

2018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

2017年度末、2018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

2017年度上半期、2018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	2017年度末		2018年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
公社債	223,813	41.6	230,255	41.6
国債	194,561	36.2	202,197	36.5
地方債	8,815	1.6	8,693	1.6
社債	20,436	3.8	19,364	3.5
(うち公社・公団債)	(8,107)	(1.5)	(8,080)	(1.5)
株式	93,588	17.4	96,180	17.4
外国証券	193,710	36.0	199,561	36.0
公社債	144,335	26.9	145,770	26.3
株式等	49,375	9.2	53,790	9.7
その他の証券	26,330	4.9	28,145	5.1
合計	537,443	100.0	554,143	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
2017年度末	有価証券	7,869	22,874	24,128	27,952	73,717	380,901	537,443
	国債	1,720	5,889	9,340	16,438	30,736	130,436	194,561
	地方債	1,006	957	60	267	867	5,654	8,815
	社債	2,812	1,202	1,317	1,389	4,185	9,528	20,436
	株式						93,588	93,588
	外国証券	2,315	12,491	12,331	7,863	24,376	134,332	193,710
	公社債	2,224	12,314	11,988	7,529	23,795	86,481	144,335
	株式等	91	177	342	333	580	47,850	49,375
	その他の証券	15	2,332	1,078	1,993	13,551	7,359	26,330
	買入金銭債権	229	16	42	64	233	2,196	2,782
	譲渡性預金	3,275	—	—	—	—	—	3,275
	合計	11,374	22,890	24,171	28,016	73,950	383,097	543,500
2018年度上半期末	有価証券	9,799	21,486	23,996	30,568	85,502	382,790	554,143
	国債	2,304	5,403	8,796	17,445	33,841	134,406	202,197
	地方債	1,503	321	100	255	1,042	5,469	8,693
	社債	1,403	1,198	1,701	1,256	4,696	9,108	19,364
	株式						96,180	96,180
	外国証券	4,570	12,600	12,282	8,135	29,859	132,112	199,561
	公社債	4,536	12,363	11,963	7,808	29,311	79,787	145,770
	株式等	34	237	319	327	547	52,324	53,790
	その他の証券	17	1,962	1,115	3,474	16,063	5,513	28,145
	買入金銭債権	209	21	20	41	399	1,881	2,574
	譲渡性預金	2,140	—	—	—	—	—	2,140
	合計	12,150	21,507	24,016	30,609	85,902	384,672	558,859

③地域別地方債保有内訳

(単位:億円、%)

区分	2017年度末		2018年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
北海道	22	0.2	22	0.3
東北	—	—	—	—
関東	5,270	59.8	5,259	60.5
中部	2,057	23.3	2,062	23.7
近畿	217	2.5	221	2.6
中国	97	1.1	97	1.1
四国	—	—	—	—
九州	989	11.2	998	11.5
その他	159	1.8	30	0.3
合計	8,815	100.0	8,693	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	2017年度末		2018年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
AAA	18,004	10.4	18,251	10.5
AA	112,869	65.0	105,481	60.7
A	23,905	13.8	25,069	14.4
BBB	16,269	9.4	22,621	13.0
BB以下	108	0.1	114	0.1
格付なし	2,428	1.4	2,289	1.3
合計	173,587	100.0	173,828	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。(2017年度末:19兆4,561億円、2018年度上半期末:20兆2,197億円)
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	2017年度末		2018年度上半期末		
	金額	占率	金額	占率	
水産・農林業	39	0.0	47	0.0	
鉱業	15	0.0	15	0.0	
建設業	1,657	1.8	1,551	1.6	
製造業	食料品	3,274	3.5	3,227	3.4
	繊維製品	1,303	1.4	1,171	1.2
	パルプ・紙	292	0.3	317	0.3
	化学	9,541	10.2	9,619	10.0
	医薬品	7,725	8.3	8,381	8.7
	石油・石炭製品	281	0.3	334	0.3
	ゴム製品	988	1.1	882	0.9
	ガラス・土石製品	891	1.0	902	0.9
	鉄鋼	1,378	1.5	1,398	1.5
	非鉄金属	873	0.9	852	0.9
	金属製品	448	0.5	411	0.4
	機械	5,976	6.4	5,592	5.8
	電気機器	11,574	12.4	11,307	11.8
	輸送用機器	14,018	15.0	13,935	14.5
精密機器	1,199	1.3	1,169	1.2	
その他製品	1,018	1.1	1,093	1.1	
電気・ガス業	3,455	3.7	3,741	3.9	
運輸・情報通信業	陸運業	5,380	5.7	5,968	6.2
	海運業	72	0.1	69	0.1
	空運業	139	0.1	154	0.2
	倉庫・運輸関連業	105	0.1	105	0.1
	情報・通信業	2,474	2.6	2,958	3.1
商業	卸売業	3,260	3.5	3,367	3.5
	小売業	2,827	3.0	2,951	3.1
金融・保険業	銀行業	5,436	5.8	5,203	5.4
	証券、商品先物取引業	792	0.8	754	0.8
	保険業	4,389	4.7	5,709	5.9
	その他金融業	558	0.6	585	0.6
不動産業	467	0.5	487	0.5	
サービス業	1,728	1.8	1,909	2.0	
合計	93,588	100.0	96,180	100.0	

