# 2019年度第2四半期(上半期)報告 補足資料

1.	一般勘定		
	a. 有価証券関係		
	(1) 有価証券明細表		1頁
	(2) 地域別地方債保有内訳		1頁
	(3) 有価証券残存期間別残高		2頁
	(4)業種別株式保有の状況	• • •	3頁
	b. 貸付金関係		
	(1) 貸付金明細表		4頁
	(2) 国内企業向け貸付金企業規模別内訳		4頁
	(3)貸付金残存期間別残高		5頁
	(4)貸付金業種別內訳		6 頁
	(5)貸付金担保別内訳		7頁
	(6)貸付金地域別内訳		7頁
	c. 海外投融資の状況		
	(1)資産別明細		8頁
	(2) 海外投融資の地域別構成		9頁
	(3) 外貨建資産の通貨別構成		9頁
2.	個人変額保険・変額個人年金保険 特別勘定		
	a.売買目的有価証券の評価損益		10頁
	b. 金銭の信託の時価情報		10頁
	c. デリバティブ取引の時価情報	• • •	11頁
3.	会社計		
	a. 資産の構成		13頁
	b. 有価証券の時価情報		14頁
	c. 金銭の信託の時価情報		15頁
	d デリバティブ取引の時価情報		16百

# 1. 一般勘定

## a. 有価証券関係

## (1) 有価証券明細表

(単位:百万円、%)

区分	2018年月	度末	2019年 第2四半期(上	
	金 額	占率	金額	占率
国 債	9, 979, 710	38. 4	9, 971, 542	37. 3
地 方 債	128, 733	0.5	176, 371	0.7
社債	3, 240, 009	12. 5	3, 521, 687	13. 2
うち公社・公団債	2, 077, 089	8. 0	2, 210, 784	8.3
うち外貨建	444, 724	1. 7	529, 197	2. 0
株式	1, 868, 704	7. 2	1, 804, 287	6.8
外 国 証 券	10, 636, 418	40. 9	11, 052, 809	41. 4
公 社 債	9, 398, 093	36. 2	9, 868, 583	37. 0
うち外貨建	7, 831, 640	30. 1	8, 293, 769	31. 1
株 式 等	1, 238, 325	4.8	1, 184, 225	4. 4
うち外貨建	909, 479	3. 5	987, 537	3. 7
その他の証券	128, 231	0.5	180, 304	0. 7
合 計	25, 981, 809	100. 0	26, 707, 002	100. 0
うち外貨建	9, 185, 845	35. 4	9, 810, 503	36. 7

## (2) 地域別地方債保有内訳

	区	分		2018年度末	2019年度 第2四半期(上半期)末
北	Ħ	ij.	道	-	138
東			北	-	-
関			東	67, 567	76, 457
中			部	29, 872	36, 499
近			畿	14, 670	37, 707
中			国	115	5, 054
四			国	-	-
九			州	16, 508	20, 513
	合	計		128, 733	176, 371

## (3) 有価証券残存期間別残高

#### <2018年度末>

(単位:百万円)

_											14位・日かけた
	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	合 計
有	佃	i 証	券	355, 500	1, 046, 345	1, 158, 229	1, 939, 758	4, 221, 485	13, 707, 478	3, 553, 010	25, 981, 809
国			債	18, 184	316, 250	222, 694	260, 089	1, 427, 853	7, 734, 638	_	9, 979, 710
地	I	方	債	4, 003	-	2, 805	6, 015	_	115, 908	_	128, 733
社			債	31, 933	90, 793	222, 797	264, 570	471, 271	1, 822, 337	336, 305	3, 240, 009
梆	:		式							1, 868, 704	1, 868, 704
外	· 国	副証	券	301, 378	639, 128	709, 932	1, 408, 677	2, 321, 647	4, 034, 594	1, 221, 060	10, 636, 418
	公	社	債	301, 359	639, 128	706, 602	1, 408, 677	2, 318, 015	4, 024, 309	_	9, 398, 093
	株	式	等	19	_	3, 329	_	3, 631	10, 284	1, 221, 060	1, 238, 325
そ	の	他の証	E券	-	174	-	404	713	-	126, 938	128, 231
買	入。	金銭(	責権	13, 998	-	-	-	_	160, 260	_	174, 259
譲	渡	性預	金	386, 779	-	-	_	_	-	_	386, 779
そ		の	他	_	-	_	_		-	_	_
	合	計	•	756, 279	1, 046, 345	1, 158, 229	1, 939, 758	4, 221, 485	13, 867, 739	3, 553, 010	26, 542, 848

### <2019年度第2四半期(上半期)末>

(単位:百万円)

	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	合 計
有	価	証	券	565, 813	917, 626	1, 054, 634	2, 356, 595	4, 334, 093	13, 968, 066	3, 510, 172	26, 707, 002
国			債	116, 629	325, 377	151, 466	365, 601	1, 511, 696	7, 500, 771	-	9, 971, 542
地	ļ	方	債	-	_	3, 537	5, 282	1	167, 551	-	176, 371
社			債	25, 239	121, 215	261, 976	327, 067	444, 806	1, 974, 237	367, 144	3, 521, 687
株			式							1, 804, 287	1, 804, 287
外	<u> </u>	証	券	423, 944	470, 877	637, 654	1, 658, 279	2, 376, 436	4, 325, 506	1, 160, 109	11, 052, 809
	公	社	債	423, 925	470, 877	633, 877	1, 658, 279	2, 372, 315	4, 309, 306	-	9, 868, 583
	株	式	等	18	-	3, 777	ı	4, 120	16, 199	1, 160, 109	1, 184, 225
そ	のも	也の訂	E券	-	155	-	364	1, 154	_	178, 630	180, 304
買	入名	定銭(	責権	92, 982	-	-	-	-	161, 888	-	254, 870
譲	渡	性預	金	587, 975	-	-	-	-	-	-	587, 975
そ		の	他	-	-	-	-	-	_	-	-
	合	計		1, 246, 772	917, 626	1, 054, 634	2, 356, 595	4, 334, 093	14, 129, 955	3, 510, 172	27, 549, 849

