

平成27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 17

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26年度末、平成27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26年度上半期、平成27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26年度末		平成27年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
公社債	226,544	46.4	225,464	47.0
国債	184,852	37.9	185,856	38.8
地方債	14,394	2.9	13,877	2.9
社債 (うち公社・公団債)	27,297 (13,491)	5.6 (2.8)	25,731 (12,297)	5.4 (2.6)
株式	90,752	18.6	83,789	17.5
外国証券	161,449	33.1	159,321	33.2
公社債	120,772	24.7	122,980	25.6
株式等	40,676	8.3	36,341	7.6
その他の証券	9,593	2.0	11,034	2.3
合計	488,339	100.0	479,610	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 26 年度 末	国債	3,475	7,747	5,670	8,423	22,426	137,109	184,852
	地方債	712	4,664	2,775	123	74	6,044	14,394
	社債	2,181	5,265	3,563	983	2,288	13,014	27,297
	株式						90,752	90,752
	外国証券	2,437	10,029	11,870	14,125	14,264	108,722	161,449
	公社債	2,409	10,027	11,546	13,604	13,722	69,464	120,772
	株式等	28	2	323	520	542	39,257	40,676
	その他の証券	215	423	1,144	1,205	2,321	4,282	9,593
	買入金銭債権	420	—	21	186	426	3,932	4,987
	譲渡性預金	3,029	—	—	—	—	—	3,029
合計	12,473	28,130	25,044	25,047	41,802	363,859	496,357	
平成 27 年度 上半 期末	国債	4,029	5,604	5,528	10,863	21,335	138,495	185,856
	地方債	3,115	1,588	2,511	25	358	6,277	13,877
	社債	2,463	4,961	2,028	1,075	2,399	12,803	25,731
	株式						83,789	83,789
	外国証券	3,561	8,697	14,312	13,776	14,034	104,939	159,321
	公社債	3,539	8,598	14,005	13,349	13,375	70,111	122,980
	株式等	21	98	306	427	658	34,828	36,341
	その他の証券	197	451	1,779	915	3,829	3,860	11,034
	買入金銭債権	475	8	45	136	419	3,566	4,652
	譲渡性預金	2,699	—	—	—	—	—	2,699
合計	16,543	21,311	26,205	26,793	42,377	353,731	486,962	

③地域別地方債保有内訳

(単位:億円、%)

区分	平成26年度末		平成27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	93	0.6	71	0.5
関東	7,263	50.5	7,134	51.4
中部	3,108	21.6	3,017	21.7
近畿	186	1.3	120	0.9
中国	94	0.7	76	0.6
四国	—	—	—	—
九州	1,034	7.2	1,122	8.1
その他	2,592	18.0	2,311	16.7
合計	14,394	100.0	13,877	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26年度末		平成27年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
AAA	15,239	9.4	16,955	10.4
AA	112,625	69.3	108,702	66.9
A	19,905	12.3	21,358	13.1
BBB	8,898	5.5	10,033	6.2
BB以下	—	—	112	0.1
格付なし	5,794	3.6	5,426	3.3
合計	162,464	100.0	162,588	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26年度末:18兆4,852億円、平成27年度上半期末:18兆5,856億円)
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26年度末		平成27年度上半期末		
	金額	占率	金額	占率	
水産・農林業	29	0.0	27	0.0	
鉱業	62	0.1	51	0.1	
建設業	1,312	1.4	1,412	1.7	
製造業	食料品	3,209	3.5	3,224	3.8
	繊維製品	1,277	1.4	1,290	1.5
	パルプ・紙	236	0.3	247	0.3
	化学	8,268	9.1	6,943	8.3
	医薬品	8,065	8.9	7,576	9.0
	石油・石炭製品	234	0.3	221	0.3
	ゴム製品	1,147	1.3	1,003	1.2
	ガラス・土石製品	829	0.9	812	1.0
	鉄鋼	1,960	2.2	1,402	1.7
	非鉄金属	881	1.0	813	1.0
	金属製品	425	0.5	410	0.5
	機械	5,309	5.9	4,532	5.4
	電気機器	10,486	11.6	9,359	11.2
	輸送用機器	16,125	17.8	14,147	16.9
精密機器	1,464	1.6	1,302	1.6	
その他製品	986	1.1	1,034	1.2	
電気・ガス業	4,213	4.6	4,379	5.2	
運輸・情報通信業	陸運業	5,855	6.5	5,435	6.5
	海運業	103	0.1	81	0.1
	空運業	106	0.1	115	0.1
	倉庫・運輸関連業	151	0.2	121	0.1
	情報・通信業	1,162	1.3	1,546	1.8
商業	卸売業	2,906	3.2	2,677	3.2
	小売業	2,355	2.6	2,467	2.9
金融・保険業	銀行業	6,749	7.4	6,530	7.8
	証券、商品先物取引業	679	0.7	619	0.7
	保険業	1,585	1.7	1,611	1.9
	その他金融業	524	0.6	478	0.6
不動産業	519	0.6	478	0.6	
サービス業	1,525	1.7	1,433	1.7	
合計	90,752	100.0	83,789	100.0	

