

2021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

商品有価証券明細表

2020年度末、2021年度上半期末に該当の残高はありません。

商品有価証券売買高

2020年度上半期、2021年度上半期に該当はありません。

(2) 有価証券関係

有価証券明細表

(単位:億円、%)

区分	2020年度末		2021年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
公社債	262,254	42.6	272,742	43.3
国債	231,701	37.7	242,005	38.4
地方債	8,304	1.4	8,395	1.3
社債	22,248	3.6	22,342	3.5
(うち公社・公団債)	(8,536)	(1.4)	(8,337)	(1.3)
株式	105,782	17.2	104,548	16.6
外国証券	212,641	34.6	217,346	34.5
公社債	137,670	22.4	138,054	21.9
株式等	74,970	12.2	79,292	12.6
その他の証券	34,379	5.6	34,798	5.5
合計	615,058	100.0	629,435	100.0

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
2020年度末	有価証券	10,714	23,364	35,463	52,997	74,706	417,812	615,058
	国債	4,336	10,358	18,052	17,993	25,255	155,704	231,701
	地方債	18	180	379	587	1,491	5,646	8,304
	社債	593	1,783	2,356	2,882	4,938	9,693	22,248
	株式						105,782	105,782
	外国証券	4,962	10,060	11,113	19,706	30,880	135,917	212,641
	公社債	4,748	9,588	10,873	19,274	29,718	63,467	137,670
	株式等	213	472	239	432	1,162	72,450	74,970
	その他の証券	804	980	3,561	11,826	12,139	5,067	34,379
	買入金銭債権	61	0	25	67	338	1,234	1,726
	譲渡性預金	1,139	-	-	-	-	-	1,139
合計	11,915	23,364	35,488	53,064	75,044	419,046	617,924	
2021年度上半期末	有価証券	12,259	25,317	41,787	57,752	62,831	429,487	629,435
	国債	5,559	12,927	20,241	16,217	22,350	164,708	242,005
	地方債	12	198	738	418	1,501	5,526	8,395
	社債	651	2,068	2,466	2,914	4,541	9,698	22,342
	株式						104,548	104,548
	外国証券	5,390	8,916	13,252	22,256	27,196	140,335	217,346
	公社債	5,181	8,388	12,918	21,862	25,632	64,071	138,054
	株式等	208	528	333	394	1,563	76,264	79,292
	その他の証券	645	1,205	5,088	15,945	7,241	4,670	34,798
	買入金銭債権	69	-	22	160	253	1,078	1,585
	譲渡性預金	1,384	-	-	-	-	-	1,384
合計	13,714	25,317	41,809	57,913	63,084	430,566	632,406	

地域別地方債保有内訳

(単位:億円、%)

区分	2020年度末		2021年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
北海道	69	0.8	69	0.8
東北	-	-	-	-
関東	4,466	53.8	4,435	52.8
中部	1,669	20.1	1,658	19.8
近畿	599	7.2	733	8.7
中国	188	2.3	188	2.2
四国	-	-	-	-
九州	1,167	14.1	1,165	13.9
その他	145	1.7	145	1.7
合計	8,304	100.0	8,395	100.0

(注)上記「その他」は共同発行市場公募地方債です。

公社債及び外国公社債格付別内訳

(単位: 億円、%)

区分	2020年度末		2021年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
AAA	12,339	7.3	11,096	6.6
AA	78,501	46.7	77,463	45.9
A	34,182	20.3	37,765	22.4
BBB	40,769	24.2	39,954	23.7
BB以下	192	0.1	195	0.1
格付なし	2,238	1.3	2,316	1.4
合計	168,223	100.0	168,791	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。(2020年度末:23兆1,701億円、2021年度上半期末:24兆2,005億円)
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。

株式業種別内訳

(単位: 億円、%)

