

2023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            | ..... | 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         | 2022年度末    |       | 2023年度<br>第2四半期(上半期)末 |       |
|-------------|------------|-------|-----------------------|-------|
|             | 金 額        | 占 率   | 金 額                   | 占 率   |
| 国 債         | 15,254,703 | 56.5  | 15,828,521            | 56.1  |
| 地 方 債       | 117,628    | 0.4   | 114,784               | 0.4   |
| 社 債         | 1,702,676  | 6.3   | 1,927,535             | 6.8   |
| うち公社・公団債    | 414,373    | 1.5   | 419,103               | 1.5   |
| 株 式         | 3,207,944  | 11.9  | 3,537,602             | 12.5  |
| 外 国 証 券     | 5,930,212  | 22.0  | 5,684,454             | 20.1  |
| 公 社 債       | 4,454,788  | 16.5  | 4,101,930             | 14.5  |
| 株 式 等       | 1,475,424  | 5.5   | 1,582,524             | 5.6   |
| そ の 他 の 証 券 | 798,919    | 3.0   | 1,123,189             | 4.0   |
| 合 計         | 27,012,086 | 100.0 | 28,216,087            | 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<br>3年以下 | 3年超<br>5年以下 | 5年超<br>7年以下 | 7年超<br>10年以下 | 10年超<br>(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年度第2四半期(上半期)末 |             |             |             |              |                         |            | 合 計 |
|             | 1年以下              | 1年超<br>3年以下 | 3年超<br>5年以下 | 5年超<br>7年以下 | 7年超<br>10年以下 | 10年超<br>(期間の定めのないものを含む) |            |     |
| 有 価 証 券     | 462,479           | 1,415,454   | 1,950,411   | 1,393,024   | 2,223,943    | 20,770,774              | 28,216,087 |     |
| 国 債         | 98,900            | 410,963     | 524,990     | 594,781     | 1,219,549    | 12,979,335              | 15,828,521 |     |
| 地 方 債       | -                 | 16,712      | 4,401       | 4           | 286          | 93,379                  | 114,784    |     |
| 社 債         | 87,043            | 209,375     | 244,913     | 145,855     | 200,390      | 1,039,957               | 1,927,535  |     |
| 株 式         | -                 | -           | -           | -           | -            | 3,537,602               | 3,537,602  |     |
| 外 国 証 券     | 261,257           | 715,545     | 677,775     | 527,867     | 627,974      | 2,874,033               | 5,684,454  |     |
| 公 社 債       | 247,820           | 674,730     | 604,096     | 374,917     | 457,181      | 1,743,183               | 4,101,930  |     |
| 株 式 等       | 13,437            | 40,814      | 73,678      | 152,950     | 170,793      | 1,130,850               | 1,582,524  |     |
| そ の 他 の 証 券 | 15,277            | 62,857      | 498,331     | 124,514     | 175,742      | 246,466                 | 1,123,189  |     |
| 買 入 金 銭 債 権 | 3,961             | 32,730      | 18,666      | 17,300      | 11,778       | 151,331                 | 235,769    |     |
| 譲 渡 性 預 金   | 91,997            | -           | -           | -           | -            | -                       | 91,997     |     |
| そ の 他       | -                 | -           | -           | -           | -            | 7,677                   | 7,677      |     |

