

# 2023年度第2四半期（上半期）報告 補足資料

## 1. 一般勘定

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

## 2. 個人変額保険特別勘定

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

## 3. 会社計

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

## 1. 一般勘定

### (1) 商品有価証券関係

#### ① 商品有価証券明細表

2022年度末、2023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

2022年度上半期、2023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	2022年度末		2023年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
公社債	301,563	48.3	306,128	46.7
国債	273,621	43.8	278,832	42.5
地方債	8,152	1.3	7,984	1.2
社債	19,790	3.2	19,311	2.9
(うち公社・公団債)	(7,155)	(1.1)	(6,224)	(0.9)
株式	102,536	16.4	119,259	18.2
外国証券	189,544	30.3	202,047	30.8
公社債	100,729	16.1	111,017	16.9
株式等	88,814	14.2	91,029	13.9
その他の証券	31,259	5.0	28,028	4.3
合計	624,904	100.0	655,464	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
2022年度末	有価証券	9,182	28,105	40,914	48,120	49,263	449,318	624,904
	国債	3,996	14,430	16,320	16,484	19,160	203,229	273,621
	地方債	137	374	586	1,193	1,362	4,497	8,152
	社債	1,256	1,879	2,472	3,030	2,973	8,178	19,790
	株式						102,536	102,536
	外国証券	3,503	8,218	13,659	18,012	21,976	124,174	189,544
	公社債	2,921	7,957	13,055	16,521	18,492	41,781	100,729
	株式等	582	261	604	1,491	3,484	82,392	88,814
	その他の証券	289	3,201	7,875	9,399	3,790	6,703	31,259
	買入金銭債権	79	6	13	151	172	820	1,245
	譲渡性預金	2,075	—	—	—	—	—	2,075
	合計	11,338	28,112	40,927	48,271	49,436	450,139	628,225
2023年度上半期末	有価証券	13,352	34,192	44,730	36,645	47,439	479,103	655,464
	国債	7,545	16,698	15,971	12,102	15,495	211,018	278,832
	地方債	110	733	416	1,139	1,393	4,191	7,984
	社債	1,071	2,108	2,440	3,037	3,428	7,225	19,311
	株式						119,259	119,259
	外国証券	4,295	10,754	16,461	18,583	23,338	128,614	202,047
	公社債	3,593	10,199	15,874	17,028	19,408	44,913	111,017
	株式等	702	554	587	1,554	3,929	83,700	91,029
	その他の証券	328	3,898	9,440	1,782	3,784	8,794	28,028
	買入金銭債権	89	1	78	97	159	824	1,251
	譲渡性預金	2,424	—	—	—	—	—	2,424
	合計	15,867	34,193	44,809	36,743	47,598	479,927	659,140

③地域別地方債保有内訳

(単位:億円、%)

区分	2022年度末		2023年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
北海道	59	0.7	59	0.7
東北	5	0.1	5	0.1
関東	4,311	52.9	4,273	53.5
中部	1,656	20.3	1,593	20.0
近畿	695	8.5	694	8.7
中国	188	2.3	187	2.4
四国	—	—	—	—
九州	1,091	13.4	1,026	12.9
その他	144	1.8	144	1.8
合計	8,152	100.0	7,984	100.0

(注)上記「その他」は共同発行市場公募地方債です。

## ④公社債および外国公社債格付別内訳

(単位:億円、%)

