

2024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）		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年度末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
国 債	15,936,171	55.7	16,428,904	59.4
地 方 債	121,805	0.4	121,949	0.4
社 債	1,874,903	6.5	1,798,040	6.5
うち公社・公団債	402,652	1.4	353,864	1.3
株 式	4,036,229	14.1	3,323,680	12.0
外 国 証 券	5,400,341	18.9	4,751,704	17.2
公 社 債	3,742,801	13.1	3,184,892	11.5
株 式 等	1,657,540	5.8	1,566,811	5.7
そ の 他 の 証 券	1,261,978	4.4	1,210,758	4.4
合 計	28,631,430	100.0	27,635,037	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						
		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
有 価 証 券	国 債	430,560	1,234,083	1,872,503	1,823,358	2,031,639	21,239,284	28,631,430
	地 方 債	104,089	372,120	277,510	894,008	1,051,930	13,236,511	15,936,171
	社 債	509	21,795	2,904	2	3,889	92,704	121,805
	株 式 債	74,065	203,840	272,447	174,096	182,032	968,419	1,874,903
	外 国 証 券	-	-	-	-	-	4,036,229	4,036,229
	公 社 債	251,377	571,713	705,095	555,421	673,729	2,643,003	5,400,341
	株 式 等	239,581	520,081	590,175	406,756	498,901	1,487,304	3,742,801
	そ の 他 の 証 券	11,795	51,632	114,920	148,665	174,827	1,155,698	1,657,540
買 入 金 銭 債 権	519	64,612	614,544	199,829	120,057	262,416	1,261,978	
譲 渡 性 預 金	3,422	14,980	29,448	18,371	3,332	136,654	206,210	
そ の 他	90,994	-	-	-	-	-	90,994	
	-	-	-	-	-	8,872	8,872	

区 分		2024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 (期間の定めのないものを含む)	合 計
有 価 証 券	国 債	567,799	977,375	1,966,476	1,663,103	2,095,214	20,365,068	27,635,037
	地 方 債	161,982	318,704	470,981	838,259	1,060,013	13,578,963	16,428,904
	社 債	11,156	10,912	2,904	185	3,692	93,097	121,949
	株 式 債	90,477	176,458	302,960	178,117	122,770	927,256	1,798,040
	外 国 証 券	-	-	-	-	-	3,323,680	3,323,680
	公 社 債	269,784	417,164	561,960	525,601	747,239	2,229,953	4,751,704
	株 式 等	241,595	363,191	412,359	318,615	625,190	1,223,940	3,184,892
	そ の 他 の 証 券	28,189	53,972	149,600	206,986	122,048	1,006,013	1,566,811
買 入 金 銭 債 権	34,398	54,135	627,669	120,939	161,498	212,116	1,210,758	
譲 渡 性 預 金	1,062	26,551	30,239	12,679	4,799	116,522	191,855	
そ の 他	90,990	-	-	-	-	-	90,990	
	-	-	-	-	-	8,530	8,530	

