

2020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) 貸付金業種別内訳	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	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 頁

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	2019年度末		2020年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
国 債	9,975,756	37.2	10,096,804	35.5
地 方 債	211,689	0.8	212,836	0.7
社 債	3,621,624	13.5	3,688,580	13.0
うち公社・公団債	2,267,727	8.5	2,281,020	8.0
うち外貨建	549,151	2.0	591,838	2.1
株 式	1,718,821	6.4	2,130,001	7.5
外 国 証 券	10,959,518	40.9	11,935,259	42.0
公 社 債	9,611,587	35.9	10,285,989	36.2
うち外貨建	7,985,172	29.8	8,668,088	30.5
株 式 等	1,347,930	5.0	1,649,269	5.8
うち外貨建	1,227,638	4.6	1,521,454	5.4
その他の証券	303,462	1.1	343,165	1.2
合 計	26,790,871	100.0	28,406,648	100.0
うち外貨建	9,761,962	36.4	10,781,381	38.0

(2) 地域別地方債保有内訳

(単位：百万円)

区 分	2019年度末	2020年度 第2四半期(上半期)末
北 海 道	2,312	2,235
東 北	-	-
関 東	86,522	85,951
中 部	38,267	38,119
近 畿	42,538	45,094
中 国	8,141	8,067
四 国	-	-
九 州	33,906	33,368
合 計	211,689	212,836

(3) 有価証券残存期間別残高

<2019年度末>

(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 ないもの	合 計
有 価 証 券	551,068	809,023	1,241,082	2,382,331	5,120,099	12,989,790	3,697,476	26,790,871
国 債	134,999	353,716	138,970	550,265	2,372,877	6,424,926	-	9,975,756
地 方 債	-	-	8,812	-	2,827	200,049	-	211,689
社 債	39,943	122,063	279,102	413,915	332,420	2,057,423	376,755	3,621,624
株 式							1,718,821	1,718,821
外 国 証 券	376,124	333,068	814,197	1,417,489	2,410,747	4,307,390	1,300,499	10,959,518
公 社 債	376,106	329,803	812,292	1,412,694	2,400,849	4,279,840	-	9,611,587
株 式 等	18	3,264	1,904	4,795	9,897	27,549	1,300,499	1,347,930
その他の証券	-	174	-	660	1,226	-	301,400	303,462
買入金銭債権	23,998	-	-	-	-	169,072	-	193,071
譲渡性預金	435,863	-	-	-	-	-	-	435,863
そ の 他	-	-	-	-	-	-	-	-
合 計	1,010,931	809,023	1,241,082	2,382,331	5,120,099	13,158,863	3,697,476	27,419,806

<2020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 ないもの	合 計
有 価 証 券	297,834	769,611	1,457,042	2,907,400	5,492,921	13,044,094	4,437,743	28,406,648
国 債	78,970	293,130	157,401	567,200	2,762,313	6,237,787	-	10,096,804
地 方 債	-	2,839	5,971	-	4,174	199,850	-	212,836
社 債	31,909	144,754	292,599	500,806	259,598	2,071,900	387,012	3,688,580
株 式							2,130,001	2,130,001
外 国 証 券	186,955	328,886	1,000,257	1,839,392	2,462,787	4,534,555	1,582,423	11,935,259
公 社 債	186,937	325,712	998,405	1,834,329	2,449,081	4,491,523	-	10,285,989
株 式 等	18	3,174	1,851	5,063	13,705	43,032	1,582,423	1,649,269
その他の証券	-	0	812	-	4,047	-	338,305	343,165
買入金銭債権	307,933	-	-	-	-	163,151	-	471,084
譲渡性預金	480,466	-	-	-	-	-	-	480,466
そ の 他	-	-	-	-	-	-	-	-
合 計	1,086,234	769,611	1,457,042	2,907,400	5,492,921	13,207,246	4,437,743	29,358,199

(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、%)

