

2017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

2016年度末、2017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

2016年度上半期、2017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	2016年度末		2017年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
公社債	224,601	43.3	222,501	41.4
国債	192,586	37.1	191,947	35.7
地方債	9,568	1.8	9,016	1.7
社債	22,446	4.3	21,537	4.0
(うち公社・公団債)	(9,201)	(1.8)	(8,535)	(1.6)
株式	86,952	16.8	90,624	16.9
外国証券	188,550	36.3	202,666	37.7
公社債	143,794	27.7	153,460	28.5
株式等	44,756	8.6	49,205	9.2
その他の証券	18,610	3.6	21,877	4.1
合計	518,715	100.0	537,669	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
2016年度末	有価証券	10,037	20,621	23,200	25,325	67,378	372,151	518,715
	国債	3,188	4,841	7,913	11,414	33,587	131,641	192,586
	地方債	542	2,152	70	183	904	5,714	9,568
	社債	2,055	3,566	1,116	1,647	3,069	10,990	22,446
	株式						86,952	86,952
	外国証券	3,776	8,630	12,630	11,166	21,291	131,055	188,550
	公社債	3,767	8,384	12,267	10,884	20,691	87,799	143,794
	株式等	9	246	362	281	600	43,255	44,756
	その他の証券	474	1,429	1,469	914	8,524	5,797	18,610
	買入金銭債権	359	—	76	78	200	2,547	3,262
	譲渡性預金	6,976	—	—	—	—	—	6,976
	合計	17,373	20,621	23,277	25,403	67,579	374,699	528,954
2017年度上半期末	有価証券	8,512	21,140	25,543	28,342	74,316	379,814	537,669
	国債	2,034	4,265	9,976	13,779	33,347	128,544	191,947
	地方債	357	1,789	41	200	896	5,730	9,016
	社債	2,703	1,978	1,208	1,640	3,954	10,053	21,537
	株式						90,624	90,624
	外国証券	2,968	11,457	13,045	11,554	23,819	139,821	202,666
	公社債	2,880	11,227	12,746	11,269	23,223	92,111	153,460
	株式等	87	229	298	284	596	47,709	49,205
	その他の証券	448	1,649	1,272	1,168	12,299	5,039	21,877
	買入金銭債権	329	20	43	62	153	2,370	2,980
	譲渡性預金	6,654	—	—	—	—	—	6,654
	合計	15,496	21,160	25,586	28,404	74,470	382,185	547,303

③地域別地方債保有内訳

(単位:億円、%)

区分	2016年度末		2017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	1	0.0	1	0.0
関東	5,458	57.0	5,301	58.8
中部	2,161	22.6	2,115	23.5
近畿	217	2.3	217	2.4
中国	98	1.0	97	1.1
四国	—	—	—	—
九州	991	10.4	990	11.0
その他	616	6.4	268	3.0
合計	9,568	100.0	9,016	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	2016年度末		2017年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
AAA	16,900	9.6	17,970	9.8
AA	118,765	67.6	123,247	67.0
A	24,854	14.1	25,112	13.6
BBB	12,146	6.9	14,991	8.1
BB以下	146	0.1	117	0.1
格付なし	2,997	1.7	2,573	1.4
合計	175,809	100.0	184,014	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。(2016年度末:19兆2,586億円、2017年度上半期末:19兆1,947億円)
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	2016年度末		2017年度上半期末		
	金額	占率	金額	占率	
水産・農林業	44	0.1	39	0.0	
鉱業	13	0.0	13	0.0	
建設業	1,437	1.7	1,631	1.8	
製造業	食料品	3,280	3.8	3,317	3.7
	繊維製品	1,224	1.4	1,306	1.4
	パルプ・紙	258	0.3	272	0.3
	化学	8,547	9.8	9,226	10.2
	医薬品	7,371	8.5	7,602	8.4
	石油・石炭製品	242	0.3	244	0.3
	ゴム製品	982	1.1	1,068	1.2
	ガラス・土石製品	864	1.0	851	0.9
	鉄鋼	1,428	1.6	1,478	1.6
	非鉄金属	854	1.0	871	1.0
	金属製品	474	0.5	485	0.5
	機械	5,317	6.1	5,640	6.2
	電気機器	9,876	11.4	11,042	12.2
	輸送用機器	13,093	15.1	13,299	14.7
精密機器	1,143	1.3	1,141	1.3	
その他製品	1,003	1.2	1,054	1.2	
電気・ガス業	3,617	4.2	3,781	4.2	
運輸・情報通信業	陸運業	5,340	6.1	5,415	6.0
	海運業	88	0.1	83	0.1
	空運業	117	0.1	139	0.2
	倉庫・運輸関連業	94	0.1	112	0.1
	情報・通信業	2,176	2.5	2,267	2.5
商業	卸売業	2,832	3.3	3,025	3.3
	小売業	2,401	2.8	2,484	2.7
金融・保険業	銀行業	5,435	6.3	5,235	5.8
	証券、商品先物取引業	581	0.7	571	0.6
	保険業	4,424	5.1	4,340	4.8
	その他金融業	486	0.6	523	0.6
不動産業	422	0.5	427	0.5	
サービス業	1,473	1.7	1,626	1.8	
合計	86,952	100.0	90,624	100.0	