（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年度末	
		金 額	占 率	金 額	占 率
水 産 ・ 農 林 業		290	0.0	176	0.0
鉱 業		200	0.0	200	0.0
建 設 業		151,577	3.8	130,775	3.9
製 造 業	食 料 品	261,579	6.5	207,818	6.3
	繊 維 製 品	18,942	0.5	17,797	0.5
	パ ル プ ・ 紙	3,200	0.1	1,617	0.0
	化 学	199,429	4.9	164,338	4.9
	医 薬 品	105,893	2.6	66,541	2.0
	石 油 ・ 石 炭 製 品	6,024	0.1	4,189	0.1
	ゴ ム 製 品	22,566	0.6	19,150	0.6
	ガ ラ ス ・ 土 石 製 品	163,975	4.1	140,404	4.2
	鉄 鋼	36,369	0.9	27,283	0.8
	非 鉄 金 属	18,375	0.5	22,757	0.7
	金 属 製 品	41,416	1.0	54,257	1.6
	機 械	263,066	6.5	203,364	6.1
	電 気 機 器	919,168	22.8	715,279	21.5
	輸 送 用 機 器	282,731	7.0	192,402	5.8
	精 密 機 器	200,275	5.0	184,343	5.5
	そ の 他 製 品	88,314	2.2	95,159	2.9
電 気 ・ ガ ス 業		48,628	1.2	46,336	1.4
運 輸 ・ 情 報 通 信 業	陸 運 業	160,167	4.0	112,748	3.4
	海 運 業	32	0.0	-	-
	空 運 業	3,726	0.1	2,303	0.1
	倉 庫 ・ 運 輸 関 連 業	4,955	0.1	2,565	0.1
	情 報 ・ 通 信 業	115,170	2.9	106,547	3.2
商 業	卸 売 業	220,031	5.5	184,603	5.6
	小 売 業	122,747	3.0	106,589	3.2
金 融 ・ 保 険 業	銀 行 業	239,483	5.9	266,640	8.0
	証 券、商 品 先 物 取 引 業	597	0.0	639	0.0
	保 険 業	7,200	0.2	8,473	0.3
	そ の 他 金 融 業	46,354	1.1	28,139	0.8
不 動 産 業		23,572	0.6	18,294	0.6
サ ー ビ ス 業		260,161	6.4	191,940	5.8
合 計		4,036,229	100.0	3,323,680	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年度末							
変 動 金 利	56,653	87,891	166,920	64,266	90,167	487,029	952,929
固 定 金 利	374,124	562,134	263,875	136,796	200,604	714,468	2,252,003
一般貸付計	430,777	650,026	430,795	201,062	290,772	1,201,497	3,204,932

（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年度末	
			占 率		占 率
大 企 業	貸付先数 金 額	199 1,900,854	61.2 82.3	193 2,076,538	59.9 83.3
中 堅 企 業	貸付先数 金 額	6 5,323	1.8 0.2	6 4,520	1.9 0.2
中 小 企 業	貸付先数 金 額	120 402,428	36.9 17.4	123 412,734	38.2 16.6
国内企業向け 貸付計	貸付先数 金 額	325 2,308,606	100.0 100.0	322 2,493,793	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	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		2023年度末		2024年度末	
		金 額	占 率	金 額	占 率
担 保 貸 付		2,904	0.1	2,799	0.1
	有価証券担保貸付	1,913	0.1	1,591	0.0
	不動産・動産・ 財団担保貸付	990	0.0	1,207	0.0
	指名債権担保貸付	－	－	－	－
保 証 貸 付		100,723	3.5	138,096	4.3
信 用 貸 付		2,770,570	96.4	3,064,036	95.6
そ の 他		－	－	－	－
一 般 貸 付 計		2,874,198	100.0	3,204,932	100.0
	うち劣後特約付 貸 付	264,514	9.2	572,490	17.9

