

2020年度上半期報告 補足資料

< 目 次 >

I. 一般勘定

1. 有価証券関係	
(1) 有価証券明細表	…… 1 頁
(2) 有価証券残存期間別残高	…… 1 頁
(3) 業種別株式保有明細表	…… 2 頁
(4) デリバティブ取引の時価情報	…… 3 頁
2. 貸付金関係	
(1) 貸付金明細表	…… 6 頁
(2) 貸付金残存期間別残高	…… 6 頁
(3) 国内企業向け貸付金企業規模別内訳	…… 7 頁
(4) 貸付金業種別内訳	…… 8 頁
(5) 貸付金地域別内訳	…… 9 頁
(6) 貸付金担保別内訳	…… 9 頁
3. 海外投融資関係	
(1) 資産別明細	…… 10 頁
(2) 外貨建資産の通貨別構成	…… 11 頁
(3) 海外投融資の地域別構成	…… 11 頁

II. 個人変額保険・個人変額年金保険特別勘定

1. 売買目的有価証券の評価損益	…… 12 頁
2. 有価証券の時価情報	…… 12 頁
3. 金銭の信託の時価情報	…… 12 頁
4. デリバティブ取引の時価情報	…… 13 頁

III. 会社計

1. 売買目的有価証券の評価損益	…… 15 頁
2. 有価証券の時価情報	…… 15 頁
3. 金銭の信託の時価情報	…… 17 頁
4. デリバティブ取引の時価情報	…… 18 頁

IV. その他

1. 資産査定状況等	…… 20 頁
2. 土地の時価情報	…… 21 頁

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年度上半期末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
国 債	2,423,540	44.6	2,446,615	43.2
地 方 債	173,099	3.2	177,407	3.1
社 債	642,311	11.8	659,156	11.6
うち公社・公団債	349,899	6.4	348,267	6.2
株 式	287,233	5.3	314,572	5.6
外 国 証 券	1,779,132	32.7	1,914,188	33.8
公 社 債	1,654,149	30.4	1,777,192	31.4
株 式 等	124,982	2.3	136,995	2.4
そ の 他 の 証 券	133,370	2.5	147,936	2.6
合 計	5,438,687	100.0	5,659,877	100.0

(2) 有価証券残存期間別残高

(単位：百万円)

2019年度末							
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
有 価 証 券	65,321	211,519	301,352	244,726	729,845	3,885,922	5,438,687
国 債	24,800	107,828	88,214	29,106	137,150	2,036,438	2,423,540
地 方 債	—	6,122	16,003	2,698	62,350	85,924	173,099
社 債	2,929	38,578	91,955	49,587	175,342	283,917	642,311
株 式	—	—	—	—	—	287,233	287,233
外 国 証 券	37,591	58,989	105,179	163,333	355,001	1,059,037	1,779,132
公 社 債	37,591	58,989	105,179	163,333	355,001	934,054	1,654,149
株 式 等	—	—	—	—	—	124,982	124,982
そ の 他 の 証 券	—	—	—	—	—	133,370	133,370
買 入 金 銭 債 権	—	—	—	—	—	8,487	8,487
譲 渡 性 預 金	62,000	—	—	—	—	—	62,000
合 計	127,321	211,519	301,352	244,726	729,845	3,894,410	5,509,175
2020年度上半期末							
有 価 証 券	95,801	262,612	242,516	330,915	822,968	3,905,063	5,659,877
国 債	33,956	107,468	82,267	19,893	171,627	2,031,402	2,446,615
地 方 債	—	14,092	10,167	439	62,330	90,377	177,407
社 債	7,128	63,859	73,738	64,243	165,644	284,542	659,156
株 式	—	—	—	—	—	314,572	314,572
外 国 証 券	54,716	77,192	76,343	246,338	423,366	1,036,230	1,914,188
公 社 債	54,716	77,192	76,343	246,338	423,366	899,234	1,777,192
株 式 等	—	—	—	—	—	136,995	136,995
そ の 他 の 証 券	—	—	—	—	—	147,936	147,936
買 入 金 銭 債 権	—	—	—	—	—	8,162	8,162
譲 渡 性 預 金	54,000	—	—	—	—	—	54,000
合 計	149,801	262,612	242,516	330,915	822,968	3,913,225	5,722,040

(注) 「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号)に基づく有価証券として取り扱うものを含んでいます。

(3) 業種別株式保有明細表

(単位：百万円、%)

区 分		2019年度末		2020年度上半期末	
		金 額	占 率	金 額	占 率
水 産 ・ 農 林 業		—	—	—	—
鉱 業		618	0.2	631	0.2
建 設 業		12,269	4.3	12,364	3.9
製 造 業	食 料 品	16,045	5.6	16,624	5.3
	織 維 製 品	18,318	6.4	18,191	5.8
	パ ル プ ・ 紙	10,171	3.5	9,675	3.1
	化 学	25,030	8.7	30,366	9.7
	医 薬 品	13	0.0	13	0.0
	石 油 ・ 石 炭 製 品	3,504	1.2	3,798	1.2
	ゴ ム 製 品	30	0.0	30	0.0
	ガ ラ ス ・ 土 石 製 品	2,556	0.9	3,419	1.1
	鉄 鋼	535	0.2	526	0.2
	非 鉄 金 属	4,404	1.5	4,919	1.6
	金 属 製 品	991	0.3	1,441	0.5
	機 械	9,856	3.4	12,374	3.9
	電 気 機 器	24,577	8.6	31,466	10.0
	輸 送 用 機 器	48,748	17.0	53,644	17.1
	精 密 機 器	1,212	0.4	1,531	0.5
	そ の 他 製 品	5,296	1.8	4,976	1.6
電 気 ・ ガ ス 業		5,071	1.8	4,966	1.6
運 輸 ・ 情 報 通 信 業	陸 運 業	14,270	5.0	13,663	4.3
	海 運 業	1,953	0.7	2,223	0.7
	空 運 業	77	0.0	77	0.0
	倉 庫 ・ 運 輸 関 連 業	2,399	0.8	3,095	1.0
	情 報 ・ 通 信 業	191	0.1	208	0.1
商 業	卸 売 業	31,049	10.8	37,063	11.8
	小 売 業	9,542	3.3	8,126	2.6
金 融 ・ 保 険 業	銀 行 業	10,528	3.7	11,247	3.6
	証 券 、 商 品 先 物 取 引 業	3,648	1.3	3,763	1.2
	保 険 業	3,159	1.1	3,084	1.0
	そ の 他 金 融 業	4,278	1.5	4,479	1.4
不 動 産 業		14,658	5.1	14,265	4.5
サ ー ビ ス 業		2,221	0.8	2,311	0.7
合 計		287,233	100.0	314,572	100.0