区分	2020年度末		2021年度上半期末		
	金額	占率	金額	占率	
水産・農林業	37	0.0	37	0.0	
鉱業	10	0.0	11	0.0	
建設業	1,512	1.4	1,560	1.5	
製造業	食料品	3,001	2.8	3,171	3.0
	繊維製品	973	0.9	1,014	1.0
	パルプ・紙	288	0.3	243	0.2
	化学	11,562	10.9	10,866	10.4
	医薬品	8,789	8.3	7,622	7.3
	石油・石炭製品	130	0.1	126	0.1
	ゴム製品	834	0.8	766	0.7
	ガラス・土石製品	927	0.9	891	0.9
	鉄鋼	964	0.9	1,094	1.0
	非鉄金属	736	0.7	656	0.6
	金属製品	407	0.4	383	0.4
	機械	6,390	6.0	5,745	5.5
	電気機器	14,111	13.3	13,727	13.1
	輸送用機器	15,592	14.7	17,820	17.0
精密機器	1,800	1.7	1,199	1.1	
その他製品	1,111	1.1	1,216	1.2	
電気・ガス業	3,188	3.0	2,690	2.6	
運輸・情報通信業	陸運業	5,614	5.3	5,178	5.0
	海運業	79	0.1	170	0.2
	空運業	84	0.1	93	0.1
	倉庫・運輸関連業	82	0.1	87	0.1
	情報・通信業	5,582	5.3	5,953	5.7
商業	卸売業	3,934	3.7	4,032	3.9
	小売業	3,008	2.8	3,142	3.0
金融・保険業	銀行業	3,792	3.6	3,284	3.1
	証券、商品先物取引業	687	0.6	704	0.7
	保険業	6,363	6.0	6,587	6.3
	その他金融業	629	0.6	665	0.6
不動産業	472	0.4	462	0.4	
サービス業	3,075	2.9	3,337	3.2	
合計	105,782	100.0	104,548	100.0	

(3) 貸付金関係

貸付金明細表

(単位:億円)

区分	2020年度末	2021年度上半期末
保険約款貸付	4,908	4,724
保険料振替貸付	324	307
契約者貸付	4,584	4,416
一般貸付	69,398	69,240
企業貸付	51,920	51,455
国内	46,182	45,399
海外	5,738	6,056
国・国際機関・政府関係機関・ 公共団体・公企業貸付	4,545	4,804
国内	4,458	4,722
海外	86	81
住宅ローン	8,333	8,426
消費者ローン	3,711	3,695
その他	888	859
合計	74,307	73,965
非居住者貸付	5,824	6,137

貸付金企業規模別内訳

(単位:件、億円、%)

区分	2020年度末		2021年度上半期末	
		占率		占率
大企業	貸付先数	705	687	40.5
	金額	39,270	38,276	84.3
中堅企業	貸付先数	208	199	11.7
	金額	508	511	1.1
中小企業	貸付先数	850	810	47.8
	金額	6,402	6,610	14.6
国内企業計	貸付先数	1,763	1,696	100.0
	金額	46,182	45,399	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	右の ~ を除く 全業種		小売業、飲食業		サービス業		卸売業	
	常用する 従業員 300名超	資本金 10億円以上	常用する 従業員 50名超	資本金 10億円以上	常用する 従業員 100名超	資本金 10億円以上	常用する 従業員 100名超	資本金 10億円以上
大企業								
中堅企業	かつ	資本金 3億円超 10億円未満	かつ	資本金 5千万円超 10億円未満	かつ	資本金 5千万円超 10億円未満	かつ	資本金 1億円超 10億円未満
中小企業	資本金3億円以下又は 常用する従業員300名以下		資本金5千万円以下又は 常用する従業員50名以下		資本金5千万円以下又は 常用する従業員100名以下		資本金1億円以下又は 常用する従業員100名以下	

貸付金業種別内訳

(単位:億円、%)

