

2023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 | 2022年度末 | | 2023年度末 | |
|-------------|------------|-------|------------|-------|
| | 金 額 | 占 率 | 金 額 | 占 率 |
| 国 債 | 15,254,703 | 56.5 | 15,936,171 | 55.7 |
| 地 方 債 | 117,628 | 0.4 | 121,805 | 0.4 |
| 社 債 | 1,702,676 | 6.3 | 1,874,903 | 6.5 |
| うち公社・公団債 | 414,373 | 1.5 | 402,652 | 1.4 |
| 株 式 | 3,207,944 | 11.9 | 4,036,229 | 14.1 |
| 外 国 証 券 | 5,930,212 | 22.0 | 5,400,341 | 18.9 |
| 公 社 債 | 4,454,788 | 16.5 | 3,742,801 | 13.1 |
| 株 式 等 | 1,475,424 | 5.5 | 1,657,540 | 5.8 |
| そ の 他 の 証 券 | 798,919 | 3.0 | 1,261,978 | 4.4 |
| 合 計 | 27,012,086 | 100.0 | 28,631,430 | 100.0 |

(2) 有価証券残存期間別残高

(単位：百万円)

| 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 | |
| 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 | |

(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 | | 2022年度末 | | 2023年度末 | |
|-----------------|---------------------|-----------|-------|-----------|-------|
| | | 金 額 | 占 率 | 金 額 | 占 率 |
| 水 産 ・ 農 林 業 | | 249 | 0.0 | 290 | 0.0 |
| 鉱 業 | | 200 | 0.0 | 200 | 0.0 |
| 建 設 業 | | 105,329 | 3.3 | 151,577 | 3.8 |
| 製 造 業 | 食 料 品 | 219,146 | 6.8 | 261,579 | 6.5 |
| | 織 維 製 品 | 20,793 | 0.6 | 18,942 | 0.5 |
| | パ ル プ ・ 紙 | 2,658 | 0.1 | 3,200 | 0.1 |
| | 化 学 | 171,356 | 5.3 | 199,429 | 4.9 |
| | 医 薬 品 | 100,977 | 3.1 | 105,893 | 2.6 |
| | 石 油 ・ 石 炭 製 品 | 3,555 | 0.1 | 6,024 | 0.1 |
| | ゴ ム 製 品 | 19,424 | 0.6 | 22,566 | 0.6 |
| | ガ ラ ス ・ 土 石 製 品 | 107,765 | 3.4 | 163,975 | 4.1 |
| | 鉄 鋼 | 34,402 | 1.1 | 36,369 | 0.9 |
| | 非 鉄 金 属 | 12,077 | 0.4 | 18,375 | 0.5 |
| | 金 属 製 品 | 32,076 | 1.0 | 41,416 | 1.0 |
| | 機 械 | 219,057 | 6.8 | 263,066 | 6.5 |
| | 電 気 機 器 | 700,083 | 21.8 | 919,168 | 22.8 |
| | 輸 送 用 機 器 | 165,788 | 5.2 | 282,731 | 7.0 |
| | 精 密 機 器 | 148,682 | 4.6 | 200,275 | 5.0 |
| | そ の 他 製 品 | 85,966 | 2.7 | 88,314 | 2.2 |
| 電 気 ・ ガ ス 業 | | 37,210 | 1.2 | 48,628 | 1.2 |
| 運 輸 ・ 情 報 通 信 業 | 陸 運 業 | 178,867 | 5.6 | 160,167 | 4.0 |
| | 海 運 業 | 28 | 0.0 | 32 | 0.0 |
| | 空 運 業 | 3,327 | 0.1 | 3,726 | 0.1 |
| | 倉 庫 ・ 運 輸 関 連 業 | 4,520 | 0.1 | 4,955 | 0.1 |
| | 情 報 ・ 通 信 業 | 102,384 | 3.2 | 115,170 | 2.9 |
| 商 業 | 卸 売 業 | 153,258 | 4.8 | 220,031 | 5.5 |
| | 小 売 業 | 114,908 | 3.6 | 122,747 | 3.0 |
| 金 融 ・ 保 険 業 | 銀 行 業 | 163,620 | 5.1 | 239,483 | 5.9 |
| | 証 券 ・ 商 品 先 物 取 引 業 | 618 | 0.0 | 597 | 0.0 |
| | 保 険 業 | 6,143 | 0.2 | 7,200 | 0.2 |
| | そ の 他 金 融 業 | 31,486 | 1.0 | 46,354 | 1.1 |
| 不 動 産 業 | | 16,633 | 0.5 | 23,572 | 0.6 |
| サ ー ビ ス 業 | | 245,345 | 7.6 | 260,161 | 6.4 |
| 合 計 | | 3,207,944 | 100.0 | 4,036,229 | 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 |
|---------|-------|-------------|-------------|-------------|--------------|-------------------------|-----------|
| 2022年度末 | 変動金利 | 10,643 | 78,216 | 49,560 | 72,781 | 43,437 | 608,753 |
| | 固定金利 | 437,306 | 323,212 | 344,854 | 217,918 | 150,282 | 1,855,994 |
| | 一般貸付計 | 447,949 | 401,428 | 394,415 | 290,699 | 193,719 | 2,464,747 |
| 2023年度末 | 変動金利 | 52,847 | 88,862 | 103,452 | 73,406 | 76,940 | 867,000 |
| | 固定金利 | 551,237 | 475,628 | 257,522 | 180,132 | 150,049 | 2,007,197 |
| | 一般貸付計 | 604,084 | 564,491 | 360,974 | 253,539 | 226,989 | 2,874,198 |

