

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年度末	
	金 額	占率	金 額	占率
国 債	14,579,276	46.0	15,634,628	45.1
地 方 債	306,157	1.0	275,769	0.8
社 債	2,323,598	7.3	2,243,469	6.5
うち公社・公団債	368,886	1.2	391,662	1.1
株 式	3,447,155	10.9	4,641,731	13.4
外 国 証 券	10,168,944	32.1	10,656,853	30.7
公 社 債	8,513,065	26.9	8,351,872	24.1
株 式 等	1,655,879	5.2	2,304,980	6.6
そ の 他 の 証 券	872,076	2.8	1,251,796	3.6
合 計	31,697,210	100.0	34,704,247	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年度末
北 海 道	4,589	4,399
東 北	—	—
関 東	114,554	108,527
中 部	38,348	35,334
近 畿	85,387	83,722
中 国	7,159	6,262
四 国	—	—
九 州	31,206	30,838
そ の 他	24,911	6,683
合 計	306,157	275,769

(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	1,333,499	2,053,792	1,126,637	2,180,727	4,674,927	23,334,662	34,704,247
国 債	886,705	1,082,854	739,192	875,379	2,102,540	9,947,956	15,634,628
地 方 債	100	5,095	1,702	88,157	114,850	65,863	275,769
社 債	102,224	151,645	83,603	299,173	342,577	1,264,244	2,243,469
株 式	—	—	—	—	—	4,641,731	4,641,731
外 国 証 券	344,451	807,795	301,024	905,763	2,010,923	6,286,893	10,656,853
公 社 債	344,451	807,795	301,024	905,763	2,010,923	3,981,913	8,351,872
株 式 等	—	—	—	—	—	2,304,980	2,304,980
そ の 他 の 証 券	17	6,400	1,114	12,253	104,034	1,127,974	1,251,796
買 入 金 銭 債 権	69,990	—	—	—	—	194,194	264,184
譲 渡 性 預 金	52,995	—	—	—	—	—	52,995
そ の 他	—	—	—	—	—	154,622	154,622
合 計	1,456,484	2,053,792	1,126,637	2,180,727	4,674,927	23,683,479	35,176,049

(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年度末	
		金 額	占 率	金 額	占 率
水 産 ・ 農 林 業		1,130	0.0	1,413	0.0
鉱 業		—	—	—	—
建 設 業		76,306	2.2	96,750	2.1
製 造 業	食 料 品	181,982	5.3	210,132	4.5
	織 維 製 品	20,660	0.6	23,853	0.5
	パ ル プ ・ 紙	2,598	0.1	3,140	0.1
	化 学	332,025	9.6	509,153	11.0
	医 薬 品	128,861	3.7	148,056	3.2
	石 油 ・ 石 炭 製 品	4,430	0.1	5,898	0.1
	ゴ ム 製 品	8,899	0.3	10,446	0.2
	ガ ラ ス ・ 土 石 製 品	134,835	3.9	199,034	4.3
	鉄 鋼	29,585	0.9	48,185	1.0
	非 鉄 金 属	10,069	0.3	11,538	0.2
	金 属 製 品	16,113	0.5	20,400	0.4
	機 械	173,864	5.0	277,800	6.0
	電 気 機 器	447,829	13.0	731,510	15.8
	輸 送 用 機 器	376,625	10.9	496,205	10.7
	精 密 機 器	188,575	5.5	230,962	5.0
	そ の 他 製 品	33,003	1.0	44,272	1.0
電 気 ・ ガ ス 業		119,531	3.5	131,837	2.8
運 輸 ・ 情 報 通 信 業	陸 運 業	178,693	5.2	216,246	4.7
	海 運 業	4,819	0.1	12,435	0.3
	空 運 業	4,251	0.1	4,130	0.1
	倉 庫 ・ 運 輸 関 連 業	20,349	0.6	28,623	0.6
	情 報 ・ 通 信 業	32,445	0.9	29,240	0.6
商 業	卸 売 業	245,424	7.1	322,758	7.0
	小 売 業	29,191	0.8	36,067	0.8
金 融 ・ 保 険 業	銀 行 業	237,094	6.9	315,954	6.8
	証 券 ・ 商 品 先 物 取 引 業	14,028	0.4	15,149	0.3
	保 険 業	137,729	4.0	140,061	3.0
	そ の 他 金 融 業	66,643	1.9	91,405	2.0
不 動 産 業		138,095	4.0	160,500	3.5
サ ー ビ ス 業		51,460	1.5	68,563	1.5
合 計		3,447,155	100.0	4,641,731	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年度末
保 険 約 款 貸 付	229,759	207,776
契 約 者 貸 付	217,693	196,720
保 険 料 振 替 貸 付	12,065	11,055
一 般 貸 付 (うち非居住者貸付)	3,875,676 (188,980)	3,887,946 (192,465)
企 業 貸 付 (うち国内企業向け)	3,718,107 (3,550,126)	3,733,471 (3,559,006)
国・国際機関・政府関係機関貸付	11,756	8,550
公 共 団 体 ・ 公 企 業 貸 付	128,232	129,602
住 宅 ロ ー ン	—	—
消 費 者 ロ ー ン	17,472	16,250
そ の 他	108	72
合 計	4,105,435	4,095,722

