

2021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. 金銭の信託の時価情報	…… 12 頁
3. デリバティブ取引の時価情報	…… 12 頁

III. 会社計

1. 売買目的有価証券の評価損益	…… 13 頁
2. 有価証券の時価情報	…… 13 頁
3. 金銭の信託の時価情報	…… 15 頁
4. デリバティブ取引の時価情報	…… 16 頁

IV. その他

1. 資産査定の状況等	…… 18 頁
2. 土地の時価情報	…… 19 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	2020年度末		2021年度上半期末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
国 債	2,483,253	42.8	2,474,706	42.8
地 方 債	180,208	3.1	182,487	3.2
社 債	653,179	11.2	660,061	11.4
うち公社・公団債	350,310	6.0	359,308	6.2
株 式	393,998	6.8	410,659	7.1
外 国 証 券	1,943,340	33.5	1,912,333	33.1
公 社 債	1,801,424	31.0	1,767,067	30.6
株 式 等	141,916	2.4	145,265	2.5
そ の 他 の 証 券	153,447	2.6	139,058	2.4
合 計	5,807,428	100.0	5,779,307	100.0

(2) 有価証券残存期間別残高

(単位：百万円)

2020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	121,792	260,228	215,507	419,017	873,766	3,917,117	5,807,428
国 債	67,168	87,321	51,261	21,716	246,403	2,009,382	2,483,253
地 方 債	—	17,693	7,022	—	62,306	93,185	180,208
社 債	9,011	74,997	65,077	102,543	134,780	266,769	653,179
株 式	—	—	—	—	—	393,998	393,998
外 国 証 券	45,612	80,216	92,146	294,756	430,276	1,000,333	1,943,340
公 社 債	45,612	80,216	92,146	294,756	430,276	858,417	1,801,424
株 式 等	—	—	—	—	—	141,916	141,916
そ の 他 の 証 券	—	—	—	—	—	153,447	153,447
買 入 金 銭 債 権	—	—	—	—	—	7,825	7,825
譲 渡 性 預 金	60,000	—	—	—	—	—	60,000
合 計	181,792	260,228	215,507	419,017	873,766	3,924,943	5,875,254
2021年度上半期末							
有 価 証 券	98,259	247,246	266,028	440,933	893,956	3,832,882	5,779,307
国 債	51,972	50,335	48,149	51,891	249,255	2,023,101	2,474,706
地 方 債	1,711	16,426	6,502	30,696	31,589	95,561	182,487
社 債	15,496	88,317	66,109	102,814	119,597	267,726	660,061
株 式	—	—	—	—	—	410,659	410,659
外 国 証 券	29,078	92,166	145,267	255,530	493,514	896,775	1,912,333
公 社 債	29,078	92,166	145,267	255,530	493,514	751,509	1,767,067
株 式 等	—	—	—	—	—	145,265	145,265
そ の 他 の 証 券	—	—	—	—	—	139,058	139,058
買 入 金 銭 債 権	—	—	—	—	—	7,513	7,513
譲 渡 性 預 金	83,000	—	—	—	—	—	83,000
合 計	181,259	247,246	266,028	440,933	893,956	3,840,396	5,869,820