区分	2022年度末		2023年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
AAA	5,702	4.4	5,694	4.1
AA	48,058	37.3	51,260	37.1
A	36,224	28.2	40,283	29.1
BBB	36,376	28.3	38,819	28.1
BB以下	57	0.0	30	0.0
格付なし	2,252	1.8	2,225	1.6
合計	128,672	100.0	138,314	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。(2022年度末:27兆3,621億円、2023年度上半期末:27兆8,832億円)  
2. 上記は外部の格付業者の格付け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	2022年度末		2023年度上半期末		
	金額	占率	金額	占率	
水産・農林業	33	0.0	37	0.0	
鉱業	16	0.0	24	0.0	
建設業	1,463	1.4	1,842	1.5	
製造業	食料品	3,290	3.2	3,854	3.2
	繊維製品	1,070	1.0	1,115	0.9
	パルプ・紙	209	0.2	254	0.2
	化学	9,487	9.3	9,963	8.4
	医薬品	8,495	8.3	7,983	6.7
	石油・石炭製品	131	0.1	166	0.1
	ゴム製品	775	0.8	859	0.7
	ガラス・土石製品	815	0.8	892	0.7
	鉄鋼	1,101	1.1	1,330	1.1
	非鉄金属	743	0.7	784	0.7
	金属製品	324	0.3	345	0.3
	機械	5,400	5.3	6,022	5.0
	電気機器	11,602	11.3	12,198	10.2
	輸送用機器	16,670	16.3	23,279	19.5
精密機器	1,105	1.1	1,085	0.9	
その他製品	1,346	1.3	1,634	1.4	
電気・ガス業	2,678	2.6	3,562	3.0	
運輸・情報通信業	陸運業	4,743	4.6	5,358	4.5
	海運業	233	0.2	335	0.3
	空運業	92	0.1	99	0.1
	倉庫・運輸関連業	101	0.1	114	0.1
	情報・通信業	6,097	5.9	6,936	5.8
商業	卸売業	5,385	5.3	6,997	5.9
	小売業	3,125	3.0	3,382	2.8
金融・保険業	銀行業	4,063	4.0	5,626	4.7
	証券、商品先物取引業	677	0.7	806	0.7
	保険業	7,495	7.3	8,161	6.8
	その他金融業	609	0.6	735	0.6
不動産業	444	0.4	545	0.5	
サービス業	2,703	2.6	2,924	2.5	
合計	102,536	100.0	119,259	100.0	

(3) 貸付金関係

① 貸付金明細表

(単位:億円)

区分	2022年度末	2023年度上半期末
保険約款貸付	4,378	4,295
保険料振替貸付	262	250
契約者貸付	4,116	4,045
一般貸付	73,568	76,303
企業貸付	55,697	57,935
国内	47,984	48,166
海外	7,712	9,769
国・国際機関・政府関係機関・ 公共団体・公企業貸付	4,505	4,735
国内	4,427	4,655
海外	77	79
住宅ローン	8,858	8,989
消費者ローン	3,612	3,792
その他	895	851
合 計	77,946	80,599
非居住者貸付	7,790	9,848

② 貸付金企業規模別内訳

(単位:件、億円、%)

