

2024年度第2四半期（上半期）報告 補足資料

1. 一般勘定

(1) 商品有価証券関係	1
① 商品有価証券明細表	1
② 商品有価証券売買高	1
(2) 有価証券関係	1
① 有価証券明細表	1
② 有価証券残存期間別残高	2
③ 地域別地方債保有内訳	2
④ 公社債および外国公社債格付別内訳	3
⑤ 株式業種別内訳	3
(3) 貸付金関係	4
① 貸付金明細表	4
② 貸付金企業規模別内訳	4
③ 貸付金業種別内訳	5
④ 貸付金担保別内訳	6
⑤ 貸付金地域別内訳	6
⑥ 一般貸付金残存期間別残高	6
(4) 海外投融資関係	7
① 資産別明細	7
② 外貨建資産の通貨別構成	8
③ 海外投融資の地域別構成	8
(5) デリバティブ取引の状況	9

2. 個人変額保険特別勘定

(1) 売買目的有価証券の評価損益	14
(2) デリバティブ取引の状況	14

3. 会社計

(1) 資産構成	15
(2) 売買目的有価証券の評価損益	15
(3) 有価証券の時価情報	16
(4) 金銭の信託の時価情報	17
(5) デリバティブ取引の状況	18

1. 一般勘定

(1) 商品有価証券関係

①商品有価証券明細表

2023年度末、2024年度上半期末に該当の残高はありません。

②商品有価証券売買高

2023年度、2024年度上半期に該当はありません。

(2) 有価証券関係

①有価証券明細表

(単位：億円、%)

区分	2023年度末		2024年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
公社債	305,711	43.6	306,283	45.0
国債	278,636	39.8	280,734	41.3
地方債	7,935	1.1	7,715	1.1
社債	19,138	2.7	17,832	2.6
(うち公社・公団債)	(5,901)	(0.8)	(5,426)	(0.8)
株式	145,694	20.8	135,320	19.9
外国証券	218,239	31.1	211,754	31.1
公社債	118,261	16.9	112,551	16.6
株式等	99,977	14.3	99,203	14.6
その他の証券	31,284	4.5	26,710	3.9
合計	700,929	100.0	680,067	100.0

②有価証券残存期間別残高

(単位：億円)

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	有価証券	13,002	36,100	45,496	40,455	49,382	516,492	700,929
	国債	6,591	16,869	14,778	16,114	12,192	212,090	278,636
	地方債	128	736	504	1,078	1,377	4,110	7,935
	社債	927	2,170	3,095	2,500	3,343	7,102	19,138
	株式						145,694	145,694
	外国証券	3,927	12,496	17,975	18,504	24,348	140,987	218,239
	公社債	3,064	12,006	17,244	16,895	20,295	48,754	118,261
	株式等	863	489	730	1,608	4,052	92,233	99,977
	その他の証券	1,428	3,828	9,142	2,258	8,120	6,507	31,284
	買入金銭債権	80	—	67	66	180	793	1,187
	譲渡性預金	439	—	—	—	—	—	439
	合計	13,523	36,100	45,564	40,521	49,562	517,286	702,557
2024年度上半期末	有価証券	12,233	40,995	41,221	32,375	46,874	506,367	680,067
	国債	4,248	20,726	14,757	12,239	10,836	217,925	280,734
	地方債	143	711	868	968	1,363	3,659	7,715
	社債	931	1,979	3,424	1,951	3,449	6,096	17,832
	株式						135,320	135,320
	外国証券	4,391	12,597	18,787	15,681	23,233	137,063	211,754
	公社債	3,457	12,168	17,866	13,094	19,718	46,245	112,551
	株式等	934	428	920	2,587	3,514	90,818	99,203
	その他の証券	2,517	4,981	3,383	1,534	7,991	6,302	26,710
	買入金銭債権	49	—	60	60	103	751	1,025
	譲渡性預金	440	—	—	—	—	—	440
	合計	12,723	40,995	41,282	32,435	46,978	507,119	681,533

③地域別地方債保有内訳

(単位：億円、%)

区分	2023年度末		2024年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
北海道	59	0.7	59	0.8
東北	5	0.1	5	0.1
関東	4,294	54.1	4,185	54.2
中部	1,523	19.2	1,504	19.5
近畿	695	8.8	709	9.2
中国	187	2.4	149	1.9
四国	—	—	—	—
九州	1,025	12.9	926	12.0
その他	144	1.8	175	2.3
合計	7,935	100.0	7,715	100.0

(注) 上記「その他」は共同発行市場公募地方債です。

④公社債および外国公社債格付別内訳

(単位：億円、%)

区分	2023年度末		2024年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
AAA	5,313	3.7	4,717	3.4
AA	55,177	38.0	53,155	38.5
A	41,528	28.6	38,931	28.2
BBB	40,943	28.2	38,991	28.2
BB以下	147	0.1	32	0.0
格付なし	2,226	1.5	2,271	1.6
合計	145,336	100.0	138,100	100.0

(注) 1. 上記公社債残高は日本国債の残高を除いています。(2023年度末：27兆8,636億円、2024年度上半期末：28兆734億円)

2. 上記は外部の格付業者の格付に基づき作成しています。

⑤株式業種別内訳

(単位：億円、%)

