

2022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	2021年度末		2022年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
国 債	10,791,013	35.1	10,746,478	35.7
地 方 債	180,166	0.6	177,997	0.6
社 債	3,549,240	11.6	3,502,107	11.6
うち公社・公団債	2,202,542	7.2	2,161,988	7.2
うち外貨建	640,774	2.1	697,978	2.3
株 式	2,459,308	8.0	2,419,777	8.0
外 国 証 券	13,218,894	43.0	12,793,117	42.5
公 社 債	10,730,565	34.9	10,344,612	34.4
うち外貨建	9,130,405	29.7	8,696,638	28.9
株 式 等	2,488,328	8.1	2,448,504	8.1
うち外貨建	2,354,182	7.7	2,325,235	7.7
そ の 他 の 証 券	522,373	1.7	463,748	1.5
合 計	30,720,996	100.0	30,103,226	100.0
うち外貨建	12,125,362	39.5	11,719,851	38.9

(2) 地域別地方債保有内訳

(単位：百万円)

区 分	2021年度末	2022年度 第2四半期(上半期)末
北 海 道	133	132
東 北	-	-
関 東	81,897	80,522
中 部	39,602	38,901
近 畿	35,319	35,546
中 国	3,368	3,230
四 国	-	-
九 州	19,845	19,663
合 計	180,166	177,997

(3) 有価証券残存期間別残高

<2021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 のないもの	合 計
有 価 証 券	528,588	1,245,795	2,476,127	3,205,916	5,304,216	12,426,135	5,534,217	30,720,996
国 債	187,439	124,370	550,649	854,777	3,064,058	6,009,716	-	10,791,013
地 方 債	-	8,797	-	-	15,828	155,540	-	180,166
社 債	86,579	243,944	441,389	249,723	243,378	1,935,100	349,124	3,549,240
株 式							2,459,308	2,459,308
外 国 証 券	254,568	868,682	1,483,122	2,099,988	1,967,627	4,325,776	2,219,128	13,218,894
公 社 債	254,568	868,682	1,473,824	2,091,203	1,830,429	4,211,856	-	10,730,565
株 式 等	0	-	9,297	8,784	137,197	113,919	2,219,128	2,488,328
その他の証券	-	-	966	1,427	13,324	-	506,655	522,373
買入金銭債権	34,493	-	-	-	-	157,630	-	192,123
譲渡性預金	520,844	-	-	-	-	-	-	520,844
そ の 他	-	-	-	-	-	-	4,914	4,914
合 計	1,083,926	1,245,795	2,476,127	3,205,916	5,304,216	12,583,765	5,539,131	31,438,879

<2022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	333,490	1,447,728	2,602,798	2,931,876	5,263,584	12,242,211	5,281,535	30,103,226
国 債	67,354	141,934	522,096	1,003,859	3,397,495	5,613,738	-	10,746,478
地 方 債	2,884	5,906	-	-	19,850	149,355	-	177,997
社 債	69,408	247,791	558,280	216,815	156,981	1,905,066	347,762	3,502,107
株 式							2,419,777	2,419,777
外 国 証 券	193,842	1,051,268	1,522,421	1,709,874	1,675,666	4,574,051	2,065,992	12,793,117
公 社 債	193,842	1,051,268	1,506,981	1,667,928	1,500,844	4,423,748	-	10,344,612
株 式 等	0	-	15,440	41,946	174,822	150,302	2,065,992	2,448,504
その他の証券	-	827	-	1,327	13,590	-	448,002	463,748
買入金銭債権	217,992	-	-	-	-	150,262	-	368,254
譲渡性預金	642,359	-	-	-	-	-	-	642,359
そ の 他	-	-	-	-	-	-	8,758	8,758
合 計	1,193,842	1,447,728	2,602,798	2,931,876	5,263,584	12,392,473	5,290,293	31,122,598

