

平成28年度第2四半期（上半期）報告 補足資料

1. 一般勘定

(1) 商品有価証券関係	1
① 商品有価証券明細表	1
② 商品有価証券売買高	1
(2) 有価証券関係	1
① 有価証券明細表	1
② 有価証券残存期間別残高	2
③ 地域別地方債保有内訳	2
④ 公社債及び外国公社債格付別内訳	3
⑤ 株式業種別内訳	3
(3) 貸付金関係	4
① 貸付金明細表	4
② 貸付金企業規模別内訳	4
③ 貸付金業種別内訳	5
④ 貸付金担保別内訳	6
⑤ 貸付金地域別内訳	6
⑥ 一般貸付金残存期間別残高	6
(4) 海外投融資関係	7
① 資産別明細	7
② 外貨建資産の通貨別構成	8
③ 海外投融資の地域別構成	8
(5) デリバティブ取引の状況	9

2. 個人変額保険特別勘定

(1) 売買目的有価証券の評価損益	14
(2) デリバティブ取引の状況	14

3. 会社計

(1) 資産構成	15
(2) 売買目的有価証券の評価損益	15
(3) 有価証券の時価情報	16
(4) 金銭の信託の時価情報	17
(5) デリバティブ取引の状況	18

1. 一般勘定

(1) 商品有価証券関係

① 商品有価証券明細表

平成27年度末、平成28年度上半期末に該当の残高はありません。

② 商品有価証券売買高

平成27年度上半期、平成28年度上半期に該当はありません。

(2) 有価証券関係

① 有価証券明細表

(単位:億円、%)

区分	平成27年度末		平成28年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
公社債	233,548	46.6	227,614	45.7
国債	196,169	39.1	194,326	39.0
地方債	12,811	2.6	10,113	2.0
社債	24,567	4.9	23,175	4.7
(うち公社・公団債)	(11,270)	(2.2)	(9,967)	(2.0)
株式	81,076	16.2	76,793	15.4
外国証券	171,581	34.2	177,227	35.6
公社債	134,251	26.8	141,347	28.4
株式等	37,330	7.4	35,879	7.2
その他の証券	15,130	3.0	16,445	3.3
合計	501,337	100.0	498,080	100.0

②有価証券残存期間別残高

(単位:億円)

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
平成 27 年度 末	国債	3,229	5,568	7,419	9,778	28,696	141,476	196,169
	地方債	2,827	1,866	1,387	32	565	6,132	12,811
	社債	2,247	5,064	1,300	1,267	2,230	12,457	24,567
	株式						81,076	81,076
	外国証券	4,302	7,805	15,644	14,000	15,734	114,093	171,581
	公社債	4,290	7,673	15,360	13,558	15,279	78,088	134,251
	株式等	12	131	283	442	455	36,005	37,330
	その他の証券	190	438	2,202	1,080	5,477	5,742	15,130
	買入金銭債権	229	6	49	120	368	3,425	4,199
	譲渡性預金	7,302	—	—	—	—	—	7,302
合計	20,329	20,748	28,003	26,280	53,072	364,404	512,839	
平成 28 年度 上半 期末	国債	3,126	5,567	6,256	8,948	35,500	134,926	194,326
	地方債	851	2,167	336	102	883	5,772	10,113
	社債	1,584	4,259	1,272	1,672	2,551	11,835	23,175
	株式						76,793	76,793
	外国証券	4,064	8,367	12,582	11,306	18,137	122,768	177,227
	公社債	4,056	8,183	12,262	10,963	17,594	88,286	141,347
	株式等	8	183	319	343	542	34,481	35,879
	その他の証券	505	103	2,187	1,175	7,003	5,470	16,445
	買入金銭債権	296	—	77	47	242	2,902	3,566
	譲渡性預金	4,512	—	—	—	—	—	4,512
合計	14,940	20,465	22,712	23,253	64,318	360,469	506,159	

③地域別地方債保有内訳

(単位:億円、%)

区分	平成27年度末		平成28年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
北海道	22	0.2	22	0.2
東北	71	0.6	1	0.0
関東	6,492	50.7	5,656	55.9
中部	2,844	22.2	2,260	22.4
近畿	206	1.6	217	2.2
中国	93	0.7	98	1.0
四国	—	—	—	—
九州	1,042	8.1	975	9.6
その他	2,037	15.9	880	8.7
合計	12,811	100.0	10,113	100.0

(注)上記「その他」は共同発行市場公募地方債です。

④公社債及び外国公社債格付別内訳

(単位:億円、%)

区分	平成27年度末		平成28年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
AAA	18,905	11.0	16,879	9.7
AA	112,606	65.6	119,153	68.2
A	23,734	13.8	22,961	13.1
BBB	11,117	6.5	12,042	6.9
BB以下	262	0.2	238	0.1
格付なし	5,002	2.9	3,361	1.9
合計	171,629	100.0	174,636	100.0

(注) 1. 上記公社債残高は日本国債の残高を除いています。(平成27年度末:19兆6,169億円、平成28年度上半期末:19兆4,326億円)
2. 上記は外部の格付業者の格付に基づき作成しています。

⑤株式業種別内訳

(単位:億円、%)