(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<br>第2四半期(上半期)末 |       |
|-----------------|---------------------|-----------|-------|-----------------------|-------|
|                 |                     | 金 額       | 占 率   | 金 額                   | 占 率   |
| 水 産 ・ 農 林 業     |                     | 249       | 0.0   | 265                   | 0.0   |
| 鉱 業             |                     | 200       | 0.0   | 343                   | 0.0   |
| 建 設 業           |                     | 105,329   | 3.3   | 129,777               | 3.7   |
| 製 造 業           | 食 料 品               | 219,146   | 6.8   | 260,625               | 7.4   |
|                 | 織 維 製 品             | 20,793    | 0.6   | 18,659                | 0.5   |
|                 | パ ル プ ・ 紙           | 2,658     | 0.1   | 2,995                 | 0.1   |
|                 | 化 学                 | 171,356   | 5.3   | 180,882               | 5.1   |
|                 | 医 薬 品               | 100,977   | 3.1   | 98,783                | 2.8   |
|                 | 石 油 ・ 石 炭 製 品       | 3,555     | 0.1   | 4,364                 | 0.1   |
|                 | ゴ ム 製 品             | 19,424    | 0.6   | 21,514                | 0.6   |
|                 | ガ ラ ス ・ 土 石 製 品     | 107,765   | 3.4   | 125,971               | 3.6   |
|                 | 鉄 鋼                 | 34,402    | 1.1   | 38,491                | 1.1   |
|                 | 非 鉄 金 属             | 12,077    | 0.4   | 15,636                | 0.4   |
|                 | 金 属 製 品             | 32,076    | 1.0   | 33,367                | 0.9   |
|                 | 機 械                 | 219,057   | 6.8   | 229,961               | 6.5   |
|                 | 電 気 機 器             | 700,083   | 21.8  | 728,244               | 20.6  |
|                 | 輸 送 用 機 器           | 165,788   | 5.2   | 225,440               | 6.4   |
|                 | 精 密 機 器             | 148,682   | 4.6   | 159,646               | 4.5   |
|                 | そ の 他 製 品           | 85,966    | 2.7   | 100,058               | 2.8   |
| 電 気 ・ ガ ス 業     |                     | 37,210    | 1.2   | 45,336                | 1.3   |
| 運 輸 ・ 情 報 通 信 業 | 陸 運 業               | 178,867   | 5.6   | 179,227               | 5.1   |
|                 | 海 運 業               | 28        | 0.0   | 27                    | 0.0   |
|                 | 空 運 業               | 3,327     | 0.1   | 3,659                 | 0.1   |
|                 | 倉 庫 ・ 運 輸 関 連 業     | 4,520     | 0.1   | 4,965                 | 0.1   |
|                 | 情 報 ・ 通 信 業         | 102,384   | 3.2   | 110,642               | 3.1   |
| 商 業             | 卸 売 業               | 153,258   | 4.8   | 190,291               | 5.4   |
|                 | 小 売 業               | 114,908   | 3.6   | 117,009               | 3.3   |
| 金 融 ・ 保 険 業     | 銀 行 業               | 163,620   | 5.1   | 207,848               | 5.9   |
|                 | 証 券 ・ 商 品 先 物 取 引 業 | 618       | 0.0   | 920                   | 0.0   |
|                 | 保 険 業               | 6,143     | 0.2   | 7,389                 | 0.2   |
|                 | そ の 他 金 融 業         | 31,486    | 1.0   | 38,852                | 1.1   |
| 不 動 産 業         |                     | 16,633    | 0.5   | 20,049                | 0.6   |
| サ ー ビ ス 業       |                     | 245,345   | 7.6   | 236,352               | 6.7   |
| 合 計             |                     | 3,207,944 | 100.0 | 3,537,602             | 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<br>3年以下 | 3年超<br>5年以下 | 5年超<br>7年以下 | 7年超<br>10年以下 | 10年超<br>(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                  |           |
|                           | 固定金利  | 437,306 | 323,212     | 344,854     | 217,918     | 150,282      | 382,420                 | 1,855,994 |
|                           | 一般貸付計 | 447,949 | 401,428     | 394,415     | 290,699     | 193,719      | 736,534                 | 2,464,747 |
| 2023年度<br>第2四半期<br>(上半期)末 | 変動金利  | 51,002  | 66,299      | 71,848      | 83,880      | 65,167       | 449,635                 | 787,833   |
|                           | 固定金利  | 359,865 | 327,835     | 338,289     | 183,436     | 136,247      | 407,212                 | 1,752,886 |
|                           | 一般貸付計 | 410,868 | 394,134     | 410,137     | 267,316     | 201,415      | 856,847                 | 2,540,720 |