区分		2022年度末		2023年度上半期末	
			占率		占率
大企業	貸付先数	671	40.5	649	39.7
	金額	40,555	84.5	40,678	84.5
中堅企業	貸付先数	171	10.3	162	9.9
	金額	494	1.0	450	0.9
中小企業	貸付先数	816	49.2	824	50.4
	金額	6,934	14.5	7,036	14.6
国内企業計	貸付先数	1,658	100.0	1,635	100.0
	金額	47,984	100.0	48,166	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		2022年度末		2023年度上半期末	
		金額	占率	金額	占率
国内向け	製造業	9,366	12.7	9,279	12.2
	食料	698	0.9	694	0.9
	繊維	219	0.3	229	0.3
	木材・木製品	18	0.0	18	0.0
	パルプ・紙	550	0.7	535	0.7
	印刷	333	0.5	316	0.4
	化学	1,922	2.6	2,105	2.8
	石油・石炭	954	1.3	924	1.2
	窯業・土石	438	0.6	424	0.6
	鉄鋼	1,003	1.4	950	1.2
	非鉄金属	161	0.2	161	0.2
	金属製品	90	0.1	88	0.1
	はん用・生産用・業務用機械	837	1.1	845	1.1
	電気機械	788	1.1	726	1.0
	輸送用機械	1,016	1.4	932	1.2
	その他の製造業	330	0.4	325	0.4
	農業、林業	—	—	—	—
	漁業	—	—	—	—
	鉱業、採石業、砂利採取業	19	0.0	13	0.0
	建設業	533	0.7	540	0.7
	電気・ガス・熱供給・水道業	12,880	17.5	13,038	17.1
	情報通信業	1,187	1.6	1,239	1.6
	運輸業、郵便業	6,057	8.2	6,170	8.1
	卸売業	7,109	9.7	7,196	9.4
	小売業	517	0.7	499	0.7
	金融業、保険業	5,624	7.6	5,829	7.6
	不動産業	5,884	8.0	5,808	7.6
物品賃貸業	2,778	3.8	2,759	3.6	
学術研究、専門・技術サービス業	32	0.0	23	0.0	
宿泊業	4	0.0	3	0.0	
飲食業	25	0.0	21	0.0	
生活関連サービス業、娯楽業	32	0.0	31	0.0	
教育、学習支援業	22	0.0	25	0.0	
医療、福祉	8	0.0	8	0.0	
その他のサービス	152	0.2	162	0.2	
地方公共団体	1,067	1.5	1,021	1.3	
個人(住宅・消費・納税資金等)	12,470	17.0	12,781	16.8	
合 計	65,777	89.4	66,454	87.1	
海外向け	政府等	—	—	—	—
	金融機関	1,587	2.2	1,917	2.5
	商工業(等)	6,203	8.4	7,931	10.4
	合 計	7,790	10.6	9,848	12.9
総 合 計	73,568	100.0	76,303	100.0	

## ④貸付金担保別内訳

(単位:億円、%)

区分	2022年度末		2023年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
担保貸付	169	0.2	170	0.2
有価証券担保貸付	37	0.1	40	0.1
不動産・動産・財団担保貸付	125	0.2	126	0.2
指名債権担保貸付	6	0.0	4	0.0
保証貸付	1,180	1.6	1,150	1.5
信用貸付	59,747	81.2	62,201	81.5
その他	12,470	17.0	12,781	16.8
一般貸付計	73,568	100.0	76,303	100.0
うち劣後特約付貸付	1,936	2.6	1,826	2.4

## ⑤貸付金地域別内訳

(単位:億円、%)

区分	2022年度末		2023年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
北海道	944	2.0	1,129	2.3
東北	1,401	2.9	1,334	2.8
関東	32,956	68.7	32,331	67.1
中部	3,546	7.4	3,573	7.4
近畿	6,242	13.0	6,764	14.0
中国	820	1.7	948	2.0
四国	719	1.5	743	1.5
九州	1,352	2.8	1,341	2.8
合計	47,984	100.0	48,166	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
	2022年度末						
固定金利	7,866	10,591	8,901	6,107	9,485	18,247	61,200
変動金利	787	2,167	2,300	1,288	1,869	3,954	12,367
一般貸付計	8,653	12,759	11,202	7,396	11,354	22,201	73,568
2023年度上半期末							
固定金利	8,041	10,579	8,684	6,446	9,471	18,787	62,010
変動金利	1,093	2,427	2,511	1,738	2,329	4,192	14,292
一般貸付計	9,135	13,007	11,196	8,184	11,801	22,979	76,303

#### (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	2022年度末		2023年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
公社債	97,986	47.0	108,957	48.3
株式	9,239	4.4	9,682	4.3
現預金・その他	74,114	35.5	79,452	35.2
小計	181,340	86.9	198,091	87.8

##### ・円貨額が確定した外貨建資産

(単位:億円、%)

区分	2022年度末		2023年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
公社債	—	—	—	—
現預金・その他	2,527	1.2	2,604	1.2
小計	2,527	1.2	2,604	1.2

