

Ⅱ． 2019年度決算（案） 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、2019年度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年度末	
	金額	占率	金額	占率
公社債	235,275	42.4	246,581	43.7
国債	208,091	37.5	218,597	38.7
地方債	7,897	1.4	7,314	1.3
社債	19,286	3.5	20,669	3.7
(うち公社・公団債)	(7,930)	(1.4)	(7,929)	(1.4)
株式	89,554	16.1	78,582	13.9
外国証券	198,595	35.8	204,714	36.3
公社債	138,710	25.0	141,910	25.1
株式等	59,884	10.8	62,803	11.1
その他の証券	31,717	5.7	34,398	6.1
合計	555,143	100.0	564,276	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年度末	有価証券	9,041	22,102	27,828	46,998	80,870	377,435	564,276
	国債	3,164	8,828	14,897	22,178	25,068	144,459	218,597
	地方債	51	60	266	770	1,323	4,841	7,314
	社債	550	1,287	2,171	2,354	5,372	8,933	20,669
	株式						78,582	78,582
	外国証券	4,921	10,887	8,370	15,192	29,877	135,465	204,714
	公社債	4,838	10,610	7,867	14,902	28,894	74,796	141,910
	株式等	82	276	502	290	982	60,669	62,803
	その他の証券	353	1,038	2,122	6,502	19,227	5,154	34,398
	買入金銭債権	291	8	11	49	366	1,464	2,190
	譲渡性預金	1,628	—	—	—	—	—	1,628
	合計	10,961	22,111	27,839	47,047	81,236	378,900	568,096

③地域別地方債保有内訳

(単位:億円、%)

区分	2018年度末		2019年度末	
	金額	占率	金額	占率
北海道	22	0.3	32	0.4
東北	—	—	—	—
関東	4,647	58.8	4,166	57.0
中部	1,873	23.7	1,517	20.7
近畿	256	3.2	314	4.3
中国	98	1.2	95	1.3
四国	—	—	—	—
九州	999	12.7	1,044	14.3
その他	—	—	145	2.0
合計	7,897	100.0	7,314	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年度末	
	金額	占率	金額	占率
AAA	16,991	10.2	13,093	7.7
AA	94,547	57.0	90,527	53.3
A	26,113	15.7	31,345	18.4
BBB	26,132	15.8	32,825	19.3
BB以下	111	0.1	193	0.1
格付なし	1,998	1.2	1,908	1.1
合計	165,895	100.0	169,894	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年度末:21兆8,597億円)
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年度末		
	金額	占率	金額	占率	
水産・農林業	50	0.1	30	0.0	
鉱業	13	0.0	9	0.0	
建設業	1,532	1.7	1,262	1.6	
製造業	食料品	3,220	3.6	2,617	3.3
	繊維製品	1,073	1.2	776	1.0
	パルプ・紙	287	0.3	217	0.3
	化学	8,907	9.9	8,156	10.4
	医薬品	7,590	8.5	7,070	9.0
	石油・石炭製品	218	0.2	144	0.2
	ゴム製品	854	1.0	626	0.8
	ガラス・土石製品	773	0.9	615	0.8
	鉄鋼	1,188	1.3	591	0.8
	非鉄金属	728	0.8	477	0.6
	金属製品	328	0.4	257	0.3
	機械	4,834	5.4	3,982	5.1
	電気機器	9,984	11.1	8,800	11.2
	輸送用機器	13,005	14.5	11,680	14.9
精密機器	1,191	1.3	1,341	1.7	
その他製品	1,032	1.2	885	1.1	
電気・ガス業	3,935	4.4	2,891	3.7	
運輸・情報通信業	陸運業	6,249	7.0	4,853	6.2
	海運業	48	0.1	38	0.0
	空運業	181	0.2	121	0.2
	倉庫・運輸関連業	104	0.1	73	0.1
	情報・通信業	2,896	3.2	3,730	4.7
商業	卸売業	3,121	3.5	2,770	3.5
	小売業	2,697	3.0	2,186	2.8
金融・保険業	銀行業	4,214	4.7	2,990	3.8
	証券、商品先物取引業	678	0.8	581	0.7
	保険業	5,691	6.4	5,717	7.3
	その他金融業	520	0.6	481	0.6
不動産業	494	0.6	386	0.5	
サービス業	1,904	2.1	2,212	2.8	
合計	89,554	100.0	78,582	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年度末
保険約款貸付	5,827	5,542
保険料振替貸付	395	361
契約者貸付	5,431	5,181
一般貸付	68,559	68,575
企業貸付	51,118	51,064
国内	47,912	47,331
海外	3,206	3,732
国・国際機関・政府関係機関・ 公共団体・公企業貸付	4,751	4,725
国内	4,451	4,530
海外	300	194
住宅ローン	8,105	8,270
消費者ローン	3,788	3,735
その他	794	779
合 計	74,387	74,118
非居住者貸付	3,506	3,926

