

## I. 一般勘定

### 1. 有価証券関係

#### (1) 有価証券明細表

(単位:百万円、%)

区 分	2019年度末		2020年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
国 債	14,579,276	46.0	14,748,216	45.2
地 方 債	306,157	1.0	285,808	0.9
社 債	2,323,598	7.3	2,307,854	7.1
うち公社・公団債	368,886	1.2	367,535	1.1
株 式	3,447,155	10.9	3,947,466	12.1
外 国 証 券	10,168,944	32.1	10,312,517	31.6
公 社 債	8,513,065	26.9	8,245,176	25.3
株 式 等	1,655,879	5.2	2,067,340	6.3
そ の 他 の 証 券	872,076	2.8	1,006,498	3.1
合 計	31,697,210	100.0	32,608,361	100.0

#### (2) 地域別地方債保有明細表

(単位:百万円)

区 分	2019年度末	2020年度 第2四半期(上半期)末
北 海 道	4,589	4,589
東 北	—	—
関 東	114,554	110,641
中 部	38,348	36,159
近 畿	85,387	84,149
中 国	7,159	6,517
四 国	—	—
九 州	31,206	30,922
そ の 他	24,911	12,828
合 計	306,157	285,808

(注)「その他」は、共同発行市場公募地方債です。

## (3) 有価証券残存期間別残高

(単位:百万円)

区 分	2019年度末						
	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
有 価 証 券	891,693	2,430,711	1,527,391	1,358,427	4,124,543	21,364,442	31,697,210
国 債	169,363	1,380,322	933,770	735,115	1,869,795	9,490,909	14,579,276
地 方 債	9,090	100	5,293	35,740	189,514	66,419	306,157
社 債	62,812	174,659	125,222	159,914	412,529	1,388,459	2,323,598
株 式	—	—	—	—	—	3,447,155	3,447,155
外 国 証 券	646,259	873,609	462,896	422,654	1,645,690	6,117,834	10,168,944
公 社 債	646,068	873,609	462,896	422,654	1,645,690	4,462,146	8,513,065
株 式 等	191	—	—	—	—	1,655,688	1,655,879
そ の 他 の 証 券	4,168	2,020	208	5,002	7,012	853,663	872,076
買 入 金 銭 債 権	—	—	—	—	—	204,335	204,335
譲 渡 性 預 金	32,995	—	—	—	—	—	32,995
そ の 他	—	—	—	—	—	13,966	13,966
合 計	924,689	2,430,711	1,527,391	1,358,427	4,124,543	21,582,744	31,948,508

(単位:百万円)

区 分	2020年度第2四半期(上半期)末						
	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
有 価 証 券	1,308,251	2,297,908	1,115,807	1,893,338	3,977,488	22,015,567	32,608,361
国 債	707,774	1,107,042	822,612	916,141	1,623,084	9,571,560	14,748,216
地 方 債	3,288	4,582	1,708	71,677	138,332	66,219	285,808
社 債	64,666	183,214	80,203	229,666	392,744	1,357,359	2,307,854
株 式	—	—	—	—	—	3,947,466	3,947,466
外 国 証 券	532,508	996,214	210,159	670,583	1,757,537	6,145,512	10,312,517
公 社 債	531,553	996,214	210,159	670,583	1,757,537	4,079,127	8,245,176
株 式 等	955	—	—	—	—	2,066,385	2,067,340
そ の 他 の 証 券	13	6,853	1,124	5,269	65,788	927,448	1,006,498
買 入 金 銭 債 権	19,996	—	—	—	—	199,461	219,458
譲 渡 性 預 金	29,997	—	—	—	—	—	29,997
そ の 他	—	—	—	—	—	142,378	142,378
合 計	1,358,245	2,297,908	1,115,807	1,893,338	3,977,488	22,357,407	33,000,195

(注) 1. 10年超には、期間の定めのないものを含んでいます。

2. 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。

## (4)業種別株式保有明細表

(単位:百万円、%)

区 分		2019年度末		2020年度 第2四半期(上半期)末	
		金 額	占 率	金 額	占 率
水 産 ・ 農 林 業		1,130	0.0	1,299	0.0
鉱 業		—	—	—	—
建 設 業		76,306	2.2	85,170	2.2
製 造 業	食 料 品	181,982	5.3	196,363	5.0
	織 維 製 品	20,660	0.6	22,052	0.6
	パ ル プ ・ 紙	2,598	0.1	2,653	0.1
	化 学	332,025	9.6	417,376	10.6
	医 薬 品	128,861	3.7	162,303	4.1
	石 油 ・ 石 炭 製 品	4,430	0.1	4,787	0.1
	ゴ ム 製 品	8,899	0.3	9,807	0.2
	ガ ラ ス ・ 土 石 製 品	134,835	3.9	159,180	4.0
	鉄 鋼	29,585	0.9	30,929	0.8
	非 鉄 金 属	10,069	0.3	9,649	0.2
	金 属 製 品	16,113	0.5	17,415	0.4
	機 械	173,864	5.0	214,462	5.4
	電 気 機 器	447,829	13.0	561,373	14.2
	輸 送 用 機 器	376,625	10.9	409,792	10.4
	精 密 機 器	188,575	5.5	224,993	5.7
そ の 他 製 品	33,003	1.0	37,054	0.9	
電 気 ・ ガ ス 業		119,531	3.5	122,254	3.1
運 輸 ・ 情 報 通 信 業	陸 運 業	178,693	5.2	198,625	5.0
	海 運 業	4,819	0.1	6,393	0.2
	空 運 業	4,251	0.1	4,091	0.1
	倉 庫 ・ 運 輸 関 連 業	20,349	0.6	26,601	0.7
	情 報 ・ 通 信 業	32,445	0.9	28,903	0.7
商 業	卸 売 業	245,424	7.1	266,376	6.7
	小 売 業	29,191	0.8	30,329	0.8
金 融 ・ 保 険 業	銀 行 業	237,094	6.9	271,849	6.9
	証 券 ・ 商 品 先 物 取 引 業	14,028	0.4	14,188	0.4
	保 険 業	137,729	4.0	138,378	3.5
	そ の 他 金 融 業	66,643	1.9	76,604	1.9
不 動 産 業		138,095	4.0	134,823	3.4
サ ー ビ ス 業		51,460	1.5	61,379	1.6
合 計		3,447,155	100.0	3,947,466	100.0