(4) デリバティブ取引の時価情報 (ヘッジ会計適用・非適用分の合算値：一般勘定)

①差損益の内訳 (ヘッジ会計適用分・非適用分の内訳)

(単位：百万円)

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	13	—	—	—	—	13
ヘッジ会計非適用分	—	72	125	—	—	198
合計	13	72	125	—	—	211
2020年度上半期末						
	金利関連	通貨関連	株式関連	債券関連	その他	合計
ヘッジ会計適用分	9	—	—	—	—	9
ヘッジ会計非適用分	—	△4,368	△14	—	—	△4,382
合計	9	△4,368	△14	—	—	△4,373

(注) ヘッジ会計非適用分の差損益については、損益計算書に計上しています。

②金利関連

(単位：百万円)

区分	種類	2019年度末				2020年度上半期末			
		契約額等	うち1年超	時価	差損益	契約額等	うち1年超	時価	差損益
店頭	金利スワップ								
	固定金利受取／変動金利支払	2,123	1,060	13	13	1,060	200	9	9
	固定金利支払／変動金利受取	—	—	—	—	—	—	—	—
	変動金利受取／変動金利支払	—	—	—	—	—	—	—	—
合計					13				9

(注) 差損益欄には、時価を記載しています。

(参考) 金利スワップ残存期間別残高

(単位：百万円、%)

2019年度末							
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	合計
受取側固定スワップ想定元本	1,063	860	200	—	—	—	2,123
平均受取固定金利	0.96	0.80	1.43	—	—	—	0.94
平均支払変動金利	0.48	0.48	0.58	—	—	—	0.49
支払側固定スワップ想定元本	—	—	—	—	—	—	—
平均受取変動金利	—	—	—	—	—	—	—
平均支払固定金利	—	—	—	—	—	—	—
支払／受取共に変動スワップ想定元本	—	—	—	—	—	—	—
平均受取変動金利	—	—	—	—	—	—	—
平均支払変動金利	—	—	—	—	—	—	—
合計	1,063	860	200	—	—	—	2,123
2020年度上半期末							
受取側固定スワップ想定元本	860	200	—	—	—	—	1,060
平均受取固定金利	0.80	1.43	—	—	—	—	0.92
平均支払変動金利	0.48	0.58	—	—	—	—	0.50
支払側固定スワップ想定元本	—	—	—	—	—	—	—
平均受取変動金利	—	—	—	—	—	—	—
平均支払固定金利	—	—	—	—	—	—	—
支払／受取共に変動スワップ想定元本	—	—	—	—	—	—	—
平均受取変動金利	—	—	—	—	—	—	—
平均支払変動金利	—	—	—	—	—	—	—
合計	860	200	—	—	—	—	1,060

③通貨関連

(単位：百万円)

区分	種類	2019年度末				2020年度上半期末			
		契約額等	うち1年超	時価	差損益	契約額等	うち1年超	時価	差損益
店頭	為替予約 売 建	927,385	—	832	832	927,132	—	△4,476	△4,476
	米ドル	256,979	—	△1,595	△1,595	237,400	—	2,216	2,216
	ユーロ	670,406	—	2,427	2,427	681,618	—	△6,810	△6,810
	その他の通貨	—	—	—	—	8,112	—	117	117
	通貨スワップ	5,700	5,700	△759	△759	5,700	5,700	108	108
	円払／豪ドル受	5,700	5,700	△759	△759	5,700	5,700	108	108
	合 計				72				△4,368

- (注) 1. 各期末の為替相場は先物相場を使用しています。
2. 外貨建金銭債権債務等に先物為替予約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ている外貨建金銭債権債務等で、貸借対照表において当該円貨額で表示されているものについては、開示の対象から除いています。
3. 差損益欄には、時価を記載しています。

④株式関連

(単位：百万円)

区分	種類	2019年度末				2020年度上半期末			
		契約額等	うち1年超	時価	差損益	契約額等	うち1年超	時価	差損益
店頭	株価指数先渡 売 建	1,876	—	125	125	2,014	—	△14	△14
	合 計				125				△14

(注) 差損益欄には、時価を記載しています。

⑤債券関連

2019年度末、2020年度上半期末ともに該当する残高はありません。

⑥その他

2019年度末、2020年度上半期末ともに該当する残高はありません。

デリバティブ取引のリスク管理等

（１）利用目的

当社では、主に資産または負債のリスクヘッジを目的にデリバティブ取引を行っています。

資産の安定的な運用のため現物資産に係る市場リスクなどのヘッジやコントロール、個人変額保険・個人変額年金保険に係る最低保証リスク（最低保証に関する責任準備金の変動による期間損益の変動リスク）の軽減を目的として利用しています。

