

2020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

2019年度末、2020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

2019年度上半期、2020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	2019年度末		2020年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
公社債	246,581	43.7	258,201	43.6
国債	218,597	38.7	227,936	38.5
地方債	7,314	1.3	8,045	1.4
社債	20,669	3.7	22,219	3.8
(うち公社・公団債)	(7,929)	(1.4)	(8,311)	(1.4)
株式	78,582	13.9	89,529	15.1
外国証券	204,714	36.3	209,883	35.5
公社債	141,910	25.1	140,663	23.8
株式等	62,803	11.1	69,220	11.7
その他の証券	34,398	6.1	34,242	5.8
合計	564,276	100.0	591,858	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
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
2020年度上半期末	有価証券	8,543	21,130	30,963	58,716	73,964	398,540	591,858
	国債	3,089	8,220	15,574	25,760	22,033	153,257	227,936
	地方債	41	99	255	724	1,467	5,458	8,045
	社債	640	1,602	2,319	2,961	5,134	9,561	22,219
	株式						89,529	89,529
	外国証券	4,496	10,053	9,268	19,268	30,926	135,869	209,883
	公社債	4,317	9,836	8,764	19,030	29,816	68,899	140,663
	株式等	179	217	504	237	1,110	66,970	69,220
	その他の証券	275	1,153	3,544	10,002	14,402	4,863	34,242
	買入金銭債権	199	4	4	48	418	1,303	1,979
	譲渡性預金	1,461	—	—	—	—	—	1,461
	合計	10,205	21,134	30,968	58,765	74,382	399,844	595,299

③地域別地方債保有内訳

(単位:億円、%)

区分	2019年度末		2020年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
北海道	32	0.4	32	0.4
東北	—	—	—	—
関東	4,166	57.0	4,349	54.1
中部	1,517	20.7	1,635	20.3
近畿	314	4.3	543	6.7
中国	95	1.3	177	2.2
四国	—	—	—	—
九州	1,044	14.3	1,163	14.5
その他	145	2.0	145	1.8
合計	7,314	100.0	8,045	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	2019年度末		2020年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
AAA	13,093	7.7	13,318	7.8
AA	90,527	53.3	83,031	48.6
A	31,345	18.4	35,461	20.7
BBB	32,825	19.3	36,769	21.5
BB以下	193	0.1	307	0.2
格付なし	1,908	1.1	2,040	1.2
合計	169,894	100.0	170,929	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。(2019年度末:21兆8,597億円、2020年度上半期末:22兆7,936億円)
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	2019年度末		2020年度上半期末		
	金額	占率	金額	占率	
水産・農林業	30	0.0	34	0.0	
鉱業	9	0.0	9	0.0	
建設業	1,262	1.6	1,360	1.5	
製造業	食料品	2,617	3.3	2,848	3.2
	繊維製品	776	1.0	782	0.9
	パルプ・紙	217	0.3	214	0.2
	化学	8,156	10.4	9,700	10.8
	医薬品	7,070	9.0	8,876	9.9
	石油・石炭製品	144	0.2	151	0.2
	ゴム製品	626	0.8	651	0.7
	ガラス・土石製品	615	0.8	742	0.8
	鉄鋼	591	0.8	639	0.7
	非鉄金属	477	0.6	542	0.6
	金属製品	257	0.3	320	0.4
	機械	3,982	5.1	5,111	5.7
	電気機器	8,800	11.2	10,731	12.0
	輸送用機器	11,680	14.9	12,766	14.3
精密機器	1,341	1.7	1,625	1.8	
その他製品	885	1.1	957	1.1	
電気・ガス業	2,891	3.7	2,950	3.3	
運輸・情報通信業	陸運業	4,853	6.2	5,018	5.6
	海運業	38	0.0	46	0.1
	空運業	121	0.2	117	0.1
	倉庫・運輸関連業	73	0.1	82	0.1
	情報・通信業	3,730	4.7	4,248	4.7
商業	卸売業	2,770	3.5	3,221	3.6
	小売業	2,186	2.8	2,464	2.8
金融・保険業	銀行業	2,990	3.8	3,357	3.8
	証券、商品先物取引業	581	0.7	608	0.7
	保険業	5,717	7.3	5,699	6.4
	その他金融業	481	0.6	561	0.6
不動産業	386	0.5	380	0.4	
サービス業	2,212	2.8	2,706	3.0	
合計	78,582	100.0	89,529	100.0	

