

2018年度上半期報告 補足資料

< 目 次 >

I. 一般勘定

1. 有価証券関係	
(1) 有価証券明細表	…… 1 頁
(2) 有価証券残存期間別残高	…… 1 頁
(3) 業種別株式保有明細表	…… 2 頁
(4) デリバティブ取引の時価情報	…… 3 頁
2. 貸付金関係	
(1) 貸付金明細表	…… 6 頁
(2) 貸付金残存期間別残高	…… 6 頁
(3) 国内企業向け貸付金企業規模別内訳	…… 7 頁
(4) 貸付金業種別内訳	…… 8 頁
(5) 貸付金地域別内訳	…… 9 頁
(6) 貸付金担保別内訳	…… 9 頁
3. 海外投融資関係	
(1) 資産別明細	…… 10 頁
(2) 外貨建資産の通貨別構成	…… 11 頁
(3) 海外投融資の地域別構成	…… 11 頁

II. 個人変額保険・個人変額年金保険特別勘定

1. 売買目的有価証券の評価損益	…… 12 頁
2. 有価証券の時価情報	…… 12 頁
3. 金銭の信託の時価情報	…… 12 頁
4. デリバティブ取引の時価情報	…… 13 頁

III. 会社計

1. 売買目的有価証券の評価損益	…… 15 頁
2. 有価証券の時価情報	…… 15 頁
3. 金銭の信託の時価情報	…… 17 頁
4. デリバティブ取引の時価情報	…… 18 頁

IV. その他

1. 資産査定状況等	…… 21 頁
2. 土地の時価情報	…… 22 頁

I. 一般勘定

1. 有価証券関係

(1) 有価証券明細表

(単位：百万円、%)

区 分	2017年度末		2018年度上半期末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
国 債	2,420,045	46.3	2,382,963	44.5
地 方 債	161,613	3.1	169,153	3.2
社 債	531,009	10.1	552,654	10.3
うち公社・公団債	296,377	5.7	303,672	5.7
株 式	399,362	7.6	393,152	7.3
外 国 証 券	1,621,793	31.0	1,760,544	32.9
公 社 債	1,427,303	27.3	1,558,453	29.1
株 式 等	194,490	3.7	202,090	3.8
そ の 他 の 証 券	97,352	1.9	93,957	1.8
合 計	5,231,175	100.0	5,352,425	100.0

(2) 有価証券残存期間別残高

(単位：百万円)

2017年度末							
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
有 価 証 券	90,883	119,239	248,079	354,103	489,918	3,928,950	5,231,175
国 債	18,920	50,236	120,365	107,491	53,869	2,069,161	2,420,045
地 方 債	2,106	2,267	6,211	15,116	2,709	133,202	161,613
社 債	23,504	6,124	37,814	83,712	93,272	286,580	531,009
株 式	—	—	—	—	—	399,362	399,362
外 国 証 券	46,351	60,611	83,688	147,782	340,066	943,292	1,621,793
公 社 債	46,351	60,611	83,688	147,782	340,066	748,802	1,427,303
株 式 等	—	—	—	—	—	194,490	194,490
そ の 他 の 証 券	—	—	—	—	—	97,352	97,352
買 入 金 銭 債 権	—	—	—	—	—	10,517	10,517
譲 渡 性 預 金	42,000	—	—	—	—	—	42,000
合 計	132,883	119,239	248,079	354,103	489,918	3,939,467	5,283,692
2018年度上半期末							
有 価 証 券	79,233	153,893	288,016	316,945	585,530	3,928,807	5,352,425
国 債	8,941	62,180	117,830	89,236	74,430	2,030,342	2,382,963
地 方 債	3,646	—	14,248	11,527	31,227	108,504	169,153
社 債	12,491	7,883	62,961	70,518	114,912	283,886	552,654
株 式	—	—	—	—	—	393,152	393,152
外 国 証 券	54,152	83,828	92,976	145,662	364,959	1,018,963	1,760,544
公 社 債	54,152	83,828	92,976	145,662	364,959	816,873	1,558,453
株 式 等	—	—	—	—	—	202,090	202,090
そ の 他 の 証 券	—	—	—	—	—	93,957	93,957
買 入 金 銭 債 権	—	—	—	—	—	9,967	9,967
譲 渡 性 預 金	42,000	—	—	—	—	—	42,000
合 計	121,233	153,893	288,016	316,945	585,530	3,938,774	5,404,393

(注) 「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号)に基づく有価証券として取り扱うものを含んでいます。

(3) 業種別株式保有明細表

(単位：百万円、%)

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		—	—	—	—
鉱 業		543	0.1	566	0.1
建 設 業		18,199	4.6	16,226	4.1
製 造 業	食 料 品	21,763	5.4	20,733	5.3
	織 維 製 品	37,417	9.4	30,726	7.8
	パ ル プ ・ 紙	13,910	3.5	15,215	3.9
	化 学	39,552	9.9	39,404	10.0
	医 薬 品	13	0.0	13	0.0
	石 油 ・ 石 炭 製 品	6,050	1.5	7,464	1.9
	ゴ ム 製 品	30	0.0	30	0.0
	ガ ラ ス ・ 土 石 製 品	4,587	1.1	4,111	1.0
	鉄 鋼	1,298	0.3	1,391	0.4
	非 鉄 金 属	10,659	2.7	8,293	2.1
	金 属 製 品	1,731	0.4	1,572	0.4
	機 械	18,226	4.6	16,100	4.1
	電 気 機 器	33,545	8.4	35,130	8.9
	輸 送 用 機 器	57,243	14.3	56,621	14.4
	精 密 機 器	1,032	0.3	1,084	0.3
そ の 他 製 品	5,829	1.5	6,185	1.6	
電 気 ・ ガ ス 業		5,809	1.4	6,851	1.7
運 輸 ・ 情 報 通 信 業	陸 運 業	14,376	3.6	16,266	4.1
	海 運 業	3,200	0.8	3,163	0.8
	空 運 業	—	—	—	—
	倉 庫 ・ 運 輸 関 連 業	2,908	0.7	3,317	0.8
	情 報 ・ 通 信 業	151	0.0	180	0.0
商 業	卸 売 業	36,845	9.2	37,675	9.6
	小 売 業	13,418	3.4	13,756	3.5
金 融 ・ 保 険 業	銀 行 業	17,154	4.3	17,232	4.4
	証 券 、 商 品 先 物 取 引 業	4,668	1.2	4,602	1.2
	保 険 業	3,435	0.9	3,638	0.9
	そ の 他 金 融 業	4,781	1.2	4,695	1.2
不 動 産 業		17,875	4.5	18,303	4.7
サ ー ビ ス 業		3,100	0.8	2,595	0.7
合 計		399,362	100.0	393,152	100.0

