

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	2020年度末		2021年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
国 債	10,556,925	35.5	10,674,272	35.3
地 方 債	215,856	0.7	225,849	0.7
社 債	3,658,367	12.3	3,660,563	12.1
うち公社・公団債	2,258,230	7.6	2,268,188	7.5
うち外貨建	604,165	2.0	615,140	2.0
株 式	2,480,707	8.3	2,560,908	8.5
外 国 証 券	12,391,645	41.6	12,625,923	41.8
公 社 債	10,516,392	35.3	10,451,423	34.6
うち外貨建	8,930,876	30.0	8,849,942	29.3
株 式 等	1,875,252	6.3	2,174,499	7.2
うち外貨建	1,735,632	5.8	2,033,637	6.7
そ の 他 の 証 券	452,669	1.5	489,627	1.6
合 計	29,756,172	100.0	30,237,143	100.0
うち外貨建	11,270,674	37.9	11,498,720	38.0

(2) 地域別地方債保有内訳

(単位：百万円)

区 分	2020年度末	2021年度 第2四半期(上半期)末
北 海 道	2,196	2,209
東 北	-	-
関 東	89,906	89,939
中 部	38,013	40,906
近 畿	44,659	51,552
中 国	7,998	8,085
四 国	-	-
九 州	33,083	33,155
合 計	215,856	225,849

(3) 有価証券残存期間別残高

<2020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	339,506	905,904	2,025,560	2,921,025	5,435,370	13,070,788	5,058,017	29,756,172
国 債	146,668	208,386	258,840	833,420	2,782,220	6,327,388	-	10,556,925
地 方 債	-	2,850	5,957	-	12,230	194,817	-	215,856
社 債	35,949	213,383	301,174	446,563	256,994	2,041,685	362,617	3,658,367
株 式							2,480,707	2,480,707
外 国 証 券	156,880	481,283	1,458,669	1,640,128	2,376,328	4,506,897	1,771,458	12,391,645
公 社 債	156,880	477,962	1,455,764	1,635,068	2,355,845	4,434,871	-	10,516,392
株 式 等	0	3,321	2,904	5,059	20,482	72,025	1,771,458	1,875,252
その他の証券	8	-	917	913	7,596	-	443,233	452,669
買入金銭債権	280,366	-	-	-	-	159,383	-	439,749
譲渡性預金	491,530	-	-	-	-	-	-	491,530
そ の 他	-	-	-	-	-	-	-	-
合 計	1,111,402	905,904	2,025,560	2,921,025	5,435,370	13,230,172	5,058,017	30,687,452

<2021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	443,951	928,580	2,466,710	2,871,003	5,486,764	12,632,030	5,408,101	30,237,143
国 債	222,380	136,969	365,136	756,423	3,006,943	6,186,418	-	10,674,272
地 方 債	-	3,574	5,229	-	14,395	202,649	-	225,849
社 債	73,546	253,093	353,484	318,592	281,637	2,016,986	363,221	3,660,563
株 式							2,560,908	2,560,908
外 国 証 券	148,024	534,943	1,742,031	1,795,086	2,170,142	4,225,976	2,009,718	12,625,923
公 社 債	148,024	528,228	1,742,031	1,789,146	2,134,305	4,109,688	-	10,451,423
株 式 等	0	6,715	-	5,939	35,837	116,288	2,009,718	2,174,499
その他の証券	-	-	827	901	13,644	-	474,253	489,627
買入金銭債権	176,435	-	-	-	-	159,743	-	336,179
譲渡性預金	545,040	-	-	-	-	-	-	545,040
そ の 他	-	-	-	-	-	-	2,244	2,244
合 計	1,165,427	928,580	2,466,710	2,871,003	5,486,764	12,791,774	5,410,346	31,120,608