(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年度末	
			占 率		占 率
大 企 業	貸付先数	605	54.1	555	54.7
	金 額	3,068,356	86.4	3,069,943	86.3
中 堅 企 業	貸付先数	97	8.7	87	8.6
	金 額	19,107	0.5	18,788	0.5
中 小 企 業	貸付先数	417	37.3	372	36.7
	金 額	462,662	13.0	470,274	13.2
国内企業向け貸付計	貸付先数	1,119	100.0	1,014	100.0
	金 額	3,550,126	100.0	3,559,006	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	
	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
大企業								
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年度末	
		金 額	占 率	金 額	占 率
国 内 向 け	製 造 業	610,804	15.8	625,519	16.1
	食 料	25,882	0.7	21,221	0.5
	織 維	5,284	0.1	1,934	0.0
	木 材 ・ 木 製 品	—	—	—	—
	パ ル プ ・ 紙	40,199	1.0	42,770	1.1
	印 刷	5,434	0.1	15,447	0.4
	化 学	118,266	3.1	131,032	3.4
	石 油 ・ 石 炭	76,548	2.0	72,461	1.9
	窯 業 ・ 土 石	58,004	1.5	57,657	1.5
	鉄 鋼	119,898	3.1	118,689	3.1
	非 鉄 金 属	10,987	0.3	9,228	0.2
	金 属 製 品	3,065	0.1	3,048	0.1
	はん用・生産用・業務用機械	45,388	1.2	43,348	1.1
	電 気 機 械	43,851	1.1	43,997	1.1
	輸 送 用 機 械	53,283	1.4	60,677	1.6
	そ の 他 の 製 造 業	4,710	0.1	4,003	0.1
	農 業 、 林 業	141	0.0	38	0.0
	漁 業	—	—	—	—
	鉱業、採石業、砂利採取業	26	0.0	—	—
	建 設 業	13,380	0.3	19,520	0.5
	電気・ガス・熱供給・水道業	770,642	19.9	781,706	20.1
	情 報 通 信 業	88,870	2.3	88,804	2.3
	運 輸 業 、 郵 便 業	280,164	7.2	288,850	7.4
	卸 売 業	664,374	17.1	661,983	17.0
	小 売 業	13,947	0.4	14,321	0.4
	金 融 業 、 保 険 業	730,700	18.9	691,751	17.8
	不 動 産 業	367,187	9.5	369,158	9.5
	物 品 賃 貸 業	100,405	2.6	110,785	2.8
	学術研究、専門・技術サービス業	20,502	0.5	20,460	0.5
	宿 泊 業	1,598	0.0	694	0.0
	飲 食 業	420	0.0	305	0.0
	生活関連サービス業、娯楽業	2,465	0.1	2,038	0.1
	教 育 、 学 習 支 援 業	180	0.0	107	0.0
医 療 ・ 福 祉	477	0.0	494	0.0	
そ の 他 の サ ー ビ ス	2,652	0.1	2,526	0.1	
地 方 公 共 団 体	282	0.0	163	0.0	
個人(住宅・消費・納税資金等)	17,472	0.5	16,250	0.4	
そ の 他	—	—	—	—	
合 計	3,686,695	95.1	3,695,481	95.0	
海 外 向 け	政 府 等	21,000	0.5	18,000	0.5
	金 融 機 関	14,520	0.4	10,000	0.3
	商 工 業 等	153,460	4.0	164,465	4.2
	合 計	188,980	4.9	192,465	5.0
一 般 貸 付 計		3,875,676	100.0	3,887,946	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	99,197	7,513	11,818	3,800	36,435	82,213	240,978
固 定 金 利	280,250	574,700	644,744	491,531	761,567	894,175	3,646,968
一 般 貸 付 計	379,447	582,213	656,562	495,331	798,002	976,388	3,887,946