② 貸付金企業規模別内訳

(単位:件、億円、%)

区分		2018年度末		2019年度末	
			占率		占率
大企業	貸付先数	783	38.1	754	39.4
	金額	41,159	85.9	40,263	85.1
中堅企業	貸付先数	261	12.7	233	12.2
	金額	672	1.4	553	1.2
中小企業	貸付先数	1,011	49.2	927	48.4
	金額	6,081	12.7	6,515	13.8
国内企業計	貸付先数	2,055	100.0	1,914	100.0
	金額	47,912	100.0	47,331	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年度末	
		金額	占率	金額	占率
国内向け	製造業	10,589	15.4	10,337	15.1
	食料	961	1.4	1,061	1.5
	繊維	193	0.3	198	0.3
	木材・木製品	20	0.0	24	0.0
	パルプ・紙	606	0.9	570	0.8
	印刷	156	0.2	160	0.2
	化学	2,013	2.9	2,011	2.9
	石油・石炭	875	1.3	839	1.2
	窯業・土石	422	0.6	378	0.6
	鉄鋼	1,839	2.7	1,680	2.4
	非鉄金属	190	0.3	144	0.2
	金属製品	91	0.1	84	0.1
	はん用・生産用・業務用機械	1,010	1.5	1,010	1.5
	電気機械	737	1.1	722	1.1
	輸送用機械	1,211	1.8	1,181	1.7
	その他の製造業	257	0.4	268	0.4
	農業、林業	—	—	—	—
	漁業	—	—	—	—
	鉱業、採石業、砂利採取業	25	0.0	33	0.0
	建設業	311	0.5	333	0.5
	電気・ガス・熱供給・水道業	12,359	18.0	12,576	18.3
	情報通信業	1,299	1.9	1,274	1.9
	運輸業、郵便業	6,266	9.1	6,085	8.9
	卸売業	7,708	11.2	7,306	10.7
	小売業	517	0.8	487	0.7
	金融業、保険業	4,689	6.8	4,671	6.8
	不動産業	4,719	6.9	5,291	7.7
物品賃貸業	2,390	3.5	2,344	3.4	
学術研究、専門・技術サービス業	15	0.0	16	0.0	
宿泊業	234	0.3	32	0.0	
飲食業	31	0.0	28	0.0	
生活関連サービス業、娯楽業	442	0.6	355	0.5	
教育、学習支援業	16	0.0	14	0.0	
医療・福祉	10	0.0	8	0.0	
その他のサービス	102	0.1	111	0.2	
地方公共団体	1,426	2.1	1,333	1.9	
個人(住宅・消費・納税資金等)	11,894	17.3	12,005	17.5	
合 計	65,053	94.9	64,648	94.3	
海外向け	政府等	300	0.4	100	0.1
	金融機関	603	0.9	689	1.0
	商工業(等)	2,602	3.8	3,137	4.6
	合 計	3,506	5.1	3,926	5.7
総 合 計	68,559	100.0	68,575	100.0	