(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。

## (4)業種別株式保有の状況

(単位:百万円、%)

				2018年度5	<b>末</b>	2019年度	
	区	分		金額	占率	第2四半期(上半 金 額	-朔/木 占率
	産・	 農 林	業	346	0.0	286	0.0
鉱			業	76	0. 0	70	0.0
建	Ī	 投	業	66, 603	3. 6	63, 904	3. 5
	食	料	品	71, 668	3. 8	70, 573	3. 9
	繊 維	製	品	10, 816	0.6	10, 406	0.6
	パル	プ・	紙	8, 504	0. 5	6, 997	0.4
	化		学	210, 998	11. 3	217, 013	12. 0
	医	薬	品	185, 645	9. 9	164, 923	9. 1
製	石油·	石炭製	品	6, 891	0.4	5, 673	0. 3
	ゴム	製	品	5, 922	0. 3	5, 585	0. 3
业	ガラス	・土石製	品	21, 179	1. 1	20, 898	1. 2
造	鉄		鋼	19, 679	1. 1	15, 563	0.9
	非 鉄	金	属	38, 637	2. 1	36, 053	2. 0
業	金 属	製	品	8, 273	0.4	7, 904	0.4
	機		械	125, 007	6. 7	127, 841	7. 1
	電気	機	器	212, 089	11. 3	213, 241	11.8
	輸送	用機	器	47, 199	2. 5	45, 888	2. 5
	精 密	機	器	13, 548	0. 7	12, 834	0. 7
	その	他 製	品	58, 755	3. 1	53, 486	3. 0
電	<b>気</b> ・	ガス	業	37, 538	2. 0	32, 321	1.8
運	陸	運	業	214, 023	11.5	194, 646	10.8
輸・	海	運	業	2, 700	0. 1	3, 061	0. 2
情報	空	運	業	4, 915	0. 3	4, 502	0. 2
通信	倉庫・	運輸関連	業	9, 392	0. 5	9, 272	0. 5
業	情 報	• 通信	業	19, 660	1. 1	22, 236	1. 2
商	卸	売	業	108, 329	5.8	114, 119	6. 3
業	小	売	業	24, 775	1. 3	24, 699	1.4
金融	銀	行	業	142, 576	7. 6	124, 410	6. 9
融・	証券、商	品先物取引	業	4, 920	0.3	4, 397	0. 2
保険	保	険	業	110, 056	5. 9	112, 293	6. 2
業	その化	也金融	業	4, 131	0. 2	6, 243	0. 3
不	動	産	業	28, 228	1. 5	27, 081	1.5
サ	<u> </u>	ビス	業	45, 610	2. 4	45, 853	2. 5
	合	計		1,868,704	100.0	1, 804, 287	100.0

<sup>(</sup>注)業種区分は、「証券コード協議会」の「業種別分類項目」に準拠しています。

## b. 貸付金関係

## (1)貸付金明細表

(単位:百万円)

		l	区 分					2018年度末	2019年度 第2四半期(上半期)末
保	険	¥	的 蒙	ţ	貸		付	289, 747	285, 695
契		約	者		貸		付	264, 921	260, 586
保	険	料	振	替	1	Ť	付	24, 825	25, 108
_		般		貸			付	2, 585, 222	2, 550, 112
(	う ち	非	居 住	者	貸	付	)	(59, 945)	(58, 564)
企		業		貸			付	1, 606, 471	1, 601, 732
(	5 t	国	内 企	業	向	け	)	(1, 556, 525)	(1, 553, 168)
国	・国際	機関	・政府	関係	系機	関貸	付	961, 433	926, 371
公	共 5	日 体	· 公	企	業	貸	付	14, 045	19, 022
住		宅	П		_		ン	3, 269	2, 983
消	費		者口	1	_		ン	3	2
そ			の				他	-	-
		1	合 計					2, 874, 970	2, 835, 807

## (2) 国内企業向け貸付金企業規模別内訳

(単位:件、百万円、%)

							(単位・行	<u>、日万円、%)</u>	
		区	分		2018年度	表	2019年度 第2四半期(上半期)末		
						占率		占率	
大	,	È	業	貸付先数	176	77. 2	172	76. 1	
	1	E.	未	金 額	1, 384, 790	89.0	1, 378, 238	88. 7	
中	堅	企	業	貸付先数	1	0.4	-	-	
	<b>E</b>	TE.	未	金 額	1,000	0.1	ı	-	
中	小	企	業	貸付先数	51	22. 4	54	23. 9	
	۰۱٬	1E.	**************************************	金 額	170, 735	11.0	174, 930	11. 3	
国	内 企	業向	ゖゖ	貸付先数	228	100.0	226	100.0	
貸	f	寸	計	金 額	1, 556, 525	100.0	1, 553, 168	100.0	

(注)1. 規模の区分は業種により以下のとおり定義しています。

	業	種		①右の②、③、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	í	È	業		資本金 10億円以上	常用する従業員	資本金 10億円以上	常用する従業員	資本金 10億円以上	常用する従業員	資本金 10億円以上
中	堅	企	業	300人超 かつ	資本金3億円超 10億円未満	50人超 かつ	資本金5千万円超 10億円未満	100人超	資本金5千万円超 10億円未満	100人超 かつ	資本金1億円超 10億円未満
中	小	企								資本金1億円以下または 常用する従業員100人以下	

- 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。
- 3. 従業員数及び資本金額は、資料作成時点で当社が把握しているものによります。
- 4. サービス業は、「物品賃貸業」、「学術研究、専門・技術サービス業」、「宿泊業」、「生活関連サービス業、娯楽業」、「教育、学習支援業」、「医療・福祉」、及び「その他のサービス」で構成されます。
- 5. 規模の区分は、日本銀行の「貸出先別貸出金(業種別、設備資金新規貸出)」の規模区分に準拠しています。

## (3)貸付金残存期間別残高

### <2018年度末>

(単位:百万円)