(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	2021年度末		2022年度 第2四半期(上半期)末		
	金 額	占率	金 額	占率	
水 産 ・ 農 林 業	314	0.0	298	0.0	
鉱 業	103	0.0	97	0.0	
建 設 業	70,545	2.9	66,930	2.8	
製 造 業	食 料 品	76,065	3.1	82,052	3.4
	織 維 製 品	9,698	0.4	12,587	0.5
	パ ル プ ・ 紙	6,733	0.3	6,924	0.3
	化 学	250,844	10.2	217,077	9.0
	医 薬 品	218,627	8.9	215,922	8.9
	石 油 ・ 石 炭 製 品	6,084	0.2	6,244	0.3
	ゴ ム 製 品	9,834	0.4	10,981	0.5
	ガ ラ ス ・ 土 石 製 品	26,440	1.1	31,031	1.3
	鉄 鋼	21,569	0.9	20,717	0.9
	非 鉄 金 属	50,212	2.0	43,619	1.8
	金 属 製 品	8,645	0.4	10,769	0.4
	機 械	183,248	7.5	177,442	7.3
	電 気 機 器	309,705	12.6	290,326	12.0
	輸 送 用 機 器	92,789	3.8	93,778	3.9
	精 密 機 器	22,015	0.9	23,044	1.0
そ の 他 製 品	65,864	2.7	64,635	2.7	
電 気 ・ ガ ス 業	26,148	1.1	27,697	1.1	
運 輸 ・ 情 報 通 信 業	陸 運 業	182,552	7.4	181,417	7.5
	海 運 業	11,425	0.5	8,656	0.4
	空 運 業	3,129	0.1	3,306	0.1
	倉 庫 ・ 運 輸 関 連 業	10,313	0.4	10,619	0.4
	情 報 ・ 通 信 業	87,067	3.5	95,869	4.0
商 業	卸 売 業	217,109	8.8	184,644	7.6
	小 売 業	41,744	1.7	44,054	1.8
金 融 ・ 保 険 業	銀 行 業	158,556	6.4	164,518	6.8
	証 券、商 品 先 物 取 引 業	5,240	0.2	5,133	0.2
	保 険 業	173,624	7.1	193,146	8.0
	そ の 他 金 融 業	28,013	1.1	26,516	1.1
不 動 産 業	26,697	1.1	39,805	1.6	
サ ー ビ ス 業	58,341	2.4	59,911	2.5	
合 計	2,459,308	100.0	2,419,777	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	2021年度末	2022年度 第2四半期(上半期)末
保 険 約 款 貸 付	244,196	239,006
契 約 者 貸 付	222,703	217,954
保 険 料 振 替 貸 付	21,493	21,052
一 般 貸 付 (うち非居住者貸付)	1,948,057 (91,792)	1,998,223 (108,607)
企 業 貸 付 (うち国内企業向け)	1,690,979 (1,599,187)	1,693,437 (1,584,830)
国・国際機関・政府関係機関貸付	228,641	276,489
公 共 団 体 ・ 公 企 業 貸 付	26,500	26,500
住 宅 ロ ー ン	1,935	1,792
消 費 者 ロ ー ン	1	4
そ の 他	-	-
合 計	2,192,253	2,237,230

(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		2021年度末		2022年度 第2四半期(上半期)末	
			占率		占率
大 企 業	貸付先数	172	74.8	171	73.1
	金額	1,419,005	88.7	1,399,352	88.3
中 堅 企 業	貸付先数	-	-	-	-
	金額	-	-	-	-
中 小 企 業	貸付先数	58	25.2	63	26.9
	金額	180,181	11.3	185,477	11.7
国内企業向け 貸付計	貸付先数 金額	230 1,599,187	100.0 100.0	234 1,584,830	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

<2021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	51,089	1,402	8,588	44,667	68,061	61,465	6,000	241,274
固 定 金 利	354,287	200,459	240,690	169,380	195,216	546,748	-	1,706,782
一 般 貸 付 計	405,377	201,862	249,279	214,047	263,277	608,213	6,000	1,948,057

<2022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	50,904	2,355	9,616	55,515	74,993	61,868	6,000	261,254
固 定 金 利	402,727	186,709	267,532	125,322	210,113	544,562	-	1,736,969
一 般 貸 付 計	453,632	189,065	277,149	180,837	285,106	606,431	6,000	1,998,223

(4) 貸付金業種別内訳

(単位：百万円、%)