区分		2020年度末		2021年度上半期末	
		金額	占率	金額	占率
国内向け	製造業	10,153	14.6	9,699	14.0
	食料	1,041	1.5	942	1.4
	繊維	129	0.2	216	0.3
	木材・木製品	19	0.0	19	0.0
	パルプ・紙	561	0.8	563	0.8
	印刷	383	0.6	370	0.5
	化学	1,730	2.5	1,764	2.5
	石油・石炭	956	1.4	956	1.4
	窯業・土石	438	0.6	434	0.6
	鉄鋼	1,432	2.1	1,171	1.7
	非鉄金属	128	0.2	129	0.2
	金属製品	91	0.1	95	0.1
	はん用・生産用・業務用機械	999	1.4	1,008	1.5
	電気機械	691	1.0	675	1.0
	輸送用機械	1,272	1.8	1,080	1.6
	その他の製造業	277	0.4	270	0.4
	農業、林業	-	-	-	-
	漁業	-	-	-	-
	鉱業、採石業、砂利採取業	27	0.0	26	0.0
	建設業	443	0.6	440	0.6
	電気・ガス・熱供給・水道業	12,083	17.4	12,075	17.4
	情報通信業	1,271	1.8	1,278	1.8
運輸業、郵便業	6,216	9.0	6,186	8.9	
卸売業	7,275	10.5	7,165	10.3	
小売業	408	0.6	474	0.7	
金融業、保険業	4,309	6.2	4,389	6.3	
不動産業	5,377	7.7	5,344	7.7	
物品賃貸業	2,224	3.2	2,415	3.5	
学術研究、専門・技術サービス業	26	0.0	21	0.0	
宿泊業	19	0.0	12	0.0	
飲食業	29	0.0	29	0.0	
生活関連サービス業、娯楽業	244	0.4	57	0.1	
教育、学習支援業	19	0.0	19	0.0	
医療・福祉	8	0.0	7	0.0	
その他のサービス	130	0.2	126	0.2	
地方公共団体	1,257	1.8	1,210	1.7	
個人(住宅・消費・納税資金等)	12,044	17.4	12,121	17.5	
合計	63,573	91.6	63,102	91.1	
海外向け	政府等	-	-	-	-
	金融機関	1,276	1.8	1,385	2.0
	商工業(等)	4,547	6.6	4,752	6.9
	合計	5,824	8.4	6,137	8.9
総	合計	69,398	100.0	69,240	100.0

貸付金担保別内訳

(単位:億円、%)

区分	2020年度末		2021年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
担保貸付	229	0.3	211	0.3
有価証券担保貸付	49	0.1	46	0.1
不動産・動産・財団担保貸付	153	0.2	144	0.2
指名債権担保貸付	26	0.0	21	0.0
保証貸付	1,484	2.1	1,341	1.9
信用貸付	55,640	80.2	55,566	80.3
その他	12,044	17.4	12,121	17.5
一般貸付計	69,398	100.0	69,240	100.0
うち劣後特約付貸付	1,706	2.5	1,716	2.5

貸付金地域別内訳

(単位:億円、%)

区分	2020年度末		2021年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
北海道	708	1.5	709	1.6
東北	1,333	2.9	1,341	3.0
関東	31,175	67.5	31,041	68.4
中部	3,467	7.5	3,311	7.3
近畿	6,596	14.3	6,069	13.4
中国	896	1.9	888	2.0
四国	695	1.5	706	1.6
九州	1,308	2.8	1,331	2.9
合計	46,182	100.0	45,399	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。

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
	2020年度末						
固定金利	8,226	11,061	8,910	6,429	8,119	16,811	59,558
変動金利	659	1,488	1,464	1,621	1,604	3,001	9,840
一般貸付計	8,886	12,549	10,374	8,051	9,723	19,812	69,398
2021年度上半期末							
固定金利	7,998	11,168	8,703	6,436	8,677	16,288	59,272
変動金利	625	1,405	1,701	1,582	1,643	3,010	9,968
一般貸付計	8,624	12,573	10,404	8,019	10,321	19,298	69,240