(注) 業種の分類は、証券コード協議会の業種別分類項目によります。

## 2. 貸付金関係

### (1) 貸付金明細表

(単位:百万円)

区 分	2019年度末	2020年度 第2四半期(上半期)末
保 険 約 款 貸 付	229,759	218,320
契 約 者 貸 付	217,693	206,649
保 険 料 振 替 貸 付	12,065	11,670
一 般 貸 付 (うち非居住者貸付)	3,875,676 (188,980)	3,901,164 (191,795)
企 業 貸 付 (うち国内企業向け)	3,718,107 (3,550,126)	3,744,348 (3,570,552)
国・国際機関・政府関係機関貸付	11,756	8,605
公 共 団 体 ・ 公 企 業 貸 付	128,232	131,336
住 宅 ロ ー ン	—	—
消 費 者 ロ ー ン	17,472	16,784
そ の 他	108	90
合 計	4,105,435	4,119,485

### (2) 国内企業向け貸付金企業規模別内訳

(単位:百万円、%)

区 分		2019年度末		2020年度 第2四半期(上半期)末	
			占 率		占 率
大 企 業	貸付先数	605	54.1	593	54.8
	金 額	3,068,356	86.4	3,078,691	86.2
中 堅 企 業	貸付先数	97	8.7	94	8.7
	金 額	19,107	0.5	18,773	0.5
中 小 企 業	貸付先数	417	37.3	395	36.5
	金 額	462,662	13.0	473,086	13.2
国内企業向け貸付計	貸付先数	1,119	100.0	1,082	100.0
	金 額	3,550,126	100.0	3,570,552	100.0

(注) 1.業種による規模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。

区 分	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	従業員 300名超 かつ	資本金 10億円以上	従業員 50名超 かつ	資本金 10億円以上	従業員 100名超 かつ	資本金 10億円以上	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 または常用する従業員 300名以下		資本金5千万円以下 または常用する従業員 50名以下		資本金5千万円以下 または常用する従業員 100名以下		資本金1億円以下 または常用する従業員 100名以下	

## (3)貸付金業種別内訳

(単位:百万円、%)

区 分		2019年度末		2020年度 第2四半期(上半期)末	
		金 額	占 率	金 額	占 率
国 内	製 造 業	610,804	15.8	624,280	16.0
	食 料	25,882	0.7	22,627	0.6
	織 維	5,284	0.1	5,112	0.1
	木 材 ・ 木 製 品	—	—	—	—
	パ ル プ ・ 紙	40,199	1.0	43,017	1.1
	印 刷	5,434	0.1	15,386	0.4
	化 学	118,266	3.1	133,368	3.4
	石 油 ・ 石 炭	76,548	2.0	70,004	1.8
	窯 業 ・ 土 石	58,004	1.5	57,796	1.5
	鉄 鋼	119,898	3.1	119,286	3.1
	非 鉄 金 属	10,987	0.3	11,128	0.3
	金 属 製 品	3,065	0.1	3,053	0.1
	はん用・生産用・業務用機械	45,388	1.2	47,193	1.2
	電 気 機 械	43,851	1.1	44,025	1.1
	輸 送 用 機 械	53,283	1.4	47,726	1.2
	そ の 他 の 製 造 業	4,710	0.1	4,553	0.1
	農 業 、 林 業	141	0.0	77	0.0
	漁 業	—	—	—	—
	鉱業、採石業、砂利採取業	26	0.0	—	—
	建 設 業	13,380	0.3	12,591	0.3
	電気・ガス・熱供給・水道業	770,642	19.9	777,345	19.9
	情 報 通 信 業	88,870	2.3	88,888	2.3
	運 輸 業 、 郵 便 業	280,164	7.2	289,836	7.4
	卸 売 業	664,374	17.1	662,563	17.0
	小 売 業	13,947	0.4	13,867	0.4
	金 融 業 、 保 険 業	730,700	18.9	725,362	18.6
	不 動 産 業	367,187	9.5	364,802	9.4
	物 品 賃 貸 業	100,405	2.6	104,703	2.7
	学術研究、専門・技術サービス業	20,502	0.5	20,480	0.5
	宿 泊 業	1,598	0.0	1,492	0.0
	飲 食 業	420	0.0	361	0.0
	生活関連サービス業、娯楽業	2,465	0.1	2,404	0.1
教 育 、 学 習 支 援 業	180	0.0	144	0.0	
医 療 ・ 福 祉	477	0.0	534	0.0	
そ の 他 の サ ー ビ ス	2,652	0.1	2,626	0.1	
地 方 公 共 団 体	282	0.0	223	0.0	
個人(住宅・消費・納税資金等)	17,472	0.5	16,784	0.4	
そ の 他	—	—	—	—	
合 計	3,686,695	95.1	3,709,369	95.1	
海 外 向 け	政 府 等	21,000	0.5	18,000	0.5
	金 融 機 関	14,520	0.4	13,500	0.3
	商 工 業 等	153,460	4.0	160,295	4.1
	合 計	188,980	4.9	191,795	4.9
一 般 貸 付 計		3,875,676	100.0	3,901,164	100.0

(注) 国内向けの貸付の業種の分類は、日本銀行の貸出先別貸出金(業種別、設備資金新規貸出)の業種分類によります。

## (4) 貸付金残存期間別残高

(単位:百万円)

区 分	2019年度末						合 計
	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	
変 動 金 利	95,528	7,538	15,683	4,532	16,589	86,096	225,969
固 定 金 利	227,458	602,501	553,454	593,327	717,022	955,943	3,649,707
一 般 貸 付 計	322,986	610,040	569,137	597,859	733,611	1,042,040	3,875,676

(単位:百万円)

区 分	2020年度第2四半期(上半期)末						合 計
	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	
変 動 金 利	95,449	8,288	15,987	6,425	26,922	77,383	230,456
固 定 金 利	248,370	617,661	522,052	636,963	712,534	933,126	3,670,708
一 般 貸 付 計	343,820	625,949	538,040	643,388	739,456	1,010,509	3,901,164

(注)10年超には、期間の定めのないものを含んでいます。

## (5) 貸付金地域別内訳

(単位:百万円、%)

区 分	2019年度末		2020年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
北 海 道	47,165	1.3	49,026	1.3
東 北	49,317	1.3	49,979	1.4
関 東	2,778,432	75.7	2,803,790	75.9
中 部	333,153	9.1	326,719	8.8
近 畿	222,227	6.1	222,515	6.0
中 国	44,706	1.2	44,220	1.2
四 国	40,820	1.1	40,788	1.1
九 州	153,401	4.2	155,543	4.2
合 計	3,669,223	100.0	3,692,584	100.0