区分	2021年度末		2022年度 第2四半期(上半期)末		
	金額	占率	金額	占率	
	175,950	9.0	162,851	8.1	
製造業	食料	12,014	0.6	13,480	0.7
	繊維	900	0.0	900	0.0
	木材・木製品	400	0.0	400	0.0
	パルプ・紙	14,750	0.8	13,590	0.7
	印刷	-	-	-	-
	化学	24,515	1.3	23,525	1.2
	石油・石炭	29,080	1.5	29,080	1.5
	窯業・土石	8,594	0.4	8,666	0.4
	鉄鋼	32,300	1.7	18,800	0.9
	非金属製品	4,650	0.2	4,650	0.2
	金属製品	1,064	0.1	1,042	0.1
	はん用・生産用・業務用機械	12,466	0.6	13,612	0.7
	電気機械	19,570	1.0	19,500	1.0
輸送用機械	14,606	0.7	14,574	0.7	
その他の製造業	1,040	0.1	1,030	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	5,361	0.3	10,443	0.5
	電気・ガス・熱供給・水道業	236,505	12.1	234,125	11.7
	情報通信業	25,000	1.3	20,990	1.1
	運輸業、郵便業	164,714	8.5	164,579	8.2
	卸売業	367,700	18.9	366,500	18.3
	小売業	5,581	0.3	5,391	0.3
	金融業、保険業	345,187	17.7	348,679	17.4
	不動産業	180,010	9.2	181,407	9.1
	物品賃貸業	111,472	5.7	113,789	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	8,727	0.4	3,000	0.2
	地方公共団体	-	-	-	-
個人(住宅・消費・納税資金等)	1,936	0.1	1,796	0.1	
合計	1,856,264	95.3	1,889,616	94.6	
海外向け	政府等	-	-	-	-
	金融機関等	91,792	4.7	108,607	5.4
	商工業等	-	-	-	-
合計	91,792	4.7	108,607	5.4	
一般貸付計	1,948,057	100.0	1,998,223	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。
(2021年度末 2,281億円、2022年度第2四半期(上半期)末 2,760億円)

(5) 貸付金担保別内訳

(単位：百万円、%)

区 分	2021年度末		2022年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
担 保 貸 付	11,889	0.6	12,864	0.6
有 価 証 券 担 保 貸 付	-	-	-	-
不 動 産 ・ 動 産 ・ 財 団 担 保 貸 付	11,889	0.6	12,864	0.6
指 名 債 権 担 保 貸 付	-	-	-	-
保 証 貸 付	13,104	0.7	8,049	0.4
信 用 貸 付	1,921,126	98.6	1,975,512	98.9
そ の 他	1,936	0.1	1,796	0.1
一 般 貸 付 計	1,948,057	100.0	1,998,223	100.0
う ち 劣 後 特 約 付 貸 付	116,000	6.0	118,800	5.9

(6) 貸付金地域別内訳

(単位：百万円、%)

区 分	2021年度末		2022年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
北 海 道	9,798	0.5	9,754	0.5
東 北	18,521	1.0	11,867	0.6
関 東	1,534,505	82.8	1,574,643	83.4
中 部	97,300	5.2	97,100	5.1
近 畿	139,838	7.5	136,229	7.2
中 国	15,225	0.8	15,168	0.8
四 国	5,550	0.3	5,550	0.3
九 州	33,590	1.8	37,505	2.0
合 計	1,854,328	100.0	1,887,819	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	2021年度末		2022年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
公 社 債	9,771,179	65.8	9,394,616	63.9
株 式 等	2,354,182	15.8	2,325,235	15.8
現 預 金 ・ そ の 他	535,141	3.6	720,324	4.9
外 貨 建 資 産 計	12,660,503	85.2	12,440,176	84.6

(イ) 円貨額が確定した外貨建資産

(単位：百万円、%)

区 分	2021年度末		2022年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
貸 付 金	185,118	1.2	185,118	1.3
現 預 金 ・ そ の 他	3,132	0.0	3,135	0.0
円 貨 額 が 確 定 し た 外 貨 建 資 産 計	188,251	1.3	188,253	1.3