(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		2020年度末		2021年度上半期末	
		金 額	占 率	金 額	占 率
水 産 ・ 農 林 業		—	—	—	—
鉱 業		616	0.2	597	0.1
建 設 業		14,612	3.7	15,527	3.8
製 造 業	食 料 品	18,963	4.8	20,269	4.9
	織 維 製 品	26,148	6.6	26,007	6.3
	パ ル プ ・ 紙	12,931	3.3	10,356	2.5
	化 学	38,997	9.9	38,354	9.3
	医 薬 品	13	0.0	13	0.0
	石 油 ・ 石 炭 製 品	4,761	1.2	4,384	1.1
	ゴ ム 製 品	30	0.0	30	0.0
	ガ ラ ス ・ 土 石 製 品	3,444	0.9	2,833	0.7
	鉄 鋼	786	0.2	959	0.2
	非 鉄 金 属	8,043	2.0	8,878	2.2
	金 属 製 品	2,136	0.5	2,226	0.5
	機 械	16,648	4.2	18,482	4.5
	電 気 機 器	39,052	9.9	43,082	10.5
	輸 送 用 機 器	67,897	17.2	73,958	18.0
	精 密 機 器	1,673	0.4	1,758	0.4
	そ の 他 製 品	5,739	1.5	6,053	1.5
電 気 ・ ガ ス 業		5,404	1.4	4,897	1.2
運 輸 ・ 情 報 通 信 業	陸 運 業	14,864	3.8	12,646	3.1
	海 運 業	3,823	1.0	7,769	1.9
	空 運 業	77	0.0	77	0.0
	倉 庫 ・ 運 輸 関 連 業	3,679	0.9	4,194	1.0
	情 報 ・ 通 信 業	204	0.1	197	0.0
商 業	卸 売 業	46,092	11.7	48,185	11.7
	小 売 業	10,524	2.7	11,401	2.8
金 融 ・ 保 険 業	銀 行 業	13,381	3.4	12,245	3.0
	証 券 、 商 品 先 物 取 引 業	4,129	1.0	4,357	1.1
	保 険 業	3,380	0.9	3,889	0.9
	そ の 他 金 融 業	4,973	1.3	5,186	1.3
不 動 産 業		18,543	4.7	19,349	4.7
サ ー ビ ス 業		2,423	0.6	2,486	0.6
合 計		393,998	100.0	410,659	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)

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	6	—	—	—	—	6
ヘッジ会計非適用分	—	△28,426	△37	—	—	△28,464
合計	6	△28,426	△37	—	—	△28,458
2021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	3	—	—	—	—	3
ヘッジ会計非適用分	—	1,142	13	—	—	1,156
合計	3	1,142	13	—	—	1,160

(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	2020年度末				2021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	1,060	200	6	6	200	200	3	3
	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					6				3

(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、%)

2020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	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	0.49	0.59	—	—	—	—	0.51
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
2021年度上半期末							
受取側固定スワップ想定元本	—	200	—	—	—	—	200
平均受取固定金利	—	1.43	—	—	—	—	1.43
平均支払変動金利	—	0.57	—	—	—	—	0.57
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	—	200	—	—	—	—	200

③通貨関連

(単位：百万円)

区分	種類	2020年度末				2021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	922,027	—	△29,000	△29,000	900,451	—	888	888
	米ドル	205,837	—	△11,456	△11,456	208,108	—	△3,851	△3,851
	ユーロ	686,057	—	△16,473	△16,473	654,361	—	4,325	4,325
	その他の通貨	30,132	—	△1,071	△1,071	37,980	—	413	413
	買 建	4,837	—	53	53	22	—	0	0
	米ドル	—	—	—	—	22	—	0	0
	豪ドル	4,837	—	53	53	—	—	—	—
	通貨スワップ	5,700	5,700	521	521	5,700	5,700	254	254
	円払／豪ドル受	5,700	5,700	521	521	5,700	5,700	254	254
合 計					△28,426				1,142

- (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	2020年度末				2021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	1,182	—	△37	△37	1,281	—	13	13
合 計					△37				13

(注) 差損益欄には、時価を記載しています。

⑤債券関連

2020年度末、2021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

2020年度末、2021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	2020年度末		2021年度上半期末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
保 険 約 款 貸 付	37,767	3.8	35,485	3.7
保 険 料 振 替 貸 付	4,749	0.5	4,322	0.5
契 約 者 貸 付	33,017	3.4	31,163	3.3
一 般 貸 付	943,845	96.2	921,959	96.3
(うち非居住者貸付)	—	—	—	—
企 業 貸 付	795,696	81.1	774,592	80.9
(うち国内企業向け)	(795,639)	(81.1)	(774,561)	(80.9)
国・国際機関・政府関係機関貸付	136	0.0	137	0.0
公 共 団 体 ・ 公 企 業 貸 付	27,830	2.8	27,625	2.9
住 宅 ロ ー ン	17,313	1.8	15,523	1.6
消 費 者 ロ ー ン	102,424	10.4	103,665	10.8
そ の 他	445	0.0	415	0.0
合 計	981,612	100.0	957,445	100.0