(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	2020年度末		2021年度 第2四半期(上半期)末		
	金 額	占率	金 額	占率	
水 産 ・ 農 林 業	317	0.0	332	0.0	
鉱 業	57	0.0	63	0.0	
建 設 業	74,157	3.0	77,584	3.0	
製 造 業	食 料 品	84,194	3.4	88,556	3.5
	織 維 製 品	10,284	0.4	10,692	0.4
	パ ル プ ・ 紙	8,219	0.3	7,721	0.3
	化 学	295,701	11.9	280,768	11.0
	医 薬 品	204,644	8.2	232,656	9.1
	石 油 ・ 石 炭 製 品	5,719	0.2	5,589	0.2
	ゴ ム 製 品	11,259	0.5	10,966	0.4
	ガ ラ ス ・ 土 石 製 品	33,611	1.4	30,311	1.2
	鉄 鋼	18,429	0.7	21,477	0.8
	非 鉄 金 属	47,472	1.9	42,815	1.7
	金 属 製 品	10,144	0.4	10,655	0.4
	機 械	202,071	8.1	199,277	7.8
	電 気 機 器	329,168	13.3	339,578	13.3
	輸 送 用 機 器	95,250	3.8	92,145	3.6
	精 密 機 器	23,052	0.9	25,508	1.0
そ の 他 製 品	70,191	2.8	80,140	3.1	
電 気 ・ ガ ス 業	32,526	1.3	28,854	1.1	
運 輸 ・ 情 報 通 信 業	陸 運 業	209,617	8.4	220,551	8.6
	海 運 業	4,138	0.2	8,450	0.3
	空 運 業	3,195	0.1	3,549	0.1
	倉 庫 ・ 運 輸 関 連 業	8,793	0.4	9,864	0.4
	情 報 ・ 通 信 業	73,480	3.0	89,169	3.5
商 業	卸 売 業	171,532	6.9	177,181	6.9
	小 売 業	37,668	1.5	45,643	1.8
金 融 ・ 保 険 業	銀 行 業	160,953	6.5	151,808	5.9
	証 券、商 品 先 物 取 引 業	5,253	0.2	5,290	0.2
	保 険 業	142,538	5.7	147,368	5.8
	そ の 他 金 融 業	19,926	0.8	21,554	0.8
不 動 産 業	29,720	1.2	30,333	1.2	
サ ー ビ ス 業	57,415	2.3	64,443	2.5	
合 計	2,480,707	100.0	2,560,908	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	2020年度末	2021年度 第2四半期(上半期)末
保 險 約 款 貸 付	258,549	250,351
契 約 者 貸 付	235,830	228,077
保 險 料 振 替 貸 付	22,718	22,274
一 般 貸 付 (うち非居住者貸付)	1,686,968 (83,032)	1,915,906 (83,940)
企 業 貸 付 (うち国内企業向け)	1,662,649 (1,579,617)	1,648,953 (1,565,013)
国・国際機関・政府関係機関貸付	560	238,373
公 共 団 体 ・ 公 企 業 貸 付	21,500	26,500
住 宅 ロ ー ン	2,257	2,078
消 費 者 ロ ー ン	1	1
そ の 他	-	-
合 計	1,945,518	2,166,258

(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	2020年度末		2021年度 第2四半期(上半期)末	
	貸付先数	占率	貸付先数	占率
大 企 業	174	74.7	173	75.9
	金 額	1,375,865	1,393,193	89.0
中 堅 企 業	-	-	-	-
	金 額	-	-	-
中 小 企 業	59	25.3	55	24.1
	金 額	203,751	171,820	11.0
国 内 企 業 向 け 貸 付 計	233	100.0	228	100.0
	金 額	1,579,617	1,565,013	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	
	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								
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。
- 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

<2020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	46,170	163	4,426	47,569	56,739	59,901	10,000	224,971
固 定 金 利	105,726	215,948	236,733	213,541	183,347	506,699	-	1,461,997
一 般 貸 付 計	151,896	216,112	241,159	261,111	240,087	566,600	10,000	1,686,968