### （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<br>第2四半期(上半期)末 |                |
|---------------|-------------|------------------|----------------|-----------------------|----------------|
|               |             | 金額               | 占 率            | 金額                    | 占 率            |
| 大 企 業         | 貸付先数        | 204              | 60.7           | 207                   | 60.3           |
|               | 金 額         | 1,659,429        | 81.7           | 1,620,021             | 79.2           |
| 中 堅 企 業       | 貸付先数        | 5                | 1.5            | 4                     | 1.2            |
|               | 金 額         | 4,044            | 0.2            | 3,199                 | 0.2            |
| 中 小 企 業       | 貸付先数        | 127              | 37.8           | 132                   | 38.5           |
|               | 金 額         | 367,663          | 18.1           | 422,278               | 20.6           |
| 国内企業向け<br>貸付計 | 貸付先数<br>金 額 | 336<br>2,031,138 | 100.0<br>100.0 | 343<br>2,045,498      | 100.0<br>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<br>従業員<br>300名超        | 資本金10億円<br>以上               | 常用する<br>従業員<br>50名超 | 資本金10億円<br>以上                | 常用する<br>従業員<br>100名超 | 資本金10億円<br>以上               | 常用する<br>従業員<br>100名超 |
| 中 堅 企 業 | かつ                          | 資本金3億円超<br>10億円未満           | かつ                  | 資本金5千万円超<br>10億円未満           | かつ                   | 資本金5千万円超<br>10億円未満          | かつ                   |
| 中 小 企 業 | 資本金3億円以下又は<br>常用する従業員300名以下 | 資本金5千万円以下又は<br>常用する従業員50名以下 |                     | 資本金5千万円以下又は<br>常用する従業員100名以下 |                      | 資本金1億円以下又は<br>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<br>第2四半期(上半期)末 |       |
|---------------------------|-----------|-------|-----------------------|-------|
|                           | 金 額       | 占 率   | 金 額                   | 占 率   |
| 担 保 貸 付                   | 2,217     | 0.1   | 2,882                 | 0.1   |
| 有 価 証 券<br>担 保 貸 付        | 1,318     | 0.1   | 1,798                 | 0.1   |
| 不 動 産・動 産・<br>財 団 担 保 貸 付 | 899       | 0.0   | 1,083                 | 0.0   |
| 指 名 債 権<br>担 保 貸 付        | -         | -     | -                     | -     |
| 保 証 貸 付                   | 86,273    | 3.5   | 113,218               | 4.5   |
| 信 用 貸 付                   | 2,376,255 | 96.4  | 2,424,619             | 95.4  |
| そ の 他                     | -         | -     | -                     | -     |
| 一 般 貸 付 計                 | 2,464,747 | 100.0 | 2,540,720             | 100.0 |
| うち劣後特約付<br>貸              | 247,058   | 10.0  | 271,856               | 10.7  |