(2) 貸付金残存期間別残高

(単位：百万円)

2020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	5,771	409	508	2,020	799	17,873	27,382
固定金利	75,726	189,288	157,095	122,320	143,577	228,454	916,463
一般貸付計	81,497	189,697	157,603	124,340	144,377	246,328	943,845
2021年度上半期末							
変動金利	4,903	405	476	1,968	1,257	13,192	22,204
固定金利	104,068	161,822	167,155	96,311	162,119	208,277	899,754
一般貸付計	108,972	162,227	167,631	98,280	163,376	221,470	921,959

(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		2020年度末		2021年度上半期末	
			占 率		占 率
大 企 業	貸付先数	78	72.2	74	73.3
	金 額	732,044	92.0	727,688	93.9
中 堅 企 業	貸付先数	1	0.9	1	1.0
	金 額	500	0.1	500	0.1
中 小 企 業	貸付先数	29	26.9	26	25.7
	金 額	63,095	7.9	46,372	6.0
国内企業向け 貸 付 計	貸付先数	108	100.0	101	100.0
	金 額	795,639	100.0	774,561	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		2020年度末		2021年度上半期末		
		金 額	占 率	金 額	占 率	
国 内	製 造 業	104,738	11.1	100,803	10.9	
	食 料	5,000	0.5	4,900	0.5	
	織 維	—	—	—	—	
	木 材 ・ 木 製 品	—	—	—	—	
	パ ル プ ・ 紙	33,500	3.5	36,500	4.0	
	印 刷	—	—	—	—	
	化 学	12,830	1.4	12,710	1.4	
	石 油 ・ 石 炭	19,310	2.0	18,000	2.0	
	窯 業 ・ 土 石	4,414	0.5	4,180	0.5	
	鉄 鋼	3,000	0.3	3,000	0.3	
	非 鉄 金 属	5,576	0.6	5,576	0.6	
	金 属 製 品	—	—	—	—	
	はん 用 ・ 生 産 用 ・ 業 務 用 機 械	1,126	0.1	1,115	0.1	
	電 気 機 械	6,500	0.7	6,500	0.7	
	輸 送 用 機 械	13,424	1.4	8,280	0.9	
	そ の 他 の 製 造 業	58	0.0	41	0.0	
	向 け	農 業 、 林 業	—	—	—	—
		漁 業	—	—	—	—
		鉱 業 、 採 石 業 、 砂 利 採 取 業	45	0.0	37	0.0
		建 設 業	3,560	0.4	3,486	0.4
電 気 ・ ガ ス ・ 熱 供 給 ・ 水 道 業		87,381	9.3	75,400	8.2	
情 報 通 信 業		24,100	2.6	23,600	2.6	
運 輸 業 、 郵 便 業		39,989	4.2	42,786	4.6	
卸 売 業		222,107	23.5	217,102	23.5	
小 売 業		500	0.1	—	—	
金 融 業 、 保 険 業		231,094	24.5	226,974	24.6	
不 動 産 業		97,125	10.3	98,623	10.7	
物 品 賃 貸 業		8,688	0.9	9,447	1.0	
学 術 研 究 、 専 門 ・ 技 術 サ ー ビ ス 業		—	—	—	—	
宿 泊 業		14	0.0	7	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		445	0.0	415	0.0	
そ の 他 の サ ー ビ ス		31	0.0	29	0.0	
地 方 公 共 団 体		4,230	0.4	4,025	0.4	
個 人 （ 住 宅 ・ 消 費 ・ 納 税 資 金 等 ）	119,737	12.7	119,189	12.9		
そ の 他	56	0.0	31	0.0		
合 計		943,845	100.0	921,959	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		943,845	100.0	921,959	100.0	

(5) 貸付金地域別内訳

(単位：百万円、%)