<2021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	51,787	1,451	5,028	50,670	54,803	64,196	6,000	233,937
固 定 金 利	369,996	195,552	240,169	203,562	156,780	515,908	-	1,681,969
一 般 貸 付 計	421,784	197,004	245,197	254,232	211,583	580,104	6,000	1,915,906

(4) 貸付金業種別内訳

(単位：百万円、%)

区分	2020年度末		2021年度 第2四半期(上半期)末		
	金額	占率	金額	占率	
	185,760	11.0	181,413	9.5	
製造業	食料	12,396	0.7	11,878	0.6
	繊維	900	0.1	900	0.0
	木材・木製品	600	0.0	600	0.0
	パルプ・紙	13,500	0.8	13,500	0.7
	印刷	-	-	-	-
	化学	25,843	1.5	24,679	1.3
	石油・石炭	27,080	1.6	27,080	1.4
	窯業・土石	8,740	0.5	8,591	0.4
	鉄鋼	45,300	2.7	42,300	2.2
	非金属製品	1,450	0.1	1,450	0.1
	金属製品	1,106	0.1	1,085	0.1
	はん用・生産用・業務用機械	12,324	0.7	13,121	0.7
	電気機械	20,786	1.2	20,540	1.1
輸送用機械	14,673	0.9	14,638	0.8	
その他の製造業	1,060	0.1	1,050	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	4,737	0.3	4,975	0.3
	電気・ガス・熱供給・水道業	231,814	13.7	238,806	12.5
	情報通信業	21,100	1.3	21,100	1.1
	運輸業、郵便業	159,671	9.5	162,402	8.5
	卸売業	372,750	22.1	367,700	19.2
	小売業	4,845	0.3	4,727	0.2
	金融業、保険業	332,446	19.7	332,997	17.4
	不動産業	173,590	10.3	163,418	8.5
	物品賃貸業	105,870	6.3	108,441	5.7
	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	6,091	0.3
	地方公共団体	-	-	-	-
個人(住宅・消費・納税資金等)	2,258	0.1	2,079	0.1	
合計	1,603,936	95.1	1,831,966	95.6	
海外向け	政府等	-	-	-	-
	金融機関等	83,032	4.9	83,940	4.4
	商工業等	-	-	-	-
合計	83,032	4.9	83,940	4.4	
一般貸付計	1,686,968	100.0	1,915,906	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。
(2020年度末 残高なし、2021年度第2四半期(上半期)末 2,378億円)

(5) 貸付金担保別内訳

(単位：百万円、%)

区 分	2020年度末		2021年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
担 保 貸 付	12,594	0.7	11,785	0.6
有 価 証 券 担 保 貸 付	50	0.0	-	-
不 動 産 ・ 動 産 ・ 財 団 担 保 貸 付	12,544	0.7	11,785	0.6
指 名 債 権 担 保 貸 付	-	-	-	-
保 証 貸 付	15,677	0.9	11,172	0.6
信 用 貸 付	1,656,437	98.2	1,890,868	98.7
そ の 他	2,258	0.1	2,079	0.1
一 般 貸 付 計	1,686,968	100.0	1,915,906	100.0
う ち 劣 後 特 約 付 貸 付	133,000	7.9	131,000	6.8

(6) 貸付金地域別内訳

区 分	2020年度末		2021年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
北 海 道	9,892	0.6	9,844	0.5
東 北	19,031	1.2	15,882	0.9
関 東	1,271,239	79.4	1,508,509	82.4
中 部	97,544	6.1	97,516	5.3
近 畿	146,571	9.2	140,853	7.7
中 国	20,287	1.3	20,256	1.1
四 国	5,050	0.3	5,050	0.3
九 州	32,060	2.0	31,975	1.7
合 計	1,601,677	100.0	1,829,886	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	2020年度末		2021年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
公 社 債	9,535,042	68.3	9,465,082	66.9
株 式 等	1,735,632	12.4	2,033,637	14.4
現 預 金 ・ そ の 他	528,620	3.8	472,339	3.3
外 貨 建 資 産 計	11,799,295	84.6	11,971,059	84.6