(3) 貸付金関係

① 貸付金明細表

(単位:億円)

区分	平成26年度末	平成27年度上半期末
保険約款貸付	7,365	7,183
保険料振替貸付	553	534
契約者貸付	6,812	6,649
一般貸付	76,210	75,622
企業貸付	56,087	55,825
国内	54,372	54,212
海外	1,715	1,613
国・国際機関・政府関係機関・ 公共団体・公企業貸付	5,486	5,279
国内	4,889	4,757
海外	596	522
住宅ローン	8,898	8,697
消費者ローン	4,987	4,888
その他	749	931
合 計	83,576	82,806
非居住者貸付	2,312	2,135

② 貸付金企業規模別内訳

(単位:件、億円、%)

区分		平成26年度末		平成27年度上半期末	
			占率		占率
大企業	貸付先数	950	39.9	944	38.9
	金額	48,453	89.1	48,341	89.2
中堅企業	貸付先数	320	13.4	326	13.4
	金額	744	1.4	786	1.5
中小企業	貸付先数	1,110	46.6	1,156	47.7
	金額	5,174	9.5	5,083	9.4
国内企業計	貸付先数	2,380	100.0	2,426	100.0
	金額	54,372	100.0	54,212	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26年度末		平成27年度上半期末	
		金額	占率	金額	占率
国内向け	製造業	14,095	18.5	14,051	18.6
	食料	1,012	1.3	1,136	1.5
	繊維	358	0.5	337	0.4
	木材・木製品	19	0.0	20	0.0
	パルプ・紙	768	1.0	771	1.0
	印刷	199	0.3	196	0.3
	化学	2,821	3.7	2,784	3.7
	石油・石炭	779	1.0	742	1.0
	窯業・土石	466	0.6	450	0.6
	鉄鋼	1,993	2.6	1,843	2.4
	非鉄金属	222	0.3	217	0.3
	金属製品	172	0.2	174	0.2
	はん用・生産用・業務用機械	1,355	1.8	1,366	1.8
	電気機械	1,413	1.9	1,552	2.1
	輸送用機械	2,067	2.7	2,013	2.7
	その他の製造業	446	0.6	442	0.6
	農業、林業	—	—	—	—
	漁業	20	0.0	20	0.0
	鉱業、採石業、砂利採取業	65	0.1	58	0.1
	建設業	432	0.6	406	0.5
	電気・ガス・熱供給・水道業	11,930	15.7	12,056	15.9
	情報通信業	1,746	2.3	1,726	2.3
運輸業、郵便業	7,144	9.4	6,996	9.3	
卸売業	9,004	11.8	9,046	12.0	
小売業	531	0.7	546	0.7	
金融業、保険業	6,206	8.1	6,103	8.1	
不動産業	3,978	5.2	4,110	5.4	
物品賃貸業	2,632	3.5	2,586	3.4	
学術研究、専門・技術サービス業	18	0.0	11	0.0	
宿泊業	40	0.1	38	0.1	
飲食業	37	0.0	36	0.0	
生活関連サービス業、娯楽業	257	0.3	252	0.3	
教育、学習支援業	18	0.0	17	0.0	
医療・福祉	11	0.0	9	0.0	
その他のサービス	40	0.1	82	0.1	
地方公共団体	1,799	2.4	1,742	2.3	
個人(住宅・消費・納税資金等)	13,889	18.2	13,587	18.0	
合 計	73,898	97.0	73,486	97.2	
海外向け	政府等	596	0.8	522	0.7
	金融機関	200	0.3	200	0.3
	商工業(等)	1,515	2.0	1,413	1.9
	合 計	2,312	3.0	2,135	2.8
総 合 計	76,210	100.0	75,622	100.0	