(3) 貸付金関係

① 貸付金明細表

(単位:億円)

区分	2017年度末	2018年度上半期末
保険約款貸付	6,190	6,015
保険料振替貸付	430	414
契約者貸付	5,760	5,600
一般貸付	68,492	68,813
企業貸付	50,961	51,559
国内	49,310	49,466
海外	1,651	2,093
国・国際機関・政府関係機関・ 公共団体・公企業貸付	4,765	4,638
国内	4,442	4,338
海外	323	300
住宅ローン	7,986	7,955
消費者ローン	3,930	3,841
その他	849	817
合 計	74,683	74,828
非居住者貸付	1,974	2,393

② 貸付金企業規模別内訳

(単位:件、億円、%)

区分		2017年度末		2018年度上半期末	
			占率		占率
大企業	貸付先数	845	37.0	815	37.8
	金額	42,955	87.1	42,774	86.5
中堅企業	貸付先数	312	13.7	284	13.2
	金額	724	1.5	740	1.5
中小企業	貸付先数	1,127	49.3	1,058	49.0
	金額	5,629	11.4	5,950	12.0
国内企業計	貸付先数	2,284	100.0	2,157	100.0
	金額	49,310	100.0	49,466	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		2017年度末		2018年度上半期末	
		金額	占率	金額	占率
国内向け	製造業	11,152	16.3	11,013	16.0
	食料	1,021	1.5	1,022	1.5
	繊維	222	0.3	197	0.3
	木材・木製品	24	0.0	23	0.0
	パルプ・紙	591	0.9	650	0.9
	印刷	158	0.2	159	0.2
	化学	1,821	2.7	1,965	2.9
	石油・石炭	799	1.2	946	1.4
	窯業・土石	426	0.6	418	0.6
	鉄鋼	1,805	2.6	1,805	2.6
	非鉄金属	183	0.3	186	0.3
	金属製品	87	0.1	92	0.1
	はん用・生産用・業務用機械	1,244	1.8	1,081	1.6
	電気機械	943	1.4	891	1.3
	輸送用機械	1,574	2.3	1,300	1.9
	その他の製造業	245	0.4	272	0.4
	農業、林業	—	—	—	—
	漁業	—	—	—	—
	鉱業、採石業、砂利採取業	45	0.1	26	0.0
	建設業	321	0.5	337	0.5
	電気・ガス・熱供給・水道業	12,081	17.6	12,198	17.7
	情報通信業	1,512	2.2	1,404	2.0
	運輸業、郵便業	6,470	9.4	6,373	9.3
	卸売業	8,030	11.7	7,823	11.4
	小売業	547	0.8	545	0.8
	金融業、保険業	5,185	7.6	5,247	7.6
	不動産業	4,337	6.3	4,755	6.9
物品賃貸業	2,554	3.7	2,563	3.7	
学術研究、専門・技術サービス業	18	0.0	13	0.0	
宿泊業	230	0.3	241	0.4	
飲食業	31	0.0	31	0.0	
生活関連サービス業、娯楽業	429	0.6	438	0.6	
教育、学習支援業	15	0.0	17	0.0	
医療・福祉	12	0.0	12	0.0	
その他のサービス	111	0.2	108	0.2	
地方公共団体	1,510	2.2	1,468	2.1	
個人(住宅・消費・納税資金等)	11,916	17.4	11,797	17.1	
合 計	66,518	97.1	66,419	96.5	
海外向け	政府等	323	0.5	300	0.4
	金融機関	142	0.2	229	0.3
	商工業(等)	1,508	2.2	1,863	2.7
	合 計	1,974	2.9	2,393	3.5
総 合 計	68,492	100.0	68,813	100.0	