（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年度末	
		金 額	占 率	金 額	占 率
国内向け	製 造 業	196,533	6.8	177,409	5.5
	食 料	35,818	1.2	29,960	0.9
	繊 維	540	0.0	572	0.0
	木 材 ・ 木 製 品	-	-	-	-
	パ ル プ ・ 紙	2,716	0.1	2,546	0.1
	印 刷	15,000	0.5	12,500	0.4
	化 学	28,672	1.0	20,562	0.6
	石 油 ・ 石 炭	500	0.0	500	0.0
	窯 業 ・ 土 石	21,213	0.7	15,261	0.5
	鉄 鋼	31,737	1.1	31,632	1.0
	非 鉄 金 属	7,184	0.2	6,820	0.2
	金 属 製 品	540	0.0	700	0.0
	はん用・生産用・業務用機械	23,583	0.8	27,076	0.8
	電 気 機 械	9,939	0.3	14,586	0.5
	輸 送 用 機 械	12,816	0.4	8,432	0.3
	そ の 他 の 製 造 業	6,272	0.2	6,259	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	14,656	0.5
	電 気 ・ ガ ス ・ 熱 供 給 ・ 水 道 業	501,023	17.4	565,305	17.6
	情 報 通 信 業	57,156	2.0	45,785	1.4
	運 輸 業 、 郵 便 業	228,930	8.0	217,720	6.8
	卸 売 業	179,210	6.2	154,799	4.8
	小 売 業	9,038	0.3	8,877	0.3
	金 融 業 、 保 険 業	1,068,210	37.2	1,312,568	41.0
	不 動 産 業	156,272	5.4	155,545	4.9
	物 品 賃 貸 業	82,966	2.9	80,987	2.5
	学術研究、専門・技術サービス業	6,120	0.2	6,125	0.2
	宿 泊 業	-	-	-	-
	飲 食 業	-	-	-	-
	生活関連サービス業・娯楽業	6,954	0.2	4,082	0.1
	教 育 、 学 習 支 援 業	-	-	-	-
	医 療 ・ 福 祉	1,788	0.1	2,679	0.1
	そ の 他 の サ ー ビ ス	1,875	0.1	1,135	0.0
	地 方 公 共 団 体	9,645	0.3	7,285	0.2
	個 人 （ 住 宅 ・ 消 費 ・ 納 税 資 金 等 ）	-	-	-	-
	そ の 他	-	-	-	-
	合 計	2,521,259	87.7	2,754,963	86.0
海外向け	政 府 等	6,795	0.2	5,348	0.2
	金 融 機 関	-	-	-	-
	商 工 業 等	346,143	12.0	444,620	13.9
	合 計	352,939	12.3	449,968	14.0
一 般 貸 付 計		2,874,198	100.0	3,204,932	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年度末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
公 社 債	2,807,267	44.0	2,476,364	42.4
株 式	1,363,963	21.4	1,259,168	21.5
現 預 金 ・ そ の 他	575,968	9.0	606,841	10.4
小 計	4,747,199	74.5	4,342,373	74.3

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年度末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
公 社 債	-	-	-	-
現 預 金 ・ そ の 他	20,190	0.3	20,220	0.3
小 計	20,190	0.3	20,220	0.3

③円貨建資産

（単位：百万円、％）

区 分	2023年度末		2024年度末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
非 居 住 者 貸 付	32,260	0.5	78,138	1.3
公社債（円建外債）・その他	1,575,320	24.7	1,404,691	24.0
小 計	1,607,580	25.2	1,482,829	25.4

④合 計

（単位：百万円、％）

区 分	2023年度末		2024年度末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
海 外 投 融 資	6,374,971	100.0	5,845,424	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年度末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
米 ド ル	2,779,553	58.6	2,821,952	65.0
ユ ー ロ	744,208	15.7	760,850	17.5
オーストラリアドル	771,303	16.2	317,522	7.3
イギリスポンド	170,489	3.6	169,686	3.9
カナダドル	74,948	1.6	100,494	2.3
ニュージーランドドル	39,920	0.8	37,679	0.9
インドルピー	25,865	0.5	33,921	0.8
そ の 他 共 計	4,747,199	100.0	4,342,373	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
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
2024年度末	北 米	1,883,260	39.6	1,304,424	41.0	578,836	36.9	131,858	29.3
	ヨ ー ロ ッ パ	1,229,500	25.9	832,595	26.1	396,905	25.3	142,482	31.7
	オ セ ア ニ ア	275,615	5.8	263,745	8.3	11,870	0.8	89,332	19.9
	ア ジ ア	98,004	2.1	52,167	1.6	45,837	2.9	7,403	1.6
	中 南 米	1,123,006	23.6	590,205	18.5	532,801	34.0	73,543	16.3
	中 東	438	0.0	-	-	438	0.0	-	-
	ア フ リ カ	122	0.0	-	-	122	0.0	5,348	1.2
	国 際 機 関	141,754	3.0	141,754	4.5	-	-	-	-
	合 計	4,751,704	100.0	3,184,892	100.0	1,566,811	100.0	449,968	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	△ 67,098	△ 93,395	-	-	-	△ 160,493
ヘッジ会計非適用分	△ 6,058	△ 13,456	△ 7,267	△ 333	752	△ 26,363	△ 7,501	3,519	3,938	38	656	651
合 計	△ 49,285	△ 133,349	△ 7,267	△ 333	752	△ 189,483	△ 74,599	△ 89,876	3,938	38	656	△ 159,841

