

2021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	.....	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	2020年度末		2021年度末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
国 債	14,672,138	45.1	15,469,602	48.8
地 方 債	107,735	0.3	106,012	0.3
社 債	1,960,238	6.0	1,827,166	5.8
うち公社・公団債	393,526	1.2	386,821	1.2
株 式	3,569,109	11.0	3,292,713	10.4
外 国 証 券	11,402,677	35.1	10,143,485	32.0
公 社 債	9,811,240	30.2	8,620,159	27.2
株 式 等	1,591,436	4.9	1,523,325	4.8
そ の 他 の 証 券	818,392	2.5	858,702	2.7
合 計	32,530,293	100.0	31,697,684	100.0

(2) 有価証券残存期間別残高

(単位：百万円)

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	
区 分	2021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	400,142	1,165,600	2,561,824	1,689,698	3,011,504	22,868,914	31,697,684	
国 債	1,764	220,014	648,700	486,786	1,695,678	12,416,657	15,469,602	
地 方 債	1,595	3,327	18,949	2,906	201	79,032	106,012	
社 債	79,833	194,914	306,617	141,107	127,312	977,381	1,827,166	
株 式	-	-	-	-	-	3,292,713	3,292,713	
外 国 証 券	315,734	718,489	1,345,338	1,006,587	861,563	5,895,770	10,143,485	
公 社 債	310,447	708,595	1,290,592	914,054	724,984	4,671,486	8,620,159	
株 式 等	5,287	9,894	54,746	92,533	136,578	1,224,284	1,523,325	
そ の 他 の 証 券	1,213	28,854	242,217	52,310	326,748	207,358	858,702	
買 入 金 銭 債 権	3,358	5,650	42,053	6,413	7,791	174,627	239,896	
譲 渡 性 預 金	82,997	-	-	-	-	-	82,997	
そ の 他	-	-	-	-	-	12,164	12,164	

(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		2020年度末		2021年度末	
		金 額	占 率	金 額	占 率
水 産 ・ 農 林 業		266	0.0	253	0.0
鉱 業		200	0.0	200	0.0
建 設 業		119,215	3.3	106,940	3.2
製 造 業	食 料 品	184,173	5.2	193,957	5.9
	織 維 製 品	23,338	0.7	19,699	0.6
	パ ル プ ・ 紙	3,830	0.1	2,935	0.1
	化 学	212,174	5.9	172,474	5.2
	医 薬 品	87,967	2.5	74,608	2.3
	石 油 ・ 石 炭 製 品	3,324	0.1	3,357	0.1
	ゴ ム 製 品	15,100	0.4	15,131	0.5
	ガ ラ ス ・ 土 石 製 品	108,791	3.0	97,476	3.0
	鉄 鋼	36,139	1.0	44,293	1.3
	非 鉄 金 属	13,969	0.4	11,202	0.3
	金 属 製 品	48,079	1.3	32,942	1.0
	機 械	249,106	7.0	228,622	6.9
	電 気 機 器	731,687	20.5	734,986	22.3
	輸 送 用 機 器	190,618	5.3	186,635	5.7
	精 密 機 器	168,390	4.7	151,965	4.6
	そ の 他 製 品	68,351	1.9	75,665	2.3
電 気 ・ ガ ス 業		67,031	1.9	38,835	1.2
運 輸 ・ 情 報 通 信 業	陸 運 業	278,117	7.8	203,888	6.2
	海 運 業	51	0.0	29	0.0
	空 運 業	3,113	0.1	2,963	0.1
	倉 庫 ・ 運 輸 関 連 業	4,617	0.1	4,390	0.1
	情 報 ・ 通 信 業	83,762	2.3	91,986	2.8
商 業	卸 売 業	142,684	4.0	139,254	4.2
	小 売 業	120,546	3.4	114,287	3.5
金 融 ・ 保 険 業	銀 行 業	207,608	5.8	156,537	4.8
	証 券、商 品 先 物 取 引 業	1,786	0.1	1,266	0.0
	保 険 業	4,325	0.1	4,682	0.1
	そ の 他 金 融 業	29,575	0.8	26,304	0.8
不 動 産 業		18,737	0.5	16,760	0.5
サ ー ビ ス 業		342,425	9.6	338,176	10.3
合 計		3,569,109	100.0	3,292,713	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
	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
2021年度末							
変動金利	19,772	49,016	29,451	29,680	20,297	341,605	489,825
固定金利	326,399	339,132	394,564	202,637	181,428	365,696	1,809,860
一般貸付計	346,171	388,148	424,015	232,317	201,725	707,301	2,299,685