（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             |                 | 2022年度末   |           | 2023年度<br>第2四半期(上半期)末 |       |
|-----------------|-----------------|-----------|-----------|-----------------------|-------|
|                 |                 | 金 額       | 占 率       | 金 額                   | 占 率   |
| 国内向け            | 製 造 業           | 220,580   | 8.9       | 202,960               | 8.0   |
|                 | 食 料             | 27,479    | 1.1       | 26,293                | 1.0   |
|                 | 織 維             | 676       | 0.0       | 774                   | 0.0   |
|                 | 木 材 ・ 木 製 品     | 500       | 0.0       | 200                   | 0.0   |
|                 | パ ル プ ・ 紙       | 10,920    | 0.4       | 7,768                 | 0.3   |
|                 | 印 刷             | 17,500    | 0.7       | 16,250                | 0.6   |
|                 | 化 学             | 34,972    | 1.4       | 32,221                | 1.3   |
|                 | 石 油 ・ 石 炭       | 2,000     | 0.1       | 2,000                 | 0.1   |
|                 | 窯 業 ・ 土 石       | 19,195    | 0.8       | 19,104                | 0.8   |
|                 | 鉄 鋼             | 44,968    | 1.8       | 41,129                | 1.6   |
|                 | 非 鉄 金 属         | 5,288     | 0.2       | 5,432                 | 0.2   |
|                 | 金 属 製 品         | 950       | 0.0       | 600                   | 0.0   |
|                 | はん用・生産用・業務用機械   | 22,222    | 0.9       | 23,299                | 0.9   |
|                 | 電 気 機 械         | 14,438    | 0.6       | 9,367                 | 0.4   |
|                 | 輸 送 用 機 械       | 12,864    | 0.5       | 12,680                | 0.5   |
|                 | そ の 他 の 製 造 業   | 6,606     | 0.3       | 5,839                 | 0.2   |
|                 | 農 業 、 林 業       | -         | -         | -                     | -     |
|                 | 漁 業             | -         | -         | -                     | -     |
|                 | 鉱業、採石業、砂利採取業    | -         | -         | -                     | -     |
|                 | 建 設 業           | 15,762    | 0.6       | 16,475                | 0.6   |
|                 | 電気・ガス・熱供給・水道業   | 485,134   | 19.7      | 499,379               | 19.7  |
|                 | 情 報 通 信 業       | 67,124    | 2.7       | 58,400                | 2.3   |
|                 | 運 輸 業 、 郵 便 業   | 229,873   | 9.3       | 228,011               | 9.0   |
|                 | 卸 売 業           | 216,433   | 8.8       | 203,048               | 8.0   |
|                 | 小 売 業           | 8,909     | 0.4       | 8,906                 | 0.4   |
|                 | 金 融 業 、 保 険 業   | 719,225   | 29.2      | 791,136               | 31.1  |
|                 | 不 動 産 業         | 147,019   | 6.0       | 145,844               | 5.7   |
|                 | 物 品 賃 貸 業       | 91,577    | 3.7       | 83,392                | 3.3   |
|                 | 学術研究、専門・技術サービス業 | 4,450     | 0.2       | 4,422                 | 0.2   |
|                 | 宿 泊 業           | -         | -         | -                     | -     |
|                 | 飲 食 業           | -         | -         | -                     | -     |
|                 | 生活関連サービス業・娯楽業   | 11,507    | 0.5       | 11,139                | 0.4   |
|                 | 教 育 、 学 習 支 援 業 | -         | -         | -                     | -     |
| 医 療 ・ 福 祉       | 2,463           | 0.1       | 1,795     | 0.1                   |       |
| そ の 他 の サ ー ビ ス | 2,701           | 0.1       | 2,245     | 0.1                   |       |
| 地 方 公 共 団 体     | 12,006          | 0.5       | 10,826    | 0.4                   |       |
| 個人（住宅・消費・納税資金等） | -               | -         | -         | -                     |       |
| そ の 他           | -               | -         | -         | -                     |       |
| 合 計             | 2,234,768       | 90.7      | 2,267,987 | 89.3                  |       |
| 海外向け            | 政 府 等           | 4,484     | 0.2       | 10,017                | 0.4   |
|                 | 金 融 機 関         | -         | -         | -                     | -     |
|                 | 商 工 業 等         | 225,494   | 9.1       | 262,716               | 10.3  |
|                 | 合 計             | 229,978   | 9.3       | 272,733               | 10.7  |
| 一 般 貸 付 計       |                 | 2,464,747 | 100.0     | 2,540,720             | 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<br>第2四半期(上半期)末 |      |
|---------------|-----------|------|-----------------------|------|
|               | 金 額       | 占 率  | 金 額                   | 占 率  |
| 公 社 債         | 3,345,415 | 50.7 | 2,994,621             | 45.4 |
| 株 式           | 1,169,397 | 17.7 | 1,282,270             | 19.4 |
| 現 預 金 ・ そ の 他 | 422,964   | 6.4  | 547,787               | 8.3  |
| 小 計           | 4,937,777 | 74.8 | 4,824,680             | 73.2 |

##### 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<br>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 | 27,881  | 0.4 | 21,922                | 0.3 |
| 小 計           | 27,881  | 0.4 | 21,922                | 0.3 |

##### ③円貨建資産

（単位：百万円、％）

| 区 分              | 2022年度末   |      | 2023年度<br>第2四半期(上半期)末 |      |
|------------------|-----------|------|-----------------------|------|
|                  | 金 額       | 占 率  | 金 額                   | 占 率  |
| 非 居 住 者 貸 付      | 35,913    | 0.5  | 32,679                | 0.5  |
| 公 社 債 (円建外債)・その他 | 1,599,936 | 24.2 | 1,713,980             | 26.0 |
| 小 計              | 1,635,849 | 24.8 | 1,746,660             | 26.5 |

##### ④合 計

（単位：百万円、％）

| 区 分       | 2022年度末   |       | 2023年度<br>第2四半期(上半期)末 |       |
|-----------|-----------|-------|-----------------------|-------|
|           | 金 額       | 占 率   | 金 額                   | 占 率   |
| 海 外 投 融 資 | 6,601,508 | 100.0 | 6,593,263             | 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<br>第2四半期(上半期)末 |       |
|------------|-----------|-------|-----------------------|-------|
|            | 金 額       | 占 率   | 金 額                   | 占 率   |
| 米 ド ル      | 2,522,477 | 51.1  | 2,768,517             | 57.4  |
| オーストラリアドル  | 914,427   | 18.5  | 840,115               | 17.4  |
| ユ ー ロ      | 890,921   | 18.0  | 700,016               | 14.5  |
| イギリスポンド    | 172,040   | 3.5   | 167,749               | 3.5   |
| カナダドル      | 115,921   | 2.3   | 83,076                | 1.7   |
| 中 国 元      | 72,904    | 1.5   | 39,554                | 0.8   |
| ニュージーランドドル | 78,371    | 1.6   | 38,042                | 0.8   |
| そ の 他 共 計  | 4,937,777 | 100.0 | 4,824,680             | 100.0 |