④貸付金担保別内訳

(単位:億円、%)

区分	2018年度末		2019年度末	
	金額	占率	金額	占率
担保貸付	297	0.4	280	0.4
有価証券担保貸付	80	0.1	64	0.1
不動産・動産・財団担保貸付	156	0.2	166	0.2
指名債権担保貸付	61	0.1	49	0.1
保証貸付	1,790	2.6	1,553	2.3
信用貸付	54,576	79.6	54,735	79.8
その他	11,894	17.3	12,005	17.5
一般貸付計	68,559	100.0	68,575	100.0
うち劣後特約付貸付	1,616	2.4	1,816	2.6

⑤貸付金地域別内訳

(単位:億円、%)

区分	2018年度末		2019年度末	
	金額	占率	金額	占率
北海道	673	1.4	694	1.5
東北	1,323	2.8	1,327	2.8
関東	31,860	66.5	31,565	66.7
中部	3,958	8.3	3,761	7.9
近畿	6,870	14.3	6,791	14.3
中国	1,173	2.4	1,100	2.3
四国	692	1.4	688	1.5
九州	1,358	2.8	1,402	3.0
合計	47,912	100.0	47,331	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	61,345
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年度末							
固定金利	9,066	11,501	9,127	6,152	7,637	16,809	60,294
変動金利	676	1,066	1,246	1,097	1,499	2,694	8,280
一般貸付計	9,743	12,567	10,373	7,249	9,136	19,504	68,575

(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年度末	
	金額	占率	金額	占率
公社債	135,536	63.3	138,839	62.2
株式	8,892	4.2	7,667	3.4
現預金・その他	42,767	20.0	50,366	22.6
小計	187,195	87.4	196,873	88.2

・円貨額が確定した外貨建資産

(単位: 億円、%)

区分	2018年度末		2019年度末	
	金額	占率	金額	占率
公社債	—	—	—	—
現預金・その他	2,812	1.3	2,521	1.1
小計	2,812	1.3	2,521	1.1

・円貨建資産

(単位: 億円、%)

区分	2018年度末		2019年度末	
	金額	占率	金額	占率
非居住者貸付	738	0.3	548	0.2
公社債(円建外債)・その他	23,417	10.9	23,336	10.5
小計	24,156	11.3	23,885	10.7

・合計

(単位: 億円、%)

区分	2018年度末		2019年度末	
	金額	占率	金額	占率
海外投融資	214,164	100.0	223,281	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年度末	
	金額	占率	金額	占率
米ドル	113,219	60.5	121,830	61.9
ユーロ	46,552	24.9	50,420	25.6
イギリスポンド	13,940	7.4	12,770	6.5
オーストラリアドル	7,290	3.9	6,179	3.1
インドルピー	1,381	0.7	2,083	1.1
香港ドル	1,149	0.6	1,002	0.5
その他	3,661	2.0	2,587	1.3
合計	187,195	100.0	196,873	100.0

(注) 内訳は、2019年度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年度末	北米	75,252	36.8	70,417	49.6	4,834	7.7	498
ヨーロッパ		61,507	30.0	56,520	39.8	4,987	7.9	1,997	50.9
オセアニア		6,417	3.1	5,133	3.6	1,284	2.0	482	12.3
アジア		8,037	3.9	4,249	3.0	3,787	6.0	10	0.3
中南米		51,431	25.1	3,521	2.5	47,909	76.3	423	10.8
中東		—	—	—	—	—	—	342	8.7
アフリカ		—	—	—	—	—	—	172	4.4
国際機関		2,069	1.0	2,069	1.5	—	—	—	—
合計		204,714	100.0	141,910	100.0	62,803	100.0	3,926	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、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	1,038	△1,677	119	—	—	△518
ヘッジ会計非適用分	188	△21	△6	—	—	160	142	△293	132	—	—	△18
合計	673	△966	△6	—	—	△299	1,181	△1,970	252	—	—	△536

