

## 平成28年度上半期決算 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・変額個人年金保険特別勘定

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. 貸倒引当金の明細	…… 22 頁
3. 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	前事業年度末 (平成28年3月31日)		当中間会計期間末 (平成28年9月30日)	
	金 額	占 率	金 額	占 率
国 債	2,318,534	48.7	2,329,669	48.8
地 方 債	233,289	4.9	215,495	4.5
社 債	459,204	9.7	472,743	9.9
うち公社・公団債	319,697	6.7	307,390	6.4
株 式	333,864	7.0	327,556	6.8
外 国 証 券	1,376,759	28.9	1,374,832	28.8
公 社 債	1,143,826	24.0	1,175,439	24.6
株 式 等	232,932	4.9	199,393	4.2
そ の 他 の 証 券	38,573	0.8	57,429	1.2
合 計	4,760,226	100.0	4,777,726	100.0

### (2) 有価証券残存期間別残高

(単位:百万円)

前事業年度末(平成28年3月31日)							
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	118,800	216,671	172,346	390,349	615,694	3,246,363	4,760,226
国 債	32,087	46,947	77,769	138,562	158,997	1,864,170	2,318,534
地 方 債	1,415	6,912	2,324	6,294	29,223	187,119	233,289
社 債	6,340	41,909	6,307	33,697	90,511	280,439	459,204
株 式	-	-	-	-	-	333,864	333,864
外 国 証 券	78,957	120,901	85,945	211,795	336,963	542,195	1,376,759
公 社 債	78,957	120,901	85,945	211,795	336,963	309,262	1,143,826
株 式 等	-	-	-	-	-	232,932	232,932
そ の 他 の 証 券	-	-	-	-	-	38,573	38,573
買 入 金 銭 債 権	1,720	-	-	-	-	14,994	16,715
譲 渡 性 預 金	42,000	-	-	-	-	-	42,000
合 計	162,520	216,671	172,346	390,349	615,694	3,261,358	4,818,941
当中間会計期間末(平成28年9月30日)							
有 価 証 券	77,325	200,451	197,209	423,743	602,573	3,276,422	4,777,726
国 債	6,032	55,473	79,070	155,477	156,566	1,877,047	2,329,669
地 方 債	2,611	4,673	-	12,740	20,761	174,706	215,495
社 債	5,858	39,616	13,452	58,440	79,393	275,981	472,743
株 式	-	-	-	-	-	327,556	327,556
外 国 証 券	62,822	100,687	104,686	197,084	345,851	563,700	1,374,832
公 社 債	62,822	100,687	104,686	197,084	345,851	364,307	1,175,439
株 式 等	-	-	-	-	-	199,393	199,393
そ の 他 の 証 券	-	-	-	-	-	57,429	57,429
買 入 金 銭 債 権	437	-	-	-	-	12,783	13,221
譲 渡 性 預 金	42,000	-	-	-	-	-	42,000
合 計	119,763	200,451	197,209	423,743	602,573	3,289,206	4,832,947

(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		前事業年度末 (平成28年3月31日)		当中間会計期間末 (平成28年9月30日)	
		金 額	占 率	金 額	占 率
水 産 ・ 農 林 業		-	-	-	-
鉱 業		448	0.1	452	0.1
建 設 業		15,637	4.7	14,530	4.4
製 造 業	食 料 品	17,681	5.3	16,884	5.1
	織 維 製 品	34,105	10.2	35,461	10.8
	パ ル プ ・ 紙	10,859	3.3	9,856	3.0
	化 学	24,991	7.5	26,760	8.2
	医 薬 品	13	0.0	13	0.0
	石 油 ・ 石 炭 製 品	4,298	1.3	3,770	1.1
	ゴ ム 製 品	30	0.0	30	0.0
	ガ ラ ス ・ 土 石 製 品	3,244	1.0	3,647	1.1
	鉄 鋼	935	0.3	940	0.3
	非 鉄 金 属	6,983	2.1	7,087	2.2
	金 属 製 品	1,727	0.5	1,543	0.5
	機 械	10,851	3.3	12,866	3.9
	電 気 機 器	28,283	8.5	29,334	9.0
	輸 送 用 機 器	49,224	14.7	48,157	14.7
	精 密 機 器	1,043	0.3	901	0.3
そ の 他 製 品	6,100	1.8	5,778	1.8	
電 気 ・ ガ ス 業		6,281	1.9	5,475	1.7
運 輸 ・ 情 報 通 信 業	陸 運 業	15,027	4.5	13,424	4.1
	海 運 業	2,477	0.7	2,502	0.8
	空 運 業	-	-	-	-
	倉 庫 ・ 運 輸 関 連 業	2,539	0.8	2,597	0.8
	情 報 ・ 通 信 業	104	0.0	99	0.0
商 業	卸 売 業	27,132	8.1	26,775	8.2
	小 売 業	13,553	4.1	12,089	3.7
金 融 ・ 保 険 業	銀 行 業	14,138	4.2	15,297	4.7
	証 券、商 品 先 物 取 引 業	4,682	1.4	4,321	1.3
	保 険 業	3,249	1.0	3,060	0.9
	そ の 他 金 融 業	4,367	1.3	4,535	1.4
不 動 産 業		19,793	5.9	15,811	4.8
サ ー ビ ス 業		4,056	1.2	3,550	1.1
合 計		333,864	100.0	327,556	100.0