区 分	2020年度末		2021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	664,966	80.7	660,401	82.3
中 部	100,055	12.1	88,915	11.1
近 畿	28,101	3.4	22,550	2.8
中 国	2,150	0.3	2,140	0.3
四 国	3,500	0.4	3,500	0.4
九 州	12,357	1.5	12,286	1.5
合 計	824,107	100.0	802,769	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		2020年度末		2021年度上半期末	
		金 額	占 率	金 額	占 率
担 保 貸 付		607	0.1	548	0.1
	有 価 証 券 担 保 貸 付	—	—	—	—
	不 動 産 ・ 動 産 ・ 財 団 担 保 貸 付	607	0.1	548	0.1
	指 名 債 権 担 保 貸 付	—	—	—	—
保 証 貸 付		3,552	0.4	3,383	0.4
信 用 貸 付		819,947	86.9	798,837	86.6
そ の 他		119,737	12.7	119,189	12.9
一 般 貸 付 計		943,845	100.0	921,959	100.0
	う ち 劣 後 特 約 付 貸 付	183,000	19.4	180,000	19.5

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	2020年度末		2021年度上半期末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
公 社 債	2,021,983	84.4	1,997,740	85.2
株 式	—	—	—	—
現 預 金 ・ そ の 他	203,644	8.5	213,863	9.1
小 計	2,225,628	92.9	2,211,603	94.3

②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年度上半期末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
公 社 債	—	—	—	—
現 預 金 ・ そ の 他	40,991	1.7	2,999	0.1
小 計	40,991	1.7	2,999	0.1

③円貨建資産

(単位：百万円、%)

区 分	2020年度末		2021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	128,750	5.4	130,361	5.6
小 計	128,750	5.4	130,361	5.6

④合 計

(単位：百万円、%)

区 分	2020年度末		2021年度上半期末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
海 外 投 融 資	2,395,370	100.0	2,344,965	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	2020年度末		2021年度上半期末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
豪 ド ル	801,670	36.0	833,004	37.7
ユ ー ロ	756,631	34.0	693,078	31.3
米 ド ル	667,313	30.0	685,501	31.0
ス イ ス フ ラ ン	9	0.0	13	0.0
そ の 他	3	0.0	5	0.0
合 計	2,225,628	100.0	2,211,603	100.0

(3) 海外投融資の地域別構成

(単位：百万円、%)

2020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	405,700	20.9	394,017	21.9	11,682	8.2	—	—	
ヨ ー ロ ッ パ	950,723	48.9	825,807	45.8	124,915	88.0	—	—	
オ セ ア ニ ア	391,800	20.2	391,800	21.7	—	—	—	—	
ア ジ ア	5,317	0.3	—	—	5,317	3.7	—	—	
中 南 米	—	—	—	—	—	—	—	—	
中 東	—	—	—	—	—	—	—	—	
ア フ リ カ	—	—	—	—	—	—	—	—	
国 際 機 関	189,798	9.8	189,798	10.5	—	—	—	—	
合 計	1,943,340	100.0	1,801,424	100.0	141,916	100.0	—	—	
2021年度上半期末									
北 米	406,790	21.3	394,293	22.3	12,497	8.6	—	—	
ヨ ー ロ ッ パ	890,005	46.5	762,608	43.2	127,397	87.7	—	—	
オ セ ア ニ ア	427,119	22.3	427,119	24.2	—	—	—	—	
ア ジ ア	5,370	0.3	—	—	5,370	3.7	—	—	
中 南 米	—	—	—	—	—	—	—	—	
中 東	—	—	—	—	—	—	—	—	
ア フ リ カ	—	—	—	—	—	—	—	—	
国 際 機 関	183,046	9.6	183,046	10.4	—	—	—	—	
合 計	1,912,333	100.0	1,767,067	100.0	145,265	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	2020年度末		2021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	66,277	10,936	67,367	1,113
公 社 債	18,936	△208	18,901	0
株 式	23,083	5,867	22,062	△18
外 国 証 券	19,663	4,480	21,932	1,093
公 社 債	7,067	110	7,554	△30
株 式 等	12,596	4,369	14,377	1,123
そ の 他 の 証 券	4,593	796	4,470	38