(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年度末:通貨関連305億円、株式関連119億円)、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	12,750	12,750	540	540	17,750	17,750	1,038	1,038	—	—	
	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	9,525	9,525	507	142	—	—	
	固定金利支払/変動金利受取	(186)	(186)	—	—	(365)	(365)	—	—	—	—	
合計											673	1,181

(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年度末	固定金利受取/変動金利支払スワップ	想定元本	—	40	60	—	—	17,650	17,750
		平均受取固定金利	—	△0.05	△0.02	—	—	0.45	0.45
		平均支払変動金利	—	△0.01	△0.01	—	—	△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	2018年度末				2019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	87,982	52	△32	△32	76,989	49	410	410
	米ドル	41,254	52	△129	△129	38,120	49	△373	△373
	ユーロ	32,041	—	209	209	27,555	—	171	171
	ポンド	9,865	—	△113	△113	7,577	—	423	423
	買建	2,837	—	△3	△3	5,501	—	△17	△17
	米ドル	1,020	—	0	0	3,689	—	△9	△9
	ユーロ	205	—	△1	△1	561	—	△0	△0
	ポンド	755	—	0	0	898	—	△1	△1
	加ドル	467	—	△3	△3	99	—	△1	△1
	通貨オプション								
	売建								
	コール	12,874	—	15	39	7,019	—	26	△5
	(54)	(—)				(20)	(—)		
	米ドル	12,874	—	15	39	7,019	—	26	△5
	(54)	(—)				(20)	(—)		
	ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—
	(—)	(—)				(—)	(—)		
	プット	2,108	—	0	0	—	—	—	—
	(0)	(—)				(—)	(—)		
	米ドル	2,108	—	0	0	—	—	—	—
	(0)	(—)				(—)	(—)		
	ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—
	(—)	(—)				(—)	(—)		
	買建								
	コール	3,995	—	1	△2	7,019	—	26	△26
	(3)	(—)				(53)	(—)		
	米ドル	3,995	—	1	△2	7,019	—	26	△26
(3)	(—)				(53)	(—)			
ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—	
(—)	(—)				(—)	(—)			
プット	11,741	—	30	△61	13,658	—	116	18	
(91)	(—)				(97)	(—)			
米ドル	10,988	—	27	△55	13,658	—	116	18	
(83)	(—)				(97)	(—)			
ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—	
(—)	(—)				(—)	(—)			
通貨スワップ	16,583	15,457	△907	△907	29,547	28,139	△2,349	△2,349	
米ドル払/円受	6,632	5,822	△681	△681	14,534	13,596	△1,911	△1,911	
ユーロ払/円受	5,382	5,089	△376	△376	8,020	7,624	△251	△251	
ポンド払/円受	1,301	1,279	141	141	3,476	3,402	178	178	
円払/豪ドル受	3,125	3,125	11	11	3,201	3,201	△349	△349	
合計				△966				△1,970	

(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	4,067	—	212	132
		(16)	(—)			(79)	(—)		
店頭	株式先渡契約								
	売建	—	—	—	—	897	—	119	119
	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				252	

(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

2018年度末、2019年度末に該当の残高はありません。

6. その他

2018年度末、2019年度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	835	△57

(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	△3	—	—	△4
合計	—	0	0	△0	—	0	—	△0	△3	—	—	△4

(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	38	—	0	0	92	—	△1	△1
	米ドル	11	—	0	0	48	—	△0	△0
	ユーロ	20	—	0	0	18	—	△0	△0
	豪ドル	0	—	△0	△0	9	—	△0	△0
	買建	49	—	△0	△0	51	—	0	0
	米ドル	28	—	△0	△0	8	—	0	0
	ユーロ	12	—	0	0	26	—	0	0
豪ドル	0	—	△0	△0	9	—	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	2018年度末				2019年度末			
		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	—	—	—	—	29	—	△3	△3
	買建	49	—	0	0	15	—	△0	△0
合計					0			△3	

