# Ⅱ．２０２０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


日本生命保険相互会社

## 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、2020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 | 2019年度末 | | 2020年度末 | |
|---|---|---|---|---|
| | 金額 | 占率 | 金額 | 占率 |
| 公社債 | 246,581 | 43.7 | 262,254 | 42.6 |
| 国債 | 218,597 | 38.7 | 231,701 | 37.7 |
| 地方債 | 7,314 | 1.3 | 8,304 | 1.4 |
| 社債 | 20,669 | 3.7 | 22,248 | 3.6 |
| (うち公社・公団債) | (7,929) | (1.4) | (8,536) | (1.4) |
| 株式 | 78,582 | 13.9 | 105,782 | 17.2 |
| 外国証券 | 204,714 | 36.3 | 212,641 | 34.6 |
| 公社債 | 141,910 | 25.1 | 137,670 | 22.4 |
| 株式等 | 62,803 | 11.1 | 74,970 | 12.2 |
| その他の証券 | 34,398 | 6.1 | 34,379 | 5.6 |
| 合　計 | 564,276 | 100.0 | 615,058 | 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 |

③地域別地方債保有内訳

（単位：億円、％）

| 区分 | 2019年度末 | | 2020年度末 | |
|---|---|---|---|---|
| | 金額 | 占率 | 金額 | 占率 |
| 北海道 | 32 | 0.4 | 69 | 0.8 |
| 東北 | － | － | － | － |
| 関東 | 4,166 | 57.0 | 4,466 | 53.8 |
| 中部 | 1,517 | 20.7 | 1,669 | 20.1 |
| 近畿 | 314 | 4.3 | 599 | 7.2 |
| 中国 | 95 | 1.3 | 188 | 2.3 |
| 四国 | － | － | － | － |
| 九州 | 1,044 | 14.3 | 1,167 | 14.1 |
| その他 | 145 | 2.0 | 145 | 1.7 |
| 合　計 | 7,314 | 100.0 | 8,304 | 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年度末 | |
|---|---|---|---|---|
| | 金額 | 占率 | 金額 | 占率 |
| AAA | 13,093 | 7.7 | 12,339 | 7.3 |
| AA | 90,527 | 53.3 | 78,501 | 46.7 |
| A | 31,345 | 18.4 | 34,182 | 20.3 |
| BBB | 32,825 | 19.3 | 40,769 | 24.2 |
| BB以下 | 193 | 0.1 | 192 | 0.1 |
| 格付なし | 1,908 | 1.1 | 2,238 | 1.3 |
| 合　計 | 169,894 | 100.0 | 168,223 | 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年度末：23兆1,701億円)
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年度末 | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 金額 | 占率 | 金額 | 占率 |
| 水産・農林業 | | 30 | 0.0 | 37 | 0.0 |