(注)1.個人ローン、非居住者貸付、保険約款貸付等を含んでいません。

2.地域区分は貸付先の本社所在地によります。

## (6) 貸付金担保別内訳

(単位:百万円、%)

区 分	2019年度末		2020年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
担 保 貸 付	11,558	0.3	10,464	0.3
有 価 証 券 担 保 貸 付	4,184	0.1	3,691	0.1
不 動 産・動 産・財 団 担 保 貸 付	5,974	0.2	5,375	0.1
指 名 債 権 担 保 貸 付	1,400	0.0	1,398	0.0
保 証 貸 付	61,204	1.6	59,530	1.5
信 用 貸 付	3,785,439	97.7	3,814,385	97.8
そ の 他	17,472	0.5	16,784	0.4
一 般 貸 付 計	3,875,676	100.0	3,901,164	100.0
うち劣後特約付貸付	308,150	8.0	324,650	8.3

### 3. 海外投融資関係

#### (1) 資産別明細表

##### ア. 外貨建資産

(単位:百万円、%)

区 分	2019年度末		2020年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
公 社 債	8,754,071	78.9	8,549,450	75.3
株 式 等	1,612,256	14.5	2,020,313	17.8
現 預 金・そ の 他	239,121	2.2	297,341	2.6
小 計	10,605,449	95.5	10,867,105	95.7

##### イ. 円貨額が確定した外貨建資産

(単位:百万円、%)

区 分	2019年度末		2020年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
貸 付 金	131,049	1.2	131,049	1.2
そ の 他	100	0.0	94	0.0
小 計	131,149	1.2	131,143	1.2

(注)「円貨額が確定した外貨建資産」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。

##### ウ. 円貨建資産

(単位:百万円、%)

区 分	2019年度末		2020年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
非 居 住 者 貸 付	153,520	1.4	150,350	1.3
公 社 債 ( 円 建 外 債 )	166,166	1.5	155,859	1.4
そ の 他	43,623	0.4	47,027	0.4
小 計	363,310	3.3	353,236	3.1

##### エ. 合計 (ア+イ+ウ)

(単位:百万円、%)

区 分	2019年度末		2020年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
海 外 投 融 資	11,099,909	100.0	11,351,485	100.0

#### (2) 外貨建資産の通貨別構成

(単位:百万円、%)

区 分	2019年度末		2020年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
米 ド ル	9,350,802	88.2	9,023,659	83.0
豪 ド ル	522,653	4.9	1,022,865	9.4
そ の 他	731,992	6.9	820,580	7.6
合 計	10,605,449	100.0	10,867,105	100.0

## (3) 海外投融資の地域別構成

(単位:百万円、%)

区 分	2019年度末									
	外国証券				公社債		株式等		非居住者貸付	
	金額	占率	金額	占率	金額	占率	金額	占率		
北 米	7,596,787	74.7	6,966,101	81.8	630,685	38.1	23,852	12.6		
ヨ ー ロ ッ パ	936,028	9.2	838,597	9.9	97,430	5.9	29,500	15.6		
オ セ ア ニ ア	467,731	4.6	467,731	5.5	—	—	24,607	13.0		
ア ジ ア	188,086	1.8	76,882	0.9	111,204	6.7	1,020	0.5		
中 南 米	850,783	8.4	34,224	0.4	816,559	49.3	110,000	58.2		
中 東	—	—	—	—	—	—	—	—		
ア フ リ カ	—	—	—	—	—	—	—	—		
国 際 機 関	129,527	1.3	129,527	1.5	—	—	—	—		
合 計	10,168,944	100.0	8,513,065	100.0	1,655,879	100.0	188,980	100.0		

(単位:百万円、%)

区 分	2020年度第2四半期(上半期)末									
	外国証券				公社債		株式等		非居住者貸付	
	金額	占率	金額	占率	金額	占率	金額	占率		
北 米	7,289,856	70.7	6,205,130	75.3	1,084,725	52.5	23,360	12.2		
ヨ ー ロ ッ パ	930,382	9.0	858,195	10.4	72,187	3.5	26,500	13.8		
オ セ ア ニ ア	950,912	9.2	950,912	11.5	—	—	31,084	16.2		
ア ジ ア	212,966	2.1	101,683	1.2	111,282	5.4	850	0.4		
中 南 米	833,633	8.1	34,489	0.4	799,144	38.7	110,000	57.4		
中 東	—	—	—	—	—	—	—	—		
ア フ リ カ	—	—	—	—	—	—	—	—		
国 際 機 関	94,764	0.9	94,764	1.1	—	—	—	—		
合 計	10,312,517	100.0	8,245,176	100.0	2,067,340	100.0	191,795	100.0		



#### 4. デリバティブ取引

##### (1) 定性的情報

###### ア. 取引の内容

当社が利用対象としている主なデリバティブ取引は、以下のとおりです。

- ・ 金利関連：金利先物、金利オプション、金利スワップ、スワップション
- ・ 通貨関連：外国為替予約、通貨オプション、通貨スワップ
- ・ 株式関連：株価指数先物、株式オプション
- ・ 債券関連：債券先物、債券オプション

なお、店頭取引において、リスクが過大となるような複雑な仕組みの取引はありません。

###### イ. 取組方針

当社では、デリバティブ取引を、運用資産、保険負債または社債のリスクに対する主要なヘッジ手段と位置付けており、主に、ヘッジ目的で利用しております。

###### ウ. 利用目的

当社が利用しているデリバティブ取引の主な目的は、以下のとおりです。

- ・ 「金利関連取引」は、当社の貸付金および借入金等の変動金利を固定化する目的または保険負債の金利リスクをヘッジする目的で利用しております。
- ・ 「通貨関連取引」は、外貨建資産・負債の為替レートを事前に確定する目的、および為替変動による損失を一定範囲内に限定する等、為替リスクを回避する目的で利用しております。
- ・ 「株式関連取引」は、近い将来に購入・売却を予定している株式を対象に実際の取引時点までの価格変動リスクを回避する目的、および株式ポートフォリオの価格変動リスクを回避する目的で利用しております。
- ・ 「債券関連取引」は、近い将来に購入・売却を予定している債券を対象に実際の取引時点までの価格変動リスクを回避する目的で利用しております。