区分	平成27年度末		平成28年度上半期末		
	金額	占率	金額	占率	
水産・農林業	34	0.0	34	0.0	
鉱業	42	0.1	43	0.1	
建設業	1,479	1.8	1,276	1.7	
製造業	食料品	3,399	4.2	3,114	4.1
	繊維製品	1,206	1.5	1,138	1.5
	パルプ・紙	225	0.3	211	0.3
	化学	6,644	8.2	6,984	9.1
	医薬品	7,510	9.3	6,926	9.0
	石油・石炭製品	187	0.2	165	0.2
	ゴム製品	1,001	1.2	807	1.1
	ガラス・土石製品	694	0.9	707	0.9
	鉄鋼	1,254	1.5	1,191	1.6
	非鉄金属	701	0.9	723	0.9
	金属製品	403	0.5	387	0.5
	機械	4,241	5.2	4,297	5.6
	電気機器	8,501	10.5	8,323	10.8
	輸送用機器	12,366	15.3	12,052	15.7
精密機器	1,248	1.5	968	1.3	
その他製品	999	1.2	907	1.2	
電気・ガス業	3,840	4.7	3,423	4.5	
運輸・情報通信業	陸運業	5,628	6.9	4,984	6.5
	海運業	66	0.1	80	0.1
	空運業	113	0.1	97	0.1
	倉庫・運輸関連業	122	0.2	80	0.1
	情報・通信業	1,665	2.1	1,771	2.3
商業	卸売業	2,527	3.1	2,374	3.1
	小売業	2,335	2.9	2,215	2.9
金融・保険業	銀行業	4,782	5.9	4,769	6.2
	証券、商品先物取引業	554	0.7	490	0.6
	保険業	4,801	5.9	4,068	5.3
	その他金融業	496	0.6	467	0.6
不動産業	467	0.6	397	0.5	
サービス業	1,529	1.9	1,311	1.7	
合計	81,076	100.0	76,793	100.0	

(3) 貸付金関係

① 貸付金明細表

(単位:億円)

区分	平成27年度末	平成28年度上半期末
保険約款貸付	6,958	6,749
保険料振替貸付	505	486
契約者貸付	6,452	6,263
一般貸付	74,256	74,338
企業貸付	55,020	54,461
国内	53,593	53,155
海外	1,426	1,305
国・国際機関・政府関係機関・ 公共団体・公企業貸付	5,131	6,380
国内	4,611	5,863
海外	519	517
住宅ローン	8,497	7,972
消費者ローン	4,727	4,491
その他	880	1,032
合計	81,214	81,088
非居住者貸付	1,946	1,822

② 貸付金企業規模別内訳

(単位:件、億円、%)

区分		平成27年度末		平成28年度上半期末	
			占率		占率
大企業	貸付先数	927	37.8	905	36.5
	金額	47,446	88.5	46,711	87.9
中堅企業	貸付先数	341	13.9	334	13.5
	金額	766	1.4	744	1.4
中小企業	貸付先数	1,183	48.3	1,241	50.0
	金額	5,380	10.0	5,698	10.7
国内企業計	貸付先数	2,451	100.0	2,480	100.0
	金額	53,593	100.0	53,155	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②～④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	資本金 10億円以上	常用する 従業員 50名超	資本金 10億円以上	常用する 従業員 100名超	資本金 10億円以上	常用する 従業員 100名超	資本金 10億円以上
中堅企業		かつ 資本金 3億円超 10億円未満		かつ 資本金 5千万円超 10億円未満		かつ 資本金 5千万円超 10億円未満		かつ 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貸付金業種別内訳

(単位:億円、%)

区分		平成27年度末		平成28年度上半期末	
		金額	占率	金額	占率
国内向け	製造業	13,645	18.4	13,242	17.8
	食料	1,029	1.4	1,051	1.4
	繊維	348	0.5	355	0.5
	木材・木製品	21	0.0	28	0.0
	パルプ・紙	770	1.0	712	1.0
	印刷	187	0.3	184	0.2
	化学	2,688	3.6	2,661	3.6
	石油・石炭	776	1.0	715	1.0
	窯業・土石	440	0.6	430	0.6
	鉄鋼	1,858	2.5	1,981	2.7
	非鉄金属	205	0.3	193	0.3
	金属製品	151	0.2	146	0.2
	はん用・生産用・業務用機械	1,346	1.8	1,384	1.9
	電気機械	1,449	2.0	1,320	1.8
	輸送用機械	1,941	2.6	1,758	2.4
	その他の製造業	428	0.6	315	0.4
	農業、林業	—	—	—	—
	漁業	20	0.0	20	0.0
	鉱業、採石業、砂利採取業	55	0.1	53	0.1
	建設業	403	0.5	335	0.5
	電気・ガス・熱供給・水道業	11,916	16.0	11,769	15.8
	情報通信業	1,617	2.2	1,589	2.1
	運輸業、郵便業	6,956	9.4	6,816	9.2
	卸売業	8,661	11.7	9,190	12.4
	小売業	556	0.7	552	0.7
	金融業、保険業	5,894	7.9	5,701	7.7
	不動産業	4,122	5.6	4,180	5.6
物品賃貸業	2,615	3.5	2,522	3.4	
学術研究、専門・技術サービス業	11	0.0	9	0.0	
宿泊業	38	0.1	41	0.1	
飲食業	31	0.0	28	0.0	
生活関連サービス業、娯楽業	679	0.9	657	0.9	
教育、学習支援業	15	0.0	14	0.0	
医療・福祉	6	0.0	10	0.0	
その他のサービス	143	0.2	152	0.2	
地方公共団体	1,689	2.3	1,629	2.2	
個人(住宅・消費・納税資金等)	13,225	17.8	12,465	16.8	
その他	—	—	1,533	2.1	
合 計	72,309	97.4	72,515	97.5	
海外向け	政府等	519	0.7	517	0.7
	金融機関	150	0.2	150	0.2
	商工業(等)	1,276	1.7	1,155	1.6
	合 計	1,946	2.6	1,822	2.5
総 合 計	74,256	100.0	74,338	100.0	