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

①差損益の内訳 (ヘッジ会計適用分・非適用分の内訳)

(単位：百万円)

2017年度末						
	金利関連	通貨関連	株式関連	債券関連	その他	合計
ヘッジ会計適用分	31	—	—	—	—	31
ヘッジ会計非適用分	—	22,189	△2,419	—	—	19,769
合計	31	22,189	△2,419	—	—	19,801
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
ヘッジ会計適用分	23	—	—	—	—	23
ヘッジ会計非適用分	—	△23,493	△1,510	—	—	△25,004
合計	23	△23,493	△1,510	—	—	△24,980

(注) ヘッジ会計非適用分の差損益については、損益計算書に計上しています。

②金利関連

(単位：百万円)

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	3,123	2,123	31	31	2,123	2,123	23	23
	固定金利支払/変動金利受取	—	—	—	—	—	—	—	—
	変動金利受取/変動金利支払	—	—	—	—	—	—	—	—
	合計				31				23

(注) 差損益欄には、時価を記載しています。

(参考) 金利スワップ残存期間別残高

(単位：百万円、%)

2017年度末							
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	合計
受取側固定スワップ想定元本	1,000	1,063	860	200	—	—	3,123
平均受取固定金利	0.62	0.96	0.80	1.43	—	—	0.84
平均支払変動金利	0.22	0.48	0.48	0.58	—	—	0.40
支払側固定スワップ想定元本	—	—	—	—	—	—	—
平均受取変動金利	—	—	—	—	—	—	—
平均支払固定金利	—	—	—	—	—	—	—
支払/受取共に変動スワップ想定元本	—	—	—	—	—	—	—
平均受取変動金利	—	—	—	—	—	—	—
平均支払変動金利	—	—	—	—	—	—	—
合計	1,000	1,063	860	200	—	—	3,123
2018年度上半期末							
受取側固定スワップ想定元本	—	1,923	200	—	—	—	2,123
平均受取固定金利	—	0.89	1.43	—	—	—	0.94
平均支払変動金利	—	0.48	0.58	—	—	—	0.49
支払側固定スワップ想定元本	—	—	—	—	—	—	—
平均受取変動金利	—	—	—	—	—	—	—
平均支払固定金利	—	—	—	—	—	—	—
支払/受取共に変動スワップ想定元本	—	—	—	—	—	—	—
平均受取変動金利	—	—	—	—	—	—	—
平均支払変動金利	—	—	—	—	—	—	—
合計	—	1,923	200	—	—	—	2,123

③通貨関連

(単位：百万円)

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	1,114,370	—	22,373	22,373	1,104,240	—	△23,330	△23,330
	米ドル ユーロ	333,099	—	6,962	6,962	323,940	—	△8,914	△8,914
	通貨スワップ	781,270	—	15,411	15,411	780,299	—	△14,415	△14,415
	円払/豪ドル受	5,700	5,700	△184	△184	5,700	5,700	△163	△163
	円払/豪ドル受	5,700	5,700	△184	△184	5,700	5,700	△163	△163
合計				22,189				△23,493	

- (注) 1. 各期末の為替相場は先物相場を使用しています。
 2. 外貨建金銭債権債務等に先物為替予約が付されていることにより決済時における円貨額が確定している外貨建金銭債権債務等で、貸借対照表において当該円貨額で表示されているものについては、開示の対象から除いています。
 3. 差損益欄には、時価を記載しています。

④株式関連

(単位：百万円)

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	株価指数先渡 売 建	5,016	—	△39	△39	2,691	—	△227	△227
	株価指数オプション 売 建	3,831 (0)	—	166	△166	1,451 (0)	—	236	△236
店頭	買 建 プ ッ ト	10,009 (2,267)	—	54	△2,213	3,895 (1,047)	—	0	△1,047
	合計				△2,419				△1,510

- (注) 1. 括弧内には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

2017年度末、2018年度上半期末ともに該当する残高はありません。

⑥その他

2017年度末、2018年度上半期末ともに該当する残高はありません。

デリバティブ取引のリスク管理等

(1) 利用目的

当社では、主に資産または負債のリスクヘッジを目的にデリバティブ取引を行っています。

資産の安定的な運用のため現物資産に係る市場リスクなどのヘッジやコントロール、個人変額保険・個人変額年金保険に係る最低保証リスク（最低保証に関する責任準備金の変動による期間損益の変動リスク）の軽減を目的として利用しています。

(2) 取引の内容

運用対象としているデリバティブ取引は以下の通りです。

- ① 株式関連 国内外株価指数先物取引・国内外株価指数オプション取引・個別株券オプション取引等
- ② 債券関連 国内債券先物取引・国内外債券オプション取引
- ③ 通貨関連 先物為替予約取引・通貨オプション取引・通貨スワップ取引
- ④ 金利関連 金利スワップ取引