上記取引のうち、「金利関連取引」の一部については、金利スワップの特例処理および繰延ヘッジを適用しています。また、為替リスクを回避する目的の「通貨関連取引」の一部については、時価ヘッジ、繰延ヘッジおよび通貨スワップの振当処理を適用しています。

###### エ. リスクの内容

当社が利用しているデリバティブ取引は、主に、運用資産、保険負債または社債のリスクのヘッジを目的としているため、デリバティブ取引のもつ市場リスクは減殺され、限定的なものになっています。

また、取引形態は、取引所を通じた取引、あるいは、格付等を勘案し信用度が高いと判断される取引先を選別した上で、原則市場動向やリスク等に応じて取引先との間で相互に担保資産の差し入れを行なう契約（いわゆるクレジット・サポート・アネックス）を用いた店頭取引であり、取引相手が契約不履行に陥り、損失を被るリスクは限定的です。

## オ. リスク管理体制

当社では、デリバティブ取引の取扱いについて利用方針等を規定化するとともに、取引種類および取引先ごとの残高与信枠を設定しているほか、取引先ごとに再構築コストをベースとした信用リスク相当額を算出（カレント・エクスポージャー方式）し、その上限枠を設定するなどしてリスクを抑制しています。また、取引先の選定にあたっては、格付等を勘案し信用度が高いと判断される取引先を選別しています。

全体のポジション状況については、リスク管理検証委員会等において、ヘッジ対象となる運用資産とトータルで残高・損益を把握する等、包括的な管理を行なっています。また、取引を執行する部署（フロントオフィス）と事務管理部署（バックオフィス）を分離し、フロント・バック間で相互牽制が働く組織体制をとり、適切なリスク管理を行なっています。

## カ. 定量的情報に関する補足説明

### ① 時価算定に関する補足説明

[金利スワップ取引]

期末日の情報ベンダーが提供する価格

[外国為替予約等の店頭取引の場合]

期末日のTTM、WMロイターレート、割引レート等を基準とした理論価格、または情報ベンダーが提供する価格

[株価指数先物、債券先物等の取引所取引の場合]

期末日の終値または清算価格等

### ② 差損益に関する補足説明

当社では、デリバティブ取引を、主に、運用資産、保険負債または社債のリスクをヘッジする手段として利用しております。

例えば、運用資産に関する金利スワップ取引は、主に変動金利を固定化する目的で利用しております。また、保険負債に関する金利スワップ取引は、金利変動による保険負債の変動の影響をコントロールする目的で利用しております。

このように、取引単位で損益をとらえるのではなく、ヘッジ対象となる運用資産、保険負債または社債とあわせて管理を行なっています。

## (2) 定量的情報

## ア. 差損益の内訳 (ヘッジ会計適用分・非適用分の内訳)

(単位:百万円)

区 分	2019年度末					合計
	金利関連	通貨関連	株式関連	債券関連	その他	
ヘッジ会計適用分	61,637	△10,208	—	—	—	51,428
ヘッジ会計非適用分	0	△20,724	△8,969	—	—	△29,694
合 計	61,637	△30,933	△8,969	—	—	21,734

(単位:百万円)

区 分	2020年度第2四半期(上半期)末					合計
	金利関連	通貨関連	株式関連	債券関連	その他	
ヘッジ会計適用分	58,047	7,408	—	—	—	65,456
ヘッジ会計非適用分	265	9,601	—	—	—	9,866
合 計	58,312	17,010	—	—	—	75,322

(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△11,456百万円、2020年度第2四半期(上半期)末:通貨関連9,424百万円)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。

## イ. ヘッジ会計が適用されていないもの

## ○金利関連

(単位:百万円)

店 頭	区 分	2019年度末			2020年度第2四半期(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
	固定金利受取/変動金利支払	900	900	0	0	90,000	90,000	265	265
	合 計				0				265

(注) 金利スワップの差損益は、時価を記載しています。

## 【ご参考】 金利スワップ契約の残存期間別構成

(単位:百万円、%)

区 分		2019年度末						合計
		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	
固定金利受取 変動金利支払 スワップ	想 定 元 本	—	—	—	—	—	900	900
	平均受取金利	—	—	—	—	—	0.15	0.15
	平均支払金利	—	—	—	—	—	△0.04	△0.04

(単位:百万円、%)

区 分		2020年度第2四半期(上半期)末						合計
		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	
固定金利受取 変動金利支払 スワップ	想 定 元 本	—	—	—	—	—	90,000	90,000
	平均受取金利	—	—	—	—	—	0.18	0.18
	平均支払金利	—	—	—	—	—	△0.04	△0.04

## ○通貨関連

(単位:百万円)

区 分	2019年度末				2020年度第2四半期(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	679,417	—	△2,022	△2,022	740,853	—	3,372	3,372
	米ドル	652,226	—	△4,399	△4,399	712,486	—	4,218	4,218
	豪ドル	27,191	—	2,377	2,377	28,366	—	△846	△846
	買建	—	—	—	—	8,544	—	33	33
	ポーランドズロチ	—	—	—	—	5,408	—	24	24
	米ドル	—	—	—	—	3,126	—	8	8
	通貨オプション								
	売建								
	コール	157,097	—	41	0	(-)	—	—	—
	米ドル	(41)	—	—	—	(-)	—	—	—
	買建	157,097	—	41	0	(-)	—	—	—
	プット	166,178	—	198	135	(-)	—	—	—
	米ドル	(63)	—	—	—	(-)	—	—	—
	166,178	—	198	135	(-)	—	—	—	—
(63)	—	—	—	—	—	—	—	—	
通貨スワップ									
円払/豪ドル受	175,156	175,156	△19,719	△19,719	143,162	143,162	5,468	5,468	
円払/米ドル受	7,080	7,080	881	881	7,080	7,080	726	726	
合 計				△20,724				9,601	

(注) 1. 為替予約および通貨スワップの差損益は、時価を記載しています。通貨オプションの差損益はオプション料と時価との差額を記載しています。

2. ( )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。

## ○株式関連

(単位:百万円)

区 分	2019年度末				2020年度第2四半期(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	148,066	—	△8,969	△8,969	—	—	—
	買建	—	—	—	—	—	—	—
合 計				△8,969				-

(注) 株価指数先物の差損益は、時価を記載しています。

## ○債券関連

2019年度末および2020年度第2四半期(上半期)末とも保有していません。

ウ. ヘッジ会計が適用されているもの

○金利関連

(単位:百万円)