区 分		2019年度末		2020年度 第2四半期(上半期)末	
		金 額	占率	金 額	占率
水産・農林業		243	0.0	282	0.0
鉱業		49	0.0	44	0.0
建設業		57,952	3.4	63,935	3.0
製 造 業	食料品	71,436	4.2	81,443	3.8
	繊維製品	8,629	0.5	9,094	0.4
	パルプ・紙	6,807	0.4	6,972	0.3
	化学	188,428	11.0	265,185	12.5
	医薬品	167,246	9.7	200,600	9.4
	石油・石炭製品	4,438	0.3	4,432	0.2
	ゴム製品	9,903	0.6	10,167	0.5
	ガラス・土石製品	22,518	1.3	27,722	1.3
	鉄鋼	11,213	0.7	12,303	0.6
	非鉄金属	27,978	1.6	34,217	1.6
	金属製品	6,423	0.4	7,808	0.4
	機械	121,747	7.1	167,933	7.9
	電気機器	195,553	11.4	250,319	11.8
	輸送用機器	60,834	3.5	76,685	3.6
	精密機器	15,125	0.9	21,937	1.0
その他製品	49,815	2.9	59,062	2.8	
電気・ガス業		28,105	1.6	28,934	1.4
運 輸 ・ 情 報 通 信 業	陸運業	159,013	9.3	194,398	9.1
	海運業	2,042	0.1	2,375	0.1
	空運業	3,438	0.2	3,300	0.2
	倉庫・運輸関連業	7,303	0.4	8,436	0.4
	情報・通信業	52,496	3.1	67,811	3.2
商 業	卸売業	116,705	6.8	138,931	6.5
	小売業	22,638	1.3	32,503	1.5
金 融 ・ 保 険 業	銀行業	109,581	6.4	140,033	6.6
	証券、商品先物取引業	3,727	0.2	3,977	0.2
	保険業	108,437	6.3	119,559	5.6
	その他金融業	15,001	0.9	14,538	0.7
不動産業		21,592	1.3	23,167	1.1
サービス業		42,393	2.5	51,882	2.4
合 計		1,718,821	100.0	2,130,001	100.0

(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)

区 分	2019年度末	2020年度 第2四半期(上半期)末
保 険 約 款 貸 付	281,112	270,459
契 約 者 貸 付	256,882	246,806
保 険 料 振 替 貸 付	24,229	23,652
一 般 貸 付 (うち非居住者貸付)	1,818,472 (48,973)	1,655,351 (47,610)
企 業 貸 付 (うち国内企業向け)	1,588,214 (1,539,241)	1,560,934 (1,513,324)
国・国際機関・政府関係機関貸付	213,528	70,384
公 共 団 体 ・ 公 企 業 貸 付	14,000	21,500
住 宅 ロ ー ン	2,727	2,531
消 費 者 ロ ー ン	2	2
そ の 他	-	-
合 計	2,099,584	1,925,810

(2) 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 第2四半期(上半期)末	
			占率		占率
大 企 業	貸付先数	177	75.6	172	74.8
	金 額	1,354,530	88.0	1,324,064	87.5
中 堅 企 業	貸付先数	-	-	-	-
	金 額	-	-	-	-
中 小 企 業	貸付先数	57	24.4	58	25.2
	金 額	184,710	12.0	189,259	12.5
国内企業向け 貸 付 計	貸付先数 金 額	234 1,539,241	100.0 100.0	230 1,513,324	100.0 100.0

(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 企業種		②小売業、飲食業		③サービス業		④卸売業	
	常用する 従業員 300人超 かつ	資本金 10億円以上	常用する 従業員 50人超 かつ	資本金 10億円以上	常用する 従業員 100人超 かつ	資本金 10億円以上	常用する 従業員 100人超 かつ	資本金 10億円以上
大 企 業		資本金 10億円以上		資本金 10億円以上		資本金 10億円以上		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人以下		資本金5千万円以下または 常用する従業員50人以下		資本金5千万円以下または 常用する従業員100人以下		資本金1億円以下または 常用する従業員100人以下	

- 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。
- 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。
- サービス業は、「物品貸貸業」、「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。
- 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

<2019年度末>

(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 ないもの	合 計
変 動 金 利	95,433	259	1,392	17,472	7,561	52,376	10,000	184,494
固 定 金 利	334,849	231,740	201,631	218,987	209,458	437,310	-	1,633,977
一 般 貸 付 計	430,282	231,999	203,023	236,459	217,020	489,686	10,000	1,818,472