区分	2023年度末		2024年度上半期末		
	金額	占率	金額	占率	
水産・農林業	43	0.0	43	0.0	
鉱業	24	0.0	77	0.1	
建設業	2,257	1.5	2,278	1.7	
製造業	食料品	4,029	2.8	4,012	3.0
	繊維製品	1,088	0.7	1,200	0.9
	パルプ・紙	256	0.2	226	0.2
	化学	12,148	8.3	11,787	8.7
	医薬品	8,085	5.5	7,902	5.8
	石油・石炭製品	233	0.2	229	0.2
	ゴム製品	985	0.7	817	0.6
	ガラス・土石製品	1,087	0.7	1,050	0.8
	鉄鋼	1,473	1.0	1,238	0.9
	非鉄金属	977	0.7	1,002	0.7
	金属製品	453	0.3	472	0.3
	機械	7,241	5.0	6,282	4.6
	電気機器	15,208	10.4	14,813	10.9
	輸送用機器	31,453	21.6	21,940	16.2
精密機器	1,349	0.9	1,546	1.1	
その他製品	1,794	1.2	2,242	1.7	
電気・ガス業	4,042	2.8	3,659	2.7	
運輸・情報通信業	陸運業	5,329	3.7	4,530	3.3
	海運業	386	0.3	426	0.3
	空運業	101	0.1	96	0.1
	倉庫・運輸関連業	122	0.1	131	0.1
	情報・通信業	7,918	5.4	7,782	5.8
商業	卸売業	8,704	6.0	8,442	6.2
	小売業	4,130	2.8	3,925	2.9
金融・保険業	銀行業	6,766	4.6	6,381	4.7
	証券・商品先物取引業	955	0.7	861	0.6
	保険業	12,238	8.4	13,004	9.6
	その他金融業	826	0.6	793	0.6
不動産業	728	0.5	625	0.5	
サービス業	3,250	2.2	5,493	4.1	
合計	145,694	100.0	135,320	100.0	

(3) 貸付金関係

①貸付金明細表

(単位：億円)

区分	2023年度末	2024年度上半期末
保険約款貸付	4,229	4,124
保険料振替貸付	236	225
契約者貸付	3,992	3,899
一般貸付	76,253	76,158
企業貸付	57,834	58,791
国内	47,706	48,121
海外	10,128	10,670
国・国際機関・政府関係機関・ 公共団体・公企業貸付	4,689	3,575
国内	4,616	3,515
海外	72	60
住宅ローン	9,096	9,099
消費者ローン	3,858	3,878
その他	774	812
合 計	80,482	80,283
非居住者貸付	10,200	10,730

②貸付金企業規模別内訳

(単位：件、億円、%)

区分		2023年度末		2024年度上半期末	
			占率		占率
大企業	貸付先数	640	39.3	621	39.1
	金額	40,164	84.2	40,701	84.6
中堅企業	貸付先数	160	9.8	163	10.3
	金額	425	0.9	428	0.9
中小企業	貸付先数	828	50.9	806	50.7
	金額	7,116	14.9	6,990	14.5
国内企業計	貸付先数	1,628	100.0	1,590	100.0
	金額	47,706	100.0	48,121	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②～④を除く 全業種		②小売業、飲食業		③サービス業		④卸売業	
	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
大企業								
中堅企業	かつ	資本金 3億円超 10億円未満	かつ	資本金 5千万円超 10億円未満	かつ	資本金 5千万円超 10億円未満	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貸付金業種別内訳

(単位：億円、%)

区分		2023年度末		2024年度上半期末	
		金額	占率	金額	占率
国内向け	製造業	9,012	11.8	8,987	11.8
	食料	690	0.9	751	1.0
	繊維	234	0.3	230	0.3
	木材・木製品	17	0.0	10	0.0
	パルプ・紙	555	0.7	553	0.7
	印刷	308	0.4	289	0.4
	化学	2,027	2.7	1,974	2.6
	石油・石炭	924	1.2	921	1.2
	窯業・土石	416	0.5	413	0.5
	鉄鋼	787	1.0	833	1.1
	非鉄金属	151	0.2	153	0.2
	金属製品	96	0.1	102	0.1
	はん用・生産用・業務用機械	834	1.1	788	1.0
	電気機械	665	0.9	675	0.9
	輸送用機械	986	1.3	974	1.3
	その他の製造業	317	0.4	313	0.4
	農業、林業	—	—	—	—
	漁業	—	—	—	—
	鉱業、採石業、砂利採取業	5	0.0	4	0.0
	建設業	519	0.7	518	0.7
	電気・ガス・熱供給・水道業	13,119	17.2	12,726	16.7
	情報通信業	1,249	1.6	1,255	1.6
運輸業、郵便業	6,087	8.0	6,011	7.9	
卸売業	7,154	9.4	7,016	9.2	
小売業	504	0.7	496	0.7	
金融業、保険業	5,388	7.1	5,490	7.2	
不動産業	5,934	7.8	5,950	7.8	
物品賃貸業	2,862	3.8	2,780	3.7	
学術研究、専門・技術サービス業	45	0.1	45	0.1	
宿泊業	0	0.0	1	0.0	
飲食業	19	0.0	16	0.0	
生活関連サービス業、娯楽業	33	0.0	30	0.0	
教育、学習支援業	22	0.0	23	0.0	
医療、福祉	7	0.0	7	0.0	
その他のサービス	154	0.2	161	0.2	
地方公共団体	973	1.3	923	1.2	
個人（住宅・消費・納税資金等）	12,954	17.0	12,978	17.0	
合 計	66,052	86.6	65,427	85.9	
海外向け	政府等	—	—	—	—
	金融機関	1,901	2.5	1,974	2.6
	商工業（等）	8,299	10.9	8,756	11.5
	合 計	10,200	13.4	10,730	14.1
総 合 計	76,253	100.0	76,158	100.0	

④貸付金担保別内訳

(単位：億円、%)

区分	2023年度末		2024年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
担保貸付	164	0.2	164	0.2
有価証券担保貸付	38	0.1	41	0.1
不動産・動産・財団担保貸付	123	0.2	122	0.2
指名債権担保貸付	2	0.0	0	0.0
保証貸付	1,029	1.3	992	1.3
信用貸付	62,104	81.4	62,023	81.4
その他	12,954	17.0	12,978	17.0
一般貸付計	76,253	100.0	76,158	100.0
うち劣後特約付貸付	1,426	1.9	1,726	2.3

⑤貸付金地域別内訳

(単位：億円、%)