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		時価
				うち1年超	
繰延ヘッジ	金利スワップ	保険負債	227,300	227,300	61,477
	固定金利受取/変動金利支払				
金利スワップの特例処理	金利スワップ	貸付金	3,222	3,222	159
	固定金利受取/変動金利支払				
合 計					61,637

(単位:百万円)

ヘッジ会計の方法	種類	主なヘッジ対象	2020年度第2四半期(上半期)末		
			契約額等		時価
				うち1年超	
繰延ヘッジ	金利スワップ	保険負債	226,900	226,900	57,894
	固定金利受取/変動金利支払				
金利スワップの特例処理	金利スワップ	貸付金	3,171	3,171	153
	固定金利受取/変動金利支払				
合 計					58,047

【ご参考】 金利スワップ契約の残存期間別構成

(単位:百万円、%)

区 分		2019年度末						合計
		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	
固定金利受取 変動金利支払 スワップ	想 定 元 本	—	6,500	8,122	10,100	12,400	193,400	230,522
	平均受取金利	—	1.68	1.74	1.83	2.13	1.86	1.86
	平均支払金利	—	△0.01	0.10	0.01	△0.01	△0.02	△0.02

(単位:百万円、%)

区 分		2020年度第2四半期(上半期)末						合計
		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	
固定金利受取 変動金利支払 スワップ	想 定 元 本	—	6,500	7,871	9,800	12,400	193,500	230,071
	平均受取金利	—	1.68	1.74	1.82	2.13	1.85	1.85
	平均支払金利	—	△0.02	0.06	0.04	△0.05	△0.02	△0.02

## ○通貨関連

(単位:百万円)

ヘッジ会計の方法	種類	主なヘッジ対象	2019年度末			2020年度第2四半期(上半期)末		
			契約額等	時価		契約額等	時価	
				うち1年超			うち1年超	
時価ヘッジ	為替予約 売建	外貨建 債券	4,679,142	—	△11,456	4,550,869	—	8,875
	米ドル		4,169,798	—	△34,142	3,623,477	—	24,624
	豪ドル		240,977	—	20,754	527,470	—	△7,803
	ユーロ		253,887	—	1,063	292,357	—	△8,969
	その他		14,479	—	867	107,564	—	1,023
繰延ヘッジ	通貨スワップ	外貨建 債券						
	ユーロ		35,575	35,575	538	35,575	35,575	△1,546
	豪ドル		4,305	4,305	709	4,305	4,305	80
合 計					△10,208			7,408

(注) 為替予約等が付されていることにより、決済時における円貨額が確定し、貸借対照表において当該円貨額で表示されている外貨建金銭債権債務等にかかる取引を除いています。

## ○株式関連

2019年度末および2020年度第2四半期(上半期)末とも保有していません。

## ○債券関連

2019年度末および2020年度第2四半期(上半期)末とも保有していません。

## 5. 一般勘定資産全体の含み損益の状況

(単位: 百万円)

区 分	2019年度末	2020年度 第2四半期(上半期)末
有 価 証 券	4,996,600	5,427,259
評 価 差 額	2,707,975	3,286,705
オ フ バ ラ ン ス	2,288,625	2,140,554
土 地	542,845	545,823
再 評 価 差 額	197,631	197,303
オ フ バ ラ ン ス	345,214	348,519
そ の 他	62,679	55,819
合 計	5,602,126	6,028,902

- (注) 1. 有価証券は、時価のある有価証券に加え、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(外貨建の子会社株式及び関連会社株式等)の為替評価等の含み損益相当額を記載しています。
2. 有価証券には、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。
3. 土地は「土地の再評価に関する法律」に基づき、明治生命は1999年度末に、安田生命は2000年度末に時価評価を実施しました。これによる評価差額を「再評価差額」に記載しています。なお、土地には借地権を含んでいます。
4. 「その他」には、デリバティブ取引等の含み損益相当額を記載しています。なお、デリバティブ取引は一部ヘッジ会計を適用しました。本表にはヘッジ会計(繰延ヘッジ・特例処理)適用分の含み損益を記載しています。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△11,456百万円、2020年度第2四半期(上半期)末:通貨関連9,424百万円)、およびヘッジ会計非適用分については、評価損益を損益計算書に計上しており、含み損益相当額はありません。

## II. 個人変額保険・変額個人年金保険特別勘定

### 1. 個人変額保険

#### (1) 売買目的有価証券の評価損益

(単位:百万円)

区 分	2019年度末		2020年度第2四半期(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	42,865	△4,240	45,692	5,178

#### (2) デリバティブ取引の定量的情報

##### ア. 差損益の内訳(ヘッジ会計適用分・非適用分の内訳)

(単位:百万円)

区 分	2019年度末					合計
	金利関連	通貨関連	株式関連	債券関連	その他	
ヘッジ会計適用分	—	—	—	—	—	—
ヘッジ会計非適用分	—	△3	△28	—	—	△31
合 計	—	△3	△28	—	—	△31

(単位:百万円)

区 分	2020年度第2四半期(上半期)末					合計
	金利関連	通貨関連	株式関連	債券関連	その他	
ヘッジ会計適用分	—	—	—	—	—	—
ヘッジ会計非適用分	—	0	2	—	—	2
合 計	—	0	2	—	—	2

(注) ヘッジ会計非適用分の差損益は、損益計算書に計上されています。

##### イ. ヘッジ会計が適用されていないもの

###### ○金利関連

2019年度末および2020年度第2四半期(上半期)末とも保有していません。

###### ○通貨関連

(単位:百万円)

区 分	2019年度末				2020年度第2四半期(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	631	—	△2	△2	—	—	—
	米ドル	341	—	△3	△3	—	—	—
	ユーロ	290	—	1	1	—	—	—
	買建	164	—	△0	△0	19	—	0
	米ドル	—	—	—	—	14	—	0
	ユーロ	164	—	△0	△0	4	—	0
合 計				△3				0

(注) 為替予約の差損益は、時価を記載しています。



○株式関連

(単位:百万円)

区 分		2019年度末			2020年度第2四半期(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 買建	91	—	6	6	128	—	1	1
	外国株価指数先物 売建	346	—	△35	△35	22	—	0	0
合 計					△28				2

