

2025年度第2四半期（上半期）報告補足資料

※資料中、「第2四半期（上半期）」は「4月1日～9月30日」を表しております。

1. 有価証券関係（一般勘定）		
(1) 有価証券明細表		1 頁
(2) 有価証券残存期間別残高		1 頁
(3) 業種別国内株式保有明細表		2 頁
2. 貸付金関係（一般勘定）		
(1) 貸付金残存期間別残高		3 頁
(2) 貸付金企業規模別内訳		3 頁
(3) 貸付金担保別内訳		3 頁
(4) 貸付金業種別内訳		4 頁
3. 海外投融資関係（一般勘定）		
(1) 資産別明細		5 頁
(2) 外貨建資産の通貨別構成		5 頁
(3) 海外投融資の地域別構成		6 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		7 頁
(2) 時価情報（ヘッジ会計非適用分）		7 頁
(3) 時価情報（ヘッジ会計適用分）		10 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	2024年度末		2025年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
国 債	16,428,904	59.4	16,307,889	58.2
地 方 債	121,949	0.4	123,026	0.4
社 債	1,798,040	6.5	1,785,451	6.4
うち公社・公団債	353,864	1.3	358,111	1.3
株 式	3,323,680	12.0	3,570,922	12.7
外 国 証 券	4,751,704	17.2	4,772,702	17.0
公 社 債	3,184,892	11.5	3,113,392	11.1
株 式 等	1,566,811	5.7	1,659,309	5.9
そ の 他 の 証 券	1,210,758	4.4	1,467,926	5.2
合 計	27,635,037	100.0	28,027,919	100.0

（2）有価証券残存期間別残高

（単位：百万円）

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

区 分		2025年度第2四半期(上半期)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		441,781	1,340,823	1,860,610	1,544,516	2,180,463	20,659,723	28,027,919
	国 債	130,096	354,791	476,264	711,489	1,136,347	13,498,901	16,307,889
	地 方 債	16,088	4,397	2	277	3,599	98,660	123,026
	社 債	92,012	204,869	251,289	135,303	123,928	978,047	1,785,451
	株 式	-	-	-	-	-	3,570,922	3,570,922
	外 国 証 券	175,208	386,562	650,945	562,665	657,667	2,339,652	4,772,702
	公 社 債	135,365	326,828	504,335	311,375	592,491	1,242,996	3,113,392
	株 式 等	39,843	59,734	146,609	251,290	65,175	1,096,656	1,659,309
そ の 他 の 証 券	28,375	390,203	482,108	134,780	258,920	173,539	1,467,926	
買 入 金 銭 債 権	9,629	17,416	21,276	6,692	6,304	110,629	171,949	
譲 渡 性 預 金	140,996	-	-	-	-	-	140,996	
そ の 他	-	-	-	-	-	2,979	2,979	

（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		2024年度末		2025年度 第2四半期(上半期)末	
		金 額	占 率	金 額	占 率
水 産 ・ 農 林 業		176	0.0	185	0.0
鉱 業		200	0.0	697	0.0
建 設 業		130,775	3.9	141,599	4.0
製 造 業	食 料 品	207,818	6.3	201,910	5.7
	繊 維 製 品	17,797	0.5	18,354	0.5
	パ ル プ ・ 紙	1,617	0.0	1,932	0.1
	化 学	164,338	4.9	166,695	4.7
	医 薬 品	66,541	2.0	64,723	1.8
	石 油 ・ 石 炭 製 品	4,189	0.1	2,582	0.1
	ゴ ム 製 品	19,150	0.6	25,019	0.7
	ガ ラ ス ・ 土 石 製 品	140,404	4.2	161,334	4.5
	鉄 鋼	27,283	0.8	27,382	0.8
	非 鉄 金 属	22,757	0.7	42,765	1.2
	金 属 製 品	54,257	1.6	53,798	1.5
	機 械	203,364	6.1	234,406	6.6
	電 気 機 器	715,279	21.5	832,480	23.3
	輸 送 用 機 器	192,402	5.8	196,747	5.5
	精 密 機 器	184,343	5.5	137,678	3.9
	そ の 他 製 品	95,159	2.9	117,332	3.3
電 気 ・ ガ ス 業		46,336	1.4	51,084	1.4
運 輸 ・ 情 報 通 信 業	陸 運 業	112,748	3.4	121,661	3.4
	海 運 業	-	-	156	0.0
	空 運 業	2,303	0.1	1,640	0.0
	倉 庫 ・ 運 輸 関 連 業	2,565	0.1	3,090	0.1
	情 報 ・ 通 信 業	106,547	3.2	82,351	2.3
商 業	卸 売 業	184,603	5.6	211,775	5.9
	小 売 業	106,589	3.2	101,509	2.8
金 融 ・ 保 険 業	銀 行 業	266,640	8.0	314,564	8.8
	証 券、商 品 先 物 取 引 業	639	0.0	567	0.0
	保 険 業	8,473	0.3	37,514	1.1
	そ の 他 金 融 業	28,139	0.8	28,515	0.8
不 動 産 業		18,294	0.6	22,124	0.6
サ ー ビ ス 業		191,940	5.8	166,737	4.7
合 計		3,323,680	100.0	3,570,922	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
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
2025年度 第2四半期 (上半期)末	変 動 金 利	54,041	116,291	131,999	36,264	94,422	478,458	911,478
	固 定 金 利	535,512	448,583	230,035	119,579	214,607	682,439	2,230,757
	一般貸付計	589,554	564,875	362,035	155,843	309,029	1,160,898	3,142,236

