

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	2020年度末		2021年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
国 債	15,634,628	45.1	15,877,881	44.9
地 方 債	275,769	0.8	274,961	0.8
社 債	2,243,469	6.5	2,164,812	6.1
うち公社・公団債	391,662	1.1	412,587	1.2
株 式	4,641,731	13.4	4,834,681	13.7
外 国 証 券	10,656,853	30.7	11,100,369	31.4
公 社 債	8,351,872	24.1	8,612,163	24.3
株 式 等	2,304,980	6.6	2,488,206	7.0
そ の 他 の 証 券	1,251,796	3.6	1,141,804	3.2
合 計	34,704,247	100.0	35,394,510	100.0

(2) 地域別地方債保有明細表

(単位:百万円)

区 分	2020年度末	2021年度 第2四半期(上半期)末
北 海 道	4,399	4,399
東 北	—	—
関 東	108,527	108,123
中 部	35,334	35,278
近 畿	83,722	83,417
中 国	6,262	6,221
四 国	—	—
九 州	30,838	30,835
そ の 他	6,683	6,686
合 計	275,769	274,961

(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	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

(単位:百万円)

区 分	2021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	1,080,013	1,862,324	1,157,191	2,693,077	5,348,165	23,253,738	35,394,510
国 債	497,532	1,104,153	641,906	1,111,122	2,177,469	10,345,697	15,877,881
地 方 債	—	5,096	18,833	122,422	62,723	65,885	274,961
社 債	91,752	148,943	133,522	305,322	298,724	1,186,547	2,164,812
株 式	—	—	—	—	—	4,834,681	4,834,681
外 国 証 券	490,647	597,493	356,715	1,143,904	2,587,484	5,924,124	11,100,369
公 社 債	490,647	597,493	356,715	1,143,904	2,587,484	3,435,917	8,612,163
株 式 等	—	—	—	—	—	2,488,206	2,488,206
そ の 他 の 証 券	81	6,637	6,213	10,306	221,763	896,802	1,141,804
買 入 金 銭 債 権	59,992	—	—	—	—	188,107	248,100
譲 渡 性 預 金	49,995	—	—	—	—	—	49,995
そ の 他	—	—	—	—	—	157,065	157,065
合 計	1,190,001	1,862,324	1,157,191	2,693,077	5,348,165	23,598,911	35,849,671

(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		2020年度末		2021年度 第2四半期(上半期)末	
		金 額	占 率	金 額	占 率
水 産 ・ 農 林 業		1,413	0.0	1,375	0.0
鉱 業		—	—	—	—
建 設 業		96,750	2.1	97,894	2.0
製 造 業	食 料 品	210,132	4.5	230,830	4.8
	織 維 製 品	23,853	0.5	23,490	0.5
	パ ル プ ・ 紙	3,140	0.1	2,970	0.1
	化 学	509,153	11.0	523,616	10.8
	医 薬 品	148,056	3.2	147,664	3.1
	石 油 ・ 石 炭 製 品	5,898	0.1	5,394	0.1
	ゴ ム 製 品	10,446	0.2	10,727	0.2
	ガ ラ ス ・ 土 石 製 品	199,034	4.3	193,589	4.0
	鉄 鋼	48,185	1.0	53,214	1.1
	非 鉄 金 属	11,538	0.2	10,124	0.2
	金 属 製 品	20,400	0.4	20,572	0.4
	機 械	277,800	6.0	262,455	5.4
	電 気 機 器	731,510	15.8	758,629	15.7
	輸 送 用 機 器	496,205	10.7	544,302	11.3
	精 密 機 器	230,962	5.0	285,795	5.9
そ の 他 製 品	44,272	1.0	49,267	1.0	
電 気 ・ ガ ス 業		131,837	2.8	117,563	2.4
運 輸 ・ 情 報 通 信 業	陸 運 業	216,246	4.7	205,612	4.3
	海 運 業	12,435	0.3	29,459	0.6
	空 運 業	4,130	0.1	4,535	0.1
	倉 庫 ・ 運 輸 関 連 業	28,623	0.6	28,436	0.6
	情 報 ・ 通 信 業	29,240	0.6	54,015	1.1
商 業	卸 売 業	322,758	7.0	351,568	7.3
	小 売 業	36,067	0.8	36,413	0.8
金 融 ・ 保 険 業	銀 行 業	315,954	6.8	304,239	6.3
	証 券 ・ 商 品 先 物 取 引 業	15,149	0.3	15,036	0.3
	保 険 業	140,061	3.0	142,047	2.9
	そ の 他 金 融 業	91,405	2.0	93,178	1.9
不 動 産 業		160,500	3.5	148,384	3.1
サ ー ビ ス 業		68,563	1.5	82,276	1.7
合 計		4,641,731	100.0	4,834,681	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	2020年度末	2021年度 第2四半期(上半期)末
保 険 約 款 貸 付	207,776	199,547
契 約 者 貸 付	196,720	189,032
保 険 料 振 替 貸 付	11,055	10,514
一 般 貸 付 (うち非居住者貸付)	3,887,946 (192,465)	3,800,611 (187,983)
企 業 貸 付 (うち国内企業向け)	3,733,471 (3,559,006)	3,645,576 (3,472,593)
国・国際機関・政府関係機関貸付	8,550	5,551
公 共 団 体 ・ 公 企 業 貸 付	129,602	133,519
住 宅 ロ ー ン	—	—
消 費 者 ロ ー ン	16,250	15,909
そ の 他	72	54
合 計	4,095,722	4,000,158