(3) 貸付金関係

① 貸付金明細表

(単位:億円)

区分	2016年度末	2017年度上半期末
保険約款貸付	6,547	6,353
保険料振替貸付	466	451
契約者貸付	6,080	5,902
一般貸付	70,948	70,169
企業貸付	53,034	52,600
国内	51,815	51,581
海外	1,219	1,018
国・国際機関・政府関係機関・ 公共団体・公企業貸付	4,488	4,614
国内	4,124	4,290
海外	364	324
住宅ローン	7,927	7,909
消費者ローン	4,226	4,055
その他	1,270	989
合 計	77,495	76,523
非居住者貸付	1,583	1,343

② 貸付金企業規模別内訳

(単位:件、億円、%)

区分		2016年度末		2017年度上半期末	
			占率		占率
大企業	貸付先数	889	35.5	875	36.4
	金額	45,233	87.3	45,034	87.3
中堅企業	貸付先数	347	13.9	329	13.7
	金額	758	1.5	779	1.5
中小企業	貸付先数	1,268	50.6	1,202	50.0
	金額	5,823	11.2	5,766	11.2
国内企業計	貸付先数	2,504	100.0	2,406	100.0
	金額	51,815	100.0	51,581	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		2016年度末		2017年度上半期末	
		金額	占率	金額	占率
国内向け	製造業	12,959	18.3	12,384	17.6
	食料	1,044	1.5	1,025	1.5
	繊維	336	0.5	229	0.3
	木材・木製品	26	0.0	26	0.0
	パルプ・紙	727	1.0	678	1.0
	印刷	177	0.3	175	0.2
	化学	2,535	3.6	2,484	3.5
	石油・石炭	726	1.0	801	1.1
	窯業・土石	425	0.6	425	0.6
	鉄鋼	1,966	2.8	1,864	2.7
	非鉄金属	191	0.3	182	0.3
	金属製品	144	0.2	104	0.1
	はん用・生産用・業務用機械	1,366	1.9	1,297	1.8
	電気機械	1,214	1.7	1,159	1.7
	輸送用機械	1,763	2.5	1,631	2.3
	その他の製造業	310	0.4	297	0.4
	農業、林業	—	—	—	—
	漁業	20	0.0	20	0.0
	鉱業、採石業、砂利採取業	50	0.1	48	0.1
	建設業	352	0.5	333	0.5
	電気・ガス・熱供給・水道業	11,592	16.3	11,902	17.0
	情報通信業	1,549	2.2	1,533	2.2
	運輸業、郵便業	6,608	9.3	6,444	9.2
	卸売業	8,627	12.2	8,322	11.9
	小売業	574	0.8	567	0.8
	金融業、保険業	5,623	7.9	5,913	8.4
	不動産業	4,155	5.9	4,441	6.3
物品賃貸業	2,476	3.5	2,616	3.7	
学術研究、専門・技術サービス業	16	0.0	11	0.0	
宿泊業	153	0.2	153	0.2	
飲食業	32	0.0	31	0.0	
生活関連サービス業、娯楽業	646	0.9	400	0.6	
教育、学習支援業	17	0.0	17	0.0	
医療・福祉	12	0.0	12	0.0	
その他のサービス	155	0.2	155	0.2	
地方公共団体	1,586	2.2	1,550	2.2	
個人(住宅・消費・納税資金等)	12,155	17.1	11,965	17.1	
合 計	69,364	97.8	68,825	98.1	
海外向け	政府等	364	0.5	324	0.5
	金融機関	100	0.1	—	—
	商工業(等)	1,119	1.6	1,018	1.5
	合 計	1,583	2.2	1,343	1.9
総 合 計	70,948	100.0	70,169	100.0	