（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		2024年度末		2025年度 第2四半期(上半期)末	
			占 率		占 率
大 企 業	貸付先数	193	59.9	186	61.0
	金 額	2,076,538	83.3	2,040,702	83.7
中 堅 企 業	貸付先数	6	1.9	4	1.3
	金 額	4,520	0.2	2,596	0.1
中 小 企 業	貸付先数	123	38.2	115	37.7
	金 額	412,734	16.6	394,292	16.2
国内企業向け 貸付計	貸付先数	322	100.0	305	100.0
	金 額	2,493,793	100.0	2,437,591	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		資本金3億円超 10億円未満		資本金5千万円超 10億円未満		資本金5千万円超 10億円未満		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		2024年度末		2025年度 第2四半期(上半期)末	
		金 額	占 率	金 額	占 率
担 保 貸 付		2,799	0.1	2,649	0.1
	有 価 証 券 付	1,591	0.0	1,621	0.1
	不 動 産 ・ 動 産 ・ 財 団 担 保 貸 付	1,207	0.0	1,028	0.0
	指 名 債 権 付 担 保 貸 付	-	-	-	-
保 証 貸 付		138,096	4.3	134,581	4.3
信 用 貸 付		3,064,036	95.6	3,005,004	95.6
そ の 他		-	-	-	-
一 般 貸 付 計		3,204,932	100.0	3,142,236	100.0
	うち劣後特約付 貸	572,490	17.9	568,292	18.1

（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		2024年度末		2025年度 第2四半期(上半期)末	
		金 額	占 率	金 額	占 率
国内向け	製 造 業	177,409	5.5	161,763	5.1
	食 料	29,960	0.9	28,828	0.9
	繊 維	572	0.0	471	0.0
	木 材 ・ 木 製 品	-	-	-	-
	パ ル プ ・ 紙	2,546	0.1	2,421	0.1
	印 刷	12,500	0.4	11,250	0.4
	化 学	20,562	0.6	20,174	0.6
	石 油 ・ 石 炭	500	0.0	500	0.0
	窯 業 ・ 土 石	15,261	0.5	15,090	0.5
	鉄 鋼	31,632	1.0	31,611	1.0
	非 鉄 金 属	6,820	0.2	3,546	0.1
	金 属 製 品	700	0.0	820	0.0
	はん用・生産用・業務用機械	27,076	0.8	23,598	0.8
	電 気 機 械	14,586	0.5	12,598	0.4
	輸 送 用 機 械	8,432	0.3	6,854	0.2
	そ の 他 の 製 造 業	6,259	0.2	3,999	0.1
	農 業 、 林 業	-	-	-	-
	漁 業	-	-	-	-
	鉱 業 、 採 石 業 、 砂 利 採 取 業	-	-	-	-
	建 設 業	14,656	0.5	13,726	0.4
	電 気 ・ ガ ス ・ 熱 供 給 ・ 水 道 業	565,305	17.6	564,369	18.0
	情 報 通 信 業	45,785	1.4	38,721	1.2
	運 輸 業 、 郵 便 業	217,720	6.8	217,869	6.9
	卸 売 業	154,799	4.8	145,386	4.6
	小 売 業	8,877	0.3	8,884	0.3
	金 融 業 、 保 険 業	1,312,568	41.0	1,298,528	41.3
	不 動 産 業	155,545	4.9	149,086	4.7
	物 品 賃 貸 業	80,987	2.5	79,499	2.5
	学術研究、専門・技術サービス業	6,125	0.2	6,018	0.2
	宿 泊 業	-	-	-	-
	飲 食 業	-	-	-	-
	生活関連サービス業・娯楽業	4,082	0.1	3,923	0.1
	教 育 、 学 習 支 援 業	-	-	-	-
	医 療 ・ 福 祉	2,679	0.1	2,646	0.1
	そ の 他 の サ ー ビ ス	1,135	0.0	375	0.0
	地 方 公 共 団 体	7,285	0.2	6,105	0.2
	個 人 (住 宅 ・ 消 費 ・ 納 税 資 金 等)	-	-	-	-
	そ の 他	-	-	-	-
	合 計	2,754,963	86.0	2,696,903	85.8
海外向け	政 府 等	5,348	0.2	5,234	0.2
	金 融 機 関	-	-	-	-
	商 工 業 等	444,620	13.9	440,098	14.0
	合 計	449,968	14.0	445,332	14.2
一 般 貸 付 計		3,204,932	100.0	3,142,236	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	2024年度末		2025年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
公 社 債	2,476,364	42.4	2,418,784	41.3
株 式	1,259,168	21.5	1,339,535	22.9
現 預 金 ・ そ の 他	606,841	10.4	568,040	9.7
小 計	4,342,373	74.3	4,326,360	73.9