### （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		2020年度末		2021年度末		
		金額	占 率	金額	占 率	
大 企 業	貸付先数	209	62.8	205	60.1	
	金 額	1,688,707	83.6	1,625,276	81.9	
中 堅 企 業	貸付先数	7	2.1	7	2.1	
	金 額	4,103	0.2	4,477	0.2	
中 小 企 業	貸付先数	117	35.1	129	37.8	
	金 額	326,916	16.2	354,972	17.9	
国内企業向け 貸付計		貸付先数 金 額	333 2,019,726	100.0 100.0	341 1,984,726	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
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	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	50名超 かつ	資本金5千万円以下又は 常用する従業員100名以下	100名超 かつ	資本金1億円以下又は 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	2020年度末		2021年度末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
担 保 貸 付	2,546	0.1	2,360	0.1
有価証券担保貸付	1,130	0.0	1,354	0.1
不動産・動産・ 財団担保貸付	1,415	0.1	1,006	0.0
指名債権担保貸付	-	-	-	-
保 証 貸 付	99,406	4.4	90,063	3.9
信 用 貸 付	2,182,031	95.5	2,207,261	96.0
そ の 他	-	-	-	-
一 般 貸 付 計	2,283,983	100.0	2,299,685	100.0
うち劣後特約付 貸	241,551	10.6	222,562	9.7

（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	2020年度末		2021年度末		
	金 額	占 率	金 額	占 率	
製 造 業	食 料	270,245	11.8	248,359	10.8
	織 維	43,049	1.9	34,113	1.5
	木 材 ・ 木 製 品	1,824	0.1	1,710	0.1
	パ ル プ ・ 紙	500	0.0	500	0.0
	印 刷	10,600	0.5	11,600	0.5
	化 学	22,500	1.0	20,000	0.9
	石 油 ・ 石 炭	27,865	1.2	35,740	1.6
	窯 業 ・ 土 石	7,860	0.3	3,680	0.2
	鉄 鋼	18,791	0.8	18,678	0.8
	非 鉄 金 属	66,245	2.9	53,243	2.3
	金 属 製 品	3,985	0.2	3,397	0.1
	はん用・生産用・業務用機械	964	0.0	957	0.0
	電 気 機 械	22,495	1.0	23,105	1.0
	輸 送 用 機 械	15,273	0.7	14,396	0.6
	そ の 他 の 製 造 業	19,173	0.8	17,707	0.8
国 内 向 け	農 業 、 林 業	9,116	0.4	9,531	0.4
	漁 業	-	-	-	-
	鉱 業 、 採 石 業 、 砂 利 採 取 業	-	-	-	-
	建 設 業	-	-	-	-
	電 気 ・ ガ ス ・ 熱 供 給 ・ 水 道 業	14,077	0.6	14,515	0.6
	情 報 通 信 業	452,713	19.8	461,963	20.1
	運 輸 業 、 郵 便 業	61,006	2.7	65,798	2.9
	卸 売 業	250,994	11.0	246,048	10.7
	小 売 業	303,944	13.3	270,789	11.8
	金 融 業 、 保 険 業	11,557	0.5	9,999	0.4
	不 動 産 業	596,675	26.1	587,693	25.6
	物 品 賃 貸 業	135,914	6.0	142,348	6.2
	学 術 研 究 、 専 門 ・ 技 術 サ ー ビ ス 業	93,647	4.1	94,500	4.1
	宿 泊 業	500	0.0	4,450	0.2
	飲 食 業	-	-	-	-
	生 活 関 連 サ ー ビ ス 業 ・ 娯 楽 業	-	-	-	-
	教 育 、 学 習 支 援 業	3,477	0.2	8,822	0.4
	医 療 ・ 福 祉	-	-	-	-
	そ の 他 の サ ー ビ ス	4,715	0.2	1,000	0.0
	地 方 公 共 団 体	2,313	0.1	3,607	0.2
個 人 ( 住 宅 ・ 消 費 ・ 納 税 資 金 等 )	16,727	0.7	14,367	0.6	
そ の 他	-	-	-	-	
合 計	2,218,510	97.1	2,174,266	94.5	
海 外 向 け	政 府 等	4,218	0.2	4,600	0.2
	金 融 機 関	-	-	-	-
	商 工 業 等	61,255	2.7	120,819	5.3
合 計	65,473	2.9	125,419	5.5	
一 般 貸 付 計	2,283,983	100.0	2,299,685	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	2020年度末		2021年度末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
公 社 債	9,017,236	74.1	7,915,570	71.4
株 式	1,196,647	9.8	1,247,213	11.2
現 預 金 ・ そ の 他	214,984	1.8	358,127	3.2
小 計	10,428,868	85.7	9,520,911	85.8

