

## 2024年度決算 補足資料

### < 目 次 >

#### I. 一般勘定

|                      |         |
|----------------------|---------|
| 1. 有価証券関係            |         |
| (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) 業種別株式保有明細表       | …… 2 頁  |
| (4) デリバティブ取引の時価情報    | …… 3 頁  |
| 2. 貸付金関係             |         |
| (1) 貸付金明細表           | …… 6 頁  |
| (2) 貸付金残存期間別残高       | …… 6 頁  |
| (3) 国内企業向け貸付金企業規模別内訳 | …… 7 頁  |
| (4) 貸付金業種別内訳         | …… 8 頁  |
| (5) 貸付金地域別内訳         | …… 9 頁  |
| (6) 貸付金担保別内訳         | …… 9 頁  |
| 3. 海外投融資関係           |         |
| (1) 資産別明細            | …… 10 頁 |
| (2) 外貨建資産の通貨別構成      | …… 11 頁 |
| (3) 海外投融資の地域別構成      | …… 11 頁 |

#### II. 個人変額保険・個人変額年金保険特別勘定

|                  |         |
|------------------|---------|
| 1. 売買目的有価証券の評価損益 | …… 12 頁 |
| 2. 金銭の信託の時価情報    | …… 12 頁 |
| 3. デリバティブ取引の時価情報 | …… 12 頁 |

#### III. 会社計

|                  |         |
|------------------|---------|
| 1. 売買目的有価証券の評価損益 | …… 13 頁 |
| 2. 有価証券の時価情報     | …… 13 頁 |
| 3. 金銭の信託の時価情報    | …… 15 頁 |
| 4. デリバティブ取引の時価情報 | …… 16 頁 |

## I. 一般勘定

### 1. 有価証券関係

#### (1) 有価証券明細表

(単位：百万円、%)

| 区 分         | 2023年度末   |       | 2024年度末   |       |
|-------------|-----------|-------|-----------|-------|
|             | 金 額       | 占 率   | 金 額       | 占 率   |
| 国 債         | 2,575,263 | 43.7  | 2,651,741 | 44.0  |
| 地 方 債       | 175,964   | 3.0   | 184,204   | 3.1   |
| 社 債         | 432,952   | 7.4   | 398,001   | 6.6   |
| うち公社・公団債    | 180,501   | 3.1   | 154,357   | 2.6   |
| 株 式         | 598,288   | 10.2  | 573,330   | 9.5   |
| 外 国 証 券     | 2,001,414 | 34.0  | 2,114,042 | 35.1  |
| 公 社 債       | 1,938,194 | 32.9  | 2,033,701 | 33.7  |
| 株 式 等       | 63,219    | 1.1   | 80,340    | 1.3   |
| そ の 他 の 証 券 | 104,821   | 1.8   | 105,889   | 1.8   |
| 合 計         | 5,888,705 | 100.0 | 6,027,210 | 100.0 |

#### (2) 有価証券残存期間別残高

(単位：百万円)

| 2023年度末     |         |             |             |             |              |                                 |           |
|-------------|---------|-------------|-------------|-------------|--------------|---------------------------------|-----------|
| 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<br>のないものを<br>含む) | 合計        |
| 有 価 証 券     | 100,643 | 75,583      | 343,410     | 519,010     | 974,075      | 3,875,982                       | 5,888,705 |
| 国 債         | 25,031  | 18,789      | 43,744      | 196,234     | 371,660      | 1,919,803                       | 2,575,263 |
| 地 方 債       | 2,903   | 2,642       | 43,102      | 27,491      | 9,326        | 90,499                          | 175,964   |
| 社 債         | 31,748  | 12,092      | 71,776      | 59,700      | 20,114       | 237,520                         | 432,952   |
| 株 式         | —       | —           | —           | —           | —            | 598,288                         | 598,288   |
| 外 国 証 券     | 40,959  | 42,059      | 184,787     | 235,584     | 572,974      | 925,048                         | 2,001,414 |
| 公 社 債       | 40,959  | 42,059      | 184,787     | 235,584     | 572,974      | 861,828                         | 1,938,194 |
| 株 式 等       | —       | —           | —           | —           | —            | 63,219                          | 63,219    |
| そ の 他 の 証 券 | —       | —           | —           | —           | —            | 104,821                         | 104,821   |
| 買 入 金 銭 債 権 | —       | —           | —           | —           | —            | 6,395                           | 6,395     |
| 譲 渡 性 預 金   | 94,000  | —           | —           | —           | —            | —                               | 94,000    |
| 合 計         | 194,643 | 75,583      | 343,410     | 519,010     | 974,075      | 3,882,377                       | 5,989,101 |
| 2024年度末     |         |             |             |             |              |                                 |           |
| 有 価 証 券     | 104,190 | 219,415     | 443,711     | 502,925     | 978,142      | 3,778,824                       | 6,027,210 |
| 国 債         | 58,160  | 70,292      | 105,937     | 233,987     | 398,806      | 1,784,557                       | 2,651,741 |
| 地 方 債       | 2,629   | 7,282       | 63,297      | 10,113      | 12,872       | 88,009                          | 184,204   |
| 社 債         | 6,376   | 47,763      | 66,140      | 38,462      | 21,617       | 217,641                         | 398,001   |
| 株 式         | —       | —           | —           | —           | —            | 573,330                         | 573,330   |
| 外 国 証 券     | 37,024  | 94,078      | 208,336     | 220,362     | 544,845      | 1,009,395                       | 2,114,042 |
| 公 社 債       | 37,024  | 94,078      | 208,336     | 220,362     | 544,845      | 929,054                         | 2,033,701 |
| 株 式 等       | —       | —           | —           | —           | —            | 80,340                          | 80,340    |
| そ の 他 の 証 券 | —       | —           | —           | —           | —            | 105,889                         | 105,889   |
| 買 入 金 銭 債 権 | —       | —           | —           | —           | —            | 1,904                           | 1,904     |
| 譲 渡 性 預 金   | 26,000  | —           | —           | —           | —            | —                               | 26,000    |
| 合 計         | 130,190 | 219,415     | 443,711     | 502,925     | 978,142      | 3,780,729                       | 6,055,115 |