(イ) 円貨額が確定した外貨建資産

(単位：百万円、%)

区 分	2020年度末		2021年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
貸 付 金	179,829	1.3	179,829	1.3
現 預 金 ・ そ の 他	3,088	0.0	3,090	0.0
円 貨 額 が 確 定 し た 外 貨 建 資 産 計	182,917	1.3	182,919	1.3

(ウ) 円貨建資産

(単位：百万円、%)

区 分	2020年度末		2021年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
公 社 債	1,585,515	11.4	1,601,481	11.3
株 式 等	377,670	2.7	384,776	2.7
そ の 他	6,857	0.0	10,147	0.1
円 貨 建 資 産 計	1,970,044	14.1	1,996,406	14.1

(エ) 合計

(単位：百万円、%)

区 分	2020年度末		2021年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
海 外 投 融 資	13,952,257	100.0	14,150,386	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	2020年度末				2021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	4,180,165	3,524,452	655,712	83,032	4,288,851	3,524,273	764,578	83,940
	占率	33.7	33.5	35.0	100.0	34.0	33.7	35.2	100.0
ヨーロッパ	金額	3,535,362	3,508,038	27,323	-	3,459,524	3,417,743	41,780	-
	占率	28.5	33.4	1.5	-	27.4	32.7	1.9	-
オセアニア	金額	916,038	916,038	-	-	866,338	866,338	-	-
	占率	7.4	8.7	-	-	6.9	8.3	-	-
ア ジ ア	金額	199,537	52,702	146,835	-	305,787	157,727	148,059	-
	占率	1.6	0.5	7.8	-	2.4	1.5	6.8	-
中 南 米	金額	3,233,126	2,187,745	1,045,380	-	3,376,397	2,156,316	1,220,081	-
	占率	26.1	20.8	55.7	-	26.7	20.6	56.1	-
中 東	金額	-	-	-	-	-	-	-	-
	占率	-	-	-	-	-	-	-	-
ア フ リ カ	金額	3,625	3,625	-	-	3,603	3,603	-	-
	占率	0.0	0.0	-	-	0.0	0.0	-	-
国際機関	金額	323,788	323,788	-	-	325,420	325,420	-	-
	占率	2.6	3.1	-	-	2.6	3.1	-	-
合 計	金額	12,391,645	10,516,392	1,875,252	83,032	12,625,923	10,451,423	2,174,499	83,940
	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、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・オセアニア地域等への投資です。

(3) 外貨建資産の通貨別構成

(単位：百万円、%)

区 分	2020年度末		2021年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
米 ド ル	6,810,658	57.7	7,080,112	59.1
ユ ー ロ	2,517,067	21.3	2,467,719	20.6
豪 ド ル	1,631,917	13.8	1,492,957	12.5
ニュージーランドドル	323,623	2.7	312,634	2.6
中 国 元	95,066	0.8	202,868	1.7
ポーランドズロチ	172,826	1.5	168,183	1.4
カナダドル	88,789	0.8	88,990	0.7
メキシコペソ	56,207	0.5	54,439	0.5
ベトナムドン	52,250	0.4	52,264	0.4
シンガポールドル	35,146	0.3	35,146	0.3
インドネシアルピア	15,723	0.1	15,723	0.1
そ の 他	19	0.0	18	0.0
合 計	11,799,295	100.0	11,971,059	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	2020年度末		2021年度 第2四半期(上半期)末	
	貸借対照表 計上額	当期の損益に含 まれた評価損益	貸借対照表 計上額	当期の損益に含 まれた評価損益
売 買 目 的 有 価 証 券	59,058	10,913	60,493	11,733

