

2019年度第2四半期（上半期）報告 補足資料

1. 一般勘定

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

2. 個人変額保険特別勘定

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

3. 会社計

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

1. 一般勘定

(1) 商品有価証券関係

① 商品有価証券明細表

2018年度末、2019年度上半期末に該当の残高はありません。

② 商品有価証券売買高

2018年度上半期、2019年度上半期に該当はありません。

(2) 有価証券関係

① 有価証券明細表

(単位:億円、%)

区分	2018年度末		2019年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
公社債	235,275	42.4	237,208	41.6
国債	208,091	37.5	209,438	36.7
地方債	7,897	1.4	7,342	1.3
社債	19,286	3.5	20,426	3.6
(うち公社・公団債)	(7,930)	(1.4)	(7,972)	(1.4)
株式	89,554	16.1	88,857	15.6
外国証券	198,595	35.8	209,909	36.8
公社債	138,710	25.0	145,290	25.5
株式等	59,884	10.8	64,619	11.3
その他の証券	31,717	5.7	34,448	6.0
合計	555,143	100.0	570,423	100.0

②有価証券残存期間別残高

(単位:億円)

区分		1年以下	1年超 3年以下	3年超 5年以下	5年超 7年以下	7年超 10年以下	10年超 (期間の定めのないものを含む)	合計
2018年度末	有価証券	10,968	22,169	24,101	34,617	84,345	378,941	555,143
	国債	2,679	7,795	11,098	19,876	28,077	138,563	208,091
	地方債	901	69	181	406	1,003	5,334	7,897
	社債	637	1,102	1,897	1,316	5,617	8,715	19,286
	株式						89,554	89,554
	外国証券	5,455	12,112	9,989	9,440	31,936	129,660	198,595
	公社債	5,384	11,858	9,631	9,176	31,117	71,540	138,710
	株式等	70	253	358	263	819	58,119	59,884
	その他の証券	1,295	1,088	933	3,577	17,709	7,112	31,717
	買入金銭債権	269	19	17	48	364	1,720	2,440
	譲渡性預金	2,792	—	—	—	—	—	2,792
	合計	14,031	22,188	24,118	34,665	84,709	380,662	560,376
2019年度上半期末	有価証券	9,820	23,014	25,421	42,358	83,104	386,704	570,423
	国債	1,894	9,445	13,167	21,912	24,365	138,654	209,438
	地方債	278	53	199	764	1,020	5,025	7,342
	社債	551	1,154	2,154	1,939	5,550	9,077	20,426
	株式						88,857	88,857
	外国証券	5,504	11,443	8,741	12,829	31,893	139,497	209,909
	公社債	5,442	11,218	8,334	12,455	31,095	76,741	145,290
	株式等	61	224	406	373	797	62,755	64,619
	その他の証券	1,591	918	1,158	4,912	20,274	5,592	34,448
	買入金銭債権	124	9	8	42	319	1,630	2,134
	譲渡性預金	2,327	—	—	—	—	—	2,327
	合計	12,272	23,024	25,429	42,400	83,423	388,335	574,885

③地域別地方債保有内訳

(単位:億円、%)

区分	2018年度末		2019年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
北海道	22	0.3	22	0.3
東北	—	—	—	—
関東	4,647	58.8	4,312	58.7
中部	1,873	23.7	1,613	22.0
近畿	256	3.2	302	4.1
中国	98	1.2	93	1.3
四国	—	—	—	—
九州	999	12.7	977	13.3
その他	—	—	22	0.3
合計	7,897	100.0	7,342	100.0

(注)上記「その他」は共同発行市場公募地方債です。

④公社債及び外国公社債格付別内訳

(単位:億円、%)

区分	2018年度末		2019年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
AAA	16,991	10.2	16,334	9.4
AA	94,547	57.0	94,997	54.9
A	26,113	15.7	30,172	17.4
BBB	26,132	15.8	29,699	17.2
BB以下	111	0.1	22	0.0
格付なし	1,998	1.2	1,832	1.1
合計	165,895	100.0	173,059	100.0

(注) 1. 上記公社債残高は日本国債の残高を除いています。(2018年度末:20兆8,091億円、2019年度上半期末:20兆9,438億円)
2. 上記は外部の格付業者の格付に基づき作成しています。

⑤株式業種別内訳

(単位:億円、%)

区分	2018年度末		2019年度上半期末		
	金額	占率	金額	占率	
水産・農林業	50	0.1	38	0.0	
鉱業	13	0.0	12	0.0	
建設業	1,532	1.7	1,490	1.7	
製造業	食料品	3,220	3.6	3,031	3.4
	繊維製品	1,073	1.2	1,069	1.2
	パルプ・紙	287	0.3	229	0.3
	化学	8,907	9.9	9,093	10.2
	医薬品	7,590	8.5	7,436	8.4
	石油・石炭製品	218	0.2	185	0.2
	ゴム製品	854	1.0	825	0.9
	ガラス・土石製品	773	0.9	706	0.8
	鉄鋼	1,188	1.3	899	1.0
	非鉄金属	728	0.8	667	0.8
	金属製品	328	0.4	314	0.4
	機械	4,834	5.4	4,838	5.4
	電気機器	9,984	11.1	10,036	11.3
	輸送用機器	13,005	14.5	13,405	15.1
精密機器	1,191	1.3	1,234	1.4	
その他製品	1,032	1.2	1,028	1.2	
電気・ガス業	3,935	4.4	3,387	3.8	
運輸・情報通信業	陸運業	6,249	7.0	5,957	6.7
	海運業	48	0.1	50	0.1
	空運業	181	0.2	164	0.2
	倉庫・運輸関連業	104	0.1	100	0.1
	情報・通信業	2,896	3.2	3,349	3.8
商業	卸売業	3,121	3.5	3,100	3.5
	小売業	2,697	3.0	2,622	3.0
金融・保険業	銀行業	4,214	4.7	3,835	4.3
	証券、商品先物取引業	678	0.8	630	0.7
	保険業	5,691	6.4	5,987	6.7
	その他金融業	520	0.6	540	0.6
不動産業	494	0.6	482	0.5	
サービス業	1,904	2.1	2,103	2.4	
合計	89,554	100.0	88,857	100.0	