②円貨額が確定した外貨建資産

（単位：百万円、％）

区 分	2024年度末		2025年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
公 社 債	-	-	-	-
現 預 金 ・ そ の 他	20,220	0.3	20,239	0.3
小 計	20,220	0.3	20,239	0.3

③円貨建資産

（単位：百万円、％）

区 分	2024年度末		2025年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
非 居 住 者 貸 付	78,138	1.3	77,730	1.3
公社債（円建外債）・その他	1,404,691	24.0	1,427,718	24.4
小 計	1,482,829	25.4	1,505,449	25.7

④合 計

（単位：百万円、％）

区 分	2024年度末		2025年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
海 外 投 融 資	5,845,424	100.0	5,852,049	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	2024年度末		2025年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
米 ド ル	2,821,952	65.0	2,808,799	64.9
ユ ー ロ	760,850	17.5	872,017	20.2
オーストラリアドル	317,522	7.3	257,304	5.9
イギリスポンド	169,686	3.9	138,575	3.2
カナダドル	100,494	2.3	94,521	2.2
インドルピー	33,921	0.8	36,423	0.8
ニュージーランドドル	37,679	0.9	29,842	0.7
そ の 他 共 計	4,342,373	100.0	4,326,360	100.0

(3) 海外投融資の地域別構成

(単位：百万円、%)

区 分	2024年度末							
	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
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
区 分	2025年度第2四半期(上半期)末							
	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
北 米	1,877,866	39.3	1,232,663	39.6	645,202	38.9	139,809	31.4
ヨ ー ロ ッ パ	1,259,833	26.4	868,487	27.9	391,345	23.6	140,276	31.5
オ セ ア ニ ア	225,673	4.7	213,955	6.9	11,717	0.7	80,342	18.0
ア ジ ア	83,305	1.7	40,653	1.3	42,651	2.6	7,242	1.6
中 南 米	1,179,963	24.7	612,440	19.7	567,523	34.2	72,426	16.3
中 東	392	0.0	-	-	392	0.0	-	-
ア フ リ カ	476	0.0	-	-	476	0.0	5,234	1.2
国 際 機 関	145,191	3.0	145,191	4.7	-	-	-	-
合 計	4,772,702	100.0	3,113,392	100.0	1,659,309	100.0	445,332	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	2024年度末						2025年度第2四半期(上半期)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	△ 67,098	△ 93,395	-	-	-	△ 160,493	△ 76,479	△ 125,395	-	-	-	△ 201,875
ヘッジ会計非適用分	△ 7,501	3,519	3,938	38	656	651	△ 4,296	△ 8,288	△ 8,263	△ 132	421	△ 20,559
合 計	△ 74,599	△ 89,876	3,938	38	656	△ 159,841	△ 80,776	△ 133,683	△ 8,263	△ 132	421	△ 222,435

(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。
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
2025年度第2四半期(上半期)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△11,587百万円）及び
ヘッジ会計非適用分の差損益（△20,559百万円）の合計△32,147百万円

(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	2024年度末				2025年度第2四半期(上半期)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	-	-	-	-	33,370	33,370	△ 155	△ 155
	固定金利支払／変動金利受取	10,300	500	4	4	28,000	28,000	359	359
	円建金利スワップション								
	売建								
	固定金利支払／変動金利受取	-	-			430,000	-		
		(-)	(-)	-	-	(242)	(-)	360	△ 118
	買建								
	固定金利支払／変動金利受取	1,140,000	1,010,000			1,295,000	255,000		
		(20,517)	(18,626)	13,011	△ 7,505	(19,394)	(5,305)	15,011	△ 4,383
合 計					△ 7,501				△ 4,296

