2024 年 11 月 22 日
住友生命保険相互会社

# 2024 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 | 2023年度末 | | 2024年度<br>第2四半期(上半期)末 | |
|---|---|---|---|---|
| | 金　額 | 占率 | 金　額 | 占率 |
| 国債 | 11,176,175 | 35.2 | 11,143,780 | 36.2 |
| 地方債 | 179,710 | 0.6 | 176,984 | 0.6 |
| 社債 | 3,064,290 | 9.6 | 2,892,548 | 9.4 |
| うち公社・公団債 | 1,826,541 | 5.7 | 1,677,548 | 5.4 |
| うち外貨建 | 407,026 | 1.3 | 293,773 | 1.0 |
| 株式 | 3,279,944 | 10.3 | 3,180,491 | 10.3 |
| 外国証券 | 13,560,063 | 42.7 | 12,907,306 | 41.9 |
| 公社債 | 10,020,877 | 31.5 | 9,219,100 | 29.9 |
| うち外貨建 | 7,680,012 | 24.2 | 6,917,790 | 22.5 |
| 株式等 | 3,539,186 | 11.1 | 3,688,205 | 12.0 |
| うち外貨建 | 3,393,525 | 10.7 | 3,547,068 | 11.5 |
| その他の証券 | 528,885 | 1.7 | 509,213 | 1.7 |
| 合計 | 31,789,069 | 100.0 | 30,810,325 | 100.0 |
| うち外貨建 | 11,480,564 | 36.1 | 10,758,632 | 34.9 |

#### （２）地域別地方債保有内訳

（単位：百万円）

| 区　分 | 2023年度末 | 2024年度<br>第2四半期(上半期)末 |
|---|---|---|
| 北海道 | 429 | 428 |
| 東北 | － | － |
| 関東 | 82,723 | 82,098 |
| 中部 | 38,396 | 37,374 |
| 近畿 | 35,595 | 34,693 |
| 中国 | 3,097 | 3,025 |
| 四国 | － | － |
| 九州 | 19,468 | 19,362 |
| 合計 | 179,710 | 176,984 |

## （３）有価証券残存期間別残高

＜2023年度末＞

（単位：百万円）

| 区　分 | 1年以下 | 1年超<br>3年以下 | 3年超<br>5年以下 | 5年超<br>7年以下 | 7年超<br>10年以下 | 10年超 | 期間の定めのないもの | 合　計 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 有　価　証　券 | 560,635 | 1,401,480 | 1,928,423 | 3,628,983 | 4,429,505 | 12,736,870 | 7,103,171 | 31,789,069 |
| 国　債 | 103,235 | 551,033 | 825,321 | 2,185,463 | 1,906,805 | 5,604,316 | － | 11,176,175 |
| 地　方　債 | 5,864 | － | － | 11,864 | 7,768 | 154,212 | － | 179,710 |
| 社　債 | 71,559 | 257,846 | 211,222 | 190,033 | 119,884 | 1,813,662 | 400,080 | 3,064,290 |
| 株　式 | | | | | | | 3,279,944 | 3,279,944 |
| 外国証券 | 379,975 | 591,748 | 890,544 | 1,225,227 | 2,372,278 | 5,154,469 | 2,945,819 | 13,560,063 |
| 公社債 | 379,975 | 580,959 | 876,624 | 1,183,586 | 2,047,721 | 4,922,797 | 29,213 | 10,020,877 |
| 株式等 | 0 | 10,788 | 13,920 | 41,640 | 324,557 | 231,672 | 2,916,606 | 3,539,186 |
| その他の証券 | － | 853 | 1,333 | 16,393 | 22,768 | 10,208 | 477,327 | 528,885 |
| 買入金銭債権 | 235,977 | － | － | － | － | 141,323 | － | 377,300 |
| 譲渡性預金 | 254,952 | － | － | － | － | － | － | 254,952 |
| そ　の　他 | － | － | － | － | － | 5,035 | 19,309 | 24,345 |
| 合　計 | 1,051,564 | 1,401,480 | 1,928,423 | 3,628,983 | 4,429,505 | 12,883,229 | 7,122,481 | 32,445,668 |

＜2024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<br>3年以下 | 3年超<br>5年以下 | 5年超<br>7年以下 | 7年超<br>10年以下 | 10年超 | 期間の定めのないもの | 合　計 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 有　価　証　券 | 487,694 | 1,275,821 | 1,946,992 | 3,530,609 | 4,025,069 | 12,424,460 | 7,119,677 | 30,810,325 |
| 国　債 | 76,763 | 522,436 | 991,170 | 2,383,936 | 1,615,078 | 5,554,394 | － | 11,143,780 |
| 地　方　債 | 5,151 | － | － | 13,961 | 10,801 | 147,070 | － | 176,984 |
| 社　債 | 53,111 | 232,618 | 229,440 | 94,274 | 141,432 | 1,691,748 | 449,922 | 2,892,548 |
| 株　式 | | | | | | | 3,180,491 | 3,180,491 |
| 外国証券 | 352,144 | 520,766 | 725,289 | 1,014,288 | 2,234,236 | 5,019,266 | 3,041,314 | 12,907,306 |
| 公社債 | 352,144 | 505,880 | 701,021 | 972,231 | 1,904,815 | 4,753,928 | 29,079 | 9,219,100 |
| 株式等 | 0 | 14,886 | 24,268 | 42,056 | 329,421 | 265,338 | 3,012,235 | 3,688,205 |
| その他の証券 | 523 | － | 1,091 | 24,148 | 23,520 | 11,980 | 447,948 | 509,213 |
| 買入金銭債権 | 243,960 | － | － | － | － | 141,862 | － | 385,823 |
| 譲渡性預金 | 289,903 | － | － | － | － | － | － | 289,903 |
| そ　の　他 | － | － | － | － | － | 14,581 | 18,944 | 33,525 |
| 合　計 | 1,021,558 | 1,275,821 | 1,946,992 | 3,530,609 | 4,025,069 | 12,580,904 | 7,138,621 | 31,519,578 |