(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	2020年度末		2021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	18,916	1,616	18,025	△36
公 社 債	9,490	△182	9,267	△4
株 式	3,905	971	3,349	△98
外 国 証 券	2,990	716	3,294	168
公 社 債	1,038	16	1,035	△6
株 式 等	1,952	700	2,259	175
そ の 他 の 証 券	2,529	111	2,114	△102

(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．金銭の信託の時価情報

個人変額保険、個人変額年金保険ともに残高がないため、記載していません。

3．デリバティブ取引の時価情報

個人変額保険、個人変額年金保険ともに残高がないため、記載していません。

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	2020年度末		2021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	193,298	26,285	200,771	2,489
公 社 債	82,107	△905	86,381	94
株 式	51,450	13,402	49,647	△9
外 国 証 券	52,617	12,880	58,157	2,469
公 社 債	16,244	354	17,433	△109
株 式 等	36,372	12,526	40,723	2,579
そ の 他 の 証 券	7,123	908	6,585	△63

(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）

(単位：百万円)

区 分		2020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		4,150	4,504	353	353	－	4,150	353	353	－
	公 社 債	1,822	1,977	155	155	－	1,822	155	155	－
	買 入 金 銭 債 権	2,328	2,527	198	198	－	2,328	198	198	－
責任準備金対応債券		2,388,153	2,712,659	324,506	331,443	6,936	2,391,758	320,901	329,586	8,684
	公 社 債	2,216,793	2,529,915	313,122	320,056	6,934	2,216,866	313,049	319,993	6,944
	外 国 公 社 債	171,360	182,744	11,384	11,386	1	174,892	7,852	9,592	1,740
子会社・関連会社株式		－	－	－	－	－	－	－	－	－
そ の 他 有 価 証 券		3,052,010	3,467,210	415,200	425,943	10,742	3,108,239	358,971	375,755	16,783
	公 社 債	1,038,602	1,097,952	59,350	62,206	2,856	1,041,454	56,498	60,022	3,523
	株 式	190,616	383,026	192,409	196,005	3,595	190,616	192,409	196,005	3,595
	外 国 証 券	1,617,108	1,768,448	151,340	155,075	3,735	1,670,486	97,962	107,071	9,109
	公 社 債	1,484,396	1,626,532	142,135	145,575	3,439	1,537,774	88,758	97,571	8,813
	株 式 等	132,711	141,916	9,204	9,500	295	132,711	9,204	9,500	295
	そ の 他 の 証 券	140,542	152,285	11,742	12,298	555	140,542	11,742	12,298	555
	買 入 金 銭 債 権	5,140	5,497	357	357	－	5,140	357	357	－
	譲 渡 性 預 金	60,000	60,000	－	－	－	60,000	－	－	－
	合 計	5,444,314	6,184,375	740,061	757,740	17,679	5,504,148	680,226	705,695	25,468
公 社 債	3,257,217	3,629,845	372,627	382,418	9,791	3,260,142	369,702	380,170	10,467	
株 式	190,616	383,026	192,409	196,005	3,595	190,616	192,409	196,005	3,595	
外 国 証 券		1,788,468	1,951,193	162,724	166,461	3,737	1,845,378	105,814	116,664	10,849
	公 社 債	1,655,756	1,809,276	153,520	156,961	3,441	1,712,666	96,610	107,164	10,553
	株 式 等	132,711	141,916	9,204	9,500	295	132,711	9,204	9,500	295
そ の 他 の 証 券	140,542	152,285	11,742	12,298	555	140,542	11,742	12,298	555	
買 入 金 銭 債 権	7,468	8,024	556	556	－	7,468	556	556	－	
譲 渡 性 預 金	60,000	60,000	－	－	－	60,000	－	－	－	

- (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3,605百万円、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56,229百万円については、為替差損益として損益計算書に計上しています。
- ３．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。

(単位：百万円)