(2) 変額個人年金保険

(単位：百万円)

区 分	2020年度末		2021年度 第2四半期(上半期)末	
	貸借対照表 計上額	当期の損益に含 まれた評価損益	貸借対照表 計上額	当期の損益に含 まれた評価損益
売 買 目 的 有 価 証 券	65,603	6,533	58,608	6,349

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	2020年度末			2021年度第2四半期(上半期)末				
		契約額等		時価	差損益	契約額等		時価	差損益
		うち1年超				うち1年超			
取引所	株価指数先物								
	売建	-	-	-	-	-	-	-	
	買建	395	-	20	20	-	-	-	
	合 計				20			-	

(通貨関連)

(単位：百万円)

区分	種 類	2020年度末			2021年度第2四半期(上半期)末				
		契約額等		時価	差損益	契約額等		時価	差損益
		うち1年超				うち1年超			
店頭	為替予約								
	売建	-	-	-	0	-	△0	△0	
	(*ドル)	-	-	-	-	-	-	-	
	(ユーロ)	-	-	-	0	-	△0	△0	
	買建	-	-	-	-	-	-	-	
	(*ドル)	-	-	-	-	-	-	-	
	(ユーロ)	-	-	-	-	-	-	-	
	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	2020年度末			2021年度第2四半期(上半期)末				
		契約額等		時価	差損益	契約額等		時価	差損益
		うち1年超				うち1年超			
取引所	株価指数先物								
	売建	-	-	-	-	-	-	-	
	買建	564	-	28	28	833	-	△18	
	合 計				28			△18	

(通貨関連)

(単位：百万円)

区分	種 類	2020年度末			2021年度第2四半期(上半期)末				
		契約額等		時価	差損益	契約額等		時価	差損益
		うち1年超				うち1年超			
店頭	為替予約								
	売建	-	-	-	-	101	-	△0	
	(米ドル)	-	-	-	-	42	-	△0	
	(ユーロ)	-	-	-	-	49	-	0	
	(英ポンド)	-	-	-	-	8	-	0	
	買建	-	-	-	-	-	-	-	
	(米ドル)	-	-	-	-	-	-	-	
	(ユーロ)	-	-	-	-	-	-	-	
	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	2020年度末		2021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	1,390,794	3.9	1,135,653	3.2
買入金銭債権	565,143	1.6	457,995	1.3
金銭の信託	-	-	2,244	0.0
有 価 証 券	30,463,881	86.1	30,978,049	86.7
公 社 債	14,728,394	41.6	14,846,663	41.6
株 式	2,623,466	7.4	2,709,207	7.6
外 国 証 券	12,643,660	35.7	12,915,166	36.2
公 社 債	10,626,729	30.0	10,569,269	29.6
株 式 等	2,016,930	5.7	2,345,897	6.6
その他の証券	468,359	1.3	507,011	1.4
貸 付 金	1,945,518	5.5	2,166,258	6.1
保険約款貸付	258,549	0.7	250,351	0.7
一般貸付	1,686,968	4.8	1,915,906	5.4
不 動 産	557,409	1.6	554,382	1.6
うち投資用	394,204	1.1	391,497	1.1
繰延税金資産	68,356	0.2	63,825	0.2
そ の 他	410,574	1.2	362,261	1.0
貸倒引当金	△890	△0.0	△916	△0.0
会 社 計	35,400,786	100.0	35,719,755	100.0
うち外貨建資産	12,040,455	34.0	12,249,876	34.3