(注) 株価指数先物および外国株価指数先物の差損益は、時価を記載しています。

○債券関連

2019年度末および2020年度第2四半期(上半期)末とも保有していません。

ウ. ヘッジ会計が適用されているもの

○金利関連

2019年度末および2020年度第2四半期(上半期)末とも保有していません。

○通貨関連

2019年度末および2020年度第2四半期(上半期)末とも保有していません。

○株式関連

2019年度末および2020年度第2四半期(上半期)末とも保有していません。

○債券関連

2019年度末および2020年度第2四半期(上半期)末とも保有していません。

## 2. 変額個人年金保険

### (1) 売買目的有価証券の評価損益

(単位:百万円)

区 分	2019年度末		2020年度第2四半期(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	247,899	△9,961	208,736	△3,344

### (2) デリバティブ取引の定量的情報

#### ア. ヘッジ会計が適用されていないもの

○金利関連

2019年度末および2020年度第2四半期(上半期)末とも保有していません。

○通貨関連

2019年度末および2020年度第2四半期(上半期)末とも保有していません。

○株式関連

2019年度末および2020年度第2四半期(上半期)末とも保有していません。

○債券関連

2019年度末および2020年度第2四半期(上半期)末とも保有していません。

#### イ. ヘッジ会計が適用されているもの

○金利関連

2019年度末および2020年度第2四半期(上半期)末とも保有していません。

○通貨関連

2019年度末および2020年度第2四半期(上半期)末とも保有していません。

○株式関連

2019年度末および2020年度第2四半期(上半期)末とも保有していません。

○債券関連

2019年度末および2020年度第2四半期(上半期)末とも保有していません。

### Ⅲ. その他(会社計)

#### 1. 資産構成

##### (1) 資産の構成(2020年度第2四半期(上半期)末)

(単位:百万円、%)

区 分	会 社 計		うち一般勘定	
	金 額	占率	金 額	占率
現預金・コールローン	1,205,318	3.0	1,193,217	3.0
買現先勘定	—	—	—	—
債券貸借取引支払保証金	—	—	—	—
買入金銭債権	219,458	0.5	219,458	0.6
商品有価証券	—	—	—	—
金銭の信託	142,378	0.4	142,378	0.4
有価証券	33,341,114	82.5	32,608,361	82.2
公 社 債	17,546,574	43.4	17,341,880	43.7
株 式	4,042,039	10.0	3,947,466	10.0
外 国 証 券	10,537,264	26.1	10,312,517	26.0
公 社 債	8,389,359	20.8	8,245,176	20.8
株 式 等	2,147,905	5.3	2,067,340	5.2
その他の証券	1,215,235	3.0	1,006,498	2.5
貸付金	4,119,485	10.2	4,119,485	10.4
保険約款貸付	218,320	0.5	218,320	0.6
一般貸付	3,901,164	9.7	3,901,164	9.8
不動産	858,907	2.1	858,907	2.2
繰延税金資産	—	—	—	—
その他	542,341	1.3	522,634	1.3
貸倒引当金	△7,137	△0.0	△7,137	△0.0
合 計	40,421,866	100.0	39,657,305	100.0
うち外貨建資産	11,096,878	27.5	10,867,105	27.4

(注) 不動産については、土地・建物・建設仮勘定を合計した金額を計上しています。

##### (2) 資産の増減(対2019年度末)

(単位:百万円)

区 分	会 社 計		うち一般勘定	
	増減	増減	増減	増減
現預金・コールローン	△90,168		△80,148	
買現先勘定	—		—	
債券貸借取引支払保証金	—		—	
買入金銭債権	15,123		15,123	
商品有価証券	—		—	
金銭の信託	128,411		128,411	
有価証券	899,914		911,151	
公 社 債	111,603		132,847	
株 式	515,278		500,310	
外 国 証 券	177,772		143,572	
公 社 債	△251,993		△267,888	
株 式 等	429,765		411,461	
その他の証券	95,258		134,421	
貸付金	14,050		14,050	
保険約款貸付	△11,438		△11,438	
一般貸付	25,488		25,488	
不動産	△2,051		△2,051	
繰延税金資産	—		—	
その他	△73,895		△63,249	
貸倒引当金	△382		△382	
合 計	891,000		922,903	
うち外貨建資産	289,393		261,656	

(注) 不動産については、土地・建物・建設仮勘定を合計した金額を計上しています。

#### 2. 資産運用収支(2020年度第2四半期(上半期))

特別勘定の資産運用収支は、「特別勘定資産運用益(損)」として一括計上しています。  
(本資料「5. 中間損益計算書」参照)

### 3. 有価証券の時価情報

#### (1) 売買目的有価証券の評価損益

(単位:百万円)

区 分	2019年度末		2020年度第2四半期(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	743,989	△32,957	732,752	30,679
一般勘定	—	—	—	—
特別勘定	743,989	△32,957	732,752	30,679

#### (2) 有価証券の時価情報

(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:百万円)

区 分	2019年度末				
	帳簿価額	時価	差損益	差益	差損
満期保有目的の債券	4,135,333	4,882,136	746,803	747,035	△232
責任準備金対応債券	8,923,833	10,532,331	1,608,498	1,620,716	△12,218
子会社株式及び関連会社株式	—	—	—	—	—
その他の有価証券	15,288,346	17,996,179	2,707,833	2,850,425	△142,591
公 社 債	4,872,059	5,232,993	360,934	364,394	△3,460
株 式	1,598,539	3,354,683	1,756,144	1,803,462	△47,317
外 国 証 券	7,920,182	8,505,333	585,150	646,961	△61,810
公 社 債	7,083,149	7,622,208	539,058	567,541	△28,483
株 式 等	837,033	883,125	46,091	79,419	△33,327
その他の証券	835,520	844,140	8,620	34,726	△26,106
買入金銭債権	11,184	12,064	880	880	—
譲渡性預金	33,000	32,995	△4	0	△4
金銭の信託	17,859	13,966	△3,892	—	△3,892
合 計	28,347,512	33,410,647	5,063,135	5,218,177	△155,042
公 社 債	16,848,098	19,480,539	2,632,441	2,644,645	△12,203
株 式	1,598,539	3,354,683	1,756,144	1,803,462	△47,317
外 国 証 券	8,811,040	9,466,805	655,765	721,284	△65,518
公 社 債	7,974,006	8,583,680	609,673	641,864	△32,190
株 式 等	837,033	883,125	46,091	79,419	△33,327
その他の証券	835,520	844,140	8,620	34,726	△26,106
買入金銭債権	203,455	217,514	14,059	14,059	—
譲渡性預金	33,000	32,995	△4	0	△4
金銭の信託	17,859	13,966	△3,892	—	△3,892