④貸付金担保別内訳

(単位:億円、%)

区分	平成26年度末		平成27年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
担保貸付	348	0.5	341	0.5
有価証券担保貸付	94	0.1	97	0.1
不動産・動産・財団担保貸付	179	0.2	177	0.2
指名債権担保貸付	74	0.1	66	0.1
保証貸付	1,997	2.6	2,074	2.7
信用貸付	59,978	78.7	59,620	78.8
その他	13,886	18.2	13,585	18.0
一般貸付計	76,210	100.0	75,622	100.0
うち劣後特約付貸付	2,400	3.1	2,150	2.8

⑤貸付金地域別内訳

(単位:億円、%)

区分	平成26年度末		平成27年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
北海道	663	1.2	666	1.2
東北	1,280	2.4	1,276	2.4
関東	35,212	64.8	35,142	64.8
中部	4,919	9.0	5,031	9.3
近畿	8,199	15.1	8,230	15.2
中国	1,384	2.5	1,348	2.5
四国	958	1.8	814	1.5
九州	1,752	3.2	1,701	3.1
合計	54,372	100.0	54,212	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26年度末						
固定金利	8,631	16,624	11,411	9,529	9,169	17,263	72,629
変動金利	307	630	793	465	410	973	3,580
一般貸付計	8,939	17,255	12,204	9,994	9,579	18,237	76,210
平成27年度上半期末							
固定金利	8,830	16,204	11,408	8,836	9,293	16,887	71,460
変動金利	342	941	938	579	433	926	4,162
一般貸付計	9,172	17,146	12,347	9,415	9,727	17,813	75,622

(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26年度末		平成27年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
公社債	112,127	66.6	114,556	68.4
株式	5,958	3.5	5,521	3.3
現預金・その他	21,701	12.9	19,708	11.8
小計	139,787	83.0	139,786	83.4

・円貨額が確定した外貨建資産

(単位:億円、%)

区分	平成26年度末		平成27年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
公社債	—	—	—	—
現預金・その他	2,317	1.4	2,538	1.5
小計	2,317	1.4	2,538	1.5

・円貨建資産

(単位:億円、%)

区分	平成26年度末		平成27年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
非居住者貸付	1,094	0.7	991	0.6
公社債(円建外債)・その他	25,152	14.9	24,222	14.5
小計	26,247	15.6	25,214	15.0

・合計

(単位:億円、%)

区分	平成26年度末		平成27年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
海外投融資	168,352	100.0	167,539	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26年度末		平成27年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
米ドル	81,305	58.2	82,150	58.8
ユーロ	28,095	20.1	28,718	20.5
イギリスポンド	17,511	12.5	17,517	12.5
オーストラリアドル	5,432	3.9	4,925	3.5
ポーランドズロチ	3,383	2.4	2,569	1.8
香港ドル	1,166	0.8	1,003	0.7
その他	2,892	2.1	2,901	2.1
合計	139,787	100.0	139,786	100.0