-										1 PE - 11/4 1 4/
	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	合 計
	変動	金 利	48, 646	54, 565	371	4, 426	18, 746	59, 087	10,000	195, 844
	固定	金 利	1, 150, 032	235, 161	216, 037	212, 984	247, 476	327, 686	_	2, 389, 378
	一般貸	付計	1, 198, 679	289, 727	216, 408	217, 410	266, 223	386, 774	10, 000	2, 585, 222

### <2019年度第2四半期(上半期)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	合 計
変動金利	52, 653	48, 850	273	4, 072	21,814	56, 856	10, 000	194, 521
固定金利	1, 100, 389	237, 325	195, 909	217, 157	228, 987	375, 820	_	2, 355, 591
一般貸付計	1, 153, 043	286, 176	196, 183	221, 230	250, 802	432, 677	10, 000	2, 550, 112

## (4)貸付金業種別内訳

Т		1		1万円、%)
区分	2018年度	末	2019年月 第2四半期(上	
	金 額	占率	金額	占率
	188, 961	7. 3	188, 398	7.4
食 料	12, 142	0. 5	11, 926	0. 5
	400	0.0	400	0.0
木 材 ・ 木 製 品	600	0.0	600	0.0
パルプ・紙	12,040	0.5	13, 130	0.5
印 刷	_	_	-	_
製化業	24, 422	0.9	23, 799	0.9
<sup>32</sup>   石 油 · 石 炭	31, 230	1. 2	31, 230	1. 2
造 窯 業・土 石	10, 518	0.4	10, 364	0.4
<b>数</b>	44, 800	1. 7	44, 800	1.8
│	6, 150	0. 2	6, 575	0.3
金属製品	190	0.0	169	0.0
はん用・生産用・業務用機械	12, 864	0. 5	12, 293	0.5
電 気 機 械	20, 442	0.8	20, 589	0.8
│ │ 輸 送 用 機 械 │	9, 522	0.4	8, 902	0.3
その他の製造業	3,640	0.1	3, 620	0.1
農業、林業	_	-	-	1
漁 業	_	_	-	-
<sup>内  </sup>	_	_	-	-
	1, 937	0.1	2, 268	0.1
電気・ガス・熱供給・水道業	235, 476	9. 1	222, 662	8. 7
け  情 報 通 信 業	26, 100	1.0	26, 100	1.0
運輸業、郵便業	147, 288	5. 7	148, 152	5.8
卸 売 業	397, 950	15. 4	384, 900	15. 1
小 売 業	4, 452	0. 2	4, 114	0.2
金融業、保険業	301, 805	11.7	311, 969	12. 2
不 動 産 業	136, 701	5. 3	160, 217	6. 3
物 品質貸業	115, 634	4. 5	110, 180	4. 3
│ │ 学術研究、専門・技術サービス業 │	-	-	-	-
宿 泊 業	1,000	0.0	-	_
	=	-	-	-
生活関連サービス業、娯楽業	_	-	-	-
教 育 、 学 習 支 援 業	-	-	-	_
医療 · 福 祉	_	-	-	-
その他のサービス	9, 091	0.4	9, 091	0.4
地方公共団体	45	0.0	22	0.0
個人(住宅・消費・納税資金等)	3, 272	0.1	2, 986	0.1
合 計	2, 525, 277	97. 7	2, 491, 548	97. 7
海政府等	10,000	0.4	10,000	0.4
外  金 融 機 関	49, 945	1. 9	48, 564	1.9
向	-	-	-	-
合 計	59, 945	2. 3	58, 564	2. 3
一般貸付計	2, 585, 222	100.0	2, 550, 112	100.0

<sup>(</sup>注)1. 国内向けの区分は、日本銀行の「貸出先別貸出金(業種別、設備資金新規貸出)」の業種分類に準拠しています。

<sup>2. 「</sup>国内向け貸付の合計」ならびに「一般貸付計」には日本国政府向け貸出を含みます。 (2018年度末 9,555億円、2019年度第2四半期(上半期)末 9,204億円)

## (5)貸付金担保別内訳

(単位:百万円、%)

	区	分		2018年度	末	2019年 <u>/</u> 第2四半期(上	
	·			金額	占率	金額	占率
担	保	貸	付	16, 221	0.6	14, 927	0.6
有	有 価 証	券 担 保	貸付	250	0.0	200	0.0
7	「動産・動	産・財団担	保貸付	15, 971	0.6	14, 727	0.6
捐	省名 債	権担保	貸付	ı	ı	ı	-
保	証	貸	付	22, 605	0. 9	22, 283	0.9
信	用	貸	付	2, 543, 123	98. 4	2, 509, 914	98. 4
そ		Ø	他	3, 272	0. 1	2, 986	0. 1
_	般	貸付	計	2, 585, 222	100.0	2, 550, 112	100.0
ž	ち劣後	後 特 約 付	貸付	117, 000	4. 5	117, 000	4. 6

## (6)貸付金地域別内訳

	区分		2018年度	沫	2019年度 第2四半期(上半期)末		
	_		金額	占率	金額	占率	
北	海	道	11, 355	0.5	10,000	0.4	
東		北	19, 309	0.8	17, 455	0.7	
関		東	2, 161, 029	85. 7	2, 151, 912	86. 5	
中		部	85, 688	3. 4	82, 629	3. 3	
近		畿	171, 143	6.8	166, 591	6.7	
中		国	26, 609	1.1	25, 927	1.0	
四		国	10, 100	0.4	5, 100	0. 2	
九		州	36,770	1.5	28, 945	1. 2	
	合 計		2, 522, 004	100.0	2, 488, 562	100.0	

<sup>(</sup>注)1. 個人ローン、非居住者貸付、保険約款貸付等は含みません。

<sup>2.</sup> 地域区分は、資料作成時点で当社が把握している貸付先の本社所在地によります。

## c. 海外投融資の状況

## (1) 資産別明細

### (ア)外貨建資産

(単位:百万円、%)