④貸付金担保別内訳

(単位:億円、%)

区分	平成27年度末		平成28年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
担保貸付	350	0.5	380	0.5
有価証券担保貸付	92	0.1	124	0.2
不動産・動産・財団担保貸付	173	0.2	179	0.2
指名債権担保貸付	84	0.1	76	0.1
保証貸付	1,982	2.7	1,792	2.4
信用貸付	58,698	79.0	59,701	80.3
その他	13,224	17.8	12,463	16.8
一般貸付計	74,256	100.0	74,338	100.0
うち劣後特約付貸付	1,961	2.6	2,741	3.7

⑤貸付金地域別内訳

(単位:億円、%)

区分	平成27年度末		平成28年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
北海道	667	1.2	638	1.2
東北	1,314	2.5	1,256	2.4
関東	34,299	64.0	34,503	64.9
中部	4,946	9.2	4,781	9.0
近畿	8,635	16.1	8,335	15.7
中国	1,181	2.2	1,193	2.2
四国	802	1.5	801	1.5
九州	1,746	3.3	1,644	3.1
合計	53,593	100.0	53,155	100.0

(注) 1. 個人ローン、非居住者貸付、保険約款貸付等は含んでいません。
2. 地域区分は、貸付先の本社所在地によります。

⑥一般貸付金残存期間別残高

(単位:億円)

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
	平成27年度末						
固定金利	8,791	15,231	11,944	8,221	8,297	16,956	69,443
変動金利	443	973	1,339	495	603	956	4,812
一般貸付計	9,235	16,205	13,283	8,717	8,901	17,912	74,256
平成28年度上半期末							
固定金利	10,873	13,337	11,251	8,392	8,302	17,496	69,653
変動金利	545	871	1,185	621	511	948	4,684
一般貸付計	11,419	14,208	12,436	9,014	8,814	18,444	74,338

(4)海外投融資関係

①資産別明細

・外貨建資産

(単位:億円、%)

区分	平成27年度末		平成28年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
公社債	126,712	70.9	135,371	72.8
株式	5,575	3.1	5,558	3.0
現預金・その他	19,494	10.9	19,736	10.6
小計	151,783	84.9	160,666	86.4

・円貨額が確定した外貨建資産

(単位:億円、%)

区分	平成27年度末		平成28年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
公社債	—	—	—	—
現預金・その他	2,481	1.4	2,464	1.3
小計	2,481	1.4	2,464	1.3

・円貨建資産

(単位:億円、%)

区分	平成27年度末		平成28年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
非居住者貸付	941	0.5	837	0.5
公社債(円建外債)・その他	23,484	13.1	21,978	11.8
小計	24,426	13.7	22,816	12.3

・合計

(単位:億円、%)

区分	平成27年度末		平成28年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
海外投融資	178,691	100.0	185,947	100.0

(注)「円貨額が確定した外貨建資産」とは、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計上額としているものです。

②外貨建資産の通貨別構成

(単位:億円、%)

区分	平成27年度末		平成28年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
米ドル	89,750	59.1	98,195	61.1
ユーロ	31,554	20.8	35,681	22.2
イギリスポンド	15,912	10.5	13,312	8.3
オーストラリアドル	5,558	3.7	5,669	3.5
カナダドル	2,713	1.8	3,441	2.1
インドルピー	1,359	0.9	1,362	0.8
その他	4,935	3.3	3,002	1.9
合計	151,783	100.0	160,666	100.0

(注) 内訳は、平成28年度上半期末における残高上位6通貨を表示しています。

③海外投融資の地域別構成

(単位:億円、%)

区分	外国証券						非居住者貸付		
	金額		占率		金額		占率		
	金額	占率	金額	占率	金額	占率	金額	占率	
平成27年度末	北米	77,805	45.3	73,601	54.8	4,204	11.3	1,067	54.8
	ヨーロッパ	53,770	31.3	47,603	35.5	6,166	16.5	380	19.5
	オセアニア	4,914	2.9	4,889	3.6	24	0.1	48	2.5
	アジア	5,710	3.3	2,652	2.0	3,058	8.2	34	1.8
	中南米	27,388	16.0	3,512	2.6	23,876	64.0	106	5.5
	中東	—	—	—	—	—	—	—	—
	アフリカ	—	—	—	—	—	—	44	2.3
	国際機関	1,991	1.2	1,991	1.5	—	—	265	13.6
	合計	171,581	100.0	134,251	100.0	37,330	100.0	1,946	100.0
平成28年度上半期末	北米	86,315	48.7	82,244	58.2	4,071	11.3	1,050	57.6
	ヨーロッパ	52,956	29.9	47,360	33.5	5,596	15.6	380	20.8
	オセアニア	4,598	2.6	4,575	3.2	23	0.1	—	—
	アジア	5,576	3.1	2,474	1.8	3,101	8.6	32	1.8
	中南米	25,941	14.6	2,854	2.0	23,086	64.3	95	5.2
	中東	—	—	—	—	—	—	—	—
	アフリカ	—	—	—	—	—	—	—	—
	国際機関	1,838	1.0	1,838	1.3	—	—	265	14.5
	合計	177,227	100.0	141,347	100.0	35,879	100.0	1,822	100.0