##### ・円貨建資産

(単位:億円、%)

区分	2022年度末		2023年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
非居住者貸付	244	0.1	238	0.1
公社債(円建外債)・その他	24,555	11.8	24,574	10.9
小計	24,800	11.9	24,812	11.0

##### ・合計

(単位:億円、%)

区分	2022年度末		2023年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
海外投融資	208,668	100.0	225,509	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	2022年度末		2023年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
米ドル	127,429	70.3	138,276	69.8
ユーロ	34,677	19.1	37,433	18.9
イギリスポンド	10,359	5.7	12,311	6.2
オーストラリアドル	4,588	2.5	5,754	2.9
インドルピー	2,084	1.1	2,084	1.1
香港ドル	748	0.4	672	0.3
その他	1,453	0.8	1,559	0.8
合計	181,340	100.0	198,091	100.0

(注) 内訳は、2023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		
	金額	占率	金額	占率	金額	占率	金額	占率	
2022年度末	北米	69,234	36.5	60,780	60.3	8,453	9.5	1,302	16.7
	ヨーロッパ	36,882	19.5	29,397	29.2	7,485	8.4	4,533	58.2
	オセアニア	4,470	2.4	2,607	2.6	1,863	2.1	1,470	18.9
	アジア	7,354	3.9	3,965	3.9	3,389	3.8	—	—
	中南米	71,032	37.5	3,409	3.4	67,623	76.1	133	1.7
	中東	69	0.0	69	0.1	—	—	350	4.5
	アフリカ	—	—	—	—	—	—	—	—
	国際機関	500	0.3	500	0.5	—	—	—	—
	合計	189,544	100.0	100,729	100.0	88,814	100.0	7,790	100.0
2023年度上半期末	北米	77,343	38.3	67,608	60.9	9,735	10.7	1,714	17.4
	ヨーロッパ	40,118	19.9	32,266	29.1	7,852	8.6	5,656	57.4
	オセアニア	4,823	2.4	2,960	2.7	1,863	2.0	1,955	19.9
	アジア	7,371	3.6	4,037	3.6	3,334	3.7	—	—
	中南米	71,732	35.5	3,487	3.1	68,244	75.0	143	1.5
	中東	75	0.0	75	0.1	—	—	378	3.8
	アフリカ	—	—	—	—	—	—	—	—
	国際機関	582	0.3	582	0.5	—	—	—	—
	合計	202,047	100.0	111,017	100.0	91,029	100.0	9,848	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、投融資執行部門（フロントオフィス）に対しての牽制が働く体制としています。また、資産または負債も併せたリスクを定量的に把握・分析し、そのリスク量とともにポジション、損益状況を定期的に「運用リスク管理専門委員会」に報告する体制になっています。

(f) 定量的情報に関する補足説明

ア) 想定元本（契約金額）に関する補足説明

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

イ) 時価算定に係る補足説明

[先物取引等の市場取引]

期末日の清算値または終値

[株式オプション取引]

主に期末日の清算値または終値、外部情報ベンダーより入手した評価額

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

主に外部情報ベンダーより入手した評価額

ウ) 差損益に関する補足説明

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

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

[定量的情報(一般勘定)](ヘッジ会計適用・非適用分合算値)

1. 差損益の内訳(ヘッジ会計適用分・非適用分の内訳)

(単位:億円)

区分	2022年度末						2023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	△1,941	△3,282	△19	—	—	△5,243	△3,731	△9,778	△1	—	—	△13,512
ヘッジ会計非適用分	△305	△799	△50	△30	—	△1,185	△335	△78	△36	△44	—	△495
合計	△2,246	△4,081	△69	△30	—	△6,429	△4,066	△9,857	△38	△44	—	△14,007

(注)ヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ適用分の差損益(2022年度末:通貨関連△4億円、株式関連△19億円、2023年度上半期末:通貨関連△1,710億円、株式関連△1億円)、およびヘッジ会計非適用分の差損益は、損益計算書に計上しています。