（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 | | 2022年度末 | | 2023年度末 | |
|---------------|------|-----------|-------|-----------|-------|
| | | 金額 | 占 率 | 金額 | 占 率 |
| 大 企 業 | 貸付先数 | 204 | 60.7 | 199 | 61.2 |
| | 金 額 | 1,659,429 | 81.7 | 1,900,854 | 82.3 |
| 中 堅 企 業 | 貸付先数 | 5 | 1.5 | 6 | 1.8 |
| | 金 額 | 4,044 | 0.2 | 5,323 | 0.2 |
| 中 小 企 業 | 貸付先数 | 127 | 37.8 | 120 | 36.9 |
| | 金 額 | 367,663 | 18.1 | 402,428 | 17.4 |
| 国内企業向け 貸付計 | | 336 | 100.0 | 325 | 100.0 |
| | | 2,031,138 | 100.0 | 2,308,606 | 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 | 資本金10億円 以上 | 常用する 従業員 | 資本金10億円 以上 | 常用する 従業員 | 資本金10億円 以上 | 常用する 従業員 | 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 | 2022年度末 | | 2023年度末 | |
|-------------------|-----------|-------|-----------|-------|
| | 金 額 | 占 率 | 金 額 | 占 率 |
| 担 保 貸 付 | 2,217 | 0.1 | 2,904 | 0.1 |
| 有価証券担保貸付 | 1,318 | 0.1 | 1,913 | 0.1 |
| 不動産・動産・ 財団担保貸付 | 899 | 0.0 | 990 | 0.0 |
| 指名債権担保貸付 | - | - | - | - |
| 保 証 貸 付 | 86,273 | 3.5 | 100,723 | 3.5 |
| 信 用 貸 付 | 2,376,255 | 96.4 | 2,770,570 | 96.4 |
| そ の 他 | - | - | - | - |
| 一 般 貸 付 計 | 2,464,747 | 100.0 | 2,874,198 | 100.0 |
| うち劣後特約付 貸 | 247,058 | 10.0 | 264,514 | 9.2 |