| 鉱業 | | 9 | 0.0 | 10 | 0.0 |
| 建設業 | | 1,262 | 1.6 | 1,512 | 1.4 |
| 製造業 | 食料品 | 2,617 | 3.3 | 3,001 | 2.8 |
| | 繊維製品 | 776 | 1.0 | 973 | 0.9 |
| | パルプ・紙 | 217 | 0.3 | 288 | 0.3 |
| | 化学 | 8,156 | 10.4 | 11,562 | 10.9 |
| | 医薬品 | 7,070 | 9.0 | 8,789 | 8.3 |
| | 石油・石炭製品 | 144 | 0.2 | 130 | 0.1 |
| | ゴム製品 | 626 | 0.8 | 834 | 0.8 |
| | ガラス・土石製品 | 615 | 0.8 | 927 | 0.9 |
| | 鉄鋼 | 591 | 0.8 | 964 | 0.9 |
| | 非鉄金属 | 477 | 0.6 | 736 | 0.7 |
| | 金属製品 | 257 | 0.3 | 407 | 0.4 |
| | 機械 | 3,982 | 5.1 | 6,390 | 6.0 |
| | 電気機器 | 8,800 | 11.2 | 14,111 | 13.3 |
| | 輸送用機器 | 11,680 | 14.9 | 15,592 | 14.7 |
| | 精密機器 | 1,341 | 1.7 | 1,800 | 1.7 |
| | その他製品 | 885 | 1.1 | 1,111 | 1.1 |
| 電気・ガス業 | | 2,891 | 3.7 | 3,188 | 3.0 |
| 運輸・情報通信業 | 陸運業 | 4,853 | 6.2 | 5,614 | 5.3 |
| | 海運業 | 38 | 0.0 | 79 | 0.1 |
| | 空運業 | 121 | 0.2 | 84 | 0.1 |
| | 倉庫・運輸関連業 | 73 | 0.1 | 82 | 0.1 |
| | 情報・通信業 | 3,730 | 4.7 | 5,582 | 5.3 |
| 商業 | 卸売業 | 2,770 | 3.5 | 3,934 | 3.7 |
| | 小売業 | 2,186 | 2.8 | 3,008 | 2.8 |
| 金融・保険業 | 銀行業 | 2,990 | 3.8 | 3,792 | 3.6 |
| | 証券、商品先物取引業 | 581 | 0.7 | 687 | 0.6 |
| | 保険業 | 5,717 | 7.3 | 6,363 | 6.0 |
| | その他金融業 | 481 | 0.6 | 629 | 0.6 |
| 不動産業 | | 386 | 0.5 | 472 | 0.4 |
| サービス業 | | 2,212 | 2.8 | 3,075 | 2.9 |
| 合　計 | | 78,582 | 100.0 | 105,782 | 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年度末 |
|---|---|---|---|---|
| 保険約款貸付 | | | 5,542 | 4,908 |
| | 保険料振替貸付 | | 361 | 324 |
| | 契約者貸付 | | 5,181 | 4,584 |
| 一般貸付 | | | 68,575 | 69,398 |
| | 企業貸付 | | 51,064 | 51,920 |
| | | 国内 | 47,331 | 46,182 |
| | | 海外 | 3,732 | 5,738 |
| | 国・国際機関・政府関係機関・公共団体・公企業貸付 | | 4,725 | 4,545 |
| | | 国内 | 4,530 | 4,458 |
| | | 海外 | 194 | 86 |
| | 住宅ローン | | 8,270 | 8,333 |
| | 消費者ローン | | 3,735 | 3,711 |
| | その他 | | 779 | 888 |
| 合　計 | | | 74,118 | 74,307 |
| | 非居住者貸付 | | 3,926 | 5,824 |