（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 | | 2023年度末 | | 2024年度 第2四半期(上半期)末 | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 金額 | 占率 | 金額 | 占率 |
| 水産・農林業 | | 390 | 0.0 | 375 | 0.0 |
| 鉱業 | | 168 | 0.0 | 139 | 0.0 |
| 建設業 | | 114,729 | 3.5 | 123,974 | 3.9 |
| 製造業 | 食料品 | 102,915 | 3.1 | 103,845 | 3.3 |
| | 繊維製品 | 14,791 | 0.5 | 12,850 | 0.4 |
| | パルプ・紙 | 9,541 | 0.3 | 8,221 | 0.3 |
| | 化学 | 217,801 | 6.6 | 202,462 | 6.4 |
| | 医薬品 | 257,075 | 7.8 | 245,840 | 7.7 |
| | 石油・石炭製品 | 10,759 | 0.3 | 10,893 | 0.3 |
| | ゴム製品 | 17,531 | 0.5 | 16,905 | 0.5 |
| | ガラス・土石製品 | 48,077 | 1.5 | 47,711 | 1.5 |
| | 鉄鋼 | 34,645 | 1.1 | 32,347 | 1.0 |
| | 非鉄金属 | 75,129 | 2.3 | 90,946 | 2.9 |
| | 金属製品 | 16,204 | 0.5 | 12,781 | 0.4 |
| | 機械 | 225,623 | 6.9 | 208,496 | 6.6 |
| | 電気機器 | 431,882 | 13.2 | 419,936 | 13.2 |
| | 輸送用機器 | 135,957 | 4.1 | 102,473 | 3.2 |
| | 精密機器 | 28,309 | 0.9 | 23,645 | 0.7 |
| | その他製品 | 57,179 | 1.7 | 64,548 | 2.0 |
| 電気・ガス業 | | 41,512 | 1.3 | 40,566 | 1.3 |
| 運輸・情報通信業 | 陸運業 | 188,113 | 5.7 | 165,115 | 5.2 |
| | 海運業 | 15,301 | 0.5 | 20,964 | 0.7 |
| | 空運業 | 3,863 | 0.1 | 3,708 | 0.1 |
| | 倉庫・運輸関連業 | 13,496 | 0.4 | 13,732 | 0.4 |
| | 情報・通信業 | 109,464 | 3.3 | 104,206 | 3.3 |
| 商業 | 卸売業 | 325,744 | 9.9 | 313,742 | 9.9 |
| | 小売業 | 57,211 | 1.7 | 50,931 | 1.6 |
| 金融・保険業 | 銀行業 | 278,814 | 8.5 | 293,437 | 9.2 |
| | 証券、商品先物取引業 | 15,477 | 0.5 | 13,280 | 0.4 |
| | 保険業 | 249,310 | 7.6 | 269,207 | 8.5 |
| | その他金融業 | 43,883 | 1.3 | 41,488 | 1.3 |
| 不動産業 | | 61,911 | 1.9 | 53,881 | 1.7 |
| サービス業 | | 77,122 | 2.4 | 67,832 | 2.1 |
| 合計 | | 3,279,944 | 100.0 | 3,180,491 | 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 | 2023年度末 | 2024年度<br>第2四半期(上半期)末 |
|---|---|---|
| 保険約款貸付 | 226,775 | 222,504 |
| 契約者貸付 | 207,831 | 203,733 |
| 保険料振替貸付 | 18,944 | 18,771 |
| 一般貸付 | 1,937,734 | 1,828,963 |
| （うち非居住者貸付） | (154,522) | (148,012) |
| 企業貸付 | 1,815,024 | 1,795,640 |
| （うち国内企業向け） | (1,660,502) | (1,647,627) |
| 国・国際機関・政府関係機関貸付 | 89,835 | 244 |
| 公共団体・公企業貸付 | 31,500 | 31,871 |
| 住宅ローン | 1,372 | 1,204 |
| 消費者ローン | 2 | 3 |
| その他 | － | － |
| 合　計 | 2,164,509 | 2,051,467 |

### （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 | | 2023年度末 | | 2024年度<br>第2四半期(上半期)末 | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | 占率 | | 占率 |
| 大企業 | 貸付先数 | 168 | 72.7 | 163 | 72.4 |
| | 金額 | 1,438,767 | 86.6 | 1,437,391 | 87.2 |
| 中堅企業 | 貸付先数 | － | － | － | － |
| | 金額 | － | － | － | － |
| 中小企業 | 貸付先数 | 63 | 27.3 | 62 | 27.6 |
| | 金額 | 221,735 | 13.4 | 210,235 | 12.8 |
| 国内企業向け貸付計 | 貸付先数 | 231 | 100.0 | 225 | 100.0 |
| | 金額 | 1,660,502 | 100.0 | 1,647,627 | 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 | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 大企業 | 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 |
| 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 | |