（２）取引の内容

運用対象としているデリバティブ取引は以下の通りです。

- ① 株式関連 国内外株価指数先物取引・国内外株価指数オプション取引・個別株券オプション取引等
- ② 債券関連 国内債券先物取引・国内外債券オプション取引
- ③ 通貨関連 先物為替予約取引・通貨オプション取引・通貨スワップ取引
- ④ 金利関連 金利スワップ取引

（３）リスクの内容

デリバティブ取引のリスクには、市場関連リスクと信用リスク並びに事務リスク・法務リスクがあります。

① 市場関連リスクについて

市場リスクにはヘッジ対象である株式、債券、通貨の価格変動や金利変動によってもたらされるリスクに加えて、オプション取引に見られるような市場変動性（ボラティリティ）など、デリバティブ固有のリスクも含まれています。

従って、市場リスクについては現物資産と合わせたポジション管理を行うと同時にデリバティブ取引そのもののリスクのモニタリングも行っています。

② 信用リスクについて

デリバティブ取引に付随する取引相手先のデフォルト（債務不履行）により、デリバティブ・ポジションから期待する経済効果を得られない信用リスクについて認識し、管理しています。

③ 事務リスク・法務リスクについて

当社のデリバティブ取引実行に際しては取引実行部門と独立した事務管理部門が取引先の管理部門と照合を行うなど、相互牽制機能が働く体制としています。また、取引開始に際しては契約書の内容精査など法務リスクに配慮し、状況に応じて弁護士など専門家の意見を聴取するなどの対応を行っています。

（４）リスク管理体制

当社では取引実行部門とリスク管理担当部門を分離独立させ、相互牽制機能が発揮できる体制を確立しています。

具体的な管理・報告体制は以下の通りです。

- ① 価格変動リスクのモニタリングとリスク管理担当への報告
- ② 価格変動リスクのモニタリングとリスク管理責任者への報告
- ③ 市場関連リスク管理分会、信用リスク管理分会への報告
- ④ リスク管理会議への報告
- ⑤ 経営会議、取締役会への報告
- ⑥ 監査部門による規定遵守状況確認

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年度上半期末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
保 険 約 款 貸 付	42,207	4.2	40,441	4.1
保 険 料 振 替 貸 付	5,209	0.5	4,923	0.5
契 約 者 貸 付	36,998	3.7	35,517	3.6
一 般 貸 付	961,217	95.8	949,052	95.9
(うち非居住者貸付)	—	—	—	—
企 業 貸 付	814,327	81.2	802,279	81.1
(うち国内企業向け)	(814,204)	(81.1)	(802,188)	(81.1)
国・国際機関・政府関係機関貸付	189	0.0	151	0.0
公 共 団 体 ・ 公 企 業 貸 付	28,239	2.8	28,034	2.8
住 宅 ロ ー ン	21,102	2.1	19,145	1.9
消 費 者 ロ ー ン	96,854	9.7	98,967	10.0
そ の 他	505	0.1	475	0.0
合 計	1,003,425	100.0	989,493	100.0

(2) 貸付金残存期間別残高

(単位：百万円)

2019年度末							
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
変動金利	9,491	1,160	686	569	2,308	21,506	35,724
固定金利	60,929	186,267	141,107	164,148	127,204	245,835	925,492
一般貸付計	70,421	187,428	141,793	164,718	129,512	267,341	961,217
2020年度上半期末							
変動金利	4,294	452	533	2,056	771	19,605	27,714
固定金利	61,542	184,258	160,182	133,328	153,741	228,282	921,337
一般貸付計	65,837	184,711	160,716	135,385	154,513	247,888	949,052

(3) 国内企業向け貸付金企業規模別内訳

(単位：件、百万円、%)

区 分		2019年度末		2020年度上半期末	
			占 率		占 率
大 企 業	貸付先数	88	72.1	82	71.9
	金 額	745,335	91.5	733,986	91.5
中 堅 企 業	貸付先数	1	0.8	1	0.9
	金 額	500	0.1	500	0.1
中 小 企 業	貸付先数	33	27.0	31	27.2
	金 額	68,369	8.4	67,701	8.4
国内企業向け 貸 付 計	貸付先数	122	100.0	114	100.0
	金 額	814,204	100.0	802,188	100.0

(注) 1. 業種の区分は以下のとおりです。

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	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	

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。

(4) 貸付金業種別内訳

(单位:百万円、%)