(注) 海外投融資のうち、外国証券、非居住者貸付を対象としています。

(5) デリバティブ取引の状況

[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。

金利関連：金利先物取引、金利スワップ取引、スワップション取引等

通貨関連：為替予約取引、通貨オプション取引、通貨スワップ取引等

株式関連：株価指数先物取引、株価指数オプション取引、株券オプション取引、株式先渡取引等

債券関連：債券先物取引、債券先物オプション取引、選択権付債券売買取引等

(b) 取組方針

効率的な資産運用を図る観点から、主として現物資産運用のリスクをコントロールする目的でデリバティブを活用しています。

(c) 利用目的

ご契約者よりお預かりした資産の安定運用のため、主として保有資産に係る市場リスクのヘッジを目的として利用しています。

(d) リスクの内容

当社が行っているデリバティブ取引については、市場リスク（金利・為替・株式等の変動によるリスク）及び信用リスク（取引相手が倒産等により契約不履行に陥るリスク）があります。市場リスクについては、デリバティブ取引は主として現物資産運用のリスクをコントロールすることを目的としていることから、限定的であると認識しています。また、信用リスクについても、国内外の金融商品取引所を通じた取引か、信用度の高い取引先を相手としており、契約が履行されないリスクは小さいものと認識しています。

(e) リスク管理体制

デリバティブ取引の目的や種類ごとに必要となる取引限度枠等を規定するとともに、その取引については、事務部門（バックオフィス）が外部証票との照合により内容を確認する等、投融資執行部門（フロントオフィス）に対しての牽制が働く体制としています。また、現物資産も併せた市場リスクを定量的に把握・分析し、そのリスク量とともにポジション、損益状況を定期的に「運用リスク管理専門委員会」に報告する体制になっています。

(f) 定量的情報に関する補足説明

ア) 想定元本（契約金額）に関する補足説明

スワップ取引に係る想定元本やオプション取引の契約金額は、金利交換等に係る名目的なものであり、信用リスク量を示すものではありません。

デリバティブ取引の信用リスクとは、取引相手先がデフォルトした際に、市場で同じポジションを再構築するための潜在的なコストを意味しており、当社ではカレントエクスポージャー方式により算出しています。

○信用リスク相当額

(単位：億円)

	平成27年度末		平成28年度上半期末	
	想定元本 (契約金額)	信用リスク 相当額	想定元本 (契約金額)	信用リスク 相当額
金利スワップ	1,785	115	2,608	187
通貨スワップ	11,944	1,039	13,081	1,654
為替予約	74,578	2,194	97,728	3,371
株式先渡契約	2,100	157	5,597	459
株式オプション(買)	2	0	853	52
通貨オプション(買)	—	—	1,516	15
株価指数先物	—	—	628	49
その他の金融派生商品	—	—	—	—
合計	90,411	3,507	122,014	5,790

(注)「外貨建債権債務等」に充当された通貨関連デリバティブを除く。

イ) 時価算定に係る補足説明

[先物取引等の市場取引]

期末日の清算値または終値

[株式オプション取引]

期末日の清算値または終値、外部情報ベンダー等より入手したボラティリティ等を基準として、当社で算出した理論価格

[為替予約取引、通貨オプション取引]

取引相手の金融機関等より入手したTTM、割引レート等を基準として、当社で算出した理論価格

[金利スワップ取引、通貨スワップ取引]

公表されている市場金利等を基準として、将来のキャッシュ・フロー差額を現在価値に割り引いて算出した理論価格

[株式先渡取引]

公表されている市場金利等を基準として、将来のキャッシュ・フローを現在価値に割り引いて算出した理論価格

ウ) 差損益に関する補足説明

当社では、デリバティブ取引を主として現物資産のかかえる市場リスクのコントロールを行うための補完手段として活用しています。

例えば、為替予約、通貨オプション取引については、主として為替リスクをヘッジするために活用しており、外国債券・外国株式等の外貨建資産全体の損益と合計で見する必要があります。

(g) ヘッジ会計の方法

ヘッジ会計の手法については、主に、貸付金の一部及び外貨建貸付金の一部に対するキャッシュ・フローのヘッジとして金利スワップの特例処理、保険契約の一部に対する金利変動リスクのヘッジとして「保険業における金融商品会計基準適用に関する会計上及び監査上の取扱い」(日本公認会計士協会業種別監査委員会報告第26号)に基づく金利スワップによる繰延ヘッジ、外貨建債券の一部、外貨建貸付金の一部及び外貨建劣後特約付社債に対する為替変動に係るキャッシュ・フローのヘッジとして通貨スワップによる繰延ヘッジ及び振当処理、外貨建債券等の一部及び外貨建株式の一部に対する為替変動に係る価格変動リスクのヘッジとして為替予約による時価ヘッジ及び繰延ヘッジ、また、国内株式の一部に対する価格変動リスクのヘッジとして株式先渡による時価ヘッジを適用しており、ヘッジの有効性の判定については、リスク管理方針に基づき、主にヘッジ対象とヘッジ手段の時価変動を比較する比率分析によっております。

[定量的情報(一般勘定)](ヘッジ会計適用・非適用分合算値)