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

＜2023年度末＞

（単位：百万円）

| 区　　分 | 1年以下 | 1年超<br>3年以下 | 3年超<br>5年以下 | 5年超<br>7年以下 | 7年超<br>10年以下 | 10年超 | 期間の定めのないもの | 合　計 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 変 動 金 利 | 60,513 | 7,941 | 61,603 | 73,787 | 8,258 | 98,581 | 40,000 | 350,685 |
| 固 定 金 利 | 199,679 | 235,978 | 176,728 | 149,517 | 274,824 | 550,319 | － | 1,587,048 |
| 一般貸付計 | 260,192 | 243,919 | 238,332 | 223,305 | 283,083 | 648,901 | 40,000 | 1,937,734 |

＜2024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<br>3年以下 | 3年超<br>5年以下 | 5年超<br>7年以下 | 7年超<br>10年以下 | 10年超 | 期間の定めのないもの | 合　計 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 変 動 金 利 | 61,949 | 10,856 | 56,678 | 67,040 | 10,248 | 103,749 | 50,000 | 360,523 |
| 固 定 金 利 | 113,835 | 262,147 | 132,739 | 130,363 | 290,406 | 538,947 | － | 1,468,439 |
| 一般貸付計 | 175,785 | 273,004 | 189,417 | 197,403 | 300,654 | 642,697 | 50,000 | 1,828,963 |

## （4）貸付金業種別内訳

（単位：百万円、%）

| 区分 | | | 2023年度末 金額 | 2023年度末 占率 | 2024年度 第2四半期(上半期)末 金額 | 2024年度 第2四半期(上半期)末 占率 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 国内向け | 製造業 | | 152,502 | 7.9 | 152,245 | 8.3 |
| | | 食料 | 14,774 | 0.8 | 10,280 | 0.6 |
| | | 繊維 | 900 | 0.0 | 900 | 0.0 |
| | | 木材・木製品 | 100 | 0.0 | 100 | 0.0 |
| | | パルプ・紙 | 18,380 | 0.9 | 18,360 | 1.0 |
| | | 印刷 | － | － | － | － |
| | | 化学 | 25,922 | 1.3 | 24,779 | 1.4 |
| | | 石油・石炭 | 26,800 | 1.4 | 26,800 | 1.5 |
| | | 窯業・土石 | 10,182 | 0.5 | 11,117 | 0.6 |
| | | 鉄鋼 | 8,100 | 0.4 | 13,100 | 0.7 |
| | | 非鉄金属 | 4,650 | 0.2 | 4,650 | 0.3 |
| | | 金属製品 | 1,000 | 0.1 | － | － |
| | | はん用・生産用・業務用機械 | 13,537 | 0.7 | 14,563 | 0.8 |
| | | 電気機械 | 12,357 | 0.6 | 11,821 | 0.6 |
| | | 輸送用機械 | 14,800 | 0.8 | 14,775 | 0.8 |
| | | その他の製造業 | 1,000 | 0.1 | 1,000 | 0.1 |
| | 農業、林業 | | － | － | － | － |
| | 漁業 | | － | － | － | － |
| | 鉱業、採石業、砂利採取業 | | － | － | － | － |
| | 建設業 | | 10,825 | 0.6 | 11,968 | 0.7 |
| | 電気・ガス・熱供給・水道業 | | 257,107 | 13.3 | 259,039 | 14.2 |
| | 情報通信業 | | 23,500 | 1.2 | 23,500 | 1.3 |
| | 運輸業、郵便業 | | 172,955 | 8.9 | 175,681 | 9.6 |
| | 卸売業 | | 322,600 | 16.6 | 312,800 | 17.1 |
| | 小売業 | | 4,871 | 0.3 | 4,708 | 0.3 |
| | 金融業、保険業 | | 440,747 | 22.7 | 439,258 | 24.0 |
| | 不動産業 | | 192,147 | 9.9 | 190,517 | 10.4 |
| | 物品賃貸業 | | 107,012 | 5.5 | 102,023 | 5.6 |
| | 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 | | 8,000 | 0.4 | 8,000 | 0.4 |
| | 地方公共団体 | | － | － | － | － |
| | 個人（住宅・消費・納税資金等） | | 1,374 | 0.1 | 1,207 | 0.1 |
| | 合計 | | 1,783,211 | 92.0 | 1,680,950 | 91.9 |
| 海外向け | 政府等 | | － | － | － | － |
| | 金融機関 | | 154,522 | 8.0 | 148,012 | 8.1 |
| | 商工業等 | | － | － | － | － |
| | 合計 | | 154,522 | 8.0 | 148,012 | 8.1 |
| 一般貸付計 | | | 1,937,734 | 100.0 | 1,828,963 | 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。
(2023年度末 895億円、2024年度第2四半期(上半期)末 残高なし)