(3) 貸付金関係

① 貸付金明細表

(単位:億円)

区分	2019年度末	2020年度上半期末
保険約款貸付	5,542	5,465
保険料振替貸付	361	344
契約者貸付	5,181	5,121
一般貸付	68,575	69,578
企業貸付	51,064	51,985
国内	47,331	47,445
海外	3,732	4,540
国・国際機関・政府関係機関・ 公共団体・公企業貸付	4,725	4,742
国内	4,530	4,555
海外	194	187
住宅ローン	8,270	8,259
消費者ローン	3,735	3,719
その他	779	871
合 計	74,118	75,044
非居住者貸付	3,926	4,727

② 貸付金企業規模別内訳

(単位:件、億円、%)

区分		2019年度末		2020年度上半期末	
			占率		占率
大企業	貸付先数	754	39.4	722	39.6
	金額	40,263	85.1	40,134	84.6
中堅企業	貸付先数	233	12.2	214	11.7
	金額	553	1.2	522	1.1
中小企業	貸付先数	927	48.4	886	48.6
	金額	6,515	13.8	6,787	14.3
国内企業計	貸付先数	1,914	100.0	1,822	100.0
	金額	47,331	100.0	47,445	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		2019年度末		2020年度上半期末	
		金額	占率	金額	占率
国内向け	製造業	10,337	15.1	10,670	15.3
	食料	1,061	1.5	1,070	1.5
	繊維	198	0.3	201	0.3
	木材・木製品	24	0.0	25	0.0
	パルプ・紙	570	0.8	561	0.8
	印刷	160	0.2	385	0.6
	化学	2,011	2.9	1,898	2.7
	石油・石炭	839	1.2	799	1.1
	窯業・土石	378	0.6	442	0.6
	鉄鋼	1,680	2.4	1,726	2.5
	非鉄金属	144	0.2	141	0.2
	金属製品	84	0.1	88	0.1
	はん用・生産用・業務用機械	1,010	1.5	1,046	1.5
	電気機械	722	1.1	732	1.1
	輸送用機械	1,181	1.7	1,206	1.7
	その他の製造業	268	0.4	345	0.5
	農業、林業	—	—	—	—
	漁業	—	—	—	—
	鉱業、採石業、砂利採取業	33	0.0	29	0.0
	建設業	333	0.5	423	0.6
	電気・ガス・熱供給・水道業	12,576	18.3	12,325	17.7
	情報通信業	1,274	1.9	1,273	1.8
	運輸業、郵便業	6,085	8.9	6,364	9.1
	卸売業	7,306	10.7	7,356	10.6
	小売業	487	0.7	440	0.6
	金融業、保険業	4,671	6.8	4,535	6.5
	不動産業	5,291	7.7	5,294	7.6
物品賃貸業	2,344	3.4	2,364	3.4	
学術研究、専門・技術サービス業	16	0.0	9	0.0	
宿泊業	32	0.0	31	0.0	
飲食業	28	0.0	34	0.0	
生活関連サービス業、娯楽業	355	0.5	266	0.4	
教育、学習支援業	14	0.0	19	0.0	
医療・福祉	8	0.0	7	0.0	
その他のサービス	111	0.2	128	0.2	
地方公共団体	1,333	1.9	1,295	1.9	
個人(住宅・消費・納税資金等)	12,005	17.5	11,979	17.2	
合 計	64,648	94.3	64,851	93.2	
海外向け	政府等	100	0.1	100	0.1
	金融機関	689	1.0	1,046	1.5
	商工業(等)	3,137	4.6	3,581	5.1
	合 計	3,926	5.7	4,727	6.8
総 合 計	68,575	100.0	69,578	100.0	

④貸付金担保別内訳

(単位:億円、%)