(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	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
区 分	2025年度第2四半期(上半期)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	-	30,200	-	-	3,170	-	33,370
平均受取固定金利	-	0.75	-	-	1.26	-	0.80
平均支払変動金利	-	0.48	-	-	0.48	-	0.48
円建支払側固定スワップ想定元本	-	-	18,500	-	500	9,000	28,000
平均支払固定金利	-	-	0.94	-	1.40	2.03	1.30
平均受取変動金利	-	-	0.48	-	0.48	0.48	0.48
合 計	-	30,200	18,500	-	3,670	9,000	61,370

②通貨関連

(単位：百万円)

区分	種 類	2024年度末			2025年度第2四半期(上半期)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	599,361	3,703	3,703	961,538	△ 7,834	△ 7,834
	(米ドル)	272,141	3,521	3,521	515,975	△ 3,601	△ 3,601
	(ユーロ)	92,022	△ 1,850	△ 1,850	138,142	△ 1,111	△ 1,111
	(イギリスポンド)	72,582	△ 1,236	△ 1,236	117,328	△ 144	△ 144
	(オーストラリアドル)	136,321	2,622	2,622	108,400	△ 3,100	△ 3,100
	(カナダドル)	24,567	644	644	36,106	46	46
	(その他)	1,725	2	2	45,584	76	76
	買建	80,996	△ 36	△ 36	486,368	468	468
	(米ドル)	35,333	48	48	171,738	480	480
	(ユーロ)	12,128	172	172	123,367	500	500
	(オーストラリアドル)	27,933	△ 284	△ 284	56,477	21	21
	(イギリスポンド)	2,907	9	9	37,661	△ 65	△ 65
	(カナダドル)	1,166	18	18	14,421	△ 5	△ 5
	(その他)	1,528	△ 0	△ 0	82,702	△ 462	△ 462
	通貨オプション						
	売建						
	プット	-			69,019		
	(米ドル)	(-)	-	-	(20)	27	△ 7
	(カナダドル)	(-)	-	-	(20)	27	△ 7
	(その他)	-	-	-	(-)	-	-
	コール	10,892			199,871		
	(米ドル)	(7)	0	7	(1,434)	936	498
	(ユーロ)	1,495	-	5	132,875	881	311
	(オーストラリアドル)	(5)	-	-	61,238	55	180
	(その他)	(-)	-	-	(235)	0	6
	買建	9,397	0	1	1,468		
	プット	(1)	0	1	(6)	0	6
	(米ドル)	-	-	-	4,288	-	-
	(カナダドル)	(-)	-	-	(-)	-	-
	(オーストラリアドル)	-	-	-	-	-	-
	(イギリスポンド)	-	-	-	-	-	-
	(ユーロ)	-	-	-	-	-	-
	(その他)	-	-	-	-	-	-
	コール	11,345			180,615		
	プット	(29)	0	△ 29	(1,408)	140	△ 1,267
	(米ドル)	-	-	-	163,243	139	△ 1,253
	(カナダドル)	(-)	-	-	(1,393)	-	-
	(オーストラリアドル)	-	-	-	10,648	-	-
	(イギリスポンド)	(-)	-	-	(9)	0	△ 9
	(ユーロ)	-	-	-	799	0	△ 4
	(その他)	(-)	-	-	(4)	-	-
	コール	11,345			-		
	プット	(29)	0	△ 29	(-)	-	-
	(米ドル)	-	-	-	539	-	-
	(カナダドル)	(-)	-	-	(-)	-	-
	(オーストラリアドル)	-	-	-	-	-	-
	(イギリスポンド)	-	-	-	-	-	-
	(ユーロ)	-	-	-	-	-	-
	(その他)	-	-	-	-	-	-
	コール	38,433			74,187		
	(ユーロ)	(128)	2	△ 125	(715)	570	△ 145
	(オーストラリアドル)	-	-	-	61,238	561	△ 124
	(イギリスポンド)	(-)	-	-	(686)	6	△ 17
	(ユーロ)	24,432	0	△ 86	1,957	-	-
	(米ドル)	(87)	0	△ 86	(23)	-	-
	(カナダドル)	13,561	2	△ 36	774	-	-
	(イギリスポンド)	(38)	2	△ 36	(-)	-	-
	(ユーロ)	439	0	△ 2	10,216	1	△ 3
	(その他)	(2)	0	△ 2	(5)	-	-
	合 計			3,519			△ 8,288