②貸付金企業規模別内訳

(単位:件、億円、%)

| 区分 | | | 2019年度末 | | 2020年度末 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | | 占率 | | 占率 |
| | 大企業 | 貸付先数 | 754 | 39.4 | 705 | 40.0 |
| | | 金額 | 40,263 | 85.1 | 39,270 | 85.0 |
| | 中堅企業 | 貸付先数 | 233 | 12.2 | 208 | 11.8 |
| | | 金額 | 553 | 1.2 | 508 | 1.1 |
| | 中小企業 | 貸付先数 | 927 | 48.4 | 850 | 48.2 |
| | | 金額 | 6,515 | 13.8 | 6,402 | 13.9 |
| 国内企業計 | | 貸付先数 | 1,914 | 100.0 | 1,763 | 100.0 |
| | | 金額 | 47,331 | 100.0 | 46,182 | 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 かつ | 資本金10億円以上 | 常用する従業員50名超 かつ | 資本金10億円以上 | 常用する従業員100名超 かつ | 資本金10億円以上 | 常用する従業員100名超 かつ | 資本金10億円以上 |
| 中堅企業 | | 資本金3億円超10億円未満 | | 資本金5千万円超10億円未満 | | 資本金5千万円超10億円未満 | | 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年度末 | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 金額 | 占率 | 金額 | 占率 |
| 国内向け | 製造業 | 10,337 | 15.1 | 10,153 | 14.6 |
| | 食料 | 1,061 | 1.5 | 1,041 | 1.5 |
| | 繊維 | 198 | 0.3 | 129 | 0.2 |
| | 木材・木製品 | 24 | 0.0 | 19 | 0.0 |
| | パルプ・紙 | 570 | 0.8 | 561 | 0.8 |
| | 印刷 | 160 | 0.2 | 383 | 0.6 |
| | 化学 | 2,011 | 2.9 | 1,730 | 2.5 |
| | 石油・石炭 | 839 | 1.2 | 956 | 1.4 |
| | 窯業・土石 | 378 | 0.6 | 438 | 0.6 |
| | 鉄鋼 | 1,680 | 2.4 | 1,432 | 2.1 |
| | 非鉄金属 | 144 | 0.2 | 128 | 0.2 |
| | 金属製品 | 84 | 0.1 | 91 | 0.1 |
| | はん用・生産用・業務用機械 | 1,010 | 1.5 | 999 | 1.4 |
| | 電気機械 | 722 | 1.1 | 691 | 1.0 |
| | 輸送用機械 | 1,181 | 1.7 | 1,272 | 1.8 |
| | その他の製造業 | 268 | 0.4 | 277 | 0.4 |
| | 農業、林業 | — | — | — | — |
| | 漁業 | — | — | — | — |
| | 鉱業、採石業、砂利採取業 | 33 | 0.0 | 27 | 0.0 |
| | 建設業 | 333 | 0.5 | 443 | 0.6 |
| | 電気・ガス・熱供給・水道業 | 12,576 | 18.3 | 12,083 | 17.4 |
| | 情報通信業 | 1,274 | 1.9 | 1,271 | 1.8 |
| | 運輸業、郵便業 | 6,085 | 8.9 | 6,216 | 9.0 |
| | 卸売業 | 7,306 | 10.7 | 7,275 | 10.5 |
| | 小売業 | 487 | 0.7 | 408 | 0.6 |
| | 金融業、保険業 | 4,671 | 6.8 | 4,309 | 6.2 |
| | 不動産業 | 5,291 | 7.7 | 5,377 | 7.7 |
| | 物品賃貸業 | 2,344 | 3.4 | 2,224 | 3.2 |
| | 学術研究、専門・技術サービス業 | 16 | 0.0 | 26 | 0.0 |
| | 宿泊業 | 32 | 0.0 | 19 | 0.0 |
| | 飲食業 | 28 | 0.0 | 29 | 0.0 |
| | 生活関連サービス業、娯楽業 | 355 | 0.5 | 244 | 0.4 |
| | 教育、学習支援業 | 14 | 0.0 | 19 | 0.0 |
| | 医療・福祉 | 8 | 0.0 | 8 | 0.0 |
| | その他のサービス | 111 | 0.2 | 130 | 0.2 |
| | 地方公共団体 | 1,333 | 1.9 | 1,257 | 1.8 |
| | 個人(住宅・消費・納税資金等) | 12,005 | 17.5 | 12,044 | 17.4 |
| | 合　計 | 64,648 | 94.3 | 63,573 | 91.6 |
| 海外向け | 政府等 | 100 | 0.1 | — | — |
| | 金融機関 | 689 | 1.0 | 1,276 | 1.8 |
| | 商工業(等) | 3,137 | 4.6 | 4,547 | 6.6 |
| | 合　計 | 3,926 | 5.7 | 5,824 | 8.4 |
| 総　合　計 | | 68,575 | 100.0 | 69,398 | 100.0 |