（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 | 2022年度末 | | 2023年度末 | | |
|-------------------------------|---------------|---------|-----------|-----------|------|
| | 金 額 | 占 率 | 金 額 | 占 率 | |
| 製 造 業 | 食 料 | 27,479 | 1.1 | 35,818 | 1.2 |
| | 織 維 | 676 | 0.0 | 540 | 0.0 |
| | 木 材 ・ 木 製 品 | 500 | 0.0 | - | - |
| | パ ル プ ・ 紙 | 10,920 | 0.4 | 2,716 | 0.1 |
| | 印 刷 | 17,500 | 0.7 | 15,000 | 0.5 |
| | 化 学 | 34,972 | 1.4 | 28,672 | 1.0 |
| | 石 油 ・ 石 炭 | 2,000 | 0.1 | 500 | 0.0 |
| | 窯 業 ・ 土 石 | 19,195 | 0.8 | 21,213 | 0.7 |
| | 鉄 鋼 | 44,968 | 1.8 | 31,737 | 1.1 |
| | 非 鉄 金 属 | 5,288 | 0.2 | 7,184 | 0.2 |
| | 金 属 製 品 | 950 | 0.0 | 540 | 0.0 |
| | はん用・生産用・業務用機械 | 22,222 | 0.9 | 23,583 | 0.8 |
| | 電 気 機 械 | 14,438 | 0.6 | 9,939 | 0.3 |
| | 輸 送 用 機 械 | 12,864 | 0.5 | 12,816 | 0.4 |
| | そ の 他 の 製 造 業 | 6,606 | 0.3 | 6,272 | 0.2 |
| | 農 業 、 林 業 | 農 業 | - | - | - |
| 漁 業 | | - | - | - | - |
| 鉱 業 、 採 石 業 、 砂 利 採 取 業 | | - | - | - | - |
| 建 設 業 | | 15,762 | 0.6 | 15,532 | 0.5 |
| 電 気 ・ ガ ス ・ 熱 供 給 ・ 水 道 業 | | 485,134 | 19.7 | 501,023 | 17.4 |
| 情 報 通 信 業 | | 67,124 | 2.7 | 57,156 | 2.0 |
| 運 輸 業 、 郵 便 業 | | 229,873 | 9.3 | 228,930 | 8.0 |
| 卸 売 業 | | 216,433 | 8.8 | 179,210 | 6.2 |
| 小 売 業 | | 8,909 | 0.4 | 9,038 | 0.3 |
| 金 融 業 、 保 険 業 | | 719,225 | 29.2 | 1,068,210 | 37.2 |
| 不 動 産 業 | | 147,019 | 6.0 | 156,272 | 5.4 |
| 物 品 賃 貸 業 | | 91,577 | 3.7 | 82,966 | 2.9 |
| 学 術 研 究 、 専 門 ・ 技 術 サ ー ビ ス 業 | | 4,450 | 0.2 | 6,120 | 0.2 |
| 宿 泊 業 | | - | - | - | - |
| 飲 食 業 | | - | - | - | - |
| 生 活 関 連 サ ー ビ ス 業 ・ 娯 楽 業 | | 11,507 | 0.5 | 6,954 | 0.2 |
| 教 育 、 学 習 支 援 業 | - | - | - | - | |
| 医 療 ・ 福 祉 | 2,463 | 0.1 | 1,788 | 0.1 | |
| そ の 他 の サ ー ビ ス | 2,701 | 0.1 | 1,875 | 0.1 | |
| 地 方 公 共 団 体 | 12,006 | 0.5 | 9,645 | 0.3 | |
| 個 人 (住 宅 ・ 消 費 ・ 納 税 資 金 等) | - | - | - | - | |
| そ の 他 | - | - | - | - | |
| 合 計 | 2,234,768 | 90.7 | 2,521,259 | 87.7 | |
| 海 外 向 け | 政 府 等 | 4,484 | 0.2 | 6,795 | 0.2 |
| | 金 融 機 関 | - | - | - | - |
| | 商 工 業 等 | 225,494 | 9.1 | 346,143 | 12.0 |
| 合 計 | 229,978 | 9.3 | 352,939 | 12.3 | |
| 一 般 貸 付 計 | 2,464,747 | 100.0 | 2,874,198 | 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 | 2022年度末 | | 2023年度末 | |
|---------------|-----------|------|-----------|------|
| | 金 額 | 占 率 | 金 額 | 占 率 |
| 公 社 債 | 3,345,415 | 50.7 | 2,807,267 | 44.0 |
| 株 式 | 1,169,397 | 17.7 | 1,363,963 | 21.4 |
| 現 預 金 ・ そ の 他 | 422,964 | 6.4 | 575,968 | 9.0 |
| 小 計 | 4,937,777 | 74.8 | 4,747,199 | 74.5 |

②円貨額が確定した外貨建資産

（単位：百万円、％）

| 区 分 | 2022年度末 | | 2023年度末 | |
|---------------|---------|-----|---------|-----|
| | 金 額 | 占 率 | 金 額 | 占 率 |
| 公 社 債 | - | - | - | - |
| 現 預 金 ・ そ の 他 | 27,881 | 0.4 | 20,190 | 0.3 |
| 小 計 | 27,881 | 0.4 | 20,190 | 0.3 |