(3) リスクの内容

デリバティブ取引のリスクには、市場関連リスクと信用リスクならびに事務リスク・法務リスクがあります。

① 市場関連リスクについて

市場リスクにはヘッジ対象である株式、債券、通貨の価格変動や金利変動によってもたらされるリスクに加えて、オプション取引に見られるような市場変動性（ボラティリティ）など、デリバティブ固有のリスクも含まれています。

従って、市場リスクについては現物資産と合わせたポジション管理を行うと同時にデリバティブ取引そのもののリスクのモニタリングも行っています。

② 信用リスクについて

デリバティブ取引に付随する取引相手先のデフォルト（債務不履行）により、デリバティブ・ポジションから期待する経済効果を得られない信用リスクについて認識し、管理しています。

③ 事務リスク・法務リスク

当社のデリバティブ取引実行に際しては取引実行部門と独立した事務管理部門が取引先の管理部門と照合を行うなど、相互牽制機能が働く体制となっています。また、取引開始に際しては契約書の内容精査など法務リスクに配慮し、状況に応じて弁護士など専門家の意見を聴取するなどの対応を行っています。

(4) リスク管理体制

当社では取引実行部門とリスク管理担当部門を分離独立させ、相互牽制機能が発揮できる体制を確立しています。

具体的な管理・報告体制は以下の通りです。

- ① 価格変動リスクのモニタリングとリスク管理担当への報告
- ② 価格変動リスクのモニタリングとリスク管理責任者への報告
- ③ 市場関連リスク管理分会、信用リスク管理分会への報告
- ④ リスク管理会議への報告
- ⑤ 経営会議、取締役会への報告
- ⑥ 監査部門による規定遵守状況確認

2. 貸付金関係

(1) 貸付金明細表

(単位：百万円、%)

区 分	2017年度末		2018年度上半期末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
保 険 約 款 貸 付	49,176	4.4	47,179	4.4
保 険 料 振 替 貸 付	6,748	0.6	6,270	0.6
契 約 者 貸 付	42,428	3.8	40,908	3.8
一 般 貸 付	1,072,326	95.6	1,020,267	95.6
(うち非居住者貸付)	—	—	—	—
企 業 貸 付	930,598	83.0	874,961	82.0
(うち国内企業向け)	(930,324)	(83.0)	(874,729)	(81.9)
国・国際機関・政府関係機関貸付	259	0.0	241	0.0
公 共 団 体 ・ 公 企 業 貸 付	29,059	2.6	28,854	2.7
住 宅 ロ ー ン	31,021	2.8	28,464	2.7
消 費 者 ロ ー ン	80,763	7.2	87,152	8.2
そ の 他	625	0.0	595	0.1
合 計	1,121,503	100.0	1,067,447	100.0

(2) 貸付金残存期間別残高

(単位：百万円)

区 分	2017年度末						合計
	1年以下	1年超 3年以下	3年超 5年以下	5年超 7年以下	7年超 10年以下	10年超 (期間の定めない ものを含む)	
変動金利	21,191	14,946	1,580	1,104	3,051	29,873	71,747
固定金利	97,873	110,393	196,174	133,882	190,973	271,282	1,000,578
一般貸付計	119,065	125,340	197,754	134,986	194,024	301,155	1,072,326
区 分	2018年度上半期末						合計
	1年以下	1年超 3年以下	3年超 5年以下	5年超 7年以下	7年超 10年以下	10年超 (期間の定めない ものを含む)	
変動金利	11,007	14,930	805	951	2,750	27,750	58,195
固定金利	67,784	111,927	196,950	151,378	160,029	274,001	962,072
一般貸付計	78,792	126,858	197,755	152,329	162,780	301,751	1,020,267

(3) 国内企業向け貸付金企業規模別内訳

(単位：件、百万円、%)

区 分		2017年度末		2018年度上半期末	
			占 率		占 率
大 企 業	貸付先数	114	71.7	105	71.9
	金 額	840,006	90.3	800,513	91.5
中 堅 企 業	貸付先数	1	0.6	1	0.7
	金 額	500	0.0	500	0.1
中 小 企 業	貸付先数	44	27.7	40	27.4
	金 額	89,817	9.7	73,715	8.4
国内企業向け 貸 付 計	貸付先数	159	100.0	146	100.0
	金 額	930,324	100.0	874,729	100.0

(注) 1. 業種の区分は以下のとおりです。

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	従業員 300名超 かつ	資本金10億円以上	従業員 50名超 かつ	資本金10億円以上	従業員 100名超 かつ	資本金10億円以上	従業員 100名超 かつ	資本金10億円以上
中 堅 企 業		資本金3億円超 10億円未満		資本金5千万円超 10億円未満		資本金5千万円超 10億円未満		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	

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。

(4) 貸付金業種別内訳

(単位：百万円、%)