④貸付金担保別内訳

(単位:億円、%)

区分	2017年度末		2018年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
担保貸付	324	0.5	321	0.5
有価証券担保貸付	81	0.1	89	0.1
不動産・動産・財団担保貸付	169	0.2	164	0.2
指名債権担保貸付	73	0.1	67	0.1
保証貸付	1,868	2.7	1,704	2.5
信用貸付	54,383	79.4	54,990	79.9
その他	11,916	17.4	11,796	17.1
一般貸付計	68,492	100.0	68,813	100.0
うち劣後特約付貸付	2,096	3.1	2,021	2.9

⑤貸付金地域別内訳

(単位:億円、%)

区分	2017年度末		2018年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
北海道	660	1.3	656	1.3
東北	1,240	2.5	1,282	2.6
関東	32,968	66.9	33,283	67.3
中部	4,192	8.5	4,041	8.2
近畿	6,899	14.0	6,807	13.8
中国	1,150	2.3	1,196	2.4
四国	693	1.4	688	1.4
九州	1,504	3.1	1,509	3.1
合計	49,310	100.0	49,466	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	
	2017年度末	固定金利	8,435	13,121	9,937	6,692	8,295	16,261
変動金利		545	937	1,098	719	1,031	1,416	5,749
一般貸付計		8,980	14,058	11,036	7,412	9,326	17,677	68,492
2018年度上半期末	固定金利	8,408	12,970	10,196	6,501	7,943	16,526	62,547
	変動金利	488	1,180	1,151	714	1,145	1,586	6,265
	一般貸付計	8,896	14,151	11,347	7,216	9,088	18,113	68,813

(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	2017年度末		2018年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
公社債	140,903	68.4	142,335	66.6
株式	9,349	4.5	8,951	4.2
現預金・その他	29,905	14.5	35,962	16.8
小計	180,158	87.5	187,248	87.6

・円貨額が確定した外貨建資産

(単位:億円、%)

区分	2017年度末		2018年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
公社債	—	—	—	—
現預金・その他	2,909	1.4	3,024	1.4
小計	2,909	1.4	3,024	1.4

・円貨建資産

(単位:億円、%)

区分	2017年度末		2018年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
非居住者貸付	550	0.3	573	0.3
公社債(円建外債)・その他	22,354	10.9	23,029	10.8
小計	22,904	11.1	23,602	11.0

・合計

(単位:億円、%)

区分	2017年度末		2018年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
海外投融資	205,972	100.0	213,875	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	2017年度末		2018年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
米ドル	102,429	56.9	107,711	57.5
ユーロ	47,739	26.5	50,536	27.0
イギリスポンド	14,015	7.8	13,731	7.3
オーストラリアドル	7,485	4.2	7,778	4.2
カナダドル	3,062	1.7	2,224	1.2
インドルピー	1,381	0.8	1,381	0.7
その他	4,044	2.2	3,885	2.1
合計	180,158	100.0	187,248	100.0

(注) 内訳は、2018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		
2017年度末	北米	79,486	41.0	73,727	51.1	5,759	11.7	955	48.4
	ヨーロッパ	62,542	32.3	56,906	39.4	5,635	11.4	491	24.9
	オセアニア	7,443	3.8	5,632	3.9	1,811	3.7	142	7.2
	アジア	6,413	3.3	2,869	2.0	3,543	7.2	33	1.7
	中南米	35,446	18.3	2,821	2.0	32,625	66.1	71	3.6
	中東	—	—	—	—	—	—	—	—
	アフリカ	—	—	—	—	—	—	180	9.1
	国際機関	2,378	1.2	2,378	1.6	—	—	100	5.1
	合計	193,710	100.0	144,335	100.0	49,375	100.0	1,974	100.0
	2018年度上半期末	北米	76,777	38.5	70,516	48.4	6,261	11.6	1,014
ヨーロッパ		65,025	32.6	59,960	41.1	5,064	9.4	618	25.8
オセアニア		7,971	4.0	6,156	4.2	1,815	3.4	229	9.6
アジア		6,669	3.3	3,461	2.4	3,207	6.0	10	0.4
中南米		40,599	20.3	3,158	2.2	37,441	69.6	73	3.1
中東		—	—	—	—	—	—	158	6.6
アフリカ		—	—	—	—	—	—	188	7.9
国際機関		2,517	1.3	2,517	1.7	—	—	100	4.2
合計		199,561	100.0	145,770	100.0	53,790	100.0	2,393	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）