(注) 内訳は、平成27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		
平成26年度末	北米	67,036	41.5	62,708	51.9	4,327	10.6	1,267	54.8
	ヨーロッパ	52,772	32.7	45,913	38.0	6,858	16.9	530	22.9
	オセアニア	4,102	2.5	4,073	3.4	29	0.1	51	2.2
	アジア	5,352	3.3	2,570	2.1	2,782	6.8	10	0.4
	中南米	30,301	18.8	3,624	3.0	26,677	65.6	136	5.9
	中東	—	—	—	—	—	—	—	—
	アフリカ	—	—	—	—	—	—	51	2.2
	国際機関	1,882	1.2	1,882	1.6	—	—	265	11.5
	合計	161,449	100.0	120,772	100.0	40,676	100.0	2,312	100.0
平成27年度上半期末	北米	67,906	42.6	63,736	51.8	4,170	11.5	1,204	56.4
	ヨーロッパ	52,793	33.1	46,619	37.9	6,173	17.0	430	20.1
	オセアニア	4,396	2.8	4,372	3.6	23	0.1	49	2.3
	アジア	5,219	3.3	2,633	2.1	2,586	7.1	36	1.7
	中南米	27,157	17.0	3,769	3.1	23,387	64.4	101	4.8
	中東	—	—	—	—	—	—	—	—
	アフリカ	—	—	—	—	—	—	47	2.2
	国際機関	1,848	1.2	1,848	1.5	—	—	265	12.4
	合計	159,321	100.0	122,980	100.0	36,341	100.0	2,135	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26年度末		平成27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
金利スワップ等	—	—	1,015	10
通貨スワップ	9,564	649	10,626	738
為替予約	62,579	1,998	62,332	1,056
金利オプション(買)	—	—	—	—
通貨オプション(買)	—	—	—	—
その他の金融派生商品	408	29	23	2
合 計	72,552	2,678	73,998	1,807

(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]

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T T M、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、外貨建債券等の一部に対する為替変動リスクのヘッジとして時価ヘッジ及び繰延ヘッジ、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、外貨建債権の一部について為替予約及び通貨スワップの振当処理、外貨建劣後特約付社債について通貨スワップの振当処理、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)に基づく繰延ヘッジを適用しております。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27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	△7	△3,000	0	—	—	△3,008
ヘッジ会計非適用分	0	3	0	—	—	3
合計	△7	△2,997	0	—	—	△3,004

(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26年度末			平成27年度上半期末		
		契約額等	時価	差損益	契約額等	時価	差損益
店頭	金利スワップ						
	固定金利受取/変動金利支払	—	—	—	515	515	△7
	固定金利支払/変動金利受取	—	—	—	500	500	0
合計							△7

(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26年度末	固定金利受取/変動金利支払スワップ	想定元本	—	—	—	—	—	—
		平均受取固定金利	—	—	—	—	—	—
		平均支払変動金利	—	—	—	—	—	—
	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27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	—	—	—	10	505	515
		平均受取固定金利	—	—	—	0.60	1.21	1.20
		平均支払変動金利	—	—	—	0.13	0.12	0.12
	固定金利支払/変動金利受取スワップ	想定元本	—	500	—	—	—	500
		平均支払固定金利	—	0.10	—	—	—	0.10
		平均受取変動金利	—	0.13	—	—	—	0.13

3. 通貨関連

(単位:億円)

区分	種類	平成26年度末				平成27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	63,636	—	1,088	1,088	62,280	—	23	23
	米ドル	39,267	—	△10	△10	40,277	—	191	191
	ユーロ	11,776	—	806	806	12,150	—	△188	△188
	買建	32	—	0	0	75	—	0	0
	米ドル	31	—	0	0	43	—	0	0
	ユーロ	0	—	0	0	—	—	—	—
	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	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	通貨スワップ								
	米ドル	9,564	9,376	△3,245	△3,245	10,626	10,488	△3,021	△3,021
	ユーロ	4,552	4,462	△1,685	△1,685	4,977	4,838	△1,649	△1,649
	ユーロ	3,982	3,885	△1,310	△1,310	4,388	4,388	△1,138	△1,138
	合計				△2,156				△2,997

(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26年度末				平成27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	株式先渡契約								
	売建	407	—	△1	△1	21	—	0	0
	買建	—	—	—	—	—	—	—	—
	株式オプション								
	売建								
	コール	—	—	—	—	—	—	—	—
	プット	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	買建								
	コール	2	2	1	0	2	2	1	0
	プット	(0)	(0)	—	—	(0)	(0)	—	—
合計	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	0

(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26年度末、平成27年度上半期末に該当の残高はありません。

6. その他

平成26年度末、平成27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26年度末		平成27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	1,194	96	1,040	△128

(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27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	△2	0	—	△2
合計	—	△0	△2	0	—	△2