区 分		2017年度末		2018年度上半期末		
		金 額	占 率	金 額	占 率	
内 国	製 造 業	159,889	14.9	127,934	12.5	
	食 料	4,800	0.5	4,800	0.5	
	織 維	2,500	0.2	1,000	0.1	
	木 材 ・ 木 製 品	—	—	—	—	
	パ ル プ ・ 紙	39,000	3.6	37,000	3.6	
	印 刷	—	—	—	—	
	化 学	18,048	1.7	17,494	1.7	
	石 油 ・ 石 炭	25,810	2.4	23,810	2.3	
	窯 業 ・ 土 石	4,586	0.4	4,271	0.4	
	鉄 鋼	5,300	0.5	3,300	0.3	
	非 鉄 金 属 製 品	9,479	0.9	8,363	0.8	
	金 属 製 品	—	—	—	—	
	はん 用 ・ 生 産 用 ・ 業 務 用 機 械	3,321	0.3	2,287	0.2	
	電 気 機 械	17,300	1.6	3,250	0.3	
	輸 送 用 機 械	29,686	2.8	22,315	2.2	
	そ の 他 の 製 造 業	58	0.0	41	0.0	
	向 け	農 業 、 林 業	—	—	—	—
		漁 業	—	—	—	—
		鉱 業 、 採 石 業 、 砂 利 採 取 業	56	0.0	46	0.0
		建 設 業	8,000	0.8	4,926	0.5
電 気 ・ ガ ス ・ 熱 供 給 ・ 水 道 業		95,818	8.9	92,394	9.1	
情 報 通 信 業		25,190	2.4	24,100	2.4	
運 輸 業 、 郵 便 業		43,287	4.0	43,551	4.3	
卸 売 業		226,657	21.1	231,642	22.7	
小 売 業		500	0.1	500	0.0	
金 融 業 、 保 険 業		258,826	24.1	237,393	23.3	
不 動 産 業		112,356	10.5	114,433	11.2	
物 品 賃 貸 業		22,930	2.1	21,503	2.1	
学 術 研 究 、 専 門 ・ 技 術 サ ー ビ ス 業		500	0.1	—	—	
宿 泊 業		77	0.0	60	0.0	
飲 食 業		—	—	—	—	
生 活 関 連 サ ー ビ ス 業 、 娯 楽 業		—	—	—	—	
教 育 、 学 習 支 援 業		—	—	—	—	
医 療 ・ 福 祉		625	0.1	595	0.1	
そ の 他 の サ ー ビ ス		93	0.0	83	0.0	
地 方 公 共 団 体		5,459	0.5	5,254	0.5	
個 人 (住 宅 ・ 消 費 ・ 納 税 資 金 等)	111,784	10.4	115,616	11.3		
そ の 他	274	0.0	232	0.0		
合 計	1,072,326	100.0	1,020,267	100.0		
海 外 向 け	政 府	—	—	—	—	
	金 融 機 関	—	—	—	—	
	商 工 業 等	—	—	—	—	
合 計	—	—	—	—		
一 般 貸 付 計	1,072,326	100.0	1,020,267	100.0		

(5) 貸付金地域別内訳

(単位：百万円、%)

区 分	2017年度末		2018年度上半期末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
北 海 道	6,501	0.7	6,500	0.7
東 北	9,137	0.9	9,136	1.0
関 東	774,791	80.6	733,707	81.1
中 部	117,007	12.2	110,825	12.3
近 畿	32,561	3.4	24,875	2.7
中 国	2,925	0.3	2,370	0.3
四 国	3,535	0.4	3,525	0.4
九 州	14,081	1.5	13,711	1.5
合 計	960,541	100.0	904,651	100.0

- (注) 1. 住宅ローン、消費者ローン、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) 貸付金担保別内訳

(単位：百万円、%)

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	1,185	0.1	1,105	0.1
有 価 証 券 担 保 貸 付	—	—	—	—
不 動 産 ・ 動 産 ・ 財 団 担 保 貸 付	1,185	0.1	1,105	0.1
指 名 債 権 担 保 貸 付	—	—	—	—
保 証 貸 付	6,131	0.6	5,844	0.6
信 用 貸 付	953,224	88.9	897,701	88.0
そ の 他	111,784	10.4	115,616	11.3
一 般 貸 付 計	1,072,326	100.0	1,020,267	100.0
う ち 劣 後 特 約 付 貸 付	188,000	17.5	182,000	17.8

3. 海外投融资関係

(1) 資産別明細

①外貨建資産

(単位：百万円、%)

区 分	2017年度末		2018年度上半期末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
公 社 債	1,498,524	80.7	1,658,902	81.9
株 式	—	—	—	—
現 預 金 ・ そ の 他	150,251	8.1	160,918	7.9
小 計	1,648,776	88.8	1,819,821	89.8

②円貨額が確定した外貨建資産

(単位：百万円、%)

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	59,873	3.2	59,880	3.0
小 計	59,873	3.2	59,880	3.0

③円貨建資産

(単位：百万円、%)

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	—	—	—	—
公 社 債 (円 建 外 債) ・ そ の 他	149,134	8.0	146,904	7.2
小 計	149,134	8.0	146,904	7.2

④合 計

(単位：百万円、%)

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	1,857,784	100.0	2,026,606	100.0

※ 「円貨額が確定した外貨建資産」は、為替予約が付されていることにより決済時の円貨額が確定し、当該円貨額を資産の貸借対照表価額としているものです。

(2) 外貨建資産の通貨別構成

(単位：百万円、%)

区 分	2017年度末		2018年度上半期末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
ユ ー ロ	795,956	48.3	809,508	44.5
豪 ド ル	420,898	25.5	533,495	29.3
米 ド ル	431,919	26.2	476,814	26.2
そ の 他	2	0.0	2	0.0
合 計	1,648,776	100.0	1,819,821	100.0

(3) 海外投融資の地域別構成

(単位：百万円、%)