2. 金利関連

(単位:億円)

区分	種類	2022年度末				2023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	32,066	32,006	△1,941	△1,941	33,006	33,006	△3,731	△3,731
	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	10,130	8,330	49	△305	9,430	5,493	17	△335	
(355)	(346)	—	—	(352)	(240)	—	—		
固定金利支払/変動金利受取	—	—	—	—	—	—	—	—	
(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—		
合計				△2,246				△4,066	

(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	
2022年度末	固定金利受取 /変動金利支払 スワップ	想定元本	60	—	—	—	606	31,400	32,066
		平均受取固定金利	△0.02	—	—	—	0.46	0.44	0.44
		平均支払変動金利	0.04	—	—	—	△0.03	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	—	—	—	—	—	—	—
2023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	—	—	—	—	4,206	28,800	33,006
		平均受取固定金利	—	—	—	—	0.33	0.48	0.46
		平均支払変動金利	—	—	—	—	△0.02	△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	—	—	—	—	—	—	—

## 3. 通貨関連

(単位:億円)

区分	種類	2022年度末				2023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	81,264	—	△259	△259	98,962	—	△4,223	△4,223
	米ドル	58,247	—	293	293	68,252	—	△3,886	△3,886
	ユーロ	11,968	—	△348	△348	16,761	—	△124	△124
	買建	32,411	—	△561	△561	49,005	—	2,456	2,456
	米ドル	27,262	—	△611	△611	39,123	—	2,390	2,390
	ユーロ	502	—	12	12	4,333	—	5	5
	通貨オプション								
	売建								
	コール	—	—	—	—	2,836	—	36	△13
		(—)	(—)			(22)	(—)		
	米ドル	—	—	—	—	1,839	—	24	△11
		(—)	(—)			(13)	(—)		
	ユーロ	—	—	—	—	99	—	0	0
		(—)	(—)			(0)	(—)		
	ポンド	—	—	—	—	491	—	4	△0
		(—)	(—)			(3)	(—)		
	豪ドル	—	—	—	—	391	—	6	△2
		(—)	(—)			(4)	(—)		
	プット	—	—	—	—	—	—	—	—
		(—)	(—)			(—)	(—)		
	米ドル	—	—	—	—	—	—	—	—
		(—)	(—)			(—)	(—)		
	ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—
		(—)	(—)			(—)	(—)		
	買建								
	コール	—	—	—	—	—	—	—	—
		(—)	(—)			(—)	(—)		
	米ドル	—	—	—	—	—	—	—	—
		(—)	(—)			(—)	(—)		
ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—	
	(—)	(—)			(—)	(—)			
プット	1,335	—	4	△10	8,819	—	9	△64	
	(15)	(—)			(74)	(—)			
米ドル	1,335	—	4	△10	7,823	—	6	△58	
	(15)	(—)			(65)	(—)			
ユーロ	—	—	—	—	99	—	0	△0	
	(—)	(—)			(0)	(—)			
通貨スワップ									
米ドル払/円受	58,904	56,985	△3,250	△3,250	61,646	60,116	△8,011	△8,011	
ユーロ払/円受	39,353	38,118	△3,175	△3,175	41,652	40,662	△6,407	△6,407	
ユーロ払/円受	13,521	12,893	△173	△173	13,823	13,327	△1,342	△1,342	
合計				△4,081				△9,857	

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

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

## 4. 株式関連

(単位:億円)

区分	種類	2022年度末				2023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	5,111	—	11	△43	5,081	—	15	△25
		(54)	(—)			(40)			
店頭	株式先渡契約								
	売建	483	—	△19	△19	96	—	△1	△1
	買建	—	—	—	—	—	—	—	—
	株価指数先渡契約								
	売建	—	—	—	—	—	—	—	—
	買建	540	540	△1	△1	540	293	△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	746	382	2	△5	1,300	—	0	△8	
		(7)	(3)			(9)			
合計				△69				△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、先物取引および先渡取引については時価を記載し、オプション取引についてはオプション料と時価との差額を記載しています。