(3) 貸付金関係

① 貸付金明細表

(単位:億円)

区分	2018年度末	2019年度上半期末
保険約款貸付	5,827	5,669
保険料振替貸付	395	381
契約者貸付	5,431	5,288
一般貸付	68,559	68,885
企業貸付	51,118	51,101
国内	47,912	47,357
海外	3,206	3,744
国・国際機関・政府関係機関・ 公共団体・公企業貸付	4,751	4,891
国内	4,451	4,591
海外	300	300
住宅ローン	8,105	8,168
消費者ローン	3,788	3,763
その他	794	960
合 計	74,387	74,555
非居住者貸付	3,506	4,044

② 貸付金企業規模別内訳

(単位:件、億円、%)

区分		2018年度末		2019年度上半期末	
			占率		占率
大企業	貸付先数	783	38.1	771	38.8
	金額	41,159	85.9	40,408	85.3
中堅企業	貸付先数	261	12.7	246	12.4
	金額	672	1.4	602	1.3
中小企業	貸付先数	1,011	49.2	968	48.8
	金額	6,081	12.7	6,346	13.4
国内企業計	貸付先数	2,055	100.0	1,985	100.0
	金額	47,912	100.0	47,357	100.0

(注) 1. 業種の区分は以下のとおりです。

2. 貸付先数とは、各貸付先を名寄せした結果の債務者数をいい、貸付件数ではありません。

業種	①右の②～④を除く 全業種		②小売業、飲食業		③サービス業		④卸売業	
大企業	常用する 従業員 300名超	資本金 10億円以上	常用する 従業員 50名超	資本金 10億円以上	常用する 従業員 100名超	資本金 10億円以上	常用する 従業員 100名超	資本金 10億円以上
中堅企業		かつ 資本金 3億円超 10億円未満		かつ 資本金 5千万円超 10億円未満		かつ 資本金 5千万円超 10億円未満		かつ 資本金 1億円超 10億円未満
中小企業	資本金3億円以下又は 常用する従業員300名以下		資本金5千万円以下又は 常用する従業員50名以下		資本金5千万円以下又は 常用する従業員100名以下		資本金1億円以下又は 常用する従業員100名以下	

③貸付金業種別内訳

(単位:億円、%)

区分		2018年度末		2019年度上半期末	
		金額	占率	金額	占率
国内向け	製造業	10,589	15.4	10,331	15.0
	食料	961	1.4	1,086	1.6
	繊維	193	0.3	199	0.3
	木材・木製品	20	0.0	24	0.0
	パルプ・紙	606	0.9	572	0.8
	印刷	156	0.2	165	0.2
	化学	2,013	2.9	1,972	2.9
	石油・石炭	875	1.3	874	1.3
	窯業・土石	422	0.6	419	0.6
	鉄鋼	1,839	2.7	1,667	2.4
	非鉄金属	190	0.3	199	0.3
	金属製品	91	0.1	93	0.1
	はん用・生産用・業務用機械	1,010	1.5	986	1.4
	電気機械	737	1.1	701	1.0
	輸送用機械	1,211	1.8	1,117	1.6
	その他の製造業	257	0.4	250	0.4
	農業、林業	—	—	—	—
	漁業	—	—	—	—
	鉱業、採石業、砂利採取業	25	0.0	24	0.0
	建設業	311	0.5	350	0.5
	電気・ガス・熱供給・水道業	12,359	18.0	12,539	18.2
	情報通信業	1,299	1.9	1,281	1.9
	運輸業、郵便業	6,266	9.1	6,145	8.9
	卸売業	7,708	11.2	7,492	10.9
	小売業	517	0.8	451	0.7
	金融業、保険業	4,689	6.8	4,555	6.6
不動産業	4,719	6.9	5,120	7.4	
物品賃貸業	2,390	3.5	2,402	3.5	
学術研究、専門・技術サービス業	15	0.0	9	0.0	
宿泊業	234	0.3	228	0.3	
飲食業	31	0.0	32	0.0	
生活関連サービス業、娯楽業	442	0.6	432	0.6	
教育、学習支援業	16	0.0	15	0.0	
医療・福祉	10	0.0	9	0.0	
その他のサービス	102	0.1	101	0.1	
地方公共団体	1,426	2.1	1,385	2.0	
個人(住宅・消費・納税資金等)	11,894	17.3	11,932	17.3	
合 計	65,053	94.9	64,841	94.1	
海外向け	政府等	300	0.4	300	0.4
	金融機関	603	0.9	688	1.0
	商工業(等)	2,602	3.8	3,055	4.4
	合 計	3,506	5.1	4,044	5.9
総 合 計	68,559	100.0	68,885	100.0	

④貸付金担保別内訳

(単位:億円、%)

区分	2018年度末		2019年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
担保貸付	297	0.4	304	0.4
有価証券担保貸付	80	0.1	76	0.1
不動産・動産・財団担保貸付	156	0.2	172	0.3
指名債権担保貸付	61	0.1	55	0.1
保証貸付	1,790	2.6	1,709	2.5
信用貸付	54,576	79.6	54,939	79.8
その他	11,894	17.3	11,932	17.3
一般貸付計	68,559	100.0	68,885	100.0
うち劣後特約付貸付	1,616	2.4	1,616	2.3

⑤貸付金地域別内訳

(単位:億円、%)