## （５）貸付金担保別内訳

（単位：百万円、％）

| 区　分 | 2023年度末 | | 2024年度<br>第2四半期(上半期)末 | |
|---|---|---|---|---|
| | 金　額 | 占率 | 金　額 | 占率 |
| 担保貸付 | 9,534 | 0.5 | 7,711 | 0.4 |
| 有価証券担保貸付 | － | － | － | － |
| 不動産・動産・財団担保貸付 | 9,534 | 0.5 | 7,711 | 0.4 |
| 指名債権担保貸付 | － | － | － | － |
| 保証貸付 | 10,838 | 0.6 | 10,440 | 0.6 |
| 信用貸付 | 1,915,986 | 98.9 | 1,809,602 | 98.9 |
| その他 | 1,374 | 0.1 | 1,207 | 0.1 |
| 一般貸付計 | 1,937,734 | 100.0 | 1,828,963 | 100.0 |
| うち劣後特約付貸付 | 162,300 | 8.4 | 178,300 | 9.7 |

## （６）貸付金地域別内訳

（単位：百万円、％）

| 区　分 | 2023年度末 | | 2024年度<br>第2四半期(上半期)末 | |
|---|---|---|---|---|
| | 金　額 | 占率 | 金　額 | 占率 |
| 北海道 | 10,070 | 0.6 | 9,877 | 0.6 |
| 東北 | 18,102 | 1.0 | 18,200 | 1.1 |
| 関東 | 1,465,159 | 82.2 | 1,368,896 | 81.5 |
| 中部 | 92,300 | 5.2 | 92,300 | 5.5 |
| 近畿 | 144,151 | 8.1 | 138,580 | 8.3 |
| 中国 | 17,400 | 1.0 | 17,350 | 1.0 |
| 四国 | 5,430 | 0.3 | 5,365 | 0.3 |
| 九州 | 29,224 | 1.6 | 29,173 | 1.7 |
| 合　計 | 1,781,837 | 100.0 | 1,679,743 | 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 | 2023年度末 | | 2024年度<br>第2四半期(上半期)末 | |
|---|---|---|---|---|
| | 金　額 | 占率 | 金　額 | 占率 |
| 公社債 | 8,087,039 | 53.7 | 7,211,563 | 49.9 |
| 株式等 | 3,393,525 | 22.6 | 3,547,068 | 24.5 |
| 現預金・その他 | 599,977 | 4.0 | 715,446 | 5.0 |
| 外貨建資産計 | 12,080,542 | 80.3 | 11,474,078 | 79.4 |

（イ）円貨額が確定した外貨建資産

（単位：百万円、%）

| 区　分 | 2023年度末 | | 2024年度<br>第2四半期(上半期)末 | |
|---|---|---|---|---|
| | 金　額 | 占率 | 金　額 | 占率 |
| 貸付金 | 232,867 | 1.5 | 222,687 | 1.5 |
| 現預金・その他 | 3,235 | 0.0 | 3,227 | 0.0 |
| 円貨額が確定した外貨建資産計 | 236,103 | 1.6 | 225,915 | 1.6 |

（ウ）円貨建資産

（単位：百万円、%）

| 区　分 | 2023年度末 | | 2024年度<br>第2四半期(上半期)末 | |
|---|---|---|---|---|
| | 金　額 | 占率 | 金　額 | 占率 |
| 公社債 | 2,340,865 | 15.6 | 2,301,310 | 15.9 |
| 株式等 | 347,851 | 2.3 | 345,218 | 2.4 |
| その他 | 42,312 | 0.3 | 104,604 | 0.7 |
| 円貨建資産計 | 2,731,029 | 18.1 | 2,751,133 | 19.0 |

（エ）合計

（単位：百万円、%）

| 区　分 | 2023年度末 | | 2024年度<br>第2四半期(上半期)末 | |
|---|---|---|---|---|
| | 金　額 | 占率 | 金　額 | 占率 |
| 海外投融資 | 15,047,675 | 100.0 | 14,451,127 | 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 | | 2023年度末 | | | | 2024年度第2四半期（上半期）末 | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 外国証券 | | | 非居住者貸付 | 外国証券 | | | 非居住者貸付 |
| | | | 公社債 | 株式等 | | | 公社債 | 株式等 | |
| 北米 | 金額 | 6,083,550 | 5,116,322 | 967,227 | 154,522 | 5,555,041 | 4,380,799 | 1,174,241 | 148,012 |
| | 占率 | 44.9 | 51.1 | 27.3 | 100.0 | 43.0 | 47.5 | 31.8 | 100.0 |
| ヨーロッパ | 金額 | 2,262,239 | 2,053,678 | 208,560 | － | 2,368,662 | 2,134,962 | 233,700 | － |
| | 占率 | 16.7 | 20.5 | 5.9 | － | 18.4 | 23.2 | 6.3 | － |
| オセアニア | 金額 | 709,496 | 709,496 | － | － | 706,625 | 706,625 | － | － |
| | 占率 | 5.2 | 7.1 | － | － | 5.5 | 7.7 | － | － |
| アジア | 金額 | 581,356 | 35,164 | 546,192 | － | 579,639 | 34,822 | 544,816 | － |
| | 占率 | 4.3 | 0.4 | 15.4 | － | 4.5 | 0.4 | 14.8 | － |
| 中南米 | 金額 | 3,682,859 | 1,865,653 | 1,817,206 | － | 3,473,204 | 1,737,757 | 1,735,447 | － |
| | 占率 | 27.2 | 18.6 | 51.3 | － | 26.9 | 18.8 | 47.1 | － |
| 中東 | 金額 | － | － | － | － | － | － | － | － |
| | 占率 | － | － | － | － | － | － | － | － |
| アフリカ | 金額 | 3,510 | 3,510 | － | － | 3,500 | 3,500 | － | － |
| | 占率 | 0.0 | 0.0 | － | － | 0.0 | 0.0 | － | － |
| 国際機関 | 金額 | 237,050 | 237,050 | － | － | 220,632 | 220,632 | － | － |
| | 占率 | 1.7 | 2.4 | － | － | 1.7 | 2.4 | － | － |
| 合計 | 金額 | 13,560,063 | 10,020,877 | 3,539,186 | 154,522 | 12,907,306 | 9,219,100 | 3,688,205 | 148,012 |
| | 占率 | 100.0 | 100.0 | 100.0 | 100.0 | 100.0 | 100.0 | 100.0 | 100.0 |