区分	2023年度末		2024年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
北海道	1,161	2.4	1,089	2.3
東北	1,410	3.0	1,197	2.5
関東	31,928	66.9	33,092	68.8
中部	3,598	7.5	3,573	7.4
近畿	6,528	13.7	6,216	12.9
中国	952	2.0	840	1.7
四国	751	1.6	744	1.5
九州	1,374	2.9	1,365	2.8
合計	47,706	100.0	48,121	100.0

(注) 1. 個人ローン、非居住者貸付、保険約款貸付等は含んでいません。
2. 地域区分は、貸付先の本社所在地によります。

⑥一般貸付金残存期間別残高

(単位：億円)

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	固定金利	8,807	10,487	8,146	7,269	8,392	19,087	62,190
	変動金利	1,080	2,484	2,506	2,137	2,205	3,648	14,062
	一般貸付計	9,887	12,972	10,652	9,406	10,597	22,736	76,253
2024年度上半期末	固定金利	8,985	10,406	7,878	7,814	8,510	18,069	61,663
	変動金利	1,303	3,369	2,474	1,593	2,314	3,438	14,494
	一般貸付計	10,289	13,775	10,352	9,407	10,824	21,507	76,158

(4) 海外投融資関係

①資産別明細

・外貨建資産

(単位：億円、%)

区分	2023年度末		2024年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
公社債	116,203	48.0	110,033	46.6
株式	10,283	4.2	10,135	4.3
現預金・その他	84,414	34.9	84,752	35.9
小計	210,901	87.1	204,921	86.7

・円貨額が確定した外貨建資産

(単位：億円、%)

区分	2023年度末		2024年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
公社債	—	—	—	—
現預金・その他	2,563	1.1	2,519	1.1
小計	2,563	1.1	2,519	1.1

・円貨建資産

(単位：億円、%)

区分	2023年度末		2024年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
非居住者貸付	245	0.1	238	0.1
公社債(円建外債)・その他	28,427	11.7	28,671	12.1
小計	28,672	11.8	28,909	12.2

・合計

(単位：億円、%)

区分	2023年度末		2024年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
海外投融資	242,137	100.0	236,349	100.0

(注) 「円貨額が確定した外貨建資産」とは、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計上額としているものです。

②外貨建資産の通貨別構成

(単位：億円、%)

区分	2023年度末		2024年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
米ドル	148,730	70.5	144,216	70.4
ユーロ	39,751	18.8	37,721	18.4
イギリスポンド	12,741	6.0	12,515	6.1
オーストラリアドル	5,449	2.6	6,181	3.0
インドルピー	2,084	1.0	2,083	1.0
香港ドル	543	0.3	592	0.3
その他	1,600	0.8	1,611	0.8
合計	210,901	100.0	204,921	100.0

(注) 内訳は、2024年度上半期末における残高上位6通貨を表示しています。

③海外投融資の地域別構成

(単位：億円、%)

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	85,075	39.0	73,684	62.3	11,391	11.4	1,806	17.7
	ヨーロッパ	43,075	19.7	33,820	28.6	9,254	9.3	5,867	57.5
	オセアニア	4,738	2.2	2,875	2.4	1,863	1.9	1,988	19.5
	アジア	7,081	3.2	3,894	3.3	3,187	3.2	—	—
	中南米	77,773	35.6	3,491	3.0	74,281	74.3	169	1.7
	中東	77	0.0	77	0.1	—	—	368	3.6
	アフリカ	—	—	—	—	—	—	—	—
	国際機関	417	0.2	417	0.4	—	—	—	—
	合計	218,239	100.0	118,261	100.0	99,977	100.0	10,200	100.0
2024年度上半期末	北米	79,817	37.7	69,337	61.6	10,479	10.6	2,223	20.7
	ヨーロッパ	41,461	19.6	32,311	28.7	9,149	9.2	5,833	54.4
	オセアニア	5,425	2.6	3,562	3.2	1,863	1.9	2,134	19.9
	アジア	6,893	3.3	3,620	3.2	3,273	3.3	—	—
	中南米	77,797	36.7	3,360	3.0	74,436	75.0	206	1.9
	中東	75	0.0	75	0.1	—	—	333	3.1
	アフリカ	—	—	—	—	—	—	—	—
	国際機関	283	0.1	283	0.3	—	—	—	—
	合計	211,754	100.0	112,551	100.0	99,203	100.0	10,730	100.0

(注) 海外投融資のうち、外国証券、非居住者貸付を対象としています。

(5) デリバティブ取引の状況

[定性的情報]

(a) 取引の内容

当社が利用対象としているデリバティブ取引は次の取引です。

金利関連：金利先物取引、金利スワップ取引、スワップション取引等

通貨関連：為替予約取引、通貨オプション取引、通貨スワップ取引等

株式関連：株価指数先物取引、株価指数オプション取引、株券オプション取引、株式先渡取引等

債券関連：債券先物取引、債券先物オプション取引、選択権付債券売買取引等

(b) 取組方針

主として資産または負債に係るリスクをコントロールする目的でデリバティブを活用しています。

(c) 利用目的

主として資産または負債に係るリスクのヘッジを目的として利用しており、その一部についてヘッジ会計を適用しています。

ヘッジ会計の手法については、主に、外貨建貸付金の一部に対するキャッシュ・フローのヘッジとして金利スワップの特例処理、保険契約の一部に対する金利変動リスクのヘッジとして「保険業における金融商品会計基準適用に関する会計上及び監査上の取扱い」（日本公認会計士協会業種別監査委員会報告第26号）に基づく金利スワップによる繰延ヘッジ、外貨建債券の一部、外貨建貸付金の一部および外貨建劣後特約付社債に対する為替変動に係るキャッシュ・フローのヘッジとして通貨スワップによる繰延ヘッジおよび振当処理、外貨建債券等の一部および外貨建株式（予定取引）の一部に対する為替変動に係る価格変動リスクのヘッジとして為替予約による時価ヘッジおよび繰延ヘッジ、外貨建債券の一部に対する為替変動に係る価格変動リスクのヘッジとして通貨オプションによる時価ヘッジ、国内株式の一部に対する価格変動リスクのヘッジとして株式先渡による時価ヘッジを適用しており、ヘッジの有効性の判定については、リスク管理方針に基づき、主にヘッジ対象とヘッジ手段の時価変動を比較する比率分析によります。