<2020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 ないもの	合 計
変 動 金 利	94,514	152	1,375	17,833	6,986	52,833	10,000	183,695
固 定 金 利	168,311	258,352	189,103	243,157	151,812	460,919	-	1,471,656
一 般 貸 付 計	262,826	258,504	190,478	260,991	158,798	513,752	10,000	1,655,351

(4) 貸付金業種別内訳

(単位：百万円、%)

区分	2019年度末		2020年度 第2四半期(上半期)末		
	金額	占率	金額	占率	
	189,725	10.4	188,885	11.4	
製造業	食料	12,132	0.7	11,852	0.7
	繊維	400	0.0	900	0.1
	木材・木製品	600	0.0	600	0.0
	パルプ・紙	13,390	0.7	11,820	0.7
	印刷	-	-	-	-
	化学	25,856	1.4	27,584	1.7
	石油・石炭	31,750	1.7	31,750	1.9
	窯業・土石	8,522	0.5	7,770	0.5
	鉄鋼	46,300	2.5	45,300	2.7
	非金属製品	1,300	0.1	1,225	0.1
	金属製品	148	0.0	127	0.0
	はん用・生産用・業務用機械	12,442	0.7	13,259	0.8
	電気機械	20,738	1.1	20,657	1.2
	輸送用機械	14,546	0.8	14,459	0.9
その他の製造業	1,600	0.1	1,580	0.1	
国内向け	農業、林業	-	-	-	-
	漁業	-	-	-	-
	鉱業、採石業、砂利採取業	-	-	-	-
	建設業	2,522	0.1	2,865	0.2
	電気・ガス・熱供給・水道業	219,890	12.1	219,618	13.3
	情報通信業	26,100	1.4	26,100	1.6
	運輸業、郵便業	156,332	8.6	162,958	9.8
	卸売業	371,850	20.4	349,800	21.1
	小売業	5,983	0.3	5,837	0.4
	金融業、保険業	305,737	16.8	308,680	18.6
	不動産業	158,677	8.7	160,487	9.7
	物品賃貸業	108,111	5.9	101,125	6.1
	学術研究、専門・技術サービス業	-	-	-	-
	宿泊業	-	-	-	-
	飲食業	-	-	-	-
	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	0.5	9,091	0.5
	地方公共団体	-	-	-	-
個人(住宅・消費・納税資金等)	2,729	0.2	2,533	0.2	
合計	1,769,498	97.3	1,607,741	97.1	
海外向け	政府等	-	-	-	-
	金融機関等	48,973	2.7	47,610	2.9
	商工業等	-	-	-	-
合計	48,973	2.7	47,610	2.9	
一般貸付計	1,818,472	100.0	1,655,351	100.0	

(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。

2. 「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。
(2019年度末 2,127億円、2020年度第2四半期(上半期)末 697億円)

(5) 貸付金担保別内訳

(単位：百万円、%)

区 分	2019年度末		2020年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
担 保 貸 付	14,177	0.8	12,920	0.8
有 価 証 券 担 保 貸 付	150	0.0	100	0.0
不 動 産 ・ 動 産 ・ 財 団 担 保 貸 付	14,027	0.8	12,820	0.8
指 名 債 権 担 保 貸 付	-	-	-	-
保 証 貸 付	17,907	1.0	17,344	1.0
信 用 貸 付	1,783,658	98.1	1,622,552	98.0
そ の 他	2,729	0.2	2,533	0.2
一 般 貸 付 計	1,818,472	100.0	1,655,351	100.0
う ち 劣 後 特 約 付 貸 付	117,000	6.4	121,000	7.3

(6) 貸付金地域別内訳

(単位：百万円、%)

区 分	2019年度末		2020年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
北 海 道	9,997	0.6	9,943	0.6
東 北	18,813	1.1	18,961	1.2
関 東	1,439,883	81.5	1,281,407	79.8
中 部	92,601	5.2	89,572	5.6
近 畿	149,672	8.5	147,923	9.2
中 国	21,001	1.2	20,374	1.3
四 国	5,100	0.3	5,100	0.3
九 州	29,700	1.7	31,925	2.0
合 計	1,766,769	100.0	1,605,208	100.0