③円貨建資産

（単位：百万円、％）

| 区 分 | 2022年度末 | | 2023年度末 | |
|---------------|-----------|------|-----------|------|
| | 金 額 | 占 率 | 金 額 | 占 率 |
| 非 居 住 者 貸 付 | 35,913 | 0.5 | 32,260 | 0.5 |
| 公社債（円建外債）・その他 | 1,599,936 | 24.2 | 1,575,320 | 24.7 |
| 小 計 | 1,635,849 | 24.8 | 1,607,580 | 25.2 |

④合 計

（単位：百万円、％）

| 区 分 | 2022年度末 | | 2023年度末 | |
|-----------|-----------|-------|-----------|-------|
| | 金 額 | 占 率 | 金 額 | 占 率 |
| 海 外 投 融 資 | 6,601,508 | 100.0 | 6,374,971 | 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 | 2022年度末 | | 2023年度末 | |
|------------|-----------|-------|-----------|-------|
| | 金 額 | 占 率 | 金 額 | 占 率 |
| 米 ド ル | 2,522,477 | 51.1 | 2,779,553 | 58.6 |
| オーストラリアドル | 914,427 | 18.5 | 771,303 | 16.2 |
| ユ ー ロ | 890,921 | 18.0 | 744,208 | 15.7 |
| イギリスポンド | 172,040 | 3.5 | 170,489 | 3.6 |
| カナダドル | 115,921 | 2.3 | 74,948 | 1.6 |
| ニュージーランドドル | 78,371 | 1.6 | 39,920 | 0.8 |
| インドルピー | 10,659 | 0.2 | 25,865 | 0.5 |
| そ の 他 共 計 | 4,937,777 | 100.0 | 4,747,199 | 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 | |
| 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 |
| 2023年度末 | 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 |

(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 | 2022年度末 | | | | | | 2023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 | △ 25,897 | △ 71,887 | - | - | - | △ 97,785 | △ 43,226 | △ 119,893 | - | - | - | △ 163,120 |
| ヘッジ会計非適用分 | 14,266 | △ 7,027 | △ 2,345 | 418 | 405 | 5,716 | △ 6,058 | △ 13,456 | △ 7,267 | △ 333 | 752 | △ 26,363 |
| 合 計 | △ 11,631 | △ 78,915 | △ 2,345 | 418 | 405 | △ 92,068 | △ 49,285 | △ 133,349 | △ 7,267 | △ 333 | 752 | △ 189,483 |

（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。

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

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

(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 | 2022年度末 | | | | 2023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 | 10,000 | 10,000 | △ 338 | △ 338 | 10,000 | 10,000 | △ 689 | △ 689 |
| | 固定金利支払／変動金利受取 | 10,000 | 10,000 | 338 | 338 | 10,000 | 10,000 | 689 | 689 |
| | 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 | 1,580,000 (19,754) | 635,000 (7,108) | 34,020 | 14,266 | 1,240,000 (20,468) | 1,180,000 (20,119) | 14,410 | △ 6,058 |
| | 合 計 | | | | 14,266 | | | | △ 6,058 |

（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 | 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 |
| 区 分 | 2023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 | - | - | - | - | - | 0.63 | 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 |

②通貨関連

(単位：百万円)