(4) 海外投融資関係

資産別明細

・外貨建資産

(単位: 億円、%)

区分	2020年度末		2021年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
公社債	136,280	58.6	136,440	57.8
株式	8,804	3.8	8,970	3.8
現預金・その他	61,672	26.5	63,296	26.8
小計	206,757	88.9	208,707	88.5

・円貨額が確定した外貨建資産

(単位: 億円、%)

区分	2020年度末		2021年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
公社債	-	-	-	-
現預金・その他	2,051	0.9	2,203	0.9
小計	2,051	0.9	2,203	0.9

・円貨建資産

(単位: 億円、%)

区分	2020年度末		2021年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
非居住者貸付	429	0.2	423	0.2
公社債(円建外債)・その他	23,388	10.1	24,617	10.4
小計	23,817	10.2	25,040	10.6

・合計

(単位: 億円、%)

区分	2020年度末		2021年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
海外投融資	232,627	100.0	235,951	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。

外貨建資産の通貨別構成

(単位:億円、%)

区分	2020年度末		2021年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
米ドル	125,854	60.9	128,841	61.7
ユーロ	53,040	25.7	52,346	25.1
イギリスポンド	14,696	7.1	14,550	7.0
オーストラリアドル	7,284	3.5	6,745	3.2
インドルピー	2,084	1.0	2,084	1.0
ポーランドズロチ	782	0.4	946	0.5
その他	3,014	1.5	3,191	1.5
合計	206,757	100.0	208,707	100.0

(注) 内訳は、2021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。

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		
2020年度末	北米	72,593	34.1	66,144	48.0	6,448	8.6	770	13.2
	ヨーロッパ	63,113	29.7	56,249	40.9	6,864	9.2	3,254	55.9
	オセアニア	6,807	3.2	4,944	3.6	1,863	2.5	916	15.7
	アジア	8,303	3.9	4,700	3.4	3,603	4.8	-	-
	中南米	59,812	28.1	3,621	2.6	56,191	75.0	384	6.6
	中東	94	0.0	94	0.1	-	-	330	5.7
	アフリカ	-	-	-	-	-	-	170	2.9
	国際機関	1,915	0.9	1,915	1.4	-	-	-	-
	合計	212,641	100.0	137,670	100.0	74,970	100.0	5,824	100.0
2021年度上半期末	北米	75,139	34.6	68,060	49.3	7,078	8.9	838	13.7
	ヨーロッパ	62,096	28.6	54,955	39.8	7,141	9.0	3,577	58.3
	オセアニア	6,216	2.9	4,353	3.2	1,863	2.3	1,017	16.6
	アジア	8,417	3.9	4,911	3.6	3,505	4.4	-	-
	中南米	63,440	29.2	3,736	2.7	59,703	75.3	380	6.2
	中東	96	0.0	96	0.1	-	-	323	5.3
	アフリカ	-	-	-	-	-	-	-	-
	国際機関	1,938	0.9	1,938	1.4	-	-	-	-
	合計	217,346	100.0	138,054	100.0	79,292	100.0	6,137	100.0

(注) 海外投融資のうち、外国証券、非居住者貸付を対象としています。

(5) デリバティブ取引の状況

[定性的情報]

(a) 取引の内容

当社が利用対象としているデリバティブ取引は次の取引です。

金利関連：金利先物取引、金利スワップ取引、スワップション取引等

通貨関連：為替予約取引、通貨オプション取引、通貨スワップ取引等

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

債券関連：債券先物取引、債券先物オプション取引、選択権付債券売買取引等

(b) 取組方針

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

(c) 利用目的

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

ヘッジ会計の手法については、主に、貸付金の一部およ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および外貨建劣後特約付社債に対する為替変動に係るキャッシュ・フローのヘッジとして通貨スワップによる繰延ヘッジおよび振当処理、外貨建債券等の一部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。