(ウ) 円貨建資産

(単位：百万円、%)

区 分	2021年度末		2022年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
公 社 債	1,600,160	10.8	1,647,974	11.2
株 式 等	388,794	2.6	393,943	2.7
そ の 他	15,817	0.1	32,830	0.2
円 貨 建 資 産 計	2,004,772	13.5	2,074,747	14.1

(エ) 合計

(単位：百万円、%)

区 分	2021年度末		2022年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
海 外 投 融 資	14,853,528	100.0	14,703,178	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	2021年度末				2022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	4,594,949	3,720,505	874,444	91,792	4,728,133	3,996,135	731,997	108,607
	占率	34.8	34.7	35.1	100.0	37.0	38.6	29.9	100.0
ヨーロッパ	金額	3,465,522	3,400,825	64,697	-	2,958,427	2,854,776	103,651	-
	占率	26.2	31.7	2.6	-	23.1	27.6	4.2	-
オセアニア	金額	973,046	973,046	-	-	897,759	897,759	-	-
	占率	7.4	9.1	-	-	7.0	8.7	-	-
ア ジ ア	金額	215,271	60,197	155,073	-	172,453	14,645	157,808	-
	占率	1.6	0.6	6.2	-	1.3	0.1	6.4	-
中 南 米	金額	3,608,286	2,214,173	1,394,112	-	3,714,884	2,259,837	1,455,046	-
	占率	27.3	20.6	56.0	-	29.0	21.8	59.4	-
中 東	金額	-	-	-	-	-	-	-	-
	占率	-	-	-	-	-	-	-	-
ア フ リ カ	金額	3,565	3,565	-	-	3,543	3,543	-	-
	占率	0.0	0.0	-	-	0.0	0.0	-	-
国際機関	金額	358,253	358,253	-	-	317,914	317,914	-	-
	占率	2.7	3.3	-	-	2.5	3.1	-	-
合 計	金額	13,218,894	10,730,565	2,488,328	91,792	12,793,117	10,344,612	2,448,504	108,607
	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	2021年度末		2022年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
米 ド ル	7,573,450	59.8	8,270,695	66.5
ユ ー ロ	2,566,665	20.3	1,950,095	15.7
豪 ド ル	1,656,420	13.1	1,469,473	11.8
ニュージーランドドル	385,779	3.0	357,228	2.9
カナダドル	218,115	1.7	219,624	1.8
中 国 元	109,231	0.9	65,799	0.5
ベトナムドン	52,257	0.4	52,259	0.4
シンガポールドル	37,004	0.3	37,004	0.3
インドネシアルピア	15,722	0.1	15,723	0.1
ポーランドズロチ	31,532	0.2	2,254	0.0
メキシコペソ	14,298	0.1	-	-
そ の 他	24	0.0	18	0.0
合 計	12,660,503	100.0	12,440,176	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	2021年度末		2022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	59,314	12,039	54,478	8,395

(2) 変額個人年金保険

(単位：百万円)

区 分	2021年度末		2022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	48,847	4,178	39,286	1,399

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	2021年度末			2022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	294	-	△0	△0	286	-	7	7
	買建	-	-	-	-	-	-	-	-
	合 計				△0				7

(通貨関連)

(単位：百万円)

区分	種 類	2021年度末			2022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	611	-	1	1	99	-	△3	△3	
	(米ドル)	300	-	2	2	-	-	-	-	
	(ユーロ)	256	-	△1	△1	56	-	△1	△1	
	(豪ドル)	10	-	0	0	-	-	-	-	
	(カナダドル)	9	-	0	0	-	-	-	-	
	(英ポンド)	27	-	0	0	42	-	△1	△1	
	(ノルウェークローネ)	2	-	△0	△0	-	-	-	-	
	(ポーランドズロチ)	2	-	△0	△0	-	-	-	-	
	買建	113	-	0	0	992	-	2	2	
	(米ドル)	51	-	0	0	764	-	0	0	
	(ユーロ)	61	-	0	0	113	-	0	0	
	(カナダドル)	-	-	-	-	17	-	0	0	
	(スイスフラン)	-	-	-	-	28	-	0	0	
	(デンマーククローネ)	-	-	-	-	5	-	0	0	
	(英ポンド)	-	-	-	-	50	-	1	1	
	(ノルウェークローネ)	-	-	-	-	2	-	0	0	
	(スウェーデンクローナ)	-	-	-	-	1	-	0	0	
	(シンガポールドル)	-	-	-	-	2	-	0	0	
	(香港ドル)	-	-	-	-	6	-	0	0	
		合 計				1				△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	2021年度末			2022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	876	-	107	107	837	-	△18	
	合 計							△18	

