

2021年度決算(案) <補足資料>

<目次>

1. 一般勘定

(1) 有価証券関係	
① 有価証券明細表	・・・ 1頁
② 有価証券残存期間別残高	・・・ 1頁
③ 業種別株式保有明細	・・・ 2頁
④ デリバティブ取引の時価情報	・・・ 3頁
(2) 貸付金関係	
① 貸付金明細表	・・・ 4頁
(3) 海外投融資関係	
① 資産別明細表	・・・ 5頁
② 外貨建資産の通貨別構成	・・・ 5頁
③ 海外投融資の地域別構成	・・・ 6頁

2. 特別勘定

(1) 個人変額保険及び個人変額年金保険<合同運用分>特別勘定	
① 有価証券明細表	・・・ 7頁
② 売買目的有価証券の評価損益	・・・ 7頁
③ 金銭の信託の時価情報	・・・ 7頁
④ デリバティブ取引の時価情報	・・・ 7頁
(2) 個人変額年金保険<合同運用分以外>特別勘定	
① 有価証券明細表	・・・ 8頁
② 売買目的有価証券の評価損益	・・・ 8頁
③ 金銭の信託の時価情報	・・・ 8頁
④ デリバティブ取引の時価情報	・・・ 8頁

3. 会社計

(1) 資産構成	
① 資産の構成	・・・ 9頁
② 資産の増減	・・・ 9頁
(2) 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	・・・ 10頁
② 有価証券の時価情報	・・・ 10頁
(3) 金銭の信託の時価情報	
①	・・・ 11頁
(4) デリバティブ取引の時価情報	
①	・・・ 12頁

以上

※ 実績値は単位未満切り捨て。前年比等の百分率は四捨五入。また、増減率が1,000%を超える場合や比較対象の一方もしくは両方がマイナスの場合は「-」表示しております。

※ 当社は、2021年4月1日付で当社の100%連結子会社であったソニーライフ・ウィズ生命保険株式会社(以下、ソニーライフ・ウィズ生命)を吸収合併いたしました。本資料の2021年度の単体業績は、吸収合併を反映した単体業績ですが、比較年度である2020年度の単体業績は、ソニーライフ・ウィズ生命の単体業績を含めておりません。

※ 当社の業績は、日本の会計基準に準拠して作成しており、その会計基準は、当社の親会社であるソニーグループ株式会社が開示する連結業績の準拠する国際財務報告基準とは異なります。

※ 本資料は、公認会計士又は監査法人の監査の対象外です。

1. 一般勘定

(1) 有価証券関係（一般勘定）

①有価証券明細表（一般勘定）

（単位：百万円、％）

区 分	2020年度末		2021年度末	
	金額	占率	金額	占率
国 債	8,141,298	80.3	8,365,547	77.0
地 方 債	442	0.0	439	0.0
社 債	730,820	7.2	853,028	7.9
うち公社・公団債	503,493	5.0	517,489	4.8
株 式	34,687	0.3	4,337	0.0
外 国 証 券	1,225,436	12.1	1,634,803	15.1
公 社 債	1,195,169	11.8	1,621,486	14.9
株 式 等	30,267	0.3	13,317	0.1
そ の 他 の 証 券	343	0.0	231	0.0
合 計	10,133,029	100.0	10,858,387	100.0

②有価証券残存期間別残高（一般勘定）

（単位：百万円）

区 分	2020年度末						合計
	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)	
国 債	4,814	94,125	335,431	448,113	313,813	6,945,000	8,141,298
地 方 債	—	—	—	—	—	442	442
社 債	—	2,308	2,551	3,220	578	722,160	730,820
株 式	—	—	—	—	—	34,687	34,687
外 国 証 券	4,245	2,770	2,379	4,220	3,301	1,208,520	1,225,436
公 社 債	—	2,342	2,379	4,220	3,301	1,182,926	1,195,169
株 式 等	4,245	427	—	—	—	25,594	30,267
そ の 他 の 証 券	—	343	—	—	—	—	343
合 計	9,060	99,548	340,362	455,554	317,692	8,910,811	10,133,029
区 分	2021年度末						合計
	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)	
国 債	13,379	220,560	305,030	333,552	322,717	7,170,306	8,365,547
地 方 債	—	—	—	—	—	439	439
社 債	—	4,833	1,044	2,176	4,688	840,285	853,028
株 式	—	—	—	—	—	4,337	4,337
外 国 証 券	3,598	991	4,558	14,527	47,192	1,563,935	1,634,803
公 社 債	—	—	4,558	14,527	47,192	1,555,207	1,621,486
株 式 等	3,598	991	—	—	—	8,727	13,317
そ の 他 の 証 券	231	—	—	—	—	—	231
合 計	17,209	226,385	310,633	350,256	374,598	9,579,303	10,858,387