(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) 業種別株式保有明細表

(単位：百万円、%)

| 区 分             |                   | 2023年度末 |       | 2024年度末 |       |
|-----------------|-------------------|---------|-------|---------|-------|
|                 |                   | 金 額     | 占 率   | 金 額     | 占 率   |
| 水 産 ・ 農 林 業     |                   | —       | —     | —       | —     |
| 鉱 業             |                   | 1,214   | 0.2   | 1,114   | 0.2   |
| 建 設 業           |                   | 21,856  | 3.7   | 25,974  | 4.5   |
| 製 造 業           | 食 料 品             | 23,577  | 3.9   | 23,241  | 4.1   |
|                 | 繊 維 製 品           | 26,951  | 4.5   | 36,806  | 6.4   |
|                 | パ ル プ ・ 紙         | 11,366  | 1.9   | 10,793  | 1.9   |
|                 | 化 学               | 37,385  | 6.2   | 33,212  | 5.8   |
|                 | 医 薬 品             | 21      | 0.0   | 21      | 0.0   |
|                 | 石 油 ・ 石 炭 製 品     | 6,919   | 1.2   | 7,332   | 1.3   |
|                 | ゴ ム 製 品           | 30      | 0.0   | 30      | 0.0   |
|                 | ガ ラ ス ・ 土 石 製 品   | 4,276   | 0.7   | 4,734   | 0.8   |
|                 | 鉄 鋼               | 1,294   | 0.2   | 939     | 0.2   |
|                 | 非 鉄 金 属           | 26,303  | 4.4   | 57,899  | 10.1  |
|                 | 金 属 製 品           | 1,457   | 0.2   | 1,367   | 0.2   |
|                 | 機 械               | 25,674  | 4.3   | 34,110  | 5.9   |
|                 | 電 気 機 器           | 31,750  | 5.3   | 24,533  | 4.3   |
|                 | 輸 送 用 機 器         | 97,999  | 16.4  | 61,169  | 10.7  |
|                 | 精 密 機 器           | 1,733   | 0.3   | 1,606   | 0.3   |
|                 | そ の 他 製 品         | 10,044  | 1.7   | 9,673   | 1.7   |
| 電 気 ・ ガ ス 業     |                   | 7,752   | 1.3   | 3,869   | 0.7   |
| 運 輸 ・ 情 報 通 信 業 | 陸 運 業             | 13,486  | 2.3   | 12,055  | 2.1   |
|                 | 海 運 業             | 13,840  | 2.3   | 15,574  | 2.7   |
|                 | 空 運 業             | 77      | 0.0   | 77      | 0.0   |
|                 | 倉 庫 ・ 運 輸 関 連 業   | 7,429   | 1.2   | 12,538  | 2.2   |
|                 | 情 報 ・ 通 信 業       | 410     | 0.1   | 416     | 0.1   |
| 商 業             | 卸 売 業             | 127,475 | 21.3  | 100,988 | 17.6  |
|                 | 小 売 業             | 19,670  | 3.3   | 17,960  | 3.1   |
| 金 融 ・ 保 険 業     | 銀 行 業             | 20,849  | 3.5   | 23,737  | 4.1   |
|                 | 証 券、商 品 先 物 取 引 業 | 6,016   | 1.0   | 5,527   | 1.0   |
|                 | 保 険 業             | 8,136   | 1.4   | 9,678   | 1.7   |
|                 | そ の 他 金 融 業       | 5,314   | 0.9   | 5,188   | 0.9   |
| 不 動 産 業         |                   | 35,104  | 5.9   | 28,505  | 5.0   |
| サ ー ビ ス 業       |                   | 2,868   | 0.5   | 2,649   | 0.5   |
| 合 計             |                   | 598,288 | 100.0 | 573,330 | 100.0 |

(4) デリバティブ取引の時価情報（ヘッジ会計適用・非適用分の合算値：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）

| 2023年度末   |      |         |      |      |     |         |
|-----------|------|---------|------|------|-----|---------|
|           | 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 | －    | △18,130 | －    | －    | －   | △18,130 |
| 合計        | －    | △18,130 | －    | －    | －   | △18,130 |
| 2024年度末   |      |         |      |      |     |         |
|           | 金利関連 | 通貨関連    | 株式関連 | 債券関連 | その他 | 合計      |
| ヘッジ会計適用分  | －    | －       | －    | －    | －   | －       |
| ヘッジ会計非適用分 | －    | △7,218  | －    | －    | －   | △7,218  |
| 合計        | －    | △7,218  | －    | －    | －   | △7,218  |

（注）ヘッジ会計非適用分の差損益については、損益計算書に計上しています。

②金利関連

2023年度末、2024年度末ともに該当する残高はありません。

③通貨関連

(単位：百万円)

| 区分 | 種類      | 2023年度末 |        |         |         | 2024年度末 |        |        |        |
|----|---------|---------|--------|---------|---------|---------|--------|--------|--------|
|    |         | 契約額等    | 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      | 464,792 | 49,780 | △18,387 | △18,387 | 480,051 | 66,355 | △7,929 | △7,929 |
|    | 米ドル     | 184,242 | 35,459 | △11,340 | △11,340 | 203,868 | 47,768 | △4,629 | △4,629 |
|    | ユーロ     | 215,192 | 14,320 | △5,891  | △5,891  | 229,050 | 18,587 | △3,508 | △3,508 |
|    | 豪ドル     | 65,358  | —      | △1,155  | △1,155  | 47,132  | —      | 208    | 208    |
|    | 買建      | —       | —      | —       | —       | 106     | —      | 0      | 0      |
|    | 米ドル     | —       | —      | —       | —       | 106     | —      | 0      | 0      |
|    | 通貨オプション |         |        |         |         |         |        |        |        |
|    | 売建      |         |        |         |         |         |        |        |        |
|    | ユーロ     | 19,813  | —      |         |         | 4,572   | —      |        |        |
|    |         | (254)   |        | 595     | △341    | (73)    |        | 38     | 34     |
|    | 米ドル     | 10,216  | —      |         |         | 4,572   | —      |        |        |
|    |         | (131)   |        | 382     | △250    | (73)    |        | 38     | 34     |
|    | ユーロ     | 9,597   | —      |         |         | —       | —      |        |        |
|    |         | (123)   |        | 213     | △90     | (—)     |        | —      | —      |
|    | 買建      |         |        |         |         |         |        |        |        |
|    | プット     | 19,375  | —      |         |         | 4,476   | —      |        |        |
|    |         | (254)   |        | 47      | △206    | (73)    |        | 92     | 18     |
| 店頭 | 米ドル     | 9,966   | —      |         |         | 4,476   | —      |        |        |
|    |         | (131)   |        | 20      | △111    | (73)    |        | 92     | 18     |
|    | ユーロ     | 9,408   | —      |         |         | —       | —      |        |        |
|    |         | (123)   |        | 27      | △95     | (—)     |        | —      | —      |
|    | 通貨スワップ  | 5,700   | 5,700  | 805     | 805     | 5,700   | 5,700  | 657    | 657    |
|    | 円払／豪ドル受 | 5,700   | 5,700  | 805     | 805     | 5,700   | 5,700  | 657    | 657    |
|    | 合計      |         |        |         | △18,130 |         |        |        | △7,218 |

- (注) 1. 各期末の為替相場は先物相場を使用しています。
2. 外貨建金銭債権債務等に先物為替予約が付されていることにより決済時における円貨額が確定している外貨建金銭債権債務等で、貸借対照表において当該円貨額で表示されているものについては、開示の対象から除いています。
3. ( ) 内にはオプション料を記載しています。
4. 差損益欄には、為替予約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