## (3) 海外投融資の地域別構成

(単位：百万円、%)

| 区 分   | 2022年度末           |       |           |       |           |       |         |       |
|-------|-------------------|-------|-----------|-------|-----------|-------|---------|-------|
|       | 外国証券              |       | 公社債       |       | 株式等       |       | 非居住者貸付  |       |
|       | 金額                | 占率    | 金額        | 占率    | 金額        | 占率    | 金額      | 占率    |
| 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 |
| 区 分   | 2023年度第2四半期(上半期)末 |       |           |       |           |       |         |       |
|       | 外国証券              |       | 公社債       |       | 株式等       |       | 非居住者貸付  |       |
|       | 金額                | 占率    | 金額        | 占率    | 金額        | 占率    | 金額      | 占率    |
| 北 米   | 2,089,811         | 36.8  | 1,396,085 | 34.0  | 693,726   | 43.8  | 42,922  | 15.7  |
| ヨーロッパ | 1,422,791         | 25.0  | 1,031,302 | 25.1  | 391,488   | 24.7  | 90,135  | 33.0  |
| オセアニア | 605,653           | 10.7  | 597,662   | 14.6  | 7,991     | 0.5   | 94,827  | 34.8  |
| アジア   | 150,082           | 2.6   | 104,597   | 2.5   | 45,485    | 2.9   | 9,392   | 3.4   |
| 中南米   | 1,244,117         | 21.9  | 800,764   | 19.5  | 443,352   | 28.0  | 30,242  | 11.1  |
| 中 東   | 314               | 0.0   | -         | -     | 314       | 0.0   | -       | -     |
| アフリカ  | 165               | 0.0   | -         | -     | 165       | 0.0   | 5,214   | 1.9   |
| 国際機関  | 171,517           | 3.0   | 171,517   | 4.2   | -         | -     | -       | -     |
| 合 計   | 5,684,454         | 100.0 | 4,101,930 | 100.0 | 1,582,524 | 100.0 | 272,733 | 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  | △ 25,897 | △ 71,887 | -       | -    | -   | △ 97,785 | △ 55,776          | △ 106,567 | -       | -     | -   | △ 162,343 |
| ヘッジ会計非適用分 | 14,266   | △ 7,027  | △ 2,345 | 418  | 405 | 5,716    | 17,539            | △ 15,832  | △ 2,069 | △ 562 | 791 | △ 134     |
| 合 計       | △ 11,631 | △ 78,915 | △ 2,345 | 418  | 405 | △ 92,068 | △ 38,237          | △ 122,399 | △ 2,069 | △ 562 | 791 | △ 162,477 |

（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△51,669百万円）及び  
ヘッジ会計非適用分の差損益（△134百万円）の合計△51,803百万円

##### （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 | 10,000  | 10,000 | △ 338  | △ 338     | 500,000           | 180,000 | △ 1,679 | △ 1,679 |
|               | 固定金利支払/変動金利受取 | 10,000  | 10,000 | 338    | 338       | 67,800            | 67,800  | 1,527   | 1,527   |
|               | 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            | -       | -       | -       |
|               |               | (-)     | (-)    | -      | -         | (281)             | (-)     | 233     | 47      |
|               | 固定金利支払/変動金利受取 | -       | -      | -      | -         | 20,000            | -       | -       | -       |
|               |               | (-)     | (-)    | -      | -         | (281)             | (-)     | 347     | △ 66    |
|               | 買建            |         |        |        |           |                   |         |         |         |
| 固定金利受取/変動金利支払 | -             | -       | -      | -      | 10,000    | -                 | -       | -       |         |
|               | (-)           | (-)     | -      | -      | (282)     | (-)               | 243     | △ 38    |         |
| 固定金利支払/変動金利受取 | 1,580,000     | 635,000 | 34,020 | 14,266 | 2,230,000 | 1,995,000         | 54,338  | 17,748  |         |
|               | (19,754)      | (7,108) |        |        | (36,590)  | (32,524)          |         |         |         |
| 合 計           |               |         |        | 14,266 |           |                   |         | 17,539  |         |