④貸付金担保別内訳

(単位:億円、%)

| 区分 | | 2019年度末 | | 2020年度末 | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 金額 | 占率 | 金額 | 占率 |
| 担保貸付 | | 280 | 0.4 | 229 | 0.3 |
| | 有価証券担保貸付 | 64 | 0.1 | 49 | 0.1 |
| | 不動産・動産・財団担保貸付 | 166 | 0.2 | 153 | 0.2 |
| | 指名債権担保貸付 | 49 | 0.1 | 26 | 0.0 |
| 保証貸付 | | 1,553 | 2.3 | 1,484 | 2.1 |
| 信用貸付 | | 54,735 | 79.8 | 55,640 | 80.2 |
| その他 | | 12,005 | 17.5 | 12,044 | 17.4 |
| 一般貸付計 | | 68,575 | 100.0 | 69,398 | 100.0 |
| | うち劣後特約付貸付 | 1,816 | 2.6 | 1,706 | 2.5 |

⑤貸付金地域別内訳

(単位:億円、%)

| 区分 | 2019年度末 | | 2020年度末 | |
|---|---|---|---|---|
| | 金額 | 占率 | 金額 | 占率 |
| 北海道 | 694 | 1.5 | 708 | 1.5 |
| 東北 | 1,327 | 2.8 | 1,333 | 2.9 |
| 関東 | 31,565 | 66.7 | 31,175 | 67.5 |
| 中部 | 3,761 | 7.9 | 3,467 | 7.5 |
| 近畿 | 6,791 | 14.3 | 6,596 | 14.3 |
| 中国 | 1,100 | 2.3 | 896 | 1.9 |
| 四国 | 688 | 1.5 | 695 | 1.5 |
| 九州 | 1,402 | 3.0 | 1,308 | 2.8 |
| 合　計 | 47,331 | 100.0 | 46,182 | 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<br>3年以下 | 3年超<br>5年以下 | 5年超<br>7年以下 | 7年超<br>10年以下 | 10年超<br>(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 |

(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年度末 | |
|---|---|---|---|---|
| | 金額 | 占率 | 金額 | 占率 |
| 公社債 | 138,839 | 62.2 | 136,280 | 58.6 |
| 株式 | 7,667 | 3.4 | 8,804 | 3.8 |
| 現預金・その他 | 50,366 | 22.6 | 61,672 | 26.5 |
| 小　計 | 196,873 | 88.2 | 206,757 | 88.9 |

・円貨額が確定した外貨建資産

(単位:億円、%)

| 区分 | 2019年度末 | | 2020年度末 | |
|---|---|---|---|---|
| | 金額 | 占率 | 金額 | 占率 |
| 公社債 | － | － | － | － |
| 現預金・その他 | 2,521 | 1.1 | 2,051 | 0.9 |
| 小　計 | 2,521 | 1.1 | 2,051 | 0.9 |

・円貨建資産

(単位:億円、%)

| 区分 | 2019年度末 | | 2020年度末 | |
|---|---|---|---|---|
| | 金額 | 占率 | 金額 | 占率 |
| 非居住者貸付 | 548 | 0.2 | 429 | 0.2 |
| 公社債(円建外債)・その他 | 23,336 | 10.5 | 23,388 | 10.1 |
| 小　計 | 23,885 | 10.7 | 23,817 | 10.2 |

・合計

(単位:億円、%)

| 区分 | 2019年度末 | | 2020年度末 | |
|---|---|---|---|---|
| | 金額 | 占率 | 金額 | 占率 |
| 海外投融資 | 223,281 | 100.0 | 232,627 | 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年度末 | |
|---|---|---|---|---|
| | 金額 | 占率 | 金額 | 占率 |
| 米ドル | 121,830 | 61.9 | 125,854 | 60.9 |
| ユーロ | 50,420 | 25.6 | 53,040 | 25.7 |
| イギリスポンド | 12,770 | 6.5 | 14,696 | 7.1 |
| オーストラリアドル | 6,179 | 3.1 | 7,284 | 3.5 |
| インドルピー | 2,083 | 1.1 | 2,084 | 1.0 |
| ポーランドズロチ | 847 | 0.4 | 782 | 0.4 |
| その他 | 2,741 | 1.4 | 3,014 | 1.5 |
| 合　計 | 196,873 | 100.0 | 206,757 | 100.0 |