区 分		2019年度末		2020年度上半期末		
		金 額	占 率	金 額	占 率	
国 内	製 造 業	117,505	12.2	108,000	11.4	
	食 料	4,500	0.5	4,000	0.4	
	織 維	—	—	—	—	
	木 材 ・ 木 製 品	—	—	—	—	
	パ ル プ ・ 紙	36,000	3.7	33,500	3.5	
	印 刷	—	—	—	—	
	化 学	14,360	1.5	14,178	1.5	
	石 油 ・ 石 炭	21,310	2.2	21,310	2.2	
	窯 業 ・ 土 石	4,738	0.5	4,516	0.5	
	鉄 鋼	3,000	0.3	3,000	0.3	
	非 鉄 金 属 製 品	6,082	0.6	5,826	0.6	
	金 属 製 品	—	—	—	—	
	はん 用 ・ 生 産 用 ・ 業 務 用 機 械	1,177	0.1	1,161	0.1	
	電 気 機 械	7,100	0.7	6,550	0.7	
	輸 送 用 機 械	19,146	2.0	13,883	1.5	
	そ の 他 の 製 造 業	91	0.0	75	0.0	
	向 け	農 業 、 林 業	—	—	—	—
		漁 業	—	—	—	—
		鉱 業 、 採 石 業 、 砂 利 採 取 業	47	0.0	38	0.0
建 設 業		3,504	0.4	3,430	0.4	
電 気 ・ ガ ス ・ 熱 供 給 ・ 水 道 業		89,625	9.3	87,501	9.2	
情 報 通 信 業		24,100	2.5	24,100	2.5	
運 輸 業 、 郵 便 業		39,605	4.1	38,871	4.1	
卸 売 業		225,117	23.4	232,112	24.5	
小 売 業		500	0.1	500	0.1	
金 融 業 、 保 険 業		231,624	24.1	225,952	23.8	
不 動 産 業		95,319	9.9	96,727	10.2	
物 品 賃 貸 業		10,968	1.1	8,638	0.9	
学 術 研 究 、 専 門 ・ 技 術 サ ー ビ ス 業		—	—	—	—	
宿 泊 業		28	0.0	21	0.0	
飲 食 業		—	—	—	—	
生 活 関 連 サ ー ビ ス 業 、 娛 楽 業		—	—	—	—	
教 育 、 学 習 支 援 業		—	—	—	—	
医 療 ・ 福 祉		505	0.1	475	0.1	
そ の 他 の サ ー ビ ス		47	0.0	44	0.0	
地 方 公 共 団 体		4,639	0.5	4,434	0.5	
個 人 （ 住 宅 ・ 消 費 ・ 納 税 資 金 等 ）	117,956	12.3	118,112	12.4		
そ の 他	122	0.0	90	0.0		
合 計		961,217	100.0	949,052	100.0	
海 外 向 け	政 府 等	—	—	—	—	
	金 融 機 関 等	—	—	—	—	
	商 工 業 等	—	—	—	—	
合 計		—	—	—	—	
一 般 貸 付 計		961,217	100.0	949,052	100.0	

(5) 貸付金地域別内訳

(単位：百万円、%)

区 分	2019年度末		2020年度上半期末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
北 海 道	6,500	0.8	6,500	0.8
東 北	6,476	0.8	6,476	0.8
関 東	682,055	80.9	674,669	81.2
中 部	105,352	12.5	100,202	12.1
近 畿	23,646	2.8	24,973	3.0
中 国	2,230	0.3	2,190	0.3
四 国	3,500	0.4	3,500	0.4
九 州	13,498	1.6	12,428	1.5
合 計	843,260	100.0	830,939	100.0

- (注) 1. 住宅ローン、消費者ローン、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年度上半期末	
		金 額	占 率	金 額	占 率
担 保 貸 付		740	0.1	674	0.1
	有 価 証 券 担 保 貸 付	—	—	—	—
	不 動 産 ・ 動 産 ・ 財 団 担 保 貸 付	740	0.1	674	0.1
	指 名 債 権 担 保 貸 付	—	—	—	—
保 証 貸 付		4,525	0.5	3,639	0.4
信 用 貸 付		837,994	87.2	826,625	87.1
そ の 他		117,956	12.3	118,112	12.4
一 般 貸 付 計		961,217	100.0	949,052	100.0
	う ち 劣 後 特 約 付 貸 付	178,000	18.5	178,000	18.8

3. 海外投融資関係

(1) 資産別明細

①外貨建資産

(単位：百万円、%)

区 分	2019年度末		2020年度上半期末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
公 社 債	1,839,735	83.1	1,980,747	82.5
株 式	—	—	—	—
現 預 金 ・ そ の 他	215,486	9.7	249,484	10.4
小 計	2,055,221	92.9	2,230,232	92.9

②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年度上半期末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
公 社 債	—	—	—	—
現 預 金 ・ そ の 他	40,929	1.8	40,989	1.7
小 計	40,929	1.8	40,989	1.7

③円貨建資産

(単位：百万円、%)

区 分	2019年度末		2020年度上半期末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
非 居 住 者 貸 付	—	—	—	—
公 社 債 (円 建 外 債) ・ そ の 他	116,727	5.3	130,105	5.4
小 計	116,727	5.3	130,105	5.4

④合 計

(単位：百万円、%)

区 分	2019年度末		2020年度上半期末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
海 外 投 融 資	2,212,879	100.0	2,401,327	100.0

※ 「円貨額が確定した外貨建資産」は、為替予約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価額としているものです。

(2) 外貨建資産の通貨別構成

(単位：百万円、%)

区 分	2019年度末		2020年度上半期末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
豪 ド ル	631,554	30.7	761,539	34.1
ユ ー ロ	711,025	34.6	757,464	34.0
米 ド ル	712,619	34.7	711,199	31.9
ス イ ス フ ラ ン	17	0.0	21	0.0
そ の 他	4	0.0	6	0.0
合 計	2,055,221	100.0	2,230,232	100.0

(3) 海外投融資の地域別構成

(単位：百万円、%)