(d) リスクの内容

当社が行っているデリバティブ取引については、市場リスク（金利・為替・株式等の変動によるリスク）および信用リスク（取引相手が倒産等により契約不履行に陥るリスク）があります。市場リスクについては、デリバティブ取引は主として資産または負債に係るリスクをコントロールすることを目的としていることから、限定的であると認識しています。また、信用リスクについても、国内外の金融商品取引所を通じた取引か、信用度の高い取引先を相手としており、契約が履行されないリスクは小さいものと認識しています。

(e) リスク管理体制

デリバティブ取引の目的や種類ごとに必要となる取引限度枠等を規定するとともに、その取引については、事務部門（バックオフィス）が外部証票との照合により内容を確認する等、投融资執行部門（フロントオフィス）に対しての牽制が働く体制としています。また、資産または負債も併せたリスクを定量的に把握・分析し、そのリスク量とともにポジション、損益状況を定期的に「運用リスク管理専門委員会」に報告する体制になっています。

(f) 定量的情報に関する補足説明

ア) 想定元本（契約金額）に関する補足説明

スワップ取引に係る想定元本やオプション取引の契約金額は、金利交換等に係る名目的なものであり、信用リスク量（取引相手先がデフォルトした際に、市場で同じポジションを再構築するための潜在的なコスト）を示すものではありません。

イ) 時価算定に係る補足説明

[先物取引等の市場取引]

期末日の清算値または終値

[株式オプション取引]

主に期末日の清算値または終値、外部情報ベンダーより入手した評価額

[為替予約取引、通貨オプション取引、金利スワップ取引、通貨スワップ取引、スワップション取引、株式先渡取引、選択権付債券売買取引]

主に外部情報ベンダーより入手した評価額

ウ) 差損益に関する補足説明

当社では、デリバティブ取引を主として資産または負債に係るリスクのコントロールを行うための補完手段として活用しています。

例えば、為替予約、通貨オプション取引については、主として為替リスクをヘッジするために活用しており、外国債券・外国株式等の外貨建資産全体の損益と合計で見する必要があります。

[定量的情報（一般勘定）]（ヘッジ会計適用・非適用分合算値）

1. 差損益の内訳（ヘッジ会計適用分・非適用分の内訳）

（単位：億円）

区分	2023年度末						2024年度上半期末					
	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	△3,130	△14,028	△31	—	—	△17,190	△3,167	△11,694	13	—	—	△14,847
ヘッジ会計非適用分	△338	△117	△22	△51	—	△530	△247	467	—	△57	—	163
合計	△3,468	△14,146	△54	△51	—	△17,721	△3,414	△11,226	13	△57	—	△14,684

（注）ヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ適用分の差損益（2023年度末：通貨関連△1,322億円、株式関連△31億円、2024年度上半期末：通貨関連959億円、株式関連13億円）、およびヘッジ会計非適用分の差損益は、損益計算書に計上しています。

2. 金利関連

（単位：億円）

区分	種類	2023年度末				2024年度上半期末			
		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
店頭	金利スワップ								
	固定金利受取／変動金利支払	33,006	33,006	△3,130	△3,130	33,043	33,043	△3,167	△3,167
	固定金利支払／変動金利受取	—	—	—	—	2,028	2,028	△9	△9
	金利スワップション								
	売建								
	固定金利受取／変動金利支払	—	—	—	—	—	—	—	—
		(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	固定金利支払／変動金利受取	—	—	—	—	—	—	—	—
		(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	買建								
固定金利受取／変動金利支払	8,330	4,023	7	△338	5,593	3,138	4	△236	
	(346)	(192)	—	—	(240)	(153)	—	—	
固定金利支払／変動金利受取	—	—	—	—	100	—	0	△0	
	(—)	(—)	—	—	(0)	(—)	—	—	
その他									
売建	—	—	—	—	—	—	—	—	
買建	—	—	—	—	2,444	2,444	△1	△1	
合計				△3,468				△3,414	

（注）1.（ ）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、先渡取引および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）金利スワップ契約の残存期間別構成

（単位：億円、%）

残存期間		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
2023年度末	固定金利受取／変動金利支払スワップ	—	—	—	—	4,206	28,800	33,006
	平均受取固定金利	—	—	—	—	0.33	0.48	0.46
	平均支払変動金利	—	—	—	—	0.12	0.12	0.12
	固定金利支払／変動金利受取スワップ	—	—	—	—	—	—	—
	平均支払固定金利	—	—	—	—	—	—	—
	平均受取変動金利	—	—	—	—	—	—	—
2024年度上半期末	固定金利受取／変動金利支払スワップ	—	—	27	100	7,506	25,409	33,043
	平均受取固定金利	—	—	0.57	0.44	0.25	0.53	0.46
	平均支払変動金利	—	—	0.23	0.23	0.28	0.27	0.27
	固定金利支払／変動金利受取スワップ	—	—	—	—	28	2,000	2,028
	平均支払固定金利	—	—	—	—	0.86	1.58	1.57
	平均受取変動金利	—	—	—	—	0.23	—	0.00

（注）平均支払変動金利・平均受取変動金利には、利息計算開始日を迎えていない金利を含んでいません。

3. 通貨関連

(単位：億円)