区分	2019年度末		2020年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
担保貸付	280	0.4	274	0.4
有価証券担保貸付	64	0.1	60	0.1
不動産・動産・財団担保貸付	166	0.2	169	0.2
指名債権担保貸付	49	0.1	44	0.1
保証貸付	1,553	2.3	1,611	2.3
信用貸付	54,735	79.8	55,714	80.1
その他	12,005	17.5	11,978	17.2
一般貸付計	68,575	100.0	69,578	100.0
うち劣後特約付貸付	1,816	2.6	1,796	2.6

⑤貸付金地域別内訳

(単位:億円、%)

区分	2019年度末		2020年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
北海道	694	1.5	708	1.5
東北	1,327	2.8	1,340	2.8
関東	31,565	66.7	32,037	67.5
中部	3,761	7.9	3,729	7.9
近畿	6,791	14.3	6,604	13.9
中国	1,100	2.3	943	2.0
四国	688	1.5	643	1.4
九州	1,402	3.0	1,437	3.0
合計	47,331	100.0	47,445	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
	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
2020年度上半期末							
固定金利	9,062	11,660	9,015	6,204	7,800	17,035	60,779
変動金利	513	1,256	1,282	1,649	1,226	2,870	8,799
一般貸付計	9,576	12,917	10,298	7,853	9,027	19,906	69,578

(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	2019年度末		2020年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
公社債	138,839	62.2	138,486	60.4
株式	7,667	3.4	8,115	3.5
現預金・その他	50,366	22.6	56,376	24.6
小計	196,873	88.2	202,977	88.6

・円貨額が確定した外貨建資産

(単位:億円、%)

区分	2019年度末		2020年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
公社債	—	—	—	—
現預金・その他	2,521	1.1	2,404	1.0
小計	2,521	1.1	2,404	1.0

・円貨建資産

(単位:億円、%)

区分	2019年度末		2020年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
非居住者貸付	548	0.2	560	0.2
公社債(円建外債)・その他	23,336	10.5	23,266	10.2
小計	23,885	10.7	23,826	10.4

・合計

(単位:億円、%)

区分	2019年度末		2020年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
海外投融資	223,281	100.0	229,208	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	2019年度末		2020年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
米ドル	121,830	61.9	124,139	61.2
ユーロ	50,420	25.6	51,990	25.6
イギリスポンド	12,770	6.5	13,486	6.6
オーストラリアドル	6,179	3.1	7,373	3.6
インドルピー	2,083	1.1	2,083	1.0
香港ドル	1,002	0.5	1,077	0.5
その他	2,587	1.3	2,825	1.4
合計	196,873	100.0	202,977	100.0

(注) 内訳は、2020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	
2019年度末	北米	75,252	36.8	70,417	49.6	4,834	7.7	498	12.7
	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
2020年度上半期末	北米	73,264	34.9	67,709	48.1	5,554	8.0	581	12.3
	ヨーロッパ	62,604	29.8	56,700	40.3	5,904	8.5	2,551	54.0
	オセアニア	7,182	3.4	5,655	4.0	1,527	2.2	701	14.8
	アジア	8,445	4.0	4,668	3.3	3,777	5.5	10	0.2
	中南米	56,164	26.8	3,707	2.6	52,456	75.8	394	8.3
	中東	93	0.0	93	0.1	—	—	323	6.9
	アフリカ	—	—	—	—	—	—	165	3.5
	国際機関	2,129	1.0	2,129	1.5	—	—	—	—
	合計	209,883	100.0	140,663	100.0	69,220	100.0	4,727	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	2019年度末						2020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	1,038	△1,677	119	—	—	△518	847	△2,196	△14	—	—	△1,363
ヘッジ会計非適用分	142	△293	132	—	—	△18	△50	13	△1	—	—	△39
合計	1,181	△1,970	252	—	—	△536	796	△2,183	△16	—	—	△1,402