(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年度末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
北 海 道	47,165	1.3	51,001	1.4
東 北	49,317	1.3	49,529	1.3
関 東	2,778,432	75.7	2,789,690	75.8
中 部	333,153	9.1	323,902	8.8
近 畿	222,227	6.1	224,930	6.1
中 国	44,706	1.2	43,013	1.2
四 国	40,820	1.1	40,704	1.1
九 州	153,401	4.2	156,458	4.3
合 計	3,669,223	100.0	3,679,230	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) 貸付金担保別内訳

(単位:百万円、%)

区 分	2019年度末		2020年度末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
担 保 貸 付	11,558	0.3	9,434	0.2
有 価 証 券 担 保 貸 付	4,184	0.1	3,525	0.1
不 動 産・動 産・財 団 担 保 貸 付	5,974	0.2	4,568	0.1
指 名 債 権 担 保 貸 付	1,400	0.0	1,340	0.0
保 証 貸 付	61,204	1.6	54,220	1.4
信 用 貸 付	3,785,439	97.7	3,808,041	97.9
そ の 他	17,472	0.5	16,250	0.4
一 般 貸 付 計	3,875,676	100.0	3,887,946	100.0
う ち 劣 後 特 約 付 貸 付	308,150	8.0	340,350	8.8

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年度末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
公 社 債	8,754,071	78.9	8,711,821	74.3
株 式 等	1,612,256	14.5	2,258,780	19.3
現 預 金・その他	239,121	2.2	292,545	2.5
小 計	10,605,449	95.5	11,263,147	96.1

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年度末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
貸 付 金	131,049	1.2	131,049	1.1
そ の 他	100	0.0	100	0.0
小 計	131,149	1.2	131,149	1.1

(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年度末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
非 居 住 者 貸 付	153,520	1.4	146,680	1.3
公 社 債 (円 建 外 債)	166,166	1.5	138,265	1.2
そ の 他	43,623	0.4	46,199	0.4
小 計	363,310	3.3	331,145	2.8

エ. 合計 (ア+イ+ウ)

(単位:百万円、%)

区 分	2019年度末		2020年度末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
海 外 投 融 資	11,099,909	100.0	11,725,442	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年度末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
米 ド ル	9,350,802	88.2	9,136,929	81.1
豪 ド ル	522,653	4.9	1,323,573	11.8
そ の 他	731,992	6.9	802,643	7.1
合 計	10,605,449	100.0	11,263,147	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	7,191,416	67.5	6,026,342	72.2	1,165,074	50.5	23,612	12.3		
ヨ ー ロ ッ パ	982,895	9.2	896,482	10.7	86,412	3.7	23,000	12.0		
オ セ ア ニ ア	1,124,095	10.5	1,124,095	13.5	—	—	35,172	18.3		
ア ジ ア	215,444	2.0	103,816	1.2	111,627	4.8	680	0.4		
中 南 米	1,013,273	9.5	71,408	0.9	941,865	40.9	110,000	57.2		
中 東	—	—	—	—	—	—	—	—		
ア フ リ カ	—	—	—	—	—	—	—	—		
国 際 機 関	129,727	1.2	129,727	1.6	—	—	—	—		
合 計	10,656,853	100.0	8,351,872	100.0	2,304,980	100.0	192,465	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T T M、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					
	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	△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	47,124	△235,410	—	—	—	△188,285
ヘッジ会計非適用分	△1,320	△32,892	△88	—	—	△34,301
合 計	45,803	△268,302	△88	—	—	△222,587