| 区分 | 種 類 | 2022年度末 | | | 2023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 | 369,137 | △ 4,514 | △ 4,514 | 609,204 | △ 10,055 | △ 10,055 |
| | (米ドル) | 116,964 | △ 870 | △ 870 | 190,554 | △ 3,608 | △ 3,608 |
| | (オーストラリアドル) | 76,562 | 980 | 980 | 159,727 | △ 2,922 | △ 2,922 |
| | (ユーロ) | 52,526 | △ 2,045 | △ 2,045 | 115,704 | △ 1,869 | △ 1,869 |
| | (イギリスポンド) | 49,145 | △ 2,390 | △ 2,390 | 86,747 | △ 1,257 | △ 1,257 |
| | (カナダドル) | 18,506 | △ 94 | △ 94 | 31,355 | △ 449 | △ 449 |
| | (その他) | 55,432 | △ 94 | △ 94 | 25,115 | 52 | 52 |
| | 買建 | 84,560 | 229 | 229 | 247,154 | 171 | 171 |
| | (米ドル) | 59,013 | 47 | 47 | 147,589 | 150 | 150 |
| | (ユーロ) | 2,301 | 54 | 54 | 42,745 | △ 104 | △ 104 |
| | (イギリスポンド) | 2,630 | 49 | 49 | 23,309 | 65 | 65 |
| | (カナダドル) | 1,624 | - | - | 5,434 | 71 | 71 |
| | (オーストラリアドル) | 1,414 | 8 | 8 | 5,163 | 34 | 34 |
| | (その他) | 17,574 | 70 | 70 | 22,911 | △ 45 | △ 45 |
| | 通貨オプション | | | | | | |
| | 売建 | | | | | | |
| | プット | - | - | - | 2,943 | - | - |
| | (その他) | (-) | - | - | (-) | - | - |
| | 買建 | | | | | | |
| | コール | 49,272 | | | 2,788 | | |
| | (米ドル) | (311) | 115 | 195 | (10) | - | 10 |
| | (その他) | 49,272 | 115 | 195 | (-) | - | - |
| | (その他) | - | - | - | 2,788 | - | - |
| | (その他) | (-) | - | - | (10) | - | 10 |
| | 買建 | | | | | | |
| | プット | 188,951 | | | 194,510 | | |
| | (米ドル) | (4,283) | 1,345 | △ 2,938 | (3,577) | 15 | △ 3,562 |
| | (ユーロ) | 138,564 | 829 | △ 2,279 | 190,019 | 2 | △ 3,561 |
| | (オーストラリアドル) | (3,109) | - | - | 1,632 | 12 | △ 1 |
| | (その他) | (-) | - | - | (14) | - | - |
| | (その他) | 50,387 | 515 | △ 659 | - | - | - |
| | (その他) | (1,174) | - | - | (-) | - | - |
| (その他) | - | - | - | 2,858 | - | - | |
| (その他) | (-) | - | - | (-) | - | - | |
| コール | - | | | 5,177 | | | |
| (米ドル) | (-) | - | - | (43) | 22 | △ 20 | |
| (その他) | - | - | - | 757 | - | - | |
| (その他) | (-) | - | - | (13) | 22 | 8 | |
| (その他) | - | - | - | 4,420 | 0 | △ 29 | |
| (その他) | (-) | - | - | (29) | 0 | △ 29 | |
| 合 計 | | | △ 7,027 | | | △ 13,456 | |

- (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 | 2022年度末 | | | 2023年度末 | | |
|-----|---------------------------|--------------------|-------|---------|---------------------|-------|---------|
| | | 契約額等 | 時価 | 差損益 | 契約額等 | 時価 | 差損益 |
| 取引所 | 円建株価指数オプション 買建 プット | 330,195 (4,081) | 2,169 | △ 1,912 | 458,503 (10,083) | 3,193 | △ 6,890 |
| | 外貨建株価指数オプション 買建 プット | 39,690 (588) | 155 | △ 433 | 20,883 (429) | 53 | △ 376 |
| 合計 | | | | △ 2,345 | | | △ 7,267 |

(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 | 2022年度末 | | | 2023年度末 | | |
|-----|--------------------------|-----------------|--------|--------|------------------|---------------|---------------|
| | | 契約額等 | 時価 | 差損益 | 契約額等 | 時価 | 差損益 |
| 取引所 | 外貨建債券先物 売建 買建 | - - | - - | - - | 40,811 93,712 | △ 309 △ 14 | △ 309 △ 14 |
| | 外貨建債券先渡契約 売建 買建 | - - | - - | - - | 13,967 22,284 | 5 62 | 5 62 |
| 店頭 | 円建債券店頭オプション 売建 コール | 29,124 (25) | 72 | △ 47 | 74,630 (88) | 351 | △ 262 |
| | プット | 95,842 (341) | 102 | 239 | - (-) | - | - |
| | 買建 コール | 95,842 (296) | 554 | 257 | - (-) | - | - |
| | プット | 29,124 (33) | 0 | △ 32 | 74,630 (117) | 301 | 184 |
| 合計 | | | | 418 | | | △ 333 |

(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 | 2022年度末 | | | | 2023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 | | 68,000 | | | | 26,600 | | |
| | プロテクション買建 | 7,000 | 7,000 | △ 40 | △ 40 | - | - | - | - |
| 合計 | | | | | 405 | | | | 752 |