（注）本表は発行会社の国籍に基づき作成されています。

## （３）外貨建資産の通貨別構成

（単位：百万円、%）

| 区分 | 2023年度末 | | 2024年度第2四半期（上半期）末 | |
|---|---|---|---|---|
| | 金額 | 占率 | 金額 | 占率 |
| 米ドル | 9,469,941 | 78.4 | 8,723,316 | 76.0 |
| 豪ドル | 929,565 | 7.7 | 958,221 | 8.4 |
| ユーロ | 693,525 | 5.7 | 770,439 | 6.7 |
| シンガポールドル | 462,258 | 3.8 | 462,144 | 4.0 |
| カナダドル | 308,185 | 2.6 | 305,416 | 2.7 |
| ニュージーランドドル | 94,027 | 0.8 | 97,697 | 0.9 |
| 中国元 | 55,249 | 0.5 | 53,088 | 0.5 |
| ベトナムドン | 42,814 | 0.4 | 42,795 | 0.4 |
| メキシコペソ | 2,518 | 0.0 | 38,308 | 0.3 |
| インドネシアルピア | 15,724 | 0.1 | 15,724 | 0.1 |
| 英ポンド | 6,116 | 0.1 | 6,093 | 0.1 |
| その他 | 614 | 0.0 | 832 | 0.0 |
| 合計 | 12,080,542 | 100.0 | 11,474,078 | 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 | 2023年度末 | | 2024年度<br>第2四半期（上半期）末 | |
|---|---|---|---|---|
| | 貸借対照表<br>計上額 | 当期の損益に含<br>まれた評価損益 | 貸借対照表<br>計上額 | 当期の損益に含<br>まれた評価損益 |
| 売買目的有価証券 | 64,010 | 16,879 | 59,196 | 13,022 |

#### （２）変額個人年金保険

（単位：百万円）

| 区　　分 | 2023年度末 | | 2024年度<br>第2四半期（上半期）末 | |
|---|---|---|---|---|
| | 貸借対照表<br>計上額 | 当期の損益に含<br>まれた評価損益 | 貸借対照表<br>計上額 | 当期の損益に含<br>まれた評価損益 |
| 売買目的有価証券 | 34,184 | 3,491 | 31,300 | 2,421 |

### 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 | 2023年度末 | | | | 2024年度第2四半期（上半期）末 | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 契約額等 | うち１年超 | 時価 | 差損益 | 契約額等 | うち１年超 | 時価 | 差損益 |
| 取引所 | 株価指数先物 | | | | | | | | |
| | 売建 | 994 | － | 4 | 4 | － | － | － | － |
| | 買建 | － | － | － | － | － | － | － | － |
| 合　計 | | | | | 4 | | | | － |

（通貨関連）　　（単位：百万円）

| 区分 | 種　類 | 2023年度末 | | | | 2024年度第2四半期（上半期）末 | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 契約額等 | うち１年超 | 時価 | 差損益 | 契約額等 | うち１年超 | 時価 | 差損益 |
| 店頭 | 為替予約 | | | | | | | | |
| | 売建 | － | － | － | － | 202 | － | 2 | 2 |
| | (米ドル) | － | － | － | － | 116 | － | 1 | 1 |
| | (ユーロ) | － | － | － | － | 63 | － | 0 | 0 |
| | (英ポンド) | － | － | － | － | 22 | － | 0 | 0 |
| | 買建 | － | － | － | － | － | － | － | － |
| | (米ドル) | － | － | － | － | － | － | － | － |
| | (ユーロ) | － | － | － | － | － | － | － | － |
| 合　計 | | | | | － | | | | 2 |

(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 | 2023年度末 | | | | 2024年度第2四半期（上半期）末 | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 契約額等 | うち１年超 | 時価 | 差損益 | 契約額等 | うち１年超 | 時価 | 差損益 |
| 取引所 | 株価指数先物 | | | | | | | | |
| | 売建 | － | － | － | － | － | － | － | － |
| | 買建 | 362 | － | △4 | △4 | 25 | － | 1 | 1 |
| 合　計 | | | | | △4 | | | | 1 |

（通貨関連）　　（単位：百万円）

| 区分 | 種　類 | 2023年度末 | | | | 2024年度第2四半期（上半期）末 | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 契約額等 | うち１年超 | 時価 | 差損益 | 契約額等 | うち１年超 | 時価 | 差損益 |
| 店頭 | 為替予約 | | | | | | | | |
| | 売建 | － | － | － | － | 232 | － | 3 | 3 |
| | (米ドル) | － | － | － | － | 138 | － | 2 | 2 |
| | (ユーロ) | － | － | － | － | 73 | － | 0 | 0 |
| | (カナダドル) | － | － | － | － | 2 | － | 0 | 0 |
| | (英ポンド) | － | － | － | － | 18 | － | 0 | 0 |
| | 買建 | － | － | － | － | － | － | － | － |
| | (米ドル) | － | － | － | － | － | － | － | － |
| | (ユーロ) | － | － | － | － | － | － | － | － |
| 合　計 | | | | | － | | | | 3 |