(単位:百万円)

区 分	2020年度第2四半期(上半期)末				
	帳簿価額	時価	差損益	差益	差損
満期保有目的の債券	4,038,523	4,739,013	700,490	700,490	△0
責任準備金対応債券	9,386,809	10,906,017	1,519,207	1,553,390	△34,182
子会社株式及び関連会社株式	—	—	—	—	—
その他の有価証券	15,393,771	18,680,249	3,286,478	3,350,329	△63,851
公 社 債	4,708,475	5,080,357	371,882	372,273	△391
株 式	1,566,696	3,855,158	2,288,461	2,318,090	△29,628
外 国 証 券	7,992,758	8,566,011	573,252	603,064	△29,811
公 社 債	6,796,078	7,271,312	475,233	491,829	△16,595
株 式 等	1,196,680	1,294,699	98,018	111,234	△13,216
その他の証券	927,574	976,835	49,260	53,167	△3,906
買入金銭債権	28,807	29,511	704	705	△1
譲渡性預金	30,000	29,997	△2	—	△2
金銭の信託	139,458	142,378	2,919	3,028	△108
合 計	28,819,105	34,325,281	5,506,176	5,604,210	△98,034
公 社 債	16,969,997	19,431,262	2,461,264	2,494,968	△33,703
株 式	1,566,696	3,855,158	2,288,461	2,318,090	△29,628
外 国 証 券	8,966,623	9,658,215	691,592	722,273	△30,681
公 社 債	7,769,942	8,363,515	593,573	611,038	△17,465
株 式 等	1,196,680	1,294,699	98,018	111,234	△13,216
その他の証券	927,574	976,835	49,260	53,167	△3,906
買入金銭債権	218,754	231,434	12,680	12,681	△1
譲渡性預金	30,000	29,997	△2	—	△2
金銭の信託	139,458	142,378	2,919	3,028	△108

(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。

ア. 満期保有目的の債券

(単位:百万円)

区 分	2019年度末			2020年度第2四半期(上半期)末		
	貸借対照表計上額	時価	差額	貸借対照表計上額	時価	差額
時価が貸借対照表計上額を 超えるもの	4,124,533	4,871,569	747,035	4,035,723	4,736,214	700,490
公 社 債	3,835,912	4,564,012	728,099	3,751,426	4,435,066	683,639
外 国 証 券	96,349	102,106	5,756	94,349	99,224	4,874
買 入 金 銭 債 権	192,270	205,449	13,179	189,946	201,922	11,976
時価が貸借対照表計上額を 超えないもの	10,800	10,567	△232	2,800	2,799	△0
公 社 債	2,800	2,798	△1	2,800	2,799	△0
外 国 証 券	8,000	7,768	△231	—	—	—
買 入 金 銭 債 権	—	—	—	—	—	—

イ. 責任準備金対応債券

(単位:百万円)

区 分	2019年度末			2020年度第2四半期(上半期)末		
	貸借対照表計上額	時価	差額	貸借対照表計上額	時価	差額
時価が貸借対照表計上額を 超えるもの	8,170,256	9,790,973	1,620,716	8,216,535	9,769,925	1,553,390
公 社 債	7,492,090	9,044,241	1,552,150	7,393,167	8,832,222	1,439,055
外 国 証 券	678,166	746,731	68,565	823,367	937,702	114,334
時価が貸借対照表計上額を 超えないもの	753,576	741,358	△12,218	1,170,274	1,136,092	△34,182
公 社 債	645,235	636,493	△8,741	1,114,127	1,080,815	△33,312
外 国 証 券	108,340	104,864	△3,476	56,146	55,276	△869

ウ. その他有価証券

(単位:百万円)

区 分	2019年度末			2020年度第2四半期(上半期)末		
	帳簿価額	貸借対照表計上額	差額	帳簿価額	貸借対照表計上額	差額
貸借対照表計上額が帳簿価額を 超えるもの	13,292,127	16,142,552	2,850,425	13,801,518	17,151,848	3,350,329
公 社 債	4,655,016	5,019,411	364,394	4,631,128	5,003,402	372,273
株 式	1,188,129	2,991,591	1,803,462	1,316,802	3,634,893	2,318,090
外 国 証 券	6,857,142	7,504,104	646,961	6,908,676	7,511,740	603,064
そ の 他 の 証 券	577,654	612,381	34,726	816,619	869,786	53,167
買 入 金 銭 債 権	11,184	12,064	880	8,809	9,515	705
譲 渡 性 預 金	3,000	3,000	0	—	—	—
金 銭 の 信 託	—	—	—	119,481	122,509	3,028
貸借対照表計上額が帳簿価額を 超えないもの	1,996,218	1,853,626	△142,591	1,592,253	1,528,401	△63,851
公 社 債	217,042	213,582	△3,460	77,346	76,955	△391
株 式	410,410	363,092	△47,317	249,893	220,264	△29,628
外 国 証 券	1,063,040	1,001,229	△61,810	1,084,082	1,054,270	△29,811
そ の 他 の 証 券	257,866	231,759	△26,106	110,955	107,048	△3,906
買 入 金 銭 債 権	—	—	—	19,998	19,996	△1
譲 渡 性 預 金	30,000	29,995	△4	30,000	29,997	△2
金 銭 の 信 託	17,859	13,966	△3,892	19,977	19,868	△108

- ・ 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:百万円)

区 分	2019年度末	2020年度 第2四半期(上半期)末
満期保有目的の債券	—	—
責任準備金対応債券	—	—
子会社株式及び関連会社株式	847,921	847,855
そ の 他 の 有 価 証 券	45,098	46,529
非 上 場 国 内 株 式	27,725	27,627
非 上 場 外 国 株 式	4,126	4,126
そ の 他 外 国 証 券	531	337
そ の 他	12,714	14,437
合 計	893,020	894,385

#### 4. デリバティブ取引の定量的情報

##### (1) 差損益の内訳(ヘッジ会計適用分・非適用分の内訳)

(単位:百万円)

区 分	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
ヘッジ会計適用分	61,637	△10,208	—	—	—	51,428
ヘッジ会計非適用分	0	△19,275	△8,598	9	—	△27,864
合 計	61,637	△29,483	△8,598	9	—	23,564

(単位:百万円)