(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年度末:通貨関連△227,340百万円)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	87,000	87,000	△1,320	△1,320
	合 計				0				△1,320

(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	—	—	—	—	—	87,000	87,000
	平均受取金利	—	—	—	—	—	0.40	0.40
	平均支払金利	—	—	—	—	—	△0.05	△0.05

○通貨関連

(単位:百万円)

区 分	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	679,417	—	△2,022	△2,022	826,158	—	△40,715	△40,715	
	米ドル	652,226	—	△4,399	△4,399	796,104	—	△37,867	△37,867	
	豪ドル	27,191	—	2,377	2,377	30,054	—	△2,847	△2,847	
	通貨オプション									
	売建									
	コール	157,097	—	41	0	(-)	—	—	—	
	米ドル	157,097	—	41	0	(-)	—	—	—	
	買建									
	プット	166,178	—	198	135	(-)	—	—	—	
	米ドル	166,178	—	198	135	(-)	—	—	—	
通貨スワップ										
円払/豪ドル受	175,156	175,156	△19,719	△19,719	78,660	78,660	7,315	7,315		
円払/米ドル受	7,080	7,080	881	881	8,280	8,280	507	507		
合 計				△20,724				△32,892		

(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	—	—	—	—	
	株価指数オプション									
買建										
プット	—	—	—	—	99,981	—	214	—	△88	
	(-)				(302)					
合 計				△8,969					△88	

(注) 1. 株価指数先物の差損益は、時価を記載しています。株価指数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。

○債券関連

2019年度末および2020年度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	411,200	408,000	46,989
	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	3,120	3,120	134
	固定金利受取/変動金利支払				
合 計					47,124

【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	3,200	6,800	10,420	7,800	8,300	377,800	414,320
	平均受取金利	1.62	1.75	1.73	2.03	2.15	1.05	1.12
	平均支払金利	△0.05	△0.07	0.09	△0.05	△0.05	△0.05	△0.05

○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	4,283,029	—	△227,340
	米ドル		4,169,798	—	△34,142	3,107,080	—	△142,681
	豪ドル		240,977	—	20,754	796,361	—	△67,254
	ユーロ		253,887	—	1,063	259,122	—	△13,256
	その他		14,479	—	867	120,465	—	△4,147
繰延ヘッジ	為替予約 売建	外貨建 債券	—	—	—	42,322	—	△1,229
	米ドル		—	—	—	42,322	—	△1,229
	通貨スワップ 米ドル		—	—	—	81,785	81,785	△3,188
	ユーロ		35,575	35,575	538	35,575	35,575	△3,013
	豪ドル		4,305	4,305	709	12,404	12,404	△638
合 計				△10,208			△235,410	

(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年度末
有 価 証 券	4,996,600	5,907,773
評 価 差 額	2,707,975	3,990,340
オ フ バ ラ ン ス	2,288,625	1,917,433
土 地	542,845	575,817
再 評 価 差 額	197,631	197,186
オ フ バ ラ ン ス	345,214	378,630
そ の 他	62,679	38,897
合 計	5,602,126	6,522,488

- (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年度末:通貨関連△227,340百万円)、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	47,454	8,964

(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	—	△4	△12	—	—	△16
合 計	—	△4	△12	—	—	△16

(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	454	—	△4	△4
	米ドル	341	—	△3	△3	349	—	△5	△5
	ユーロ	290	—	1	1	105	—	0	0
	買建	164	—	△0	△0	—	—	—	—
	ユーロ	164	—	△0	△0	—	—	—	—
合 計				△3					△4

(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	—	—	—	—	—	△10	△10
	買建	91	—	6	6	—	—	—
	外国株価指数先物							
	売建	346	—	△35	△35	539	—	△1
合 計					△28			△12