④貸付金担保別内訳

(単位:億円、%)

区分	2016年度末		2017年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
担保貸付	364	0.5	348	0.5
有価証券担保貸付	90	0.1	86	0.1
不動産・動産・財団担保貸付	184	0.3	181	0.3
指名債権担保貸付	89	0.1	80	0.1
保証貸付	1,759	2.5	1,941	2.8
信用貸付	56,669	79.9	55,914	79.7
その他	12,154	17.1	11,965	17.1
一般貸付計	70,948	100.0	70,169	100.0
うち劣後特約付貸付	2,651	3.7	2,596	3.7

⑤貸付金地域別内訳

(単位:億円、%)

区分	2016年度末		2017年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
北海道	653	1.3	664	1.3
東北	1,206	2.3	1,269	2.5
関東	33,709	65.1	34,422	66.7
中部	4,653	9.0	4,264	8.3
近畿	8,230	15.9	7,622	14.8
中国	1,138	2.2	1,103	2.1
四国	703	1.4	711	1.4
九州	1,519	2.9	1,522	3.0
合計	51,815	100.0	51,581	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
	2016年度末						
固定金利	9,478	12,805	11,012	7,866	8,613	16,470	66,247
変動金利	587	946	1,166	596	429	974	4,700
一般貸付計	10,065	13,752	12,178	8,463	9,042	17,445	70,948
2017年度上半期末							
固定金利	9,046	12,553	10,851	7,311	8,608	16,632	65,003
変動金利	539	921	1,063	644	911	1,085	5,166
一般貸付計	9,585	13,474	11,914	7,955	9,520	17,718	70,169

(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	2016年度末		2017年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
公社債	139,010	71.0	149,762	70.8
株式	8,177	4.2	8,554	4.0
現預金・その他	23,174	11.8	27,027	12.8
小計	170,361	87.0	185,345	87.6

・円貨額が確定した外貨建資産

(単位:億円、%)

区分	2016年度末		2017年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
公社債	—	—	—	—
現預金・その他	2,484	1.3	2,932	1.4
小計	2,484	1.3	2,932	1.4

・円貨建資産

(単位:億円、%)

区分	2016年度末		2017年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
非居住者貸付	588	0.3	536	0.3
公社債(円建外債)・その他	22,480	11.5	22,848	10.8
小計	23,069	11.8	23,384	11.0

・合計

(単位:億円、%)

区分	2016年度末		2017年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
海外投融資	195,915	100.0	211,661	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	2016年度末		2017年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
米ドル	105,147	61.7	109,625	59.1
ユーロ	36,015	21.1	43,742	23.6
イギリスポンド	13,797	8.1	14,512	7.8
オーストラリアドル	6,548	3.8	7,305	3.9
カナダドル	4,271	2.5	4,548	2.5
インドルピー	1,362	0.8	1,429	0.8
その他	3,218	1.9	4,180	2.3
合計	170,361	100.0	185,345	100.0

(注) 内訳は、2017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		
2016年度末	北米	89,361	47.4	84,093	58.5	5,267	11.8	1,020	64.4
	ヨーロッパ	52,880	28.0	47,147	32.8	5,732	12.8	300	18.9
	オセアニア	7,210	3.8	5,389	3.7	1,821	4.1	—	—
	アジア	5,837	3.1	2,618	1.8	3,218	7.2	34	2.2
	中南米	31,241	16.6	2,526	1.8	28,715	64.2	88	5.6
	中東	—	—	—	—	—	—	—	—
	アフリカ	—	—	—	—	—	—	—	—
	国際機関	2,019	1.1	2,019	1.4	—	—	140	8.8
	合計	188,550	100.0	143,794	100.0	44,756	100.0	1,583	100.0
2017年度上半期末	北米	90,792	44.8	85,404	55.7	5,387	10.9	932	69.4
	ヨーロッパ	60,519	29.9	54,209	35.3	6,310	12.8	200	14.9
	オセアニア	7,541	3.7	5,728	3.7	1,812	3.7	—	—
	アジア	6,085	3.0	2,580	1.7	3,504	7.1	34	2.6
	中南米	35,325	17.4	3,134	2.0	32,191	65.4	76	5.7
	中東	—	—	—	—	—	—	—	—
	アフリカ	—	—	—	—	—	—	—	—
	国際機関	2,402	1.2	2,402	1.6	—	—	100	7.4
	合計	202,666	100.0	153,460	100.0	49,205	100.0	1,343	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（店頭デリバティブ取引）