(2) 国内企業向け貸付金企業規模別内訳

(単位:百万円、%)

区 分		2020年度末		2021年度 第2四半期(上半期)末	
			占 率		占 率
大 企 業	貸 付 先 数	555	54.7	517	54.8
	金 額	3,069,943	86.3	3,037,972	87.5
中 堅 企 業	貸 付 先 数	87	8.6	87	9.2
	金 額	18,788	0.5	17,768	0.5
中 小 企 業	貸 付 先 数	372	36.7	340	36.0
	金 額	470,274	13.2	416,851	12.0
国内企業向け貸付計	貸 付 先 数	1,014	100.0	944	100.0
	金 額	3,559,006	100.0	3,472,593	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		2020年度末		2021年度 第2四半期(上半期)末	
		金 額	占 率	金 額	占 率
国 内 向 け	製 造 業	625,519	16.1	607,013	16.0
	食 料	21,221	0.5	21,054	0.6
	織 維	1,934	0.0	1,803	0.0
	木 材 ・ 木 製 品	—	—	—	—
	パ ル プ ・ 紙	42,770	1.1	42,579	1.1
	印 刷	15,447	0.4	14,910	0.4
	化 学	131,032	3.4	129,713	3.4
	石 油 ・ 石 炭	72,461	1.9	72,417	1.9
	窯 業 ・ 土 石	57,657	1.5	57,097	1.5
	鉄 鋼	118,689	3.1	105,076	2.8
	非 鉄 金 属	9,228	0.2	8,942	0.2
	金 属 製 品	3,048	0.1	2,974	0.1
	はん用・生産用・業務用機械	43,348	1.1	43,451	1.1
	電 気 機 械	43,997	1.1	43,071	1.1
	輸 送 用 機 械	60,677	1.6	60,061	1.6
	そ の 他 の 製 造 業	4,003	0.1	3,857	0.1
	農 業 、 林 業	38	0.0	32	0.0
	漁 業	—	—	—	—
	鉱業、採石業、砂利採取業	—	—	—	—
	建 設 業	19,520	0.5	18,744	0.5
	電気・ガス・熱供給・水道業	781,706	20.1	799,868	21.0
	情 報 通 信 業	88,804	2.3	88,277	2.3
	運 輸 業 、 郵 便 業	288,850	7.4	288,224	7.6
	卸 売 業	661,983	17.0	641,237	16.9
	小 売 業	14,321	0.4	13,000	0.3
	金 融 業 、 保 険 業	691,751	17.8	631,870	16.6
	不 動 産 業	369,158	9.5	365,946	9.6
	物 品 賃 貸 業	110,785	2.8	117,253	3.1
	学術研究、専門・技術サービス業	20,460	0.5	20,105	0.5
	宿 泊 業	694	0.0	472	0.0
	飲 食 業	305	0.0	266	0.0
	生活関連サービス業、娯楽業	2,038	0.1	1,556	0.0
	教 育 、 学 習 支 援 業	107	0.0	59	0.0
医 療 ・ 福 祉	494	0.0	458	0.0	
そ の 他 の サ ー ビ ス	2,526	0.1	2,223	0.1	
地 方 公 共 団 体	163	0.0	106	0.0	
個人(住宅・消費・納税資金等)	16,250	0.4	15,909	0.4	
そ の 他	—	—	—	—	
合 計	3,695,481	95.0	3,612,627	95.1	
海 外 向 け	政 府 等	18,000	0.5	15,000	0.4
	金 融 機 関	10,000	0.3	10,000	0.3
	商 工 業 等	164,465	4.2	162,983	4.3
	合 計	192,465	5.0	187,983	4.9
一 般 貸 付 計		3,887,946	100.0	3,800,611	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	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