(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26年度末、平成27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26年度末				平成27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	53	—	△0	△0	33	—	0	0
	米ドル	12	—	△0	△0	7	—	△0	△0
	ユーロ	30	—	△0	△0	16	—	0	0
	買建	75	—	△0	△0	67	—	△0	△0
	米ドル	46	—	△0	△0	44	—	△0	△0
	ユーロ	20	—	0	0	15	—	△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26年度末				平成27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	22	—	△0	△0	—	—	—	—
	買建	21	—	0	0	56	—	△2	△2
合計				0					△2

(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26年度末				平成27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	—	—	—	—	11	—	0	0
	買建	—	—	—	—	—	—	—	—
合計				—					0

(注) 「差損益」欄には、時価を記載しています。

6. その他

平成26年度末、平成27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27年度上半期末	
		うち一般勘定
現預金・コールローン	16,455	15,413
買現先勘定	—	—
買入金銭債権	4,652	4,652
商品有価証券	—	—
金銭の信託	—	—
公社債	232,232	225,464
株式	85,808	83,789
外国証券	162,078	159,321
貸付金	82,806	82,806
不動産	16,921	16,921
資産計	620,493	606,265
うち外貨建資産	142,704	139,786

(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26年度末		平成27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	10,052	443	12,693	△767

(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26年度末					平成27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	206,738	232,924	26,185	26,189	△4	204,223	230,046	25,823	25,825	△2
満期保有目的の債券	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
子会社・関連会社株式	77	374	297	297	—	77	350	273	273	—
その他有価証券	193,376	277,227	83,850	84,192	△342	200,113	270,606	70,493	71,384	△891
公社債	23,553	25,123	1,569	1,577	△8	24,618	26,134	1,516	1,517	△1
株式	39,445	89,364	49,919	50,152	△233	39,752	82,343	42,590	42,982	△392
外国証券	118,896	150,095	31,198	31,295	△96	122,875	148,280	25,404	25,853	△449
公社債	97,520	120,054	22,534	22,550	△16	102,759	122,262	19,502	19,725	△222
株式等	21,376	30,041	8,664	8,744	△79	20,116	26,018	5,901	6,128	△226
その他の証券	8,062	9,224	1,162	1,167	△4	9,689	10,671	982	1,030	△48
買入金銭債権	388	388	0	0	△0	477	477	0	0	△0
譲渡性預金	3,030	3,029	△0	0	△0	2,700	2,699	△0	0	△0
合 計	400,192	510,526	110,333	110,680	△347	404,413	501,003	96,589	97,483	△893
公社債	224,975	252,330	27,354	27,366	△11	223,948	250,910	26,962	26,965	△2
株式	39,445	89,364	49,919	50,152	△233	39,752	82,343	42,590	42,982	△392
外国証券	119,692	151,229	31,537	31,633	△96	123,671	149,384	25,713	26,162	△449
公社債	98,238	120,813	22,574	22,591	△16	103,477	123,016	19,539	19,761	△222
株式等	21,453	30,415	8,962	9,041	△79	20,193	26,368	6,174	6,401	△226
その他の証券	8,062	9,224	1,162	1,167	△4	9,689	10,671	982	1,030	△48
買入金銭債権	4,987	5,347	359	360	△0	4,652	4,993	341	341	△0
譲渡性預金	3,030	3,029	△0	0	△0	2,700	2,699	△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26年度末	平成27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	2,928	3,021
その他有価証券	8,997	8,638
非上場国内株式(店頭売買株式を除く)	1,010	1,057
非上場外国株式(店頭売買株式を除く)	5,874	5,274
非上場外国債券	—	—
その他	2,113	2,306
合 計	11,926	11,660

(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26年度末:821億円、平成27年度上半期末:712億円)

(4) 金銭の信託の時価情報(会社計)

平成26年度末、平成27年度上半期末に該当の残高はありません。

・運用目的の金銭の信託

平成26年度末、平成27年度上半期末に該当の残高はありません。

・責任準備金対応、満期保有目的、その他の金銭の信託

平成26年度末、平成27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27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	△7	△3,000	0	—	—	△3,008
ヘッジ会計非適用分	0	8	△1	0	—	7
合計	△7	△2,991	△0	0	—	△3,000