(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。

2. 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	2019年度末		2020年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
公 社 債	8,534,323	67.7	9,259,926	68.7
株 式 等	1,227,638	9.7	1,521,454	11.3
現 預 金 ・ そ の 他	691,720	5.5	504,602	3.7
外 貨 建 資 産 計	10,453,682	82.9	11,285,984	83.7

(イ) 円貨額が確定した外貨建資産

(単位：百万円、%)

区 分	2019年度末		2020年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
貸 付 金	168,916	1.3	168,916	1.3
現 預 金 ・ そ の 他	72,843	0.6	73,030	0.5
円 貨 額 が 確 定 し た 外 貨 建 資 産 計	241,759	1.9	241,947	1.8

(ウ) 円貨建資産

(単位：百万円、%)

区 分	2019年度末		2020年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
公 社 債	1,626,415	12.9	1,617,900	12.0
株 式 等	277,123	2.2	332,922	2.5
そ の 他	4,382	0.0	4,867	0.0
円 貨 建 資 産 計	1,907,921	15.1	1,955,690	14.5

(エ) 合計

(単位：百万円、%)

区 分	2019年度末		2020年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
海 外 投 融 資	12,603,363	100.0	13,483,621	100.0

(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、%)

区 分	2019年度末				2020年度第2四半期(上半期)末				
	外国証券	公社債	株式等	非居住者 貸付	外国証券	公社債	株式等	非居住者 貸付	
北 米	金額	4,248,785	3,689,348	559,437	48,973	4,203,816	3,596,158	607,658	47,610
	占率	38.8	38.4	41.5	100.0	35.2	35.0	36.8	100.0
ヨーロッパ	金額	3,039,756	3,021,100	18,655	-	3,368,946	3,346,109	22,837	-
	占率	27.7	31.4	1.4	-	28.2	32.5	1.4	-
オセアニア	金額	413,378	413,378	-	-	847,568	847,568	-	-
	占率	3.8	4.3	-	-	7.1	8.2	-	-
ア ジ ア	金額	119,765	2,096	117,669	-	120,431	2,084	118,346	-
	占率	1.1	0.0	8.7	-	1.0	0.0	7.2	-
中 南 米	金額	2,816,180	2,164,013	652,167	-	3,076,918	2,176,490	900,427	-
	占率	25.7	22.5	48.4	-	25.8	21.2	54.6	-
中 東	金額	-	-	-	-	-	-	-	-
	占率	-	-	-	-	-	-	-	-
ア フ リ カ	金額	3,664	3,664	-	-	3,648	3,648	-	-
	占率	0.0	0.0	-	-	0.0	0.0	-	-
国際機関	金額	317,985	317,985	-	-	313,929	313,929	-	-
	占率	2.9	3.3	-	-	2.6	3.1	-	-
合 計	金額	10,959,518	9,611,587	1,347,930	48,973	11,935,259	10,285,989	1,649,269	47,610
	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

(単位：百万円、%)

区 分	2019年度末		2020年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
米 ド ル	6,745,962	64.5	6,688,579	59.3
ユ ー ロ	2,123,674	20.3	2,411,603	21.4
豪 ド ル	999,089	9.6	1,506,228	13.3
ニュージーランドドル	282,425	2.7	313,066	2.8
ポーランドズロチ	148,842	1.4	171,951	1.5
ベトナムドン	52,247	0.5	52,251	0.5
メキシコペソ	45,949	0.4	51,880	0.5
中 国 元	39,748	0.4	40,426	0.4
カナダドル	-	-	34,254	0.3
インドネシアルピア	15,722	0.2	15,723	0.1
そ の 他	21	0.0	20	0.0
合 計	10,453,682	100.0	11,285,984	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)

区 分	2019年度末		2020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	49,058	208	53,325	5,472

(2) 変額個人年金保険

(単位：百万円)

区 分	2019年度末		2020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	72,918	3,261	71,002	5,097

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)

区分	種 類	2019年度末			2020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	-	-	-	-	-	-	-	
	買建	516	-	7	7	1,683	-	58	
	合 計				7			58	

(通貨関連)