（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業種別株式保有明細（一般勘定）

（単位：百万円、％）

区 分		2020年度末		2021年度末	
		金額	占率	金額	占率
水 産 ・ 農 林 業		—	—	—	—
鉱 業		—	—	—	—
建 設 業		471	1.4	—	—
製 造 業	食 料 品	—	—	—	—
	織 維 製 品	—	—	—	—
	パ ル プ ・ 紙	—	—	—	—
	化 学	1,432	4.1	—	—
	医 薬 品	737	2.1	—	—
	石 油 ・ 石 炭 製 品	—	—	—	—
	ゴ ム 製 品	—	—	—	—
	ガ ラ ス ・ 土 石 製 品	—	—	—	—
	鉄 鋼	—	—	—	—
	非 鉄 金 属	—	—	—	—
	金 属 製 品	—	—	—	—
	機 械	1,328	3.8	—	—
	電 気 機 器	2,406	6.9	—	—
	輸 送 用 機 器	1,383	4.0	—	—
精 密 機 器	979	2.8	—	—	
そ の 他 製 品	584	1.7	—	—	
電 気 ・ ガ ス 業		—	—	—	—
運 輸 ・ 情 報 通 信 業	陸 運 業	764	2.2	—	—
	海 運 業	—	—	—	—
	空 運 業	—	—	—	—
	倉 庫 ・ 運 輸 関 連 業	—	—	—	—
	情 報 ・ 通 信 業	190	0.5	127	2.9
商 業	卸 売 業	—	—	—	—
	小 売 業	1,585	4.6	—	—
金 融 ・ 保 険 業	銀 行 業	—	—	—	—
	証 券 ・ 商 品 先 物 取 引 業	—	—	—	—
	保 険 業	20,926	60.3	4,159	95.9
	そ の 他 金 融 業	544	1.6	—	—
不 動 産 業		—	—	—	—
サ ー ビ ス 業		1,352	3.9	50	1.2
合 計		34,687	100.0	4,337	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。

④デリバティブ取引の時価情報（一般勘定）（ヘッジ会計適用分・非適用分の合算値）

a. 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）

2020年度末						
	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	—	—	—	—	—	—
ヘッジ会計非適用分	—	△ 60	△ 5,156	—	—	△ 5,216
合 計	—	△ 60	△ 5,156	—	—	△ 5,216

2021年度末						
	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	—	—	—	—	—	—
ヘッジ会計非適用分	—	△ 6,833	△ 28,008	—	—	△ 34,841
合 計	—	△ 6,833	△ 28,008	—	—	△ 34,841

（注）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。

b. 金利関連

該当ありません。

c. 通貨関連

（単位：百万円）

区分	種 類	2020年度末				2021年度末			
		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
	(ユーロ)	—	—	—	—	—	—	—	—
	(豪ドル)	12,959	—	△ 60	△ 60	71,279	—	△ 4,869	△ 4,869
	合 計	—	—	—	—	25,081	—	△ 1,964	△ 1,964
	合 計				△ 60				△ 6,833

（注）1. 為替予約の時価は、事業年度末現在の金利を基に現在価値に割引いて算定しています。

2. 差損益欄には、時価を記載しています。

d. 株式関連

（単位：百万円）

区分	種 類	2020年度末				2021年度末			
		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	トータル・リターン・スワップ 売建	117,055	—	△ 4,170	△ 4,170	136,578	—	△ 16,105	△ 16,105
	合 計				△ 5,156				△ 28,008

（注）1. 株価指数先物の時価は、取引所における事業年度末の最終価格によっています。

2. トータル・リターン・スワップの時価は、事業年度末の株価等により算定しています。

3. 差損益欄には、時価を記載しています。

e. 債券関連

該当ありません。

f. その他

該当ありません。

(2) 貸付金関係 (一般勘定)

① 貸付金明細表 (一般勘定)

(単位：百万円)