1. 差損益の内訳(ヘッジ会計適用分・非適用分の内訳)(平成28年度上半期末)

(単位:億円)

区分	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	149	2,069	△245	—	—	1,972
ヘッジ会計非適用分	0	△49	7	—	—	△41
合計	149	2,019	△237	—	—	1,930

(注) ヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ適用分の差損益、及びヘッジ会計非適用分のうちヘッジ会計の中止に伴う繰延ヘッジ損益の未償却額を除いた差損益は、損益計算書に計上しています。

2. 金利関連

(単位:億円)

区分	種類	平成27年度末				平成28年度上半期末			
		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	1,760	1,760	70	70	2,608	2,608	149	149
	固定金利支払/変動金利受取	25	25	△0	△0	—	—	—	—
合計				70				149	

(注) 「差損益」欄には、時価を記載しています。

(参考) 金利スワップ契約の残存期間別構成

(単位:億円、%)

残存期間		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	
平成27年度末	固定金利受取/変動金利支払スワップ	想定元本	—	—	—	—	1,760	1,760	
		平均受取固定金利	—	—	—	—	0.79	0.79	
		平均支払変動金利	—	—	—	—	0.02	0.02	
	固定金利支払/変動金利受取スワップ	想定元本	—	—	—	—	15	10	25
		平均支払固定金利	—	—	—	—	0.25	0.16	0.21
		平均受取変動金利	—	—	—	—	0.03	0.02	0.03
平成28年度上半期末	固定金利受取/変動金利支払スワップ	想定元本	—	—	40	60	8	2,500	2,608
		平均受取固定金利	—	—	△0.05	△0.02	0.13	0.70	0.67
		平均支払変動金利	—	—	0.00	0.00	0.02	△0.00	△0.00
	固定金利支払/変動金利受取スワップ	想定元本	—	—	—	—	—	—	—
		平均支払固定金利	—	—	—	—	—	—	—
		平均受取変動金利	—	—	—	—	—	—	—

3. 通貨関連

(単位:億円)

区分	種類	平成27年度末				平成28年度上半期末					
		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	74,316	—	1,134	1,134	99,709	—	2,305	2,305		
	米ドル	47,624	—	711	711	60,228	—	978	978		
	ユーロ	14,803	—	18	18	24,499	—	231	231		
	買建	1,373	—	23	23	330	—	△6	△6		
	米ドル	768	—	△1	△1	75	—	△0	△0		
	ユーロ	0	—	0	0	0	—	△0	△0		
	債券	—	—	—	—	254	—	△5	△5		
	通貨オプション										
	売建										
	コール	—	—	—	—	758	—	1	1		
	米ドル	(—)	(—)	—	—	(2)	(—)	—	—		
	ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—		
	プット	—	—	—	—	(—)	(—)	—	—		
	米ドル	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—		
	ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—		
	買建										
	コール	—	—	—	—	—	—	—	—		
	米ドル	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—		
	ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—		
	プット	—	—	—	—	(—)	(—)	—	—		
	米ドル	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—		
	ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—		
	通貨スワップ										
	米ドル払/円受	11,944	11,479	△1,815	△1,815	13,081	12,404	△275	△275		
	ユーロ払/円受	5,318	5,113	△1,060	△1,060	5,373	5,009	△336	△336		
	円払/豪ドル受	4,710	4,449	△777	△777	4,963	4,651	△125	△125		
	円払/豪ドル受	727	727	△1	△1	1,454	1,454	△71	△71		
	合計				△657				2,019		

(注) 1. ()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、先渡取引及び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。

4. 株式関連

(単位:億円)

区分	種類	平成27年度末				平成28年度上半期末			
		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	—	—	—	—	640	—	11	11
	買建	—	—	—	—	—	—	—	—
	株価指数オプション								
	売建								
	コール	—	—	—	—	—	—	—	—
	プット	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	買建	—	—	—	—	—	—	—	—
	コール	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	プット	—	—	—	—	851	—	42	△4
		(—)	(—)			(46)	(—)		
店頭	株式先渡契約								
	売建	2,044	—	△80	△80	5,418	—	△245	△245
	買建	—	—	—	—	—	—	—	—
	株価指数オプション								
	売建								
	コール	—	—	—	—	—	—	—	—
	プット	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	買建	—	—	—	—	—	—	—	—
	コール	2	2	1	0	2	2	0	0
	プット	(0)	(0)	—	—	(0)	(0)	—	—
		(—)	(—)			(—)	(—)		
合 計				△80					△237

(注) 1. ()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。

5. 債券関連

平成27年度末、平成28年度上半期末に該当の残高はありません。

6. その他

平成27年度末、平成28年度上半期末に該当の残高はありません。

2. 個人変額保険特別勘定

(1) 売買目的有価証券の評価損益

(単位:億円)

区分	平成27年度末		平成28年度上半期末	
	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	893	△150	955	△32

(2) デリバティブ取引の状況(個人変額保険特別勘定)

1. 差損益の内訳(ヘッジ会計適用分・非適用分の内訳)(平成28年度上半期末)

(単位:億円)

区分	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	—	0	△0	△0	—	△0
合計	—	0	△0	△0	—	△0

(注) ヘッジ会計非適用分の差損益は、損益計算書に計上しています。

2. 金利関連

平成27年度末、平成28年度上半期末に該当の残高はありません。

3. 通貨関連

(単位:億円)