(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	2020年度 第2四半期(上半期)	2021年度 第2四半期(上半期)
	金 額	金 額
現預金・コールローン	△129,266	△255,141
買入金銭債権	274,529	△107,147
金銭の信託	-	2,244
有 価 証 券	1,686,160	514,167
公 社 債	204,305	118,269
株 式	434,684	85,740
外 国 証 券	1,004,061	271,505
公 社 債	673,595	△57,460
株 式 等	330,466	328,966
その他の証券	43,107	38,651
貸 付 金	△173,773	220,740
保険約款貸付	△10,653	△8,197
一般貸付	△163,120	228,938
不 動 産	△894	△3,026
うち投資用	△2	△2,706
繰延税金資産	△146,146	△4,530
そ の 他	△125,072	△48,312
貸倒引当金	71	△25
会 社 計	1,385,607	318,969
うち外貨建資産	860,886	209,420

(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	2020年度末		2021年度第2四半期(上半期)末	
	貸借対照表計上額	当期の損益に含まれた評価損益	貸借対照表計上額	当期の損益に含まれた評価損益
売買目的有価証券	707,708	81,216	743,150	66

(注) 本表には、金銭の信託等の売買目的有価証券を含んでいます。

(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					2021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	1,590,707	1,852,103	261,395	261,404	△8	1,580,249	1,834,902	254,653	254,659	△6
責任準備金対応債券	12,470,906	14,068,089	1,597,183	1,654,525	△57,341	12,486,733	14,074,516	1,587,783	1,642,003	△54,219
子会社・関連会社株式	52,238	46,861	△5,376	-	△5,376	52,238	47,093	△5,144	-	△5,144
その他有価証券	13,963,576	15,804,479	1,840,903	1,986,544	△145,641	14,198,756	16,171,477	1,972,721	2,082,139	△109,417
公 社 債	2,477,237	2,529,740	52,503	86,818	△34,315	2,635,411	2,697,715	62,303	92,434	△30,131
株 式	1,115,669	2,338,264	1,222,594	1,252,591	△29,996	1,133,808	2,418,824	1,285,016	1,318,274	△33,257
外 国 証 券	9,096,111	9,618,085	521,974	601,930	△79,956	9,179,851	9,750,314	570,462	615,709	△45,246
公 社 債	7,922,014	8,356,187	434,173	509,392	△75,219	7,803,582	8,247,411	443,828	483,611	△39,782
株 式 等	1,174,097	1,261,898	87,801	92,538	△4,737	1,376,268	1,502,902	126,634	132,098	△5,464
その他の証券	349,067	387,108	38,040	38,775	△735	376,091	423,403	47,311	47,930	△619
買入金銭債権	433,890	439,749	5,859	6,427	△567	328,492	336,179	7,686	7,790	△103
譲渡性預金	491,600	491,530	△69	-	△69	545,100	545,040	△59	-	△59
その他	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
合 計	28,077,428	31,771,534	3,694,106	3,902,473	△208,367	28,317,976	32,127,990	3,810,013	3,978,802	△168,788
公 社 債	14,378,646	16,015,275	1,636,628	1,710,830	△74,201	14,498,381	16,109,861	1,611,479	1,685,828	△74,348
株 式	1,115,669	2,338,264	1,222,594	1,252,591	△29,996	1,133,808	2,418,824	1,285,016	1,318,274	△33,257
外 国 証 券	11,308,555	12,099,606	791,051	893,848	△102,797	11,436,102	12,294,681	858,578	918,978	△60,399
公 社 債	10,082,219	10,790,846	708,627	801,310	△92,683	10,007,595	10,744,684	737,089	786,879	△49,790
株 式 等	1,226,335	1,308,760	82,424	92,538	△10,113	1,428,506	1,549,996	121,489	132,098	△10,608
その他の証券	349,067	387,108	38,040	38,775	△735	376,091	423,403	47,311	47,930	△619
買入金銭債権	433,890	439,749	5,859	6,427	△567	328,492	336,179	7,686	7,790	△103
譲渡性預金	491,600	491,530	△69	-	△69	545,100	545,040	△59	-	△59
その他	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