(注)区分は証券コード協議会の業種別分類項目に準拠しています。

(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)

前事業年度末(平成28年3月31日)						
	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	64	-	-	-	-	64
ヘッジ会計非適用分	-	13,272	△ 1,202	-	-	12,070
合計	64	13,272	△ 1,202	-	-	12,135
当中間会計期間末(平成28年9月30日)						
	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	67	-	-	-	-	67
ヘッジ会計非適用分	-	31,185	△ 1,093	-	-	30,092
合計	67	31,185	△ 1,093	-	-	30,160

(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	前事業年度末(平成28年3月31日)				当中間会計期間末(平成28年9月30日)			
		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	金利スワップ								
	固定金利受取/変動金利支払	3,123	3,123	64	64	3,123	3,123	67	67
	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				64				67

(参考)金利スワップ残存期間別残高

(単位:百万円、%)

前事業年度末(平成28年3月31日)							
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	-	0.32	0.51	0.51	0.61	-	0.46
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
当中間会計期間末(平成28年9月30日)							
受取側固定スワップ想定元本	-	1,000	1,923	200	-	-	3,123
平均受取固定金利	-	0.62	0.89	1.43	-	-	0.84
平均支払変動金利	-	0.21	0.46	0.56	-	-	0.39
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	1,923	200	-	-	3,123

### ③通貨関連

(単位:百万円)

区分	種類	前事業年度末(平成28年3月31日)				当中間会計期間末(平成28年9月30日)			
		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	994,366	-	981,094	13,272	1,028,246	-	997,060	31,185
	アメリカドル	569,853	-	551,967	17,885	580,826	-	553,790	27,036
	ユーロ	424,513	-	429,126	△ 4,612	447,419	-	443,269	4,149
合計					13,272				31,185

(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。

### ④株式関連

(単位:百万円)

区分	種類	前事業年度末(平成28年3月31日)				当中間会計期間末(平成28年9月30日)			
		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	8,345	-	8,363	△ 17	17,602	-	17,389	212
	株価指数オプション 売 建	11,821 (0)	-	554	△ 554	- (-)	-	-	-
店頭	買 建 コール	34,257 (445)	-	0	△ 445	12,936 (13)	-	1	△ 12
	プット	52,612 (11,468)	20,605	11,283	△ 184	44,044 (9,860)	12,528	8,566	△ 1,293
合計					△ 1,202				△ 1,093

(注) 括弧内にはオプション料を記載しています。

### ⑤債券関連

前事業年度末、当中間会計期間末ともに保有していません。

### ⑥その他

前事業年度末、当中間会計期間末ともに保有していません。

## 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おります。

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、変額個人保険・変額個人年金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おります。

### (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
- 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おります。

#### 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、管理しております。

#### 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おります。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おります。

### (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おります。

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	前事業年度末 (平成28年3月31日)		当中間会計期間末 (平成28年9月30日)	
	金 額	占 率	金 額	占 率
保 険 約 款 貸 付	63,197	4.9	58,389	4.7
保 険 料 振 替 貸 付	8,890	0.7	8,072	0.7
契 約 者 貸 付	54,307	4.2	50,317	4.0
一 般 貸 付	1,238,669	95.1	1,196,297	95.3
(うち非居住者貸付)	(3,916)	(0.3)	(3,783)	(0.3)
企 業 貸 付	1,106,359	85.0	1,061,365	84.6
(うち国内企業向け)	(1,101,862)	(84.6)	(1,057,078)	(84.3)
国・国際機関・政府関係機関貸付	382	0.0	337	0.0
公 共 団 体 ・ 公 企 業 貸 付	29,922	2.3	29,706	2.4
住 宅 ロ ー ン	42,089	3.2	39,051	3.1
消 費 者 ロ ー ン	59,170	4.5	65,121	5.2
そ の 他	745	0.1	715	0.0
合 計	1,301,866	100.0	1,254,686	100.0