(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	168,035	△6,282

(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年度末とも保有していません。

Ⅲ. 個人保険および個人年金保険の責任準備金の積立方式、積立率

		2019年度末	2020年度末
積立方式	標準責任準備金 対象契約	内閣総理大臣が定める方式 (平成8年大蔵省告示第48号)	内閣総理大臣が定める方式 (平成8年大蔵省告示第48号)
	標準責任準備金 対象外契約	平準純保険料式	平準純保険料式
積立率（危険準備金を除く）		100%	100%

- (注) 1. 積立方式および積立率は、個人保険および個人年金保険を対象としています。なお、団体保険および団体年金保険の責任準備金は積立方式という概念がないため、上記には含みません。
2. 積立率については、標準責任準備金対象契約に関しては平成8年大蔵省告示第48号に定める方式により、また、標準責任準備金対象外契約に関しては平準純保険料式により計算した保険料積立金、および未経過保険料に対する積立率を記載しています。

IV. その他(会社計)

1. 資産構成

(1) 資産の構成(2020年度末)

(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	1,236,096	2.9	1,217,742	2.9
買現先勘定	—	—	—	—
債券貸借取引支払保証金	—	—	—	—
買入金銭債権	264,184	0.6	264,184	0.6
商品有価証券	—	—	—	—
金銭の信託	154,622	0.4	154,622	0.4
有価証券	35,382,820	82.9	34,704,247	82.7
公 社 債	18,366,138	43.0	18,153,867	43.2
株 式	4,713,734	11.0	4,641,731	11.1
外 国 証 券	10,854,668	25.4	10,656,853	25.4
公 社 債	8,470,717	19.8	8,351,872	19.9
株 式 等	2,383,951	5.6	2,304,980	5.5
その他の証券	1,448,279	3.4	1,251,796	3.0
貸付金	4,095,722	9.6	4,095,722	9.8
保険約款貸付	207,776	0.5	207,776	0.5
一般貸付	3,887,946	9.1	3,887,946	9.3
不動産	865,732	2.0	865,732	2.1
繰延税金資産	—	—	—	—
その他	692,875	1.6	685,663	1.6
貸倒引当金	△6,837	△0.0	△6,837	△0.0
合 計	42,685,218	100.0	41,981,079	100.0
うち外貨建資産	11,464,715	26.9	11,263,147	26.8

(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	割合	増減	割合
現預金・コールローン	△59,390		△55,624	
買現先勘定	—		—	
債券貸借取引支払保証金	—		—	
買入金銭債権	59,849		59,849	
商品有価証券	—		—	
金銭の信託	140,655		140,655	
有価証券	2,941,620		3,007,037	
公 社 債	931,167		944,834	
株 式	1,186,973		1,194,575	
外 国 証 券	495,176		487,908	
公 社 債	△170,635		△161,192	
株 式 等	665,811		649,100	
その他の証券	328,303		379,719	
貸付金	△9,712		△9,712	
保険約款貸付	△21,983		△21,983	
一般貸付	12,270		12,270	
不動産	4,773		4,773	
繰延税金資産	—		—	
その他	76,638		99,780	
貸倒引当金	△82		△82	
合 計	3,154,352		3,246,676	
うち外貨建資産	657,230		657,698	

(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年度末)

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「6.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	678,573	45,148
一般勘定	—	—	—	—
特別勘定	743,989	△32,957	678,573	45,148

