２０２０年１１月１３日
第一生命保険株式会社

２０２０年度第２四半期（上半期）報告補足資料

※資料中、「第２四半期（上半期）」は「４月１日～９月３０日」を表しております。

１．有価証券関係（一般勘定）
（１）有価証券明細表 ・・・・・ ２頁
（２）有価証券残存期間別残高 ・・・・・ ２頁
（３）業種別国内株式保有明細表 ・・・・・ ３頁
２．貸付金関係（一般勘定）
（１）貸付金残存期間別残高 ・・・・・ ４頁
（２）貸付金企業規模別内訳 ・・・・・ ４頁
（３）貸付金担保別内訳 ・・・・・ ４頁
（４）貸付金業種別内訳 ・・・・・ ５頁
３．海外投融資関係（一般勘定）
（１）資産別明細 ・・・・・ ６頁
（２）外貨建資産の通貨別構成 ・・・・・ ６頁
（３）海外投融資の地域別構成 ・・・・・ ７頁
４．デリバティブ取引の時価情報（一般勘定） ・・・・・ ８頁
（１）差損益の内訳 ・・・・・ ８頁
（２）時価情報（ヘッジ会計非適用分） ・・・・・ ８頁
（３）時価情報（ヘッジ会計適用分） ・・・・・ １２頁

１．有価証券関係（一般勘定）

（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	13,698,904	46.2	14,109,228	44.0
地方債	129,433	0.4	120,000	0.4
社債	2,042,503	6.9	2,153,963	6.7
うち公社・公団債	414,124	1.4	391,936	1.2
株式	2,786,892	9.4	3,192,727	10.0
外国証券	10,073,956	34.0	11,819,135	36.9
公社債	9,088,395	30.7	10,498,381	32.7
株式等	985,560	3.3	1,320,753	4.1
その他の証券	896,944	3.0	667,723	2.1
合計	29,628,634	100.0	32,062,778	100.0

（２）有価証券残存期間別残高

（単位：百万円）

区分	2019年度末						
	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を含む)	合計
有価証券	586,329	1,101,503	1,444,372	2,251,872	3,520,952	20,723,604	29,628,634
国債	74,467	22,774	250,094	734,136	1,504,395	11,113,036	13,698,904
地方債	23,981	4,267	4,820	17,769	2,913	75,680	129,433
社債	95,622	163,504	227,448	227,484	179,534	1,148,909	2,042,503
株式	－	－	－	－	－	2,786,892	2,786,892
外国証券	379,004	889,591	911,662	1,203,671	1,306,577	5,383,449	10,073,956
公社債	376,404	882,767	895,198	1,158,912	1,245,286	4,529,824	9,088,395
株式等	2,599	6,824	16,464	44,758	61,290	853,624	985,560
その他の証券	13,254	21,365	50,345	68,811	527,531	215,636	896,944
買入金銭債権	－	3,352	1,037	22,823	13,991	179,941	221,147
譲渡性預金	110,994	－	－	－	－	－	110,994
その他	－	－	－	－	－	34,274	34,274

区分	2020年度第2四半期(上半期)末						
	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を含む)	合計
有価証券	630,395	1,115,099	1,568,873	2,601,446	3,041,167	23,105,795	32,062,778
国債	12,045	66,225	292,537	830,410	1,508,995	11,399,013	14,109,228
地方債	17,489	5,074	5,793	13,051	2,910	75,680	120,000
社債	80,767	186,247	248,154	262,200	151,315	1,225,277	2,153,963
株式	－	－	－	－	－	3,192,727	3,192,727
外国証券	508,296	855,407	931,997	1,431,981	1,133,141	6,958,309	11,819,135
公社債	505,633	842,775	905,519	1,395,272	1,060,231	5,788,949	10,498,381
株式等	2,663	12,632	26,478	36,708	72,910	1,169,360	1,320,753
その他の証券	11,796	2,143	90,389	63,803	244,803	254,786	667,723
買入金銭債権	－	3,351	19,213	26,132	12,974	184,481	246,153
譲渡性預金	50,998	－	－	－	－	－	50,998
その他	－	－	－	－	－	37,635	37,635