(d) リスクの内容

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

(e) リスク管理体制

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

(f) 定量的情報に関する補足説明

ア) 想定元本（契約金額）に関する補足説明

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

イ) 時価算定に係る補足説明

[先物取引等の市場取引]

期末日の清算値または終値

[株式オプション取引]

主に期末日の清算値または終値、外部情報ベンダーより入手した評価額

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

主に外部情報ベンダーより入手した評価額

ウ) 差損益に関する補足説明

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

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

[定量的情報(一般勘定)](ヘッジ会計適用・非適用分合算値)

1. 差損益の内訳(ヘッジ会計適用分・非適用分の内訳)

(単位:億円)

区分	2020年度末						2021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	255	4,741	148	-	-	4,634	449	4,133	27	-	-	3,711
ヘッジ会計非適用分	265	75	51	-	-	241	265	489	92	-	-	130
合計	9	4,666	200	-	-	4,876	183	3,643	120	-	-	3,580

(注) ヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ適用分の差損益(2020年度末:通貨関連 2,244億円、株式関連 148億円、2021年度上半期末:通貨関連 689億円、株式関連 27億円)、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	2020年度末				2021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	22,750	22,710	255	255	25,085	25,085	444	444
	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	13,300	13,000	206	265	13,600	12,700	211	261	
(471)	(469)	-	-	(472)	(457)	-	-		
固定金利支払 / 変動金利受取	-	-	-	-	-	-	-	-	
(-)	(-)	-	-	(-)	(-)	-	-		
合計				9				183	

(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
2020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	-	-	22,650	22,750
		平均受取固定金利	0.05	0.02	-	-	0.41	0.41
		平均支払変動金利	0.05	0.05	-	-	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	-	-	-	-	-	-
2021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	-	60	-	-	83	24,942
		平均受取固定金利	-	0.02	-	-	0.04	0.40
		平均支払変動金利	-	0.06	-	-	0.03	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	2020年度末				2021年度上半期末			
		契約額等		時価	差損益	契約額等		時価	差損益
			うち1年超				うち1年超		
店頭	為替予約								
	売建	75,769	48	3,123	3,123	96,069	-	570	570
	米ドル	31,090	48	1,392	1,392	38,732	-	780	780
	ユーロ	25,581	-	582	582	37,972	-	44	44
	ポンド	7,633	-	470	470	10,284	-	91	91
	豪ドル	8,992	-	636	636	5,683	-	73	73
	買建	16,299	-	959	959	32,366	-	354	354
	米ドル	8,626	-	456	456	14,366	-	357	357
	ユーロ	366	-	0	0	10,858	-	75	75
	ポンド	1,249	-	2	2	3,602	-	27	27
	豪ドル	5,734	-	498	498	2,732	-	46	46
	通貨オプション								
	売建								
	コール	-	-	-	-	11,471	-	43	0
		(-)	(-)			(43)	(-)		
	米ドル	-	-	-	-	11,471	-	43	0
		(-)	(-)			(43)	(-)		
	ユーロ	-	-	-	-	-	-	-	-
		(-)	(-)			(-)	(-)		
	プット	1,660	-	0	4	-	-	-	-
		(4)	(-)			(-)	(-)		
	米ドル	1,660	-	0	4	-	-	-	-
		(4)	(-)			(-)	(-)		
	ユーロ	-	-	-	-	-	-	-	-
		(-)	(-)			(-)	(-)		
	買建								
	コール	-	-	-	-	-	-	-	-
		(-)	(-)			(-)	(-)		
	米ドル	-	-	-	-	-	-	-	-
		(-)	(-)			(-)	(-)		
ユーロ	-	-	-	-	-	-	-	-	
	(-)	(-)			(-)	(-)			
プット	11,624	-	9	128	11,471	-	9	43	
	(138)	(-)			(53)	(-)			
米ドル	11,624	-	9	128	11,471	-	9	43	
	(138)	(-)			(53)	(-)			
ユーロ	-	-	-	-	-	-	-	-	
	(-)	(-)			(-)	(-)			
通貨スワップ	46,579	45,388	2,377	2,377	49,431	48,408	3,384	3,384	
米ドル払/円受	28,627	27,738	770	770	31,070	30,389	1,897	1,897	
ユーロ払/円受	12,094	11,811	1,254	1,254	12,363	12,020	1,169	1,169	
合計				4,666				3,643	