区 分	2021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	3,981	4,296	314	314	－	3,981	314	314	－	
公 社 債	1,743	1,885	142	142	－	1,743	142	142	－	
買入金銭債権	2,238	2,410	172	172	－	2,238	172	172	－	
責任準備金対応債券	2,498,428	2,825,896	327,467	336,497	9,029	2,496,962	328,933	337,590	8,656	
公 社 債	2,284,146	2,601,008	316,861	324,973	8,111	2,284,327	316,680	324,803	8,123	
外国公社債	214,281	224,888	10,606	11,524	918	212,634	12,253	12,787	533	
子会社・関連会社株式	－	－	－	－	－	－	－	－	－	
その他の有価証券	2,943,430	3,359,598	416,168	428,989	12,821	2,971,127	388,471	400,261	11,790	
公 社 債	970,154	1,031,184	61,030	62,229	1,199	973,624	57,560	59,386	1,825	
株 式	190,608	402,396	211,787	217,247	5,459	190,608	211,787	217,247	5,459	
外国証券	1,571,408	1,699,698	128,289	133,645	5,355	1,595,635	104,062	107,760	3,698	
公 社 債	1,437,927	1,554,432	116,505	121,711	5,206	1,462,154	92,277	95,827	3,549	
株式等	133,481	145,265	11,784	11,933	149	133,481	11,784	11,933	149	
その他の証券	123,286	138,043	14,756	15,563	806	123,286	14,756	15,563	806	
買入金銭債権	4,971	5,274	303	303	－	4,971	303	303	－	
譲渡性預金	83,000	83,000	－	－	－	83,000	－	－	－	
合 計	5,445,840	6,189,791	743,950	765,801	21,851	5,472,071	717,719	738,166	20,447	
公 社 債	3,256,045	3,634,078	378,033	387,345	9,311	3,259,695	374,383	384,332	9,948	
株 式	190,608	402,396	211,787	217,247	5,459	190,608	211,787	217,247	5,459	
外国証券	1,785,690	1,924,586	138,896	145,170	6,273	1,808,270	116,316	120,548	4,232	
公 社 債	1,652,209	1,779,320	127,111	133,236	6,124	1,674,789	104,531	108,614	4,083	
株式等	133,481	145,265	11,784	11,933	149	133,481	11,784	11,933	149	
その他の証券	123,286	138,043	14,756	15,563	806	123,286	14,756	15,563	806	
買入金銭債権	7,210	7,685	475	475	－	7,210	475	475	－	
譲渡性預金	83,000	83,000	－	－	－	83,000	－	－	－	

- (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△1,465百万円、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27,696百万円については、為替差損益として損益計算書に計上しています。
3. 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。

○満期保有目的の債券

(単位：百万円)

区 分	2020年度末			2021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	4,150	4,504	353	3,981	4,296	314
公 社 債	1,822	1,977	155	1,743	1,885	142
買入金銭債権	2,328	2,527	198	2,238	2,410	172
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	2020年度末			2021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	2,110,007	2,439,593	329,586	2,207,793	2,545,383	337,590
公 社 債	2,007,713	2,327,706	319,993	2,041,256	2,366,059	324,803
外国証券	102,293	111,886	9,592	166,536	179,324	12,787
時価が貸借対照表計上額 を 超 え な い も の	281,751	273,066	△8,684	289,169	280,512	△8,656
公 社 債	209,152	202,208	△6,944	243,071	234,948	△8,123
外国証券	72,598	70,858	△1,740	46,097	45,563	△533

○その他有価証券

(単位：百万円)

区 分	2020年度末			2021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	2,627,221	3,053,164	425,943	2,518,975	2,947,965	428,989
公 社 債	915,190	977,397	62,206	873,015	935,245	62,229
株 式	169,264	365,269	196,005	164,623	381,870	217,247
外 国 証 券	1,462,008	1,617,084	155,075	1,378,814	1,512,459	133,645
そ の 他 の 証 券	75,617	87,915	12,298	97,550	113,113	15,563
買 入 金 銭 債 権	5,140	5,497	357	4,971	5,274	303
貸借対照表計上額が帳簿価額を超えないもの	424,788	414,045	△10,742	424,454	411,633	△12,821
公 社 債	123,411	120,555	△2,856	97,139	95,939	△1,199
株 式	21,351	17,756	△3,595	25,985	20,525	△5,459
外 国 証 券	155,099	151,364	△3,735	192,594	187,238	△5,355
そ の 他 の 証 券	64,925	64,369	△555	25,735	24,929	△806
譲 渡 性 預 金	60,000	60,000	—	83,000	83,000	—