(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	4	—	△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年度末	
		うち一般勘定
現預金・コールローン	14,436	9,965
買現先勘定	—	—
買入金銭債権	2,190	2,190
商品有価証券	—	—
金銭の信託	337	337
公社債	249,895	246,581
株式	79,010	78,582
外国証券	206,512	204,714
貸付金	74,118	74,118
不動産	16,587	16,587
資産計	690,711	678,687
うち外貨建資産	199,207	196,873

(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	7,142	△240

(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	217,703	255,132	37,429	37,657	△227
満期保有目的の債券	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
子会社・関連会社株式	640	1,368	728	728	—	1,342	1,904	562	563	△0
その他有価証券	269,616	337,085	67,469	70,368	△2,898	275,572	333,416	57,843	64,110	△6,267
公社債	28,953	31,307	2,353	2,364	△10	30,008	31,930	1,922	2,007	△85
株式	42,682	84,459	41,777	43,862	△2,084	41,421	73,202	31,780	34,749	△2,968
外国証券	166,482	187,236	20,753	21,533	△780	170,827	192,868	22,041	25,114	△3,073
公社債	123,905	137,743	13,837	14,350	△512	121,223	140,688	19,465	20,943	△1,478
株式等	42,576	49,492	6,916	7,183	△267	49,603	52,180	2,576	4,170	△1,594
その他の証券	28,270	30,854	2,584	2,606	△22	31,223	33,320	2,096	2,231	△134
買入金銭債権	434	434	0	1	△0	462	465	2	8	△5
譲渡性預金	2,793	2,792	△0	0	△0	1,629	1,628	△0	0	△0
合 計	477,219	586,192	108,972	111,874	△2,901	494,618	590,453	95,835	102,331	△6,495
公社債	232,921	275,912	42,990	43,001	△10	244,659	283,859	39,199	39,467	△268
株式	42,682	84,459	41,777	43,862	△2,084	41,421	73,202	31,780	34,749	△2,968
外国証券	168,103	189,618	21,515	22,297	△782	173,487	196,153	22,665	25,784	△3,118
公社債	124,895	138,767	13,871	14,386	△514	122,550	142,079	19,528	21,051	△1,522
株式等	43,207	50,851	7,643	7,911	△267	50,936	54,073	3,137	4,732	△1,595
その他の証券	28,279	30,864	2,585	2,607	△22	31,232	33,330	2,097	2,232	△134
買入金銭債権	2,439	2,544	104	106	△1	2,187	2,278	91	97	△6
譲渡性預金	2,793	2,792	△0	0	△0	1,629	1,628	△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	10,182
その他有価証券	5,398	5,583
非上場国内株式(店頭売買株式を除く)	532	600
非上場外国株式(店頭売買株式を除く)	1,200	2
非上場外国債券	—	0
その他	3,665	4,980
合 計	15,650	15,766

(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年度末:△376億円)

(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	—	—	—	337	337	—	—	—

(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	337	279

(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	1,038	△1,677	119	—	—	△518
ヘッジ会計非適用分	188	△14	△6	25	—	193	142	△294	109	1	—	△41
合計	673	△958	△6	25	—	△265	1,181	△1,971	228	1	—	△560

(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年度末:通貨関連305億円、株式関連119億円)、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	—	—	—	—
	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	9,525	9,525	507	142	
	(186)	(186)			(365)	(365)			
固定金利支払/変動金利受取	—	—	—	—	—	—	—	—	
	(—)	(—)			(—)	(—)			
合計								188	142

(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	—	—	—	—	—	—

(b)通貨関連

(単位:億円)