2019年度末									
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	
北 米	450,527	25.3	444,444	26.9	6,082	4.9	—	—	
ヨ ー ロ ッ パ	881,561	49.6	767,561	46.4	113,999	91.2	—	—	
オ セ ア ニ ア	289,226	16.3	289,226	17.5	—	—	—	—	
ア ジ ア	4,900	0.3	—	—	4,900	3.9	—	—	
中 南 米	—	—	—	—	—	—	—	—	
中 東	—	—	—	—	—	—	—	—	
ア フ リ カ	—	—	—	—	—	—	—	—	
国 際 機 関	152,917	8.6	152,917	9.2	—	—	—	—	
合 計	1,779,132	100.0	1,654,149	100.0	124,982	100.0	—	—	
2020年度上半期末									
北 米	430,250	22.5	422,360	23.8	7,889	5.8	—	—	
ヨ ー ロ ッ パ	953,098	49.8	829,098	46.7	123,999	90.5	—	—	
オ セ ア ニ ア	347,006	18.1	347,006	19.5	—	—	—	—	
ア ジ ア	5,106	0.3	—	—	5,106	3.7	—	—	
中 南 米	—	—	—	—	—	—	—	—	
中 東	—	—	—	—	—	—	—	—	
ア フ リ カ	—	—	—	—	—	—	—	—	
国 際 機 関	178,726	9.3	178,726	10.1	—	—	—	—	
合 計	1,914,188	100.0	1,777,192	100.0	136,995	100.0	—	—	

Ⅱ．個人変額保険・個人変額年金保険特別勘定

1．売買目的有価証券の評価損益

(個人変額保険)

(単位：百万円)

区 分	2019年度末		2020年度上半期末	
	貸借対照表 計上額	当期の損益に含まれた 評価損益	貸借対照表 計上額	当期の損益に含まれた 評価損益
売買目的有価証券	56,453	△5,152	61,992	4,898
公社債	18,955	△341	21,135	△100
株式	18,088	△2,312	19,041	2,549
外国証券	15,468	△2,267	17,590	2,087
公社債	6,919	285	7,041	72
株式等	8,548	△2,552	10,548	2,015
その他の証券	3,940	△232	4,225	361

(注) 「当期の損益に含まれた評価損益」には振戻損益を含んでいます。

(個人変額年金保険)

(単位：百万円)

区 分	2019年度末		2020年度上半期末	
	貸借対照表 計上額	当期の損益に含まれた 評価損益	貸借対照表 計上額	当期の損益に含まれた 評価損益
売買目的有価証券	18,730	△1,272	19,162	733
公社債	10,337	△186	10,581	△60
株式	3,114	△410	3,241	424
外国証券	2,379	△458	2,716	335
公社債	1,016	36	1,034	11
株式等	1,362	△494	1,682	323
その他の証券	2,900	△217	2,621	34

(注) 「当期の損益に含まれた評価損益」には振戻損益を含んでいます。

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）

(個人変額保険)

2019年度末、2020年度上半期末ともに該当する残高はありません。

(個人変額年金保険)

2019年度末、2020年度上半期末ともに該当する残高はありません。

3．金銭の信託の時価情報

(個人変額保険)

2019年度末、2020年度上半期末ともに該当する残高はありません。

(個人変額年金保険)

2019年度末、2020年度上半期末ともに該当する残高はありません。

4. デリバティブ取引の時価情報

(ヘッジ会計適用・非適用分の合算値：個人変額保険・個人変額年金保険特別勘定)

【個人変額保険】

(1) 差損益の内訳 (ヘッジ会計適用分・非適用分の内訳)

2019年度末、2020年度上半期末ともに該当はありません。

(2) 金利関連

2019年度末、2020年度上半期末ともに該当する残高はありません。

(3) 通貨関連

2019年度末、2020年度上半期末ともに該当する残高はありません。

(4) 株式関連

2019年度末、2020年度上半期末ともに該当する残高はありません。

(5) 債券関連

2019年度末、2020年度上半期末ともに該当する残高はありません。

(6) その他

2019年度末、2020年度上半期末ともに該当する残高はありません。

【個人変額年金保険】

(1) 差損益の内訳（ヘッジ会計適用分・非適用分の内訳）

2019年度末、2020年度上半期末ともに該当はありません。

(2) 金利関連

2019年度末、2020年度上半期末ともに該当する残高はありません。

(3) 通貨関連

2019年度末、2020年度上半期末ともに該当する残高はありません。

(4) 株式関連

2019年度末、2020年度上半期末ともに該当する残高はありません。

(5) 債券関連

2019年度末、2020年度上半期末ともに該当する残高はありません。

(6) その他

2019年度末、2020年度上半期末ともに該当する残高はありません。

Ⅲ．会社計

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	164,911	△12,828	183,215	12,494
公 社 債	80,057	△1,342	87,753	△353
株 式	39,333	△5,234	41,879	6,090
外 国 証 券	38,680	△5,801	46,734	6,361
公 社 債	14,834	532	15,909	234
株 式 等	23,846	△6,334	30,825	6,127
そ の 他 の 証 券	6,840	△449	6,847	395