2023年度末、2024年度末ともに該当する残高はありません。

⑤債券関連

2023年度末、2024年度末ともに該当する残高はありません。

⑥その他

2023年度末、2024年度末ともに該当する残高はありません。

## デリバティブ取引のリスク管理等

### （１）利用目的

当社では、主に資産または負債のリスクヘッジを目的にデリバティブ取引を行っています。

資産の安定的な運用のため現物資産に係る市場リスクなどのヘッジやコントロール、個人変額保険・個人変額年金保険に係る最低保証リスク（最低保証に関する責任準備金の変動による期間損益の変動リスク）の軽減を目的として利用しています。

### （２）取引の内容

運用対象としているデリバティブ取引は以下の通りです。

- ① 株式関連 国内外株価指数先物取引・国内外株価指数オプション取引・個別株券オプション取引等
- ② 債券関連 国内債券先物取引・国内外債券オプション取引
- ③ 通貨関連 先物為替予約取引・通貨オプション取引・通貨スワップ取引
- ④ 金利関連 金利スワップ取引

### （３）リスクの内容

デリバティブ取引のリスクには、市場関連リスクと信用リスク並びに事務リスク・法務リスクがあります。

#### ① 市場関連リスクについて

市場リスクにはヘッジ対象である株式、債券、通貨の価格変動や金利変動によってもたらされるリスクに加えて、オプション取引に見られるような市場変動性（ボラティリティ）など、デリバティブ固有のリスクも含まれています。

従って、市場リスクについては現物資産と合わせたポジション管理を行うと同時にデリバティブ取引そのもののリスクのモニタリングも行っています。

#### ② 信用リスクについて

デリバティブ取引に付随する取引相手先のデフォルト（債務不履行）により、デリバティブ・ポジションから期待する経済効果を得られない信用リスクについて認識し、管理しています。

#### ③ 事務リスク・法務リスクについて

当社のデリバティブ取引実行に際しては取引実行部門と独立した事務管理部門が取引先の管理部門と照合を行うなど、相互牽制機能が働く体制としています。また、取引開始に際しては契約書の内容精査など法務リスクに配慮し、状況に応じて弁護士など専門家の意見を聴取するなどの対応を行っています。

### （４）リスク管理体制

当社では取引実行部門とリスク管理担当部門を分離独立させ、相互牽制機能が発揮できる体制を確立しています。

具体的な管理・報告体制は以下の通りです。

- ① 価格変動リスクのモニタリングとリスク管理担当への報告
- ② 価格変動リスクのモニタリングとリスク管理責任者への報告
- ③ 市場関連リスク管理分会、信用リスク管理分会への報告
- ④ リスク管理会議への報告
- ⑤ 経営会議、取締役会への報告
- ⑥ 監査部門による規定遵守状況確認

2. 貸付金関係

(1) 貸付金明細表

(単位：百万円、%)

| 区 分                 | 2023年度末   |        | 2024年度末   |        |
|---------------------|-----------|--------|-----------|--------|
|                     | 金 額       | 占 率    | 金 額       | 占 率    |
| 保 険 約 款 貸 付         | 30,738    | 3.6    | 28,311    | 3.4    |
| 保 険 料 振 替 貸 付       | 3,495     | 0.4    | 3,211     | 0.4    |
| 契 約 者 貸 付           | 27,243    | 3.2    | 25,099    | 3.0    |
| 一 般 貸 付             | 833,901   | 96.4   | 807,755   | 96.6   |
| (うち非居住者貸付)          | —         | —      | —         | —      |
| 企 業 貸 付             | 693,740   | 80.2   | 686,939   | 82.2   |
| (うち国内企業向け)          | (693,740) | (80.2) | (686,939) | (82.2) |
| 国・国際機関・政府関係機関貸付     | 66        | 0.0    | 85        | 0.0    |
| 公 共 団 体 ・ 公 企 業 貸 付 | 23,007    | 2.7    | 22,601    | 2.7    |
| 住 宅 ロ ー ン           | 8,159     | 0.9    | 403       | 0.0    |
| 消 費 者 ロ ー ン         | 108,663   | 12.6   | 97,521    | 11.7   |
| そ の 他               | 265       | 0.0    | 205       | 0.0    |
| 合 計                 | 864,640   | 100.0  | 836,066   | 100.0  |

(2) 貸付金残存期間別残高

(単位：百万円)

| 2023年度末 |        |             |             |             |              |                             |         |
|---------|--------|-------------|-------------|-------------|--------------|-----------------------------|---------|
| 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<br>ものを含む) | 合計      |
| 変動金利    | 721    | 122         | 1,321       | 216         | 1,969        | 6,879                       | 11,230  |
| 固定金利    | 47,483 | 169,502     | 132,955     | 114,933     | 135,001      | 222,793                     | 822,670 |
| 一般貸付計   | 48,205 | 169,625     | 134,277     | 115,149     | 136,971      | 229,673                     | 833,901 |
| 2024年度末 |        |             |             |             |              |                             |         |
| 変動金利    | 13     | 879         | 44          | 3,494       | 43           | —                           | 4,476   |
| 固定金利    | 91,048 | 135,250     | 122,653     | 117,956     | 119,920      | 216,450                     | 803,278 |
| 一般貸付計   | 91,061 | 136,129     | 122,698     | 121,450     | 119,964      | 216,450                     | 807,755 |

(3) 国内企業向け貸付金企業規模別内訳

(単位：件、百万円、%)

| 区 分             |      | 2023年度末 |       | 2024年度末 |       |
|-----------------|------|---------|-------|---------|-------|
|                 |      |         | 占 率   |         | 占 率   |
| 大 企 業           | 貸付先数 | 70      | 76.1  | 70      | 76.9  |
|                 | 金 額  | 652,843 | 94.1  | 648,667 | 94.4  |
| 中 堅 企 業         | 貸付先数 | 1       | 1.1   | 1       | 1.1   |
|                 | 金 額  | 500     | 0.1   | 500     | 0.1   |
| 中 小 企 業         | 貸付先数 | 21      | 22.8  | 20      | 22.0  |
|                 | 金 額  | 40,396  | 5.8   | 37,771  | 5.5   |
| 国内企業向け<br>貸 付 計 | 貸付先数 | 92      | 100.0 | 91      | 100.0 |
|                 | 金 額  | 693,740 | 100.0 | 686,939 | 100.0 |

(注) 1. 業種の区分は以下のとおりです。

| 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                        |                   |
|---------|-----------------------------|-------------------|-----------------------------|--------------------|------------------------------|--------------------|-----------------------------|-------------------|
| 大 企 業   | 従業員<br>300名超<br>かつ          | 資本金10億円以上         | 従業員<br>50名超<br>かつ           | 資本金10億円以上          | 従業員<br>100名超<br>かつ           | 資本金10億円以上          | 従業員<br>100名超<br>かつ          | 資本金10億円以上         |
| 中 堅 企 業 |                             | 資本金3億円超<br>10億円未満 |                             | 資本金5千万円超<br>10億円未満 |                              | 資本金5千万円超<br>10億円未満 |                             | 資本金1億円超<br>10億円未満 |
| 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 |                   |