(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。

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	2020年度末		2021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	983	117	995	29

(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	2020年度末						2021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

2020年度末、2021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	2020年度末				2021年度上半期末			
		契約額等		時価	差損益	契約額等		時価	差損益
			うち1年超				うち1年超		
店頭	為替予約								
	売建	121	-	△1	△1	124	-	△1	△1
	米ドル	58	-	△0	△0	79	-	△1	△1
	ユーロ	38	-	0	0	23	-	△0	△0
	買建	101	-	1	1	93	-	1	1
	米ドル	63	-	0	0	59	-	1	1
	ユーロ	20	-	△0	△0	16	-	0	0
合計				0				△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	2020年度末				2021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	4	-	△0	△0	25	-	0	0
	買建	25	-	0	0	-	-	-	-
合計				0				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	2020年度末				2021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	22	-	0	0	42	-	0	0
	買建	-	-	-	-	-	-	-	-
	外貨建債券先物								
	売建	-	-	-	-	-	-	-	-
	買建	-	-	-	-	-	-	-	-
合計				0				0	

(注)「差損益」欄には、時価を記載しています。

6. その他

2020年度末、2021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	2021年度上半期末	
		うち一般勘定
現預金・コールローン	11,748	7,914
買現先勘定	-	-
買入金銭債権	1,585	1,585
商品有価証券	-	-
金銭の信託	0	0
公社債	275,806	272,742
株式	105,207	104,548
外国証券	219,490	217,346
貸付金	73,965	73,965
不動産	16,968	16,968
資産計	751,086	738,846
うち外貨建資産	211,548	208,707

(2) 売買目的有価証券の評価損益(会社計)

(単位:億円)

区分	2020年度末		2021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	7,250	500	7,349	142

(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)

(単位:億円)

区分	2020年度末					2021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	236,738	266,508	29,770	31,228	1,457	247,444	276,977	29,533	30,863	1,330
満期保有目的の債券	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
子会社・関連会社株式	1,286	2,832	1,545	1,545	-	1,286	3,428	2,142	2,142	-
その他有価証券	274,542	366,376	91,833	93,716	1,882	274,435	369,534	95,098	96,673	1,574
公社債	26,563	28,422	1,858	1,928	70	26,174	28,081	1,906	1,950	44
株式	41,173	99,816	58,642	59,650	1,008	39,068	98,610	59,542	60,469	927
外国証券	174,309	203,603	29,293	29,947	653	176,271	207,708	31,436	31,928	491
公社債	116,729	136,239	19,510	19,968	457	116,264	136,646	20,382	20,687	305
株式等	57,580	67,363	9,783	9,979	195	60,007	71,061	11,054	11,240	186
その他の証券	31,136	33,167	2,031	2,181	150	31,333	33,541	2,208	2,319	111
買入金銭債権	218	225	6	7	0	201	207	5	5	0
譲渡性預金	1,140	1,139	0	0	0	1,385	1,384	0	0	0
合 計	512,567	635,717	123,150	126,490	3,340	523,166	649,940	126,774	129,679	2,904
公社債	260,395	291,846	31,450	32,976	1,526	270,836	302,118	31,282	32,652	1,370
株式	41,173	99,816	58,642	59,650	1,008	39,068	98,610	59,542	60,469	927
外国証券	176,993	207,942	30,949	31,604	655	178,953	212,625	33,672	34,167	495
公社債	118,136	137,757	19,620	20,080	459	117,669	138,146	20,477	20,786	309
株式等	58,856	70,185	11,328	11,524	195	61,284	74,479	13,194	13,381	186
その他の証券	31,145	33,178	2,033	2,183	150	31,342	33,552	2,209	2,321	111
買入金銭債権	1,719	1,793	74	74	0	1,580	1,647	67	67	0
譲渡性預金	1,140	1,139	0	0	0	1,385	1,384	0	0	0