(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年度末				
	帳簿価額	時価	差損益	差益	差損
満期保有目的の債券	3,915,712	4,560,313	644,601	644,694	△93
責任準備金対応債券	10,648,522	11,967,965	1,319,442	1,370,809	△51,367
子会社株式及び関連会社株式	—	—	—	—	—
その他の有価証券	15,697,103	19,686,717	3,989,614	4,104,837	△115,222
公社債	4,600,341	4,931,654	331,312	332,752	△1,439
株式	1,569,925	4,549,352	2,979,426	3,001,258	△21,831
外国証券	8,148,691	8,727,414	578,723	650,714	△71,991
公社債	6,797,217	7,195,323	398,105	464,301	△66,195
株式等	1,351,474	1,532,091	180,617	186,413	△5,796
その他の証券	1,096,142	1,191,967	95,824	114,551	△18,726
買入金銭債権	78,122	78,711	589	595	△5
譲渡性預金	53,000	52,995	△4	—	△4
金銭の信託	150,879	154,622	3,742	4,965	△1,223
合計	30,261,338	36,214,997	5,953,658	6,120,341	△166,683
公社債	17,822,554	20,082,669	2,260,114	2,282,046	△21,931
株式	1,569,925	4,549,352	2,979,426	3,001,258	△21,831
外国証券	9,305,241	9,909,832	604,591	707,457	△102,866
公社債	7,953,767	8,377,741	423,974	521,044	△97,070
株式等	1,351,474	1,532,091	180,617	186,413	△5,796
その他の証券	1,096,142	1,191,967	95,824	114,551	△18,726
買入金銭債権	263,595	273,558	9,963	10,062	△99
譲渡性預金	53,000	52,995	△4	—	△4
金銭の信託	150,879	154,622	3,742	4,965	△1,223

(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	3,904,720	4,549,415	644,694
公 社 債	3,835,912	4,564,012	728,099	3,637,897	4,268,299	630,402
外 国 証 券	96,349	102,106	5,756	89,349	94,174	4,824
買 入 金 銭 債 権	192,270	205,449	13,179	177,473	186,940	9,467
時価が貸借対照表計上額を 超えないもの	10,800	10,567	△232	10,991	10,898	△93
公 社 債	2,800	2,798	△1	2,991	2,991	△0
外 国 証 券	8,000	7,768	△231	—	—	—
買 入 金 銭 債 権	—	—	—	8,000	7,906	△93

イ. 責任準備金対応債券

(単位:百万円)

区 分	2019年度末			2020年度末		
	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	8,286,040	9,656,850	1,370,809
公 社 債	7,492,090	9,044,241	1,552,150	7,654,986	8,973,878	1,318,891
外 国 証 券	678,166	746,731	68,565	631,053	682,972	51,918
時価が貸借対照表計上額を 超えないもの	753,576	741,358	△12,218	2,362,482	2,311,115	△51,367
公 社 債	645,235	636,493	△8,741	1,926,336	1,905,844	△20,492
外 国 証 券	108,340	104,864	△3,476	436,146	405,271	△30,874

ウ. その他有価証券

(単位:百万円)

区 分	2019年度末			2020年度末		
	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	12,913,377	17,018,214	4,104,837
公 社 債	4,655,016	5,019,411	364,394	4,495,430	4,828,182	332,752
株 式	1,188,129	2,991,591	1,803,462	1,408,942	4,410,200	3,001,258
外 国 証 券	6,857,142	7,504,104	646,961	6,272,606	6,923,320	650,714
そ の 他 の 証 券	577,654	612,381	34,726	687,471	802,022	114,551
買 入 金 銭 債 権	11,184	12,064	880	8,126	8,721	595
譲 渡 性 預 金	3,000	3,000	0	—	—	—
金 銭 の 信 託	—	—	—	40,800	45,766	4,965
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	2,783,725	2,668,502	△115,222
公 社 債	217,042	213,582	△3,460	104,911	103,472	△1,439
株 式	410,410	363,092	△47,317	160,982	139,151	△21,831
外 国 証 券	1,063,040	1,001,229	△61,810	1,876,085	1,804,093	△71,991
そ の 他 の 証 券	257,866	231,759	△26,106	408,671	389,944	△18,726
買 入 金 銭 債 権	—	—	—	69,996	69,990	△5
譲 渡 性 預 金	30,000	29,995	△4	53,000	52,995	△4
金 銭 の 信 託	17,859	13,966	△3,892	110,079	108,855	△1,223

・ 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	876,895
そ の 他 の 有 価 証 券	45,098	47,475
非 上 場 国 内 株 式	27,725	27,698
非 上 場 外 国 株 式	4,126	4,126
そ の 他 外 国 証 券	531	98
そ の 他	12,714	15,552
合 計	893,020	924,371