	2017年度末		2018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	5,910	190	7,647	177
為替予約	96,342	2,797	99,865	1,019
通貨スワップ	13,745	1,333	14,703	1,295
通貨オプション（買）	—	—	7,109	71
株式先渡契約	1,399	166	—	—
株式オプション（買）	3	1	—	—
その他の金融派生商品	—	—	—	—
合計	117,401	4,488	129,325	2,563

（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、金利スワップ取引、通貨スワップ取引、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	2017年度末						2018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	24	878	28	—	—	932	△136	△3,076	—	—	—	△3,212
ヘッジ会計非適用分	0	27	△57	—	—	△29	0	△53	△5	—	—	△58
合計	25	905	△28	—	—	902	△136	△3,129	△5	—	—	△3,271

(注)ヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ適用分の差損益(2017年度末:通貨関連1,722億円、株式関連28億円、2018年度上半期末:通貨関連△1,913億円)、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	2017年度末				2018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/変動金利支払スワップ	5,900	5,900	25	25	7,620	7,620	△136	△136
	固定金利支払/変動金利受取	10	10	0	0	27	27	0	0
合計				25					△136

(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	
2017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	—	5,800	5,900
		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	—	0.01	0.01
	固定金利支払/変動金利受取スワップ	想定元本	—	—	—	—	10	—	10
		平均支払固定金利	—	—	—	—	0.25	—	0.25
		平均受取変動金利	—	—	—	—	0.01	—	0.01
2018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	—	—	7,520	7,620
		平均受取固定金利	—	△0.05	△0.02	—	—	0.67	0.66
		平均支払変動金利	—	0.03	0.03	—	—	0.02	0.02
	固定金利支払/変動金利受取スワップ	想定元本	—	—	—	—	—	27	27
		平均支払固定金利	—	—	—	—	—	0.45	0.45
		平均受取変動金利	—	—	—	—	—	0.01	0.01

3. 通貨関連

(単位:億円)

区分	種類	2017年度末				2018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	97,389	54	1,751	1,751	96,450	54	△1,961	△1,961
	米ドル	46,154	54	1,051	1,051	43,440	54	△797	△797
	ユーロ	36,262	—	384	384	38,437	—	△791	△791
	買建	705	—	△0	△0	1,440	—	13	13
	米ドル	524	—	0	0	786	—	5	5
	ユーロ	0	—	△0	△0	86	—	1	1
	ポンド	156	—	△1	△1	242	—	1	1
	加ドル	—	—	—	—	145	—	2	2
	通貨オプション								
	売建								
	コール	—	—	—	—	567	—	5	△0
		(—)	(—)	—	—	(4)	(—)	—	—
	米ドル	—	—	—	—	567	—	5	△0
		(—)	(—)	—	—	(4)	(—)	—	—
	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	—	—	—	—	7,109	—	6	△25	
	(—)	(—)	—	—	(32)	(—)	—	—	
米ドル	—	—	—	—	7,109	—	6	△25	
	(—)	(—)	—	—	(32)	(—)	—	—	
ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—	
	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	
通貨スワップ									
	13,745	13,196	△845	△845	14,703	13,874	△1,155	△1,155	
米ドル払/円受	4,992	4,660	△325	△325	5,717	5,051	△658	△658	
ユーロ払/円受	4,699	4,481	△635	△635	4,796	4,656	△642	△642	
円払/豪ドル受	2,723	2,723	△4	△4	2,811	2,811	8	8	
合計				905				△3,129	

(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	2017年度末				2018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	106	—	△ 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	—	—	—	—	—	—	—	—
	プット	6,650	214	78	△55	11,577	—	2	△5
		(133)	(15)			(7)	(—)		
店頭	株式先渡契約								
	売建	1,438	—	27	27	—	—	—	—
	買建	—	—	—	—	—	—	—	—
	株価指数オプション								
	売建								
	コール	—	—	—	—	—	—	—	—
	プット	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	買建								
	コール	3	2	1	1	—	—	—	—
	プット	(0)	(0)	—	—	(—)	(—)	—	—
	—	—	—	—	—	—	—	—	
	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	
合計				△28				△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。

5. 債券関連

2017年度末、2018年度上半期末に該当の残高はありません。

6. その他

2017年度末、2018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	2017年度末		2018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	988	△11	1,051	16

(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	2017年度末						2018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	2	0	—	2
合計	—	0	△0	0	—	0	—	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