（注）内訳は、2020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 | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | | 公社債 | | 株式等 | | | |
| | | 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 |

（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］

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 | 255 | △4,741 | △148 | － | － | △4,634 |
| | ヘッジ会計非適用分 | 142 | △293 | 132 | － | － | △18 | △265 | 75 | △51 | － | － | △241 |
| 合　計 | | 1,181 | △1,970 | 252 | － | － | △536 | △9 | △4,666 | △200 | － | － | △4,876 |

（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年度末：通貨関連△2,244億円、株式関連△148億円）、
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 | 17,750 | 17,750 | 1,038 | 1,038 | 22,750 | 22,710 | 255 | 255 |
| | 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 | 13,300 | 13,000 | 206 | △265 |
| | | (365) | (365) | | | (471) | (469) | | |
| | 固定金利支払／変動金利受取 | － | － | － | － | － | － | － | － |
| | | (－) | (－) | | | (－) | (－) | | |
| 合　計 | | | | | 1,181 | | | | △9 |

（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 | 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 | － | － | － | － | － | － | － |

3. 通貨関連

（単位：億円）

| 区分 | 種類 | 2019年度末 | | | | 2020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 | 76,989 | 49 | 410 | 410 | 75,769 | 48 | △3,123 | △3,123 |
| | 米ドル | 38,120 | 49 | △373 | △373 | 31,090 | 48 | △1,392 | △1,392 |
| | ユーロ | 27,555 | － | 171 | 171 | 25,581 | － | △582 | △582 |
| | 豪ドル | 1,809 | － | 177 | 177 | 8,992 | － | △636 | △636 |
| | ポンド | 7,577 | － | 423 | 423 | 7,633 | － | △470 | △470 |
| | 買建 | 5,501 | － | △17 | △17 | 16,299 | － | 959 | 959 |
| | 米ドル | 3,689 | － | △9 | △9 | 8,626 | － | 456 | 456 |
| | ユーロ | 561 | － | △0 | △0 | 366 | － | △0 | △0 |
| | 豪ドル | 191 | － | △1 | △1 | 5,734 | － | 498 | 498 |
| | 通貨オプション | | | | | | | | |
| | 売建 | | | | | | | | |
| | コール | 7,019 | － | 26 | △5 | － | － | － | － |
| | | (20) | (－) | | | (－) | (－) | | |
| | 米ドル | 7,019 | － | 26 | △5 | － | － | － | － |
| | | (20) | (－) | | | (－) | (－) | | |
| | 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 | 7,019 | － | 26 | △26 | － | － | － | － |
| | | (53) | (－) | | | (－) | (－) | | |
| | 米ドル | 7,019 | － | 26 | △26 | － | － | － | － |
| | | (53) | (－) | | | (－) | (－) | | |
| | ユーロ | － | － | － | － | － | － | － | － |
| | | (－) | (－) | | | (－) | (－) | | |
| | プット | 13,658 | － | 116 | 18 | 11,624 | － | 9 | △128 |
| | | (97) | (－) | | | (138) | (－) | | |
| | 米ドル | 13,658 | － | 116 | 18 | 11,624 | － | 9 | △128 |
| | | (97) | (－) | | | (138) | (－) | | |
| | ユーロ | － | － | － | － | － | － | － | － |
| | | (－) | (－) | | | (－) | (－) | | |
| | 通貨スワップ | 29,547 | 28,139 | △2,349 | △2,349 | 46,579 | 45,388 | △2,377 | △2,377 |
| | 米ドル払/円受 | 14,534 | 13,596 | △1,911 | △1,911 | 28,627 | 27,738 | △770 | △770 |
| | ユーロ払/円受 | 8,020 | 7,624 | △251 | △251 | 12,094 | 11,811 | △1,254 | △1,254 |
| 合　計 | | | | | △1,970 | | | | △4,666 |