区分	種類	2023年度末				2024年度上半期末				
		契約額等	うち1年超		時価	差損益	契約額等	うち1年超		差損益
店頭	為替予約									
	売建	86,719	—	△2,590	△2,590	82,128	—	2,347	2,347	
	米ドル	60,589	—	△1,787	△1,787	53,253	—	1,849	1,849	
	ユーロ	12,455	—	△376	△376	15,233	—	263	263	
	買建	36,634	—	1,081	1,081	37,785	—	△1,362	△1,362	
	米ドル	31,134	—	1,045	1,045	29,804	—	△1,431	△1,431	
	ユーロ	397	—	0	0	3,234	—	47	47	
	通貨オプション									
	売建									
	ユーロ	—	—	—	—	3,360	—	31	20	
		(—)	(—)			(52)	(—)			
	米ドル	—	—	—	—	2,401	—	19	14	
		(—)	(—)			(33)	(—)			
	ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—	
		(—)	(—)			(—)	(—)			
	豪ドル	—	—	—	—	959	—	11	6	
		(—)	(—)			(18)	(—)			
	ブット	—	—	—	—	570	—	35	△4	
		(—)	(—)			(30)	(—)			
	米ドル	—	—	—	—	570	—	35	△4	
		(—)	(—)			(30)	(—)			
	ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—	
		(—)	(—)			(—)	(—)			
	買建									
	ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—	
		(—)	(—)			(—)	(—)			
	米ドル	—	—	—	—	—	—	—	—	
		(—)	(—)			(—)	(—)			
	ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—	
		(—)	(—)			(—)	(—)			
ブット	757	—	0	△5	6,786	—	165	69		
	(6)	(—)			(96)	(—)				
米ドル	757	—	0	△5	5,826	—	136	58		
	(6)	(—)			(77)	(—)				
ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—		
	(—)	(—)			(—)	(—)				
豪ドル	—	—	—	—	959	—	29	10		
	(—)	(—)			(18)	(—)				
通貨スワップ	62,525	60,637	△12,632	△12,632	61,458	58,993	△12,298	△12,298		
米ドル払/円受	42,591	41,805	△8,995	△8,995	42,036	40,657	△8,624	△8,624		
ユーロ払/円受	13,844	13,428	△2,731	△2,731	13,466	13,084	△2,672	△2,672		
合 計				△14,146				△11,226		

(注) 1. ()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、先渡取引および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。

4. 株式関連

(単位：億円)

区分	種類	2023年度末				2024年度上半期末			
		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		
取引所	株価指数先物								
	売建	—	—	—	—	—	—	—	—
	買建	—	—	—	—	—	—	—	—
	株価指数オプション								
	売建								
	コール	—	—	—	—	—	—	—	—
	プット	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	買建	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	コール	—	—	—	—	—	—	—	—
	プット	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
		3,181	—	0	△6	—	—	—	—
		(7)	(—)			(—)	(—)		
店頭	株式先渡契約								
	売建	327	—	△31	△31	78	—	13	13
	買建	—	—	—	—	—	—	—	—
	株価指数先渡契約								
	売建	—	—	—	—	—	—	—	—
	買建	543	249	△6	△6	—	—	—	—
	株価指数オプション								
	売建								
	コール	—	—	—	—	—	—	—	—
	プット	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
買建	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	
コール	—	—	—	—	—	—	—	—	
プット	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	
		1,648	—	0	△9	—	—	—	—
		(9)	(—)			(—)	(—)		
合計					△54				13

(注) 1. ()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、先物取引および先渡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。

5. 債券関連

(単位：億円)

区分	種類	2023年度末				2024年度上半期末			
		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		
取引所	円貨建債券先物								
	売建	—	—	—	—	—	—	—	—
	買建	—	—	—	—	—	—	—	—
	外貨建債券先物								
売建	—	—	—	—	16	—	△0	△0	
買建	—	—	—	—	16	—	△0	△0	
店頭	選択権付債券売買取引								
	売建								
	コール	—	—	—	—	294	—	1	0
	プット	(—)	(—)	—	—	(2)	(—)	—	—
	買建	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	コール	926	358	7	△51	888	341	2	△55
プット	(58)	(29)	—	—	(58)	(29)	—	—	
		—	—	—	—	294	—	0	△2
		(—)	(—)			(2)	(—)		
合計					△51				△57

(注) 1. ()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。

6. その他

2023年度末、2024年度上半期末に該当の残高はありません。

2. 個人変額保険特別勘定

(1) 売買目的有価証券の評価損益

(単位：億円)

区分	2023年度末		2024年度上半期末	
	貸借対照表計上額	当期の損益に含まれた評価損益	貸借対照表計上額	当期の損益に含まれた評価損益
売買目的有価証券	994	185	927	△48

(2) デリバティブ取引の状況（個人変額保険特別勘定）

1. 差損益の内訳（ヘッジ会計適用分・非適用分の内訳）

(単位：億円)

区分	2023年度末						2024年度上半期末					
	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	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
ヘッジ会計非適用分	—	△1	3	△0	—	1	—	0	4	0	—	4
合計	—	△1	3	△0	—	1	—	0	4	0	—	4

(注)ヘッジ会計非適用分の差損益は、損益計算書に計上しています。

2. 金利関連

2023年度末、2024年度上半期末に該当の残高はありません。

3. 通貨関連

(単位：億円)

区分	種類	2023年度末				2024年度上半期末			
		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	為替予約								
	売建	179	—	△2	△2	229	—	△1	△1
	米ドル	76	—	△1	△1	116	—	△0	△0
	ユーロ	35	—	△0	△0	55	—	△0	△0
	債券	18	—	△0	△0	19	—	△0	△0
	買建	144	—	0	0	176	—	1	1
	米ドル	56	—	0	0	66	—	△0	△0
	ユーロ	28	—	0	0	34	—	0	0
	債券	17	—	0	0	18	—	0	0
加ドル	14	—	0	0	8	—	△0	△0	
合計				△1				0	

(注)「差損益」欄には、時価を記載しています。

4. 株式関連

(単位：億円)