（単位：億円）

	2016年度末		2017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	3,540	122	4,620	149
通貨スワップ	13,472	1,484	13,708	1,292
為替予約	95,480	2,353	102,121	1,035
株式先渡契約	2,766	179	2,494	159
株式オプション（買）	2	1	3	1
通貨オプション（買）	—	—	—	—
その他の金融派生商品	—	—	—	—
合 計	115,261	4,140	122,947	2,638

（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]

主に期末日の清算値または終値、外部情報ベンダーより入手した評価額

[為替予約取引、通貨オプション取引]

主に外部情報ベンダーより入手した評価額

[金利スワップ取引、通貨スワップ取引]

主に外部情報ベンダーより入手した評価額

[株式先渡取引]

主に外部情報ベンダーより入手した評価額

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、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)

(単位:億円)

区分	2016年度末						2017年度上半期末					
	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	△38	50	△648	—	—	△637	△40	△4,423	△150	—	—	△4,614
ヘッジ会計非適用分	—	62	△67	—	—	△4	—	146	△56	—	—	89
合計	△38	112	△715	—	—	△641	△40	△4,277	△206	—	—	△4,524

(注)ヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ適用分の差損益(2016年度末:通貨関連917億円、株式関連△648億円、2017年度上半期末:通貨関連△2,905億円、株式関連△150億円)、及び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

(単位:億円)

区分	種類	2016年度末				2017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	3,540	3,540	△38	△38	4,620	4,620	△40	△40
	固定金利支払/変動金利受取	—	—	—	—	—	—	—	—
合計				△38					△40

(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	
2016年度末	固定金利受取/変動金利支払スワップ	想定元本	—	—	40	60	—	3,440	3,540
		平均受取固定金利	—	—	△0.05	△0.02	—	0.70	0.68
		平均支払変動金利	—	—	0.03	0.03	—	0.04	0.04
	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	—	—	—	—	—	—	—
2017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	—	4,520	4,620
		平均受取固定金利	—	—	△0.05	△0.02	—	0.69	0.68
		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	—	—	—	—	—	—	—

3. 通貨関連

(単位:億円)

区分	種類	2016年度末				2017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	96,296	—	921	921	98,637	—	△2,924	△2,924
	米ドル	54,377	—	427	427	51,835	—	△1,119	△1,119
	ユーロ	27,275	—	223	223	31,636	—	△937	△937
	買建	104	—	0	0	559	—	0	0
	米ドル	77	—	0	0	348	—	△0	△0
	ユーロ	—	—	—	—	206	—	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									
	13,472	13,052	△809	△809	13,708	13,270	△1,353	△1,353	
米ドル払/円受	5,323	4,956	△834	△834	5,171	4,853	△824	△824	
ユーロ払/円受	4,712	4,660	△212	△212	4,699	4,580	△778	△778	
円払/豪ドル受	2,104	2,104	53	53	2,506	2,506	163	163	
合計				112				△4,277	

(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	2016年度末				2017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	—	—	—	—	289	—	△16	△16
	買建	—	—	—	—	—	—	—	—
	株価指数オプション								
	売建								
	コール	—	—	—	—	—	—	—	—
	プット	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	買建	—	—	—	—	1,730	712	20	5
	コール	(—)	(—)	—	—	(26)	(17)	—	—
	プット	2,548	567	51	△65	1,730	712	30	△44
		(116)	(40)		(75)	(36)			
店頭	株式先渡契約								
	売建	2,146	—	△651	△651	2,363	—	△152	△152
	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	3	3	1	1
	プット	(0)	(0)	—	—	(0)	(0)	—	—
	—	—	—	—	—	—	—	—	
	(—)	(—)			(—)	(—)			
合計				△715				△206	

(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

2016年度末、2017年度上半期末に該当の残高はありません。

6. その他

2016年度末、2017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	2016年度末		2017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	1,039	55	1,064	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)

(単位:億円)