(単位:百万円)

区 分	2021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	112,689	8,332	16,767	5,003	36,717	68,065	247,576
固 定 金 利	251,454	638,350	598,589	466,481	796,174	801,983	3,553,034
一 般 貸 付 計	364,143	646,683	615,357	471,485	832,892	870,049	3,800,611

(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	2020年度末		2021年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
北 海 道	51,001	1.4	50,924	1.4
東 北	49,529	1.3	49,858	1.4
関 東	2,789,690	75.8	2,708,411	75.3
中 部	323,902	8.8	322,658	9.0
近 畿	224,930	6.1	220,746	6.1
中 国	43,013	1.2	42,650	1.2
四 国	40,704	1.1	40,557	1.1
九 州	156,458	4.3	160,911	4.5
合 計	3,679,230	100.0	3,596,718	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	2020年度末		2021年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
担 保 貸 付	9,434	0.2	9,263	0.2
有 価 証 券 担 保 貸 付	3,525	0.1	3,788	0.1
不 動 産・動 産・財 団 担 保 貸 付	4,568	0.1	4,231	0.1
指 名 債 権 担 保 貸 付	1,340	0.0	1,243	0.0
保 証 貸 付	54,220	1.4	52,985	1.4
信 用 貸 付	3,808,041	97.9	3,722,453	97.9
そ の 他	16,250	0.4	15,909	0.4
一 般 貸 付 計	3,887,946	100.0	3,800,611	100.0
う ち 劣 後 特 約 付 貸 付	340,350	8.8	325,350	8.6

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	2020年度末		2021年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
公 社 債	8,711,821	74.3	9,003,824	73.8
株 式 等	2,258,780	19.3	2,462,318	20.2
現 預 金・そ の 他	292,545	2.5	297,737	2.4
小 計	11,263,147	96.1	11,763,881	96.4

イ. 円貨額が確定した外貨建資産

(単位:百万円、%)

区 分	2020年度末		2021年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
貸 付 金	131,049	1.1	131,049	1.1
そ の 他	100	0.0	97	0.0
小 計	131,149	1.1	131,146	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	2020年度末		2021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	146,680	1.3	143,510	1.2
公 社 債 (円 建 外 債)	138,265	1.2	138,064	1.1
そ の 他	46,199	0.4	25,887	0.2
小 計	331,145	2.8	307,462	2.5

エ. 合計 (ア+イ+ウ)

(単位:百万円、%)

区 分	2020年度末		2021年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
海 外 投 融 資	11,725,442	100.0	12,202,490	100.0

(2) 外貨建資産の通貨別構成

(単位:百万円、%)

区 分	2020年度末		2021年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
米 ド ル	9,136,929	81.1	9,344,859	79.4
豪 ド ル	1,323,573	11.8	1,263,942	10.7
そ の 他	802,643	7.1	1,155,079	9.8
合 計	11,263,147	100.0	11,763,881	100.0

(3) 海外投融資の地域別構成

(単位:百万円、%)

区 分	2020年度末							
	外国証券						非居住者貸付	
	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

(単位:百万円、%)