区分	2018年度末		2019年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
北海道	673	1.4	674	1.4
東北	1,323	2.8	1,341	2.8
関東	31,860	66.5	31,387	66.3
中部	3,958	8.3	3,838	8.1
近畿	6,870	14.3	6,924	14.6
中国	1,173	2.4	1,122	2.4
四国	692	1.4	698	1.5
九州	1,358	2.8	1,370	2.9
合計	47,912	100.0	47,357	100.0

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

⑥一般貸付金残存期間別残高

(単位:億円)

区分	1年以下	1年超 3年以下	3年超 5年以下	5年超 7年以下	7年超 10年以下	10年超 (期間の定めのないものを含む)	合計	
	2018年度末	固定金利	8,432	12,532	9,597	6,383	7,734	16,663
変動金利		531	1,557	1,122	782	1,269	1,952	7,214
一般貸付計		8,964	14,089	10,720	7,165	9,004	18,615	68,559
2019年度上半期末	固定金利	8,548	12,166	9,440	6,203	7,683	16,847	60,889
	変動金利	611	1,330	1,128	1,041	1,521	2,362	7,995
	一般貸付計	9,159	13,496	10,569	7,244	9,204	19,210	68,885

(4)海外投融資関係

①資産別明細

・外貨建資産

(単位:億円、%)

区分	2018年度末		2019年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
公社債	135,536	63.3	141,729	62.1
株式	8,892	4.2	9,649	4.2
現預金・その他	42,767	20.0	48,959	21.5
小計	187,195	87.4	200,337	87.8

・円貨額が確定した外貨建資産

(単位:億円、%)

区分	2018年度末		2019年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
公社債	—	—	—	—
現預金・その他	2,812	1.3	2,689	1.2
小計	2,812	1.3	2,689	1.2

・円貨建資産

(単位:億円、%)

区分	2018年度末		2019年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
非居住者貸付	738	0.3	722	0.3
公社債(円建外債)・その他	23,417	10.9	24,447	10.7
小計	24,156	11.3	25,169	11.0

・合計

(単位:億円、%)

区分	2018年度末		2019年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
海外投融資	214,164	100.0	228,196	100.0

(注)「円貨額が確定した外貨建資産」とは、為替予約等が付されていることにより決済時の円貨額が確定し、当該円貨額を資産の貸借対照表計上額としているものです。

②外貨建資産の通貨別構成

(単位:億円、%)

区分	2018年度末		2019年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
米ドル	113,219	60.5	122,182	61.0
ユーロ	46,552	24.9	50,462	25.2
イギリスポンド	13,940	7.4	13,344	6.7
オーストラリアドル	7,290	3.9	7,316	3.7
インドルピー	1,381	0.7	2,088	1.0
カナダドル	923	0.5	1,211	0.6
その他	3,888	2.1	3,732	1.9
合計	187,195	100.0	200,337	100.0

(注) 内訳は、2019年度上半期末における残高上位6通貨を表示しています。

③海外投融資の地域別構成

(単位:億円、%)

区分	外国証券						非居住者貸付		
	金額		占率		金額		占率		
2018年度末	北米	73,707	37.1	67,698	48.8	6,008	10.0	1,073	30.6
	ヨーロッパ	60,573	30.5	55,749	40.2	4,823	8.1	1,238	35.3
	オセアニア	7,424	3.7	5,617	4.0	1,807	3.0	353	10.1
	アジア	7,404	3.7	4,098	3.0	3,305	5.5	10	0.3
	中南米	47,206	23.8	3,266	2.4	43,940	73.4	397	11.3
	中東	—	—	—	—	—	—	152	4.4
	アフリカ	—	—	—	—	—	—	180	5.2
	国際機関	2,279	1.1	2,279	1.6	—	—	100	2.9
	合計	198,595	100.0	138,710	100.0	59,884	100.0	3,506	100.0
	2019年度上半期末	北米	77,668	37.0	71,449	49.2	6,219	9.6	852
ヨーロッパ		62,708	29.9	57,838	39.8	4,870	7.5	1,741	43.1
オセアニア		7,607	3.6	5,798	4.0	1,808	2.8	488	12.1
アジア		8,216	3.9	4,263	2.9	3,953	6.1	10	0.2
中南米		51,550	24.6	3,782	2.6	47,767	73.9	427	10.6
中東		—	—	—	—	—	—	251	6.2
アフリカ		—	—	—	—	—	—	173	4.3
国際機関		2,157	1.0	2,157	1.5	—	—	100	2.5
合計		209,909	100.0	145,290	100.0	64,619	100.0	4,044	100.0

(注) 海外投融資のうち、外国証券、非居住者貸付を対象としています。

(5) デリバティブ取引の状況

[定性的情報]

(a) 取引の内容

当社が利用対象としているデリバティブ取引は次の取引です。

金利関連：金利先物取引、金利スワップ取引、スワップション取引等

通貨関連：為替予約取引、通貨オプション取引、通貨スワップ取引等

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

債券関連：債券先物取引、債券先物オプション取引、選択権付債券売買取引等

(b) 取組方針

効率的な資産運用を図る観点から、主として現物資産運用のリスクをコントロールする目的でデリバティブを活用しています。

(c) 利用目的

ご契約者よりお預かりした資産の安定運用のため、主として保有資産に係る市場リスクのヘッジを目的として利用しています。

(d) リスクの内容

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

(e) リスク管理体制

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

(f) 定量的情報に関する補足説明

ア) 想定元本（契約金額）に関する補足説明

スワップ取引に係る想定元本やオプション取引の契約金額は、金利交換等に係る名目的なものであり、信用リスク量を示すものではありません。

デリバティブ取引の信用リスクとは、取引相手先がデフォルトした際に、市場で同じポジションを再構築するための潜在的なコストを意味しており、当社ではカレントエクスポージャー方式により算出しています。