区分	種類	2023年度末				2024年度上半期末			
		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		
取引所	株価指数先物								
	売建	16	—	△0	△0	20	—	△0	△0
	買建	156	—	3	3	145	—	4	4
合計				3				4	

(注)「差損益」欄には、時価を記載しています。

5. 債券関連

(単位：億円)

区分	種類	2023年度末				2024年度上半期末			
		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		
取引所	円貨建債券先物								
	売建	1	—	△0	△0	14	—	0	0
	買建	—	—	—	—	—	—	—	—
	外貨建債券先物								
	売建	—	—	—	—	—	—	—	—
買建	—	—	—	—	—	—	—	—	
合計				△0				0	

(注)「差損益」欄には、時価を記載しています。

6. その他

2023年度末、2024年度上半期末に該当の残高はありません。

3. 会社計

(1) 資産構成 (会社計)

(単位：億円)

区分	2024年度上半期末	
		うち一般勘定
現預金・コールローン	12,120	9,498
買現先勘定	—	—
買入金銭債権	1,025	1,025
商品有価証券	—	—
金銭の信託	—	—
公社債	309,821	306,283
株式	135,785	135,320
外国証券	213,644	211,754
貸付金	80,283	80,283
不動産	17,345	17,345
資産計	817,149	805,289
うち外貨建資産	207,469	204,921

(2) 売買目的有価証券の評価損益 (会社計)

(単位：億円)

区分	2023年度末		2024年度上半期末	
	貸借対照表計上額	当期の損益に含まれた評価損益	貸借対照表計上額	当期の損益に含まれた評価損益
売買目的有価証券	8,651	693	8,279	△151

(注) 1. 売買目的有価証券に含まれる金銭の信託の貸借対照表計上額および当期の損益に含まれた評価損益には、デリバティブ取引に係る差損益を含んでいます。
 2. 売買目的有価証券に含まれる金銭の信託内で保有している現預金およびコールローンは含んでいません。

(3) 有価証券の時価情報（会社計）（売買目的有価証券以外）

（単位：億円）

区分	2023年度末					2024年度上半期末				
	帳簿価額	時価	差損益			帳簿価額	時価	差損益		
			差益	差損				差益	差損	
責任準備金対応債券	275,836	266,231	△9,604	10,579	△20,184	275,338	256,422	△18,915	7,736	△26,652
満期保有目的の債券	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
子会社・関連会社株式	1,286	4,413	3,127	3,127	—	1,286	5,604	4,318	4,318	—
其他有価証券	276,501	403,006	126,504	133,420	△6,916	268,962	379,886	110,924	118,962	△8,038
公社債	32,602	32,277	△324	1,147	△1,471	34,287	33,113	△1,174	947	△2,121
株式	40,337	136,116	95,778	96,049	△271	40,343	123,664	83,320	83,781	△460
外国証券	174,158	204,333	30,175	33,933	△3,758	169,529	197,738	28,208	32,008	△3,799
公社債	100,000	116,500	16,500	17,661	△1,160	96,438	111,119	14,681	15,906	△1,224
株式等	74,158	87,833	13,674	16,271	△2,597	73,091	86,618	13,527	16,101	△2,574
その他の証券	28,708	29,586	877	2,286	△1,408	24,208	24,771	562	2,219	△1,656
買入金銭債権	254	252	△1	4	△6	152	158	6	6	△0
譲渡性預金	440	439	△0	—	△0	440	440	0	0	△0
合 計	553,624	673,652	120,027	147,128	△27,100	545,586	641,913	96,327	131,017	△34,690
公社債	306,035	295,919	△10,116	11,531	△21,647	307,457	287,268	△20,188	8,573	△28,762
株式	40,337	136,116	95,778	96,049	△271	40,343	123,664	83,320	83,781	△460
外国証券	176,903	210,386	33,482	37,241	△3,758	172,108	204,731	32,623	36,425	△3,802
公社債	101,468	118,150	16,682	17,843	△1,160	97,740	112,519	14,779	16,006	△1,227
株式等	75,435	92,235	16,799	19,397	△2,597	74,368	92,211	17,843	20,418	△2,574
その他の証券	28,718	29,598	880	2,288	△1,408	24,217	24,782	565	2,221	△1,656
買入金銭債権	1,189	1,192	2	17	△14	1,019	1,025	6	15	△9
譲渡性預金	440	439	△0	—	△0	440	440	0	0	△0

(注) 1. 本表には、金融商品取引法上の有価証券として取り扱うことが適当と認められるもの等を含んでいます。

2. 市場価格のない株式等および組合等は本表から除いています。

○市場価格のない株式等および組合等の帳簿価額は以下のとおりです。

（単位：億円）

区分	2023年度末	2024年度上半期末
子会社・関連会社株式	20,665	23,411
其他有価証券	1,359	1,395
国内株式	558	570
外国株式	0	—
その他	800	825
合 計	22,024	24,806

(注) 市場価格のない株式等および組合等のうち、外貨建資産について為替を評価した差損益は次のとおりです。

(2023年度末：2,464億円、2024年度上半期末：1,824億円)

(4) 金銭の信託の時価情報（会社計）

2023年度末、2024年度上半期末に該当の残高はありません。

・運用目的の金銭の信託

2023年度末、2024年度上半期末に該当の残高はありません。

・責任準備金対応、満期保有目的、その他の金銭の信託

2023年度末、2024年度上半期末に該当の残高はありません。

(5) デリバティブ取引の状況 (会社計)

1. 差損益の内訳 (ヘッジ会計適用分・非適用分の内訳)

(単位: 億円)

区分	2023年度末						2024年度上半期末					
	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	△3,130	△14,028	△31	—	—	△17,190	△3,167	△11,694	13	—	—	△14,847
ヘッジ会計非適用分	△338	△127	3	△48	—	△510	△247	466	24	△53	—	190
合計	△3,468	△14,155	△28	△48	—	△17,701	△3,414	△11,228	38	△53	—	△14,657