（注）「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号）に基づく有価証券として取り扱うものを含んでいます。

（３）業種別国内株式保有明細表

（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
水産・農林業		716	0.0	681	0.0
鉱業		200	0.0	200	0.0
建設業		98,486	3.5	107,189	3.4
製造業	食料品	172,860	6.2	182,284	5.7
	繊維製品	19,433	0.7	18,552	0.6
	パルプ・紙	2,949	0.1	3,164	0.1
	化学	164,130	5.9	186,511	5.8
	医薬品	68,347	2.5	88,039	2.8
	石油・石炭製品	2,576	0.1	2,695	0.1
	ゴム製品	18,058	0.6	19,014	0.6
	ガラス・土石製品	79,927	2.9	92,789	2.9
	鉄鋼	23,138	0.8	24,685	0.8
	非鉄金属	9,865	0.4	10,791	0.3
	金属製品	27,248	1.0	36,060	1.1
	機械	178,284	6.4	211,934	6.6
	電気機器	479,729	17.2	581,742	18.2
	輸送用機器	141,022	5.1	156,653	4.9
	精密機器	149,300	5.4	184,977	5.8
	その他製品	59,452	2.1	60,470	1.9
電気・ガス業		91,894	3.3	95,673	3.0
運輸・情報通信業	陸運業	281,543	10.1	272,719	8.5
	海運業	32	0.0	37	0.0
	空運業	3,169	0.1	3,043	0.1
	倉庫・運輸関連業	3,953	0.1	4,401	0.1
	情報・通信業	52,364	1.9	71,412	2.2
商業	卸売業	108,226	3.9	122,907	3.8
	小売業	93,903	3.4	110,430	3.5
金融・保険業	銀行業	162,225	5.8	184,497	5.8
	証券、商品先物取引業	218	0.0	253	0.0
	保険業	3,724	0.1	4,147	0.1
	その他金融業	23,670	0.8	27,934	0.9
不動産業		17,826	0.6	15,051	0.5
サービス業		248,411	8.9	311,778	9.8
合計		2,786,892	100.0	3,192,727	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。

２．貸付金関係（一般勘定）

（１）貸付金残存期間別残高

（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を含む）	合　計
2019年度末	変動金利	4,251	25,670	18,312	9,774	1,713	306,184	365,906
	固定金利	253,671	357,475	361,668	329,174	232,174	318,468	1,852,631
	一般貸付計	257,922	383,146	379,980	338,948	233,887	624,652	2,218,538
2020年度 第2四半期 (上半期)末	変動金利	1,578	23,128	36,918	14,309	4,073	300,273	380,282
	固定金利	290,787	361,943	322,878	316,526	245,474	364,041	1,901,652
	一般貸付計	292,366	385,071	359,797	330,836	249,547	664,314	2,281,934

（２）貸付金企業規模別内訳＜国内企業向け＞

（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	215	64.2	214	63.9
	金　額	1,636,633	84.2	1,709,547	84.4
中堅企業	貸付先数	7	2.1	7	2.1
	金　額	4,038	0.2	4,276	0.2
中小企業	貸付先数	113	33.7	114	34.0
	金　額	302,872	15.6	311,807	15.4
国内企業向け貸付計	貸付先数	335	100.0	335	100.0
	金　額	1,943,544	100.0	2,025,632	100.0

（注）１．業種の区分は以下のとおりです。
　　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。

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名超かつ	資本金10億円以上	常用する従業員50名超かつ	資本金10億円以上	常用する従業員100名超かつ	資本金10億円以上	常用する従業員100名超かつ	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3億円以下又は常用する従業員300名以下		資本金5千万円以下又は常用する従業員50名以下		資本金5千万円以下又は常用する従業員100名以下		資本金1億円以下又は常用する従業員100名以下	

（３）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		2,406	0.1	2,693	0.1
	有価証券担保貸付	950	0.0	1,070	0.0
	不動産・動産・財団担保貸付	1,455	0.1	1,623	0.1
	指名債権担保貸付	－	－	－	－
保証貸付		119,612	5.4	93,054	4.1
信用貸付		2,096,520	94.5	2,186,186	95.8
その他		－	－	－	－
一般貸付計		2,218,538	100.0	2,281,934	100.0
	うち劣後特約付貸付	213,410	9.6	231,906	10.2