2017年度末									
区 分	外 国 証 券						非 居 住 者 貸 付		
	公 社 債		株 式 等		金 額	占 率	金 額	占 率	
金 額	占 率	金 額	占 率	金 額					占 率
北 米	317,781	19.6	300,224	21.0	17,556	9.0	—	—	
ヨ ー ロ ッ パ	1,006,944	62.1	835,683	58.6	171,260	88.1	—	—	
オ セ ア ニ ア	191,718	11.8	191,718	13.4	—	—	—	—	
ア ジ ア	5,672	0.4	—	—	5,672	2.9	—	—	
中 南 米	—	—	—	—	—	—	—	—	
中 東	—	—	—	—	—	—	—	—	
ア フ リ カ	—	—	—	—	—	—	—	—	
国 際 機 関	99,676	6.1	99,676	7.0	—	—	—	—	
合 計	1,621,793	100.0	1,427,303	100.0	194,490	100.0	—	—	
2018年度上半期末									
北 米	334,094	19.0	316,033	20.3	18,061	8.9	—	—	
ヨ ー ロ ッ パ	1,054,052	59.9	875,622	56.2	178,429	88.3	—	—	
オ セ ア ニ ア	249,059	14.1	249,059	16.0	—	—	—	—	
ア ジ ア	5,599	0.3	—	—	5,599	2.8	—	—	
中 南 米	—	—	—	—	—	—	—	—	
中 東	—	—	—	—	—	—	—	—	
ア フ リ カ	—	—	—	—	—	—	—	—	
国 際 機 関	117,737	6.7	117,737	7.6	—	—	—	—	
合 計	1,760,544	100.0	1,558,453	100.0	202,090	100.0	—	—	

Ⅱ. 個人変額保険・個人変額年金保険特別勘定

1. 売買目的有価証券の評価損益

(個人変額保険)

(単位：百万円)

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	69,622	154	72,000	2,248
公 社 債	19,154	△20	20,966	△288
株 式	24,324	305	24,233	505
外 国 証 券	21,538	△128	22,176	1,878
公 社 債	7,648	△30	6,030	99
株 式 等	13,889	△98	16,146	1,779
そ の 他 の 証 券	4,605	△1	4,623	152

(注) 「当期の損益に含まれた評価損益」には振戻損益を含んでいます。

(個人変額年金保険)

(単位：百万円)

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	52,179	△13,035	29,931	△5,314
公 社 債	12,061	△143	11,689	△262
株 式	4,798	△167	4,370	4
外 国 証 券	3,861	△250	3,746	322
公 社 債	1,292	1	1,100	15
株 式 等	2,569	△251	2,646	307
そ の 他 の 証 券	31,457	△12,473	10,124	△5,379

(注) 「当期の損益に含まれた評価損益」には振戻損益を含んでいます。

2. 有価証券の時価情報 (売買目的有価証券以外の有価証券)

(個人変額保険)

2017年度末、2018年度上半期末ともに該当する残高はありません。

(個人変額年金保険)

2017年度末、2018年度上半期末ともに該当する残高はありません。

3. 金銭の信託の時価情報

(個人変額保険)

2017年度末、2018年度上半期末ともに該当する残高はありません。

(個人変額年金保険)

2017年度末、2018年度上半期末ともに該当する残高はありません。

4. デリバティブ取引の時価情報

(ヘッジ会計適用・非適用分の合算値：個人変額保険・個人変額年金保険特別勘定)

【個人変額保険】

(1) 差損益の内訳 (ヘッジ会計適用分・非適用分の内訳)

2017年度末、2018年度上半期末ともに該当はありません。

(2) 金利関連

2017年度末、2018年度上半期末ともに該当する残高はありません。

(3) 通貨関連

2017年度末、2018年度上半期末ともに該当する残高はありません。

(4) 株式関連

2017年度末、2018年度上半期末ともに該当する残高はありません。

(5) 債券関連

2017年度末、2018年度上半期末ともに該当する残高はありません。

(6) その他

2017年度末、2018年度上半期末ともに該当する残高はありません。

【個人変額年金保険】

(1) 差損益の内訳（ヘッジ会計適用分・非適用分の内訳）

2017年度末、2018年度上半期末ともに該当はありません。

(2) 金利関連

2017年度末、2018年度上半期末ともに該当する残高はありません。

(3) 通貨関連

2017年度末、2018年度上半期末ともに該当する残高はありません。

(4) 株式関連

2017年度末、2018年度上半期末ともに該当する残高はありません。

(5) 債券関連

2017年度末、2018年度上半期末ともに該当する残高はありません。

(6) その他

2017年度末、2018年度上半期末ともに該当する残高はありません。

Ⅲ. 会社計

1. 売買目的有価証券の評価損益

(単位：百万円)

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	215,783	△11,993	200,113	△1,818
公 社 債	73,758	△182	80,295	△1,275
株 式	52,826	665	52,725	980
外 国 証 券	53,135	△1	52,344	3,703
公 社 債	17,084	30	14,331	207
株 式 等	36,050	△31	38,012	3,495
その他の証券	36,063	△12,475	14,748	△5,226

(注) 「当期の損益に含まれた評価損益」には振戻損益を含んでいます。

2. 有価証券の時価情報 (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：百万円)