（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<br>3年以下 | 3年超<br>5年以下 | 5年超<br>7年以下 | 7年超<br>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年度第2四半期(上半期)末 |             |             |             |              |        |         |
|                 | 1年以下              | 1年超<br>3年以下 | 3年超<br>5年以下 | 5年超<br>7年以下 | 7年超<br>10年以下 | 10年超   | 合計      |
| 円建受取側固定スワップ想定元本 | 320,000           | 100,000     | -           | -           | 70,000       | 10,000 | 500,000 |
| 平均受取固定金利        | 0.06              | 0.16        | -           | -           | 0.82         | 0.63   | 0.20    |
| 平均支払変動金利        | △ 0.03            | △ 0.00      | -           | -           | 0.03         | 0.01   | △ 0.02  |
| 円建支払側固定スワップ想定元本 | -                 | -           | 40,000      | 7,500       | -            | 20,300 | 67,800  |
| 平均支払固定金利        | -                 | -           | 0.37        | 0.47        | -            | 0.84   | 0.52    |
| 平均受取変動金利        | -                 | -           | 0.02        | △ 0.05      | -            | 0.01   | 0.01    |
| 合 計             | 320,000           | 100,000     | 40,000      | 7,500       | 70,000       | 30,300 | 567,800 |

## ②通貨関連

(単位：百万円)

| 区分          | 種類          | 2022年度末 |         |         | 2023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          | 369,137 | △ 4,514 | △ 4,514 | 488,950           | △ 12,245 | △ 12,245 |
|             | (米ドル)       | 116,964 | △ 870   | △ 870   | 165,887           | △ 7,020  | △ 7,020  |
|             | (オーストラリアドル) | 76,562  | 980     | 980     | 147,433           | △ 2,094  | △ 2,094  |
|             | (ユーロ)       | 52,526  | △ 2,045 | △ 2,045 | 85,053            | △ 1,434  | △ 1,434  |
|             | (イギリスポンド)   | 49,145  | △ 2,390 | △ 2,390 | 54,998            | △ 934    | △ 934    |
|             | (カナダドル)     | 18,506  | △ 94    | △ 94    | 18,572            | △ 741    | △ 741    |
|             | (その他)       | 55,432  | △ 94    | △ 94    | 17,005            | △ 20     | △ 20     |
|             | 買建          | 84,560  | 229     | 229     | 72,337            | △ 126    | △ 126    |
|             | (米ドル)       | 59,013  | 47      | 47      | 29,512            | 76       | 76       |
|             | (ユーロ)       | 2,301   | 54      | 54      | 20,563            | △ 338    | △ 338    |
|             | (オーストラリアドル) | 1,414   | 8       | 8       | 3,298             | 8        | 8        |
|             | (イギリスポンド)   | 2,630   | 49      | 49      | 2,090             | △ 4      | △ 4      |
|             | (カナダドル)     | 1,624   | -       | -       | 920               | -        | -        |
|             | (その他)       | 17,574  | 70      | 70      | 15,951            | 132      | 132      |
|             | 通貨オプション     |         |         |         |                   |          |          |
|             | 売建          |         |         |         |                   |          |          |
|             | プット         | -       |         |         | 13,026            |          |          |
|             | (米ドル)       | (-)     | -       | -       | (100)             | 2        | 98       |
|             | (その他)       | -       | -       | -       | (88)              | -        | 88       |
|             |             | -       | -       | -       | 4,051             |          |          |
|             |             | (-)     | -       | -       | (11)              | 2        | 9        |
|             | コール         | 49,272  |         |         | 2,842             |          |          |
|             | (米ドル)       | (311)   | 115     | 195     | (15)              | 10       | 4        |
|             |             | 49,272  |         |         | 2,842             |          |          |
|             |             | (311)   | 115     | 195     | (15)              | 10       | 4        |
|             | 買建          |         |         |         |                   |          |          |
| プット         | 188,951     |         |         | 202,400 |                   |          |          |
| (米ドル)       | (4,283)     | 1,345   | △ 2,938 | (3,678) | 139               | △ 3,538  |          |
| (オーストラリアドル) | 138,564     | 829     | △ 2,279 | (3,673) | 137               | △ 3,535  |          |
| (その他)       | 50,387      | 515     | △ 659   | 1,921   | 2                 | △ 3      |          |
|             | (1,174)     | -       | -       | (5)     |                   |          |          |
|             | -           | -       | -       | 3,557   |                   |          |          |
|             | (-)         | -       | -       | (-)     | -                 | -        |          |
| コール         | -           |         |         | 7,859   |                   |          |          |
| (米ドル)       | (-)         | -       | -       | (78)    | 53                | △ 24     |          |
| (ユーロ)       | -           | -       | -       | 5,489   |                   |          |          |
|             | (-)         | -       | -       | (65)    | 52                | △ 12     |          |
|             | -           | -       | -       | 2,370   |                   |          |          |
|             | (-)         | -       | -       | (12)    | 0                 | △ 11     |          |
| 合計          |             |         | △ 7,027 |         |                   | △ 15,832 |          |