(注) 1. 本表には、金融商品取引法上の有価証券として取り扱うことが適当と認められるもの等を含んでいます。

2. 市場価格のない株式等および組合等は本表から除いています。

市場価格のない株式等および組合等の帳簿価額は以下のとおりです。

(単位:百万円)

区 分	2020年度末	2021年度第2四半期(上半期)末
子会社・関連会社株式	697,616	700,922
その他有価証券	62,198	107,742
国内株式	20,368	20,007
外国株式	34,558	34,558
その他	7,271	53,175
合 計	759,814	808,665

c. 金銭の信託の時価情報(会社計)

(単位：百万円)

区 分	2020年度末					2021年度 第2四半期(上半期)末				
	貸借対照表 計上額	時価	差損益	差益	差損	四半期 貸借対照表 計上額	時価	差損益	差益	差損
金 銭 の 信 託	-	-	-	-	-	2,244	2,244	-	-	-

(注)時価相当額の算定は、取引金融機関が合理的に算定した価格によっています。

・運用目的の金銭の信託

(単位：百万円)

区 分	2020年度末		2021年度 第2四半期(上半期)末	
	貸借対照表計上額	当期の損益に含まれた 評価損益	四半期貸借対照表計上額	当期の損益に含まれた 評価損益
運 用 目 的 の 金 銭 の 信 託	-	-	2,244	40

・運用目的以外の金銭の信託

2020年度末、2021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	
	2020年9月末	2021年9月末	2020年9月末	2021年9月末
金利スワップ 金利スワップション(買建)	1,104	950	7	58
為替予約	118,041	111,889	2,516	2,793
通貨スワップ 通貨オプション(買建)	6,016	7,495	724	827
株式オプション(買建) 株価指数先渡	1,499	660	89	39
マルチ・アセット指数オプション(買建)	1,292	1,299	148	155
合計			1,437	1,553

(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	2020年度末						2021年度第2四半期(上半期)末					
	金利関連	通貨関連	株式関連	債券関連	その他	合 計	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	6,094	△343,195	-	-	-	△337,100	4,494	△103,370	-	-	-	△98,875
ヘッジ会計非適用分	-	△115,631	△29,654	51	687	△144,547	△167	△44,361	△1,967	△638	△44	△47,180
合 計	6,094	△458,827	△29,654	51	687	△481,648	4,326	△147,731	△1,967	△638	△44	△146,056

(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、2020年度末通貨関連 △374,068百万円、2021年度第2四半期(上半期)末通貨関連 △137,982百万円となっています。

(2) 金利関連（会社計）

（ヘッジ会計が適用されていないもの）

（単位：百万円）

区 分	種 類	2020年度末			2021年度 第2四半期(上半期)末		
		契約額等	時価	差損益	契約額等	時価	差損益
店頭	金利スワップ 固定金利受取/変動金利支払	-	-	-	30,000	30,000	△167
	合 計						△167

(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）

（単位：百万円）

ヘッジ会計の方法	種 類	主なヘッジ対象	2020年度末			2021年度 第2四半期(上半期)末		
			契約額等	時価	契約額等	時価		
							うち1年超	うち1年超
繰延ヘッジ	金利スワップ 固定金利受取/変動金利支払	貸付金	15,500	11,500	12	11,500	11,500	△0
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	145	80	1	112	57	1
	固定金利支払/変動金利受取		83,032	83,032	6,081	83,940	83,940	4,494
	合 計				6,094			4,494