- (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	2024年度末			2025年度第2四半期(上半期)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	-	-	-
	買建	-	-	-	48,332	240	240
	外貨建株価指数先物 買建	-	-	-	35,378	327	327
	円建株価指数オプション 買建 ブット	390,357 (13,831)	16,860	3,029	224,999 (10,971)	2,068	△ 8,902
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	14,169 (76)	147	71
合 計				3,938			△ 8,263

(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	2024年度末			2025年度第2四半期(上半期)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	-	-	-	53,389	430	430
	外貨建債券先物 売建	18,477	△ 18	△ 18	89,882	△ 810	△ 810
	買建	37,061	83	83	159,854	△ 85	△ 85
店頭	円建債券店頭オプション 売建						
	コール	81,787 (128)	105	23	88,870 (167)	29	137
	ブット	486 (1)	0	0	8,816 (71)	16	55
	買建						
	コール	486 (0)	1	0	8,816 (58)	59	1
	ブット	81,787 (163)	112	△ 50	88,870 (204)	342	138
合 計				38			△ 132

(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。

⑤その他

(単位：百万円)

区分	種 類	2024年度末				2025年度第2四半期(上半期)末			
		契約額等	うち1年超		時価	差損益	契約額等	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	90,900	20,200		656	656	83,000	19,200	421
合 計						656			421

(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	2024年度末				2025年度第2四半期 (上半期) 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	△ 253	△ 253	10,600	10,600	△ 232	△ 232
	固定金利受取／変動金利支払	保険負債	700,000	700,000	△ 68,949	△ 68,949	700,000	700,000	△ 78,143	△ 78,143
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	-	4	4	2,300	-	2	2
	固定金利支払／変動金利受取	借入金	245,000	64,000	2,100	2,100	245,000	64,000	1,893	1,893
合 計						△ 67,098				△ 76,479

(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	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
区 分	2025年度第2四半期 (上半期) 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	-	-	320,000	380,000	712,900
平均受取固定金利	1.19	0.10	-	-	0.34	0.57	0.46
平均支払変動金利	0.80	0.50	-	-	0.54	0.54	0.54
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	0.86	0.87	-	-	-	-	0.86
合 計	183,300	74,600	-	-	320,000	380,000	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	2024年度末				2025年度第2四半期(上半期)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	871,775	811,577	△ 97,838	△ 97,838	879,074	791,474	△ 113,808	△ 113,808
	(米ドル)		661,004	607,083	△ 70,246	△ 70,246	668,746	593,620	△ 69,331	△ 69,331
	(ユーロ)		168,673	162,396	△ 23,073	△ 23,073	168,562	156,088	△ 38,190	△ 38,190
	(イギリスポンド)		26,579	26,579	△ 4,516	△ 4,516	26,247	26,247	△ 5,841	△ 5,841
	(カナダドル)		13,099	13,099	△ 23	△ 23	13,099	13,099	△ 345	△ 345
	(オーストラリアドル)		2,418	2,418	22	22	2,418	2,418	△ 98	△ 98
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		779,716	-	3,916	3,916	776,153	-	△ 11,587	△ 11,587
	(米ドル)		456,787	-	5,370	5,370	443,702	-	△ 6,498	△ 6,498
	(ユーロ)		173,680	-	△ 1,914	△ 1,914	195,592	-	△ 3,116	△ 3,116
	(オーストラリアドル)		69,440	-	536	536	68,979	-	△ 1,505	△ 1,505
	(カナダドル)		30,946	-	684	684	30,730	-	120	120
	(イギリスポンド)		11,354	-	△ 420	△ 420	11,170	-	△ 309	△ 309
	(その他)		37,506	-	△ 339	△ 339	25,976	-	△ 278	△ 278
	買建		11,890	-	525	525	26	-	0	0
	(米ドル)		13	-	△ 0	△ 0	23	-	0	0
	(ユーロ)		13	-	0	0	1	-	0	0
	(オーストラリアドル)		-	-	-	-	0	-	0	0
	(その他)		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	10,009	-	-	-	10,005	-	-	-
	売建		10,009	-	-	-	10,005	-	-	-
	(米ドル)	外貨建社債(負債)	576,780	576,780	-	-	576,780	316,230	-	-
	通貨スワップ		576,780	576,780	-	-	576,780	316,230	-	-
	(米ドル)	外貨建貸付金	10,260	10,260	-	-	10,260	10,260	-	-
	通貨スワップ		10,260	10,260	-	-	10,260	10,260	-	-
合 計						△ 93,395				△ 125,395

(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

2024年度末、2025年度第2四半期（上半期）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

2024年度末、2025年度第2四半期（上半期）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

2024年度末、2025年度第2四半期（上半期）末ともに期末残高がないため、記載していません。