	区分		2018年度末	₹	2019年度 第2四半期(上半期)末		
			金額	占率	金 額	占率	
公	社	債	8, 276, 365	67. 1	8, 822, 966	69. 6	
株	式	等	909, 479	7. 4	987, 537	7.8	
現	預金・そ	の他	931, 248 7. 6		706, 849	5. 6	
外	貨 建 資	産 計	10, 117, 094	82. 1	10, 517, 353	83. 0	

#### (イ) 円貨額が確定した外貨建資産

(単位:百万円、%)

	区分		2018年度末	₹	2019年度 第2四半期(上半	
	<i>- x</i>		金 額	占率	金 額	占率
貸	付	金	155, 908	1.3	166, 717	1.3
公	社	債	1	1	-	1
現	預金・その	他	72, 786	0.6	74, 795	0.6
円外	貨額が確定し 貨建資産	た 計	228, 695	1. 9	241, 513	1. 9

#### (ウ) 円貨建資産

(単位:百万円、%)

								(平匹・口)		
		区	分			2018年度末	₹	2019年度 第2四半期(上半期)末		
		<b>,</b>				金 額	占率	金 額	占率	
公	· 社 債					1, 566, 453	12. 7	1, 574, 814	12. 4	
株	式 等				等	389, 096	3. 2	309, 392	2. 4	
非	居	住	者	貸	付	10,000	0. 1	10,000	0.1	
そ		0	0		他	14, 383	0. 1	24, 510	0.2	
円	貨 建 資 産 計				計	1, 979, 933	16. 1	1, 918, 717	15. 1	

## (エ) 合計

	Þ	<u> </u>	<del>``</del>		2018年度末	₹	2019年度 第2四半期(上半期)末		
	<b>,</b>	_ ,	•		金額	占率	金額	占率	
海外投融資					12, 325, 723	100.0	12, 677, 583	100.0	

<sup>(</sup>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価額としているものです。

### (2) 海外投融資の地域別構成

(単位:百万円、%)

			2018年	度末		20	19年度第2四半		1 /3   1 ( /0/
区分		外国証券			非居住者	外国証券 「			非居住者
		ア国証分	公社債 株式等 貸付		貸付	ア国証分	公社債	株式等	貸付
北米	金額	3, 637, 307	3, 163, 347	473, 959	49, 945	4, 086, 114	3, 604, 783	481, 331	48, 564
10 /	占率	34. 2	33. 7	38. 3	83. 3	37. 0	36. 5	40.6	82. 9
ヨーロッパ	金額	3, 278, 736	3, 269, 150	9, 586	5, 000	3, 291, 533	3, 277, 021	14, 512	5, 000
	占率	30.8	34. 8	0.8	8. 3	29.8	33. 2	1. 2	8. 5
オセアニア	金額	468, 747	468, 747	-	-	473, 860	473, 860	-	-
X E / = /	占率	4. 4	5. 0	-	-	4.3	4. 8	-	-
アジア	金額	93, 816	2, 129	91, 686	-	100, 624	2, 123	98, 501	-
	占率	0.9	0.0	7.4	-	0.9	0.0	8. 3	-
中南米	金額	2, 843, 476	2, 180, 384	663, 092	-	2, 803, 746	2, 213, 866	589, 880	-
	占率	26. 7	23. 2	53. 5	-	25. 4	22. 4	49.8	-
中東	金額	-	-	-	-	-	-	-	-
T 永	占率	-	-	-	-	-	-	-	-
アフリカ	金額	3, 705	3, 705	-	-	3, 704	3, 704	-	-
	占率	0.0	0.0	-	-	0.0	0.0	-	-
国際機関	金額	310, 628	310, 628	-	5, 000	293, 225	293, 225	-	5, 000
	占率	2. 9	3. 3	_	8. 3	2. 7	3. 0	_	8.5
合 計	金額	10, 636, 418	9, 398, 093	1, 238, 325	59, 945	11, 052, 809	9, 868, 583	1, 184, 225	58, 564
	占率	100.0	100. 0	100. 0	100. 0	100.0	100.0	100. 0	100.0

- (注)1. 本表は発行会社の国籍に基づき作成されています。
  - 2. 中南米向け外国証券は、その大部分が中南米に設立されたSPC(特別目的会社)が発行する債券もしくは優先出資証券、または海外投資信託等であり、発行会社の国籍に基づき中南米に分類されているものの、実質的には日本や 北米・ヨーロッパ・アジア・オセアニア地域への投資です。

## (3) 外貨建資産の通貨別構成

区分		2018年度末	Ę	2019年度 第2四半期(上半期)末			
		金 額	占率	金額	占率		
<b>米</b> ド	ル	5, 932, 327	58.6	6, 369, 508	60.6		
ュー	п	2, 452, 470	24. 2	2, 424, 732	23. 1		
豪ド	ル	1, 226, 942	12. 1	1, 151, 495	10.9		
ニュージーランド	ドル	300, 817	3.0	293, 457	2.8		
ポーランドズロ	ュチ	112, 432	1. 1	147, 980	1.4		
メキシコペ	ソ	_	1	41,602	0.4		
中 国	元	43, 175	0.4	39, 647	0.4		
ベトナムド	ン	33, 182	0.3	33, 181	0.3		
インドネシアル	ピア	15, 726	0.2	15, 725	0. 1		
そ の	他	19	0.0	22	0.0		
合 計		10, 117, 094	100.0	10, 517, 353	100. 0		

## 2. 個人変額保険・変額個人年金保険 特別勘定

## a. 売買目的有価証券の評価損益

## (1) 個人変額保険

(単位:百万円)

, Ta	2018年度末		9年度 月(上半期)末
区 分		損益に含 貸借対照表 評価損益 計上額	当期の損益に含 まれた評価損益
売買目的有価証	56, 955	5, 135 55, 478	4, 750

## (2) 変額個人年金保険

(単位:百万円)

	区		,			4			2018	年度末		9年度  (上半期)末
	区 分							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	月	的	有	価	証	券	155, 941	31, 193	87, 990	8, 132	

## b. 金銭の信託の時価情報

個人変額保険、変額個人年金保険ともに残高がないため、記載していません。

# c. デリバティブ取引の時価情報

## (1) 個人変額保険

(株式関連) (単位:百万円)