(注)ヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ適用分の差損益 (2023年度末: 通貨関連△1,322億円、株式関連△31億円、2024年度上半期末: 通貨関連959億円、株式関連13億円)、およびヘッジ会計非適用分の差損益は、損益計算書に計上しています。

2. ヘッジ会計が適用されていないもの

(a) 金利関連

(単位: 億円)

区分	種類	2023年度末				2024年度上半期末			
		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	金利スワップ								
	固定金利受取/変動金利支払	—	—	—	—	37	37	△0	△0
	固定金利支払/変動金利受取	—	—	—	—	2,028	2,028	△9	△9
	金利スワップション								
	売建								
	固定金利受取/変動金利支払	—	—	—	—	—	—	—	—
		(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	固定金利支払/変動金利受取	—	—	—	—	—	—	—	—
		(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	買建								
固定金利受取/変動金利支払	8,330	4,023	7	△338	5,593	3,138	4	△236	
	(346)	(192)	—	—	(240)	(153)	—	—	
固定金利支払/変動金利受取	—	—	—	—	100	—	0	△0	
	(—)	(—)	—	—	(0)	(—)	—	—	
その他									
売建	—	—	—	—	—	—	—	—	—
買建	—	—	—	—	2,444	2,444	△1	△1	
合計				△338				△247	

(注)1. ()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、先渡取引および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) 金利スワップ契約の残存期間別構成

(単位: 億円、%)

残存期間		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
2023年度末	固定金利受取 /変動金利支払 スワップ	想定元本	—	—	—	—	—	—
		平均受取固定金利	—	—	—	—	—	—
		平均支払変動金利	—	—	—	—	—	—
	固定金利支払 /変動金利受取 スワップ	想定元本	—	—	—	—	—	—
		平均支払固定金利	—	—	—	—	—	—
		平均受取変動金利	—	—	—	—	—	—
2024年度上半期末	固定金利受取 /変動金利支払 スワップ	想定元本	—	—	27	—	—	9
		平均受取固定金利	—	—	0.57	—	—	1.15
		平均支払変動金利	—	—	0.23	—	—	0.23
	固定金利支払 /変動金利受取 スワップ	想定元本	—	—	—	—	28	2,000
		平均支払固定金利	—	—	—	—	0.86	1.58
		平均受取変動金利	—	—	—	—	0.23	—

(注)平均支払変動金利・平均受取変動金利には、利息計算開始日を迎えていない金利を含んでいません。

(b) 通貨関連

(単位：億円)

区分	種類	2023年度末				2024年度上半期末			
		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
店頭	為替予約								
	売建	37,720	—	△1,285	△1,285	37,566	—	1,449	1,449
	米ドル	24,204	—	△871	△871	20,672	—	1,033	1,033
	ユーロ	1,363	—	△31	△31	4,540	—	167	167
	ポンド	7,323	—	△297	△297	7,777	—	164	164
	買建	37,902	—	1,090	1,090	34,221	—	△1,067	△1,067
	米ドル	31,625	—	1,049	1,049	25,730	—	△1,145	△1,145
	ユーロ	683	—	1	1	3,396	—	49	49
	通貨オプション								
	売建								
	コール	—	—	—	—	1,194	—	13	0
		(—)	(—)	—	—	(13)	(—)	—	—
	米ドル	—	—	—	—	1,194	—	13	0
		(—)	(—)	—	—	(13)	(—)	—	—
	ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—
		(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	プット	—	—	—	—	570	—	35	△4
		(—)	(—)	—	—	(30)	(—)	—	—
	米ドル	—	—	—	—	570	—	35	△4
		(—)	(—)	—	—	(30)	(—)	—	—
	ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—
		(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	買建								
	コール	—	—	—	—	—	—	—	—
		(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	米ドル	—	—	—	—	—	—	—	—
		(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—	
	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	
プット	757	—	0	△5	4,620	—	76	18	
	(6)	(—)	—	—	(57)	(—)	—	—	
米ドル	757	—	0	△5	4,620	—	76	18	
	(6)	(—)	—	—	(57)	(—)	—	—	
ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—	
	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	
通貨スワップ	510	484	73	73	438	412	69	69	
米ドル払/円受	—	—	—	—	—	—	—	—	
ユーロ払/円受	—	—	—	—	—	—	—	—	
ユーロ払/豪ドル受	50	50	△5	△5	50	50	△4	△4	
円払/豪ドル受	278	278	37	37	207	207	36	36	
円払/米ドル受	180	154	40	40	180	154	37	37	
合計				△127				466	

(注) 1. ()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、先渡取引および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。

(c) 株式関連

(単位：億円)

区分	種類	2023年度末				2024年度上半期末			
		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		
取引所	株価指数先物								
	売建	56	—	△0	△0	20	—	△0	△0
	買建	1,413	—	26	26	855	—	25	25
	株価指数オプション								
	売建								
	コール	—	—	—	—	—	—	—	—
	プット	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	買建								
	コール	—	—	—	—	—	—	—	—
	プット	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
店頭	株式先渡契約								
	売建	—	—	—	—	—	—	—	—
	買建	—	—	—	—	—	—	—	—
	株価指数先渡契約								
	売建	—	—	—	—	—	—	—	—
	買建	543	249	△6	△6	—	—	—	—
	株価指数オプション								
	売建								
	コール	—	—	—	—	—	—	—	—
	プット	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
買建									
コール	—	—	—	—	—	—	—	—	
プット	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	
合計				3				24	

(注) 1. ()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、先物取引および先渡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。

(d) 債券関連

(単位：億円)