(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 | 2022年度末 | | | | 2023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 | 10,600 | 10,600 | △ 96 | △ 96 | 10,600 | 10,600 | △ 135 | △ 135 |
| | 固定金利受取/変動金利支払 | 保険負債 | 700,000 | 700,000 | △ 27,059 | △ 27,059 | 700,000 | 700,000 | △ 44,291 | △ 44,291 |
| 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 | 2,300 | 53 | 53 | 2,300 | 2,300 | 30 | 30 |
| | 固定金利支払/変動金利受取 | 借入金 | 245,000 | 245,000 | 1,204 | 1,204 | 245,000 | 245,000 | 1,169 | 1,169 |
| 合 計 | | | | | | △ 25,897 | | | | △ 43,226 |

(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 | 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 | 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 |
| 区 分 | 2023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 | - | 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 |

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 | 2022年度末 | | | | 2023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 | 310,111 | 297,161 | △ 15,273 | △ 15,273 | 755,553 | 724,883 | △ 88,727 | △ 88,727 |
| | (米ドル) | | 207,737 | 205,890 | △ 11,073 | △ 11,073 | 550,187 | 537,205 | △ 61,534 | △ 61,534 |
| | (ユーロ) | | 82,801 | 71,698 | △ 5,074 | △ 5,074 | 172,839 | 155,150 | △ 23,294 | △ 23,294 |
| | (イギリスポンド) | | 19,572 | 19,572 | 873 | 873 | 27,215 | 27,215 | △ 3,652 | △ 3,652 |
| | (カナダドル) | | - | - | - | - | 4,360 | 4,360 | △ 181 | △ 181 |
| | (オーストラリアドル) | | - | - | - | - | 950 | 950 | △ 63 | △ 63 |
| 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 | | 2,243,706 | - | △ 57,587 | △ 57,587 | 1,139,616 | - | △ 31,173 | △ 31,173 |
| | (米ドル) | | 998,694 | - | △ 42,438 | △ 42,438 | 549,072 | - | △ 16,172 | △ 16,172 |
| | (オーストラリアドル) | | 640,128 | - | 1,316 | 1,316 | 425,188 | - | △ 8,780 | △ 8,780 |
| | (ユーロ) | | 480,482 | - | △ 14,633 | △ 14,633 | 136,283 | - | △ 5,461 | △ 5,461 |
| | (イギリスポンド) | | 34,167 | - | △ 1,325 | △ 1,325 | 11,521 | - | △ 286 | △ 286 |
| | (カナダドル) | | 36,023 | - | △ 769 | △ 769 | 1,834 | - | △ 25 | △ 25 |
| | (その他) | | 54,210 | - | 262 | 262 | 15,715 | - | △ 446 | △ 446 |
| | 買建 | | 94,813 | - | 973 | 973 | 573 | - | 7 | 7 |
| | (米ドル) | | 36,963 | - | △ 26 | △ 26 | 417 | - | 5 | 5 |
| | (ユーロ) | | 42,573 | - | 1,035 | 1,035 | 30 | - | 0 | 0 |
| | (オーストラリアドル) | | 67 | - | △ 1 | △ 1 | 29 | - | △ 0 | △ 0 |
| | (イギリスポンド) | | 567 | - | 26 | 26 | 7 | - | 0 | 0 |
| | (カナダドル) | | 13,472 | - | △ 67 | △ 67 | - | - | - | - |
| | (その他) | | 1,169 | - | 8 | 8 | 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 | | 5,000 | - | | - | - | 10,001 | - | - | - |
| (米ドル) | | 5,000 | - | | - | - | 10,001 | - | - | - |
| 通貨スワップ | | 368,715 | 368,715 | | - | - | 368,715 | 260,550 | - | - |
| (米ドル) | | 368,715 | 368,715 | | - | - | 368,715 | 260,550 | - | - |
| 通貨スワップ | | 22,878 | 12,958 | | - | - | 10,260 | 10,260 | - | - |
| (米ドル) | 22,878 | 12,958 | - | - | 10,260 | 10,260 | - | - | | |
| 合計 | | | | | | | | | △ 119,893 | |

(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

2022年度末、2023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

2022年度末、2023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

2022年度末、2023年度末ともに期末残高がないため、記載していません。