(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4,442百万円）及び
ヘッジ会計非適用分の差損益（651百万円）の合計5,094百万円

(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	-	-	-	-
	固定金利支払／変動金利受取	10,000	10,000	689	689	10,300	500	4	4
	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	1,140,000 (20,517)	1,010,000 (18,626)	13,011	△ 7,505
合 計					△ 6,058				△ 7,501

(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						
	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
区 分	2024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	-	-	-	-	-	-	-
平均受取固定金利	-	-	-	-	-	-	-
平均支払変動金利	-	-	-	-	-	-	-
円建支払側固定スワップ想定元本	9,800	-	-	-	500	-	10,300
平均支払固定金利	0.31	-	-	-	1.40	-	0.36
平均受取変動金利	0.30	-	-	-	0.48	-	0.31
合 計	9,800	-	-	-	500	-	10,300

②通貨関連

(単位：百万円)

区分	種 類	2023年度末			2024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	609,204	△ 10,055	△ 10,055	599,361	3,703	3,703
	(米ドル)	190,554	△ 3,608	△ 3,608	272,141	3,521	3,521
	(オーストラリアドル)	159,727	△ 2,922	△ 2,922	136,321	2,622	2,622
	(ユーロ)	115,704	△ 1,869	△ 1,869	92,022	△ 1,850	△ 1,850
	(イギリスポンド)	86,747	△ 1,257	△ 1,257	72,582	△ 1,236	△ 1,236
	(カナダドル)	31,355	△ 449	△ 449	24,567	644	644
	(その他)	25,115	52	52	1,725	2	2
	買建	247,154	171	171	80,996	△ 36	△ 36
	(米ドル)	147,589	150	150	35,333	48	48
	(オーストラリアドル)	5,163	34	34	27,933	△ 284	△ 284
	(ユーロ)	42,745	△ 104	△ 104	12,128	172	172
	(イギリスポンド)	23,309	65	65	2,907	9	9
	(カナダドル)	5,434	71	71	1,166	18	18
	(その他)	22,911	△ 45	△ 45	1,528	△ 0	△ 0
	通貨オプション						
	売建						
	ブット	2,943			-		
	(-)		-	-	(-)	-	-
	(その他)	2,943			-		
	(-)		-	-	(-)	-	-
	コール	2,788			10,892		
	(10)		-	10	(7)	0	7
	(オーストラリアドル)	-			9,397		
	(-)		-	-	(1)	0	1
	(米ドル)	-			1,495		
	(-)		-	-	(5)	-	5
	(その他)	2,788			-		
	(10)		-	10	(-)	-	-
	買建						
	ブット	194,510			11,345		
	(3,577)		15	△ 3,562	(29)	0	△ 29
	(ユーロ)	1,632			11,345		
	(14)		12	△ 1	(29)	0	△ 29
	(米ドル)	190,019			-		
	(3,563)		2	△ 3,561	(-)	-	-
	(その他)	2,858			-		
	(-)		-	-	(-)	-	-
	コール	5,177			38,433		
	(43)		22	△ 20	(128)	2	△ 125
	(オーストラリアドル)	-			24,432		
	(-)		-	-	(87)	0	△ 86
	(米ドル)	757			13,561		
	(13)		22	8	(38)	2	△ 36
	(その他)	4,420			439		
	(29)		0	△ 29	(2)	0	△ 2
合 計				△ 13,456			3,519