区分	種類	2023年度末				2024年度上半期末			
		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		
取引所	円貨建債券先物								
	売建	16	—	△0	△0	76	—	0	0
	買建	—	—	—	—	261	—	0	0
	外貨建債券先物								
	売建	—	—	—	—	16	—	△0	△0
買建	591	—	2	2	1,520	—	2	2	
店頭	選択権付債券売買取引								
	売建								
	コール	—	—	—	—	294	—	1	0
	プット	(—)	(—)	—	—	(2)	(—)	—	—
	買建								
	コール	926	358	7	△51	888	341	2	△55
プット	(58)	(29)	—	—	(58)	(29)	—	—	
合計				△48				△53	

(注) 1. ()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。

(e) その他

2023年度末、2024年度上半期末に該当の残高はありません。

3. ヘッジ会計が適用されているもの

(a) 金利関連

(単位：億円)

区分	ヘッジ会計の方法	種類	主なヘッジ対象	2023年度末			2024年度上半期末												
				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	繰延ヘッジ	金利スワップ	保険負債	33,006	33,006	△3,130	△3,130	33,006	33,006	△3,167	△3,167								
		固定金利受取／変動金利支払 固定金利支払／変動金利受取																	
		金利スワップ	貸付金	—	—	—	—	—	—	—	—								
		固定金利受取／変動金利支払 固定金利支払／変動金利受取																	
合計											△3,130								△3,167

(注) 「差損益」欄には、時価を記載しています。

(参考) 金利スワップ契約の残存期間別構成

(単位：億円、%)

残存期間		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	
2023年度末	固定金利受取 ／変動金利支払 スワップ	想定元本	—	—	—	—	4,206	28,800	33,006
		平均受取固定金利	—	—	—	—	0.33	0.48	0.46
		平均支払変動金利	—	—	—	—	0.12	0.12	0.12
	固定金利支払 ／変動金利受取 スワップ	想定元本	—	—	—	—	—	—	—
		平均支払固定金利	—	—	—	—	—	—	—
		平均受取変動金利	—	—	—	—	—	—	—
2024年度上半期末	固定金利受取 ／変動金利支払 スワップ	想定元本	—	—	—	100	7,506	25,400	33,006
		平均受取固定金利	—	—	—	0.44	0.25	0.53	0.46
		平均支払変動金利	—	—	—	0.23	0.28	0.27	0.27
	固定金利支払 ／変動金利受取 スワップ	想定元本	—	—	—	—	—	—	—
		平均支払固定金利	—	—	—	—	—	—	—
		平均受取変動金利	—	—	—	—	—	—	—

(注) 平均支払変動金利・平均受取変動金利には、利息計算開始日を迎えていない金利を含んでいません。

(b) 通貨関連

(単位：億円)

区分	ヘッジ 会計 の方法	種類	主な ヘッジ 対象	2023年度末				2024年度上半期末				
				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	時価 ヘッジ	為替予約	外貨建 債券									
		売建		50,458	—	△1,322	△1,322	45,974	—	888	888	
		米ドル		36,980	—	△926	△926	33,258	—	814	814	
		ユーロ		11,467	—	△348	△348	11,050	—	94	94	
		買建		—	—	—	—	—	—	—	—	—
		米ドル		—	—	—	—	—	—	—	—	—
		ユーロ		—	—	—	—	—	—	—	—	—
		通貨オプション										
		売建										
		コール		—	—	—	—	2,166	—	17	20	
				(—)	(—)			(38)	(—)			
		米ドル		—	—	—	—	1,206	—	5	14	
				(—)	(—)			(19)	(—)			
		ユーロ		—	—	—	—	—	—	—	—	
				(—)	(—)			(—)	(—)			
		豪ドル		—	—	—	—	959	—	11	6	
				(—)	(—)			(18)	(—)			
		プット		—	—	—	—	—	—	—	—	
				(—)	(—)			(—)	(—)			
		米ドル		—	—	—	—	—	—	—	—	
				(—)	(—)			(—)	(—)			
		ユーロ		—	—	—	—	—	—	—	—	
				(—)	(—)			(—)	(—)			
		買建										
		コール		—	—	—	—	—	—	—	—	
				(—)	(—)			(—)	(—)			
米ドル	—	—	—	—	—	—	—	—				
	(—)	(—)			(—)	(—)						
ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—				
	(—)	(—)			(—)	(—)						
プット	—	—	—	—	2,166	—	88	50				
	(—)	(—)			(38)	(—)						
米ドル	—	—	—	—	1,206	—	59	39				
	(—)	(—)			(19)	(—)						
ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—				
	(—)	(—)			(—)	(—)						
豪ドル	—	—	—	—	959	—	29	10				
	(—)	(—)			(18)	(—)						
繰延 ヘッジ	為替予約	外国株式 予定取引										
	売建		—	—	—	—	—	—	—	—		
	米ドル		—	—	—	—	—	—	—	—		
	ユーロ		—	—	—	—	—	—	—	—		
	買建		—	—	—	—	4,389	—	△285	△285		
	米ドル		—	—	—	—	4,389	—	△285	△285		
	ユーロ		—	—	—	—	—	—	—	—		
通貨スワップ	外貨建 債券											
米ドル払/円受		62,015	60,153	△12,705	△12,705	61,019	58,580	△12,368	△12,368			
ユーロ払/円受		42,591	41,805	△8,995	△8,995	42,036	40,657	△8,624	△8,624			
	13,844	13,428	△2,731	△2,731	13,466	13,084	△2,672	△2,672				
合 計									△11,694			

(注) 1. ()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、先渡取引および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。

(c) 株式関連

(単位：億円)

区分	ヘッジ会計の方法	種類	主なヘッジ対象	2023年度末				2024年度上半期末			
				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	時価ヘッジ	株式先渡契約	国内株式	327	—	△31	△31	78	—	13	13
		売建		—	—	—	—	—	—	—	—
合 計							△31				13

(注) 「差損益」欄には、時価を記載しています。

(d) 債券関連

2023年度末、2024年度上半期末に該当の残高はありません。

(e) その他

2023年度末、2024年度上半期末に該当の残高はありません。