(注)ヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ適用分の差損益(2019年度末:通貨関連305億円、株式関連119億円、2020年度上半期末:通貨関連213億円、株式関連△14億円)、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	2019年度末				2020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	17,750	17,750	1,038	1,038	19,838	19,798	847	847
	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	9,525	9,525	507	142	10,500	10,500	356	△50
	固定金利支払/変動金利受取	(365)	(365)	—	—	(406)	(406)	—	—
合計	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	
合計				1,181				796	

(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
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
		平均受取固定金利	—	△0.05	△0.02	—	—	0.45
		平均支払変動金利	—	△0.01	△0.01	—	—	△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	—	—	—	—	—	—
2020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	—	—	73	19,665
		平均受取固定金利	△0.05	△0.02	—	—	0.03	0.43
		平均支払変動金利	△0.02	△0.02	—	—	△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	—	—	—	—	—	—

3. 通貨関連

(単位:億円)

区分	種類	2019年度末				2020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	76,989	49	410	410	88,451	48	345	345
	米ドル	38,120	49	△373	△373	44,832	48	279	279
	ユーロ	27,555	—	171	171	29,305	—	42	42
	買建	5,501	—	△17	△17	28,036	—	△219	△219
	米ドル	3,689	—	△9	△9	22,096	—	△244	△244
	ユーロ	561	—	△0	△0	1,829	—	19	19
	豪ドル	191	—	△1	△1	3,038	—	3	3
	通貨オプション								
	売建								
	コール	7,019	—	26	△5	8,464	—	4	30
	(20)	(—)	(—)			(35)	(—)		
	米ドル	7,019	—	26	△5	8,464	—	4	30
	(20)	(—)	(—)			(35)	(—)		
	ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—
	(—)	(—)	(—)			(—)	(—)		
	プット	—	—	—	—	5,025	—	25	20
	(—)	(—)	(—)			(45)	(—)		
	米ドル	—	—	—	—	5,025	—	25	20
	(—)	(—)	(—)			(45)	(—)		
	ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—
	(—)	(—)	(—)			(—)	(—)		
	買建								
	コール	7,019	—	26	△26	2,116	—	1	△1
	(53)	(—)	(—)			(2)	(—)		
	米ドル	7,019	—	26	△26	2,116	—	1	△1
(53)	(—)	(—)			(2)	(—)			
ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—	
(—)	(—)	(—)			(—)	(—)			
プット	13,658	—	116	18	15,605	—	107	△61	
(97)	(—)	(—)			(169)	(—)			
米ドル	13,658	—	116	18	15,605	—	107	△61	
(97)	(—)	(—)			(169)	(—)			
ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—	
(—)	(—)	(—)			(—)	(—)			
通貨スワップ	29,547	28,139	△2,349	△2,349	42,255	40,729	△2,297	△2,297	
米ドル払/円受	14,534	13,596	△1,911	△1,911	25,731	24,450	△1,458	△1,458	
ユーロ払/円受	8,020	7,624	△251	△251	9,249	9,096	△857	△857	
合計				△1,970				△2,183	

(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、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	2019年度末				2020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	4,067	—	212	132	—	—	—	—
		(79)	(—)		(—)	(—)			
店頭	株式先渡契約								
	売建	897	—	119	119	695	—	△14	△14
	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	—	—	—	—	500	500	6	△1
	(—)	(—)			(7)	(7)			
合計				252				△16	

(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

2019年度末、2020年度上半期末に該当の残高はありません。

6. その他

2019年度末、2020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	2019年度末		2020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	835	△57	906	32

(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	2019年度末						2020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	△3	-	-	△4	-	0	0	0	-	0
合計	-	△0	△3	-	-	△4	-	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

2019年度末、2020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	2019年度末				2020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	92	-	△1	△1	120	-	0	0
	米ドル	48	-	△0	△0	66	-	0	0
	ユーロ	18	-	△0	△0	36	-	0	0
	買建	51	-	0	0	95	-	△0	△0
	米ドル	8	-	0	0	63	-	△0	△0
	ユーロ	26	-	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	2019年度末				2020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	29	-	△3	△3	20	-	0	0
	買建	15	-	△0	△0	-	-	-	-
合計				△3				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	2019年度末				2020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	-	-	-	-	33	-	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