- (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           | -       | -     | -       | 2,936             | 32    | 32      |
|     | 買建           | -       | -     | -       | 30,823            | △ 745 | △ 745   |
|     | 外貨建株価指数先物    |         |       |         |                   |       |         |
|     | 売建           | -       | -     | -       | 45,665            | 1,720 | 1,720   |
|     | 買建           | -       | -     | -       | 5,048             | △ 34  | △ 34    |
|     | 円建株価指数オプション  |         |       |         |                   |       |         |
|     | 買建           | 330,195 |       |         | 371,216           |       |         |
|     | プット          | (4,081) | 2,169 | △ 1,912 | (8,486)           | 4,657 | △ 3,828 |
|     | 外貨建株価指数オプション |         |       |         |                   |       |         |
| 買建  | 39,690       |         |       | 55,049  |                   |       |         |
| プット | (588)        | 155     | △ 433 | (1,587) | 704               | △ 883 |         |
| 店頭  | 国内株式先渡契約     |         |       |         |                   |       |         |
|     | 売建           | -       | -     | -       | 8,328             | 1,669 | 1,669   |
| 合計  |              |         |       | △ 2,345 |                   |       | △ 2,069 |

- (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。

④債券関連

(単位：百万円)

| 区分    | 種類          | 2022年度末 |      |         | 2023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      |         |      |         |                   |         |         |
|       | 買建          | -       | -    | -       | 128,042           | △ 622   | △ 622   |
|       | 外貨建債券先物     |         |      |         |                   |         |         |
|       | 売建          | -       | -    | -       | 80,490            | 1,649   | 1,649   |
|       | 買建          | -       | -    | -       | 79,125            | △ 1,574 | △ 1,574 |
| 店頭    | 外貨建債券先渡契約   |         |      |         |                   |         |         |
|       | 売建          | -       | -    | -       | 18,915            | 142     | 142     |
|       | 買建          | -       | -    | -       | 34,667            | △ 312   | △ 312   |
|       | 円建債券店頭オプション |         |      |         |                   |         |         |
|       | 売建          |         |      |         |                   |         |         |
|       | コール         | 29,124  |      |         | 215,877           |         |         |
|       | (25)        |         | 72   | △ 47    | (545)             | 843     | △ 298   |
|       | プット         | 95,842  |      |         | 12,623            |         |         |
|       | (341)       |         | 102  | 239     | (61)              | 57      | 3       |
|       | 買建          |         |      |         |                   |         |         |
| コール   | 95,842      |         |      | 12,623  |                   |         |         |
| (296) |             | 554     | 257  | (56)    | 32                | △ 23    |         |
| プット   | 29,124      |         |      | 215,877 |                   |         |         |
| (33)  |             | 0       | △ 32 | (634)   | 1,107             | 472     |         |
| 合計    |             |         |      | 418     |                   |         | △ 562   |

- (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 |
|    |                               |         |        |      |      |                   |        |     |     |
| 店頭 | クレジット・デフォルト・スワップ<br>プロテクション売建 | 68,000  | 26,600 | 446  | 446  | 100,150           | 42,100 | 791 | 791 |
|    | プロテクション買建                     | 7,000   | 7,000  | △ 40 | △ 40 | -                 | -      | -   | -   |
| 合計 |                               |         |        |      | 405  |                   |        |     | 791 |

(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<br>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  | △ 183    | △ 183    |
|             | 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 | △ 57,100 | △ 57,100 |
| 金利スワップの特例処理 | 円建金利スワップ<br>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   | 43       | 43       |
|             | 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 | 1,463    | 1,463    |
| 合計          |                           |         |         |         |          | △ 25,897 |                   |         |          | △ 55,776 |