区 分	2021年度第2四半期(上半期)末							
	外国証券						非居住者貸付	
	金 額		占 率		金 額		占 率	
北 米	7,196,533	64.8	5,992,525	69.6	1,204,008	48.4	23,491	12.5
ヨ ー ロ ッ パ	1,168,160	10.5	1,077,727	12.5	90,433	3.6	20,000	10.6
オ セ ア ニ ア	1,171,432	10.6	1,171,432	13.6	—	—	33,982	18.1
ア ジ ア	217,655	2.0	106,035	1.2	111,620	4.5	510	0.3
中 南 米	1,180,008	10.6	97,863	1.1	1,082,144	43.5	110,000	58.5
中 東	—	—	—	—	—	—	—	—
ア フ リ カ	—	—	—	—	—	—	—	—
国 際 機 関	166,578	1.5	166,578	1.9	—	—	—	—
合 計	11,100,369	100.0	8,612,163	100.0	2,488,206	100.0	187,983	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おります。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おります。

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おります。

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と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おります。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おります。

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おります。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おります。

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おります。

(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	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

（単位：百万円）

区 分	2021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	48,742	△52,752	—	—	—	△4,009
ヘッジ会計非適用分	—	△16,141	—	—	—	△16,141
合 計	48,742	△68,893	—	—	—	△20,150

（注）ヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ適用分の差損益（2020年度末：通貨関連△227,340百万円、2021年度第2四半期（上半期）末：通貨関連△44,463百万円）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せん。

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	2020年度末				2021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
			1年以下	1年超				1年以下	1年超		
	金利スワップ										
	固定金利受取／変動金利支払	87,000	87,000	△1,320	△1,320	—	—	—	—	—	—
	合 計				△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		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

（単位：百万円、％）

区 分		2021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	—	—	—	—	—	—	—
	平均受取金利	—	—	—	—	—	—	—
	平均支払金利	—	—	—	—	—	—	—

○通貨関連

(単位:百万円)

区 分	2020年度末				2021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	826,158	—	△40,715	△40,715	1,130,707	—	△20,749	△20,749	
	米ドル	796,104	—	△37,867	△37,867	1,074,756	—	△23,379	△23,379	
	豪ドル	30,054	—	△2,847	△2,847	55,950	—	2,629	2,629	
	買建	—	—	—	—	244,473	—	94	94	
	米ドル	—	—	—	—	202,783	—	269	269	
	豪ドル	—	—	—	—	26,272	—	△101	△101	
	その他	—	—	—	—	15,416	—	△73	△73	
	通貨スワップ									
	円払/豪ドル受	78,660	78,660	7,315	7,315	86,020	86,020	3,348	3,348	
円払/米ドル受	8,280	8,280	507	507	25,180	25,180	1,165	1,165		
合 計				△32,892				△16,141		

(注)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。

○株式関連

区 分	2020年度末				2021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	株価指数オプション									
	買建 プット	99,981 (302)	—	214	△88	— (-)	—	—	—	—
合 計				△88				—		

(注) 1. 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

2020年度末および2021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	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

(単位:百万円)

ヘッジ会計の方法	種類	主なヘッジ対象	2021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	577,500	574,300	48,621
	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	3,069	3,069	121
	固定金利受取/変動金利支払				
合 計					48,742

【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		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

(単位:百万円、%)

区 分		2021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	3,200	7,269	9,300	7,400	8,300	545,100	580,569
	平均受取金利	1.62	1.69	1.77	2.03	2.15	0.84	0.90
	平均支払金利	△0.06	0.02	0.02	△0.06	△0.06	△0.06	△0.06

○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	2020年度末			2021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	4,283,029	—	△227,340	4,190,629	—	△44,463
	米ドル		3,107,080	—	△142,681	2,930,801	—	△62,509
	豪ドル		796,361	—	△67,254	842,139	—	9,905
	ユーロ		259,122	—	△13,256	277,986	—	7,251
	その他		120,465	—	△4,147	139,701	—	890
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	81,785	81,785	△5,406
	ユーロ		35,575	35,575	△3,013	35,575	35,575	△2,731
	豪ドル		12,404	12,404	△638	12,404	12,404	△151
合 計				△235,410			△52,752	

(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

2020年度末および2021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

2020年度末および2021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	2020年度末	2021年度 第2四半期(上半期)末
有 価 証 券	5,907,773	6,165,669
評 価 差 額	3,990,340	4,220,445
オ フ バ ラ ン ス	1,917,433	1,945,223
土 地	575,817	579,987
再 評 価 差 額	197,186	200,968
オ フ バ ラ ン ス	378,630	379,019
そ の 他	38,897	39,864
合 計	6,522,488	6,785,521