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。

(4) 貸付金業種別内訳

(単位：百万円、%)

| 区 分                           |                          | 2023年度末                 |       | 2024年度末 |       |     |
|-------------------------------|--------------------------|-------------------------|-------|---------|-------|-----|
|                               |                          | 金 額                     | 占 率   | 金 額     | 占 率   |     |
| 国 内                           | 製 造 業                    | 84,998                  | 10.2  | 85,217  | 10.5  |     |
|                               | 食 料 維 生 品                | 2,400                   | 0.3   | 1,200   | 0.1   |     |
|                               | 織 維                      | —                       | —     | —       | —     |     |
|                               | 木 材 ・ 木 製 品              | —                       | —     | —       | —     |     |
|                               | パ ル プ ・ 紙                | 29,500                  | 3.5   | 31,500  | 3.9   |     |
|                               | 印 刷                      | —                       | —     | —       | —     |     |
|                               | 化 学                      | 10,250                  | 1.2   | 10,200  | 1.3   |     |
|                               | 石 油 ・ 石 炭                | 21,000                  | 2.5   | 21,000  | 2.6   |     |
|                               | 窯 業 ・ 土 石                | 2,964                   | 0.4   | 3,186   | 0.4   |     |
|                               | 鉄 鋼                      | 3,000                   | 0.4   | —       | —     |     |
|                               | 非 鉄 金 属 製 品              | 5,317                   | 0.6   | 5,317   | 0.7   |     |
|                               | 金 属 製 品                  | —                       | —     | —       | —     |     |
|                               | はん 用 ・ 生 産 用 ・ 業 務 用 機 械 | 3,900                   | 0.5   | 2,830   | 0.4   |     |
|                               | 電 気 機 械                  | 1,500                   | 0.2   | 4,850   | 0.6   |     |
|                               | 輸 送 用 機 械                | 5,100                   | 0.6   | 5,100   | 0.6   |     |
|                               | そ の 他 の 製 造 業            | 66                      | 0.0   | 33      | 0.0   |     |
|                               | 向 け                      | 農 業 、 林 業               | —     | —       | —     | —   |
|                               |                          | 漁 業                     | —     | —       | —     | —   |
|                               |                          | 鉱 業 、 採 石 業 、 砂 利 採 取 業 | 45    | 0.0     | 45    | 0.0 |
| 建 設 業                         |                          | 3,520                   | 0.4   | 3,304   | 0.4   |     |
| 電 気 ・ ガ ス ・ 熱 供 給 ・ 水 道 業     |                          | 75,236                  | 9.0   | 76,937  | 9.5   |     |
| 情 報 通 信 業                     |                          | 20,000                  | 2.4   | 20,000  | 2.5   |     |
| 運 輸 業 、 郵 便 業                 |                          | 44,736                  | 5.4   | 47,944  | 5.9   |     |
| 卸 売 業                         |                          | 206,127                 | 24.7  | 201,117 | 24.9  |     |
| 小 売 業                         |                          | —                       | —     | —       | —     |     |
| 金 融 業 、 保 険 業                 |                          | 165,158                 | 19.8  | 153,696 | 19.0  |     |
| 不 動 産 業                       |                          | 102,845                 | 12.3  | 102,472 | 12.7  |     |
| 物 品 賃 貸 業                     |                          | 11,139                  | 1.3   | 16,256  | 2.0   |     |
| 学 術 研 究 、 専 門 ・ 技 術 サ ー ビ ス 業 |                          | —                       | —     | —       | —     |     |
| 宿 泊 業                         |                          | —                       | —     | —       | —     |     |
| 飲 食 業                         |                          | —                       | —     | —       | —     |     |
| 生 活 関 連 サ ー ビ ス 業 、 娯 楽 業     |                          | —                       | —     | —       | —     |     |
| 教 育 、 学 習 支 援 業               |                          | —                       | —     | —       | —     |     |
| 医 療 ・ 福 祉                     |                          | 265                     | 0.0   | 205     | 0.0   |     |
| そ の 他 の サ ー ビ ス               |                          | —                       | —     | 33      | 0.0   |     |
| 地 方 公 共 団 体                   |                          | 3,007                   | 0.4   | 2,601   | 0.3   |     |
| 個 人 （ 住 宅 ・ 消 費 ・ 納 税 資 金 等 ） |                          | 116,822                 | 14.0  | 97,924  | 12.1  |     |
| そ の 他                         |                          | —                       | —     | —       | —     |     |
| 合 計                           |                          | 833,901                 | 100.0 | 807,755 | 100.0 |     |
| 海 外 向 け                       | 政 府 等                    | —                       | —     | —       | —     |     |
|                               | 金 融 機 関 等                | —                       | —     | —       | —     |     |
|                               | 商 工 業 等                  | —                       | —     | —       | —     |     |
|                               | 合 計                      | —                       | —     | —       | —     |     |
| 一 般 貸 付 計                     |                          | 833,901                 | 100.0 | 807,755 | 100.0 |     |

(5) 貸付金地域別内訳

(単位：百万円、%)

| 区 分   | 2023年度末 |       | 2024年度末 |       |
|-------|---------|-------|---------|-------|
|       | 金 額     | 占 率   | 金 額     | 占 率   |
| 北 海 道 | 4,500   | 0.6   | 4,500   | 0.6   |
| 東 北   | 8,567   | 1.2   | 8,317   | 1.2   |
| 関 東   | 583,740 | 81.4  | 584,545 | 82.3  |
| 中 部   | 72,228  | 10.1  | 60,014  | 8.5   |
| 近 畿   | 31,382  | 4.4   | 33,841  | 4.8   |
| 中 国   | 4,590   | 0.6   | 6,570   | 0.9   |
| 四 国   | 1,000   | 0.1   | 1,000   | 0.1   |
| 九 州   | 11,069  | 1.5   | 11,041  | 1.6   |
| 合 計   | 717,078 | 100.0 | 709,830 | 100.0 |

- (注) 1. 住宅ローン、消費者ローン、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) 貸付金担保別内訳

(単位：百万円、%)

| 区 分       |                           | 2023年度末 |       | 2024年度末 |       |
|-----------|---------------------------|---------|-------|---------|-------|
|           |                           | 金 額     | 占 率   | 金 額     | 占 率   |
| 担 保 貸 付   |                           | 365     | 0.0   | 305     | 0.0   |
|           | 有 価 証 券 担 保 貸 付           | —       | —     | —       | —     |
|           | 不 動 産 ・ 動 産 ・ 財 団 担 保 貸 付 | 365     | 0.0   | 305     | 0.0   |
|           | 指 名 債 権 担 保 貸 付           | —       | —     | —       | —     |
| 保 証 貸 付   |                           | 2,437   | 0.3   | 2,117   | 0.3   |
| 信 用 貸 付   |                           | 714,276 | 85.7  | 707,407 | 87.6  |
| そ の 他     |                           | 116,822 | 14.0  | 97,924  | 12.1  |
| 一 般 貸 付 計 |                           | 833,901 | 100.0 | 807,755 | 100.0 |
|           | う ち 劣 後 特 約 付 貸 付         | 128,000 | 15.3  | 128,000 | 15.8  |