イ) 時価算定に係る補足説明

[先物取引等の市場取引]

期末日の清算値または終値

[株式オプション取引]

主に期末日の清算値または終値、外部情報ベンダーより入手した評価額

[為替予約取引、通貨オプション取引、金利スワップ取引、通貨スワップ取引、スワップション取引、株式先渡取引]

主に外部情報ベンダーより入手した評価額

ウ) 差損益に関する補足説明

当社では、デリバティブ取引を主として現物資産のかかえる市場リスクのコントロールを行うための補完手段として活用しています。

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

(g) ヘッジ会計の方法

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

[定量的情報(一般勘定)](ヘッジ会計適用・非適用分合算値)

1. 差損益の内訳(ヘッジ会計適用分・非適用分の内訳)

(単位:億円)

区分	2018年度末						2019年度上半期末					
	金利関連	通貨関連	株式関連	債券関連	その他	合計	金利関連	通貨関連	株式関連	債券関連	その他	合計
ヘッジ会計適用分	484	△944	—	—	—	△459	876	△890	△21	—	—	△35
ヘッジ会計非適用分	188	△21	△6	—	—	160	455	△100	△16	0	—	338
合計	673	△966	△6	—	—	△299	1,331	△991	△38	0	—	302

(注) ヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ適用分の差損益(2018年度末:通貨関連△27億円、2019年度上半期末:通貨関連20億円、株式関連△21億円)、及びヘッジ会計非適用分の差損益は、損益計算書に計上しています。

2. 金利関連

(単位:億円)

区分	種類	2018年度末				2019年度上半期末			
		契約額等		時価	差損益	契約額等		時価	差損益
			うち1年超				うち1年超		
店頭	金利スワップ								
	固定金利受取/変動金利支払	12,750	12,750	540	540	18,150	18,150	993	993
	固定金利支払/変動金利受取	—	—	—	—	—	—	—	—
	金利スワップション								
	売建								
	固定金利受取/変動金利支払	—	—	—	—	—	—	—	—
		(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	固定金利支払/変動金利受取	—	—	—	—	—	—	—	—
		(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	買建								
固定金利受取/変動金利支払	5,000	5,000	320	133	8,417	8,417	649	338	
	(186)	(186)	—	—	(311)	(311)	—	—	
固定金利支払/変動金利受取	—	—	—	—	—	—	—	—	
	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	
合計									1,331

(注) 1. ()内には、貸借対照表に計上したオプション料を記載しています。

2. 「差損益」欄には、スワップ取引については時価を記載し、オプション取引についてはオプション料と時価との差額を記載しています。

(参考) 金利スワップ契約の残存期間別構成

(単位:億円、%)

残存期間		1年以下	1年超 3年以下	3年超 5年以下	5年超 7年以下	7年超 10年以下	10年超	合計	
2018年度末	固定金利受取 /変動金利支払 スワップ	想定元本	—	40	60	—	—	12,650	12,750
		平均受取固定金利	—	△0.05	△0.02	—	—	0.59	0.58
		平均支払変動金利	—	0.00	0.00	—	—	0.01	0.00
	固定金利支払 /変動金利受取 スワップ	想定元本	—	—	—	—	—	—	—
		平均支払固定金利	—	—	—	—	—	—	—
		平均受取変動金利	—	—	—	—	—	—	—
2019年度上半期末	固定金利受取 /変動金利支払 スワップ	想定元本	—	40	60	—	—	18,050	18,150
		平均受取固定金利	—	△0.05	△0.02	—	—	0.46	0.46
		平均支払変動金利	—	△0.06	△0.06	—	—	△0.04	△0.04
	固定金利支払 /変動金利受取 スワップ	想定元本	—	—	—	—	—	—	—
		平均支払固定金利	—	—	—	—	—	—	—
		平均受取変動金利	—	—	—	—	—	—	—

3. 通貨関連

(単位:億円)

区分	種類	2018年度末				2019年度上半期末			
		契約額等	うち1年超	時価	差損益	契約額等	うち1年超	時価	差損益
店頭	為替予約								
	売建	87,982	52	△32	△32	81,881	50	38	38
	米ドル	41,254	52	△129	△129	41,054	50	△232	△232
	ユーロ	32,041	—	209	209	27,811	—	216	216
	ポンド	9,865	—	△113	△113	8,336	—	△30	△30
	買建	2,837	—	△3	△3	2,038	—	2	2
	米ドル	1,020	—	0	0	688	—	2	2
	ユーロ	205	—	△1	△1	304	—	△0	△0
	ポンド	755	—	0	0	687	—	0	0
	豪ドル	210	—	0	0	262	—	△0	△0
	加ドル	467	—	△3	△3	67	—	0	0
	通貨オプション								
	売建								
	コール	12,874	—	15	39	13,274	—	12	21
		(54)	(—)			(33)	(—)		
	米ドル	12,874	—	15	39	13,274	—	12	21
		(54)	(—)			(33)	(—)		
	ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—
		(—)	(—)			(—)	(—)		
	プット	2,108	—	0	0	539	—	0	0
		(0)	(—)			(0)	(—)		
	米ドル	2,108	—	0	0	539	—	0	0
		(0)	(—)			(0)	(—)		
	ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—
		(—)	(—)			(—)	(—)		
	買建								
	コール	3,995	—	1	△2	—	—	—	—
		(3)	(—)			(—)	(—)		
	米ドル	3,995	—	1	△2	—	—	—	—
		(3)	(—)			(—)	(—)		
ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—	
	(—)	(—)			(—)	(—)			
プット	11,741	—	30	△61	15,066	—	88	△61	
	(91)	(—)			(150)	(—)			
米ドル	10,988	—	27	△55	14,785	—	80	△67	
	(83)	(—)			(147)	(—)			
ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—	
	(—)	(—)			(—)	(—)			
通貨スワップ									
米ドル払/円受	6,632	5,822	△681	△681	8,766	8,335	△431	△431	
ユーロ払/円受	5,382	5,089	△293	△293	7,193	6,683	△510	△510	
円払/豪ドル受	3,125	3,125	11	11	3,198	3,198	△73	△73	
ポンド払/円受	1,301	1,279	141	141	2,403	2,403	148	148	
合計				△966				△991	