(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 | 2023年度末 | | 2024年度<br>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 | 1,574,957 | 4.1 | 1,701,199 | 4.5 |
| 買入金銭債権 | 479,404 | 1.3 | 483,994 | 1.3 |
| 金銭の信託 | 24,345 | 0.1 | 33,525 | 0.1 |
| 有価証券 | 32,471,386 | 85.0 | 31,476,601 | 84.0 |
| 公社債 | 14,619,214 | 38.3 | 14,432,233 | 38.5 |
| 株式 | 3,449,389 | 9.0 | 3,337,215 | 8.9 |
| 外国証券 | 13,858,843 | 36.3 | 13,186,910 | 35.2 |
| 公社債 | 10,110,124 | 26.5 | 9,303,582 | 24.8 |
| 株式等 | 3,748,718 | 9.8 | 3,883,328 | 10.4 |
| その他の証券 | 543,939 | 1.4 | 520,242 | 1.4 |
| 貸付金 | 2,164,509 | 5.7 | 2,051,467 | 5.5 |
| 保険約款貸付 | 226,775 | 0.6 | 222,504 | 0.6 |
| 一般貸付 | 1,937,734 | 5.1 | 1,828,963 | 4.9 |
| 不動産 | 643,568 | 1.7 | 640,850 | 1.7 |
| うち投資用 | 468,707 | 1.2 | 467,855 | 1.2 |
| 繰延税金資産 | 208,307 | 0.5 | 337,165 | 0.9 |
| その他 | 635,326 | 1.7 | 749,961 | 2.0 |
| 貸倒引当金 | △804 | △0.0 | △766 | △0.0 |
| 会社計 | 38,201,001 | 100.0 | 37,473,999 | 100.0 |
| うち外貨建資産 | 12,395,549 | 32.4 | 11,771,164 | 31.4 |

(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 | 2023年度<br>第2四半期（上半期） | 2024年度<br>第2四半期（上半期） |
|---|---|---|
| | 金　額 | 金　額 |
| 現預金・コールローン | △505,475 | 126,241 |
| 買入金銭債権 | △78,135 | 4,589 |
| 金銭の信託 | 3,813 | 9,180 |
| 有価証券 | 1,982,279 | △994,784 |
| 公社債 | △443,014 | △186,981 |
| 株式 | 592,135 | △112,173 |
| 外国証券 | 1,718,187 | △671,932 |
| 公社債 | 1,146,107 | △806,542 |
| 株式等 | 572,080 | 134,609 |
| その他の証券 | 114,970 | △23,696 |
| 貸付金 | 134,151 | △113,042 |
| 保険約款貸付 | △4,513 | △4,271 |
| 一般貸付 | 138,664 | △108,771 |
| 不動産 | 58,267 | △2,717 |
| うち投資用 | 67,436 | △852 |
| 繰延税金資産 | △42,613 | 128,857 |
| その他 | 5,653 | 114,635 |
| 貸倒引当金 | 89 | 38 |
| 会社計 | 1,558,029 | △727,001 |
| うち外貨建資産 | 1,423,245 | △624,384 |

(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 | 2023年度末 | | 2024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 | 706,661 | 67,828 | 699,802 | △37,558 |