区分	2016年度末						2017年度上半期末					
	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	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ヘッジ会計非適用分	-	0	0	0	-	0	-	0	△0	0	-	△0
合計	-	0	0	0	-	0	-	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

2016年度末、2017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	2016年度末				2017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	76	-	0	0	97	-	△0	△0		
	米ドル	26	-	△0	△0	31	-	△0	△0		
	ユーロ	34	-	0	0	40	-	△0	△0		
	買建	80	-	△0	△0	81	-	0	0		
	米ドル	43	-	△0	△0	42	-	0	0		
	ユーロ	27	-	△0	△0	19	-	△0	△0		
合計									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	2016年度末				2017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	22	-	0	0	21	-	△0	△0		
	買建	15	-	0	0	-	-	-	-		
合計									△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	2016年度末				2017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	円貨建債券先物										
	売建	21	-	0	0	30	-	0	0		
	買建	-	-	-	-	-	-	-	-		
	外貨建債券先物										
	売建	-	-	-	-	-	-	-	-		
	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

2016年度末、2017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	2017年度上半期末	
		うち一般勘定
現預金・コールローン	12,001	9,630
買現先勘定	—	—
買入金銭債権	2,980	2,980
商品有価証券	—	—
金銭の信託	54	54
公社債	227,527	222,501
株式	92,363	90,624
外国証券	206,344	202,666
貸付金	76,523	76,523
不動産	15,985	15,985
資産計	664,930	650,856
うち外貨建資産	189,224	185,345

(2) 売買目的有価証券の評価損益(会社計)

(単位:億円)

区分	2016年度末		2017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	11,563	94	11,294	242

(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	2016年度末					2017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	196,592	233,314	36,721	36,823	△101	193,670	229,851	36,180	36,261	△80
満期保有目的の債券	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
子会社・関連会社株式	142	875	733	733	—	142	912	770	770	—
その他有価証券	253,308	316,587	63,279	67,020	△3,741	266,798	337,463	70,665	73,256	△2,591
公社債	29,547	31,428	1,881	1,945	△64	29,812	31,768	1,956	2,004	△47
株式	40,273	83,215	42,942	43,879	△937	40,629	86,830	46,200	47,154	△953
外国証券	159,325	176,343	17,018	19,524	△2,506	169,505	190,416	20,911	22,337	△1,426
公社債	132,366	143,245	10,878	13,214	△2,336	139,849	153,140	13,291	14,613	△1,321
株式等	26,958	33,098	6,140	6,310	△169	29,655	37,276	7,620	7,724	△104
その他の証券	16,794	18,231	1,436	1,669	△232	19,834	21,430	1,595	1,759	△163
買入金銭債権	391	392	0	0	△0	362	362	0	0	△0
譲渡性預金	6,976	6,976	0	0	△0	6,654	6,654	0	0	△0
合 計	450,043	550,777	100,734	104,577	△3,842	460,611	568,227	107,616	110,288	△2,672
公社債	222,720	261,025	38,304	38,470	△166	220,544	258,420	37,875	38,004	△128
株式	40,273	83,215	42,942	43,879	△937	40,629	86,830	46,200	47,154	△953
外国証券	160,008	177,781	17,773	20,279	△2,506	169,958	191,658	21,699	23,126	△1,426
公社債	132,916	143,816	10,899	13,235	△2,336	140,169	153,478	13,309	14,631	△1,321
株式等	27,091	33,965	6,873	7,043	△169	29,789	38,179	8,390	8,495	△104
その他の証券	16,803	18,240	1,436	1,669	△232	19,844	21,440	1,596	1,759	△163
買入金銭債権	3,261	3,539	277	277	△0	2,979	3,224	244	244	△0
譲渡性預金	6,976	6,976	0	0	△0	6,654	6,654	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	2016年度末	2017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	8,234	8,397
その他有価証券	7,243	7,406
非上場国内株式(店頭売買株式を除く)	551	549
非上場外国株式(店頭売買株式を除く)	4,282	4,170
非上場外国債券	—	—
その他	2,410	2,687
合 計	15,478	15,804

(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。
(2016年度末:467億円、2017年度上半期末:604億円)

(4) 金銭の信託の時価情報(会社計)

(単位:億円)

区分	2016年度末					2017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	33	33	—	—	—	54	54	—	—	—

(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	2016年度末		2017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	33	△19	54	△22