### 3. 海外投融資関係

#### (1) 資産別明細

##### ①外貨建資産

(単位：百万円、%)

| 区 分           | 2023年度末   |      | 2024年度末   |      |
|---------------|-----------|------|-----------|------|
|               | 金 額       | 占 率  | 金 額       | 占 率  |
| 公 社 債         | 2,050,413 | 89.3 | 2,138,261 | 89.8 |
| 株 式           | —         | —    | —         | —    |
| 現 預 金 ・ そ の 他 | 143,730   | 6.3  | 149,027   | 6.3  |
| 小 計           | 2,194,143 | 95.5 | 2,287,288 | 96.0 |

##### ②円貨額が確定した外貨建資産

(単位：百万円、%)

| 区 分           | 2023年度末 |     | 2024年度末 |     |
|---------------|---------|-----|---------|-----|
|               | 金 額     | 占 率 | 金 額     | 占 率 |
| 公 社 債         | —       | —   | —       | —   |
| 現 預 金 ・ そ の 他 | 2,977   | 0.1 | 2,984   | 0.1 |
| 小 計           | 2,977   | 0.1 | 2,984   | 0.1 |

##### ③円貨建資産

(単位：百万円、%)

| 区 分                       | 2023年度末 |     | 2024年度末 |     |
|---------------------------|---------|-----|---------|-----|
|                           | 金 額     | 占 率 | 金 額     | 占 率 |
| 非 居 住 者 貸 付               | —       | —   | —       | —   |
| 公 社 債 ( 円 建 外 債 ) ・ そ の 他 | 100,217 | 4.4 | 91,220  | 3.8 |
| 小 計                       | 100,217 | 4.4 | 91,220  | 3.8 |

##### ④合 計

(単位：百万円、%)

| 区 分       | 2023年度末   |       | 2024年度末   |       |
|-----------|-----------|-------|-----------|-------|
|           | 金 額       | 占 率   | 金 額       | 占 率   |
| 海 外 投 融 資 | 2,297,338 | 100.0 | 2,381,494 | 100.0 |

※ 「円貨額が確定した外貨建資産」は、為替予約が付されていることにより決済時の円貨額が確定し、当該円貨額を資産の貸借対照表価額としているものです。

## (2) 外貨建資産の通貨別構成

(単位：百万円、%)

| 区 分         | 2023年度末   |       | 2024年度末   |       |
|-------------|-----------|-------|-----------|-------|
|             | 金 額       | 占 率   | 金 額       | 占 率   |
| 豪 ド ル       | 1,350,746 | 61.6  | 1,356,264 | 59.3  |
| 米 ド ル       | 634,370   | 28.9  | 719,792   | 31.5  |
| ユ ー ロ       | 209,004   | 9.5   | 211,211   | 9.2   |
| ス イ ス フ ラ ン | 20        | 0.0   | 18        | 0.0   |
| そ の 他       | 0         | 0.0   | 1         | 0.0   |
| 合 計         | 2,194,143 | 100.0 | 2,287,288 | 100.0 |

## (3) 海外投融資の地域別構成

(単位：百万円、%)

（単位：百万円、％）

| 2023年度末   |           |       |           |       |        |       |             |     |  |
|-----------|-----------|-------|-----------|-------|--------|-------|-------------|-----|--|
| 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 |  |
| 北 米       | 534,970   | 26.7  | 527,169   | 27.2  | 7,801  | 12.3  | —           | —   |  |
| ヨ ー ロ ッ パ | 440,965   | 22.0  | 385,547   | 19.9  | 55,418 | 87.7  | —           | —   |  |
| オ セ ア ニ ア | 827,213   | 41.3  | 827,213   | 42.7  | —      | —     | —           | —   |  |
| ア ジ ア     | —         | —     | —         | —     | —      | —     | —           | —   |  |
| 中 南 米     | —         | —     | —         | —     | —      | —     | —           | —   |  |
| 中 東       | —         | —     | —         | —     | —      | —     | —           | —   |  |
| ア フ リ カ   | —         | —     | —         | —     | —      | —     | —           | —   |  |
| 国 際 機 関   | 198,264   | 9.9   | 198,264   | 10.2  | —      | —     | —           | —   |  |
| 合 計       | 2,001,414 | 100.0 | 1,938,194 | 100.0 | 63,219 | 100.0 | —           | —   |  |
| 2024年度末   |           |       |           |       |        |       |             |     |  |
| 北 米       | 617,612   | 29.2  | 591,383   | 29.1  | 26,228 | 32.6  | —           | —   |  |
| ヨ ー ロ ッ パ | 443,812   | 21.0  | 389,700   | 19.2  | 54,112 | 67.4  | —           | —   |  |
| オ セ ア ニ ア | 857,171   | 40.5  | 857,171   | 42.1  | —      | —     | —           | —   |  |
| ア ジ ア     | —         | —     | —         | —     | —      | —     | —           | —   |  |
| 中 南 米     | —         | —     | —         | —     | —      | —     | —           | —   |  |
| 中 東       | —         | —     | —         | —     | —      | —     | —           | —   |  |
| ア フ リ カ   | —         | —     | —         | —     | —      | —     | —           | —   |  |
| 国 際 機 関   | 195,446   | 9.2   | 195,446   | 9.6   | —      | —     | —           | —   |  |
| 合 計       | 2,114,042 | 100.0 | 2,033,701 | 100.0 | 80,340 | 100.0 | —           | —   |  |

## Ⅱ．個人変額保険・個人変額年金保険特別勘定

### 1．売買目的有価証券の評価損益

(個人変額保険)

(単位：百万円)

| 区 分      | 2023年度末      |                    | 2024年度末      |                    |
|----------|--------------|--------------------|--------------|--------------------|
|          | 貸借対照表<br>計上額 | 当期の損益に含まれた<br>評価損益 | 貸借対照表<br>計上額 | 当期の損益に含まれた<br>評価損益 |
| 売買目的有価証券 | 70,257       | 9,267              | 64,184       | △5,473             |
| 公社債      | 18,306       | △324               | 17,788       | △821               |
| 株式       | 25,907       | 5,355              | 21,798       | △2,770             |
| 外国証券     | 21,861       | 3,664              | 21,039       | △1,511             |
| 公社債      | 7,939        | 643                | 7,749        | △470               |
| 株式等      | 13,922       | 3,020              | 13,289       | △1,040             |
| その他の証券   | 4,181        | 572                | 3,558        | △370               |

(注) 「当期の損益に含まれた評価損益」には振戻損益を含んでいます。

(個人変額年金保険)

(単位：百万円)

| 区 分      | 2023年度末      |                    | 2024年度末      |                    |
|----------|--------------|--------------------|--------------|--------------------|
|          | 貸借対照表<br>計上額 | 当期の損益に含まれた<br>評価損益 | 貸借対照表<br>計上額 | 当期の損益に含まれた<br>評価損益 |
| 売買目的有価証券 | 14,717       | 907                | 12,329       | △1,101             |
| 公社債      | 7,574        | △143               | 6,704        | △306               |
| 株式       | 3,429        | 589                | 2,519        | △466               |
| 外国証券     | 2,694        | 489                | 2,273        | △251               |
| 公社債      | 892          | 68                 | 638          | △53                |
| 株式等      | 1,801        | 420                | 1,634        | △197               |
| その他の証券   | 1,018        | △27                | 831          | △76                |