- (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	-	-	-	24,924	925	925
	円建株価指数オプション 買建 ブット	458,503 (10,083)	3,193	△ 6,890	390,357 (13,831)	16,860	3,029
	外貨建株価指数オプション 買建 ブット	20,883 (429)	53	△ 376	- (-)	-	-
店頭	マルチアセット指数オプション 買建 コール	- (-)	-	-	4,345 (23)	7	△ 15
合 計				△ 7,267			3,938

(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	18,477 37,061	△ 18 83	△ 18 83
店頭	外貨建債券先渡契約 売建 買建	13,967 22,284	5 62	5 62	- -	- -	- -
	円建債券店頭オプション 売建 コール	74,630 (88)	351	△ 262	81,787 (128)	105	23
	ブット	- (-)	-	-	486 (1)	0	0
	買建 コール	- (-)	-	-	486 (0)	1	0
	ブット	74,630 (117)	301	184	81,787 (163)	112	△ 50
	合 計			△ 333			38

(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	90,900	20,200	656
合 計				752			656

(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	△ 253	△ 253
	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	△ 68,949	△ 68,949
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	-	4	4
	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	64,000	2,100	2,100
合 計						△ 43,226				△ 67,098

(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						
	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
区 分	2024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	2,300	10,600	-	-	300,000	400,000	712,900
平均受取固定金利	1.19	0.10	-	-	0.36	0.55	0.46
平均支払変動金利	0.82	0.50	-	-	0.49	0.53	0.51
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	0.43	0.44	-	-	-	-	0.44
合 計	183,300	74,600	-	-	300,000	400,000	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	871,775	811,577	△ 97,838	△ 97,838
	(米ドル)		550,187	537,205	△ 61,534	△ 61,534	661,004	607,083	△ 70,246	△ 70,246
	(ユーロ)		172,839	155,150	△ 23,294	△ 23,294	168,673	162,396	△ 23,073	△ 23,073
	(イギリスポンド)		27,215	27,215	△ 3,652	△ 3,652	26,579	26,579	△ 4,516	△ 4,516
	(カナダドル)		4,360	4,360	△ 181	△ 181	13,099	13,099	△ 23	△ 23
	(オーストラリアドル)		950	950	△ 63	△ 63	2,418	2,418	22	22
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	779,716	-	3,916	3,916
	(米ドル)		549,072	-	△ 16,172	△ 16,172	456,787	-	5,370	5,370
	(ユーロ)		136,283	-	△ 5,461	△ 5,461	173,680	-	△ 1,914	△ 1,914
	(オーストラリアドル)		425,188	-	△ 8,780	△ 8,780	69,440	-	536	536
	(カナダドル)		1,834	-	△ 25	△ 25	30,946	-	684	684
	(イギリスポンド)		11,521	-	△ 286	△ 286	11,354	-	△ 420	△ 420
	(その他)		15,715	-	△ 446	△ 446	37,506	-	△ 339	△ 339
	買建		573	-	7	7	11,890	-	525	525
	(米ドル)		417	-	5	5	13	-	△ 0	△ 0
	(ユーロ)		30	-	0	0	13	-	0	0
	(オーストラリアドル)		29	-	△ 0	△ 0	-	-	-	-
	(イギリスポンド)		7	-	0	0	-	-	-	-
	(その他)		89	-	0	0	11,864	-	525	525
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	-	-	-	10,009	-	-	-
	(米ドル)		10,001	-	-	-	10,009	-	-	-
	通貨スワップ	外貨建社債(負債)	368,715	260,550	-	-	576,780	576,780	-	-
	(米ドル)		368,715	260,550	-	-	576,780	576,780	-	-
	通貨スワップ	外貨建貸付金	10,260	10,260	-	-	10,260	10,260	-	-
(米ドル)	10,260		10,260	-	-	10,260	10,260	-	-	
合 計					△ 119,893				△ 93,395	

(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を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年度末ともに期末残高がないため、記載していません。