(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

2016年度末、2017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)

(単位:億円)

区分	2016年度末						2017年度上半期末					
	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	△38	50	△648	—	—	△637	△40	△4,423	△150	—	—	△4,614
ヘッジ会計非適用分	—	80	△66	0	—	13	—	109	△55	△1	—	52
合計	△38	130	△715	0	—	△623	△40	△4,314	△205	△1	—	△4,562

(注) ヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ適用分の差損益(2016年度末:通貨関連917億円、株式関連△648億円、2017年度上半期末:通貨関連△2,905億円、株式関連△150億円)、及び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. ヘッジ会計が適用されていないもの

(a) 金利関連

2016年度末、2017年度上半期末に該当の残高はありません。

(b)通貨関連

(単位:億円)

区分	種類	2016年度末				2017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	2,112	—	25	25	2,716	—	△60	△60
	米ドル	1,149	—	16	16	1,321	—	△30	△30
	ユーロ	481	—	3	3	587	—	△5	△5
	豪ドル	213	—	4	4	336	—	△4	△4
	ポンド	184	—	1	1	339	—	△19	△19
	買建	609	—	△2	△2	972	—	3	3
	米ドル	318	—	△0	△0	545	—	3	3
	ユーロ	195	—	△1	△1	312	—	0	0
	豪ドル	28	—	0	0	18	—	0	0
	ポンド	21	—	△0	△0	30	—	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								
	米ドル払/円受	2,246	2,246	57	57	2,647	2,647	165	165
	ユーロ払/円受	—	—	—	—	—	—	—	—
	円払/豪ドル受	2,104	2,104	53	53	2,506	2,506	163	163
合 計				80				109	

(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	2016年度末				2017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	238	—	1	1	480	—	△21	△21
	買建	217	—	△1	△1	245	—	7	7
	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	2,548	567	51	△65	1,730	712	30	△44
		(116)	(40)			(75)	(36)		
店頭	株式先渡契約								
	売建	—	—	△2	△2	—	—	△1	△1
	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	3	3	1	1
	プット	(0)	(0)	—	—	(0)	(0)	—	—
		(—)	(—)			(—)	(—)		
合計				△66				△55	

(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	2016年度末				2017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	円貨建債券先物								
	売建	219	—	0	0	170	—	0	0
	買建	—	—	—	—	—	—	—	—
	外貨建債券先物								
	売建	—	—	—	—	—	—	—	—
買建	—	—	—	—	117	—	△2	△2	
合計				0				△1	

(注)「差損益」欄には、時価を記載しています。

(e) その他

2016年度末、2017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	2016年度末				2017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		3,440	3,440	△37	△37	4,520	4,520	△39	△39
		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	100	100	△0	△0		
		固定金利支払/変動金利受取	—	—	—	—	—	—	—	—	—
合 計							△38				△40

(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
2016 年度末	固定金利受取 /変動金利支払 スワップ	想定元本	—	—	40	60	—	3,440	3,540
		平均受取固定金利	—	—	△0.05	△0.02	—	0.70	0.68
		平均支払変動金利	—	—	0.03	0.03	—	0.04	0.04
	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	—	—	—	—	—	—	—
2017 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	—	4,520	4,620
		平均受取固定金利	—	—	△0.05	△0.02	—	0.69	0.68
		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	2016年度末			2017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		95,928	—	917	917	97,632	—	△2,905	△2,905	
		米ドル		54,057	—	422	422	51,026	—	△1,100	△1,100	
		ユーロ		27,227	—	222	222	31,489	—	△937	△937	
		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	11,225	10,806	△866	△866	11,060	10,622	△1,518	△1,518	
		米ドル払/円受		5,323	4,956	△834	△834	5,171	4,853	△824	△824	
		ユーロ払/円受		4,712	4,660	△212	△212	4,699	4,580	△778	△778	
		ポンド払/円受		1,189	1,189	180	180	1,189	1,189	83	83	
合 計							50				△4,423	

(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	2016年度末				2017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	2,146	—	△648	△648	2,363	—	△150	△150
		売建		—	—	—	—	—	—	—	—
合 計							△648				△150

(注) 「差損益」欄には、時価を記載しています。

(d) 債券関連

2016年度末、2017年度上半期末に該当の残高はありません。

(e) その他

2016年度末、2017年度上半期末に該当の残高はありません。