(注) 1.()内には、貸借対照表に計上したオプション料を記載しています。

2. 「差損益」欄には、先渡取引及びスワップ取引については時価を記載し、オプション取引についてはオプション料と時価との差額を記載しています。

4. 株式関連

(単位:億円)

区分	種類	2018年度末				2019年度上半期末			
		契約額等		時価	差損益	契約額等		時価	差損益
			うち1年超				うち1年超		
取引所	株価指数先物								
	売建	—	—	—	—	—	—	—	—
	買建	—	—	—	—	—	—	—	—
	株価指数オプション								
	売建								
	コール	—	—	—	—	—	—	—	—
	プット	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	買建	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	コール	—	—	—	—	—	—	—	—
	プット	3,817	—	9	△6	4,895	—	3	△16
		(16)	(—)			(20)	(—)		
店頭	株式先渡契約								
	売建	—	—	—	—	429	—	△21	△21
	買建	—	—	—	—	—	—	—	—
	株価指数オプション								
	売建								
	コール	—	—	—	—	—	—	—	—
	プット	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	買建	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	コール	—	—	—	—	—	—	—	—
	プット	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	
合 計				△6				△38	

(注) 1. ()内には、貸借対照表に計上したオプション料を記載しています。

2. 「差損益」欄には、先物取引及び先渡取引については時価を記載し、オプション取引についてはオプション料と時価との差額を記載しています。

5. 債券関連

(単位:億円)

区分	種類	2018年度末				2019年度上半期末			
		契約額等		時価	差損益	契約額等		時価	差損益
			うち1年超				うち1年超		
取引所	円貨建債券先物								
	売建	—	—	—	—	—	—	—	—
	買建	—	—	—	—	—	—	—	—
	外貨建債券先物								
	売建	—	—	—	—	29	—	△0	△0
買建	—	—	—	—	27	—	0	0	
合 計				—				0	

(注) 「差損益」欄には、時価を記載しています。

6. その他

2018年度末、2019年度上半期末に該当の残高はありません。

2. 個人変額保険特別勘定

(1) 売買目的有価証券の評価損益

(単位:億円)

区分	2018年度末		2019年度上半期末	
	貸借対照表計上額	当期の損益に含まれた評価損益	貸借対照表計上額	当期の損益に含まれた評価損益
売買目的有価証券	982	△58	986	△0

(2) デリバティブ取引の状況(個人変額保険特別勘定)

1. 差損益の内訳(ヘッジ会計適用分・非適用分の内訳)

(単位:億円)

区分	2018年度末						2019年度上半期末					
	金利関連	通貨関連	株式関連	債券関連	その他	合計	金利関連	通貨関連	株式関連	債券関連	その他	合計
ヘッジ会計適用分	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ヘッジ会計非適用分	-	0	0	△0	-	0	-	0	△0	0	-	△0
合計	-	0	0	△0	-	0	-	0	△0	0	-	△0

(注)ヘッジ会計非適用分の差損益は、損益計算書に計上しています。

2. 金利関連

2018年度末、2019年度上半期末に該当の残高はありません。

3. 通貨関連

(単位:億円)

区分	種類	2018年度末				2019年度上半期末			
		契約額等	うち1年超	時価	差損益	契約額等	うち1年超	時価	差損益
店頭	為替予約								
	売建	38	-	0	0	66	-	0	0
	米ドル	11	-	0	0	22	-	△0	△0
	ユーロ	20	-	0	0	30	-	0	0
	買建	49	-	△0	△0	49	-	△0	△0
	米ドル	28	-	△0	△0	28	-	0	0
	ユーロ	12	-	0	0	11	-	△0	△0
合計									0

(注)「差損益」欄には、時価を記載しています。

4. 株式関連

(単位:億円)

区分	種類	2018年度末				2019年度上半期末			
		契約額等	うち1年超	時価	差損益	契約額等	うち1年超	時価	差損益
取引所	株価指数先物								
	売建	-	-	-	-	3	-	0	0
	買建	49	-	0	0	20	-	△0	△0
合計									△0

(注)「差損益」欄には、時価を記載しています。

5. 債券関連

(単位:億円)

区分	種類	2018年度末				2019年度上半期末			
		契約額等	うち1年超	時価	差損益	契約額等	うち1年超	時価	差損益
取引所	円貨建債券先物								
	売建	4	-	△0	△0	13	-	0	0
	買建	-	-	-	-	-	-	-	-
	外貨建債券先物								
	売建	-	-	-	-	-	-	-	-
	買建	-	-	-	-	-	-	-	-
合計									△0

(注)「差損益」欄には、時価を記載しています。

6. その他

2018年度末、2019年度上半期末に該当の残高はありません。

3. 会社計

(1) 資産構成(会社計)

(単位:億円)

区分	2019年度上半期末	
		うち一般勘定
現預金・コールローン	15,332	11,330
買現先勘定	—	—
買入金銭債権	2,134	2,134
商品有価証券	—	—
金銭の信託	107	107
公社債	240,542	237,208
株式	90,215	88,857
外国証券	212,414	209,909
貸付金	74,555	74,555
不動産	16,490	16,490
資産計	701,489	688,850
うち外貨建資産	203,255	200,337

(2) 売買目的有価証券の評価損益(会社計)

(単位:億円)