（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 | 2023年度末 | | | | | 2024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 | 1,926,606 | 2,092,804 | 166,198 | 184,790 | △18,592 | 1,908,696 | 2,010,540 | 101,843 | 155,924 | △54,080 |
| 責任準備金対応債券 | 13,799,326 | 13,527,225 | △272,100 | 667,808 | △939,909 | 13,689,429 | 13,160,954 | △528,474 | 558,171 | △1,086,646 |
| 子会社・関連会社株式 | 43,624 | 44,050 | 425 | 425 | － | 43,539 | 42,067 | △1,471 | 544 | △2,015 |
| その他有価証券 | 13,740,636 | 15,113,583 | 1,372,947 | 2,268,171 | △895,224 | 13,023,207 | 14,184,657 | 1,161,449 | 2,029,847 | △868,397 |
| 公社債 | 2,468,761 | 2,174,180 | △294,580 | 27,573 | △322,154 | 2,360,826 | 1,993,541 | △367,285 | 8,985 | △376,270 |
| 株式 | 1,323,271 | 3,072,377 | 1,749,105 | 1,774,963 | △25,857 | 1,348,942 | 2,971,846 | 1,622,903 | 1,643,691 | △20,788 |
| 外国証券 | 8,950,882 | 8,835,843 | △115,038 | 407,593 | △522,632 | 8,298,591 | 8,172,601 | △125,989 | 323,426 | △449,416 |
| 公社債 | 6,658,920 | 6,540,941 | △117,978 | 213,539 | △331,518 | 5,985,986 | 5,840,746 | △145,239 | 144,642 | △289,881 |
| 株式等 | 2,291,962 | 2,294,902 | 2,939 | 194,053 | △191,113 | 2,312,605 | 2,331,854 | 19,249 | 178,783 | △159,534 |
| その他の証券 | 355,676 | 398,928 | 43,251 | 57,063 | △13,811 | 329,477 | 370,941 | 41,463 | 52,857 | △11,393 |
| 買入金銭債権 | 387,043 | 377,300 | △9,743 | 978 | △10,721 | 395,369 | 385,823 | △9,545 | 886 | △10,432 |
| 譲渡性預金 | 255,000 | 254,952 | △47 | － | △47 | 290,000 | 289,903 | △96 | － | △96 |
| その他 | － | － | － | － | － | － | － | － | － | － |
| 合計 | 29,510,192 | 30,777,663 | 1,267,470 | 3,121,196 | △1,853,726 | 28,664,873 | 29,398,220 | 733,347 | 2,744,488 | △2,011,140 |
| 公社債 | 14,714,757 | 14,314,687 | △400,069 | 694,259 | △1,094,329 | 14,580,598 | 13,768,132 | △812,466 | 547,887 | △1,360,354 |
| 株式 | 1,324,111 | 3,073,642 | 1,749,531 | 1,775,389 | △25,857 | 1,349,696 | 2,973,144 | 1,623,447 | 1,644,236 | △20,788 |
| 外国証券 | 12,473,604 | 12,358,151 | △115,452 | 593,506 | △708,958 | 11,719,730 | 11,610,275 | △109,454 | 498,620 | △608,075 |
| 公社債 | 10,138,856 | 10,020,464 | △118,392 | 399,452 | △517,845 | 9,364,340 | 9,237,651 | △126,688 | 319,837 | △446,525 |
| 株式等 | 2,334,747 | 2,337,687 | 2,939 | 194,053 | △191,113 | 2,355,390 | 2,372,624 | 17,233 | 178,783 | △161,549 |
| その他の証券 | 355,676 | 398,928 | 43,251 | 57,063 | △13,811 | 329,477 | 370,941 | 41,463 | 52,857 | △11,393 |
| 買入金銭債権 | 387,043 | 377,300 | △9,743 | 978 | △10,721 | 395,369 | 385,823 | △9,545 | 886 | △10,432 |
| 譲渡性預金 | 255,000 | 254,952 | △47 | － | △47 | 290,000 | 289,903 | △96 | － | △96 |
| 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 | 2023年度末 | 2024年度第2四半期(上半期)末 |
|---|---|---|
| 子会社・関連会社株式 | 1,193,362 | 1,293,368 |
| その他有価証券 | 261,773 | 292,245 |
| 国内株式 | 22,762 | 23,926 |
| 外国株式 | 34,558 | 34,558 |
| その他 | 204,452 | 233,759 |
| 合計 | 1,455,135 | 1,585,613 |

ｃ．金銭の信託の時価情報(会社計)

(単位：百万円)

| 区　分 | 2023年度末 | | | | | 2024年度<br>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 | 24,345 | 24,345 | － | － | － | 33,525 | 33,525 | － | － | － |

(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 | 2023年度末 | | 2024年度<br>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 | 24,345 | 2,044 | 33,525 | △1,294 |

・運用目的以外の金銭の信託

2023年度末、2024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 | |
|---|---|---|---|---|
| | 2023年9月末 | 2024年9月末 | 2023年9月末 | 2024年9月末 |
| 金利スワップ<br>金利スワップション(買建) | 1,172 | 1,070 | 245 | 154 |
| 為替予約 | 70,976 | 68,831 | 1,648 | 2,780 |
| 通貨スワップ<br>通貨オプション(買建) | 7,168 | 11,983 | 927 | 1,194 |
| 株式オプション（買建）<br>株価指数先渡 | 2,549 | 3,499 | 152 | 214 |
| マルチ・アセット指数オプション(買建) | 2,304 | 2,512 | 267 | 316 |
| 合　計 | | | 1,248 | 3,013 |

（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 | 2023年度末 | | | | | | 2024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 | △13,805 | △355,739 | － | － | － | △369,545 | △24,463 | 129,819 | － | － | － | 105,356 |
| ヘッジ会計非適用分 | 56 | △114,929 | △934 | 201 | 5,450 | △110,154 | － | △18,002 | 336 | △0 | 725 | △16,941 |
| 合　計 | △13,748 | △470,669 | △934 | 201 | 5,450 | △479,700 | △24,463 | 111,816 | 336 | △0 | 725 | 88,414 |

(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、2023年度末通貨関連 △357,149百万円、2024年度第2四半期(上半期)末通貨関連 119,704百万円となっています。

### （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 | 2023年度末 | | | | 2024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<br>固定金利受取／変動金利支払 | 32,500 | 32,500 | 56 | 56 | － | － | － | － |
| 合　計 | | | | | 56 | | | | － |

(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 | 2023年度末 | | | 2024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<br>固定金利受取／変動金利支払 | 貸付金 | 2,500 | 2,500 | △16 | 5,500 | 5,500 | △8 |
| | 金利スワップ<br>固定金利受取／変動金利支払 | 保険負債 | 342,500 | 342,500 | △33,908 | 375,000 | 375,000 | △38,697 |
| 特例処理 | 金利スワップ<br>固定金利受取／変動金利支払 | 貸付金 | 710 | 700 | △4 | 705 | 700 | △8 |
| | 固定金利支払／変動金利受取 | | 113,557 | 113,557 | 20,124 | 107,047 | 107,047 | 14,251 |
| 合　計 | | | | | △13,805 | | | △24,463 |