(通貨関連)

(単位：百万円)

区分	種 類	2021年度末			2022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	108	-	△0	△0	60	-	△1	△1
	(米ドル)	34	-	△0	△0	-	-	-	-
	(ユーロ)	73	-	△0	△0	31	-	△0	△0
	(英ポンド)	-	-	-	-	28	-	△1	△1
	買建	108	-	0	0	60	-	1	1
	(米ドル)	35	-	0	0	31	-	0	0
	(ユーロ)	72	-	0	0	16	-	0	0
	(英ポンド)	-	-	-	-	11	-	0	0
		合 計							

(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	2021年度末		2022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	1,144,510	3.1	1,648,018	4.5
買入金銭債権	310,140	0.9	482,669	1.3
金銭の信託	4,914	0.0	8,758	0.0
有 価 証 券	31,362,641	86.1	30,691,277	83.2
公 社 債	14,767,636	40.5	14,643,766	39.7
株 式	2,595,648	7.1	2,543,727	6.9
外 国 証 券	13,470,574	37.0	13,022,712	35.3
公 社 債	10,834,516	29.7	10,434,749	28.3
株 式 等	2,636,058	7.2	2,587,962	7.0
その他の証券	528,781	1.5	481,070	1.3
貸 付 金	2,192,253	6.0	2,237,230	6.1
保 険 約 款 貸 付	244,196	0.7	239,006	0.6
一 般 貸 付	1,948,057	5.3	1,998,223	5.4
不 動 産	556,472	1.5	588,249	1.6
う ち 投 資 用	392,177	1.1	403,785	1.1
繰延税金資産	288,586	0.8	645,667	1.7
そ の 他	584,728	1.6	609,633	1.7
貸倒引当金	△925	△0.0	△870	△0.0
会 社 計	36,443,323	100.0	36,910,634	100.0
う ち 外 貨 建 資 産	12,907,664	35.4	12,682,385	34.4

(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	2021年度 第2四半期(上半期)	2022年度 第2四半期(上半期)
	金 額	金 額
現預金・コールローン	△255,141	503,508
買入金銭債権	△107,147	172,528
金銭の信託	2,244	3,844
有 価 証 券	514,167	△671,364
公 社 債	118,269	△123,870
株 式	85,740	△51,921
外 国 証 券	271,505	△447,862
公 社 債	△57,460	△399,766
株 式 等	328,966	△48,096
その他の証券	38,651	△47,710
貸 付 金	220,740	44,976
保 険 約 款 貸 付	△8,197	△5,190
一 般 貸 付	228,938	50,166
不 動 産	△3,026	31,776
う ち 投 資 用	△2,706	11,607
繰延税金資産	△4,530	357,081
そ の 他	△48,312	24,904
貸倒引当金	△25	54
会 社 計	318,969	467,310
う ち 外 貨 建 資 産	209,420	△225,278

(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	2021年度末		2022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
売買目的有価証券	646,559	△6,819	596,809	△32,301