### (2) 貸付金残存期間別残高

(単位:百万円)

前事業年度末(平成28年3月31日)							
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
変動金利	578	23,083	15,354	3,219	2,564	37,640	82,441
固定金利	140,583	236,317	112,867	176,464	201,673	288,320	1,156,227
一般貸付計	141,162	259,400	128,221	179,684	204,238	325,961	1,238,669
当中間会計期間末(平成28年9月30日)							
変動金利	1,055	23,126	15,357	2,365	2,105	38,233	82,243
固定金利	137,856	178,921	114,232	178,391	213,902	290,749	1,114,053
一般貸付計	138,911	202,048	129,589	180,757	216,007	328,983	1,196,297

(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		前事業年度末 (平成28年3月31日)		当中間会計期間末 (平成28年9月30日)	
			占 率		占 率
大 企 業	貸付先数	148	72.5	137	70.6
	金 額	982,691	89.2	953,583	90.2
中 堅 企 業	貸付先数	5	2.5	4	2.1
	金 額	2,029	0.2	1,620	0.2
中 小 企 業	貸付先数	51	25.0	53	27.3
	金 額	117,141	10.6	101,874	9.6
国内企業向け 貸 付 計	貸付先数	204	100.0	194	100.0
	金 額	1,101,862	100.0	1,057,078	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人以下		資本金5千万円以下又は 常用する従業員50人以下		資本金5千万円以下又は 常用する従業員100人以下		資本金1億円以下又は 常用する従業員100人以下	

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		前事業年度末 (平成28年3月31日)		当中間会計期間末 (平成28年9月30日)		
		金 額	占 率	金 額	占 率	
内 国	製 造 業	212,864	17.2	195,106	16.3	
	食 料	14,300	1.2	14,300	1.2	
	織 維	6,250	0.5	6,250	0.5	
	木 材 ・ 木 製 品	-	-	-	-	
	パ ル プ ・ 紙	42,500	3.4	42,500	3.6	
	印 刷	-	-	-	-	
	化 学	21,308	1.7	18,553	1.5	
	石 油 ・ 石 炭	28,810	2.3	25,810	2.2	
	窯 業 ・ 土 石	5,550	0.5	5,214	0.4	
	鉄 鋼	15,800	1.3	12,800	1.1	
	非 鉄 金 属	9,174	0.7	10,067	0.8	
	金 属 製 品	-	-	-	-	
	はん用・生産用・業務用機械	3,616	0.3	3,574	0.3	
	電 気 機 械	25,023	2.0	22,466	1.9	
	輸 送 用 機 械	40,507	3.3	33,562	2.8	
	そ の 他 の 製 造 業	25	0.0	8	0.0	
	向 け	農 業 、 林 業	-	-	-	-
		漁 業	-	-	-	-
		鉱 業 、 採 石 業 、 砂 利 採 取 業	65	0.0	55	0.0
		建 設 業	7,511	0.6	7,372	0.6
電 気 ・ ガ ス ・ 熱 供 給 ・ 水 道 業		106,671	8.6	102,486	8.6	
情 報 通 信 業		27,220	2.2	26,650	2.2	
運 輸 業 、 郵 便 業		41,619	3.4	44,146	3.7	
卸 売 業		281,822	22.7	291,758	24.4	
小 売 業		1,300	0.1	500	0.0	
金 融 業 、 保 険 業		290,555	23.5	265,747	22.2	
不 動 産 業		120,245	9.7	119,105	10.0	
物 品 賃 貸 業		35,454	2.9	27,804	2.3	
学 術 研 究 、 専 門 ・ 技 術 サ ー ビ ス 業		200	0.0	-	-	
宿 泊 業		145	0.0	128	0.0	
飲 食 業		-	-	-	-	
生 活 関 連 サ ー ビ ス 業 、 娯 楽 業		66	0.0	49	0.0	
教 育 、 学 習 支 援 業		-	-	-	-	
医 療 ・ 福 祉		745	0.1	715	0.1	
そ の 他 の サ ー ビ ス		142	0.0	135	0.0	
地 方 公 共 団 体		6,282	0.5	6,076	0.5	
個 人 (住 宅 ・ 消 費 ・ 納 税 資 金 等)	101,259	8.2	104,173	8.7		
そ の 他	580	0.0	502	0.1		
合 計	1,234,753	99.7	1,192,513	99.7		
海 外 向 け	政 府 等	-	-	-	-	
	金 融 機 関	-	-	-	-	
	商 工 業 等	3,916	0.3	3,783	0.3	
合 計	3,916	0.3	3,783	0.3		
一 般 貸 付 計	1,238,669	100.0	1,196,297	100.0		