区分	種類	平成27年度末				平成28年度上半期末			
		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	73	—	△0	△0	48	—	0	0
	米ドル	27	—	0	0	15	—	0	0
	ユーロ	35	—	△0	△0	21	—	0	0
	買建	104	—	0	0	46	—	△0	△0
	米ドル	64	—	△0	△0	21	—	△0	△0
	ユーロ	24	—	0	0	11	—	△0	△0
合計					△0				0

(注) 「差損益」欄には、時価を記載しています。

4. 株式関連

(単位:億円)

区分	種類	平成27年度末				平成28年度上半期末			
		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	107	—	0	0	39	—	△0	△0
合計					0				△0

(注) 「差損益」欄には、時価を記載しています。

5. 債券関連

(単位:億円)

区分	種類	平成27年度末				平成28年度上半期末			
		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	4	—	0	0	9	—	△0	△0
	買建	—	—	—	—	—	—	—	—
合計					0				△0

(注) 「差損益」欄には、時価を記載しています。

6. その他

平成27年度末、平成28年度上半期末に該当の残高はありません。

3. 会社計

(1) 資産構成(会社計)

(単位:億円)

区分	平成28年度上半期末	
		うち一般勘定
現預金・コールローン	11,687	10,024
買現先勘定	—	—
買入金銭債権	3,566	3,566
商品有価証券	—	—
金銭の信託	10	10
公社債	232,884	227,614
株式	78,410	76,793
外国証券	180,074	177,227
貸付金	81,088	81,088
不動産	16,529	16,529
資産計	631,750	618,703
うち外貨建資産	163,582	160,666

(2) 売買目的有価証券の評価損益(会社計)

(単位:億円)

区分	平成27年度末		平成28年度上半期末	
	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	11,645	△944	11,114	△245

(注) 1. 売買目的有価証券に含まれる金銭の信託の貸借対照表計上額及び当期の損益に含まれた評価損益には、デリバティブ取引に係る差損益を含んでいます。

2. 売買目的有価証券に含まれる金銭の信託内で保有している現預金及びコールローンは含んでいません。

(3) 有価証券の時価情報(会社計) (売買目的有価証券以外の有価証券のうち時価のあるもの)

(単位:億円)

区分	平成27年度末					平成28年度上半期末				
	帳簿価額	時価	差損益			帳簿価額	時価	差損益		
			差益	差損				差益	差損	
責任準備金対応債券	205,613	250,527	44,914	44,914	△0	199,634	245,842	46,207	46,231	△23
満期保有目的の債券	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
子会社・関連会社株式	77	669	592	592	—	77	467	390	390	—
その他有価証券	226,222	291,383	65,161	67,305	△2,143	235,457	292,515	57,057	59,877	△2,819
公社債	29,911	32,596	2,684	2,696	△11	29,300	31,901	2,600	2,640	△39
株式	39,710	76,277	36,567	38,098	△1,531	39,428	72,577	33,149	34,826	△1,676
外国証券	136,128	160,169	24,040	24,536	△496	147,605	167,137	19,532	20,444	△912
公社債	114,806	133,533	18,727	19,032	△304	125,650	140,698	15,047	15,758	△710
株式等	21,322	26,636	5,313	5,504	△191	21,955	26,439	4,484	4,685	△201
その他の証券	12,913	14,781	1,867	1,972	△104	14,317	16,091	1,774	1,965	△191
買入金銭債権	254	255	1	1	△0	293	294	1	1	△0
譲渡性預金	7,303	7,302	△0	0	△0	4,512	4,512	0	0	△0
合 計	431,912	542,580	110,667	112,812	△2,144	435,169	538,825	103,656	106,499	△2,843
公社債	230,863	278,029	47,166	47,177	△11	225,014	273,448	48,434	48,497	△62
株式	39,710	76,277	36,567	38,098	△1,531	39,428	72,577	33,149	34,826	△1,676
外国証券	136,923	161,591	24,667	25,163	△496	148,332	168,284	19,952	20,864	△912
公社債	115,523	134,285	18,761	19,066	△304	126,299	141,376	15,077	15,787	△710
株式等	21,399	27,305	5,905	6,096	△191	22,032	26,907	4,875	5,076	△201
その他の証券	12,913	14,781	1,867	1,972	△104	14,317	16,091	1,774	1,965	△191
買入金銭債権	4,198	4,597	399	399	△0	3,565	3,910	345	345	△0
譲渡性預金	7,303	7,302	△0	0	△0	4,512	4,512	0	0	△0

(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。

○時価を把握することが極めて困難と認められる有価証券の帳簿価額は以下のとおりです。

(単位:億円)

区分	平成27年度末	平成28年度上半期末
責任準備金対応債券	—	—
満期保有目的の債券	—	—
非上場外国債券	—	—
その他	—	—
子会社・関連会社株式	6,920	6,399
その他有価証券	8,637	7,546
非上場国内株式(店頭売買株式を除く)	1,047	1,045
非上場外国株式(店頭売買株式を除く)	5,257	4,312
非上場外国債券	—	—
その他	2,333	2,188
合 計	15,558	13,945

(注) 時価を把握することが極めて困難と認められる有価証券のうち、外貨建資産について為替を評価した差損益は次のとおりです。
(平成27年度末:374億円、平成28年度上半期末:△177億円)

(4) 金銭の信託の時価情報(会社計)

(単位:億円)