## 5. 債券関連

(単位:億円)

区分	種類	2022年度末				2023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	選択権付債券売買取引								
	売建								
	コール	—	—	—	—	—	—	—	—
	プット	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	買建	—	—	—	—	—	—	—	—
	コール	1,006	1,006	27	△30	932	932	14	△44
		(58)	(58)			(58)	(58)		
		—	—	—	—	—	—	—	—
		(—)	(—)			(—)	(—)		
合計					△30			△44	

(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、オプション料と時価との差額を記載しています。

## 6. その他

2022年度末、2023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	2022年度末		2023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	911	△12	805	53

### (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	2022年度末						2023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	—	△1	—	△0	△2	0	—	△2
合計	—	△0	△0	0	—	△1	—	△0	△2	0	—	△2

(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

2022年度末、2023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	2022年度末				2023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	242	—	△2	△2	238	—	△3	△3
	米ドル	129	—	△0	△0	113	—	△2	△2
	ユーロ	42	—	△0	△0	49	—	△0	△0
	買建	182	—	1	1	222	—	2	2
	米ドル	62	—	△0	△0	97	—	1	1
	ユーロ	37	—	0	0	42	—	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	2022年度末				2023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	50	—	△0	△0	18	—	0	0
	買建	32	—	0	0	178	—	△2	△2
合計				△0				△2	

(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	2022年度末				2023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	2	—	0	0	13	—	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

2022年度末、2023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	2023年度上半期末	
		うち一般勘定
現預金・コールローン	11,147	8,782
買現先勘定	—	—
買入金銭債権	1,251	1,251
商品有価証券	—	—
金銭の信託	—	—
公社債	309,640	306,128
株式	119,677	119,259
外国証券	203,886	202,047
貸付金	80,599	80,599
不動産	17,117	17,117
資産計	791,454	779,563
うち外貨建資産	200,511	198,091

#### (2) 売買目的有価証券の評価損益(会社計)

(単位:億円)

区分	2022年度末		2023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	7,443	△71	7,909	160

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

## (3) 有価証券の時価情報(会社計)(売買目的有価証券以外)

(単位:億円)

区分	2022年度末					2023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	270,389	277,247	6,857	17,340	△10,483	275,517	267,793	△7,723	10,918	△18,642
満期保有目的の債券	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
子会社・関連会社株式	1,286	2,141	855	855	—	1,286	3,249	1,962	1,962	—
その他有価証券	266,348	339,389	73,040	80,864	△7,823	273,591	364,467	90,876	101,084	△10,207
公社債	32,676	33,432	756	1,178	△422	33,383	32,948	△434	943	△1,378
株式	39,699	95,854	56,155	57,014	△859	39,580	112,588	73,007	73,369	△361
外国証券	161,665	177,985	16,320	21,667	△5,347	170,841	189,633	18,791	25,667	△6,875
公社債	91,399	99,423	8,023	10,464	△2,440	99,731	109,408	9,676	12,610	△2,933
株式等	70,265	78,562	8,296	11,203	△2,906	71,109	80,225	9,115	13,057	△3,941
その他の証券	30,081	29,897	△183	1,003	△1,187	27,114	26,635	△478	1,103	△1,582
買入金銭債権	149	143	△6	0	△6	246	237	△9	0	△10
譲渡性預金	2,076	2,075	△0	0	△0	2,425	2,424	△0	0	△0
合 計	538,024	618,778	80,753	99,060	△18,307	550,394	635,510	85,116	113,965	△28,849
公社債	300,807	308,320	7,512	18,407	△10,894	306,563	298,274	△8,288	11,715	△20,004
株式	39,699	95,854	56,155	57,014	△859	39,580	112,588	73,007	73,369	△361
外国証券	164,098	181,351	17,253	22,607	△5,354	173,441	194,320	20,879	27,760	△6,881
公社債	92,555	100,659	8,103	10,551	△2,447	101,054	110,858	9,803	12,743	△2,939
株式等	71,542	80,692	9,149	12,056	△2,906	72,386	83,462	11,075	15,017	△3,941
その他の証券	30,090	29,909	△181	1,006	△1,187	27,123	26,647	△476	1,105	△1,582
買入金銭債権	1,252	1,266	14	25	△11	1,260	1,254	△6	14	△20
譲渡性預金	2,076	2,075	△0	0	△0	2,425	2,424	△0	0	△0