区 分	2017年度末									
	帳簿価額	時 価	差 損 益	(時価－帳簿価額)		損益計算書計上後価額	差 損 益	(時価－損益計算書計上後価額)		
				差益	差損			差益	差損	
満期保有目的の債券	5,366	6,249	883	883	－	5,366	883	883	－	
公 社 債	2,394	2,640	245	245	－	2,394	245	245	－	
買入金銭債権	2,971	3,609	637	637	－	2,971	637	637	－	
責任準備金対応債券	2,075,341	2,414,738	339,396	342,420	3,023	2,073,294	341,443	342,832	1,388	
公 社 債	2,032,762	2,373,816	341,053	342,412	1,358	2,032,762	341,053	342,412	1,358	
外国公社債	42,579	40,921	△1,657	7	1,665	40,531	389	419	29	
子会社・関連会社株式	－	－	－	－	－	－	－	－	－	
その他の有価証券	2,831,303	3,112,314	281,010	326,916	45,906	2,832,137	280,176	302,996	22,819	
公 社 債	1,011,934	1,077,510	65,576	69,191	3,614	1,011,288	66,221	68,224	2,002	
株 式	200,891	387,943	187,052	190,393	3,341	200,891	187,052	190,393	3,341	
外 国 証 券	1,480,135	1,501,261	21,126	58,832	37,706	1,481,615	19,646	35,878	16,232	
公 社 債	1,365,576	1,386,771	21,195	54,137	32,942	1,367,056	19,715	31,183	11,468	
株 式 等	114,558	114,490	△68	4,694	4,763	114,558	△68	4,694	4,763	
その他の証券	89,697	96,052	6,355	7,598	1,243	89,697	6,355	7,598	1,243	
買入金銭債権	6,645	7,545	900	900	－	6,645	900	900	－	
譲渡性預金	42,000	42,000	－	－	－	42,000	－	－	－	
合 計	4,912,011	5,533,301	621,290	670,220	48,930	4,910,798	622,503	646,711	24,208	
公 社 債	3,047,091	3,453,967	406,875	411,849	4,973	3,046,446	407,521	410,882	3,361	
株 式	200,891	387,943	187,052	190,393	3,341	200,891	187,052	190,393	3,341	
外 国 証 券	1,522,714	1,542,183	19,468	58,840	39,371	1,522,146	20,036	36,298	16,262	
公 社 債	1,408,155	1,427,693	19,537	54,145	34,608	1,407,588	20,105	31,603	11,498	
株 式 等	114,558	114,490	△68	4,694	4,763	114,558	△68	4,694	4,763	
その他の証券	89,697	96,052	6,355	7,598	1,243	89,697	6,355	7,598	1,243	
買入金銭債権	9,616	11,154	1,537	1,537	－	9,616	1,537	1,537	－	
譲渡性預金	42,000	42,000	－	－	－	42,000	－	－	－	

(注) 1. 本表には、金融商品取引法上の有価証券として取り扱うことが適当と認められるもの等を含んでいます。

2. 外貨建責任準備金対応債券に係る換算差額△2,047百万円、及び外貨建その他有価証券のうち債券に係る換算差額の一部834百万円については、為替差損益として損益計算書に計上しています。

(単位：百万円)

区 分	2018年度上半期末									
	帳簿価額	時 価	差 損 益	(時価-帳簿価額)		損益計算書 計上後価額	差 損 益	(時価-損益計算書計上後価額)		
				差益	差損			差益	差損	
満期保有目的の債券	5,123	5,923	800	800	—	5,123	800	800	—	
公 社 債	2,273	2,494	220	220	—	2,273	220	220	—	
買入金銭債権	2,849	3,429	579	579	—	2,849	579	579	—	
責任準備金対応債券	2,108,437	2,397,589	289,152	294,596	5,444	2,106,343	291,246	294,957	3,711	
公 社 債	2,038,771	2,329,687	290,915	294,561	3,645	2,038,771	290,915	294,561	3,645	
外国公社債	69,666	67,902	△1,763	34	1,798	67,572	330	395	65	
子会社・関連会社株式	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
その他の有価証券	2,923,144	3,207,490	284,345	315,348	31,003	2,956,141	251,348	279,514	28,166	
公 社 債	1,009,115	1,063,726	54,611	56,918	2,307	1,012,161	51,564	55,068	3,503	
株 式	200,324	381,866	181,542	184,054	2,512	200,324	181,542	184,054	2,512	
外国証券	1,578,734	1,619,972	41,237	65,656	24,419	1,608,685	11,286	31,673	20,386	
公 社 債	1,455,695	1,490,881	35,186	58,078	22,891	1,485,645	5,236	24,095	18,859	
株 式 等	123,039	129,090	6,050	7,577	1,527	123,039	6,050	7,577	1,527	
その他の証券	86,656	92,806	6,150	7,914	1,763	86,656	6,150	7,914	1,763	
買入金銭債権	6,314	7,118	804	804	—	6,314	804	804	—	
譲渡性預金	42,000	42,000	—	—	—	42,000	—	—	—	
合 計	5,036,706	5,611,003	574,297	610,745	36,447	5,067,608	543,394	575,272	31,877	
公 社 債	3,050,160	3,395,907	345,747	351,700	5,953	3,053,207	342,700	349,850	7,149	
株 式	200,324	381,866	181,542	184,054	2,512	200,324	181,542	184,054	2,512	
外国証券	1,648,400	1,687,874	39,473	65,691	26,217	1,676,257	11,617	32,069	20,451	
公 社 債	1,525,361	1,558,784	33,423	58,113	24,690	1,553,217	5,566	24,491	18,924	
株 式 等	123,039	129,090	6,050	7,577	1,527	123,039	6,050	7,577	1,527	
その他の証券	86,656	92,806	6,150	7,914	1,763	86,656	6,150	7,914	1,763	
買入金銭債権	9,163	10,547	1,384	1,384	—	9,163	1,384	1,384	—	
譲渡性預金	42,000	42,000	—	—	—	42,000	—	—	—	

(注) 1. 本表には、金融商品取引法上の有価証券として取り扱うことが適当と認められるもの等を含んでいます。

2. 外貨建責任準備金対応債券に係る換算差額△2,094百万円、及び外貨建その他有価証券のうち債券に係る換算差額の一部32,996百万円については、為替差損益として損益計算書に計上しています。

○満期保有目的の債券

(単位：百万円)

区 分	2017年度末			2018年度上半期末		
	貸借対照表 計上額	時 価	差 額	貸借対照表 計上額	時 価	差 額
時価が貸借対照表計上額 を超えるもの	5,366	6,249	883	5,123	5,923	800
公 社 債	2,394	2,640	245	2,273	2,494	220
買入金銭債権	2,971	3,609	637	2,849	3,429	579
時価が貸借対照表計上額 を超えないもの	—	—	—	—	—	—

○責任準備金対応債券

(単位：百万円)