（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 | 758 | － | 0 | △7 |
| | | (79) | (－) | | | (7) | (－) | | |
| 店頭 | 株式先渡契約 | | | | | | | | |
| | 売建 | 897 | － | 119 | 119 | 542 | － | △148 | △148 |
| | 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 |
| | | (－) | (－) | | | (62) | (23) | | |
| 合　計 | | | | | 252 | | | | △200 |

(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年度末に該当の残高はありません。

## 6. その他

2019年度末、2020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 | 2019年度末 | | 2020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 | 835 | △57 | 983 | 117 |

(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 | 92 | ― | △1 | △1 | 121 | ― | △1 | △1 |
| | 米ドル | 48 | ― | △0 | △0 | 58 | ― | △0 | △0 |
| | ユーロ | 18 | ― | △0 | △0 | 38 | ― | 0 | 0 |
| | 買建 | 51 | ― | 0 | 0 | 101 | ― | 1 | 1 |
| | 米ドル | 8 | ― | 0 | 0 | 63 | ― | 0 | 0 |
| | ユーロ | 26 | ― | 0 | 0 | 20 | ― | △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 | 29 | ― | △3 | △3 | 4 | ― | △0 | △0 |
| | 買建 | 15 | ― | △0 | △0 | 25 | ― | 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 | ― | ― | ― | ― | 22 | ― | 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年度末 | |
|---|---|---|
| | | うち一般勘定 |
| 現預金・コールローン | 14,016 | 9,843 |
| 買現先勘定 | — | — |
| 買入金銭債権 | 1,726 | 1,726 |
| 商品有価証券 | — | — |
| 金銭の信託 | 1 | 1 |
| 公社債 | 265,314 | 262,254 |
| 株式 | 106,405 | 105,782 |
| 外国証券 | 214,709 | 212,641 |
| 貸付金 | 74,307 | 74,307 |
| 不動産 | 16,866 | 16,866 |
| 資産計 | 739,742 | 727,469 |
| うち外貨建資産 | 209,394 | 206,757 |

### (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 | 7,250 | 500 |

(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 | 236,738 | 266,508 | 29,770 | 31,228 | △1,457 |
| 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 | 1,286 | 2,832 | 1,545 | 1,545 | — |
| その他有価証券 | 275,572 | 333,416 | 57,843 | 64,110 | △6,267 | 269,257 | 360,966 | 91,708 | 93,577 | △1,868 |
| 公社債 | 30,008 | 31,930 | 1,922 | 2,007 | △85 | 26,563 | 28,422 | 1,858 | 1,928 | △70 |
| 株式 | 41,421 | 73,202 | 31,780 | 34,749 | △2,968 | 41,173 | 99,816 | 58,642 | 59,650 | △1,008 |
| 外国証券 | 170,827 | 192,868 | 22,041 | 25,114 | △3,073 | 169,025 | 198,193 | 29,168 | 29,808 | △639 |
| 公社債 | 121,223 | 140,688 | 19,465 | 20,943 | △1,478 | 116,729 | 136,239 | 19,510 | 19,968 | △457 |
| 株式等 | 49,603 | 52,180 | 2,576 | 4,170 | △1,594 | 52,295 | 61,953 | 9,658 | 9,840 | △181 |
| その他の証券 | 31,223 | 33,320 | 2,096 | 2,231 | △134 | 31,136 | 33,167 | 2,031 | 2,181 | △150 |
| 買入金銭債権 | 462 | 465 | 2 | 8 | △5 | 218 | 225 | 6 | 7 | △0 |
| 譲渡性預金 | 1,629 | 1,628 | △0 | 0 | △0 | 1,140 | 1,139 | △0 | 0 | △0 |
| 合　計 | 494,618 | 590,453 | 95,835 | 102,331 | △6,495 | 507,282 | 630,307 | 123,024 | 126,351 | △3,326 |
| 公社債 | 244,659 | 283,859 | 39,199 | 39,467 | △268 | 260,395 | 291,846 | 31,450 | 32,976 | △1,526 |
| 株式 | 41,421 | 73,202 | 31,780 | 34,749 | △2,968 | 41,173 | 99,816 | 58,642 | 59,650 | △1,008 |
| 外国証券 | 173,487 | 196,153 | 22,665 | 25,784 | △3,118 | 171,708 | 202,532 | 30,823 | 31,465 | △641 |
| 公社債 | 122,550 | 142,079 | 19,528 | 21,051 | △1,522 | 118,136 | 137,757 | 19,620 | 20,080 | △459 |
| 株式等 | 50,936 | 54,073 | 3,137 | 4,732 | △1,595 | 53,572 | 64,775 | 11,203 | 11,384 | △181 |
| その他の証券 | 31,232 | 33,330 | 2,097 | 2,232 | △134 | 31,145 | 33,178 | 2,033 | 2,183 | △150 |
| 買入金銭債権 | 2,187 | 2,278 | 91 | 97 | △6 | 1,719 | 1,793 | 74 | 74 | △0 |
| 譲渡性預金 | 1,629 | 1,628 | △0 | 0 | △0 | 1,140 | 1,139 | △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 | 11,795 |
| その他有価証券 | 5,583 | 6,967 |
| 非上場国内株式(店頭売買株式を除く) | 600 | 611 |
| 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 | — |
| その他 | 4,980 | 6,353 |
| 合　計 | 15,766 | 18,763 |