١,	W-41242							· · · · ·	· 11/4/14/	
12.			2018₫	F度末		2019年度第2四半期(上半期)末				
区分	種類	契約	額等	時価	差損益	契約	額等	時価	差損益	
			うち1年超	ь <del>Д</del> .ШП	左顶型		うち1年超	ъ <del>р</del> IIII	左頂皿	
取	株価指数先物									
引所	売建	_	-	-	-	_	-	_	_	
所	買建	_	_	_	_	899	_	11	11	
	合 計				-				11	

(通貨関連) (単位:百万円)

_ \^	世貝因(生)							(十座	· 🗆 // П/	
-			2018 <b></b>	<b>F度末</b>		2019年度第2四半期(上半期)末				
区分	種類	契約	額等	時価	差損益	契約	額等	時価	差損益	
"			うち1年超	h4J.IIII	左頂盆		うち1年超	₩77	左狽盆	
	為替予約									
	売建	_	_	_	-	66	_	Δ0	$\triangle 0$	
	(米ドル)	_	-	-	-	-	-	_	-	
店頭	(ユーロ)	_	_	_	-	-	_	_	_	
頭	(豪ドル)	_	-	-	-	66	-	△0	$\triangle 0$	
	買建	_	_	_	-	65	_	0	0	
	(米ドル)	_	-	_	-	65	-	0	0	
	(ユーロ)	_	1	-	-	_	-	ı	_	
					1	$\setminus$	$\setminus$	$\setminus$	$\triangle 0$	

<sup>(</sup>注)外貨建金銭債権債務等に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、開示の対象より除いています。

## (2) 変額個人年金保険

(株式関連) (単位:百万円)

	The ADDIVEN									
1.0			2018₫	<b>F度末</b>		2019年度第2四半期(上半期)末				
区分	種類	契約	契約額等		差損益	契約	契約額等		差損益	
			うち1年超	時価	左頂無		うち1年超	時価	左頂無	
取	株価指数先物									
引所	売建	684	_	3	3	_	-	-	_	
所	買建	468	_	6	6	2, 111	-	60	60	
	合 計				10				60	

(通貨関連) (単位:百万円)

	世兵 内在/							· · · –	. 11/2/11/		
12.			2018年	F度末		2019年度第2四半期(上半期)末					
区分	種類	契約額等		時価	差損益	契約	額等	時価	差損益		
"			うち1年超	h4.1III	左頂盆		うち1年超	₩4.ШП	左頂盆		
	為替予約										
	売建	_	_	_	_	81	_	△0	△0		
	(米ドル)	_	_	_	_	-	_	-	_		
店頭	(ユーロ)	_	_	_	_	-	_	-	_		
頭	(豪ドル)	_	_	_	_	81	_	△0	$\triangle 0$		
	買建	_	_	_	_	81	_	0	0		
	(米ドル)	_	-	_	_	81	_	0	0		
	(ユーロ)	_	-	ı	_	-	ı	-	_		
	合 計				1				$\triangle 0$		

<sup>(</sup>注)外貨建金銭債権債務等に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、開示の対象より除いています。

## 3. 会社計

## a. 資産の構成(会社計)

## (1) 資産の構成

(単位:百万円、%)

				:日万円、%)
区分	2018年	度末	2019年 第2四半期(」	
	金 額	占率	金 額	占率
現預金・コールローン	1, 748, 889	5. 3	1, 667, 215	5. 0
買入金銭債権	317, 252	1.0	393, 556	1.2
有 価 証 券	26, 764, 618	81.8	27, 426, 217	81. 9
公 社 債	13, 674, 725	41.8	13, 993, 667	41.8
株式	2, 010, 333	6. 1	1, 930, 666	5.8
外 国 証 券	10, 875, 563	33. 2	11, 301, 412	33. 7
公 社 債	9, 513, 439	29. 1	10, 002, 998	29. 9
株 式 等	1, 362, 123	4. 2	1, 298, 414	3. 9
その他の証券	203, 996	0.6	200, 470	0.6
貸 付 金	2, 874, 970	8.8	2, 835, 807	8.5
保険約款貸付	289, 747	0.9	285, 695	0.9
一般貸付	2, 585, 222	7. 9	2, 550, 112	7. 6
不 動 産	553, 738	1. 7	551,020	1.6
うち投資用	380, 980	1. 2	380, 164	1.1
繰 延 税 金 資 産	123, 979	0.4	77, 718	0. 2
そ の 他	347, 894	1. 1	544, 676	1.6
貸 倒 引 当 金	△870	△0.0	△823	△0.0
会 社 計	32, 730, 472	100.0	33, 495, 389	100.0
うち外貨建資産	10, 345, 122	31.6	10, 752, 491	32. 1

<sup>(</sup>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

(単位:百万円)

区分		2018年度 第2四半期(上半期)	2019年度 第2四半期(上半期)
		金 額	金 額
現預金・コールロー	ン	50, 811	△81,673
買入金銭債	権	△17,846	76, 303
有 価 証	券	792, 593	661, 599
公 社	債	112, 430	318, 941
株	式	81,008	△79, 666
外 国 証	券	538, 618	425, 849
公社	債	442, 548	489, 558
株式	等	96, 069	△63, 708
その他の証	券	60, 535	△3, 525
貸付	金	272, 773	△39, 163
保険約款貸	付	△2, 494	△4, 052
一般貸	付	275, 267	△35, 110
不動	産	△7, 041	△2, 717
うち投資	用	△5, 380	△815
繰 延 税 金 資	産	4, 428	△46, 260
そ の	他	△83, 228	196, 781
貸 倒 引 当	金	88	47
会 社 計		1, 012, 578	764, 916
うち外貨建資	産	799, 337	407, 369

(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。

## b. 有価証券の時価情報(会社計)

## (1) 売買目的有価証券の評価損益

(単位:百万円)

	2018≇	<b>F度末</b>	2019年度第2四	半期(上半期)末
区 分	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	782, 809	△25,801	719, 214	△23, 067