・ 市場価格のない株式等および組合等の帳簿価額は次のとおりです。

(単位：百万円)

区 分	2020年度末	2021年度上半期末
子 会 社 ・ 関 連 会 社 株 式	1,912	1,765
そ の 他 有 価 証 券	10,221	7,511
国 内 株 式	10,221	7,511
合 計	12,134	9,277

3. 金銭の信託の時価情報

2020年度末、2021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）

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	6	—	—	—	—	6
ヘッジ会計非適用分	—	△28,426	△37	—	—	△28,464
合計	6	△28,426	△37	—	—	△28,458
2021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	3	—	—	—	—	3
ヘッジ会計非適用分	—	1,142	11	—	—	1,154
合計	3	1,142	11	—	—	1,158

（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

2020年度末、2021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	2020年度末				2021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	922,027	—	△29,000	△29,000	900,451	—	888	888
	米ドル	205,837	—	△11,456	△11,456	208,108	—	△3,851	△3,851
	ユーロ	686,057	—	△16,473	△16,473	654,361	—	4,325	4,325
	その他の通貨	30,132	—	△1,071	△1,071	37,980	—	413	413
	買	4,837	—	53	53	22	—	0	0
	米ドル	—	—	—	—	22	—	0	0
	豪ドル	4,837	—	53	53	—	—	—	—
	通貨スワップ	5,700	5,700	521	521	5,700	5,700	254	254
	円払／豪ドル受	5,700	5,700	521	521	5,700	5,700	254	254
合計					△28,426				1,142

（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	2020年度末				2021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								
	買	—	—	—	—	368	—	△2	△2
店頭	株価指数先渡								
	売	1,182	—	△37	△37	1,281	—	13	13
合計					△37				11

（注）差損益欄には、時価を記載しています。

④債券関連

2020年度末、2021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

2020年度末、2021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	2020年度末			2021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
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	1,060	200	6	200	200	3
合 計					6			3

(参考) 金利スワップ残存期間別残高

(単位：百万円、%)

2020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	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	0.49	0.59	—	—	—	—	0.51	
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	
2021年度上半期末								
受 取 側 固 定 ス ワ ッ プ 想 定 元 本	—	200	—	—	—	—	200	
平均受取固定金利	—	1.43	—	—	—	—	1.43	
平均支払変動金利	—	0.57	—	—	—	—	0.57	
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	—	200	—	—	—	—	200	

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	2020年度末			2021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	40,983	—	((注) 2)	2,999	—	((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

2020年度末、2021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

2020年度末、2021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

2020年度末、2021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	2021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)	保全率 (D) / (C)
破産更生債権及びこれらに準ずる債権	3	3	—	3	—	3	100.0%
危険債権	76	76	—	76	—	76	100.0%
要管理債権	—	—	—	—	—	—	—
小計 (A)	80	80	—	80	—	80	100.0%
正常債権 (B)	1,531,986	957,364	574,621				
合計 (A + B)	1,532,067	957,445	574,621			(A) / (A + B)	0.01%

区 分	2020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	4	4	100.0%
危険債権	82	82	100.0%
要管理債権	—	—	—
小計 (A)	86	86	100.0%
正常債権 (B)	1,518,381		
合計 (A + B)	1,518,467		
	(A) / (A + B)		
	0.01%		

- (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)

	2020年度末			2021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
リスク管理債権	86	86	100.0%	80	80	—	80
							保全率
							100.0%

2. 土地の時価情報

(単位:百万円)

	2020年度末	2021年度上半期末
時 価	160,690	159,355
貸 借 対 照 表 価 額	164,289	148,718
差 損 益	△3,598	10,636

(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。