（注）保険約款貸付は含んでいません。

（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
国内向け	製造業	276,090	12.4	278,338	12.2
	食料	40,407	1.8	40,234	1.8
	繊維	1,673	0.1	1,781	0.1
	木材・木製品	500	0.0	500	0.0
	パルプ・紙	10,660	0.5	10,530	0.5
	印刷	12,502	0.6	22,500	1.0
	化学	26,771	1.2	30,036	1.3
	石油・石炭	8,860	0.4	8,860	0.4
	窯業・土石	19,022	0.9	18,909	0.8
	鉄鋼	82,547	3.7	71,246	3.1
	非鉄金属	4,626	0.2	4,373	0.2
	金属製品	961	0.0	1,012	0.0
	はん用・生産用・業務用機械	20,391	0.9	19,954	0.9
	電気機械	20,534	0.9	20,504	0.9
	輸送用機械	17,589	0.8	19,417	0.9
	その他の製造業	9,042	0.4	8,479	0.4
	農業、林業	－	－	－	－
	漁業	－	－	－	－
	鉱業、採石業、砂利採取業	－	－	－	－
	建設業	9,260	0.4	9,359	0.4
	電気・ガス・熱供給・水道業	447,376	20.2	450,235	19.7
	情報通信業	47,786	2.2	58,380	2.6
	運輸業、郵便業	251,547	11.3	263,093	11.5
	卸売業	300,862	13.6	304,359	13.3
	小売業	12,505	0.6	13,019	0.6
	金融業、保険業	554,499	25.0	587,141	25.7
	不動産業	141,549	6.4	140,630	6.2
	物品賃貸業	98,872	4.5	97,073	4.3
	学術研究、専門・技術サービス業	200	0.0	200	0.0
	宿泊業	－	－	－	－
	飲食業	－	－	－	－
	生活関連サービス業・娯楽業	4,623	0.2	3,687	0.2
	教育、学習支援業	－	－	－	－
	医療・福祉	1,000	0.0	2,246	0.1
	その他のサービス	2,819	0.1	2,566	0.1
	地方公共団体	19,088	0.9	17,907	0.8
	個人（住宅・消費・納税資金等）	－	－	－	－
	その他	66	0.0	－	－
	合計	2,168,147	97.7	2,228,238	97.6
海外向け	政府等	3,304	0.1	3,774	0.2
	金融機関	5,000	0.2	－	－
	商工業等	42,086	1.9	49,921	2.2
	合計	50,391	2.3	53,695	2.4
一般貸付計		2,218,538	100.0	2,281,934	100.0

（注）1．保険約款貸付は含んでいません。
2．国内向けの業種区分は日本銀行の「貸出先別貸出金（業種別、設備資金新規貸出）」の業種区分に準拠しています。

３．海外投融資関係（一般勘定）

（１）資産別明細

①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	8,287,407	73.4	9,666,006	76.3
株式	643,359	5.7	974,033	7.7
現預金・その他	640,851	5.7	290,156	2.3
小計	9,571,618	84.8	10,930,197	86.3

②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
公社債	－	－	－	－
現預金・その他	272,311	2.4	269,048	2.1
小計	272,311	2.4	269,048	2.1

③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
非居住者貸付	30,043	0.3	26,972	0.2
公社債（円建外債)･その他	1,412,739	12.5	1,439,359	11.4
小計	1,442,783	12.8	1,466,331	11.6

④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	11,286,713	100.0	12,665,576	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）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	4,651,934	48.6	5,676,129	51.9
ユーロ	2,637,312	27.6	2,309,843	21.1
オーストラリアドル	699,244	7.3	1,090,437	10.0
カナダドル	215,930	2.3	450,310	4.1
イギリスポンド	302,948	3.2	307,458	2.8
中国元	209,548	2.2	226,281	2.1
ポーランドズロチ	170,873	1.8	172,404	1.6
その他共計	9,571,618	100.0	10,930,197	100.0