- (注) 1. 有価証券は、時価のある有価証券に加え、市場価格のない株式等および組合等(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(2020年度末:通貨関連△227,340百万円、2021年度第2四半期(上半期)末:通貨関連△44,463百万円)、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	2020年度末		2021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	47,454	8,964	47,981	△243

(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	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

(単位:百万円)

区 分	2021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	4	—	—	3
合 計	—	△0	4	—	—	3

(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

2020年度末および2021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	2020年度末				2021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	454	—	△4	△4	50	—	△0	△0	
	米ドル	349	—	△5	△5	—	—	—	—	
	ユーロ	105	—	0	0	50	—	△0	△0	
	買建	—	—	—	—	49	—	0	0	
	カナダ・ドル	—	—	—	—	49	—	0	0	
合 計				△4					△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		2020年度末			2021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								
	売建	321	—	△10	△10	187	—	4	4
	買建	—	—	—	—	20	—	△0	△0
	外国株価指数先物								
	売建	539	—	△1	△1	—	—	—	—
合 計					△12				4

(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

2020年度末および2021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

2020年度末および2021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

2020年度末および2021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

2020年度末および2021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

2020年度末および2021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	2020年度末		2021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	168,035	△6,282	141,999	△5,494

(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

2020年度末および2021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

2020年度末および2021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

2020年度末および2021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

2020年度末および2021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

2020年度末および2021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

2020年度末および2021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

2020年度末および2021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

2020年度末および2021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(2021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	1,015,287	2.4	1,004,668	2.4
買現先勘定	—	—	—	—
債券貸借取引支払保証金	—	—	—	—
買入金銭債権	248,100	0.6	248,100	0.6
商品有価証券	—	—	—	—
金銭の信託	157,065	0.4	157,065	0.4
有価証券	36,045,395	84.0	35,394,510	83.8
公 社 債	18,520,542	43.2	18,317,655	43.4
株 式	4,908,285	11.4	4,834,681	11.5
外 国 証 券	11,303,442	26.4	11,100,369	26.3
公 社 債	8,731,254	20.4	8,612,163	20.4
株 式 等	2,572,187	6.0	2,488,206	5.9
その他の証券	1,313,125	3.1	1,141,804	2.7
貸付金	4,000,158	9.3	4,000,158	9.5
保険約款貸付	199,547	0.5	199,547	0.5
一般貸付	3,800,611	8.9	3,800,611	9.0
不動産	866,855	2.0	866,855	2.1
繰延税金資産	—	—	—	—
その他	565,375	1.3	550,416	1.3
貸倒引当金	△6,690	△0.0	△6,690	△0.0
合 計	42,891,546	100.0	42,215,082	100.0
うち外貨建資産	11,968,889	27.9	11,763,881	27.9

(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2020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	△220,809		△213,074	
買現先勘定	—		—	
債券貸借取引支払保証金	—		—	
買入金銭債権	△16,084		△16,084	
商品有価証券	—		—	
金銭の信託	2,442		2,442	
有価証券	662,575		690,262	
公 社 債	154,404		163,788	
株 式	194,551		192,949	
外 国 証 券	448,773		443,516	
公 社 債	260,537		260,290	
株 式 等	188,236		183,226	
その他の証券	△135,154		△109,991	
貸付金	△95,564		△95,564	
保険約款貸付	△8,228		△8,228	
一般貸付	△87,335		△87,335	
不動産	1,122		1,122	
繰延税金資産	—		—	
その他	△127,500		△135,247	
貸倒引当金	146		146	
合 計	206,328		234,003	
うち外貨建資産	504,174		500,734	

(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(2021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	2020年度末		2021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	678,573	45,148	650,885	△3,226
一般勘定	—	—	—	—
特別勘定	678,573	45,148	650,885	△3,226

(2) 有価証券の時価情報 (売買目的有価証券以外)

(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

(単位:百万円)