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

2. 市場価格のない株式等および組合等は本表から除いています。

○市場価格のない株式等および組合等の帳簿価額は以下のとおりです。

(単位:億円)

区分	2022年度末	2023年度上半期末
子会社・関連会社株式	14,757	15,177
その他有価証券	2,041	2,045
国内株式	561	551
外国株式	0	0
その他	1,479	1,493
合 計	16,799	17,222

(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。

(2022年度末:1,205億円、2023年度上半期末:2,275億円)

(4) 金銭の信託の時価情報(会社計)

2022年度末、2023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	2022年度末						2023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	△1,941	△3,282	△19	—	—	△5,243	△3,731	△9,778	△1	—	—	△13,512
ヘッジ会計非適用分	△305	△794	△46	△28	—	△1,175	△335	△83	△51	△46	—	△516
合計	△2,246	△4,077	△66	△28	—	△6,418	△4,066	△9,862	△53	△46	—	△14,029

(注)ヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ適用分の差損益(2022年度末:通貨関連△4億円、株式関連△19億円、2023年度上半期末:通貨関連△1,710億円、株式関連△1億円)、およびヘッジ会計非適用分の差損益は、損益計算書に計上しています。

## 2. ヘッジ会計が適用されていないもの

## (a) 金利関連

(単位:億円)

区分	種類	2022年度末				2023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	—	—	—	—	—	—	—	—
	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	10,130	8,330	49	△305	9,430	5,493	17	△335	
	(355)	(346)	—	—	(352)	(240)	—	—	
固定金利支払/変動金利受取	—	—	—	—	—	—	—	—	
	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	
合計				△305				△335	

(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。

## (b)通貨関連

(単位:億円)

区分	種類	2022年度末				2023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	33,859	—	△253	△253	50,975	—	△2,533	△2,533
	米ドル	22,763	—	△36	△36	33,146	—	△2,267	△2,267
	ユーロ	1,346	—	△27	△27	5,383	—	△94	△94
	ポンド	5,911	—	△170	△170	7,806	—	△96	△96
	買建	33,277	—	△557	△557	50,510	—	2,471	2,471
	米ドル	27,561	—	△614	△614	39,827	—	2,401	2,401
	ユーロ	678	—	14	14	4,684	—	6	6
	通貨オプション								
	売建								
	コール	—	—	—	—	2,836	—	36	△13
		(—)	(—)	—	—	(22)	(—)	—	—
	米ドル	—	—	—	—	1,839	—	24	△11
		(—)	(—)	—	—	(13)	(—)	—	—
	ユーロ	—	—	—	—	99	—	0	0
		(—)	(—)	—	—	(0)	(—)	—	—
	ポンド	—	—	—	—	491	—	4	△0
		(—)	(—)	—	—	(3)	(—)	—	—
	豪ドル	—	—	—	—	391	—	6	△2
		(—)	(—)	—	—	(4)	(—)	—	—
	プット	—	—	—	—	—	—	—	—
		(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	米ドル	—	—	—	—	—	—	—	—
		(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—
		(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	買建								
	コール	—	—	—	—	—	—	—	—
		(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	米ドル	—	—	—	—	—	—	—	—
		(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—
	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	
プット	1,335	—	4	△10	8,819	—	9	△64	
	(15)	(—)	—	—	(74)	(—)	—	—	
米ドル	1,335	—	4	△10	7,823	—	6	△58	
	(15)	(—)	—	—	(65)	(—)	—	—	
ユーロ	—	—	—	—	99	—	0	△0	
	(—)	(—)	—	—	(0)	(—)	—	—	
通貨スワップ	679	671	27	27	615	615	56	56	
米ドル払/円受	—	—	—	—	—	—	—	—	
ユーロ払/円受	—	—	—	—	—	—	—	—	
円払/豪ドル受	448	440	14	14	383	383	30	30	
円払/米ドル受	180	180	14	14	180	180	30	30	
合計				△794				△83	