区 分	2020年度末	2021年度末
保 険 約 款 貸 付	201,236	204,848
契 約 者 貸 付	184,122	187,600
保 険 料 振 替 貸 付	17,114	17,247
一 般 貸 付	897	744
そ の 他	897	744
合 計	202,134	205,593

(注) 一般貸付の「その他」の内容は従業員貸付及び代理店貸付です。

(3) 海外投融資関係（一般勘定）

①資産別明細表（一般勘定）

■外貨建資産

（単位：百万円、％）

区 分	2020年度末		2021年度末	
	金額	占率	金額	占率
公 社 債	1,195,169	95.5	1,621,486	97.1
株 式	5,909	0.5	9,146	0.5
現 預 金 ・ そ の 他	29,105	2.3	37,331	2.2
外 貨 建 資 産 計	1,230,184	98.3	1,667,963	99.9

■円貨額が確定した外貨建資産

該当ありません。

■円貨建資産

（単位：百万円、％）

区 分	2020年度末		2021年度末	
	金額	占率	金額	占率
非 居 住 者 貸 付	—	—	—	—
公社債（円建外債）・その他	20,879	1.7	1,244	0.1
円 貨 建 資 産 計	20,879	1.7	1,244	0.1

■合 計

（単位：百万円、％）

区 分	2020年度末		2021年度末	
	金額	占率	金額	占率
海 外 投 融 資	1,251,064	100.0	1,669,208	100.0

（注）「円貨額が確定した外貨建資産」は、為替予約が付されていることにより決済時の円貨額が確定し、当該円貨額が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（一般勘定）

（単位：百万円、％）

区 分	2020年度末		2021年度末	
	金額	占率	金額	占率
米 ド ル	1,221,038	99.3	1,629,138	97.7
ユ ー ロ	4,330	0.4	8,790	0.5
オーストラリアドル	4,228	0.3	29,493	1.8
イギリスポンド	89	0.0	44	0.0
シンガポールドル	497	0.0	496	0.0
外 貨 建 資 産 計	1,230,184	100.0	1,667,963	100.0

③海外投融資の地域別構成（一般勘定）

（単位：百万円、％）

区 分	2020年度末							
	外国証券				非居住者貸付			
	金額		占率		金額		占率	
北 米	1,196,844	97.7	1,195,169	100.0	1,675	5.5	—	—
ヨーロッパ	1,831	0.1	—	—	1,831	6.0	—	—
オセアニア	4,228	0.3	—	—	4,228	14.0	—	—
ア ジ ア	496	0.0	—	—	496	1.6	—	—
中 南 米	22,036	1.8	—	—	22,036	72.8	—	—
中 東	—	—	—	—	—	—	—	—
ア フ リ カ	—	—	—	—	—	—	—	—
国 際 機 関	—	—	—	—	—	—	—	—
合 計	1,225,436	100.0	1,195,169	100.0	30,267	100.0	—	—

区 分	2021年度末							
	外国証券				非居住者貸付			
	金額		占率		金額		占率	
北 米	1,410,783	86.3	1,409,366	86.9	1,417	10.6	—	—
ヨーロッパ	188,510	11.5	186,222	11.5	2,287	17.2	—	—
オセアニア	32,883	2.0	25,896	1.6	6,986	52.5	—	—
ア ジ ア	496	0.0	—	—	496	3.7	—	—
中 南 米	2,129	0.1	—	—	2,129	16.0	—	—
中 東	—	—	—	—	—	—	—	—
ア フ リ カ	—	—	—	—	—	—	—	—
国 際 機 関	—	—	—	—	—	—	—	—
合 計	1,634,803	100.0	1,621,486	100.0	13,317	100.0	—	—

2. 特別勘定

(1) 個人変額保険及び個人変額年金保険<合同運用分>特別勘定

当社では個人変額保険と一部の個人変額年金保険に係る資産は合同運用を行っておりますので、合算した数値を記載しております。

① 有価証券明細表（特別勘定）

（単位：百万円）

区 分	2020年度末	2021年度末
	貸借対照表計上額	貸借対照表計上額
公 社 債	180,918	184,716
株 式	24,123	20,759
外 国 証 券	1,188,731	1,619,915
公 社 債	107,976	120,488
株 式 等	1,080,754	1,499,426
そ の 他 の 証 券	440,433	464,987
合 計	1,834,206	2,290,378