(注) 「当期の損益に含まれた評価損益」には振戻損益を含んでいます。

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	(時価－帳簿価額)		損益計算書 計上後価額	差 損 益	(時価－損益計算書計上後価額)	
					差益	差損			差益	差損
	満期保有目的の債券	4,511	4,930	419	419	－	4,511	419	419	－
	公 社 債	1,983	2,167	184	184	－	1,983	184	184	－
	買 入 金 銭 債 権	2,528	2,762	234	234	－	2,528	234	234	－
	責任準備金対応債券	2,257,783	2,630,588	372,805	380,412	7,607	2,239,352	391,236	391,933	696
	公 社 債	2,112,143	2,484,125	371,981	372,580	598	2,112,093	372,032	372,608	576
	外 国 公 社 債	145,639	146,463	823	7,832	7,008	127,258	19,204	19,324	120
	子会社・関連会社株式	－	－	－	－	－	－	－	－	－
	そ の 他 有 価 証 券	3,130,190	3,251,948	121,757	220,541	98,784	2,996,460	255,487	280,508	25,020
	公 社 債	1,065,466	1,124,873	59,407	67,406	7,999	1,056,745	68,128	71,989	3,860
	株 式	192,147	276,246	84,099	95,575	11,475	192,147	84,099	95,575	11,475
	外 国 証 券	1,670,994	1,650,584	△20,410	54,112	74,523	1,545,985	104,598	109,496	4,897
	公 社 債	1,546,014	1,526,890	△19,123	53,426	72,549	1,421,005	105,885	108,810	2,924
	株 式 等	124,980	123,693	△1,287	685	1,973	124,980	△1,287	685	1,973
	そ の 他 の 証 券	134,077	132,284	△1,793	2,992	4,785	134,077	△1,793	2,992	4,785
	買 入 金 銭 債 権	5,504	5,959	455	455	－	5,504	455	455	－
	譲 渡 性 預 金	62,000	62,000	－	－	－	62,000	－	－	－
	合 計	5,392,485	5,887,467	494,981	601,373	106,391	5,240,324	647,143	672,860	25,717
	公 社 債	3,179,594	3,611,166	431,572	440,171	8,598	3,170,822	440,344	444,781	4,437
	株 式	192,147	276,246	84,099	95,575	11,475	192,147	84,099	95,575	11,475
	外 国 証 券	1,816,634	1,797,047	△19,586	61,944	81,531	1,673,244	123,802	128,820	5,018
公 社 債	1,691,653	1,673,354	△18,299	61,258	79,557	1,548,263	125,090	128,134	3,044	
株 式 等	124,980	123,693	△1,287	685	1,973	124,980	△1,287	685	1,973	
そ の 他 の 証 券	134,077	132,284	△1,793	2,992	4,785	134,077	△1,793	2,992	4,785	
買 入 金 銭 債 権	8,032	8,722	690	690	－	8,032	690	690	－	
譲 渡 性 預 金	62,000	62,000	－	－	－	62,000	－	－	－	

(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. 外貨建責任準備金対応債券に係る換算差額△18,431百万円、及び外貨建その他有価証券のうち債券に係る換算差額の一部△133,730百万円については、為替差損益として損益計算書に計上しています。

(単位：百万円)

区 分	2020年度上半期末									
	帳簿価額	時 価	差 損 益	(時価－帳簿価額)		損益計算書 計上後価額	差 損 益	(時価－損益計算書計上後価額)		
				差益	差損			差益	差損	
満期保有目的の債券	4,332	4,728	396	396	—	4,332	396	396	—	—
公 社 債	1,903	2,077	174	174	—	1,903	174	174	—	—
買入金銭債権	2,429	2,651	222	222	—	2,429	222	222	—	—
責任準備金対応債券	2,293,429	2,651,185	357,756	361,908	4,152	2,283,153	368,032	372,125	4,092	—
公 社 債	2,142,044	2,487,202	345,158	349,250	4,092	2,141,815	345,387	349,479	4,092	—
外国公社債	151,385	163,982	12,597	12,658	60	141,337	22,645	22,645	—	—
子会社・関連会社株式	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
その他の有価証券	3,125,642	3,421,403	295,760	320,097	24,336	3,070,940	350,462	362,650	12,187	—
公 社 債	1,077,740	1,139,461	61,720	64,046	2,326	1,069,778	69,682	71,375	1,693	—
株 式	190,779	303,597	112,818	122,483	9,665	190,779	112,818	122,483	9,665	—
外国証券	1,658,178	1,771,593	113,415	125,316	11,900	1,611,438	160,155	160,539	383	—
公 社 債	1,529,676	1,635,854	106,178	117,731	11,553	1,482,936	152,917	152,954	36	—
株式等	128,501	135,739	7,237	7,585	347	128,501	7,237	7,585	347	—
その他の証券	139,624	147,017	7,392	7,837	444	139,624	7,392	7,837	444	—
買入金銭債権	5,319	5,733	413	413	—	5,319	413	413	—	—
譲渡性預金	54,000	54,000	—	—	—	54,000	—	—	—	—
合 計	5,423,404	6,077,318	653,913	682,403	28,489	5,358,426	718,892	735,171	16,279	—
公 社 債	3,221,688	3,628,741	407,052	413,471	6,418	3,213,497	415,244	421,029	5,785	—
株 式	190,779	303,597	112,818	122,483	9,665	190,779	112,818	122,483	9,665	—
外国証券	1,809,563	1,935,576	126,013	137,974	11,961	1,752,776	182,800	183,184	383	—
公 社 債	1,681,061	1,799,837	118,775	130,389	11,613	1,624,274	175,563	175,599	36	—
株式等	128,501	135,739	7,237	7,585	347	128,501	7,237	7,585	347	—
その他の証券	139,624	147,017	7,392	7,837	444	139,624	7,392	7,837	444	—
買入金銭債権	7,748	8,384	636	636	—	7,748	636	636	—	—
譲渡性預金	54,000	54,000	—	—	—	54,000	—	—	—	—

- (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. 外貨建責任準備金対応債券に係る換算差額△10,276百万円、及び外貨建その他有価証券のうち債券に係る換算差額の一部△54,702百万円については、為替差損益として損益計算書に計上しています。

○満期保有目的の債券

(単位：百万円)

区 分	2019年度末			2020年度上半期末		
	貸借対照表 計上額	時 価	差 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	4,511	4,930	419	4,332	4,728	396
公 社 債	1,983	2,167	184	1,903	2,077	174
買入金銭債権	2,528	2,762	234	2,429	2,651	222
時価が貸借対照表計上額 を 超 え ない も の	—	—	—	—	—	—