2017年度末、2018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	2017年度末				2018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	141	—	0	0	72	—	△1	△1
	米ドル	52	—	△0	△0	19	—	△0	△0
	ユーロ	61	—	0	0	30	—	△0	△0
	買建	143	—	0	0	103	—	1	1
	米ドル	74	—	0	0	60	—	1	1
	ユーロ	40	—	△0	△0	24	—	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	2017年度末				2018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	12	—	△0	△0	67	—	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	2017年度末				2018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	19	—	0	0	7	—	0	0
	買建	—	—	—	—	—	—	—	—
	外貨建債券先物								
	売建	—	—	—	—	—	—	—	—
	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

2017年度末、2018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	2018年度上半期末	
		うち一般勘定
現預金・コールローン	13,489	10,268
買現先勘定	—	—
買入金銭債権	2,574	2,574
商品有価証券	—	—
金銭の信託	47	47
公社債	234,060	230,255
株式	97,964	96,180
外国証券	202,490	199,561
貸付金	74,828	74,828
不動産	16,119	16,119
資産計	679,683	666,555
うち外貨建資産	190,509	187,248

(2) 売買目的有価証券の評価損益(会社計)

(単位:億円)

区分	2017年度末		2018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	9,682	△58	9,360	70

(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	2017年度末					2018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	195,283	232,296	37,013	37,072	△59	202,477	234,679	32,201	32,558	△356
満期保有目的の債券	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
子会社・関連会社株式	640	1,695	1,055	1,055	—	640	1,387	746	746	—
その他有価証券	264,467	331,872	67,404	71,298	△3,893	271,139	339,330	68,191	72,046	△3,854
公社債	29,458	31,406	1,947	2,004	△56	28,885	30,492	1,606	1,694	△88
株式	41,660	89,654	47,993	48,881	△887	42,327	91,080	48,752	49,704	△951
外国証券	166,001	181,594	15,592	18,438	△2,846	171,518	187,918	16,399	18,939	△2,540
公社債	134,692	143,863	9,171	11,756	△2,585	135,656	145,263	9,607	11,591	△1,983
株式等	31,309	37,730	6,421	6,681	△260	35,862	42,654	6,792	7,348	△556
その他の証券	23,681	25,553	1,872	1,973	△100	25,887	27,324	1,437	1,706	△269
買入金銭債権	390	388	△1	0	△2	379	373	△5	0	△5
譲渡性預金	3,275	3,275	0	0	△0	2,141	2,140	△0	0	△0
合 計	460,391	565,864	105,473	109,426	△3,953	474,257	575,397	101,140	105,351	△4,211
公社債	221,865	260,700	38,835	38,941	△106	228,648	262,352	33,704	34,139	△434
株式	41,660	89,654	47,993	48,881	△887	42,327	91,080	48,752	49,704	△951
外国証券	167,115	183,771	16,655	19,511	△2,855	172,663	189,817	17,153	19,702	△2,548
公社債	135,175	144,354	9,179	11,774	△2,595	136,169	145,784	9,615	11,607	△1,992
株式等	31,940	39,416	7,476	7,737	△260	36,493	44,032	7,538	8,095	△556
その他の証券	23,690	25,562	1,872	1,973	△100	25,896	27,334	1,437	1,707	△269
買入金銭債権	2,784	2,900	116	118	△2	2,579	2,671	91	98	△6
譲渡性預金	3,275	3,275	0	0	△0	2,141	2,140	△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	2017年度末	2018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	8,954	10,143
その他有価証券	6,695	6,099
非上場国内株式(店頭売買株式を除く)	549	551
非上場外国株式(店頭売買株式を除く)	3,170	2,400
非上場外国債券	—	—
その他	2,975	3,148
合 計	15,649	16,243

(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。
(2017年度末:75億円、2018年度上半期末:258億円)

(4) 金銭の信託の時価情報(会社計)

(単位:億円)

区分	2017年度末					2018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	104	104	—	—	—	47	47	—	—	—

(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	2017年度末		2018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	104	△32	47	△83

(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

2017年度末、2018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	2017年度末						2018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	24	878	28	—	—	932	△136	△3,076	—	—	—	△3,212
ヘッジ会計非適用分	0	27	△59	11	—	△20	0	△74	△2	△7	—	△84
合計	25	905	△30	11	—	911	△136	△3,150	△2	△7	—	△3,297

(注)ヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ適用分の差損益(2017年度末:通貨関連1,722億円、株式関連28億円、2018年度上半期末:通貨関連△1,913億円)、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

(単位:億円)