(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           |             |             |             |              |         |         | 合計 |
|-----------------|-------------------|-------------|-------------|-------------|--------------|---------|---------|----|
|                 | 1年以下              | 1年超<br>3年以下 | 3年超<br>5年以下 | 5年超<br>7年以下 | 7年超<br>10年以下 | 10年超    |         |    |
| 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年度第2四半期（上半期）末 |             |             |             |              |         |         | 合計 |
|                 | 1年以下              | 1年超<br>3年以下 | 3年超<br>5年以下 | 5年超<br>7年以下 | 7年超<br>10年以下 | 10年超    |         |    |
| 円建受取側固定スワップ想定元本 | -                 | 2,300       | 10,600      | -           | 50,000       | 650,000 | 712,900 |    |
| 平均受取固定金利        | -                 | 1.19        | 0.10        | -           | 0.14         | 0.49    | 0.46    |    |
| 平均支払変動金利        | -                 | 0.07        | △ 0.01      | -           | 0.01         | 0.04    | 0.04    |    |
| 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              | -                 | 183,300     | 74,600      | -           | 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   | 310,111   | 297,161 | △ 15,273 | △ 15,273 | 603,599           | 590,364 | △ 54,897  | △ 54,897 |
|                   | (米ドル)       |         | 207,737   | 205,890 | △ 11,073 | △ 11,073 | 436,210           | 424,959 | △ 41,363  | △ 41,363 |
|                   | (ユーロ)       |         | 82,801    | 71,698  | △ 5,074  | △ 5,074  | 138,902           | 136,919 | △ 12,479  | △ 12,479 |
|                   | (イギリスポンド)   |         | 19,572    | 19,572  | 873      | 873      | 27,535            | 27,535  | △ 1,043   | △ 1,043  |
|                   | (オーストラリアドル) |         | -         | -       | -        | -        | 950               | 950     | △ 12      | △ 12     |
| 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 | 1,333,013         | -       | △ 60,237  | △ 60,237 |
|                   | (オーストラリアドル) |         | 640,128   | -       | 1,316    | 1,316    | 577,549           | -       | △ 11,888  | △ 11,888 |
|                   | (米ドル)       |         | 998,694   | -       | △ 42,438 | △ 42,438 | 531,948           | -       | △ 41,657  | △ 41,657 |
|                   | (ユーロ)       |         | 480,482   | -       | △ 14,633 | △ 14,633 | 169,781           | -       | △ 4,730   | △ 4,730  |
|                   | (イギリスポンド)   |         | 34,167    | -       | △ 1,325  | △ 1,325  | 26,557            | -       | △ 519     | △ 519    |
|                   | (カナダドル)     |         | 36,023    | -       | △ 769    | △ 769    | 11,752            | -       | △ 733     | △ 733    |
|                   | (その他)       |         | 54,210    | -       | 262      | 262      | 15,424            | -       | △ 708     | △ 708    |
|                   | 買建          |         | 94,813    | -       | 973      | 973      | 233,573           | -       | 8,568     | 8,568    |
|                   | (オーストラリアドル) |         | 67        | -       | △ 1      | △ 1      | 100,834           | -       | 1,774     | 1,774    |
|                   | (米ドル)       |         | 36,963    | -       | △ 26     | △ 26     | 88,683            | -       | 6,068     | 6,068    |
|                   | (ユーロ)       |         | 42,573    | -       | 1,035    | 1,035    | 28,776            | -       | 577       | 577      |
|                   | (イギリスポンド)   |         | 567       | -       | 26       | 26       | 14,244            | -       | 142       | 142      |
|                   | (カナダドル)     |         | 13,472    | -       | △ 67     | △ 67     | 1,034             | -       | 6         | 6        |
|                   | (その他)       |         | 1,169     | -       | 8        | 8        | -                 | -       | -         | -        |
| 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           | 368,715 | -         | -        |
|                   | (米ドル)       |         | 368,715   | 368,715 | -        | -        | 368,715           | 368,715 | -         | -        |
| 通貨スワップ            | 22,878      | 12,958  | -         | -       | 11,980   | 11,980   | -                 | -       |           |          |
| (米ドル)             | 22,878      | 12,958  | -         | -       | 11,980   | 11,980   | -                 | -       |           |          |
| 合 計               |             |         |           |         | △ 71,887 |          |                   |         | △ 106,567 |          |

(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

2022年度末、2023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

2022年度末、2023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。