②円貨額が確定した外貨建資産 (単位：百万円、%)

区 分	2020年度末		2021年度末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
公 社 債	-	-	-	-
現 預 金 ・ そ の 他	272,336	2.2	249,723	2.3
小 計	272,336	2.2	249,723	2.3

③円貨建資産 (単位：百万円、%)

区 分	2020年度末		2021年度末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
非 居 住 者 貸 付	25,948	0.2	32,479	0.3
公 社 債 (円建外債) ・ そ の 他	1,437,739	11.8	1,289,699	11.6
小 計	1,463,688	12.0	1,322,179	11.9

④合 計 (単位：百万円、%)

区 分	2020年度末		2021年度末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
海 外 投 融 資	12,164,893	100.0	11,092,814	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	2020年度末		2021年度末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
米 ド ル	5,085,454	48.8	4,767,764	50.1
ユ ー ロ	2,255,928	21.6	2,043,939	21.5
オーストラリアドル	1,226,547	11.8	1,164,665	12.2
カナダドル	434,031	4.2	511,586	5.4
イギリスポンド	331,737	3.2	323,165	3.4
中 国 元	301,325	2.9	233,784	2.5
スウェーデンクローナ	109,077	1.0	103,097	1.1
そ の 他 共 計	10,428,868	100.0	9,520,911	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	
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
2021 年度末	北 米	4,295,205	42.3	3,655,019	42.4	640,186	42.0	17,033	13.6
	ヨーロッパ	2,997,139	29.5	2,582,955	30.0	414,183	27.2	40,033	31.9
	オセアニア	930,971	9.2	900,036	10.4	30,935	2.0	42,960	34.3
	アジア	433,859	4.3	330,364	3.8	103,495	6.8	8,006	6.4
	中南米	1,273,940	12.6	939,677	10.9	334,263	21.9	17,385	13.9
	中 東	261	0.0	-	-	261	0.0	-	-
	アフリカ	-	-	-	-	-	-	-	-
	国際機関	212,106	2.1	212,106	2.5	-	-	-	-
	合 計	10,143,485	100.0	8,620,159	100.0	1,523,325	100.0	125,419	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	2020年度末						2021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	18,451	△ 314,225	-	-	-	△ 295,773	68	△ 477,894	-	-	-	△ 477,826
ヘッジ会計非適用分	△ 13,205	△ 7,702	△ 1,028	2,458	39	△ 19,438	16,630	△ 15,307	△ 10,220	△ 3,224	130	△ 11,991
合 計	5,245	△ 321,927	△ 1,028	2,458	39	△ 315,212	16,699	△ 493,202	△ 10,220	△ 3,224	130	△ 489,817

（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。

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

2021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△464,255百万円）及び

ヘッジ会計非適用分の差損益（△11,991百万円）の合計△476,246百万円

##### （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	2020年度末				2021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	510	510	10,150	10,150	163	163
	固定金利支払／変動金利受取	17,600	17,600	△ 217	△ 217	10,000	10,000	△ 163	△ 163
	円建金利スワップション								
	売建								
	固定金利受取／変動金利支払	20,000	-			-	-		
		(236)	(-)	13	222	(-)	(-)	-	-
	買建								
固定金利受取／変動金利支払	480,000	10,000	1,724	△ 10,575	-	-	-	-	
	(12,300)	(70)			(-)	(-)			
固定金利支払／変動金利受取	1,895,000	1,095,000	6,072	△ 3,143	1,340,000	1,030,000	24,329	16,630	
	(9,216)	(6,243)			(7,698)	(7,216)			
合 計				△ 13,205				16,630	