区分	種類	2017年度末				2018年度上半期末			
		契約額等	時価		契約額等	時価		差損益	
			うち1年超	差損益		うち1年超	差損益		
店頭	金利スワップ								
	固定金利受取/変動金利支払	30	30	0	0	—	—	—	—
	固定金利支払/変動金利受取	10	10	0	0	27	27	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	
2017年度末	固定金利受取/変動金利支払スワップ	想定元本	—	—	—	—	30	30	
		平均受取固定金利	—	—	—	—	0.66	0.66	
		平均支払変動金利	—	—	—	—	0.01	0.01	
	固定金利支払/変動金利受取スワップ	想定元本	—	—	—	—	10	—	10
		平均支払固定金利	—	—	—	—	0.25	—	0.25
		平均受取変動金利	—	—	—	—	0.01	—	0.01
2018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	—	—	—	—	—	—	
		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	—	—	—	—	—	27	27
		平均支払固定金利	—	—	—	—	—	0.45	0.45
		平均受取変動金利	—	—	—	—	—	0.01	0.01

(b)通貨関連

(単位:億円)

区分	種類	2017年度末				2018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	3,645	54	28	28	4,935	54	△77	△77
	米ドル	1,900	54	15	15	2,815	54	△46	△46
	ユーロ	706	—	1	1	645	—	△9	△9
	ポンド	520	—	△0	△0	655	—	△11	△11
	豪ドル	412	—	12	12	492	—	△6	△6
	買建	1,545	—	0	0	2,103	—	22	22
	米ドル	959	—	1	1	1,121	—	10	10
	ユーロ	244	—	△0	△0	271	—	2	2
	ポンド	194	—	△1	△1	294	—	2	2
	通貨オプション								
	売建								
	コール	—	—	—	—	567	—	5	△0
		(—)	(—)			(4)	(—)		
	米ドル	—	—	—	—	567	—	5	△0
		(—)	(—)			(4)	(—)		
	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	—	—	—	—	7,109	—	6	△25	
	(—)	(—)			(32)	(—)			
米ドル	—	—	—	—	7,109	—	6	△25	
	(—)	(—)			(32)	(—)			
ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—	
	(—)	(—)			(—)	(—)			
通貨スワップ	2,864	2,864	△1	△1	2,952	2,952	7	7	
米ドル払/円受	—	—	—	—	—	—	—	—	
ユーロ払/円受	—	—	—	—	—	—	—	—	
円払/豪ドル受	2,723	2,723	△4	△4	2,811	2,811	8	8	
合計				27				△74	

(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	2017年度末				2018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	281	—	0	0	142	—	△4	△4
	買建	111	—	△4	△4	359	—	6	6
	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	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
合計	6,650 (133)	214 (15)	78	△55	11,577 (7)	— (—)	2	△5	
店頭	株式先渡契約								
	売建	—	—	△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	3 (0)	2 (0)	1	1	— (—)	— (—)	—	—
	プット	— (—)	— (—)	—	—	— (—)	— (—)	—	—
合計				△59				△2	

(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	2017年度末				2018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	150	—	0	0	87	—	0	0
	買建	—	—	—	—	57	—	△0	△0
	外貨建債券先物								
	売建	—	—	—	—	—	—	—	—
買建	896	—	11	11	747	—	△7	△7	
合計				11				△7	

(注)「差損益」欄には、時価を記載しています。

(e) その他

2017年度末、2018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	2017年度末				2018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	5,770	5,770	25	25	7,520	7,520	△135	△135
		固定金利受取/変動金利支払 固定金利支払/変動金利受取									
		金利スワップ	貸付金	100	100	△0	△0	100	100	△0	△0
		固定金利受取/変動金利支払 固定金利支払/変動金利受取									
合 計						24			△136		

(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
2017 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	—	5,770	5,870
		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	—	0.01	0.01
	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	—	—	—	—	—	—	—
2018 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	—	—	7,520	7,620
		平均受取固定金利	—	△0.05	△0.02	—	—	0.67	0.66
		平均支払変動金利	—	0.03	0.03	—	—	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	—	—	—	—	—	—	—

(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	2017年度末				2018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	1,438	—	28	28	—	—	—	—
		売建		—	—	—	—	—	—	—	—
合 計							28				—

(注) 「差損益」欄には、時価を記載しています。

(d) 債券関連

2017年度末、2018年度上半期末に該当の残高はありません。

(e) その他

2017年度末、2018年度上半期末に該当の残高はありません。