② 売買目的有価証券の評価損益（特別勘定）

（単位：百万円）

区 分	2020年度末		2021年度末	
	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	1,834,206	393,448	2,290,378	92,105

③ 金銭の信託の時価情報（特別勘定）

該当ありません。

④ デリバティブ取引の時価情報（特別勘定）（ヘッジ会計適用分・非適用分の合算値）

該当ありません。

(2) 個人変額年金保険<合同運用分以外>特別勘定

当社は「個人変額保険及び個人変額年金保険<合同運用分>」に加えて、2021年度よりソニーライフ・ウィズ生命の吸収合併に伴い個人変額年金保険の運用も行っています。そのため、数値は2021年度末のみ開示しております。

① 有価証券明細表（特別勘定）

（単位：百万円）

区 分	2020年度末	2021年度末
	貸借対照表計上額	貸借対照表計上額
公 社 債	—	—
株 式	—	—
外 国 証 券	—	104,659
公 社 債	—	—
株 式 等	—	104,659
そ の 他 の 証 券	—	360,008
合 計	—	464,668

② 売買目的有価証券の評価損益（特別勘定）

（単位：百万円）

区 分	2020年度末		2021年度末	
	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	—	—	464,668	13,137

③ 金銭の信託の時価情報（特別勘定）

該当ありません。

④ デリバティブ取引の時価情報（特別勘定）（ヘッジ会計適用分・非適用分の合算値）

該当ありません。

3. 会社計

(1) 資産構成 (会社計)

①資産の構成 (会社計)

(単位：百万円、%)

区 分	2020年度末		2021年度末	
	金額	占率	金額	占率
現預金・コールローン	153,651	1.2	265,964	1.8
買現先勘定	—	—	—	—
債券貸借取引支払保証金	—	—	—	—
買入金銭債権	—	—	—	—
商品有価証券	—	—	—	—
金銭の信託	40	0.0	40	0.0
有価証券	11,967,235	95.1	13,613,434	94.0
公 社 債	9,053,479	71.9	9,403,730	64.9
株 式	58,811	0.5	25,097	0.2
外 国 証 券	2,414,168	19.2	3,359,378	23.2
公 社 債	1,303,146	10.4	1,741,974	12.0
株 式 等	1,111,022	8.8	1,617,404	11.2
その他の証券	440,776	3.5	825,227	5.7
貸付金	202,134	1.6	205,593	1.4
不動産	91,526	0.7	90,210	0.6
繰延税金資産	39,832	0.3	92,527	0.6
その他	129,997	1.0	222,582	1.5
貸倒引当金	△ 687	△ 0.0	△ 696	△ 0.0
合 計	12,583,730	100.0	14,489,657	100.0
うち外貨建資産	2,421,871	19.2	3,405,892	23.5

(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 (会社計)

(単位：百万円)

区 分	2020年度	2021年度
現預金・コールローン	△ 4,057	112,312
買現先勘定	—	—
債券貸借取引支払保証金	—	—
買入金銭債権	—	—
商品有価証券	—	—
金銭の信託	0	0
有価証券	1,337,262	1,646,198
公 社 債	520,768	350,251
株 式	8,683	△ 33,714
外 国 証 券	648,224	945,210
公 社 債	238,830	438,828
株 式 等	409,394	506,381
その他の証券	159,585	384,450
貸付金	△ 6,497	3,459
不動産	△ 1,033	△ 1,315
繰延税金資産	20,523	52,695
その他	443	92,585
貸倒引当金	△ 34	△ 8
合 計	1,346,606	1,905,926
うち外貨建資産	663,646	984,020

(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) 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 (会社計)

(単位: 百万円)

区 分	2020年度末		2021年度末	
	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	1,834,206	393,448	2,755,047	105,243

② 有価証券の時価情報 (会社計)

a. 売買目的有価証券以外の有価証券

(単位: 百万円)