区分	平成27年度末					平成28年度上半期末				
	貸借対照表 計上額	時価	差損益			貸借対照表 計上額	時価	差損益		
			差益	差損	差益			差損		
金銭の信託	19	19	—	—	—	10	10	—	—	—

(注) 1. 時価の算定は、金銭の信託の受託者が合理的に算出した価格によっています。

2. 貸借対照表計上額には、金銭の信託内で保有しているデリバティブ取引に係る差損益を含んでいます。

・運用目的の金銭の信託

(単位:億円)

区分	平成27年度末		平成28年度上半期末	
	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
運用目的の金銭の信託	19	△0	10	0

(注) 貸借対照表計上額及び当期の損益に含まれた評価損益には、デリバティブ取引に係る差損益を含んでいます。

・責任準備金対応、満期保有目的、その他の金銭の信託

平成27年度末、平成28年度上半期末に該当の残高はありません。

(5) デリバティブ取引の状況(会社計)

1. 差損益の内訳(ヘッジ会計適用分・非適用分の内訳)(平成28年度上半期末)

(単位:億円)

区分	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	149	2,069	△245	—	—	1,972
ヘッジ会計非適用分	0	△36	5	△0	—	△30
合計	149	2,032	△239	△0	—	1,942

(注) ヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ適用分の差損益、及びヘッジ会計非適用分のうちヘッジ会計の中止に伴う繰延ヘッジ損益の未償却額を除いた差損益は、損益計算書に計上しています。

2. ヘッジ会計が適用されていないもの

(a) 金利関連

(単位:億円)

区分	種類	平成27年度末				平成28年度上半期末			
		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	10	10	△0	△0	8	8	0	0
	固定金利支払/変動金利受取	25	25	△0	△0	—	—	—	—
合計				△0					0

(注) 「差損益」欄には、時価を記載しています。

(参考) 金利スワップ契約の残存期間別構成

(単位:億円、%)

残存期間		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	
平成 27 年度 末	固定金利受取 /変動金利支払 スワップ	想定元本	—	—	—	—	10	10	
		平均受取固定金利	—	—	—	—	0.16	0.16	
		平均支払変動金利	—	—	—	—	0.02	0.02	
	固定金利支払 /変動金利受取 スワップ	想定元本	—	—	—	—	15	10	25
		平均支払固定金利	—	—	—	—	0.25	0.16	0.21
		平均受取変動金利	—	—	—	—	0.03	0.02	0.03
平成 28 年度 上半 期末	固定金利受取 /変動金利支払 スワップ	想定元本	—	—	—	—	8	—	8
		平均受取固定金利	—	—	—	—	0.13	—	0.13
		平均支払変動金利	—	—	—	—	0.02	—	0.02
	固定金利支払 /変動金利受取 スワップ	想定元本	—	—	—	—	—	—	—
		平均支払固定金利	—	—	—	—	—	—	—
		平均受取変動金利	—	—	—	—	—	—	—

(b)通貨関連

(単位:億円)

区分	種類	平成27年度末				平成28年度上半期末			
		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	3,431	—	△49	△49	2,592	—	50	50
	米ドル	987	—	8	8	777	—	11	11
	ユーロ	375	—	△6	△6	249	—	1	1
	豪ドル	630	—	△11	△11	461	—	0	0
	ポンド	585	—	△5	△5	1,031	—	36	36
	買建	2,417	—	2	2	1,245	—	△9	△9
	米ドル	1,488	—	△3	△3	398	—	△1	△1
	ユーロ	199	—	2	2	120	—	△0	△0
	豪ドル	329	—	1	1	208	—	2	2
	ポンド	345	—	△0	△0	439	—	△10	△10
	通貨オプション								
	売建								
	コール	—	—	—	—	758	—	1	1
	米ドル	(—)	(—)	—	—	(2)	(—)	—	—
	ユーロ	—	—	—	—	758	—	1	1
	ポット	(—)	(—)	—	—	(2)	(—)	—	—
	米ドル	—	—	—	—	—	—	—	—
	ユーロ	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	買建								
	コール	—	—	—	—	—	—	—	—
	米ドル	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—
	ポット	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	米ドル	—	—	—	—	1,516	—	2	△6
	ユーロ	(—)	(—)	—	—	(9)	(—)	—	—
	ポット	—	—	—	—	1,516	—	2	△6
	ユーロ	(—)	(—)	—	—	(9)	(—)	—	—
	ポット	—	—	—	—	—	—	—	—
	通貨スワップ								
米ドル払/円受	727	727	△1	△1	1,554	1,554	△72	△72	
ユーロ払/円受	—	—	—	—	—	—	—	—	
円払/豪ドル受	—	—	—	—	—	—	—	—	
円払/豪ドル受	727	727	△1	△1	1,454	1,454	△71	△71	
合 計				△49				△36	

(注) 1. ()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、先渡取引及び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。

(c) 株式関連

(単位:億円)

区分	種類	平成27年度末				平成28年度上半期末			
		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	67	—	△0	△0	743	—	10	10
	買建	264	—	2	2	153	—	△0	△0
	株価指数オプション								
	売建								
	コール	—	—	—	—	—	—	—	—
	プット	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	買建								
	コール	—	—	—	—	—	—	—	—
	プット	(—)	(—)	—	—	851	—	42	△4
		(—)	(—)		(46)	(—)			
店頭	株式先渡契約								
	売建	—	—	△0	△0	—	—	—	—
	買建	—	—	—	—	—	—	—	—
	株価指数オプション								
	売建								
	コール	—	—	—	—	—	—	—	—
	プット	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	買建								
	コール	2	2	1	0	2	2	0	0
	プット	(0)	(0)	—	—	(0)	(0)	—	—
		(—)	(—)		(—)	(—)			
合計				1				5	

