1	190,618	5.3
	精 密 機 器	149,300	5.4	168,390	4.7
	そ の 他 製 品	59,452	2.1	68,351	1.9
電 気 ・ ガ ス 業		91,894	3.3	67,031	1.9
運 輸 ・ 情 報 通 信 業	陸 運 業	281,543	10.1	278,117	7.8
	海 運 業	32	0.0	51	0.0
	空 運 業	3,169	0.1	3,113	0.1
	倉 庫 ・ 運 輸 関 連 業	3,953	0.1	4,617	0.1
	情 報 ・ 通 信 業	52,364	1.9	83,762	2.3
商 業	卸 売 業	108,226	3.9	142,684	4.0
	小 売 業	93,903	3.4	120,546	3.4
金 融 ・ 保 険 業	銀 行 業	162,225	5.8	207,608	5.8
	証券、商品先物取引業	218	0.0	1,786	0.1
	保 険 業	3,724	0.1	4,325	0.1
	そ の 他 金 融 業	23,670	0.8	29,575	0.8
不 動 産 業		17,826	0.6	18,737	0.5
サ ー ビ ス 業		248,411	8.9	342,425	9.6
合 計		2,786,892	100.0	3,569,109	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
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
2020年度末							
変 動 金 利	9,928	19,985	38,724	13,547	11,905	308,274	402,366
固 定 金 利	315,760	339,671	358,971	287,638	232,373	347,202	1,881,617
一般貸付計	325,688	359,657	397,695	301,186	244,278	655,476	2,283,983

（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		2019年度末		2020年度末	
			占 率		占 率
大 企 業	貸付先数 金 額	215 1,636,633	64.2 84.2	209 1,688,707	62.8 83.6
中 堅 企 業	貸付先数 金 額	7 4,038	2.1 0.2	7 4,103	2.1 0.2
中 小 企 業	貸付先数 金 額	113 302,872	33.7 15.6	117 326,916	35.1 16.2
国内企業向け 貸付計	貸付先数 金 額	335 1,943,544	100.0 100.0	333 2,019,726	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	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	常用する 従業員 100名超	資本金10億円 以上
中 堅 企 業	300名超 かつ	資本金3億円超 10億円未満	50名超 かつ	資本金5千万円超 10億円未満	100名超 かつ	資本金5千万円超 10億円未満	100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		2019年度末		2020年度末	
		金 額	占 率	金 額	占 率
担 保 貸 付		2,406	0.1	2,546	0.1
	有価証券担保貸付	950	0.0	1,130	0.0
	不動産・動産・ 財団担保貸付	1,455	0.1	1,415	0.1
	指名債権担保貸付	－	－	－	－
保 証 貸 付		119,612	5.4	99,406	4.4
信 用 貸 付		2,096,520	94.5	2,182,031	95.5
そ の 他		－	－	－	－
一 般 貸 付 計		2,218,538	100.0	2,283,983	100.0
	うち劣後特約付 貸	213,410	9.6	241,551	10.6