## （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 | 2023年度末 | | | | 2024年度第2四半期(上半期)末 | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 契約額等 | うち１年超 | 時価 | 差損益 | 契約額等 | うち１年超 | 時価 | 差損益 |
| 店頭 | 為替予約 | | | | | | | | |
| | 売建 | 1,554,771 | 1,616 | △139,586 | △139,586 | 1,435,667 | － | 12,779 | 12,779 |
| | （米ドル） | 1,130,673 | 1,616 | △94,938 | △94,938 | 1,296,619 | － | 12,139 | 12,139 |
| | （ユーロ） | 239,423 | － | △28,022 | △28,022 | 90,359 | － | 381 | 381 |
| | 買建 | 1,384,308 | 1,614 | 30,257 | 30,257 | 970,223 | － | △31,904 | △31,904 |
| | （米ドル） | 982,764 | 1,614 | 22,018 | 22,018 | 924,719 | － | △31,969 | △31,969 |
| | （ユーロ） | 235,016 | － | 7,269 | 7,269 | 43,442 | － | 18 | 18 |
| | 通貨オプション | | | | | | | | |
| | 売建 | | | | | | | | |
| | コール | 407,720 | － | | | 4,560 | － | | |
| | | (944) | | 895 | 49 | (13) | | 15 | △1 |
| | （米ドル） | 407,720 | － | | | 4,560 | － | | |
| | | (944) | | 895 | 49 | (13) | | 15 | △1 |
| | プット | 130,000 | － | | | 3,750 | － | | |
| | | (392) | | 4 | 387 | (25) | | 18 | 7 |
| | （米ドル） | 130,000 | － | | | 3,750 | － | | |
| | | (392) | | 4 | 387 | (25) | | 18 | 7 |
| | 買建 | | | | | | | | |
| | プット | 699,040 | － | | | 537,500 | － | | |
| | | (3,869) | | 171 | △3,697 | (2,960) | | 5,952 | 2,991 |
| | （米ドル） | 699,040 | － | | | 500,000 | － | | |
| | | (3,869) | | 171 | △3,697 | (2,010) | | 2,603 | 593 |
| | （メキシコペソ） | － | － | | | 37,500 | － | | |
| | | ( － ) | | － | － | (950) | | 3,349 | 2,398 |
| | 通貨スワップ | 5,156 | 5,156 | △2,339 | △2,339 | 5,156 | 5,156 | △1,875 | △1,875 |
| | （米ドル） | 5,156 | 5,156 | △2,339 | △2,339 | 5,156 | 5,156 | △1,875 | △1,875 |
| 合　　計 | | | | | △114,929 | | | | △18,002 |

(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 | 2023年度末 | | | 2024年度 第2四半期(上半期)末 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | 契約額等 | うち１年超 | 時価 | 契約額等 | うち１年超 | 時価 |
| 時価ヘッジ | 為替予約 | | | | | | | |
| | 売建 | 外貨建資産 | 4,457,128 | 447,631 | △357,149 | 4,477,301 | 289,485 | 119,704 |
| | （米ドル） | | 3,559,006 | 435,667 | △287,124 | 3,454,234 | 268,956 | 111,273 |
| | （ユーロ） | | 560,699 | － | △27,932 | 671,626 | 20,528 | 23,885 |
| 繰延ヘッジ | 通貨スワップ | 外貨建資産 | 35,351 | 35,351 | △12,680 | 35,351 | 29,710 | △10,783 |
| | （米ドル） | | 35,351 | 35,351 | △12,680 | 35,351 | 29,710 | △10,783 |
| 振当処理 | 通貨スワップ | 外貨建資産 | 232,867 | 199,346 | △65,472 | 222,687 | 175,032 | △47,308 |
| | （米ドル） | | 232,867 | 199,346 | △65,472 | 222,687 | 175,032 | △47,308 |
| | 通貨スワップ | 外貨建負債 | 397,695 | 397,695 | 79,562 | 397,695 | 397,695 | 68,207 |
| | （米ドル） | | 397,695 | 397,695 | 79,562 | 397,695 | 397,695 | 68,207 |
| 合　　計 | | | | | △355,739 | | | 129,819 |

## （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 | 2023年度末 | | | | 2024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 | 8,940 | － | △220 | △220 | 15,320 | － | △484 | △484 |
| | 買建 | 76,971 | － | 1,628 | 1,628 | 45,429 | － | 594 | 594 |
| 店頭 | 株価指数オプション | | | | | | | | |
| | 買建 | | | | | | | | |
| | プット | 550,000 | － | | | 349,989 | － | | |
| | | (2,342) | | 0 | △2,342 | (2,895) | | 3,121 | 226 |
| 合　計 | | | | | △934 | | | | 336 |

(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）

2023年度末、2024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 | 2023年度末 | | | | 2024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 | 42,179 | － | 201 | 201 | 164,953 | － | △0 | △0 |
| 合　計 | | | | | 201 | | | | △0 |

(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）

2023年度末、2024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 | 2023年度末 | | | | 2024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 | 90,352 | － | | | 69,068 | － | | |
| | | (219) | | 610 | △391 | (159) | | 191 | △31 |
| | 買　建 | | | | | | | | |
| | コール | 264,444 | － | | | 251,247 | － | | |
| | | (5,520) | | 11,362 | 5,842 | (5,733) | | 6,490 | 756 |
| 合　計 | | | | | 5,450 | | | | 725 |

(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）

2023年度末、2024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。