(注) 1.()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。

(d) 債券関連

(単位:億円)

区分	種類	平成27年度末				平成28年度上半期末			
		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	59	—	0	0	118	—	△0	△0
	買建	—	—	—	—	—	—	—	—
合計				0				△0	

(注)「差損益」欄には、時価を記載しています。

(e) その他

平成27年度末、平成28年度上半期末に該当の残高はありません。

3. ヘッジ会計が適用されているもの

(a) 金利関連

(単位:億円)

区分	ヘッジ 会計の 方法	種類	主な ヘッジ 対象	平成27年度末				平成28年度上半期末			
				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	繰延 ヘッジ	金利スワップ	保険 負債								
		固定金利受取/変動金利支払		1,750	1,750	70	70	2,500	2,500	148	148
		固定金利支払/変動金利受取	—	—	—	—	—	—	—	—	—
		金利スワップ	貸付金								
固定金利受取/変動金利支払	—	—		—	—	100	100	0	0		
		固定金利支払/変動金利受取	—	—	—	—	—	—	—	—	
合 計							70				149

(注) 「差損益」欄には、時価を記載しています。

(参考) 金利スワップ契約の残存期間別構成

(単位:億円、%)

残存期間			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
平成 27 年度 末	固定金利受取 /変動金利支払 スワップ	想定元本	—	—	—	—	—	1,750	1,750
		平均受取固定金利	—	—	—	—	—	0.79	0.79
		平均支払変動金利	—	—	—	—	—	0.02	0.02
	固定金利支払 /変動金利受取 スワップ	想定元本	—	—	—	—	—	—	—
		平均支払固定金利	—	—	—	—	—	—	—
		平均受取変動金利	—	—	—	—	—	—	—
平成 28 年度 上半 期末	固定金利受取 /変動金利支払 スワップ	想定元本	—	—	40	60	—	2,500	2,600
		平均受取固定金利	—	—	△0.05	△0.02	—	0.70	0.67
		平均支払変動金利	—	—	0.00	0.00	—	△0.00	△0.00
	固定金利支払 /変動金利受取 スワップ	想定元本	—	—	—	—	—	—	—
		平均支払固定金利	—	—	—	—	—	—	—
		平均受取変動金利	—	—	—	—	—	—	—

(b) 通貨関連

(単位:億円)

区分	ヘッジ 会計 の方法	種類	主な ヘッジ 対象	平成27年度末				平成28年度上半期末					
				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	時価 ヘッジ	為替予約	外貨建 債券										
		売建		73,244	—	1,162	1,162	98,882	—	2,272	2,272		
		米ドル		47,493	—	705	705	60,087	—	974	974		
		ユーロ		14,778	—	17	17	24,476	—	231	231		
		買建		—	—	—	—	—	—	—	—		
		米ドル		—	—	—	—	—	—	—	—		
		ユーロ		—	—	—	—	—	—	—	—		
		通貨オプション											
		売建											
		コール		—	—	—	—	—	—	—	—	—	
				(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	—	
		米ドル		—	—	—	—	—	—	—	—	—	
		ユーロ		(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	—	
		プット		—	—	—	—	—	—	—	—	—	
		米ドル		(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	—	
		ユーロ		—	—	—	—	—	—	—	—	—	
				(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	—	
		買建											
		コール		—	—	—	—	—	—	—	—	—	
				(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	—	
		米ドル		—	—	—	—	—	—	—	—	—	
		ユーロ		(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	—	
		プット		—	—	—	—	—	—	—	—	—	
		米ドル		(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	—	
		ユーロ		—	—	—	—	—	—	—	—	—	
				(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	—	
繰延 ヘッジ	繰延 ヘッジ	為替予約	外国株式 予定取引										
		売建		—	—	—	—	—	—	—	—		
		米ドル		—	—	—	—	—	—	—	—		
		ユーロ		—	—	—	—	—	—	—	—		
		買建		562	—	23	23	—	—	—	—		
		米ドル		—	—	—	—	—	—	—	—		
		ユーロ		—	—	—	—	—	—	—	—		
		通貨スワップ											
		米ドル払/円受		11,217	10,752	△1,813	△1,813	11,526	10,849	△203	△203		
		ユーロ払/円受		5,318	5,113	△1,060	△1,060	5,373	5,009	△336	△336		
ポンド払/円受	4,710	4,449	△777	△777	4,963	4,651	△125	△125					
	1,189	1,189	23	23	1,189	1,189	258	258					
合 計									△627		2,069		

(注) 1. ()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、先渡取引及び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。

(c) 株式関連

(単位:億円)

区分	ヘッジ会計の方法	種類	主なヘッジ対象	平成27年度末				平成28年度上半期末			
				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	時価ヘッジ	株式先渡契約	国内株式	2,044	—	△80	△80	5,418	—	△245	△245
		売建		—	—	—	—	—	—	—	—
合 計							△80				△245

(注) 「差損益」欄には、時価を記載しています。

(d) 債券関連

平成27年度末、平成28年度上半期末に該当の残高はありません。

(e) その他

平成27年度末、平成28年度上半期末に該当の残高はありません。