（３）海外投融資の地域別構成

（単位：百万円、％）

区分	2019年度末							
	外国証券						非居住者貸付	
			公社債		株式等			
	金額	占率	金額	占率	金額	占率	金額	占率
北米	4,147,818	41.2	3,916,856	43.1	230,962	23.4	6,258	12.4
ヨーロッパ	3,399,520	33.7	3,079,499	33.9	320,021	32.5	12,555	24.9
オセアニア	739,451	7.3	709,931	7.8	29,520	3.0	8,304	16.5
アジア	411,998	4.1	310,903	3.4	101,095	10.3	2,308	4.6
中南米	1,216,710	12.1	912,925	10.0	303,785	30.8	20,964	41.6
中東	176	0.0	－	－	176	0.0	－	－
アフリカ	－	－	－	－	－	－	－	－
国際機関	158,279	1.6	158,279	1.7	－	－	－	－
合計	10,073,956	100.0	9,088,395	100.0	985,560	100.0	50,391	100.0

区分	2020年度第2四半期(上半期)末							
	外国証券						非居住者貸付	
			公社債		株式等			
	金額	占率	金額	占率	金額	占率	金額	占率
北米	5,352,850	45.3	4,860,380	46.3	492,469	37.3	5,946	11.1
ヨーロッパ	3,472,048	29.4	3,116,643	29.7	355,404	26.9	14,575	27.1
オセアニア	1,038,721	8.8	1,003,253	9.6	35,468	2.7	10,191	19.0
アジア	442,355	3.7	326,359	3.1	115,996	8.8	2,017	3.8
中南米	1,310,969	11.1	989,763	9.4	321,206	24.3	20,964	39.0
中東	208	0.0	－	－	208	0.0	－	－
アフリカ	－	－	－	－	－	－	－	－
国際機関	201,981	1.7	201,981	1.9	－	－	－	－
合計	11,819,135	100.0	10,498,381	100.0	1,320,753	100.0	53,695	100.0

（注）地域区分は発行会社及び貸付先企業の国籍等に基づいています。

４．デリバティブ取引の時価情報（一般勘定）

（１）差損益の内訳（ヘッジ会計適用分・非適用分の内訳）

（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	40,848	26,754	－	－	－	67,602	32,830	18,614	－	－	－	51,445
ヘッジ会計非適用分	3,245	34,472	7,735	557	194	46,206	△ 7,220	6,919	△ 2,360	1,294	△ 58	△ 1,425
合　　計	44,093	61,227	7,735	557	194	113,808	25,609	25,534	△ 2,360	1,294	△ 58	50,019

（注）上表のうち損益計算書に計上されている金額は以下のとおりです。
2019年度末　：ヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ適用分の差損益（通貨関連22,029百万円）及び
ヘッジ会計非適用分の差損益（46,206百万円）の合計68,235百万円
2020年度第2四半期(上半期)末：ヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ適用分の差損益（通貨関連17,386百万円）及び
ヘッジ会計非適用分の差損益（△1,425百万円）の合計15,960百万円

（２）時価情報（ヘッジ会計非適用分）

①金利関連

（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	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	円建金利スワップ								
	固定金利受取／変動金利支払	10,000	10,000	978	978	18,000	18,000	820	820
	固定金利支払／変動金利受取	40,250	40,250	△ 1,035	△ 1,035	98,950	98,950	△ 129	△ 129
	円建金利スワップション								
	売建								
	固定金利受取／変動金利支払	－	－			26,000	－		
		(－)	(－)	－	－	(246)	(－)	202	44
	固定金利支払／変動金利受取	－	－			10,000	－		
		(－)	(－)	－	－	(18)	(－)	3	14
	買建								
	固定金利受取／変動金利支払	830,000	460,000			480,000	340,000		
		(18,202)	(11,993)	27,507	9,305	(12,300)	(8,561)	9,318	△ 2,982
	固定金利支払／変動金利受取	1,560,000	1,110,000			1,720,000	1,145,000		
		(6,316)	(3,454)	312	△ 6,003	(7,836)	(5,035)	2,848	△ 4,987
合　　計					3,245				△ 7,220