区 分	2021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	3,814,548	4,445,309	630,760	630,793	△32
責任準備金対応債券	11,623,236	12,982,933	1,359,696	1,394,980	△35,283
子会社株式及び関連会社株式	—	—	—	—	—
その他の有価証券	15,258,671	19,478,420	4,219,749	4,310,571	△90,822
公 社 債	4,021,875	4,344,180	322,305	322,959	△654
株 式	1,594,209	4,738,337	3,144,127	3,170,336	△26,209
外 国 証 券	8,427,964	9,043,365	615,400	666,665	△51,264
公 社 債	6,944,674	7,328,078	383,403	432,560	△49,157
株 式 等	1,483,289	1,715,287	231,997	234,104	△2,107
その他の証券	944,087	1,077,601	133,513	146,200	△12,686
買入金銭債権	67,379	67,875	496	500	△3
譲渡性預金	50,000	49,995	△4	—	△4
金銭の信託	153,155	157,065	3,909	3,909	—
合 計	30,696,456	36,906,662	6,210,206	6,336,345	△126,138
公 社 債	17,995,350	20,249,447	2,254,097	2,271,318	△17,220
株 式	1,594,209	4,738,337	3,144,127	3,170,336	△26,209
外 国 証 券	9,712,049	10,373,642	661,593	731,584	△69,991
公 社 債	8,228,759	8,658,355	429,596	497,480	△67,884
株 式 等	1,483,289	1,715,287	231,997	234,104	△2,107
その他の証券	944,087	1,077,601	133,513	146,200	△12,686
買入金銭債権	247,603	260,573	12,969	12,995	△26
譲渡性預金	50,000	49,995	△4	—	△4
金銭の信託	153,155	157,065	3,909	3,909	—

(注) 1. 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。

2. 市場価格のない株式等および組合等は本表から除いています。

ア. 満期保有目的の債券

(単位:百万円)

区 分	2020年度末			2021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	3,904,720	4,549,415	644,694	3,802,548	4,433,341	630,793
公 社 債	3,637,897	4,268,299	630,402	3,544,973	4,159,148	614,174
外 国 証 券	89,349	94,174	4,824	81,349	85,473	4,123
買 入 金 銭 債 権	177,473	186,940	9,467	176,224	188,720	12,495
時価が貸借対照表計上額を 超えないもの	10,991	10,898	△93	12,000	11,967	△32
公 社 債	2,991	2,991	△0	—	—	—
外 国 証 券	—	—	—	8,000	7,989	△10
買 入 金 銭 債 権	8,000	7,906	△93	4,000	3,977	△22

イ. 責任準備金対応債券

(単位:百万円)

区 分	2020年度末			2021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	8,286,040	9,656,850	1,370,809	9,182,539	10,577,520	1,394,980
公 社 債	7,654,986	8,973,878	1,318,891	8,404,268	9,738,452	1,334,184
外 国 証 券	631,053	682,972	51,918	778,271	839,067	60,796
時価が貸借対照表計上額を 超えないもの	2,362,482	2,311,115	△51,367	2,440,696	2,405,413	△35,283
公 社 債	1,926,336	1,905,844	△20,492	2,024,233	2,007,666	△16,566
外 国 証 券	436,146	405,271	△30,874	416,463	397,746	△18,716

ウ. その他有価証券

(単位:百万円)

区 分	2020年度末			2021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	12,913,377	17,018,214	4,104,837	12,897,567	17,208,138	4,310,571
公 社 債	4,495,430	4,828,182	332,752	3,921,555	4,244,514	322,959
株 式	1,408,942	4,410,200	3,001,258	1,351,609	4,521,946	3,170,336
外 国 証 券	6,272,606	6,923,320	650,714	6,654,186	7,320,851	666,665
そ の 他 の 証 券	687,471	802,022	114,551	809,678	955,878	146,200
買 入 金 銭 債 権	8,126	8,721	595	7,382	7,882	500
譲 渡 性 預 金	—	—	—	—	—	—
金 銭 の 信 託	40,800	45,766	4,965	153,155	157,065	3,909
貸借対照表計上額が帳簿価額を 超えないもの	2,783,725	2,668,502	△115,222	2,361,103	2,270,281	△90,822
公 社 債	104,911	103,472	△1,439	100,319	99,665	△654
株 式	160,982	139,151	△21,831	242,600	216,390	△26,209
外 国 証 券	1,876,085	1,804,093	△71,991	1,773,778	1,722,513	△51,264
そ の 他 の 証 券	408,671	389,944	△18,726	134,408	121,722	△12,686
買 入 金 銭 債 権	69,996	69,990	△5	59,996	59,992	△3
譲 渡 性 預 金	53,000	52,995	△4	50,000	49,995	△4
金 銭 の 信 託	110,079	108,855	△1,223	—	—	—