区 分	2020年度末					2021年度末				
	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	7,592,136	9,231,182	1,639,046	1,699,983	60,936	7,769,162	8,953,087	1,183,924	1,313,852	129,928
責任準備金対応債券	1,254,887	1,289,774	34,887	66,278	31,391	1,714,541	1,641,126	△ 73,414	39,550	112,964
子会社・関連会社株式	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
その他の有価証券	1,118,442	1,238,646	120,204	136,575	16,371	1,301,502	1,363,910	62,408	103,030	40,622
公 社 債	935,112	1,050,093	114,981	115,969	988	1,013,654	1,088,536	74,881	90,115	15,234
株 式	4,992	13,711	8,719	8,745	26	127	127	—	—	—
外 国 証 券	178,337	174,842	△ 3,495	11,860	15,356	287,720	275,246	△ 12,473	12,914	25,387
公 社 債	176,865	170,613	△ 6,251	9,104	15,356	286,247	268,260	△ 17,987	7,400	25,387
株 式 等	1,472	4,228	2,755	2,755	—	1,472	6,986	5,514	5,514	—
その他の証券	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
買入金銭債権	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
譲渡性預金	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
その他	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
合 計	9,965,465	11,759,603	1,794,138	1,902,837	108,699	10,785,206	11,958,124	1,172,918	1,456,433	283,515
公 社 債	8,757,579	10,545,447	1,787,867	1,839,986	52,119	9,144,133	10,365,415	1,221,281	1,404,431	183,149
株 式	4,992	13,711	8,719	8,745	26	127	127	—	—	—
外 国 証 券	1,202,893	1,200,445	△ 2,448	54,105	56,553	1,640,945	1,592,582	△ 48,363	52,002	100,366
公 社 債	1,201,421	1,196,216	△ 5,204	51,349	56,553	1,639,473	1,585,595	△ 53,877	46,488	100,366
株 式 等	1,472	4,228	2,755	2,755	—	1,472	6,986	5,514	5,514	—
その他の証券	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
買入金銭債権	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
譲渡性預金	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
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。

b. 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年度末
子会社・関連会社株式	42,182	5,790
その他の有価証券	3,447	2,802
国内株式	159	159
外国株式	160	243
その他	3,126	2,398
合 計	45,630	8,593

c. 前項bについて為替等を評価し、前項aと合算した有価証券の時価情報は以下のとおりです。

(単位：百万円)

区 分	2020年度末					2021年度末				
	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	7,592,136	9,231,182	1,639,046	1,699,983	60,936	7,769,162	8,953,087	1,183,924	1,313,852	129,928
責任準備金対応債券	1,254,887	1,289,774	34,887	66,278	31,391	1,714,541	1,641,126	△ 73,414	39,550	112,964
子会社・関連会社株式	42,182	42,198	15	15	—	5,790	5,857	66	66	—
その他の有価証券	1,121,889	1,243,823	121,933	138,735	16,802	1,304,304	1,368,892	64,587	105,473	40,885
公 社 債	935,112	1,050,093	114,981	115,969	988	1,013,654	1,088,536	74,881	90,115	15,234
株 式	5,151	13,871	8,719	8,745	26	287	287	—	—	—
外 国 証 券	178,498	176,027	△ 2,471	12,885	15,356	287,963	276,910	△ 11,053	14,334	25,387
公 社 債	176,865	170,613	△ 6,251	9,104	15,356	286,247	268,260	△ 17,987	7,400	25,387
株 式 等	1,633	5,413	3,780	3,780	—	1,715	8,650	6,934	6,934	—
そ の 他 の 証 券	3,126	3,831	704	1,135	430	2,398	3,157	759	1,022	263
買 入 金 銭 債 権	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
譲 渡 性 預 金	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
そ の 他	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
合 計	10,011,095	11,806,978	1,795,882	1,905,012	109,130	10,793,800	11,968,964	1,175,163	1,458,943	283,779
公 社 債	8,757,579	10,545,447	1,787,867	1,839,986	52,119	9,144,133	10,365,415	1,221,281	1,404,431	183,149
株 式	25,968	34,687	8,719	8,745	26	4,337	4,337	—	—	—
外 国 証 券	1,224,420	1,223,012	△ 1,408	55,145	56,553	1,642,930	1,596,053	△ 46,876	53,489	100,366
公 社 債	1,201,421	1,196,216	△ 5,204	51,349	56,553	1,639,473	1,585,595	△ 53,877	46,488	100,366
株 式 等	22,999	26,795	3,796	3,796	—	3,456	10,458	7,001	7,001	—
そ の 他 の 証 券	3,126	3,831	704	1,135	430	2,398	3,157	759	1,022	263
買 入 金 銭 債 権	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
譲 渡 性 預 金	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
そ の 他	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

(3) 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年度末				
	貸借対照表計上額	時価	差損益	差益		貸借対照表計上額	時価	差損益	差益	
				差益	差損				差益	差損
金 銭 の 信 託	40	40	—	—	—	40	40	—	—	—