(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26年度末			平成27年度上半期末		
		契約額等	時価	差損益	契約額等	時価	差損益
店頭	金利スワップ						
	固定金利受取/変動金利支払スワップ	—	—	—	15	15	△0
	固定金利支払/変動金利受取	—	—	—	500	500	0
合計			—			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26年度末	固定金利受取/変動金利支払スワップ	想定元本	—	—	—	—	—	—	
		平均受取固定金利	—	—	—	—	—	—	
		平均支払変動金利	—	—	—	—	—	—	
	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27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	—	—	—	10	5	15	
		平均受取固定金利	—	—	—	0.60	1.16	0.79	
		平均支払変動金利	—	—	—	0.13	0.12	0.13	
	固定金利支払/変動金利受取スワップ	想定元本	—	500	—	—	—	—	500
		平均支払固定金利	—	0.10	—	—	—	—	0.10
		平均受取変動金利	—	0.13	—	—	—	—	0.13

(b)通貨関連

(単位:億円)

区分	種類	平成26年度末				平成27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	1,287	—	15	15	1,699	—	17	17
	米ドル	319	—	0	0	567	—	2	2
	ユーロ	528	—	8	8	228	—	3	3
	買建	1,015	—	△10	△10	651	—	△3	△3
	米ドル	387	—	△2	△2	318	—	△1	△1
	ユーロ	310	—	△3	△3	143	—	△1	△1
	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	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	通貨スワップ								
米ドル	—	—	—	—	88	88	△5	△5	
ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—	
豪ドル	—	—	—	—	88	88	△5	△5	
合計				5				8	

(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26年度末				平成27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
取引所	株価指数先物								
	売建	226	—	△2	△2	181	—	2	2
	買建	71	—	0	0	149	—	△4	△4
店頭	株式先渡契約								
	売建	—	—	—	—	—	—	△0	△0
	買建	—	—	—	—	—	—	—	—
	株式オプション								
	売建								
	コール	—	—	—	—	—	—	—	—
	プット	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	買建								
	コール	2	2	1	0	2	2	1	0
	プット	(0)	(0)	—	—	(0)	(0)	—	—
合計				△0				△1	

(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、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。

(d) 債券関連

(単位:億円)

区分	種類	平成26年度末				平成27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
取引所	債券先物								
	売建	—	—	—	—	180	—	0	0
	買建	—	—	—	—	—	—	—	—
合計				—				0	

(注) 「差損益」欄には、時価を記載しています。

(e) その他

平成26年度末、平成27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26年度末			平成27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 固定金利支払/変動金利受取		-	-	-	-	500	500	△7	△7
合 計				-	-	-	-	-	-	△7	

(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 26 年度 末	固定金利受取 /変動金利支払 スワップ	想定元本	-	-	-	-	-	-
		平均受取固定金利	-	-	-	-	-	-
		平均支払変動金利	-	-	-	-	-	-
	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 27 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	-	-	-	-	500	500
		平均受取固定金利	-	-	-	-	1.21	1.21
		平均支払変動金利	-	-	-	-	0.12	0.12
	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26年度末				平成27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		63,597	—	1,089	1,089	61,374	—	15	15		
		米ドル		39,232	—	△9	△9	39,967	—	189	189		
		ユーロ		11,776	—	806	806	12,150	—	△188	△188		
		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		通貨スワップ	外貨建債券	9,564	9,376	△3,245	△3,245	10,538	10,399	△3,015	△3,015
	米ドル		4,552	4,462	△1,685	△1,685	4,977	4,838	△1,649	△1,649			
	ユーロ		3,982	3,885	△1,310	△1,310	4,388	4,388	△1,138	△1,138			
合計						△2,156				△3,000			

(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26年度末				平成27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	株式先渡契約	株式等	407	—	△1	△1	21	—	0	0		
	売建			—	—	—	—	—	—	—			
	買建			—	—	—	—	—	—	—			
合計						△1				0			

(注) 「差損益」欄には、時価を記載しています。

(d) 債券関連

平成26年度末、平成27年度上半期末に該当の残高はありません。

(e) その他

平成26年度末、平成27年度上半期末に該当の残高はありません。