区分	2018年度末		2019年度上半期末	
	貸借対照表計上額	当期の損益に含まれた評価損益	貸借対照表計上額	当期の損益に含まれた評価損益
売買目的有価証券	8,804	△215	8,077	△54

(注) 1. 売買目的有価証券に含まれる金銭の信託の貸借対照表計上額及び当期の損益に含まれた評価損益には、デリバティブ取引に係る差損益を含んでいます。

2. 売買目的有価証券に含まれる金銭の信託内で保有している現預金及びコールローンは含んでいません。

(3) 有価証券の時価情報(会社計) (売買目的有価証券以外の有価証券のうち時価のあるもの)

(単位:億円)

区分	2018年度末					2019年度上半期末				
	帳簿価額	時価	差損益			帳簿価額	時価	差損益		
			差益	差損	差益			差損		
責任準備金対応債券	206,963	247,738	40,774	40,777	△2	208,396	252,249	43,853	43,919	△66
満期保有目的の債券	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
子会社・関連会社株式	640	1,368	728	728	—	1,328	2,232	904	904	—
その他有価証券	269,616	337,085	67,469	70,368	△2,898	275,032	349,236	74,203	77,559	△3,355
公社債	28,953	31,307	2,353	2,364	△10	29,260	31,904	2,643	2,660	△17
株式	42,682	84,459	41,777	43,862	△2,084	42,761	83,509	40,747	43,456	△2,709
外国証券	166,482	187,236	20,753	21,533	△780	170,159	197,660	27,501	28,119	△617
公社債	123,905	137,743	13,837	14,350	△512	124,334	144,116	19,782	20,115	△332
株式等	42,576	49,492	6,916	7,183	△267	45,825	53,544	7,719	8,004	△284
その他の証券	28,270	30,854	2,584	2,606	△22	30,245	33,549	3,304	3,316	△11
買入金銭債権	434	434	0	1	△0	277	284	6	6	△0
譲渡性預金	2,793	2,792	△0	0	△0	2,328	2,327	△0	0	△0
合 計	477,219	586,192	108,972	111,874	△2,901	484,757	603,718	118,961	122,383	△3,422
公社債	232,921	275,912	42,990	43,001	△10	234,564	280,903	46,339	46,417	△77
株式	42,682	84,459	41,777	43,862	△2,084	42,761	83,509	40,747	43,456	△2,709
外国証券	168,103	189,618	21,515	22,297	△782	172,721	201,177	28,456	29,079	△623
公社債	124,895	138,767	13,871	14,386	△514	125,577	145,411	19,833	20,172	△338
株式等	43,207	50,851	7,643	7,911	△267	47,143	55,766	8,622	8,907	△284
その他の証券	28,279	30,864	2,585	2,607	△22	30,254	33,559	3,305	3,317	△11
買入金銭債権	2,439	2,544	104	106	△1	2,127	2,240	112	113	△0
譲渡性預金	2,793	2,792	△0	0	△0	2,328	2,327	△0	0	△0

(注) 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。

○時価を把握することが極めて困難と認められる有価証券の帳簿価額は以下のとおりです。

(単位:億円)

区分	2018年度末	2019年度上半期末
責任準備金対応債券	—	—
満期保有目的の債券	—	—
非上場外国債券	—	—
その他	—	—
子会社・関連会社株式	10,251	10,529
その他有価証券	5,398	5,525
非上場国内株式(店頭売買株式を除く)	532	571
非上場外国株式(店頭売買株式を除く)	1,200	750
非上場外国債券	—	—
その他	3,665	4,204
合 計	15,650	16,054

(注) 時価を把握することが極めて困難と認められる有価証券のうち、外貨建資産について為替を評価した差損益は次のとおりです。
(2018年度末:36億円、2019年度上半期末:△321億円)

(4) 金銭の信託の時価情報(会社計)

(単位:億円)

区分	2018年度末					2019年度上半期末				
	貸借対照表 計上額	時価	差損益			貸借対照表 計上額	時価	差損益		
			差益	差損	差益			差損		
金銭の信託	131	131	—	—	—	107	107	—	—	—

(注) 1. 時価の算定は、金銭の信託の受託者が合理的に算出した価格によっています。

2. 貸借対照表計上額には、金銭の信託内で保有しているデリバティブ取引に係る差損益を含んでいます。

・運用目的の金銭の信託

(単位:億円)

区分	2018年度末		2019年度上半期末	
	貸借対照表計上額	当期の損益に含まれた 評価損益	貸借対照表計上額	当期の損益に含まれた 評価損益
運用目的の金銭の信託	131	△15	107	18

(注) 貸借対照表計上額及び当期の損益に含まれた評価損益には、デリバティブ取引に係る差損益を含んでいます。

・責任準備金対応、満期保有目的、その他の金銭の信託

2018年度末、2019年度上半期末に該当の残高はありません。

(5) デリバティブ取引の状況(会社計)

1. 差損益の内訳(ヘッジ会計適用分・非適用分の内訳)

(単位:億円)

区分	2018年度末						2019年度上半期末					
	金利関連	通貨関連	株式関連	債券関連	その他	合計	金利関連	通貨関連	株式関連	債券関連	その他	合計
ヘッジ会計適用分	484	△944	—	—	—	△459	876	△890	△21	—	—	△35
ヘッジ会計非適用分	188	△14	△6	25	—	193	455	△100	△19	△3	—	331
合計	673	△958	△6	25	—	△265	1,331	△991	△40	△3	—	296

(注) ヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ適用分の差損益(2018年度末:通貨関連△27億円、2019年度上半期末:通貨関連20億円、株式関連△21億円)、及びヘッジ会計非適用分の差損益は、損益計算書に計上しています。

2. ヘッジ会計が適用されていないもの

(a) 金利関連

(単位:億円)