区 分	2017年度末			2018年度上半期末		
	貸借対照表 計上額	時 価	差 額	貸借対照表 計上額	時 価	差 額
時価が貸借対照表計上額 を超えるもの	2,033,583	2,376,415	342,832	1,938,812	2,233,769	294,957
公 社 債	1,995,587	2,338,000	342,412	1,881,181	2,175,742	294,561
外国証券	37,995	38,415	419	57,630	58,026	395
時価が貸借対照表計上額 を超えないもの	39,710	38,322	△1,388	167,531	163,820	△3,711
公 社 債	37,174	35,815	△1,358	157,590	153,944	△3,645
外国証券	2,536	2,506	△29	9,941	9,875	△65

○その他有価証券

(単位：百万円)

区 分	2017年度末			2018年度上半期末		
	帳簿価額	貸借対照表計上額	差 額	帳簿価額	貸借対照表計上額	差 額
貸借対照表計上額が帳簿価額を超えるもの	1,902,937	2,229,854	326,916	1,929,447	2,244,796	315,348
公 社 債	931,419	1,000,610	69,191	831,231	888,150	56,918
株 式	180,434	370,828	190,393	176,596	360,651	184,054
外 国 証 券	733,946	792,779	58,832	896,265	961,921	65,656
そ の 他 の 証 券	50,491	58,090	7,598	19,040	26,954	7,914
買 入 金 銭 債 権	6,645	7,545	900	6,314	7,118	804
貸借対照表計上額が帳簿価額を超えないもの	928,365	882,459	△45,906	993,697	962,694	△31,003
公 社 債	80,514	76,900	△3,614	177,883	175,575	△2,307
株 式	20,456	17,115	△3,341	23,727	21,215	△2,512
外 国 証 券	746,188	708,482	△37,706	682,469	658,050	△24,419
そ の 他 の 証 券	39,205	37,961	△1,243	67,616	65,852	△1,763
譲 渡 性 預 金	42,000	42,000	—	42,000	42,000	—

・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次のとおりです。

(単位：百万円)

区 分	2017年度末	2018年度上半期末
満期保有目的の債券	—	—
責任準備金対応債券	—	—
子会社・関連会社株式	2,053	1,901
その他有価証券	90,664	83,535
非上場国内株式	10,664	10,535
非上場外国株式(店頭売買株式を除く)	80,000	73,000
合 計	92,718	85,436

3. 金銭の信託の時価情報

(単位：百万円)

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	差 益	差 損	貸借対照表計上額	時 価	差 損 益	差 益	差 損
金 銭 の 信 託	200	200	—	—	—	200	200	—	—	—

(注) 本表記載の金銭の信託は全て「取得原価をもって貸借対照表に計上している預金と同様の性格の合同運用の指定金銭信託」です。
なお運用目的、満期保有目的、責任準備金対応の金銭の信託は保有していません。

4. デリバティブ取引の時価情報（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：百万円）

2017年度末						
	金利関連	通貨関連	株式関連	債券関連	その他	合計
ヘッジ会計適用分	31	—	—	—	—	31
ヘッジ会計非適用分	—	22,189	△2,419	—	—	19,769
合計	31	22,189	△2,419	—	—	19,801
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
ヘッジ会計適用分	23	—	—	—	—	23
ヘッジ会計非適用分	—	△23,493	△1,510	—	—	△25,004
合計	23	△23,493	△1,510	—	—	△24,980

（注）ヘッジ会計非適用分の差損益については、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

①金利関連

2017年度末、2018年度上半期末ともに該当する残高はありません。

②通貨関連

（単位：百万円）

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	1,114,370	—	22,373	22,373	1,104,240	—	△23,330	△23,330
	米ドル ユーロ	333,099	—	6,962	6,962	323,940	—	△8,914	△8,914
	通貨スワップ	781,270	—	15,411	15,411	780,299	—	△14,415	△14,415
	円払 / 豪ドル受	5,700	5,700	△184	△184	5,700	5,700	△163	△163
	円払 / 豪ドル受	5,700	5,700	△184	△184	5,700	5,700	△163	△163
合計				22,189				△23,493	

（注）1. 各期末の為替相場は先物相場を使用しています。

2. 差損益欄には、時価を記載しています。

③株式関連

（単位：百万円）

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	株価指数先 売 建	5,016	—	△39	△39	2,691	—	△227	△227
	株価指数オプション 売 建	3,831	—	166	△166	1,451	—	236	△236
店頭	コール	(0)				(0)			
	プット	10,009	—	54	△2,213	3,895	—	0	△1,047
合計		(2,267)			△2,419	(1,047)		0	△1,510

（注）1. 括弧内には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。

④債券関連

2017年度末、2018年度上半期末ともに該当する残高はありません。

⑤その他

2017年度末、2018年度上半期末ともに該当する残高はありません。

(3) ヘッジ会計が適用されているもの

①金利関連

(単位：百万円)

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	うち1年超	時価	契約額等	うち1年超	時価
原則的処理方法	金利スワップ 固定金利受取/ 変動金利支払	貸付金	263	263	1	263	263	1
金利スワップの特例処理	金利スワップ 固定金利受取/ 変動金利支払	貸付金	2,860	1,860	29	1,860	1,860	22
合計					31			23

(参考) 金利スワップ残存期間別残高

(単位：百万円、%)