(注)本表では、「運用目的の金銭の信託」を通じて保有している有価証券も対象となっていますが、 2018年度末、2019年度第2四半期(上半期)末ともに残高はありません。

### (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)

		2	2018年度末				2019年度第	第2四半期(上		· D // 11/
区分	帳簿価額	時価	差損益	差益	差損	帳簿価額	時価	差損益	差益	差損
満期保有目的の債券	1, 799, 665	2, 132, 194	332, 529	332, 529	Δ0	1, 769, 534	2, 097, 246	327, 712	327, 714	Δ1
責任準備金対応債券	11, 674, 328	13, 813, 577	2, 139, 248	2, 147, 061	△7,813	11, 856, 654	14, 218, 978	2, 362, 323	2, 364, 312	△1,989
子会社・関連会社株式	33, 173	55, 574	22, 400	22, 400	1	33, 173	42, 643	9, 469	9, 469	-
その他有価証券	10, 912, 420	12, 196, 621	1, 284, 201	1, 359, 380	△75, 178	11, 623, 141	13, 170, 282	1, 547, 141	1, 620, 514	△73, 373
公 社 債	1, 746, 572	1, 849, 618	103, 045	104, 399	△1,353	1, 975, 348	2, 110, 895	135, 546	139, 427	△3,880
株式	839, 591	1, 747, 909	908, 317	946, 912	△38, 595	844, 318	1, 680, 215	835, 896	885, 478	△49, 582
外 国 証 券	7, 663, 264	7, 913, 036	249, 772	284, 817	△35, 044	7, 812, 392	8, 360, 286	547, 894	567, 650	△19,755
公 社 債	7, 184, 172	7, 422, 935	238, 763	273, 463	△34, 699	7, 278, 797	7, 801, 100	522, 303	541, 220	△18,917
株 式 等	479, 091	490, 100	11,008	11, 353	△345	533, 594	559, 186	25, 591	26, 429	△838
その他の証券	109, 895	125, 018	15, 123	15, 276	△153	155, 768	176, 038	20, 269	20, 279	△9
買入金銭債権	166, 297	174, 259	7, 962	7, 973	∆11	247, 313	254, 870	7, 557	7, 679	△121
譲 渡 性 預 金	386, 800	386, 779	△20	1	△20	588,000	587, 975	△24	ı	△24
そ の 他	ı	ı	ı	1	1	ı	ı	-	ı	-
合 計	24, 419, 588	28, 197, 967	3, 778, 379	3, 861, 372	△82, 992	25, 282, 504	29, 529, 151	4, 246, 646	4, 322, 011	△75, 364
公 社 債	13, 245, 407	15, 504, 192	2, 258, 784	2, 264, 800	△6,015	13, 534, 054	16, 004, 335	2, 470, 281	2, 475, 947	△5,666
株式	839, 591	1, 747, 909	908, 317	946, 912	△38, 595	844, 318	1, 680, 215	835, 896	885, 478	△49, 582
外 国 証 券	9, 671, 596	10, 259, 807	588, 211	626, 408	△38, 196	9, 913, 049	10, 825, 715	912, 665	932, 626	△19,961
公 社 債	9, 159, 330	9, 714, 132	554, 802	592, 654	△37,851	9, 346, 280	10, 223, 885	877, 604	896, 727	△19, 122
株 式 等	512, 265	545, 674	33, 408	33, 753	△345	566, 768	601, 829	35, 060	35, 899	△838
その他の証券	109, 895	125, 018	15, 123	15, 276	△153	155, 768	176, 038	20, 269	20, 279	△9
買入金銭債権	166, 297	174, 259	7, 962	7, 973	∆11	247, 313	254, 870	7, 557	7, 679	△121
譲渡性預金	386, 800	386, 779	△20	-	△20	588, 000	587, 975	△24	_	△24
その他	-	-	-	-	-	-	-	-	_	-

(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。

#### 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:日万円)
				Þ	<u> </u>	分				2018年度末	2019年度 第2四半期(上半期)末
	満	期	保	有	目	的	の	債	券	-	ı
	非		上	場	外	国		債	券	1	ı
	そ				の				他	_	-
	責	任	準	備	金	対	応	債	券	_	-
	子	숲	社	•	関連	会	社	株	式	586, 899	594, 379
	そ	0	כ	他	有	価		証	券	243, 910	120, 743
	非	上場	国内	株式	(店頭	売買枝	ŧ式	を除く	()	16, 136	21,898
	非	上場	外国	株式	(店頭	売買枝	夫式	を除く	()	224, 558	94, 558
	非		上	場	外	国		債	券	_	_
	そ				の				他	3, 215	4, 286
				₽	ì	₩				830, 809	715, 123

## c. 金銭の信託の時価情報(会社計)

### (1) 運用目的の金銭の信託

2018年度末、2019年度第2四半期(上半期)末ともに残高がないため、記載していません。

### (2) 運用目的以外の金銭の信託

2018年度末、2019年度第2四半期(上半期)末ともに残高がないため、記載していません。

## d. デリバティブ取引の時価情報(会社計)

#### 【定性的情報】

#### (1) 取引の内容

当社では、資産運用方針および運用する資金特性に応じて、以下のデリバティブ取引を活用しています。

	取引所取引	店頭取引
金利派生商品	1	金利スワップ、金利スワップション
為替派生商品		為替予約、通貨スワップ、通貨オプション
株式派生商品	株価指数先物、株価指数オプション	個別株オプション、株価指数オプション、
		株価指数先渡
債券派生商品	債券先物、債券先物オプション	債券現物オプション
その他		マルチ・アセット指数オプション

#### (2) 取組方針

当社では、主に保有する資産または負債の価値が変動するリスクを回避する目的で、デリバティブ 取引を活用しています。

また、運用する資金特性にそぐわないデリバティブ取引 (例えば、原資産の価格変動に対する当該 取引時価の変動率が大きいレバレッジの高い取引等) は行わないこととしています。