○責任準備金対応債券

(単位：百万円)

区 分	2019年度末			2020年度上半期末		
	貸借対照表 計上額	時 価	差 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	2,160,099	2,552,032	391,933	2,178,376	2,550,501	372,125
公 社 債	2,035,408	2,408,017	372,608	2,037,038	2,386,518	349,479
外国証券	124,690	144,015	19,324	141,337	163,982	22,645
時価が貸借対照表計上額 を 超 え ない も の	79,252	78,556	△696	104,776	100,684	△4,092
公 社 債	76,684	76,108	△576	104,776	100,684	△4,092
外国証券	2,568	2,448	△120	—	—	—

○その他有価証券

(単位：百万円)

区 分	2019年度末			2020年度上半期末		
	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	1,832,958	2,053,500	220,541	2,543,328	2,863,426	320,097
公 社 債	883,581	950,988	67,406	928,223	992,269	64,046
株 式	125,242	220,817	95,575	129,506	251,990	122,483
外 国 証 券	736,764	790,876	54,112	1,353,979	1,479,296	125,316
そ の 他 の 証 券	81,864	84,856	2,992	126,299	134,136	7,837
買 入 金 銭 債 権	5,504	5,959	455	5,319	5,733	413
貸借対照表計上額が帳簿価額を超えないもの	1,297,232	1,198,447	△98,784	582,314	557,977	△24,336
公 社 債	181,884	173,884	△7,999	149,517	147,191	△2,326
株 式	66,904	55,428	△11,475	61,272	51,607	△9,665
外 国 証 券	934,230	859,707	△74,523	304,198	292,297	△11,900
そ の 他 の 証 券	52,213	47,427	△4,785	13,325	12,880	△444
譲 渡 性 預 金	62,000	62,000	—	54,000	54,000	—

・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次のとおりです。

(単位：百万円)

区 分	2019年度末	2020年度上半期末
満期保有目的の債券	—	—
責任準備金対応債券	—	—
子会社・関連会社株式	1,837	1,670
そ の 他 有 価 証 券	11,521	11,509
非 上 場 国 内 株 式	10,236	10,224
そ の 他	1,285	1,285
合 計	13,359	13,179

(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：4百万円、2020年度上半期末：△28百万円)

3. 金銭の信託の時価情報

2019年度末、2020年度上半期末ともに該当する残高はありません。

4. デリバティブ取引の時価情報（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：百万円）

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	13	—	—	—	—	13
ヘッジ会計非適用分	—	72	115	—	—	188
合計	13	72	115	—	—	201
2020年度上半期末						
	金利関連	通貨関連	株式関連	債券関連	その他	合計
ヘッジ会計適用分	9	—	—	—	—	9
ヘッジ会計非適用分	—	△4,368	△14	—	—	△4,382
合計	9	△4,368	△14	—	—	△4,373

（注）ヘッジ会計非適用分の差損益については、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

①金利関連

2019年度末、2020年度上半期末ともに該当する残高はありません。

②通貨関連

（単位：百万円）

区分	種類	2019年度末				2020年度上半期末			
		契約額等	うち1年超	時価	差損益	契約額等	うち1年超	時価	差損益
店頭	為替予約								
	売	927,385	—	832	832	927,132	—	△4,476	△4,476
	米ドル	256,979	—	△1,595	△1,595	237,400	—	2,216	2,216
	ユーロ	670,406	—	2,427	2,427	681,618	—	△6,810	△6,810
	その他の通貨	—	—	—	—	8,112	—	117	117
	通貨スワップ	5,700	5,700	△759	△759	5,700	5,700	108	108
	円払／豪ドル受	5,700	5,700	△759	△759	5,700	5,700	108	108
	合計				72				△4,368

（注） 1. 各期末の為替相場は先物相場を使用しています。
2. 差損益欄には、時価を記載しています。

③株式関連

（単位：百万円）

区分	種類	2019年度末				2020年度上半期末			
		契約額等	うち1年超	時価	差損益	契約額等	うち1年超	時価	差損益
取引所	株価指数先物								
	売	822	—	△10	△10	—	—	—	—
店頭	株価指数先渡								
	売	1,876	—	125	125	2,014	—	△14	△14
	合計				115				△14

（注）差損益欄には、時価を記載しています。

④債券関連

2019年度末、2020年度上半期末ともに該当する残高はありません。

⑤その他

2019年度末、2020年度上半期末ともに該当する残高はありません。

(3) ヘッジ会計が適用されているもの

①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			2020年度上半期末		
			契 約 額 等	うち1年超	時 価	契 約 額 等	うち1年超	時 価
原則的処理方法	金利スワップ 固定金利受取/ 変動金利支払	貸付金	263	—	0	—	—	—
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	1,860	1,060	12	1,060	200	9
合 計					13			9

(参考) 金利スワップ残存期間別残高

(単位：百万円、%)