(注) 本表には、合同運用の金銭信託を含み、その金額は2020年度末、2021年度末において40百万円です。

- ① 運用目的の金銭の信託
該当ありません。
- ② 満期保有目的、責任準備金対応、その他の金銭の信託
該当ありません。

(4) デリバティブ取引の時価情報（会社計）

①定性的情報

a. 取引の内容

当社が利用対象としているデリバティブ取引は次の取引です。

- ・ 通貨関連：為替予約取引
- ・ 株式関連：株価指数先物取引、トータル・リターン・スワップ取引

b. 利用目的及び取組方針

当社が利用しているデリバティブ取引は以下の通り、保有資産及び負債の市場リスクを低減させる目的で行っており、投機的なデリバティブ取引は行わない方針です。

- ・ 通貨関連取引：保有資産及び個人変額保険の最低保証に係る為替リスクをヘッジする目的で行っています。
- ・ 株式関連取引：保有資産及び個人変額保険の最低保証に係る株式リスクをヘッジする目的で行っています。

c. 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市場リスク（為替リスク、株式リスク）がありますが、保有資産及び負債のリスクの低減を主目的として利用しているため、デリバティブ取引と対象となる資産及び負債のリスクは減殺され限定的と認識しています。

当社が利用しているデリバティブ取引は、当該取引に係わる契約不履行の可能性が小さいと見込まれる相手先を選定しているため、信用リスクは限定的と認識しています。

d. リスク管理体制

当社が利用しているデリバティブ取引は、社内で決裁された限度額の範囲内で取引しています。

運用部門が行った取引の相手先からの報告書は、管理部門が直接受領して運用部門からの報告と照合し、管理部門は運用部門と独立してデリバティブ取引のポジション及び損益を把握できる体制をとっています。また、デリバティブ取引に関するリスク管理は、担当所管において厳格に行うとともに、全体のリスク状況については、リスク管理部門を通じ、取締役会及び経営会議において定期的に報告しています。

e. 定量的情報に関する補足説明

当社が利用しているデリバティブ取引に、ヘッジ会計は適用していません。

②定量的情報

a. 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）

2020年度末						
	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	—	—	—	—	—	—
ヘッジ会計非適用分	—	△ 60	△ 5,156	—	—	△ 5,216
合計	—	△ 60	△ 5,156	—	—	△ 5,216
2021年度末						
	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	—	—	—	—	—	—
ヘッジ会計非適用分	—	△ 6,833	△ 28,008	—	—	△ 34,841
合計	—	△ 6,833	△ 28,008	—	—	△ 34,841

（注）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。

b. ヘッジ会計が適用されていないもの

- (a) 金利関連
該当ありません。

(b) 通貨関連

(単位：百万円)

区分	種類	2020年度末				2021年度末			
		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	12,959	—	△ 60	△ 60	96,360	—	△ 6,833	△ 6,833
	(米ドル)	—	—	—	—	—	—	—	—
	(ユーロ)	12,959	—	△ 60	△ 60	71,279	—	△ 4,869	△ 4,869
	(豪ドル)	—	—	—	—	25,081	—	△ 1,964	△ 1,964
合 計					△ 60				△ 6,833

(注) 1. 為替予約の時価は、事業年度末現在の金利を基に現在価値に割引いて算定しています。

2. 差損益欄には、時価を記載しています。

(c) 株式関連

(単位：百万円)

区分	種類	2020年度末				2021年度末			
		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	57,587	—	△ 985	△ 985	123,390	—	△ 11,902	△ 11,902
店頭	トータル・リターン・スワップ 売建	117,055	—	△ 4,170	△ 4,170	136,578	—	△ 16,105	△ 16,105
合 計					△ 5,156				△ 28,008

(注) 1. 株価指数先物の時価は、取引所における事業年度末の最終価格によっています。

2. トータル・リターン・スワップの時価は、事業年度末の株価等により算定しています。

3. 差損益欄には、時価を記載しています。

(d) 債券関連

該当ありません。

(e) その他

該当ありません。

c. ヘッジ会計が適用されているもの

(a) 金利関連

該当ありません。

(b) 通貨関連

該当ありません。

(c) 株式関連

該当ありません。

(d) 債券関連

該当ありません。

(e) その他

該当ありません。