2019年度末、2020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	2020年度上半期末	
		うち一般勘定
現預金・コールローン	14,384	10,584
買現先勘定	—	—
買入金銭債権	1,979	1,979
商品有価証券	—	—
金銭の信託	33	33
公社債	261,649	258,201
株式	90,077	89,529
外国証券	211,857	209,883
貸付金	75,044	75,044
不動産	16,559	16,559
資産計	717,500	705,659
うち外貨建資産	205,449	202,977

(2) 売買目的有価証券の評価損益(会社計)

(単位:億円)

区分	2019年度末		2020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	7,142	△240	7,411	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	2019年度末					2020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	217,703	255,132	37,429	37,657	△227	229,902	263,580	33,677	34,575	△898
満期保有目的の債券	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
子会社・関連会社株式	1,342	1,904	562	563	△0	1,342	2,084	742	742	—
その他有価証券	275,572	333,416	57,843	64,110	△6,267	269,751	347,226	77,475	80,885	△3,409
公社債	30,008	31,930	1,922	2,007	△85	29,071	31,137	2,065	2,113	△47
株式	41,421	73,202	31,780	34,749	△2,968	41,078	84,138	43,059	45,615	△2,555
外国証券	170,827	192,868	22,041	25,114	△3,073	166,877	197,022	30,144	30,872	△727
公社債	121,223	140,688	19,465	20,943	△1,478	116,293	139,464	23,170	23,470	△299
株式等	49,603	52,180	2,576	4,170	△1,594	50,584	57,557	6,973	7,402	△428
その他の証券	31,223	33,320	2,096	2,231	△134	30,895	33,096	2,201	2,276	△75
買入金銭債権	462	465	2	8	△5	366	369	3	7	△3
譲渡性預金	1,629	1,628	△0	0	△0	1,462	1,461	△0	0	△0
合 計	494,618	590,453	95,835	102,331	△6,495	500,996	612,891	111,894	116,203	△4,308
公社債	244,659	283,859	39,199	39,467	△268	256,136	291,698	35,562	36,507	△945
株式	41,421	73,202	31,780	34,749	△2,968	41,078	84,138	43,059	45,615	△2,555
外国証券	173,487	196,153	22,665	25,784	△3,118	169,439	200,425	30,986	31,715	△728
公社債	122,550	142,079	19,528	21,051	△1,522	117,522	140,793	23,271	23,571	△300
株式等	50,936	54,073	3,137	4,732	△1,595	51,917	59,632	7,715	8,143	△428
その他の証券	31,232	33,330	2,097	2,232	△134	30,904	33,107	2,202	2,277	△75
買入金銭債権	2,187	2,278	91	97	△6	1,975	2,059	83	87	△4
譲渡性預金	1,629	1,628	△0	0	△0	1,462	1,461	△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	2019年度末	2020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	10,182	10,612
その他有価証券	5,583	6,338
非上場国内株式(店頭売買株式を除く)	600	616
非上場外国株式(店頭売買株式を除く)	2	3
非上場外国債券	0	31
その他	4,980	5,686
合 計	15,766	16,951

(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。
(2019年度末: △376億円、2020年度上半期末: △287億円)

(4) 金銭の信託の時価情報(会社計)

(単位:億円)

区分	2019年度末					2020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	337	337	—	—	—	33	33	—	—	—

(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	2019年度末		2020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	337	279	33	△249

(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

2019年度末、2020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	2019年度末						2020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	1,038	△1,677	119	—	—	△518	847	△2,196	△14	—	—	△1,363
ヘッジ会計非適用分	142	△294	109	1	—	△41	△50	18	△5	4	—	△33
合計	1,181	△1,971	228	1	—	△560	796	△2,178	△20	4	—	△1,396

(注)ヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ適用分の差損益(2019年度末:通貨関連305億円、株式関連119億円、2020年度上半期末:通貨関連213億円、株式関連△14億円)、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	2019年度末				2020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	—	—	—	—	88	88	0	0
	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	9,525	9,525	507	142	10,500	10,500	356	△50
	固定金利支払/変動金利受取	(365)	(365)	—	—	(406)	(406)	—	—
合計	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	△50