（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		2019年度末		2020年度末	
		金 額	占 率	金 額	占 率
国内向け	製 造 業	276,090	12.4	270,245	11.8
	食 料	40,407	1.8	43,049	1.9
	織 維	1,673	0.1	1,824	0.1
	木 材 ・ 木 製 品	500	0.0	500	0.0
	パ ル プ ・ 紙	10,660	0.5	10,600	0.5
	印 刷	12,502	0.6	22,500	1.0
	化 学	26,771	1.2	27,865	1.2
	石 油 ・ 石 炭	8,860	0.4	7,860	0.3
	窯 業 ・ 土 石	19,022	0.9	18,791	0.8
	鉄 鋼	82,547	3.7	66,245	2.9
	非 鉄 金 属	4,626	0.2	3,985	0.2
	金 属 製 品	961	0.0	964	0.0
	はん用・生産用・業務用機械	20,391	0.9	22,495	1.0
	電 気 機 械	20,534	0.9	15,273	0.7
	輸 送 用 機 械	17,589	0.8	19,173	0.8
	そ の 他 の 製 造 業	9,042	0.4	9,116	0.4
	農 業 、 林 業	-	-	-	-
	漁 業	-	-	-	-
	鉱 業 、 採 石 業 、 砂 利 採 取 業	-	-	-	-
	建 設 業	9,260	0.4	14,077	0.6
	電 気 ・ ガ ス ・ 熱 供 給 ・ 水 道 業	447,376	20.2	452,713	19.8
	情 報 通 信 業	47,786	2.2	61,006	2.7
	運 輸 業 、 郵 便 業	251,547	11.3	250,994	11.0
	卸 売 業	300,862	13.6	303,944	13.3
	小 売 業	12,505	0.6	11,557	0.5
	金 融 業 、 保 険 業	554,499	25.0	596,675	26.1
	不 動 産 業	141,549	6.4	135,914	6.0
	物 品 賃 貸 業	98,872	4.5	93,647	4.1
	学術研究、専門・技術サービス業	200	0.0	500	0.0
	宿 泊 業	-	-	-	-
	飲 食 業	-	-	-	-
	生活関連サービス業・娯楽業	4,623	0.2	3,477	0.2
	教 育 、 学 習 支 援 業	-	-	-	-
	医 療 ・ 福 祉	1,000	0.0	4,715	0.2
	そ の 他 の サ ー ビ ス	2,819	0.1	2,313	0.1
	地 方 公 共 団 体	19,088	0.9	16,727	0.7
	個 人 (住 宅 ・ 消 費 ・ 納 税 資 金 等)	-	-	-	-
	そ の 他	66	0.0	-	-
	合 計	2,168,147	97.7	2,218,510	97.1
海外向け	政 府 等	3,304	0.1	4,218	0.2
	金 融 機 関	5,000	0.2	-	-
	商 工 業 等	42,086	1.9	61,255	2.7
	合 計	50,391	2.3	65,473	2.9
一 般 貸 付 計		2,218,538	100.0	2,283,983	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	2019年度末		2020年度末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
公 社 債	8,287,407	73.4	9,017,236	74.1
株 式	643,359	5.7	1,196,647	9.8
現 預 金 ・ そ の 他	640,851	5.7	214,984	1.8
小 計	9,571,618	84.8	10,428,868	85.7

②円貨額が確定した外貨建資産

（単位：百万円、％）

区 分	2019年度末		2020年度末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
公 社 債	-	-	-	-
現 預 金 ・ そ の 他	272,311	2.4	272,336	2.2
小 計	272,311	2.4	272,336	2.2

③円貨建資産

（単位：百万円、％）

区 分	2019年度末		2020年度末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
非 居 住 者 貸 付	30,043	0.3	25,948	0.2
公社債（円建外債）・その他	1,412,739	12.5	1,437,739	11.8
小 計	1,442,783	12.8	1,463,688	12.0

④合 計

（単位：百万円、％）

区 分	2019年度末		2020年度末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
海 外 投 融 資	11,286,713	100.0	12,164,893	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	2019年度末		2020年度末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
米 ド ル	4,651,934	48.6	5,085,454	48.8
ユ ー ロ	2,637,312	27.6	2,255,928	21.6
オーストラリアドル	699,244	7.3	1,226,547	11.8
カナダドル	215,930	2.3	434,031	4.2
イギリスポンド	302,948	3.2	331,737	3.2
中 国 元	209,548	2.2	301,325	2.9
メキシコペソ	188,095	2.0	183,055	1.8
そ の 他 共 計	9,571,618	100.0	10,428,868	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
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
2020年度末	北 米	4,721,218	41.4	4,049,280	41.3	671,937	42.2	12,085	18.5
	ヨ ー ロ ッ パ	3,471,185	30.4	2,984,625	30.4	486,560	30.6	19,397	29.6
	オ セ ア ニ ア	1,158,518	10.2	1,130,271	11.5	28,247	1.8	11,388	17.4
	ア ジ ア	507,080	4.4	402,555	4.1	104,525	6.6	2,829	4.3
	中 南 米	1,304,415	11.4	1,004,650	10.2	299,765	18.8	19,771	30.2
	中 東	400	0.0	-	-	400	0.0	-	-
	ア フ リ カ	-	-	-	-	-	-	-	-
	国 際 機 関	239,857	2.1	239,857	2.4	-	-	-	-
	合 計	11,402,677	100.0	9,811,240	100.0	1,591,436	100.0	65,473	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	2019年度末						2020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	40,848	26,754	-	-	-	67,602	18,451	△ 314,225	-	-	-	△ 295,773
ヘッジ会計非適用分	3,245	34,472	7,735	557	194	46,206	△ 13,205	△ 7,702	△ 1,028	2,458	39	△ 19,438
合 計	44,093	61,227	7,735	557	194	113,808	5,245	△ 321,927	△ 1,028	2,458	39	△ 315,212