(単位：百万円)

区分	種 類	2019年度末			2020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		
店頭	為替予約								
	売建	132	-	0	0	-	-	-	
	(米ドル)	-	-	-	-	-	-	-	
	(ユーロ)	132	-	0	0	-	-	-	
	買建	132	-	△0	△0	-	-	-	
	(米ドル)	-	-	-	-	-	-	-	
	(ユーロ)	132	-	△0	△0	-	-	-	
	合 計				△0			-	

(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)

区分	種 類	2019年度末			2020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	-	-	-	-	-	-	-	
	買建	781	-	11	11	400	-	13	
	合 計							11	
									13

(通貨関連)

(単位：百万円)

区分	種 類	2019年度末			2020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			
店頭	為替予約								
	売建	91	-	0	0	-	-	-	
	(米ドル)	-	-	-	-	-	-	-	
	(ユーロ)	91	-	0	0	-	-	-	
	買建	90	-	△0	△0	-	-	-	
	(米ドル)	-	-	-	-	-	-	-	
	(ユーロ)	90	-	△0	△0	-	-	-	
	合 計							0	
									-

(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、%)

区 分	2019年度末		2020年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
現預金・コールローン	1,822,293	5.5	1,693,027	4.9
買入金銭債権	326,239	1.0	600,768	1.7
有 価 証 券	27,423,878	83.2	29,110,038	84.8
公 社 債	14,101,856	42.8	14,306,162	41.7
株 式	1,831,515	5.6	2,266,200	6.6
外 国 証 券	11,181,658	33.9	12,185,720	35.5
公 社 債	9,731,023	29.5	10,404,618	30.3
株 式 等	1,450,635	4.4	1,781,101	5.2
その他の証券	308,848	0.9	351,955	1.0
貸 付 金	2,099,584	6.4	1,925,810	5.6
保険約款貸付	281,112	0.9	270,459	0.8
一 般 貸 付	1,818,472	5.5	1,655,351	4.8
不 動 産	558,552	1.7	557,657	1.6
う ち 投 資 用	389,872	1.2	389,870	1.1
繰延税金資産	214,138	0.6	67,991	0.2
そ の 他	507,235	1.5	382,162	1.1
貸倒引当金	△816	△0.0	△744	△0.0
会 社 計	32,951,105	100.0	34,336,712	100.0
う ち 外 貨 建 資 産	10,666,182	32.4	11,527,069	33.6

(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	2019年度 第2四半期(上半期)	2020年度 第2四半期(上半期)
	金 額	金 額
現預金・コールローン	△81,673	△129,266
買入金銭債権	76,303	274,529
有 価 証 券	661,599	1,686,160
公 社 債	318,941	204,305
株 式	△79,666	434,684
外 国 証 券	425,849	1,004,061
公 社 債	489,558	673,595
株 式 等	△63,708	330,466
その他の証券	△3,525	43,107
貸 付 金	△39,163	△173,773
保険約款貸付	△4,052	△10,653
一 般 貸 付	△35,110	△163,120
不 動 産	△2,717	△894
う ち 投 資 用	△815	△2
繰延税金資産	△46,260	△146,146
そ の 他	196,781	△125,072
貸倒引当金	47	71
会 社 計	764,916	1,385,607
う ち 外 貨 建 資 産	407,369	860,886

(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)

区 分	2019年度末		2020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	633,006	△68,569	703,390	43,331

(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、2019年度末、2020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)