（注）１．括弧内には、貸借対照表に計上したオプション料を記載しています。
２．差損益欄には、スワップ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。

（参考）金利スワップ残存期間別残高

（単位：百万円、％）

区　　分	2019年度末						
	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	合計
円建受取側固定スワップ想定元本	－	－	－	－	－	10,000	10,000
平均受取固定金利	－	－	－	－	－	0.64	0.64
平均支払変動金利	－	－	－	－	－	△ 0.06	△ 0.06
円建支払側固定スワップ想定元本	－	－	4,700	－	600	34,950	40,250
平均支払固定金利	－	－	△ 0.00	－	0.09	0.28	0.25
平均受取変動金利	－	－	△ 0.00	－	△ 0.00	△ 0.05	△ 0.04
合　　計	－	－	4,700	－	600	44,950	50,250

区　　分	2020年度第2四半期(上半期)末						
	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	合計
円建受取側固定スワップ想定元本	－	－	－	－	－	18,000	18,000
平均受取固定金利	－	－	－	－	－	0.43	0.43
平均支払変動金利	－	－	－	－	－	0.01	0.01
円建支払側固定スワップ想定元本	－	42,000	－	－	14,600	42,350	98,950
平均支払固定金利	－	△ 0.04	－	－	0.03	0.28	0.11
平均受取変動金利	－	△ 0.02	－	－	△ 0.03	△ 0.02	△ 0.02
合　　計	－	42,000	－	－	14,600	60,350	116,950

②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
店頭	為替予約						
	売建	2,222,430	20,995	20,995	1,699,285	6,844	6,844
	(米ドル)	830,641	△ 3,330	△ 3,330	909,342	△ 1,658	△ 1,658
	(ユーロ)	1,021,163	1,671	1,671	513,721	5,537	5,537
	(オーストラリアドル)	108,816	7,711	7,711	132,196	1,163	1,163
	(イギリスポンド)	58,753	2,858	2,858	42,784	1,030	1,030
	(カナダドル)	22,248	802	802	33,121	55	55
	(その他)	180,807	11,282	11,282	68,120	714	714
	買建	937,288	10,117	10,117	1,030,175	933	933
	(米ドル)	390,509	10,409	10,409	574,017	△ 1,255	△ 1,255
	(ユーロ)	449,081	758	758	231,665	1,265	1,265
	(オーストラリアドル)	29,087	55	55	75,951	559	559
	(イギリスポンド)	22,647	△ 800	△ 800	38,181	235	235
	(カナダドル)	3,697	－	－	30,981	△ 239	△ 239
	(その他)	42,265	△ 305	△ 305	79,377	368	368
	通貨オプション						
	売建						
	プット	41,021			100,761		
		(39)	87	△ 48	(1,458)	299	1,158
	(米ドル)	－			100,761		
		(－)	－	－	(1,458)	299	1,158
	(イギリスポンド)	41,021			－		
		(39)	87	△ 48	(－)	－	－
	買建						
	コール	－			12,417		
		(－)	－	－	(31)	7	△ 23
	(ユーロ)	－			12,417		
		(－)	－	－	(31)	7	△ 23
	プット	648,053			537,088		
		(10,392)	13,800	3,407	(11,222)	9,228	△ 1,994
	(米ドル)	607,032			524,363		
		(9,015)	13,675	4,660	(11,222)	9,228	△ 1,994
	(イギリスポンド)	41,021			12,724		
		(1,377)	125	△ 1,252	(－)	－	－
合計				34,472			6,919

（注）１．括弧内には、貸借対照表に計上したオプション料を記載しています。
２．各期末の為替相場は先物相場を使用しています。
３．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。
４．上表において、残存期間１年超の取引はありません。