（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。
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
2020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△306,695百万円）及び
ヘッジ会計非適用分の差損益（△19,438百万円）の合計△326,133百万円

（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	2019年度末				2020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	円建金利スワップ								
	固定金利受取／変動金利支払	10,000	10,000	978	978	10,000	10,000	510	510
	固定金利支払／変動金利受取	40,250	40,250	△ 1,035	△ 1,035	17,600	17,600	△ 217	△ 217
	円建金利スワップション								
	売建	-	-			20,000	-		
	固定金利受取／変動金利支払	(-)	(-)	-	-	(236)	(-)	13	222
	買建								
	固定金利受取／変動金利支払	830,000	460,000			480,000	10,000		
		(18,202)	(11,993)	27,507	9,305	(12,300)	(70)	1,724	△ 10,575
	固定金利支払／変動金利受取	1,560,000	1,110,000			1,895,000	1,095,000		
		(6,316)	(3,454)	312	△ 6,003	(9,216)	(6,243)	6,072	△ 3,143
合 計					3,245				△ 13,205

（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	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
合 計	-	-	4,700	-	600	44,950	50,250
区 分	2020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	-	-	-	-	2,600	15,000	17,600
平均支払固定金利	-	-	-	-	0.07	0.45	0.40
平均受取変動金利	-	-	-	-	△ 0.06	△ 0.06	△ 0.06
合 計	-	-	-	-	2,600	25,000	27,600

②通貨関連

(単位：百万円)

区分	種 類	2019年度末			2020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	△ 315	△ 315
	為替予約						
	売建	2,222,430	20,995	20,995	288,176	△ 1,246	△ 1,246
	(米ドル)	830,641	△ 3,330	△ 3,330	88,857	△ 1,048	△ 1,048
	(オーストラリアドル)	108,816	7,711	7,711	77,417	43	43
	(ユーロ)	1,021,163	1,671	1,671	58,947	925	925
	(イギリスポンド)	58,753	2,858	2,858	19,317	△ 839	△ 839
	(カナダドル)	22,248	802	802	6,478	△ 327	△ 327
	(その他)	180,807	11,282	11,282	37,158	△ 0	△ 0
	買建	937,288	10,117	10,117	230,063	△ 2,313	△ 2,313
	(米ドル)	390,509	10,409	10,409	159,658	△ 298	△ 298
	(ユーロ)	449,081	758	758	55,553	△ 1,908	△ 1,908
	(イギリスポンド)	22,647	△ 800	△ 800	9,952	△ 89	△ 89
	(オーストラリアドル)	29,087	55	55	-	-	-
	(カナダドル)	3,697	-	-	-	-	-
	(その他)	42,265	△ 305	△ 305	4,899	△ 17	△ 17
	通貨オプション						
	売建						
	プット	41,021			108,807		
	(39)		87	△ 48	(159)	0	158
	(米ドル)	-			108,807		
	(-)		-	-	(159)	0	158
	(イギリスポンド)	41,021			-		
	(39)		87	△ 48	(-)	-	-
	買建						
	プット	648,053			512,231		
	(10,392)		13,800	3,407	(4,631)	645	△ 3,985
	(米ドル)	607,032			512,231		
	(9,015)		13,675	4,660	(4,631)	645	△ 3,985
	(イギリスポンド)	41,021			-		
	(1,377)		125	△ 1,252	(-)	-	-
合 計				34,472			△ 7,702

- (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	2019年度末			2020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	-	-	-
	買建	-	-	-	5,176	104	104
	外貨建株価指数先物						
	売建	89,745	△ 9,335	△ 9,335	-	-	-
	買建	-	-	-	4,546	21	21
	円建株価指数オプション						
	買建						
	ブット	149,961 (4,213)	23,842	19,628	269,963 (5,199)	4,044	△ 1,155
	外貨建株価指数オプション						
	買建						
	ブット	20,745 (1,401)	1,910	508	- (-)	-	-
合 計				7,735			△ 1,028