(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	2021年度末					2022年度第2四半期(上半期)末				
	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	1,569,177	1,812,094	242,917	242,925	△8	1,553,656	1,798,631	244,974	245,039	△65
責任準備金対応債券	12,514,443	13,596,489	1,082,045	1,277,927	△195,882	12,820,423	13,161,509	341,085	1,027,065	△685,979
子会社・関連会社株式	52,238	53,679	1,441	1,441	-	52,238	53,216	977	977	-
その他の有価証券	15,177,316	16,387,386	1,210,069	1,599,191	△389,121	15,762,423	15,709,702	△52,721	1,403,857	△1,456,578
公 社 債	2,752,734	2,709,967	△42,767	44,159	△86,927	2,790,160	2,570,772	△219,388	51,580	△270,969
株 式	1,155,190	2,297,231	1,142,041	1,181,568	△39,527	1,242,066	2,237,540	995,473	1,033,006	△37,533
外 国 証 券	10,149,382	10,231,870	82,488	335,724	△253,236	10,320,871	9,514,080	△806,790	295,247	△1,102,038
公 社 債	8,461,174	8,457,396	△3,777	181,643	△185,421	8,452,016	7,826,343	△625,673	205,937	△831,611
株 式 等	1,688,207	1,774,473	86,266	154,081	△67,815	1,868,854	1,687,737	△181,117	89,309	△270,427
その他の証券	411,007	435,347	24,340	32,845	△8,504	399,179	376,695	△22,484	20,673	△43,158
買入金銭債権	188,102	192,123	4,021	4,891	△870	367,745	368,254	509	3,348	△2,839
譲渡性預金	520,900	520,844	△55	-	△55	642,400	642,359	△40	-	△40
その他	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
合 計	29,313,176	31,849,649	2,536,473	3,121,486	△585,012	30,188,742	30,723,058	534,315	2,676,939	△2,142,623
公 社 債	14,563,186	15,651,386	1,088,199	1,323,856	△235,656	14,645,971	14,984,097	338,125	1,090,140	△752,015
株 式	1,155,190	2,297,231	1,142,041	1,181,568	△39,527	1,242,066	2,237,540	995,473	1,033,006	△37,533
外 国 証 券	12,474,789	12,752,715	277,925	578,323	△300,398	12,891,379	12,114,111	△777,267	529,770	△1,307,037
公 社 債	10,734,343	10,924,561	190,217	422,801	△232,583	10,970,286	10,373,158	△597,127	439,482	△1,036,610
株 式 等	1,740,446	1,828,153	87,707	155,522	△67,815	1,921,093	1,740,953	△180,139	90,287	△270,427
その他の証券	411,007	435,347	24,340	32,845	△8,504	399,179	376,695	△22,484	20,673	△43,158
買入金銭債権	188,102	192,123	4,021	4,891	△870	367,745	368,254	509	3,348	△2,839
譲渡性預金	520,900	520,844	△55	-	△55	642,400	642,359	△40	-	△40
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	2021年度末	2022年度 第2四半期(上半期)末
子会社・関連会社株式	743,750	764,086
その他の有価証券	134,191	160,921
国 内 株 式	19,990	19,949
外 国 株 式	34,558	34,558
そ の 他	79,642	106,413
合 計	877,942	925,008

c. 金銭の信託の時価情報(会社計)

(単位：百万円)

区 分	2021年度末					2022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		四半期 貸借対照表 計上額	時価	差損益	差	
				差益	差損				差益	差損
金 銭 の 信 託	4,914	4,914	-	-	-	8,758	8,758	-	-	-

(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	2021年度末		2022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	4,914	383	8,758	1,149

・運用目的以外の金銭の信託

2021年度末、2022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	
	2021年9月末	2022年9月末	2021年9月末	2022年9月末
金利スワップ 金利スワップション(買建)	950	1,196	58	230
為替予約	111,889	112,698	2,793	2,089
通貨スワップ 通貨オプション(買建)	7,495	6,358	827	1,232
株式オプション(買建) 株価指数先渡	660	400	39	24
マルチ・アセット指数オプション(買建)	1,299	1,922	155	198
合計			1,553	1,024

(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	2021年度末						2022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	5,768	△555,980	-	-	-	△550,211	4,110	△866,748	-	-	-	△862,638
ヘッジ会計非適用分	△568	△75,805	△7,310	△1,133	△762	△85,580	△715	△246,111	4,347	△884	△2,737	△246,100
合 計	5,200	△631,785	△7,310	△1,133	△762	△635,792	3,395	△1,112,860	4,347	△884	△2,737	△1,108,738

(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、2021年度末通貨関連 △585,471百万円、2022年度第2四半期(上半期)末通貨関連 △902,245百万円となっています。