区 分	2019年度末					2020年度第2四半期(上半期)末				
	帳簿価額	時価	差損益	差益		帳簿価額	時価	差損益	差益	
				差益	差損				差益	差損
満期保有目的の債券	1,725,807	2,049,016	323,208	323,213	△5	1,635,302	1,917,387	282,085	282,092	△6
責任準備金対応債券	12,029,249	14,032,115	2,002,866	2,014,096	△11,230	12,051,366	13,896,625	1,845,258	1,869,873	△24,615
子会社・関連会社株式	52,238	27,869	△24,369	-	△24,369	52,238	36,435	△15,802	-	△15,802
その他有価証券	11,788,547	12,951,026	1,162,478	1,335,068	△172,589	13,142,314	14,954,296	1,811,982	1,897,527	△85,544
公 社 債	2,128,756	2,205,625	76,869	90,306	△13,437	2,325,829	2,408,327	82,497	108,254	△25,757
株 式	996,146	1,595,204	599,057	679,946	△80,889	1,080,784	2,006,753	925,968	975,828	△49,859
外 国 証 券	7,739,602	8,223,698	484,096	544,125	△60,028	8,486,050	9,253,601	767,550	776,389	△8,839
公 社 債	6,967,667	7,459,975	492,308	529,922	△37,613	7,489,890	8,189,215	699,324	706,873	△7,548
株 式 等	771,934	763,722	△8,211	14,203	△22,415	996,160	1,064,385	68,225	69,516	△1,291
その他の証券	303,523	297,562	△5,960	12,202	△18,163	305,920	334,063	28,143	29,027	△883
買入金銭債権	184,619	193,071	8,451	8,486	△34	463,228	471,084	7,856	8,026	△170
譲渡性預金	435,900	435,863	△36	-	△36	480,500	480,466	△33	-	△33
その他	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
合 計	25,595,843	29,060,026	3,464,183	3,672,378	△208,194	26,881,221	30,804,744	3,923,523	4,049,493	△125,969
公 社 債	13,732,200	15,797,682	2,065,481	2,084,466	△18,985	13,915,725	15,778,825	1,863,100	1,909,270	△46,170
株 式	996,146	1,595,204	599,057	679,946	△80,889	1,080,784	2,006,753	925,968	975,828	△49,859
外 国 証 券	9,943,452	10,740,642	797,190	887,275	△90,085	10,635,063	11,733,551	1,098,487	1,127,339	△28,852
公 社 債	9,119,279	9,949,050	829,771	873,072	△43,300	9,586,664	10,632,729	1,046,065	1,057,823	△11,758
株 式 等	824,173	791,591	△32,581	14,203	△46,784	1,048,398	1,100,821	52,422	69,516	△17,093
その他の証券	303,523	297,562	△5,960	12,202	△18,163	305,920	334,063	28,143	29,027	△883
買入金銭債権	184,619	193,071	8,451	8,486	△34	463,228	471,084	7,856	8,026	△170
譲渡性預金	435,900	435,863	△36	-	△36	480,500	480,466	△33	-	△33
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：百万円)

区 分	2019年度末	2020年度第2四半期(上半期)末
満期保有目的の債券	-	-
非上場外国債券	-	-
その他	-	-
責任準備金対応債券	-	-
子会社・関連会社株式	593,981	596,523
その他有価証券	62,246	62,611
非上場国内株式(店頭売買株式を除く)	21,841	21,473
非上場外国株式(店頭売買株式を除く)	34,558	34,558
非上場外国債券	-	-
その他	5,845	6,579
合 計	656,227	659,134

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

2019年度末、2020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

2019年度末、2020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	－	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、債券等原資産と合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合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	
	2019年9月末	2020年9月末	2019年9月末	2020年9月末
金利スワップ 金利スワップション(買建)	736	1,104	4	7
為替予約	100,283	118,041	3,710	2,516
通貨スワップ 通貨オプション(買建)	7,059	6,016	624	724
債券現物オプション(買建)	64	-	0	-
株式オプション(買建) 株価指数先渡	-	1,499	-	89
マルチ・アセット指数オプション(買建)	1,100	1,292	196	148
合計			3,705	1,437

(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	2019年度末						2020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	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	△515	172,039	-	-	-	171,523	△456	△35,014	-	-	-	△35,471
ヘッジ会計非適用分	-	△2,795	1,126	-	△1,639	△3,309	-	△4,246	△4,813	153	△827	△9,734
合 計	△515	169,243	1,126	-	△1,639	168,214	△456	△39,261	△4,813	153	△827	△45,205

(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、2019年度末通貨関連 134,617百万円、2020年度第2四半期(上半期)末通貨関連
 △70,435百万円となっています。

(2) 金利関連（会社計）

(ヘッジ会計が適用されていないもの)

2019年度末、2020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)