2017年度末								
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	合計	
受取側固定スワップ想定元本	1,000	1,063	860	200	—	—	3,123	
平均受取固定金利	0.62	0.96	0.80	1.43	—	—	0.84	
平均支払変動金利	0.22	0.48	0.48	0.58	—	—	0.40	
支払側固定スワップ想定元本	—	—	—	—	—	—	—	
平均受取変動金利	—	—	—	—	—	—	—	
平均支払固定金利	—	—	—	—	—	—	—	
支払/受取共に変動スワップ想定元本	—	—	—	—	—	—	—	
平均受取変動金利	—	—	—	—	—	—	—	
平均支払変動金利	—	—	—	—	—	—	—	
合計	1,000	1,063	860	200	—	—	3,123	
2018年度上半期末								
受取側固定スワップ想定元本	—	1,923	200	—	—	—	2,123	
平均受取固定金利	—	0.89	1.43	—	—	—	0.94	
平均支払変動金利	—	0.48	0.58	—	—	—	0.49	
支払側固定スワップ想定元本	—	—	—	—	—	—	—	
平均受取変動金利	—	—	—	—	—	—	—	
平均支払固定金利	—	—	—	—	—	—	—	
支払/受取共に変動スワップ想定元本	—	—	—	—	—	—	—	
平均受取変動金利	—	—	—	—	—	—	—	
平均支払変動金利	—	—	—	—	—	—	—	
合計	—	1,923	200	—	—	—	2,123	

②通貨関連

(単位：百万円)

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 (注) 1)	うち1年超	時価	契約額等 (注) 1)	うち1年超	時価
為替予約の振当処理	為替予約	外貨建定期預金	59,845	—	(注) 2)	59,828	—	(注) 2)

(注) 1. 為替予約の振当処理の契約額等は、ヘッジ対象としている外貨建定期預金と一体で処理しているため、当該外貨建定期預金の貸借対照表計上額（時価）と同額となります。

当該外貨建定期預金は短期間で決済されるため、金利変動を考慮する重要性が乏しいことから時価は帳簿価額と同額としています。

2. 為替予約の振当処理の時価は上記の契約額等を含めています。

③株式関連

2017年度末、2018年度上半期末ともに該当する残高はありません。

④債券関連

2017年度末、2018年度上半期末ともに該当する残高はありません。

⑤その他

2017年度末、2018年度上半期末ともに該当する残高はありません。

IV. その他

1. 資産査定状況等

当社は、資産の健全性確保のため、毎決算期末において資産の自己査定を実施し、その結果を反映した適正な償却・引当処理を行っています。

○債務者区分による債権の状況

(単位：百万円)

区 分	2018年度上半期末						
	債権額 (C)	貸付金	その他	担保・保証 等	引当金	保全額 (D)	保全率 (D) / (C)
破産更生債権及びこれらに準ずる債権	—	—	—	—	—	—	—
危険債権	126	126	—	126	—	126	100.0%
要管理債権	—	—	—	—	—	—	—
小計 (A)	126	126	—	126	—	126	100.0%
正常債権 (B)	1,300,658	1,067,320	233,337				
合計 (A+B)	1,300,785	1,067,447	233,337				
						(A) / (A+B)	0.01%

区 分	2017年度末		
	債権額	保全額	保全率
破産更生債権及びこれらに準ずる債権	8	8	100.0%
危険債権	132	132	100.0%
要管理債権	—	—	—
小計 (A)	141	141	100.0%
正常債権 (B)	1,398,558		
合計 (A+B)	1,398,699		
	(A) / (A+B)		0.01%

- (注) 1. 破産更生債権及びこれらに準ずる債権とは、破産手続開始、更生手続開始又は再生手続開始の申立て等の事由により経営破綻に陥っている債務者に対する債権及びこれらに準ずる債権です。
2. 危険債権とは、債務者が経営破綻の状態には至っていないが、財政状態及び経営成績が悪化し、契約に従った債権の元本の回収及び利息の受取りができない可能性の高い債権です。
3. 要管理債権とは、3カ月以上延滞貸付金及び条件緩和貸付金です。なお、3カ月以上延滞貸付金とは、元本又は利息の支払が、約定支払日の翌日から3カ月以上遅延している貸付金(注1及び2に掲げる債権を除く)、条件緩和貸付金とは、債務者の経営再建又は支援を図ることを目的として、金利の減免、利息の支払猶予、元本の返済猶予、債権放棄その他の債務者に有利となる取決めを行った貸付金(注1及び2に掲げる債権並びに3カ月以上延滞貸付金を除く)です。
4. 正常債権とは、債務者の財政状態及び経営成績に特に問題がないものとして、注1から3までに掲げる債権以外のものに区分される債権です。
5. 破産更生債権及びこれらに準ずる債権のⅢ・Ⅳ分類については、償却・引当規程に基づき全額を個別貸倒引当金に計上するか又は直接減額し、危険債権のⅢ分類については、必要額を個別貸倒引当金に計上しています。なお、正常債権及び要管理債権については、貸倒実績率に基づき一般貸倒引当金を計上しています。
6. 保全率とは、担保・保証等による保全額及び引当金によるカバー率であり、(担保・保証等による保全額+引当金) / 債権額で算出しています。担保・保証等による保全額とは、担保・保証等により回収が見込まれる金額であり、担保については評価額に所定の掛目を乗じて算出しています。

(参考) リスク管理債権の保全率

(単位：百万円)

	2017年度末			2018年度上半期末				
	債権額	保全額	保全率	債権額	担保・保証 等	引当金	保全額	保全率
リスク管理債権	141	141	100.0%	126	126	—	126	100.0%

(参考) 貸付金に関わる自己査定分類金額

(単位：百万円)

	2017年度末	2018年度上半期末
第Ⅱ分類	5,362	652
第Ⅲ分類	—	—
第Ⅳ分類	—	—
合計額	5,362	652

2. 土地の時価情報

(単位:百万円)

	2017年度末	2018年度上半期末
時 価	157,375	154,236
貸 借 対 照 表 価 額	171,261	169,967
差 損 益	△13,886	△15,731

(注) 1. 時価は、公示価格等を基準に算定しています。
2. 上記には、借地権を含んでいます。