③株式関連

（単位：百万円）

区分	種類	2019年度末 契約額等	2019年度末 時価	2019年度末 差損益	2020年度第2四半期(上半期)末 契約額等	2020年度第2四半期(上半期)末 時価	2020年度第2四半期(上半期)末 差損益
取引所	円建株価指数先物						
	売建	24,992	△ 3,065	△ 3,065	4,976	△ 32	△ 32
	外貨建株価指数先物						
	売建	89,745	△ 9,335	△ 9,335	－	－	－
	買建	－	－	－	6,971	121	121
	円建株価指数オプション						
	買建						
	プット	149,961			149,959		
		(4,213)	23,842	19,628	(7,007)	4,559	△ 2,448
	外貨建株価指数オプション						
	買建						
	プット	20,745			－		
		(1,401)	1,910	508	(－)	－	－
合計				7,735			△ 2,360

（注）　1．括弧内には、貸借対照表に計上した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。
　　3．上表において、残存期間１年超の取引はありません。

④債券関連

（単位：百万円）

区分	種類	2019年度末 契約額等	2019年度末 時価	2019年度末 差損益	2020年度第2四半期(上半期)末 契約額等	2020年度第2四半期(上半期)末 時価	2020年度第2四半期(上半期)末 差損益
取引所	円建債券先物						
	売建	－	－	－	11,861	△ 2	△ 2
	買建	3,647	14	14	18,263	△ 10	△ 10
	外貨建債券先物						
	売建	445,448	△ 6,283	△ 6,283	802,777	△ 1,909	△ 1,909
	買建	557,925	6,724	6,724	987,364	2,748	2,748
店頭	外貨建債券先渡契約						
	売建	88,387	△ 1,146	△ 1,146	56,015	65	65
	買建	83,442	1,466	1,466	108,625	288	288
	円建債券店頭オプション						
	売建						
	コール	－			19,218		
		(－)	－	－	(51)	61	△ 9
	プット	37,350			94,710		
		(218)	329	△ 110	(286)	254	31
	買建						
	コール	37,350			94,710		
		(205)	98	△ 107	(241)	314	72
	プット	－			19,218		
		(－)	－	－	(57)	76	19
合計				557			1,294

（注）　1．括弧内には、貸借対照表に計上したオプション料を記載しています。
　　2．差損益欄には、先物取引及び先渡契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。
　　3．上表において、残存期間１年超の取引はありません。

⑤その他

（単位：百万円）

区分	種類	2019年度末 契約額等	うち1年超	時価	差損益	2020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
店頭	クレジット・デフォルト・スワップ プロテクション売建	17,500	7,000	150	150	9,000	6,000	184	184
	プロテクション買建	40,066	40,066	44	44	11,300	11,300	△ 242	△ 242
合計					194				△ 58

（注）差損益欄には、時価を記載しています。

（３）時価情報（ヘッジ会計適用分）

①金利関連

（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 契約額等	うち1年超	時価	差損益	2020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
原則的処理方法	円建金利スワップ									
	固定金利受取／変動金利支払	貸付金	14,350	14,350	158	158	14,300	14,300	145	145
	固定金利受取／変動金利支払	保険負債	700,000	700,000	42,230	42,230	700,000	700,000	34,176	34,176
金利スワップの特例処理	円建金利スワップ									
	固定金利受取／変動金利支払	貸付金	15,300	12,300	167	167	13,300	8,300	155	155
	固定金利支払／変動金利受取	借入金	283,000	144,000	△ 1,708	△ 1,708	283,000	144,000	△ 1,648	△ 1,648
合計						40,848				32,830

（注）差損益欄には、時価を記載しています。

（参考）金利スワップ残存期間別残高

（単位：百万円、%）

区分	2019年度末 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	合計
円建受取側固定スワップ想定元本	3,000	8,000	6,350	2,300	10,000	700,000	729,650
平均受取固定金利	0.46	0.04	△ 0.01	1.19	0.10	0.47	0.45
平均支払変動金利	△ 0.04	0.03	△ 0.01	0.07	△ 0.10	△ 0.04	△ 0.04
円建支払側固定スワップ想定元本	139,000	144,000	－	－	－	－	283,000
平均支払固定金利	0.28	0.42	－	－	－	－	0.35
平均受取変動金利	0.13	0.13	－	－	－	－	0.13
合計	142,000	152,000	6,350	2,300	10,000	700,000	1,012,650