#### (3) 利用目的

当社では、外貨建資産に係る為替リスク等の回避を目的としたヘッジ取引、もしくはリスクを一定 範囲内に限定したデリバティブ取引を行っています。

なお、ヘッジ会計の適用要件を満たすヘッジ取引については、ヘッジ会計を適用しています。

#### (4) リスクの内容

当社が利用しているデリバティブ取引には、現物資産と同様に、市場リスクと信用リスクがあります。

#### ア. 市場リスク

金利、株価、為替等の市場の変動およびキャッシュフローの変動によって保有するポートフォリオやポジションの価値が変動するリスクをいいます。

#### イ. 信用リスク

与信先の信用状態の変化により保有するポートフォリオやポジションの価値が変動するリスクをいいます。 (デリバティブ取引の取引相手先のデフォルト (債務不履行) により、保有するポジションから期待する経済効果を得られないリスクを含みます。)

#### (5) リスク管理体制

### ア. リスク管理の基本方針

保有する資産または負債に対して効果的にデリバティブ取引が活用されているか、また、投資 案件ごとに設定した運用方針、運用ルール、報告体制が遵守されているか等を定期的に確認す ることで、リスクの顕在化を未然に防止することをリスク管理の基本としています。

#### イ. リスク管理部署

収益部門から独立した資産運用リスク管理部署が、デリバティブ取引のリスク状況を株式、債券等原資産とあわせて管理しています。

#### ウ. リスク管理規定

「資産運用リスク管理方針」および「資産運用リスク管理規程」において、デリバティブ取引についての利用目的、取組対象、およびリスク管理体制等を規定しています。また、資産運用部門の細則等において、各部それぞれの役割に応じた具体的な取組みを規定しています。

#### エ. リスク管理

ヘッジ取引を行う場合は、ヘッジ対象である原資産とヘッジ手段としてのデリバティブ取引を あわせてリスクを定量的に把握・分析・管理しています。

ヘッジ取引に該当しない取引を行う場合は、取引限度額、許容リスク量を設定するとともにロス・カット・ルールを策定し、ポジション状況、リスク状況および損益状況を管理しています。

#### (6) 定量的情報に関する補足説明

#### ア. デリバティブ取引に関わる信用リスクの状況

債権債務の関係が法的に相殺可能である契約については、取引相手先が当社に対して有する 与信額を考慮したネットベースのカレント・エクスポージャー方式で信用リスク相当額を算出し ています。

(単位:億円)

	契約金額·	想定元本額	信用リス	ク相当額
	2018年9月末	2019年9月末	2018年9月末	2019年9月末
金利スワップ 金利スワップション(買建)	834	736	15	4
為替予約	75, 059	100, 283	967	3, 710
通貨スワップ 通貨オプション(買建)	4, 239	7, 059	485	624
債券現物オプション(買建)	_	64	_	0
マルチ・アセット指数オプション(買建)	196	1, 100	23	196
合 計			630	3, 705

- (注1) 契約金額・想定元本額は、取引を執行する際の計算基礎として位置付けられているものであり、リスク量を表す指標ではありません。
- (注2) 取引種類別の信用リスク相当額は、取引相手先が当社に対して有する与信額を考慮しないグロスベースのカレント・エクスポージャー方式で算出しており、合計 (ネットベースのカレント・エクスポージャー方式にて算出) とは一致しません。

#### イ. 差損益に関する補足説明

ヘッジ取引については、ヘッジ手段とヘッジ対象の対応関係を明確にした上で取り組んでおり、 ヘッジ手段としてのデリバティブ取引の損益を単独で認識するのではなく、ヘッジ対象としての 資産・負債の損益と合算して認識する必要があります。

したがって、ヘッジ手段とヘッジ対象を一体として管理することで、為替変動リスク、金利変動リスク等が減殺されている効果を確認しています。

### 【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)(会社計)

(単位:百万円)

	区 分			2018年	F度末				2019	年度第2四	半期(上半	期)末	
	区 分	金利関連	通貨関連	株式関連	債券関連	その他	合計	金利関連	通貨関連	株式関連	債券関連	その他	合計
ĺ	ヘッジ会計適用分	452	47, 271	-	-	-	47, 723	△39	169, 628	-	-	-	169, 589
	ヘッジ会計非適用分	_	410	Δ1	1	1, 232	1,641	-	41, 953	△275	19	4, 282	45, 979
	合 計	452	47, 681	Δ1	1	1, 232	49, 365	△39	211, 581	△275	19	4, 282	215, 568

(注)ヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ適用分、及び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。 なお時価ヘッジ適用分の差損益は、2018年度末通貨関連 28,497百万円、2019年度第2四半期(上半期)末通貨関連 143,780百万円となっています。

## (2) 金利関連(会社計)

#### (ヘッジ会計が適用されていないもの)

2018年度末、2019年度第2四半期(上半期)末ともに残高がないため、記載していません。

#### (ヘッジ会計が適用されているもの)

	ateria Micro			2018年度末		第2匹	朝)末	
ヘッジ会計の方法	種類	主なヘッジ対象	契約	額等	時価	契約	額等	時価
				うち1年超	好価		うち1年超	好価
繰延ヘッジ	金利スワップ	貸付金						
緑連ペック	固定金利受取/変動金利支払	買削並	15,000	15,000	39	15, 500	15, 500	98
	金利スワップ							
特例処理	固定金利受取/変動金利支払	貸付金	14, 236	4, 535	64	10, 095	190	34
	固定金利支払/変動金利受取		49, 945	49, 945	349	48, 564	48, 564	△172
	合 計	•			452			△39

## (3) 通貨関連(会社計)

(ヘッジ会計が適用されていないもの)

(単位:百万円)