(注) 1. 本表には、金融商品取引法上の有価証券として取り扱うことが適当と認められるもの等を含んでいます。
2. 市場価格のない株式等および組合等は本表から除いています。

市場価格のない株式等および組合等の帳簿価格は以下のとおりです。

(単位:億円)

区分	2020年度末	2021年度上半期末
子会社・関連会社株式	11,795	12,427
その他有価証券	1,682	1,683
国内株式	611	575
外国株式	3	3
その他	1,068	1,105
合 計	13,478	14,111

(注) 市場価格のない株式等および組合等のうち、外貨建資産について為替を評価した差損益は次のとおりです。
(2020年度末:170億円、2021年度上半期末:125億円)

(4) 金銭の信託の時価情報(会社計)

(単位:億円)

区分	2020年度末					2021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	1	1	-	-	0	0	-	-	-	

(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	2020年度末		2021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	1	253	0	42

(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

2020年度末、2021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	2020年度末						2021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	255	4,741	148	-	-	4,634	449	4,133	27	-	-	3,711
ヘッジ会計非適用分	265	69	48	1	-	246	265	491	95	3	-	125
合計	9	4,672	196	1	-	4,880	183	3,642	123	3	-	3,585

(注) ヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ適用分の差損益(2020年度末:通貨関連 2,244億円、株式関連 148億円、2021年度上半期末:通貨関連 689億円、株式関連 27億円)、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	2020年度末				2021年度上半期末					
		契約額等	うち1年超		時価	差損益	契約額等	うち1年超		時価	差損益
店頭	金利スワップ										
	固定金利受取 / 変動金利支払	-	-	-	-	500	500	4	4		
	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	13,300	13,000	206	265	13,600	12,700	211	261			
	(471)	(469)			(472)	(457)					
固定金利支払 / 変動金利受取	-	-	-	-	-	-	-	-			
	(-)	(-)			(-)	(-)					
合計				265				265			

(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
2020年度末	固定金利受取 / 変動金利支払 スワップ	想定元本	-	-	-	-	-	-
		平均受取固定金利	-	-	-	-	-	-
		平均支払変動金利	-	-	-	-	-	-
	固定金利支払 / 変動金利受取 スワップ	想定元本	-	-	-	-	-	-
		平均支払固定金利	-	-	-	-	-	-
		平均受取変動金利	-	-	-	-	-	-
2021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	-	-	-	83	417	500
		平均受取固定金利	-	-	-	0.04	0.14	0.12
		平均支払変動金利	-	-	-	0.03	0.03	0.03
	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	2020年度末				2021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	16,541	48	892	892	33,375	-	113	113
	米ドル	5,222	48	236	236	10,590	-	185	185
	ユーロ	1,090	-	15	15	12,061	-	172	172
	ポンド	3,718	-	179	179	6,640	-	77	77
	豪ドル	5,866	-	443	443	3,003	-	43	43
	買建	17,090	-	966	966	33,430	-	361	361
	米ドル	9,125	-	462	462	15,000	-	365	365
	ユーロ	523	-	0	0	11,083	-	74	74
	ポンド	1,290	-	3	3	3,716	-	28	28
	豪ドル	5,779	-	498	498	2,800	-	46	46
	通貨オプション								
	売建								
	コール	-	-	-	-	11,471	-	43	0
	米ドル	(-)	(-)	-	-	(43)	(-)	43	0
	ユーロ	-	-	-	-	-	-	-	-
	ポット	(-)	(-)	-	-	(-)	(-)	-	-
	米ドル	1,660	-	0	4	-	-	-	-
	ユーロ	(4)	(-)	-	-	(-)	(-)	-	-
	ポット	1,660	-	0	4	-	-	-	-
	ユーロ	(4)	(-)	-	-	(-)	(-)	-	-
	ポット	-	-	-	-	-	-	-	-
	米ドル	(-)	(-)	-	-	(-)	(-)	-	-
	買建								
	コール	-	-	-	-	-	-	-	-
	米ドル	(-)	(-)	-	-	(-)	(-)	-	-
	ユーロ	-	-	-	-	-	-	-	-
	ポット	(-)	(-)	-	-	(-)	(-)	-	-
	米ドル	11,624	-	9	128	11,471	-	9	43
	ユーロ	(138)	(-)	-	-	(53)	(-)	-	-
ポット	11,624	-	9	128	11,471	-	9	43	
ユーロ	(138)	(-)	-	-	(53)	(-)	-	-	
ポット	-	-	-	-	-	-	-	-	
米ドル	(-)	(-)	-	-	(-)	(-)	-	-	
通貨スワップ	1,310	1,310	119	119	1,318	1,318	59	59	
米ドル払/円受	-	-	-	-	-	-	-	-	
ユーロ払/円受	-	-	-	-	-	-	-	-	
円払/豪ドル受	1,046	1,046	111	111	1,054	1,054	57	57	
合計				69				491	