区 分	2020年度第2四半期(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
ヘッジ会計適用分	58,047	7,408	—	—	—	65,456
ヘッジ会計非適用分	265	10,503	73	3	—	10,846
合 計	58,312	17,912	73	3	—	76,302

(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△11,456百万円、2020年度第2四半期(上半期)末:通貨関連9,424百万円)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

###### ○金利関連

(単位:百万円)

店 頭	区 分	2019年度末				2020年度第2四半期(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		
	金利スワップ 固定金利受取/変動金利支払	900	900	0	0	90,000	90,000	265	265
	合 計				0				265

(注) 金利スワップの差損益は、時価を記載しています。

##### 【ご参考】金利スワップ契約の残存期間別構成

(単位:百万円、%)

区 分		2019年度末						
		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
固定金利受取 変動金利支払 スワップ	想 定 元 本	—	—	—	—	—	900	900
	平均受取金利	—	—	—	—	—	0.15	0.15
	平均支払金利	—	—	—	—	—	△0.04	△0.04

(単位:百万円、%)

区 分		2020年度第2四半期(上半期)末						
		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
固定金利受取 変動金利支払 スワップ	想 定 元 本	—	—	—	—	—	90,000	90,000
	平均受取金利	—	—	—	—	—	0.18	0.18
	平均支払金利	—	—	—	—	—	△0.04	△0.04

## ○通貨関連

(単位:百万円)

区 分	2019年度末				2020年度第2四半期(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	773,127	—	△596	△596	815,915	—	4,329	4,329
	米ドル	687,556	—	△4,401	△4,401	739,514	—	4,361	4,361
	豪ドル	53,582	—	3,472	3,472	52,558	—	△340	△340
	ユーロ	31,838	—	331	331	23,541	—	309	309
	その他	149	—	0	0	301	—	△0	△0
	買建	33,772	—	23	23	20,601	—	△21	△21
	米ドル	16,746	—	68	68	10,476	—	△6	△6
	ポーランドズロチ	—	—	—	—	5,408	—	24	24
	ユーロ	11,451	—	△83	△83	3,260	—	△23	△23
	豪ドル	5,523	—	38	38	1,234	—	△15	△15
	その他	50	—	0	0	222	—	△0	△0
	通貨オプション								
	売建								
	コール	157,097	—	41	0	—	—	—	—
米ドル	(41)	—	41	0	(-)	—	—	—	
買建									
プット	166,178	—	198	135	—	—	—	—	
米ドル	(63)	—	198	135	(-)	—	—	—	
通貨スワップ									
円払/豪ドル受	175,156	175,156	△19,719	△19,719	143,162	143,162	5,468	5,468	
円払/米ドル受	7,080	7,080	881	881	7,080	7,080	726	726	
合 計				△19,275				10,503	

(注) 1. 為替予約および通貨スワップの差損益は、時価を記載しています。通貨オプションの差損益はオプション料と時価との差額を記載しています。

2. ( )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。

## ○株式関連

(単位:百万円)

区 分	2019年度末				2020年度第2四半期(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	148,066	—	△8,969	△8,969	961	—	△13	△13
	買建	8,943	—	231	231	5,461	—	49	49
	外国株価指数先物								
	売建	346	—	△35	△35	22	—	0	0
買建	6,304	—	174	174	3,612	—	37	37	
合 計				△8,598				73	

(注) 株価指数先物および外国株価指数先物の差損益は、時価を記載しています。

## ○債券関連

(単位:百万円)

区 分	2019年度末				2020年度第2四半期(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	外国債券指数先物							
	売建	-	-	-	-	-	-	-
	買建	513	-	9	9	548	-	3
合 計				9				3

## (3)ヘッジ会計が適用されているもの

## ○金利関連

(単位:百万円)

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		時価
				うち1年超	
繰延ヘッジ	金利スワップ 固定金利受取/変動金利支払	保険負債	227,300	227,300	61,477
金利スワップの特例処理	金利スワップ 固定金利受取/変動金利支払	貸付金	3,222	3,222	159
合 計					61,637

(単位:百万円)

ヘッジ会計の方法	種類	主なヘッジ対象	2020年度第2四半期(上半期)末		
			契約額等		時価
				うち1年超	
繰延ヘッジ	金利スワップ 固定金利受取/変動金利支払	保険負債	226,900	226,900	57,894
金利スワップの特例処理	金利スワップ 固定金利受取/変動金利支払	貸付金	3,171	3,171	153
合 計					58,047

## 【ご参考】金利スワップ契約の残存期間別構成

(単位:百万円、%)

区 分		2019年度末						合計
		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	
固定金利受取 変動金利支払 スワップ	想 定 元 本	—	6,500	8,122	10,100	12,400	193,400	230,522
	平均受取金利	—	1.68	1.74	1.83	2.13	1.86	1.86
	平均支払金利	—	△0.01	0.10	0.01	△0.01	△0.02	△0.02

(単位:百万円、%)

区 分		2020年度第2四半期(上半期)末						合計
		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	
固定金利受取 変動金利支払 スワップ	想 定 元 本	—	6,500	7,871	9,800	12,400	193,500	230,071
	平均受取金利	—	1.68	1.74	1.82	2.13	1.85	1.85
	平均支払金利	—	△0.02	0.06	0.04	△0.05	△0.02	△0.02



## ○通貨関連

(単位:百万円)

ヘッジ会計の方法	種類	主なヘッジ対象	2019年度末			2020年度第2四半期(上半期)末		
			契約額等	うち1年超	時価	契約額等	うち1年超	時価
時価ヘッジ	為替予約 売建	外貨建 債券	4,679,142	—	△11,456	4,550,869	—	8,875
	米ドル		4,169,798	—	△34,142	3,623,477	—	24,624
	豪ドル		240,977	—	20,754	527,470	—	△7,803
	ユーロ		253,887	—	1,063	292,357	—	△8,969
	その他		14,479	—	867	107,564	—	1,023
繰延ヘッジ	通貨スワップ	外貨建 債券						
	ユーロ		35,575	35,575	538	35,575	35,575	△1,546
	豪ドル		4,305	4,305	709	4,305	4,305	80
合 計					△10,208			7,408

(注) 為替予約等が付されていることにより、決済時における円貨額が確定し、貸借対照表において当該円貨額で表示されている外貨建金銭債権債務等にかかる取引を除いています。

## ○株式関連

2019年度末および2020年度第2四半期(上半期)末とも保有していません。

## ○債券関連

2019年度末および2020年度第2四半期(上半期)末とも保有していません。