(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	
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	—	—	—	—	—	—	
2020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	—	—	—	—	73	15	88
		平均受取固定金利	—	—	—	—	0.03	0.25	0.07
		平均支払変動金利	—	—	—	—	△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	—	—	—	—	—	—	—

(b)通貨関連

(単位:億円)

区分	種類	2019年度末				2020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	10,761	49	97	97	26,331	48	140	140
	米ドル	6,082	49	△35	△35	18,942	48	144	144
	ユーロ	854	—	4	4	2,716	—	12	12
	ポンド	2,591	—	74	74	3,036	—	△18	△18
	買建	6,377	—	△11	△11	28,725	—	△222	△222
	米ドル	4,104	—	△2	△2	22,547	—	△246	△246
	ユーロ	847	—	△0	△0	1,967	—	18	18
	豪ドル	277	—	△1	△1	3,064	—	3	3
	通貨オプション								
	売建								
	コール	7,019	—	26	△5	8,464	—	4	30
		(20)	(—)			(35)	(—)		
	米ドル	7,019	—	26	△5	8,464	—	4	30
		(20)	(—)			(35)	(—)		
	ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—
		(—)	(—)			(—)	(—)		
	プット	—	—	—	—	5,025	—	25	20
		(—)	(—)			(45)	(—)		
	米ドル	—	—	—	—	5,025	—	25	20
		(—)	(—)			(45)	(—)		
	ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—
		(—)	(—)			(—)	(—)		
	買建								
	コール	7,019	—	26	△26	2,116	—	1	△1
		(53)	(—)			(2)	(—)		
	米ドル	7,019	—	26	△26	2,116	—	1	△1
		(53)	(—)			(2)	(—)		
	ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—
		(—)	(—)			(—)	(—)		
プット	13,658	—	116	18	15,605	—	107	△61	
	(97)	(—)			(169)	(—)			
米ドル	13,658	—	116	18	15,605	—	107	△61	
	(97)	(—)			(169)	(—)			
ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—	
	(—)	(—)			(—)	(—)			
通貨スワップ	3,466	3,466	△366	△366	3,204	3,204	112	112	
米ドル払/円受	—	—	—	—	—	—	—	—	
ユーロ払/円受	—	—	—	—	—	—	—	—	
円払/豪ドル受	3,201	3,201	△349	△349	2,939	2,939	112	112	
合計				△294				18	

(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	2019年度末				2020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	387	—	△23	△23	121	—	△1	△1
	買建	174	—	△0	△0	469	—	△2	△2
	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	4,067	—	212	132	—	—	—	—
		(79)	(—)		(—)	(—)			
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	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	6	△1
		(—)	(—)		500	500			
					(7)	(7)			
合計				109				△5	

(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	2019年度末				2020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	—	—	—	—	124	—	0	0
	買建	413	—	0	0	259	—	0	0
	外貨建債券先物								
	売建	—	—	—	—	—	—	—	—
買建	279	—	1	1	1,552	—	4	4	
合計				1				4	

(注)「差損益」欄には、時価を記載しています。

(e) その他

2019年度末、2020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	2019年度末			2020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								
		固定金利受取/変動金利支払		17,650	17,650	1,038	1,038	19,650	19,650	847	847
		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	100	100		0	0	100	60	0	0		
		固定金利支払/変動金利受取	—	—	—	—	—	—	—	—	
合 計							1,038				847

(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
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	—	—	—	—	—	—	—
2020 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	—	—	—	19,650	19,750
		平均受取固定金利	△0.05	△0.02	—	—	—	0.43	0.43
		平均支払変動金利	△0.02	△0.02	—	—	—	△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	—	—	—	—	—	—	—

(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	2019年度末				2020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	897	—	119	119	695	—	△14	△14
		売建 買建		—	—	—	—	—	—	—	—
合 計							119				△14

(注) 「差損益」欄には、時価を記載しています。

(d) 債券関連

2019年度末、2020年度上半期末に該当の残高はありません。

(e) その他

2019年度末、2020年度上半期末に該当の残高はありません。