区分	2020年度第2四半期（上半期）末 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	合計
円建受取側固定スワップ想定元本	5,000	10,300	－	2,300	10,000	700,000	727,600
平均受取固定金利	△ 0.02	0.04	－	1.19	0.10	0.47	0.45
平均支払変動金利	△ 0.03	0.02	－	0.07	△ 0.10	△ 0.03	△ 0.03
円建支払側固定スワップ想定元本	139,000	144,000	－	－	－	－	283,000
平均支払固定金利	0.28	0.42	－	－	－	－	0.35
平均受取変動金利	0.13	0.13	－	－	－	－	0.13
合計	144,000	154,300	－	2,300	10,000	700,000	1,010,600

②通貨関連

（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	うち1年超	時価	差損益	契約額等	うち1年超	時価	差損益
原則的処理方法	通貨スワップ	外貨建債券	230,320	212,466	4,725	4,725	220,995	202,949	1,228	1,228
	（米ドル）		148,990	133,183	59	59	139,638	126,617	817	817
	（ユーロ）		69,227	67,181	3,376	3,376	69,259	64,233	△ 194	△ 194
	（イギリスポンド）		12,101	12,101	1,289	1,289	12,097	12,097	605	605
ヘッジ対象に係る損益を認識する方法	為替予約	外貨建債券								
	売建		5,430,501	－	31,536	31,536	6,664,069	－	17,411	17,411
	（米ドル）		2,599,200	－	△ 63,756	△ 63,756	3,502,425	－	25,994	25,994
	（ユーロ）		1,559,276	－	△ 2,621	△ 2,621	1,384,729	－	△ 24,948	△ 24,948
	（オーストラリアドル）		374,676	－	36,802	36,802	687,983	－	4,723	4,723
	（カナダドル）		91,583	－	6,221	6,221	346,411	－	3,854	3,854
	（イギリスポンド）		286,852	－	15,306	15,306	147,721	－	1,392	1,392
	（その他）		518,912	－	39,582	39,582	594,797	－	6,396	6,396
	買建		226,362	－	△ 9,507	△ 9,507	5,139	－	△ 25	△ 25
	（米ドル）		3,316	－	9	9	5,123	－	△ 25	△ 25
	（ユーロ）		718	－	2	2	14	－	0	0
	（オーストラリアドル）		－	－	－	－	0	－	0	0
	（イギリスポンド）		136,055	－	△ 5,176	△ 5,176	－	－	－	－
	（その他）		86,272	－	△ 4,342	△ 4,342	－	－	－	－
為替予約等の振当処理	為替予約									
	売建	外貨建定期預金	239,165	－	－	－	237,001	－	－	－
	（米ドル）		89,727	－	－	－	87,001	－	－	－
	（その他）		149,437	－	－	－	150,000	－	－	－
	通貨スワップ	外貨建社債（負債）	476,277	476,277	－	－	476,277	368,715	－	－
	（米ドル）		476,277	476,277	－	－	476,277	368,715	－	－
	通貨スワップ	外貨建貸付金	32,605	32,605	－	－	32,095	32,095	－	－
	（米ドル）		26,641	26,641	－	－	26,130	26,130	－	－
	（ユーロ）		5,964	5,964	－	－	5,964	5,964	－	－
合　計						26,754				18,614

（注）１．各期末の為替相場は先物相場を使用しています。

２．為替予約及び通貨スワップの振当処理によるものは、ヘッジ対象とされている外貨建定期預金、外貨建社債（負債）及び外貨建貸付金と一体処理されているため、その時価は、当該外貨建定期預金、外貨建社債（負債）及び外貨建貸付金の時価に含めて記載しています。

３．差損益欄には、為替予約及び通貨スワップ取引については時価を記載しています。（注2.を除く）

③株式関連

2019年度末、2020年度第2四半期（上半期）末ともに期末残高がないため、記載していません。

④債券関連

2019年度末、2020年度第2四半期（上半期）末ともに期末残高がないため、記載していません。

⑤その他

2019年度末、2020年度第2四半期（上半期）末ともに期末残高がないため、記載していません。