(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年度末:295億円)

(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 | ― | ― | ― | 1 | 1 | ― | ― | ― |

(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 | 1 | △253 |

(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 | 255 | △4,741 | △148 | ― | ― | △4,634 |
| | ヘッジ会計非適用分 | 142 | △294 | 109 | 1 | ― | △41 | △265 | 69 | △48 | △1 | ― | △246 |
| 合 計 | | 1,181 | △1,971 | 228 | 1 | ― | △560 | △9 | △4,672 | △196 | △1 | ― | △4,880 |

(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年度末:通貨関連△2,244億円、株式関連△148億円)、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 | ― | ― | ― | ― | ― | ― | ― | ― |
| | 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 | 13,300 | 13,000 | 206 | △265 |
| | | (365) | (365) | | | (471) | (469) | | |
| | 固定金利支払/変動金利受取 | ― | ― | ― | ― | ― | ― | ― | ― |
| | | (―) | (―) | | | (―) | (―) | | |
| 合 計 | | | | | 142 | | | | △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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 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 | 2019年度末 | | | | 2020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 | 10,761 | 49 | 97 | 97 | 16,541 | 48 | △892 | △892 |
| | 米ドル | 6,082 | 49 | △35 | △35 | 5,222 | 48 | △236 | △236 |
| | ユーロ | 854 | － | 4 | 4 | 1,090 | － | △15 | △15 |
| | 豪ドル | 947 | － | 54 | 54 | 5,866 | － | △443 | △443 |
| | ポンド | 2,591 | － | 74 | 74 | 3,718 | － | △179 | △179 |
| | 買建 | 6,377 | － | △11 | △11 | 17,090 | － | 966 | 966 |
| | 米ドル | 4,104 | － | △2 | △2 | 9,125 | － | 462 | 462 |
| | ユーロ | 847 | － | △0 | △0 | 523 | － | △0 | △0 |
| | 豪ドル | 277 | － | △1 | △1 | 5,779 | － | 498 | 498 |
| | 通貨オプション | | | | | | | | |
| | 売建 | | | | | | | | |
| | コール | 7,019 | － | 26 | △5 | － | － | － | － |
| | | (20) | (－) | | | (－) | (－) | | |
| | 米ドル | 7,019 | － | 26 | △5 | － | － | － | － |
| | | (20) | (－) | | | (－) | (－) | | |
| | 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 | 7,019 | － | 26 | △26 | － | － | － | － |
| | | (53) | (－) | | | (－) | (－) | | |
| | 米ドル | 7,019 | － | 26 | △26 | － | － | － | － |
| | | (53) | (－) | | | (－) | (－) | | |
| | ユーロ | － | － | － | － | － | － | － | － |
| | | (－) | (－) | | | (－) | (－) | | |
| | プット | 13,658 | － | 116 | 18 | 11,624 | － | 9 | △128 |
| | | (97) | (－) | | | (138) | (－) | | |
| | 米ドル | 13,658 | － | 116 | 18 | 11,624 | － | 9 | △128 |
| | | (97) | (－) | | | (138) | (－) | | |
| | ユーロ | － | － | － | － | － | － | － | － |
| | | (－) | (－) | | | (－) | (－) | | |
| | 通貨スワップ | 3,466 | 3,466 | △366 | △366 | 1,310 | 1,310 | 119 | 119 |
| | 米ドル払/円受 | － | － | － | － | － | － | － | － |
| | ユーロ払/円受 | － | － | － | － | － | － | － | － |
| | 円払/豪ドル受 | 3,201 | 3,201 | △349 | △349 | 1,046 | 1,046 | 111 | 111 |
| 合　計 | | | | | △294 | | | | 69 |