2019年度末								
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	合計	
受 取 側 固 定 ス ワ ッ プ 想 定 元 本	1,063	860	200	—	—	—	2,123	
平均受取固定金利	0.96	0.80	1.43	—	—	—	0.94	
平均支払変動金利	0.48	0.48	0.58	—	—	—	0.49	
支 払 側 固 定 ス ワ ッ プ 想 定 元 本	—	—	—	—	—	—	—	
平均受取変動金利	—	—	—	—	—	—	—	
平均支払固定金利	—	—	—	—	—	—	—	
支 払 / 受 取 共 に 変 動 ス ワ ッ プ 想 定 元 本	—	—	—	—	—	—	—	
平均受取変動金利	—	—	—	—	—	—	—	
平均支払変動金利	—	—	—	—	—	—	—	
合 計	1,063	860	200	—	—	—	2,123	
2020年度上半期末								
受 取 側 固 定 ス ワ ッ プ 想 定 元 本	860	200	—	—	—	—	1,060	
平均受取固定金利	0.80	1.43	—	—	—	—	0.92	
平均支払変動金利	0.48	0.58	—	—	—	—	0.50	
支 払 側 固 定 ス ワ ッ プ 想 定 元 本	—	—	—	—	—	—	—	
平均受取変動金利	—	—	—	—	—	—	—	
平均支払固定金利	—	—	—	—	—	—	—	
支 払 / 受 取 共 に 変 動 ス ワ ッ プ 想 定 元 本	—	—	—	—	—	—	—	
平均受取変動金利	—	—	—	—	—	—	—	
平均支払変動金利	—	—	—	—	—	—	—	
合 計	860	200	—	—	—	—	1,060	

②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年度上半期末		
			契 約 額 等 ((注) 1)	うち1年超	時 価	契 約 額 等 ((注) 1)	うち1年超	時 価
為替予約の振当処理	為替予約	外貨建定期預金	40,906	—	((注) 2)	40,980	—	((注) 2)

- (注) 1. 為替予約の振当処理の契約額等は、ヘッジ対象としている外貨建定期預金と一体で処理しているため、当該外貨建定期預金の貸借対照表計上額（時価）と同額となります。
 当該外貨建定期預金は短期間で決済されるため、金利変動を考慮する重要性が乏しいことから時価は帳簿価額と同額としています。
2. 為替予約の振当処理の時価は上記の契約額等を含めています。

③株式関連

2019年度末、2020年度上半期末ともに該当する残高はありません。

④債券関連

2019年度末、2020年度上半期末ともに該当する残高はありません。

⑤その他

2019年度末、2020年度上半期末ともに該当する残高はありません。

IV. その他

1. 資産査定の状況等

当社は、資産の健全性確保のため、毎決算期末において資産の自己査定を実施し、その結果を反映した適正な償却・引当処理を行っています。

○債務者区分による債権の状況

(単位：百万円)

区 分		2020年度上半期末					
		債権額 (C)	貸付金	その他	担保・保証 等	引当金	保全額 (D)
	破産更生債権及びこれらに準ずる債権	—	—	—	—	—	—
	危険債権	314	314	—	87	109	197
	要管理債権	—	—	—	—	—	—
	小計 (A)	314	314	—	87	109	197
	正常債権 (B)	1,331,185	989,179	342,006			
	合計 (A+B)	1,331,499	989,493	342,006			
							(A) / (A+B)
							0.02%

区 分		2019年度末		
		債権額	保全額	保全率
	破産更生債権及びこれらに準ずる債権	—	—	—
	危険債権	320	203	63.5%
	要管理債権	—	—	—
	小計 (A)	320	203	63.5%
	正常債権 (B)	1,346,081		
	合計 (A+B)	1,346,402		
		(A) / (A+B)		
		0.02%		

- (注) 1. 破産更生債権及びこれらに準ずる債権とは、破産手続開始、更生手続開始又は再生手続開始の申立て等の事由により経営破綻に陥っている債務者に対する債権及びこれらに準ずる債権です。
2. 危険債権とは、債務者が経営破綻の状態には至っていないが、財政状態及び経営成績が悪化し、契約に従った債権の元本の回収及び利息の受取りができない可能性の高い債権です。
3. 要管理債権とは、3カ月以上延滞貸付金及び条件緩和貸付金です。なお、3カ月以上延滞貸付金とは、元本又は利息の支払が、約定支払日の翌日から3カ月以上遅延している貸付金（注1及び2に掲げる債権を除く）、条件緩和貸付金とは、債務者の経営再建又は支援を図ることを目的として、金利の減免、利息の支払猶予、元本の返済猶予、債権放棄その他の債務者に有利となる取決めを行った貸付金（注1及び2に掲げる債権並びに3カ月以上延滞貸付金を除く）です。
4. 正常債権とは、債務者の財政状態及び経営成績に特に問題がないものとして、注1から3までに掲げる債権以外のものに区分される債権です。
5. 破産更生債権及びこれらに準ずる債権のⅢ・Ⅳ分類については、償却・引当規程に基づき全額を個別貸倒引当金に計上するか又は直接減額し、危険債権のⅢ分類については、必要額を個別貸倒引当金に計上しています。なお、正常債権及び要管理債権については、貸倒実績率に基づき一般貸倒引当金を計上しています。
6. 保全率とは、担保・保証等による保全額及び引当金によるカバー率であり、(担保・保証等による保全額+引当金) / 債権額で算出しています。担保・保証等による保全額とは、担保・保証等により回収が見込まれる金額であり、担保については評価額に所定の掛目を乗じて算出しています。

(参考) リスク管理債権の保全率

(単位：百万円)

リ ス ク 管 理 債 権	2019年度末			2020年度上半期末			
	債権額	保全額	保全率	債権額	担保・保証 等	引当金	保全額
	320	203	63.5%	314	87	109	197
							62.9%

2. 土地の時価情報

(単位:百万円)

	2019年度末	2020年度上半期末
時 価	161,337	160,767
貸 借 対 照 表 価 額	165,669	164,663
差 損 益	△4,332	△3,895

(注) 1. 時価は、公示価格等を基準に算定しています。
2. 上記には、借地権を含んでいます。