(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 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	
繰延ヘッジ	金利スワップ	貸付金						
	固定金利受取/変動金利支払		15,500	15,500	23	15,500	11,500	25
	固定金利支払/変動金利受取		-	-	-	47,610	47,610	△36
特例処理	金利スワップ	貸付金						
	固定金利受取/変動金利支払		4,535	145	5	190	112	1
	固定金利支払/変動金利受取		48,973	-	△544	47,610	-	△447
合 計					△515			△456

(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)

区分	種類	2019年度末				2020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		
店頭	為替予約								
	売建	2,458,184	-	21,491	21,491	1,744,627	-	△11,630	△11,630
	(米ドル)	1,304,922	-	△21,989	△21,989	551,109	-	6,423	6,423
	(ユーロ)	750,151	-	6,909	6,909	518,105	-	△16,846	△16,846
	(豪ドル)	156,299	-	13,987	13,987	325,557	-	607	607
	買建	2,354,980	165,027	△22,626	△22,626	2,335,945	-	7,000	7,000
	(ユーロ)	907,915	165,027	△1,984	△1,984	1,096,502	-	17,813	17,813
	(米ドル)	1,189,033	-	1,595	1,595	620,105	-	1,071	1,071
	(豪ドル)	22,344	-	△1,519	△1,519	270,538	-	△3,903	△3,903
	通貨オプション								
	売建								
	コール	220,250	-			172,500	-		
	(907)			1,783	△876	(726)		179	546
	(米ドル)	220,250	-			172,500	-		
	(907)			1,783	△876	(726)		179	546
	プット	-	-			135,000	-		
	(-)					(681)		288	393
	(米ドル)	-	-			135,000	-		
	(-)					(681)		288	393
	買建								
プット	199,000	-			150,000	-			
(1,986)			1,201	△784	(2,186)		1,629	△556	
(米ドル)	199,000	-			150,000	-			
(1,986)			1,201	△784	(2,186)		1,629	△556	
合計								△2,795	△4,246

(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)

(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	外貨建資産	7,329,758	1,191,995	134,617	7,723,588	448,519	△70,435
	(米ドル)		3,754,163	1,138,338	△24,521	3,796,303	18,412	46,055
	(ユーロ)		2,155,977	-	24,938	2,247,993	224,588	△71,229
(豪ドル)	915,189		53,656	97,658	1,118,086	205,517	△47,169	
繰延ヘッジ	通貨スワップ	外貨建資産	37,806	37,806	△3,638	37,806	37,806	△3,203
	(米ドル)		35,351	35,351	△3,656	35,351	35,351	△3,100
	(ユーロ)		2,454	2,454	18	2,454	2,454	△102
振当処理	通貨スワップ	外貨建資産	168,916	168,916	12,234	168,916	168,916	14,249
	(米ドル)		168,916	168,916	12,234	168,916	168,916	14,249
	通貨スワップ	外貨建負債	244,924	244,924	28,825	244,924	244,924	24,374
	(米ドル)		244,924	244,924	28,825	244,924	244,924	24,374
合計							172,039	△35,014

(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	2019年度末				2020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	-	-	-	-	3,717	-	△20	△20
	買建	19,501	-	1,126	1,126	23,817	-	△95	△95
店頭	株価指数オプション								
	売建								
	コール	-	-	-	-	148,470	-		
		(-)				(1,674)		4,203	△2,529
	プット	-	-	-	-	122,715	-		
		(-)				(2,326)		563	1,763
買建									
プット	-	-	-	-	149,985	-			
	(-)				(5,481)		1,550	△3,931	
合 計									
					1,126				△4,813

(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)

2019年度末、2020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)

区分	種 類	2019年度末				2020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	債券先物								
	売建	-	-	-	-	2,492	-	△2	△2
	買建	-	-	-	-	71,270	-	155	155
合 計									
									153

(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)

2019年度末、2020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)

区分	種 類	2019年度末				2020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			
店頭	マルチ・アセット指数オプション								
	売 建								
	コール	139,122	-			138,641	-		
		(337)		62	275	(457)		359	98
買 建									
コール	128,961	-			129,206	-			
	(2,816)		900	△1,915	(2,825)		1,900	△925	
合 計									
					△1,639				△827

(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)

2019年度末、2020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。