（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	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
区 分	2021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	-	150	-	-	-	10,000	10,150
平均受取固定金利	-	0.16	-	-	-	0.64	0.63
平均支払変動金利	-	0.07	-	-	-	△ 0.06	△ 0.06
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	-	-	-	-	-	△ 0.06	△ 0.06
合 計	-	150	-	-	-	20,000	20,150

## ②通貨関連

(単位：百万円)

区分	種類	2020年度末			2021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	14,205	△ 1,522	△ 1,522
	為替予約						
	売建	288,176	△ 1,246	△ 1,246	408,500	△ 10,982	△ 10,982
	(米ドル)	88,857	△ 1,048	△ 1,048	163,173	△ 1,346	△ 1,346
	(オーストラリアドル)	77,417	43	43	76,742	△ 5,487	△ 5,487
	(イギリスポンド)	19,317	△ 839	△ 839	31,680	△ 1,432	△ 1,432
	(カナダドル)	6,478	△ 327	△ 327	19,540	△ 960	△ 960
	(ユーロ)	58,947	925	925	13,396	△ 654	△ 654
	(その他)	37,158	△ 0	△ 0	103,967	△ 1,100	△ 1,100
	買建	230,063	△ 2,313	△ 2,313	265,622	△ 2,458	△ 2,458
	(米ドル)	159,658	△ 298	△ 298	165,748	△ 3,600	△ 3,600
	(ユーロ)	55,553	△ 1,908	△ 1,908	28,075	729	729
	(オーストラリアドル)	-	-	-	12,083	5	5
	(イギリスポンド)	9,952	△ 89	△ 89	9,265	44	44
	(その他)	4,899	△ 17	△ 17	50,449	361	361
	通貨オプション						
	売建						
	プット	108,807			10,561		
	(ユーロ)	(159)	0	158	(227)	66	160
	(米ドル)	-	-	-	10,561		
	コール	(-)	-	-	(227)	66	160
	(米ドル)	108,807			-		
	(ユーロ)	(159)	0	158	(-)	-	-
	コール	-			10,581		
	(米ドル)	(-)	-	-	(-)	-	-
	(ユーロ)	-	-	-	10,581		
	(その他)	(-)	-	-	(-)	-	-
買建							
プット	512,231			239,967			
(米ドル)	(4,631)	645	△ 3,985	(837)	333	△ 503	
(ユーロ)	512,231			130,202			
(その他)	(4,631)	645	△ 3,985	(256)	0	△ 256	
コール	-			109,765			
(米ドル)	(-)	-	-	(580)	333	△ 246	
(ユーロ)	-			52,905			
(その他)	(-)	-	-	(-)	-	-	
(ユーロ)	-			52,905			
(その他)	(-)	-	-	(-)	-	-	
合 計			△ 7,702			△ 15,307	

(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	2020年度末			2021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	-	-	-	28,465	△ 2,931	△ 2,931
	買建	5,176	104	104	-	-	-
	外貨建株価指数先物						
	売建	-	-	-	31,036	△ 2,789	△ 2,789
	買建	4,546	21	21	-	-	-
	円建株価指数オプション						
	買建						
	プット	269,963 (5,199)	4,044	△ 1,155	316,049 (6,479)	2,919	△ 3,559
	外貨建株価指数オプション						
買建							
プット	- (-)	-	-	31,983 (1,591)	650	△ 940	
合計				△ 1,028		△ 10,220	

- (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	2020年度末			2021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	25,398	99	99
	買建	-	-	-	3,606	△ 13	△ 13
	外貨建債券先物						
売建	567,017	8,802	8,802	316,975	10,921	10,921	
買建	702,387	△ 6,486	△ 6,486	432,600	△ 12,578	△ 12,578	
店頭	外貨建債券先渡契約						
	売建	41,532	137	137	87,693	2,357	2,357
	買建	78,944	△ 133	△ 133	126,811	△ 3,872	△ 3,872
	円建債券店頭オプション						
	売建						
	コール	6,555 (33)	31	2	19,200 (48)	16	31
	プット	36,871 (134)	35	98	41,988 (181)	246	△ 64
	買建						
	コール	36,871 (107)	170	63	41,988 (154)	41	△ 112
	プット	6,555 (37)	32	△ 4	19,200 (53)	60	7
合計				2,458		△ 3,224	