(注) 「当期の損益に含まれた評価損益」には振戻損益を含んでいます。

### 2．金銭の信託の時価情報

個人変額保険、個人変額年金保険ともに残高がないため、記載していません。

### 3．デリバティブ取引の時価情報

個人変額保険、個人変額年金保険ともに残高がないため、記載していません。

### Ⅲ．会社計

#### １．売買目的有価証券の評価損益

(単位：百万円)

| 区 分         | 2023年度末      |                    | 2024年度末      |                    |
|-------------|--------------|--------------------|--------------|--------------------|
|             | 貸借対照表<br>計上額 | 当期の損益に含まれた<br>評価損益 | 貸借対照表<br>計上額 | 当期の損益に含まれた<br>評価損益 |
| 売買目的有価証券    | 220,146      | 23,726             | 202,677      | △15,220            |
| 公 社 債       | 89,931       | △1,561             | 85,566       | △3,611             |
| 株 式         | 61,859       | 12,804             | 51,899       | △7,014             |
| 外 国 証 券     | 63,155       | 11,937             | 60,822       | △4,147             |
| 公 社 債       | 20,281       | 1,679              | 19,655       | △1,228             |
| 株 式 等       | 42,873       | 10,258             | 41,166       | △2,919             |
| そ の 他 の 証 券 | 5,200        | 545                | 4,389        | △447               |

(注) 「当期の損益に含まれた評価損益」には振戻損益を含んでいます。

#### ２．有価証券の時価情報（売買目的有価証券以外）

(単位：百万円)

| 区 分           |             | 2023年度末   |           |         |           |           |                |          |                 |         |
|---------------|-------------|-----------|-----------|---------|-----------|-----------|----------------|----------|-----------------|---------|
|               |             | 帳 簿 価 額   | 時 価       | 差 損 益   | (時価－帳簿価額) |           | 損益計算書<br>計上後価額 | 差 損 益    | (時価－損益計算書計上後価額) |         |
|               |             |           |           |         | 差益        | 差損        |                |          | 差益              | 差損      |
| 満期保有目的の債券     |             | 2,753     | 2,889     | 136     | 136       | －         | 2,753          | 136      | 136             | －       |
|               | 公 社 債       | 814       | 878       | 64      | 64        | －         | 814            | 64       | 64              | －       |
|               | 買 入 金 銭 債 権 | 1,938     | 2,010     | 71      | 71        | －         | 1,938          | 71       | 71              | －       |
| 責任準備金対応債券     |             | 3,409,564 | 3,409,328 | △236    | 167,951   | 168,187   | 3,504,575      | △95,247  | 125,290         | 220,537 |
|               | 公 社 債       | 2,608,265 | 2,564,846 | △43,419 | 123,656   | 167,075   | 2,611,199      | △46,353  | 121,658         | 168,011 |
|               | 外 国 公 社 債   | 801,298   | 844,481   | 43,183  | 44,295    | 1,111     | 893,376        | △48,894  | 3,631           | 52,525  |
| 子会社・関連会社株式    |             | －         | －         | －       | －         | －         | －              | －        | －               | －       |
| そ の 他 有 価 証 券 |             | 1,941,652 | 2,470,901 | 529,248 | 568,271   | 39,022    | 2,194,649      | 276,251  | 446,779         | 170,527 |
|               | 公 社 債       | 576,345   | 572,166   | △4,178  | 19,862    | 24,040    | 601,603        | △29,437  | 5,160           | 34,597  |
|               | 株 式         | 170,520   | 590,127   | 419,606 | 419,723   | 116       | 170,520        | 419,606  | 419,723         | 116     |
|               | 外 国 証 券     | 1,002,237 | 1,108,038 | 105,800 | 112,952   | 7,151     | 1,229,975      | △121,937 | 6,161           | 128,098 |
|               | 公 社 債       | 940,938   | 1,044,818 | 103,879 | 108,266   | 4,386     | 1,168,677      | △123,858 | 1,475           | 125,334 |
|               | 株 式 等       | 61,298    | 63,219    | 1,921   | 4,685     | 2,764     | 61,298         | 1,921    | 4,685           | 2,764   |
|               | そ の 他 の 証 券 | 94,145    | 102,112   | 7,967   | 15,681    | 7,714     | 94,145         | 7,967    | 15,681          | 7,714   |
|               | 買 入 金 銭 債 権 | 4,404     | 4,456     | 51      | 51        | －         | 4,404          | 51       | 51              | －       |
|               | 譲 渡 性 預 金   | 94,000    | 94,000    | －       | －         | －         | 94,000         | －        | －               | －       |
|               | 合 計         | 5,353,970 | 5,883,118 | 529,148 | 736,358   | 207,210   | 5,701,978      | 181,140  | 572,205         | 391,065 |
| 公 社 債         | 3,185,425   | 3,137,891 | △47,534   | 143,582 | 191,116   | 3,213,618 | △75,726        | 126,883  | 202,609         |         |
| 株 式           | 170,520     | 590,127   | 419,606   | 419,723 | 116       | 170,520   | 419,606        | 419,723  | 116             |         |
| 外 国 証 券       |             | 1,803,535 | 1,952,519 | 148,984 | 157,247   | 8,263     | 2,123,351      | △170,831 | 9,792           | 180,624 |
|               | 公 社 債       | 1,742,237 | 1,889,300 | 147,062 | 152,561   | 5,498     | 2,062,053      | △172,753 | 5,106           | 177,859 |
|               | 株 式 等       | 61,298    | 63,219    | 1,921   | 4,685     | 2,764     | 61,298         | 1,921    | 4,685           | 2,764   |
| そ の 他 の 証 券   | 94,145      | 102,112   | 7,967     | 15,681  | 7,714     | 94,145    | 7,967          | 15,681   | 7,714           |         |
| 買 入 金 銭 債 権   | 6,343       | 6,467     | 123       | 123     | －         | 6,343     | 123            | 123      | －               |         |
| 譲 渡 性 預 金     | 94,000      | 94,000    | －         | －       | －         | 94,000    | －              | －        | －               |         |

- (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．外貨建責任準備金対応債券に係る換算差額95,011百万円、及び外貨建その他有価証券のうち債券に係る換算差額の一部252,996百万円については、為替差損益として損益計算書に計上しています。
- ３．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。