(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 | 5 | — | △0 | △0 |
| | 買建 | 174 | — | △0 | △0 | 412 | — | 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 | 4,067 | — | 212 | 132 | 758 | — | 0 | △7 |
| | | (79) | (—) | | | (7) | (—) | | |
| 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 |
| | | (—) | (—) | | | (62) | (23) | | |
| 合計 | | | | | 109 | | | | △48 |

(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 |
| | 買建 | 413 | — | 0 | 0 | — | — | — | — |
| | 外貨建債券先物 | | | | | | | | |
| | 売建 | — | — | — | — | — | — | — | — |
| | 買建 | 279 | — | 1 | 1 | 228 | — | △1 | △1 |
| 合計 | | | | | 1 | | | | △1 |

(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 | | 17,650 | 17,650 | 1,038 | 1,038 | 22,650 | 22,650 | 255 | 255 |
| | | 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 | | | | 255 |

(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 | － | － | － | － | － | － | － |

(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 | 2019年度末 契約額等 | 2019年度末 契約額等 うち1年超 | 2019年度末 時価 | 2019年度末 差損益 | 2020年度末 契約額等 | 2020年度末 契約額等 うち1年超 | 2020年度末 時価 | 2020年度末 差損益 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 店頭 | 時価ヘッジ | 為替予約 | 外貨建債券 | | | | | | | | |
| | | 売建 | | 67,917 | — | 305 | 305 | 60,415 | — | △2,244 | △2,244 |
| | | 米ドル | | 32,787 | — | △348 | △348 | 26,392 | — | △1,163 | △1,163 |
| | | ユーロ | | 27,144 | — | 167 | 167 | 24,835 | — | △567 | △567 |
| | | 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 | | — | — | — | — | — | — | — | — |
| | | | | (—) | (—) | | | (—) | (—) | | |
| | 繰延ヘッジ | 通貨スワップ | 外貨建債券 | 26,080 | 24,672 | △1,982 | △1,982 | 45,268 | 44,077 | △2,496 | △2,496 |
| | | 米ドル払/円受 | | 14,534 | 13,596 | △1,911 | △1,911 | 28,627 | 27,738 | △770 | △770 |
| | | ユーロ払/円受 | | 8,020 | 7,624 | △251 | △251 | 12,094 | 11,811 | △1,254 | △1,254 |
| 合計 | | | | | | | △1,677 | | | | △4,741 |

(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 | 2019年度末 | | | | 2020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 | 時価ヘッジ | 株式先渡契約 | 国内株式 | | | | | | | | |
| | | 売建 | | 897 | ― | 119 | 119 | 542 | ― | △148 | △148 |
| | | 買建 | | ― | ― | ― | ― | ― | ― | ― | ― |
| 合 計 | | | | | | | 119 | | | | △148 |

(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年度末に該当の残高はありません。

(e)その他

2019年度末、2020年度末に該当の残高はありません。