区分	種類	2018年度末				2019年度上半期末			
		契約額等		時価	差損益	契約額等		時価	差損益
			うち1年超				うち1年超		
店頭	金利スワップ								
	固定金利受取/変動金利支払	2,000	2,000	55	55	3,275	3,275	117	117
	固定金利支払/変動金利受取	—	—	—	—	—	—	—	—
	金利スワップション								
	売建								
	固定金利受取/変動金利支払	—	—	—	—	—	—	—	—
		(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	固定金利支払/変動金利受取	—	—	—	—	—	—	—	—
		(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	買建								
固定金利受取/変動金利支払	5,000	5,000	320	133	8,417	8,417	649	338	
	(186)	(186)	—	—	(311)	(311)	—	—	
固定金利支払/変動金利受取	—	—	—	—	—	—	—	—	
	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	
合計				188				455	

(注) 1. ()内には、貸借対照表に計上したオプション料を記載しています。

2. 「差損益」欄には、スワップ取引については時価を記載し、オプション取引についてはオプション料と時価との差額を記載しています。

(参考) 金利スワップ契約の残存期間別構成

(単位:億円、%)

残存期間		1年以下	1年超 3年以下	3年超 5年以下	5年超 7年以下	7年超 10年以下	10年超	合計
2018年度末	固定金利受取/変動金利支払 スワップ	想定元本	—	—	—	—	2,000	2,000
		平均受取固定金利	—	—	—	—	0.44	0.44
		平均支払変動金利	—	—	—	—	0.01	0.01
	固定金利支払/変動金利受取 スワップ	想定元本	—	—	—	—	—	—
		平均支払固定金利	—	—	—	—	—	—
		平均受取変動金利	—	—	—	—	—	—
2019年度上半期末	固定金利受取/変動金利支払 スワップ	想定元本	—	—	—	—	3,275	3,275
		平均受取固定金利	—	—	—	—	0.34	0.34
		平均支払変動金利	—	—	—	—	△0.02	△0.02
	固定金利支払/変動金利受取 スワップ	想定元本	—	—	—	—	—	—
		平均支払固定金利	—	—	—	—	—	—
		平均受取変動金利	—	—	—	—	—	—

(b)通貨関連

(単位:億円)

区分	種類	2018年度末				2019年度上半期末			
		契約額等	うち1年超	時価	差損益	契約額等	うち1年超	時価	差損益
店頭	為替予約								
	売建	7,160	52	3	3	7,742	50	19	19
	米ドル	3,174	52	△15	△15	3,745	50	△21	△21
	ユーロ	874	—	10	10	884	—	8	8
	ポンド	1,597	—	0	0	1,988	—	20	20
	豪ドル	693	—	△1	△1	906	—	11	11
	買建	3,280	—	△3	△3	2,570	—	1	1
	米ドル	1,286	—	0	0	930	—	2	2
	ユーロ	325	—	△1	△1	461	—	△1	△1
	ポンド	780	—	0	0	722	—	0	0
	豪ドル	214	—	0	0	308	—	△0	△0
	通貨オプション								
	売建								
	コール	12,874	—	15	39	13,274	—	12	21
	(54)	(54)	(—)	—	—	(33)	(—)	—	—
	米ドル	12,874	—	15	39	13,274	—	12	21
	(54)	(54)	(—)	—	—	(33)	(—)	—	—
	ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—
	(—)	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	プット	2,108	—	0	0	539	—	0	0
	(0)	(0)	(—)	—	—	(0)	(—)	—	—
	米ドル	2,108	—	0	0	539	—	0	0
	(0)	(0)	(—)	—	—	(0)	(—)	—	—
	ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—
	(—)	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	買建								
	コール	3,995	—	1	△2	—	—	—	—
	(3)	(3)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	米ドル	3,995	—	1	△2	—	—	—	—
	(3)	(3)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—	
(—)	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	
プット	11,741	—	30	△61	15,066	—	88	△61	
(91)	(91)	(—)	—	—	(150)	(—)	—	—	
米ドル	10,988	—	27	△55	14,785	—	80	△67	
(83)	(83)	(—)	—	—	(147)	(—)	—	—	
ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—	
(—)	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	
通貨スワップ									
米ドル払/円受	3,266	3,266	9	9	3,368	3,368	△80	△80	
ユーロ払/円受	—	—	—	—	—	—	—	—	
円払/豪ドル受	3,125	3,125	11	11	3,198	3,198	△74	△74	
合 計				△14				△100	

(注) 1. ()内には、貸借対照表に計上したオプション料を記載しています。

2. 「差損益」欄には、先渡取引及びスワップ取引については時価を記載し、オプション取引についてはオプション料と時価との差額を記載しています。

(c) 株式関連

(単位:億円)

区分	種類	2018年度末				2019年度上半期末			
		契約額等	うち1年超	時価	差損益	契約額等	うち1年超	時価	差損益
取引所	株価指数先物								
	売建	207	—	△0	△0	148	—	△1	△1
	買建	356	—	0	0	194	—	△0	△0
	株価指数オプション								
	売建								
	コール	—	—	—	—	—	—	—	—
	プット	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	買建								
	コール	—	—	—	—	—	—	—	—
	プット	3,817	—	9	△6	4,895	—	3	△16
		(16)	(—)			(20)	(—)		
店頭	株式先渡契約								
	売建	—	—	—	—	—	—	—	—
	買建	—	—	—	—	—	—	—	—
	株価指数オプション								
	売建								
	コール	—	—	—	—	—	—	—	—
	プット	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	買建								
	コール	—	—	—	—	—	—	—	—
	プット	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
		(—)	(—)			(—)	(—)		
合計				△6				△19	