(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	2021年度末			2022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	金利スワップ 固定金利受取/変動金利支払	47,500	47,500	△568	△568	32,500	32,500	△715	△715
	合 計				△568				△715

(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	2021年度末			2022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	11,500	11,500	△14	11,500	5,500	△13
	金利スワップ 固定金利受取/変動金利支払	保険負債	77,500	77,500	△5,038	155,000	155,000	△17,234
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	80	35	0	57	22	0
	固定金利支払/変動金利受取		91,792	91,792	10,820	108,607	108,607	21,358
	合 計				5,768			4,110

(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	2021年度末			2022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	2,215,532	-	△221,515	△221,515	2,121,380	3,421	△294,122	△294,122
	(米ドル)	983,269	-	△118,453	△118,453	1,341,087	3,421	△236,199	△236,199
	(ユーロ)	582,889	-	△29,456	△29,456	532,872	-	△47,672	△47,672
	(ニュージーランドドル)	119,382	-	△12,591	△12,591	118,498	-	50	50
	(豪ドル)	513,509	-	△60,675	△60,675	109,328	-	△10,373	△10,373
	買建	2,640,665	-	147,989	147,989	1,734,423	4,024	51,802	51,802
	(米ドル)	989,700	-	47,798	47,798	1,003,860	4,024	36,839	36,839
	(ユーロ)	1,034,799	-	60,119	60,119	536,115	-	18,051	18,051
	(ニュージーランドドル)	124,363	-	2,328	2,328	116,266	-	△4,758	△4,758
	(豪ドル)	485,776	-	37,184	37,184	76,974	-	1,640	1,640
	通貨オプション								
	売建								
	コール	120,000	-			83,200	-		
	(米ドル)	(313)		2,169	△1,856	(678)		3,936	△3,258
	買建	120,000	-			83,200	-		
	(米ドル)	(313)		2,169	△1,856	(678)		3,936	△3,258
	売建								
	プット	100,000	-			67,400	-		
	(米ドル)	(422)			△422	(669)		136	△532
買建	100,000	-			67,400	-			
(米ドル)	(422)			△422	(669)		136	△532	
合計									△246,111

(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	2021年度末			2022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		7,894,713	3,363,811	△585,471	7,414,063	677,036	△902,245
	(米ドル)		3,829,723	1,656,305	△318,481	3,928,016	436,159	△699,298
	(ユーロ)		2,546,059	1,265,539	△126,821	2,110,727	240,877	△122,959
	(豪ドル)	1,159,427	441,967	△114,262	1,060,947	-	△88,401	
繰延ヘッジ	通貨スワップ	外貨建資産	37,806	37,806	△5,352	37,806	37,806	△10,004
	(米ドル)		35,351	35,351	△5,057	35,351	35,351	△9,652
	(ユーロ)		2,454	2,454	△294	2,454	2,454	△352
振当処理	通貨スワップ	外貨建資産	185,118	185,118	△15,141	185,118	178,914	△48,185
	(米ドル)		185,118	185,118	△15,141	185,118	178,914	△48,185
	通貨スワップ	外貨建負債	345,510	345,510	49,984	345,510	246,030	93,686
	(米ドル)		345,510	345,510	49,984	345,510	246,030	93,686
合計								△866,748

(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	2021年度末			2022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	83,809	-	△6,326	△6,326	58,233	-	4,425	4,425
	買建	5,044	-	408	408	12,933	-	△551	△551
店頭	株価指数オプション								
	売建	-	-			40,000	-		
	コール	(-)		-	-	(1,046)		502	543
	買建								
	プット	66,000	-			40,000	-		
	合 計	(1,392)		0	△1,391	(2,159)		2,089	△70
									4,347

(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)

2021年度末、2022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	2021年度末			2022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								
	買建	66,423	-	△1,133	△1,133	43,764	-	△884	△884
	合 計				△1,133				△884

(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)

2021年度末、2022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	2021年度末			2022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	136,100	-			133,165	-		
		(414)		187	227	(364)		51	313
	買 建								
	コール	143,926	-			192,290	-		
	合 計	(2,882)		1,892	△990	(3,687)		636	△3,050
					△762				△2,737

(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)

2021年度末、2022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。