(単位：百万円)

| 区 分        | 2024年度末   |           |          |           |         |            |          |                 |         |
|------------|-----------|-----------|----------|-----------|---------|------------|----------|-----------------|---------|
|            | 帳簿価額      | 時 価       | 差 損 益    | (時価－帳簿価額) |         | 損益計算書計上後価額 | 差 損 益    | (時価－損益計算書計上後価額) |         |
|            |           |           |          | 差益        | 差損      |            |          | 差益              | 差損      |
| 満期保有目的の債券  | 2,308     | 2,368     | 60       | 60        | －       | 2,308      | 60       | 60              | －       |
| 公 社 債      | 403       | 434       | 30       | 30        | －       | 403        | 30       | 30              | －       |
| 買入金銭債権     | 1,904     | 1,934     | 29       | 29        | －       | 1,904      | 29       | 29              | －       |
| 責任準備金対応債券  | 3,602,570 | 3,326,554 | △276,015 | 59,367    | 335,382 | 3,644,326  | △317,772 | 40,388          | 358,161 |
| 公 社 債      | 2,615,450 | 2,354,541 | △260,909 | 39,235    | 300,144 | 2,617,175  | △262,634 | 37,852          | 300,486 |
| 外国公社債      | 987,119   | 972,013   | △15,106  | 20,131    | 35,238  | 1,027,151  | △55,138  | 2,536           | 57,674  |
| 子会社・関連会社株式 | －         | －         | －        | －         | －       | －          | －        | －               | －       |
| その他の有価証券   | 1,964,824 | 2,398,216 | 433,391  | 502,466   | 69,074  | 2,161,511  | 236,704  | 411,680         | 174,976 |
| 公 社 債      | 646,715   | 616,368   | △30,346  | 13,714    | 44,060  | 666,511    | △50,142  | 1,310           | 51,453  |
| 株 式        | 167,486   | 565,775   | 398,288  | 398,562   | 273     | 167,486    | 398,288  | 398,562         | 273     |
| 外国証券       | 1,018,395 | 1,086,891 | 68,495   | 84,117    | 15,621  | 1,195,286  | △108,395 | 5,734           | 114,130 |
| 公 社 債      | 940,785   | 1,006,550 | 65,765   | 79,733    | 13,968  | 1,117,676  | △111,125 | 1,351           | 112,477 |
| 株 式 等      | 77,610    | 80,340    | 2,730    | 4,383     | 1,652   | 77,610     | 2,730    | 4,383           | 1,652   |
| その他の証券     | 106,227   | 103,180   | △3,046   | 6,073     | 9,119   | 106,227    | △3,046   | 6,073           | 9,119   |
| 買入金銭債権     | －         | －         | －        | －         | －       | －          | －        | －               | －       |
| 譲渡性預金      | 26,000    | 26,000    | －        | －         | －       | 26,000     | －        | －               | －       |
| 合 計        | 5,569,702 | 5,727,138 | 157,435  | 561,893   | 404,457 | 5,808,146  | △81,008  | 452,129         | 533,137 |
| 公 社 債      | 3,262,569 | 2,971,344 | △291,225 | 52,980    | 344,205 | 3,284,090  | △312,746 | 39,194          | 351,940 |
| 株 式        | 167,486   | 565,775   | 398,288  | 398,562   | 273     | 167,486    | 398,288  | 398,562         | 273     |
| 外 国 証 券    | 2,005,514 | 2,058,904 | 53,389   | 104,249   | 50,859  | 2,222,437  | △163,533 | 8,271           | 171,804 |
| 公 社 債      | 1,927,904 | 1,978,563 | 50,658   | 99,865    | 49,206  | 2,144,827  | △166,264 | 3,887           | 170,152 |
| 株 式 等      | 77,610    | 80,340    | 2,730    | 4,383     | 1,652   | 77,610     | 2,730    | 4,383           | 1,652   |
| その他の証券     | 106,227   | 103,180   | △3,046   | 6,073     | 9,119   | 106,227    | △3,046   | 6,073           | 9,119   |
| 買入金銭債権     | 1,904     | 1,934     | 29       | 29        | －       | 1,904      | 29       | 29              | －       |
| 譲渡性預金      | 26,000    | 26,000    | －        | －         | －       | 26,000     | －        | －               | －       |

(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. 外貨建責任準備金対応債券に係る換算差額41,756百万円、及び外貨建のその他の有価証券のうち債券に係る換算差額の一部196,687百万円については、為替差損益として損益計算書に計上しています。  
3. 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。

○満期保有目的の債券

(単位：百万円)

| 区 分                | 2023年度末  |       |     | 2024年度末  |       |     |
|--------------------|----------|-------|-----|----------|-------|-----|
|                    | 貸借対照表計上額 | 時 価   | 差 額 | 貸借対照表計上額 | 時 価   | 差 額 |
| 時価が貸借対照表計上額を超えるもの  | 2,753    | 2,889 | 136 | 2,308    | 2,368 | 60  |
| 公 社 債              | 814      | 878   | 64  | 403      | 434   | 30  |
| 買入金銭債権             | 1,938    | 2,010 | 71  | 1,904    | 1,934 | 29  |
| 時価が貸借対照表計上額を超えないもの | －        | －     | －   | －        | －     | －   |

○責任準備金対応債券

(単位：百万円)

| 区 分                | 2023年度末   |           |          | 2024年度末   |           |          |
|--------------------|-----------|-----------|----------|-----------|-----------|----------|
|                    | 貸借対照表計上額  | 時 価       | 差 額      | 貸借対照表計上額  | 時 価       | 差 額      |
| 時価が貸借対照表計上額を超えるもの  | 1,602,886 | 1,728,176 | 125,290  | 1,252,108 | 1,292,497 | 40,388   |
| 公 社 債              | 1,342,031 | 1,463,690 | 121,658  | 1,086,489 | 1,124,342 | 37,852   |
| 外国証券               | 260,854   | 264,486   | 3,631    | 165,619   | 168,155   | 2,536    |
| 時価が貸借対照表計上額を超えないもの | 1,901,689 | 1,681,151 | △220,537 | 2,392,218 | 2,034,056 | △358,161 |
| 公 社 債              | 1,269,168 | 1,101,156 | △168,011 | 1,530,685 | 1,230,199 | △300,486 |
| 外国証券               | 632,521   | 579,995   | △52,525  | 861,532   | 803,857   | △57,674  |

○その他有価証券

(単位：百万円)

| 区 分                  | 2023年度末   |           |         | 2024年度末   |           |         |
|----------------------|-----------|-----------|---------|-----------|-----------|---------|
|                      | 帳簿価額      | 貸借対照表計上額  | 差 額     | 帳簿価額      | 貸借対照表計上額  | 差 額     |
| 貸借対照表計上額が帳簿価額を超えるもの  | 1,332,093 | 1,900,364 | 568,271 | 1,062,923 | 1,565,389 | 502,466 |
| 公 社 債                | 252,509   | 272,371   | 19,862  | 148,737   | 162,451   | 13,714  |
| 株 式                  | 169,749   | 589,472   | 419,723 | 164,233   | 562,795   | 398,562 |
| 外 国 証 券              | 871,133   | 984,085   | 112,952 | 725,320   | 809,437   | 84,117  |
| そ の 他 の 証 券          | 34,296    | 49,978    | 15,681  | 24,633    | 30,706    | 6,073   |
| 買 入 金 銭 債 権          | 4,404     | 4,456     | 51      | —         | —         | —       |
| 貸借対照表計上額が帳簿価額を超えないもの | 609,558   | 570,536   | △39,022 | 901,900   | 832,826   | △69,074 |
| 公 社 債                | 323,835   | 299,794   | △24,040 | 497,978   | 453,917   | △44,060 |
| 株 式                  | 771       | 654       | △116    | 3,253     | 2,980     | △273    |
| 外 国 証 券              | 131,103   | 123,952   | △7,151  | 293,075   | 277,453   | △15,621 |
| そ の 他 の 証 券          | 59,848    | 52,134    | △7,714  | 81,594    | 72,474    | △9,119  |
| 譲 渡 性 預 金            | 94,000    | 94,000    | —       | 26,000    | 26,000    | —       |