(注) 1.()内には、貸借対照表に計上したオプション料を記載しています。

2.「差損益」欄には、先物取引及び先渡取引については時価を記載し、オプション取引についてはオプション料と時価との差額を記載しています。

(d) 債券関連

(単位:億円)

区分	種類	2018年度末				2019年度上半期末			
		契約額等	うち1年超	時価	差損益	契約額等	うち1年超	時価	差損益
取引所	円貨建債券先物								
	売建	45	—	△0	△0	172	—	0	0
	買建	166	—	0	0	254	—	△0	△0
	外貨建債券先物								
	売建	—	—	—	—	29	—	△0	△0
買建	1,280	—	25	25	1,559	—	△3	△3	
合計				25				△3	

(注)「差損益」欄には、時価を記載しています。

(e) その他

2018年度末、2019年度上半期末に該当の残高はありません。

3. ヘッジ会計が適用されているもの

(a) 金利関連

(単位:億円)

区分	ヘッジ 会計の 方法	種類	主な ヘッジ 対象	2018年度末				2019年度上半期末			
				契約額等		時価	差損益	契約額等		時価	差損益
					うち1年超				うち1年超		
店頭	繰延 ヘッジ	金利スワップ	保険 負債	10,650	10,650	484	484	14,775	14,775	876	876
		固定金利受取/変動金利支払 固定金利支払/変動金利受取		—	—	—	—	—	—	—	—
		金利スワップ	貸付金	100	100	0	0	100	100	0	0
		固定金利受取/変動金利支払 固定金利支払/変動金利受取		—	—	—	—	—	—	—	—
合 計						484			876		

(注) 「差損益」欄には、時価を記載しています。

(参考) 金利スワップ契約の残存期間別構成

(単位:億円、%)

残存期間			1年以下	1年超 3年以下	3年超 5年以下	5年超 7年以下	7年超 10年以下	10年超	合 計
2018 年度末	固定金利受取 /変動金利支払 スワップ	想定元本	—	40	60	—	—	10,650	10,750
		平均受取固定金利	—	△0.05	△0.02	—	—	0.62	0.61
		平均支払変動金利	—	0.00	0.00	—	—	0.00	0.00
	固定金利支払 /変動金利受取 スワップ	想定元本	—	—	—	—	—	—	—
		平均支払固定金利	—	—	—	—	—	—	—
		平均受取変動金利	—	—	—	—	—	—	—
2019 年度 上半 期末	固定金利受取 /変動金利支払 スワップ	想定元本	—	40	60	—	—	14,775	14,875
		平均受取固定金利	—	△0.05	△0.02	—	—	0.49	0.49
		平均支払変動金利	—	△0.06	△0.06	—	—	△0.05	△0.05
	固定金利支払 /変動金利受取 スワップ	想定元本	—	—	—	—	—	—	—
		平均支払固定金利	—	—	—	—	—	—	—
		平均受取変動金利	—	—	—	—	—	—	—

(b) 通貨関連

(単位:億円)

区分	ヘッジ 会計 の方法	種類	主な ヘッジ 対象	2018年度末				2019年度上半期末				
				契約額等		時価	差損益	契約額等		時価	差損益	
					うち1年超				うち1年超			
店頭	時価 ヘッジ	為替予約	外貨建 債券									
		売建		81,944	—	△27	△27	75,428	—	20	20	
		米ドル		38,338	—	△113	△113	37,622	—	△212	△212	
		ユーロ		31,617	—	204	204	27,420	—	211	211	
		ポンド		8,376	—	△112	△112	6,483	—	△52	△52	
		買建		—	—	—	—	—	—	—	—	
		米ドル		—	—	—	—	—	—	—	—	
		ユーロ		—	—	—	—	—	—	—	—	
		通貨オプション										
		売建										
		コール		—	—	—	—	—	—	—	—	—
				(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	—
		米ドル		—	—	—	—	—	—	—	—	—
				(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	—
		ユーロ		—	—	—	—	—	—	—	—	—
				(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	—
		プット		—	—	—	—	—	—	—	—	—
				(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	—
		米ドル		—	—	—	—	—	—	—	—	—
				(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	—
		ユーロ		—	—	—	—	—	—	—	—	—
				(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	—
		買建										
コール	—	—	—	—	—	—	—	—	—			
	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	—			
米ドル	—	—	—	—	—	—	—	—	—			
	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	—			
ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—	—			
	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	—			
プット	—	—	—	—	—	—	—	—	—			
	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	—			
米ドル	—	—	—	—	—	—	—	—	—			
	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	—			
ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—	—			
	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	—			
合 計						△944				△890		
店頭	繰延 ヘッジ	通貨スワップ	外貨建 債券	13,316	12,190	△917	△917	18,362	17,422	△911	△911	
		米ドル払/円受		6,632	5,822	△681	△681	8,766	8,335	△431	△431	
		ユーロ払/円受		5,382	5,089	△293	△293	7,193	6,683	△510	△510	
		ポンド払/円受		1,301	1,279	22	22	2,403	2,403	—	—	

(注) 1. ()内には、貸借対照表に計上したオプション料を記載しています。

2. 「差損益」欄には、先渡取引及びスワップ取引については時価を記載し、オプション取引についてはオプション料と時価との差額を記載しています。

(c) 株式関連

(単位:億円)

区分	ヘッジ会計の方法	種類	主なヘッジ対象	2018年度末				2019年度上半期末			
				契約額等		時価	差損益	契約額等		時価	差損益
					うち1年超				うち1年超		
店頭	時価ヘッジ	株式先渡契約	国内株式	—	—	—	—	429	—	△21	△21
		売建 買建		—	—	—	—	—	—	—	—
合 計							—				△21

(注) 「差損益」欄には、時価を記載しています。

(d) 債券関連

2018年度末、2019年度上半期末に該当の残高はありません。

(e) その他

2018年度末、2019年度上半期末に該当の残高はありません。