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	47,124	△235,410	—	—	—	△188,285
ヘッジ会計非適用分	△1,320	△32,982	△91	△8	—	△34,403
合 計	45,803	△268,392	△91	△8	—	△222,689

(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年度末:通貨関連△227,340百万円)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年度末			
		契約額等	時価		契約額等	時価		差損益	
			うち1年超	差損益		うち1年超	差損益		
	金利スワップ 固定金利受取/変動金利支払	900	900	0	0	87,000	87,000	△1,320	△1,320
	合 計				0				△1,320

(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	—	—	—	—	—	87,000	87,000
	平均受取金利	—	—	—	—	—	0.40	0.40
	平均支払金利	—	—	—	—	—	△0.05	△0.05

○通貨関連

(単位:百万円)

区 分	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	773,127	—	△596	△596	898,760	—	△40,836	△40,836
	米ドル	687,556	—	△4,401	△4,401	821,769	—	△38,179	△38,179
	豪ドル	53,582	—	3,472	3,472	54,482	—	△2,721	△2,721
	ユーロ	31,838	—	331	331	22,427	—	64	64
	その他	149	—	0	0	80	—	△0	△0
	買建	33,772	—	23	23	5,775	—	31	31
	米ドル	16,746	—	68	68	3,502	—	35	35
	ユーロ	11,451	—	△83	△83	1,536	—	△2	△2
	豪ドル	5,523	—	38	38	712	—	△2	△2
	その他	50	—	0	0	24	—	0	0
	通貨オプション								
	売建								
	コール	157,097	—			—	—		
	(41)		41	0	(-)		—	—	
米ドル	157,097	—			—	—			
	(41)		41	0	(-)		—	—	
買建									
プット	166,178	—			—	—			
	(63)		198	135	(-)		—	—	
米ドル	166,178	—			—	—			
	(63)		198	135	(-)		—	—	
通貨スワップ									
円払/豪ドル受	175,156	175,156	△19,719	△19,719	78,660	78,660	7,315	7,315	
円払/米ドル受	7,080	7,080	881	881	8,280	8,280	507	507	
合 計				△19,275				△32,982	

(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	2,140	—	△67	△67
	買建	8,943	—	231	231	4,656	—	33	33
	外国株価指数先物								
	売建	346	—	△35	△35	539	—	△1	△1
	買建	6,304	—	174	174	4,840	—	32	32
	株価指数オプション								
買建	—	—	—	—	99,981	—			
プット	(-)				(302)		214	△88	
合 計				△8,598				△91	

(注) 1. 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。株価指数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。

○債券関連

(単位:百万円)

区 分	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	外国債券指数先物							
買建	513	—	9	9	803	—	△8	△8
合 計				9				△8

(注) 外国債券指数先物の差損益は、時価を記載しています。

(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	411,200	408,000	46,989
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	3,120	3,120	134
合 計					47,124

【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	3,200	6,800	10,420	7,800	8,300	377,800	414,320
	平均受取金利	1.62	1.75	1.73	2.03	2.15	1.05	1.12
	平均支払金利	△0.05	△0.07	0.09	△0.05	△0.05	△0.05	△0.05

○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	4,283,029	—	△227,340
	米ドル		4,169,798	—	△34,142	3,107,080	—	△142,681
	豪ドル		240,977	—	20,754	796,361	—	△67,254
	ユーロ		253,887	—	1,063	259,122	—	△13,256
	その他		14,479	—	867	120,465	—	△4,147
繰延ヘッジ	為替予約 売建	外貨建 債券	—	—	—	42,322	—	△1,229
	米ドル		—	—	—	42,322	—	△1,229
	通貨スワップ 米ドル		—	—	—	81,785	81,785	△3,188
	ユーロ		35,575	35,575	538	35,575	35,575	△3,013
	豪ドル		4,305	4,305	709	12,404	12,404	△638
合 計				△10,208			△235,410	

(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年度末とも保有していません。