H			2018₫	F度末		20	19年度第2四	半期(上半期)	末
区分	種類	契約	額等	時価	差損益	契約	額等	時価	差損益
~			うち1年超	h4.1ml	左頂盆		うち1年超	M-44.1m1	左頂盆
	為替予約								
	<b>売建</b>	652, 734	-	7, 430	7, 430	1, 552, 100	-	52, 557	52, 557
	(米ドル)	147, 543	-	△2, 178	△2, 178	824, 555	-	5, 942	5, 942
	(豪ドル)	462, 061	-	8, 999	8, 999	290, 036	-	12, 328	12, 328
	(ユーロ)	32, 214	-	509	509	286, 838	-	21, 238	21, 238
	(ニュージーランドドル)	1, 718	_	△6	△6	144, 613	-	13, 183	13, 183
	買建	291, 802	_	△6, 908	△6, 908	1, 252, 131	_	△9, 246	△9, 246
	(米ドル)	23, 024	-	125	125	636, 899	-	6, 119	6, 119
	(ユーロ)	400	-	△0	△0	328, 330	-	△171	△171
	(豪ドル)	266, 038	-	△7,036	△7,036	154, 233	-	△12, 340	△12, 340
	(ニュージーランドドル)	-	-	-	_	132, 619	-	△2, 853	△2, 853
店頭	通貨オプション								
央	売建								
	コール	172, 500	-			282, 750	-		
		(465)		425	39	(897)		529	367
	(米ドル)	172, 500	1			282, 750	-		
		(465)		425	39	(897)		529	367
	買建								
	プット	157, 500	-			256, 500	_		
	(Mr. In a.)	(1, 585)		1, 434	△151	(2, 225)		501	△1,724
	(米ドル)	157, 500	-			256, 500	_		4.4 =6:
		(1, 585)		1, 434	△151	(2, 225)		501	△1, 724
	合 計				410				41, 953

- (注)1. ( )内には、オプション料を記載しています。
  - 2. 差損益欄には、為替予約については時価を記載し、 オプション取引についてはオプション料と時価との差額を記載しています。

### (ヘッジ会計が適用されているもの)

ヘッジ会計 の方法	種類	主なヘッジ . 対象		2018年度末		(平位: 日ガ川) 2019年度 第2四半期(上半期)末			
			契約額等		時価	契約	m-t- Ant		
				うち1年超	№ <b>4</b> .1mi		うち1年超	時価	
	為替予約								
	売建		6, 760, 420	437, 618	28, 497	7, 224, 127	429, 004	143, 780	
時価ヘッジ	(米ドル)	从心种欢立	3, 009, 559	-	△37,510	3, 459, 864	-	△11,743	
44.111/1/20 20	(ユーロ)	外貨建資産	2, 404, 420	-	73, 119	2, 333, 526	-	113,016	
	(豪ドル)		952, 792	437, 618	△4, 106	943, 257	429, 004	22, 849	
	通貨スワップ		37, 806	37, 806	△972	37, 806	37, 806	△1,476	
繰延ヘッジ	(米ドル)	外貨建資産	35, 351	35, 351	△893	35, 351	35, 351	△1,493	
殊進・ソン	(ユーロ)	/ ア貝足貝座	2, 454	2, 454	△78	2, 454	2, 454	16	
	通貨スワップ	外貨建資産	155, 908	155, 908	8, 192	166, 717	166, 717	12,717	
	(米ドル)	/ 原建黄座	155, 908	155, 908	8, 192	166, 717	166, 717	12,717	
振当処理									
	通貨スワップ	外貨建負債	244, 924	244, 924	11,553	244, 924	244, 924	14, 606	
	(米ドル)	/ 「 東 是 具 頂	244, 924	244, 924	11,553	244, 924	244, 924	14, 606	
	合 計				47, 271			169, 628	

### (4) 株式関連(会社計)

(ヘッジ会計が適用されていないもの)

(単位:百万円)

区分	種類	2018年度末				2019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	-7 іш	<b>左</b> 頂亚		うち1年超	, 44 limi	<b>左</b> 城亚	
取引所	株価指数先物 売建 買建	684 5, 568		3 △5	3 △5	1, 142 52, 259	-	△0 △274	△0 △274	
	合 計				Δ1				△275	

(注)差損益欄には、時価を記載しています。

#### (ヘッジ会計が適用されているもの)

2018年度末、2019年度第2四半期(上半期)末ともに残高がないため、記載していません。

#### (5) 債券関連(会社計)

(ヘッジ会計が適用されていないもの)

(単位:百万円)

								(十)止。	<u> ロルロ/</u>
区分	種類	2018年度末				2019年度第2四半期(上半期)末			
		契約額等		時価	<b>共相</b>	契約額等		nds.Ant	*#*
			うち1年超	ъ.Д.ДЩ	差損益		うち1年超	時価	差損益
取引所	<b>債券先物</b> 買建	-	1	-	ı	2, 803	1	9	9
	<b>債券</b> オプション 売建								
	コール	-	-			10, 798	-		
		( - )		_	-	(12)		3	8
店頭	プット	-	-			16, 338	-		
		( - )		-	-	(15)		14	0
	買建								
	コール	_	-			6, 049	-		
		( - )		-	-	(3)		2	Δ1
	プット	-	-			407	-		
		( - )		-	_	(3)		5	1
	合 計	/			-				19

- (注)1. ( )内には、オプション料を記載しています。
  - 2. 差損益欄には、先物取引については時価を記載し、 オプション取引についてはオプション料と時価との差額を記載しています。

#### (ヘッジ会計が適用されているもの)

2018年度末、2019年度第2四半期(上半期)末ともに残高がないため、記載していません。

### (6)その他(会社計)

(ヘッジ会計が適用されていないもの)

(単位:百万円)

区	種類		2018 <b></b>	F度末		2019年度第2四半期(上半期)末			
分		契約額等		時価	差損益	契約額等		時価	差損益
			うち1年超	MI IV	<b>左顶皿</b>		うち1年超	на іші	在风面
	マルチ・アセット指数オプション								
	売 建								
	コール	78, 933	-			119, 454	-		
店頭		(34)		197	△163	(167)		2, 127	△1,959
-	買建								
	コール	72, 059	-			110, 011	-		
		(1, 567)		2, 963	1, 395	(2, 435)		8, 677	6, 242
	合 計				1, 232				4, 282

(注)1. ( )内には、オプション料を記載しています。

2. 差損益欄には、オプション料と時価との差額を記載しています。

#### (ヘッジ会計が適用されているもの)

2018年度末、2019年度第2四半期(上半期)末ともに残高がないため、記載していません。