- (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	2020年度末				2021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	12,000	11,000	255	255	9,200	7,200	150	150
	プロテクション買建	11,300	11,300	△ 215	△ 215	3,000	-	△ 20	△ 20
合計					39				130

(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	2020年度末				2021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	14,250	14,250	74	74	14,600	10,600	△ 34	△ 34
	固定金利受取/変動金利支払	保険負債	700,000	700,000	18,998	18,998	700,000	700,000	△ 481	△ 481
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	12,300	8,300	124	124	8,300	8,300	81	81
	固定金利支払/変動金利受取	借入金	325,000	325,000	△ 746	△ 746	325,000	181,000	503	503
合計						18,451				68

(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	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
区分	2021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	6,000	2,900	10,000	-	700,000	722,900
平均受取固定金利	0.12	△ 0.02	0.97	0.10	-	0.47	0.46
平均支払変動金利	0.07	0.10	0.07	0.00	-	0.06	0.06
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	0.13	-	0.13	-	-	-	0.13
合計	148,000	6,000	183,900	10,000	-	700,000	1,047,900

## 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	2020年度末				2021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	196,770	185,116	△ 7,530	△ 7,530	192,809	175,356	△ 13,639	△ 13,639	
	(米ドル)		114,235	108,781	△ 3,676	△ 3,676	115,499	104,077	△ 8,735	△ 8,735	
	(ユーロ)		70,488	64,288	△ 3,478	△ 3,478	65,382	59,351	△ 4,488	△ 4,488	
	(イギリスポンド)		12,046	12,046	△ 375	△ 375	11,927	11,927	△ 415	△ 415	
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		6,454,969	-	△ 306,980	△ 306,980	5,839,213	-	△ 474,485	△ 474,485	
	(米ドル)		3,160,414	-	△ 177,109	△ 177,109	2,940,436	-	△ 273,968	△ 273,968	
	(ユーロ)		1,344,897	-	△ 42,286	△ 42,286	1,302,139	-	△ 47,364	△ 47,364	
	(オーストラリアドル)		835,833	-	△ 43,597	△ 43,597	806,327	-	△ 92,374	△ 92,374	
	(カナダドル)		344,654	-	△ 24,746	△ 24,746	412,680	-	△ 34,194	△ 34,194	
	(イギリスポンド)		162,460	-	△ 3,242	△ 3,242	154,103	-	△ 9,791	△ 9,791	
	(その他)		606,709	-	△ 15,997	△ 15,997	223,525	-	△ 16,791	△ 16,791	
	買建		11,563	-	285	285	151,085	-	10,230	10,230	
	(米ドル)		7,928	-	229	229	109,969	-	7,484	7,484	
	(オーストラリアドル)		3,585	-	53	53	10,488	-	475	475	
	(カナダドル)		49	-	1	1	7,823	-	160	160	
	(イギリスポンド)		-	-	-	-	618	-	3	3	
	(ユーロ)		-	-	-	-	477	-	22	22	
	(その他)		-	-	-	-	21,707	-	2,082	2,082	
為替予約等の振当処理	為替予約	外貨建定期預金									
	売建		242,002	-	-	-	223,000	-	-	-	
	(米ドル)		92,002	-	-	-	73,000	-	-	-	
	(その他)		150,000	-	-	-	150,000	-	-	-	
	通貨スワップ		外貨建社債(負債)	476,277	368,715	-	-	368,715	368,715	-	-
	(米ドル)			476,277	368,715	-	-	368,715	368,715	-	-
	通貨スワップ		外貨建貸付金	30,366	30,366	-	-	26,877	23,608	-	-
	(米ドル)			25,594	25,594	-	-	24,491	23,608	-	-
	(ユーロ)			4,771	4,771	-	-	2,385	-	-	-
	合 計						△ 314,225				△ 477,894

(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

2020年度末、2021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

2020年度末、2021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

2020年度末、2021年度末ともに期末残高がないため、記載していません。