(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	2020年度末			2021年度第2四半期(上半期)末					
		契約額等		時価	差損益	契約額等		時価	差損益	
			うち1年超				うち1年超			
店頭	為替予約									
	売建	3,235,486	-	△214,996	△214,996	1,372,730	-	△49,832	△49,832	
	(米ドル)	1,500,512	-	△58,407	△58,407	562,542	-	△17,205	△17,205	
	(ユーロ)	1,149,871	-	△72,428	△72,428	386,280	-	△14,023	△14,023	
	(豪ドル)	278,675	-	△67,010	△67,010	337,251	-	△16,203	△16,203	
	買建	3,542,436	-	100,313	100,313	1,829,708	-	5,851	5,851	
	(ユーロ)	1,540,936	-	44,898	44,898	937,365	-	△991	△991	
	(米ドル)	1,418,949	-	47,159	47,159	513,189	-	8,419	8,419	
	(豪ドル)	272,639	-	5,311	5,311	298,818	-	△1,056	△1,056	
	通貨オプション									
	売建									
	コール	172,500	-			120,000	-			
	(米ドル)	(726)	-	172	553	(313)	-	150	163	
	プット	135,000	-			-	-			
	(米ドル)	(681)	-		681	(-)	-			
	買建	150,000	-			186,400	-			
	プット	(2,186)	-	2	△2,184	(620)	-	76	△543	
	(米ドル)	150,000	-			186,400	-			
		(2,186)	-	2	△2,184	(620)	-	76	△543	
	合 計					△115,631				△44,361

(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	2020年度末			2021年度第2四半期(上半期)末		
			契約額等		時価	契約額等		時価
				うち1年超			うち1年超	
時価ヘッジ	為替予約	外貨建資産						
	売建		7,954,817	2,386,505	△374,068	7,986,549	2,954,698	△137,982
	(米ドル)		3,670,328	1,116,818	△161,117	3,676,005	1,507,292	△132,111
	(ユーロ)		2,412,569	906,783	△84,208	2,456,641	1,312,645	△12,123
	(豪ドル)	1,234,976	248,123	△109,166	1,215,773	134,759	2,927	
繰延ヘッジ	通貨スワップ	外貨建資産	37,806	37,806	△3,900	37,806	37,806	△4,339
	(米ドル)		35,351	35,351	△3,685	35,351	35,351	△4,126
	(ユーロ)		2,454	2,454	△215	2,454	2,454	△212
振当処理	通貨スワップ	外貨建資産	179,829	173,945	4,776	179,829	173,945	1,416
	(米ドル)		179,829	173,945	4,776	179,829	173,945	1,416
	通貨スワップ	外貨建負債	244,924	244,924	29,996	345,510	345,510	37,534
	(米ドル)		244,924	244,924	29,996	345,510	345,510	37,534
合 計					△343,195		△103,370	

(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	2020年度末			2021年度第2四半期(上半期)末				
		契約額等		時価	差損益	契約額等		時価	差損益
		うち1年超				うち1年超			
取引所	株価指数先物								
	売建	2,344	-	△58	△58	5,418	-	17	17
	買建	30,720	-	440	440	52,053	-	△1,162	△1,162
店頭	株価指数オプション								
	売建								
	コール	148,470	-			-	-		
		(1,674)		28,555	△26,881	(-)		-	-
	プット	122,715	-			-	-		
		(2,326)			2,326	(-)		-	-
買建									
プット	149,985	-			66,000	-			
	(5,481)			△5,481	(1,392)		569	△822	
合 計					△29,654				△1,967

(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)

2020年度末、2021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	2020年度末			2021年度第2四半期(上半期)末				
		契約額等		時価	差損益	契約額等		時価	差損益
		うち1年超				うち1年超			
取引所	債券先物								
	売建	20,393	-	99	99	42,854	-	△5	△5
	買建	33,536	-	△47	△47	39,555	-	△633	△633
合 計					51				△638

(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)

2020年度末、2021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	2020年度末			2021年度第2四半期(上半期)末				
		契約額等		時価	差損益	契約額等		時価	差損益
		うち1年超				うち1年超			
店頭	マルチ・アセット指数オプション								
	売 建								
	コール	134,140	-			131,368	-		
		(445)		549	△103	(426)		315	110
買 建									
コール	127,843	-			129,989	-			
	(2,630)			3,421	790	(2,734)		2,579	△155
合 計					687				△44

(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)

2020年度末、2021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。