・市場価格のない株式等および組合等の帳簿価額は次のとおりです。

(単位：百万円)

| 区 分        | 2023年度末 | 2024年度末 |
|------------|---------|---------|
| 子会社・関連会社株式 | 741     | 202     |
| その他有価証券    | 10,129  | 10,061  |
| 国 内 株 式    | 7,420   | 7,353   |
| そ の 他      | 2,709   | 2,708   |
| 合 計        | 10,871  | 10,263  |

3. 金銭の信託の時価情報

2023年度末、2024年度末ともに該当する残高はありません。

4. デリバティブ取引の時価情報（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：百万円)

| 2023年度末   |      |         |      |      |     |         |
|-----------|------|---------|------|------|-----|---------|
|           | 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 | －    | △18,130 | －    | －    | －   | △18,130 |
| 合計        | －    | △18,130 | －    | －    | －   | △18,130 |
| 2024年度末   |      |         |      |      |     |         |
|           | 金利関連 | 通貨関連    | 株式関連 | 債券関連 | その他 | 合計      |
| ヘッジ会計適用分  | －    | －       | －    | －    | －   | －       |
| ヘッジ会計非適用分 | －    | △7,218  | －    | －    | －   | △7,218  |
| 合計        | －    | △7,218  | －    | －    | －   | △7,218  |

(注) ヘッジ会計非適用分の差損益については、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

①金利関連

2023年度末、2024年度末ともに該当する残高はありません。

②通貨関連

(単位：百万円)

| 区分 | 種類      | 2023年度末 |        |         |         | 2024年度末 |        |        |        |
|----|---------|---------|--------|---------|---------|---------|--------|--------|--------|
|    |         | 契約額等    | 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      | 464,792 | 49,780 | △18,387 | △18,387 | 480,051 | 66,355 | △7,929 | △7,929 |
|    | 米ドル     | 184,242 | 35,459 | △11,340 | △11,340 | 203,868 | 47,768 | △4,629 | △4,629 |
|    | ユーロ     | 215,192 | 14,320 | △5,891  | △5,891  | 229,050 | 18,587 | △3,508 | △3,508 |
|    | 豪ドル     | 65,358  | －      | △1,155  | △1,155  | 47,132  | －      | 208    | 208    |
|    | 買建      | －       | －      | －       | －       | 106     | －      | 0      | 0      |
|    | 米ドル     | －       | －      | －       | －       | 106     | －      | 0      | 0      |
|    | 通貨オプション |         |        |         |         |         |        |        |        |
|    | 売建      |         |        |         |         |         |        |        |        |
|    | ユーロ     | 19,813  | －      |         |         | 4,572   | －      |        |        |
|    |         | (254)   |        | 595     | △341    | (73)    |        | 38     | 34     |
|    | 米ドル     | 10,216  | －      |         |         | 4,572   | －      |        |        |
|    |         | (131)   |        | 382     | △250    | (73)    |        | 38     | 34     |
|    | ユーロ     | 9,597   | －      |         |         | －       | －      |        |        |
|    |         | (123)   |        | 213     | △90     | (－)     |        | －      | －      |
|    | 買建      |         |        |         |         |         |        |        |        |
|    | プット     | 19,375  | －      |         |         | 4,476   | －      |        |        |
|    |         | (254)   |        | 47      | △206    | (73)    |        | 92     | 18     |
|    | 米ドル     | 9,966   | －      |         |         | 4,476   | －      |        |        |
|    |         | (131)   |        | 20      | △111    | (73)    |        | 92     | 18     |
|    | ユーロ     | 9,408   | －      |         |         | －       | －      |        |        |
|    |         | (123)   |        | 27      | △95     | (－)     |        | －      | －      |
|    | 通貨スワップ  | 5,700   | 5,700  | 805     | 805     | 5,700   | 5,700  | 657    | 657    |
|    | 円払／豪ドル受 | 5,700   | 5,700  | 805     | 805     | 5,700   | 5,700  | 657    | 657    |
| 合計 |         |         |        |         | △18,130 |         |        |        | △7,218 |

(注) 1. 各期末の為替相場は先物相場を使用しています。  
2. 外貨建金銭債権債務等に先物為替予約が付されていることにより決済時における円貨額が確定している外貨建金銭債権債務等で、貸借対照表において当該円貨額で表示されているものについては、開示の対象から除いています。  
3. ( ) 内にはオプション料を記載しています。  
4. 差損益欄には、為替予約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。

③株式関連

2023年度末、2024年度末ともに該当する残高はありません。

④債券関連

2023年度末、2024年度末ともに該当する残高はありません。

⑤その他

2023年度末、2024年度末ともに該当する残高はありません。

(3) ヘッジ会計が適用されているもの

①金利関連

2023年度末、2024年度末ともに該当する残高はありません。

②通貨関連

(単位：百万円)

| ヘッジ会計<br>の方法  | 種<br>類 | 主な<br>ヘッジ対象 | 2023年度末             |       |             | 2024年度末             |       |             |
|---------------|--------|-------------|---------------------|-------|-------------|---------------------|-------|-------------|
|               |        |             | 契 約 額 等 ( ( 注 ) 1 ) |       | 時 価         | 契 約 額 等 ( ( 注 ) 1 ) |       | 時 価         |
|               |        |             |                     | うち1年超 |             |                     | うち1年超 |             |
| 為替予約の<br>振当処理 | 為替予約   | 外貨建<br>定期預金 | 2,969               | －     | ( ( 注 ) 2 ) | 2,982               | －     | ( ( 注 ) 2 ) |

（注）1． 為替予約の振当処理の契約額等は、ヘッジ対象としている外貨建定期預金と一体で処理しているため、当該外貨建定期預金の貸借対照表計上額（時価）と同額となります。  
当該外貨建定期預金は短期間で決済されるため、金利変動を考慮する重要性が乏しいことから時価は帳簿価額と同額としています。

2． 為替予約の振当処理の時価は上記の契約額等を含めています。

③株式関連

2023年度末、2024年度末ともに該当する残高はありません。

④債券関連

2023年度末、2024年度末ともに該当する残高はありません。

⑤その他

2023年度末、2024年度末ともに該当する残高はありません。