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

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

## (c) 株式関連

(単位:億円)

区分	種類	2022年度末				2023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	181	—	△4	△4	32	—	0	0
	買建	783	—	7	7	1,043	—	△14	△14
	株価指数オプション								
	売建	—	—	—	—	—	—	—	—
	コール	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	プット	—	—	—	—	—	—	—	—
	コール	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	プット	5,111	—	11	△43	5,081	—	15	△25
	(54)	(—)			(40)	(—)			
店頭	株式先渡契約								
	売建	—	—	—	—	—	—	—	—
	買建	—	—	—	—	—	—	—	—
	株価指数先渡契約								
	売建	—	—	—	—	—	—	—	—
	買建	540	540	△1	△1	540	293	△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	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	
(7)	382	2	△5	1,300	—	0	△8	(9)	
(3)				(9)	(—)				
合計				△46				△51	

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

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

## (d) 債券関連

(単位:億円)

区分	種類	2022年度末				2023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	32	—	0	0	74	—	0	0
	買建	591	—	△0	△0	—	—	—	—
	外貨建債券先物								
売建	—	—	—	—	—	—	—	—	
買建	438	—	2	2	114	—	△2	△2	
店頭	選択権付債券売買取引								
	売建	—	—	—	—	—	—	—	—
	コール	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	プット	—	—	—	—	—	—	—	—
	コール	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	買建	1,006	1,006	27	△30	932	932	14	△44
(58)	(58)			(58)	(58)				
(—)	—	—	—	—	—	—	—	—	
(—)	(—)	(—)		(—)	(—)				
合計				△28				△46	

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

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

## (e) その他

2022年度末、2023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	2022年度末			2023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	繰延ヘッジ	金利スワップ	保険負債								
		固定金利受取/変動金利支払		32,006	32,006	△1,941	△1,941	33,006	33,006	△3,731	△3,731
		固定金利支払/変動金利受取	—	—	—	—	—	—	—	—	
		金利スワップ	貸付金								
固定金利受取/変動金利支払	60	—		△0	△0	—	—	—	—		
		固定金利支払/変動金利受取	—	—	—	—	—	—	—	—	
合計							△1,941				△3,731

(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	
2022年度末	固定金利受取 /変動金利支払 スワップ	想定元本	60	—	—	—	606	31,400	32,066
		平均受取固定金利	△0.02	—	—	—	0.46	0.44	0.44
		平均支払変動金利	0.04	—	—	—	△0.03	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	—	—	—	—	—	—	—
2023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	—	—	—	—	4,206	28,800	33,006
		平均受取固定金利	—	—	—	—	0.33	0.48	0.46
		平均支払変動金利	—	—	—	—	△0.02	△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	—	—	—	—	—	—	—



## (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	2022年度末				2023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	483	—	△19	△19	96	—	△1	△1
		売建 買建		—	—	—	—	—	—	—	—
合 計							△19				△1

(注) 「差損益」欄には、時価を記載しています。

## (d) 債券関連

2022年度末、2023年度上半期末に該当の残高はありません。

## (e) その他

2022年度末、2023年度上半期末に該当の残高はありません。