- (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	2019年度末			2020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	-	-	-	18,270	△ 20	△ 20
	買建	3,647	14	14	-	-	-
	外貨建債券先物						
店頭	売建	445,448	△ 6,283	△ 6,283	567,017	8,802	8,802
	買建	557,925	6,724	6,724	702,387	△ 6,486	△ 6,486
	外貨建債券先渡契約						
	売建	88,387	△ 1,146	△ 1,146	41,532	137	137
	買建	83,442	1,466	1,466	78,944	△ 133	△ 133
	円建債券店頭オプション						
	売建						
	コール	-	-	-	6,555	31	2
	(-)	(-)	-	-	(33)		
	ブット	37,350 (218)	329	△ 110	36,871 (134)	35	98
	買建						
	コール	37,350 (205)	98	△ 107	36,871 (107)	170	63
	ブット	- (-)	-	-	6,555 (37)	32	△ 4
合 計				557			2,458

- (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	2019年度末				2020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	17,500	7,000	150	150	12,000	11,000	255	255
	プロテクション買建	40,066	40,066	44	44	11,300	11,300	△ 215	△ 215
合 計					194				39

(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	2019年度末				2020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	14,350	14,350	158	158	14,250	14,250	74	74
	固定金利受取／変動金利支払	保険負債	700,000	700,000	42,230	42,230	700,000	700,000	18,998	18,998
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	12,300	167	167	12,300	8,300	124	124
	固定金利支払／変動金利受取	借入金	283,000	144,000	△ 1,708	△ 1,708	325,000	325,000	△ 746	△ 746
合 計						40,848				18,451

(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	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
区 分	2020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	4,000	10,250	2,300	10,000	—	700,000	726,550
平均受取固定金利	△ 0.05	0.04	1.19	0.10	—	0.47	0.45
平均支払変動金利	△ 0.05	0.00	0.08	△ 0.08	—	△ 0.05	△ 0.05
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	4,000	154,250	183,300	10,000	—	700,000	1,051,550

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	2019年度末				2020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	230,320	212,466	4,725	4,725	196,770	185,116	△ 7,530	△ 7,530
	(米ドル)		148,990	133,183	59	59	114,235	108,781	△ 3,676	△ 3,676
	(ユーロ)		69,227	67,181	3,376	3,376	70,488	64,288	△ 3,478	△ 3,478
	(イギリスポンド)		12,101	12,101	1,289	1,289	12,046	12,046	△ 375	△ 375
ヘッジ対象 に係る損益 を認識する 方法	為替予約 売建	外貨建 債券	5,430,501	-	31,536	31,536	6,454,969	-	△ 306,980	△ 306,980
	(米ドル)		2,599,200	-	△ 63,756	△ 63,756	3,160,414	-	△ 177,109	△ 177,109
	(ユーロ)		1,559,276	-	△ 2,621	△ 2,621	1,344,897	-	△ 42,286	△ 42,286
	(オーストラリアドル)		374,676	-	36,802	36,802	835,833	-	△ 43,597	△ 43,597
	(カナダドル)		91,583	-	6,221	6,221	344,654	-	△ 24,746	△ 24,746
	(イギリスポンド)		286,852	-	15,306	15,306	162,460	-	△ 3,242	△ 3,242
	(その他)		518,912	-	39,582	39,582	606,709	-	△ 15,997	△ 15,997
	買建		226,362	-	△ 9,507	△ 9,507	11,563	-	285	285
	(米ドル)		3,316	-	9	9	7,928	-	229	229
	(オーストラリアドル)		-	-	-	-	3,585	-	53	53
	(カナダドル)		-	-	-	-	49	-	1	1
	(イギリスポンド)		136,055	-	△ 5,176	△ 5,176	-	-	-	-
	(ユーロ)		718	-	2	2	-	-	-	-
	(その他)		86,272	-	△ 4,342	△ 4,342	-	-	-	-
為替予約等の 振当処理	為替予約 売建	外貨建 定期預金	239,165	-	-	-	242,002	-	-	-
	(米ドル)		89,727	-	-	-	92,002	-	-	-
	(その他)		149,437	-	-	-	150,000	-	-	-
	通貨スワップ	外貨建社債 (負債)	476,277	476,277	-	-	476,277	368,715	-	-
	(米ドル)		476,277	476,277	-	-	476,277	368,715	-	-
	通貨スワップ	外貨建 貸付金	32,605	32,605	-	-	30,366	30,366	-	-
	(米ドル)		26,641	26,641	-	-	25,594	25,594	-	-
	(ユーロ)		5,964	5,964	-	-	4,771	4,771	-	-
	合 計					26,754				△ 314,225

(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

2019年度末、2020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

2019年度末、2020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

2019年度末、2020年度末ともに期末残高がないため、記載していません。