区分	種類	2018年度末				2019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	7,160	52	3	3	10,761	49	97	97
	米ドル	3,174	52	△15	△15	6,082	49	△35	△35
	ユーロ	874	—	10	10	854	—	4	4
	ポンド	1,597	—	0	0	2,591	—	74	74
	買建	3,280	—	△3	△3	6,377	—	△11	△11
	米ドル	1,286	—	0	0	4,104	—	△2	△2
	ユーロ	325	—	△1	△1	847	—	△0	△0
	ポンド	780	—	0	0	954	—	△1	△1
	通貨オプション								
	売建								
	コール	12,874	—	15	39	7,019	—	26	△5
	(54)	(—)	(—)	(—)	(—)	(20)	(—)	(—)	(—)
	米ドル	12,874	—	15	39	7,019	—	26	△5
	(54)	(—)	(—)	(—)	(—)	(20)	(—)	(—)	(—)
	ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—
	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)
	プット	2,108	—	0	0	—	—	—	—
	(0)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)
	米ドル	2,108	—	0	0	—	—	—	—
	(0)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)
	ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—
	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)
	買建								
	コール	3,995	—	1	△2	7,019	—	26	△26
	(3)	(—)	(—)	(—)	(—)	(53)	(—)	(—)	(—)
	米ドル	3,995	—	1	△2	7,019	—	26	△26
(3)	(—)	(—)	(—)	(—)	(53)	(—)	(—)	(—)	
ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—	
(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	
プット	11,741	—	30	△61	13,658	—	116	18	
(91)	(—)	(—)	(—)	(—)	(97)	(—)	(—)	(—)	
米ドル	10,988	—	27	△55	13,658	—	116	18	
(83)	(—)	(—)	(—)	(—)	(97)	(—)	(—)	(—)	
ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—	
(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	
通貨スワップ	3,266	3,266	9	9	3,466	3,466	△366	△366	
米ドル払/円受	—	—	—	—	—	—	—	—	
ユーロ払/円受	—	—	—	—	—	—	—	—	
円払/豪ドル受	3,125	3,125	11	11	3,201	3,201	△349	△349	
合計				△14				△294	

(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	387	—	△23	△23
	買建	356	—	0	0	174	—	△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	4,067	—	212	132
		(16)	(—)		(79)	(—)			
店頭	株式先渡契約								
	売建	—	—	—	—	—	—	△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	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
		(—)	(—)		(—)	(—)			
合計				△6				109	

(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	—	—	—	—
	買建	166	—	0	0	413	—	0	0
	外貨建債券先物								
	売建	—	—	—	—	—	—	—	—
買建	1,280	—	25	25	279	—	1	1	
合計				25				1	

(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								
		固定金利受取/変動金利支払 固定金利支払/変動金利受取		10,650	10,650	484	484	17,650	17,650	1,038	1,038
		金利スワップ	貸付金								
		固定金利受取/変動金利支払 固定金利支払/変動金利受取		100	100	0	0	100	100	0	0
合 計							484				1,038

(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 年度末	固定金利受取 /変動金利支払 スワップ	想定元本	—	40	60	—	—	17,650	17,750
		平均受取固定金利	—	△0.05	△0.02	—	—	0.45	0.45
		平均支払変動金利	—	△0.01	△0.01	—	—	△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	ヘッジ 会計 の方法	種類	主な ヘッジ 対象	2018年度末				2019年度末				
				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	67,917	—	305	305	
		米ドル		38,338	—	△113	△113	32,787	—	△348	△348	
		ユーロ		31,617	—	204	204	27,144	—	167	167	
		ポンド		8,376	—	△112	△112	5,130	—	348	348	
		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				△1,677		
	繰延 ヘッジ	通貨スワップ	外貨建 債券	13,316	12,190	△917	△917	26,080	24,672	△1,982	△1,982	
		米ドル払/円受		6,632	5,822	△681	△681	14,534	13,596	△1,911	△1,911	
		ユーロ払/円受		5,382	5,089	△376	△376	8,020	7,624	△251	△251	
		ポンド払/円受		1,301	1,279	141	141	3,476	3,402	178	178	

(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	—	—	—	—	897	—	119	119
		売建 買建		—	—	—	—	—	—	—	—
合 計							—				119

(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年度末に該当の残高はありません。

(e) その他

2018年度末、2019年度末に該当の残高はありません。