(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	2020年度末				2021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	5	-	0	0	78	-	0	0
	買建	412	-	3	3	351	-	3	3
	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	758	-	0	7	4,712	-	17	29
		(7)	(-)		(46)	(-)			
店頭	株式先渡契約								
	売建	-	-	0	0	-	-	0	0
	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	4,376	1,479	18	44	5,805	1,260	12	63
		(62)	(23)		(75)	(17)			
合計				48				95	

(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	2020年度末				2021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	89	-	0	0	142	-	0	0
	買建	-	-	-	-	-	-	-	-
	外貨建債券先物								
	売建	-	-	-	-	-	-	-	-
買建	228	-	1	1	188	-	4	4	
合計				1				3	

(注) 「差損益」欄には、時価を記載しています。

(e) その他

2020年度末、2021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	2020年度末			2021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	22,650	22,650	255	255	24,525	24,525	449	449
		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	60	0	0	60	60	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							255				449

(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	
2020 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	-	-	-	22,650	22,750
		平均受取固定金利	0.05	0.02	-	-	-	0.41	0.41
		平均支払変動金利	0.05	0.05	-	-	-	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	-	-	-	-	-	-	-
2021 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	-	60	-	-	-	24,525	24,585
		平均受取固定金利	-	0.02	-	-	-	0.40	0.40
		平均支払変動金利	-	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	-	-	-	-	-	-	-

(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	2020年度末				2021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	時価 ヘッジ	為替予約	外貨建 債券										
		売建		60,415	-	2,244	2,244	64,615	-	689	689		
		米ドル		26,392	-	1,163	1,163	29,124	-	603	603		
		ユーロ		24,835	-	567	567	26,402	-	125	125		
		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						4,741				4,133			
	繰延 ヘッジ	通貨スワップ	外貨建 債券	45,268	44,077	2,496	2,496	48,113	47,089	3,444	3,444		
		米ドル払/円受		28,627	27,738	770	770	31,070	30,389	1,897	1,897		
		ユーロ払/円受		12,094	11,811	1,254	1,254	12,363	12,020	1,169	1,169		

(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	2020年度末				2021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 売建 買建	国内株式	542	-	148	148	1,371	-	27	27
				-	-	-	-	-	-	-	-
合 計							148				27

(注) 「差損益」欄には、時価を記載しています。

(d) 債券関連

2020年度末、2021年度上半期末に該当の残高はありません。

(e) その他

2020年度末、2021年度上半期末に該当の残高はありません。