・ 市場価格のない株式等および組合等の帳簿価額は以下のとおりです。

(単位:百万円)

区 分	2020年度末	2021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	876,895	879,114
そ の 他 の 有 価 証 券	47,475	53,655
非 上 場 国 内 株 式	27,698	31,663
非 上 場 外 国 株 式	4,126	4,126
そ の 他 外 国 証 券	98	88
そ の 他	15,552	17,776
合 計	924,371	932,770

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	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

(単位:百万円)

区 分	2021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	48,742	△52,752	—	—	—	△4,009
ヘッジ会計非適用分	—	△16,387	△72	△12	—	△16,472
合 計	48,742	△69,140	△72	△12	—	△20,481

(注) ヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ適用分の差損益(2020年度末:通貨関連△227,340百万円、2021年度第2四半期(上半期)末:通貨関連△44,463百万円)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	2020年度末				2021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	87,000	87,000	△1,320	△1,320	—	—	—	—
	合 計			△1,320	△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		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

(単位:百万円、%)

区 分		2021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	—	—	—	—	—	—	—
	平均受取金利	—	—	—	—	—	—	—
	平均支払金利	—	—	—	—	—	—	—

○通貨関連

(単位:百万円)

区 分	2020年度末				2021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	為替予約									
	売建	898,760	—	△40,836	△40,836	1,211,761	—	△21,052	△21,052	
	米ドル	821,769	—	△38,179	△38,179	1,105,764	—	△23,840	△23,840	
	豪ドル	54,482	—	△2,721	△2,721	83,415	—	2,714	2,714	
	ユーロ	22,427	—	64	64	22,481	—	73	73	
	その他	80	—	△0	△0	99	—	△0	△0	
	頭	買建	5,775	—	31	31	253,508	—	150	150
		米ドル	3,502	—	35	35	207,330	—	324	324
		豪ドル	712	—	△2	△2	28,128	—	△97	△97
		ユーロ	1,536	—	△2	△2	2,325	—	△4	△4
その他		24	—	0	0	15,723	—	△72	△72	
通貨スワップ										
円払/豪ドル受	78,660	78,660	7,315	7,315	86,020	86,020	3,348	3,348		
円払/米ドル受	8,280	8,280	507	507	25,180	25,180	1,165	1,165		
合 計				△32,982				△16,387		

(注) 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。

○株式関連

(単位:百万円)

区 分	2020年度末				2021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	2,140	—	△67	△67	2,060	—	9	9
	買建	4,656	—	33	33	4,586	—	△58	△58
	外国株価指数先物								
	売建	539	—	△1	△1	2,662	—	87	87
	買建	4,840	—	32	32	3,471	—	△110	△110
株価指数オプション									
買建									
プット	99,981	—	214	△88	(-)	—	—	—	
合 計				△91				△72	

(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	2020年度末				2021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							
買建	803	—	△8	△8	802	—	△12	△12
合 計				△8				△12

(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	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

(単位:百万円)

ヘッジ会計の方法	種類	主なヘッジ対象	2021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	577,500	574,300	48,621
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	3,069	3,069	121
合 計					48,742

【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		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

(単位:百万円、%)

区 分		2021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	3,200	7,269	9,300	7,400	8,300	545,100	580,569
	平均受取金利	1.62	1.69	1.77	2.03	2.15	0.84	0.90
	平均支払金利	△0.06	0.02	0.02	△0.06	△0.06	△0.06	△0.06

○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	2020年度末			2021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	4,283,029	—	△227,340	4,190,629	—	△44,463
	米ドル		3,107,080	—	△142,681	2,930,801	—	△62,509
	豪ドル		796,361	—	△67,254	842,139	—	9,905
	ユーロ		259,122	—	△13,256	277,986	—	7,251
	その他		120,465	—	△4,147	139,701	—	890
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	81,785	81,785	△5,406
	ユーロ		35,575	35,575	△3,013	35,575	35,575	△2,731
	豪ドル		12,404	12,404	△638	12,404	12,404	△151
合計				△235,410			△52,752	

(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

2020年度末および2021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

2020年度末および2021年度第2四半期(上半期)末とも保有していません。