## (5)貸付金地域別内訳

(単位:百万円、%)

区 分	前事業年度末 (平成28年3月31日)		当中間会計期間末 (平成28年9月30日)	
	金 額	占 率	金 額	占 率
北 海 道	6,307	0.5	6,306	0.6
東 北	10,275	0.9	10,261	0.9
関 東	924,494	81.6	895,265	82.3
中 部	116,460	10.3	102,202	9.4
近 畿	51,083	4.5	49,764	4.6
中 国	4,396	0.4	4,258	0.4
四 国	4,725	0.4	4,665	0.4
九 州	15,749	1.4	15,617	1.4
合 計	1,133,493	100.0	1,088,340	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	前事業年度末 (平成28年3月31日)		当中間会計期間末 (平成28年9月30日)	
	金 額	占 率	金 額	占 率
担 保 貸 付	1,678	0.1	1,552	0.1
有 価 証 券 担 保 貸 付	-	-	-	-
不 動 産・動 産・財 団 担 保 貸 付	1,678	0.1	1,552	0.1
指 名 債 権 担 保 貸 付	-	-	-	-
保 証 貸 付	21,656	1.8	21,115	1.8
信 用 貸 付	1,114,074	89.9	1,069,456	89.4
そ の 他	101,259	8.2	104,173	8.7
一 般 貸 付 計	1,238,669	100.0	1,196,297	100.0
う ち 劣 後 特 約 付 貸 付	174,000	14.0	197,000	16.5

### 3. 海外投融資関係

#### (1) 資産別明細

##### ① 外貨建資産

(単位:百万円、%)

区 分	前事業年度末(平成28年3月31日)		当中間会計期間末(平成28年9月30日)	
	金 額	占 率	金 額	占 率
公 社 債	1,088,243	73.8	1,162,459	76.6
株 式	10,651	0.7	-	-
現 預 金 ・ そ の 他	150,490	10.2	127,604	8.4
小 計	1,249,385	84.7	1,290,064	85.0

##### ② 円貨額が確定した外貨建資産

(単位:百万円、%)

区 分	前事業年度末(平成28年3月31日)		当中間会計期間末(平成28年9月30日)	
	金 額	占 率	金 額	占 率
公 社 債	-	-	-	-
現 預 金 ・ そ の 他	71,969	4.9	75,950	5.0
小 計	71,969	4.9	75,950	5.0

##### ③ 円貨建資産

(単位:百万円、%)

区 分	前事業年度末(平成28年3月31日)		当中間会計期間末(平成28年9月30日)	
	金 額	占 率	金 額	占 率
非 居 住 者 貸 付	3,916	0.3	3,783	0.3
公 社 債 (円 建 外 債) ・ そ の 他	148,877	10.1	147,124	9.7
小 計	152,793	10.4	150,908	10.0

##### ④ 合 計

(単位:百万円、%)

区 分	前事業年度末(平成28年3月31日)		当中間会計期間末(平成28年9月30日)	
	金 額	占 率	金 額	占 率
海 外 投 融 資	1,474,148	100.0	1,516,922	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	前事業年度末 (平成28年3月31日)		当中間会計期間末 (平成28年9月30日)	
	金 額	占 率	金 額	占 率
米 ド ル	707,021	56.6	676,730	52.5
カ ナ ダ ド ル	-	-	-	-
豪 ド ル	101,088	8.1	133,353	10.3
ユ ー ロ	441,272	35.3	479,976	37.2
英 ポ ン ド	-	-	-	-
ス イ ス フ ラ ン	-	-	-	-
そ の 他	3	0.0	3	0.0
合 計	1,249,385	100.0	1,290,064	100.0

## (3)海外投融資の地域別構成

(単位:百万円、%)

前事業年度末(平成28年3月31日)								
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					
北 米	606,747	44.1	565,732	49.5	41,014	17.6	-	-
ヨ ー ロ ッ パ	662,888	48.2	476,642	41.7	186,245	80.0	-	-
オ セ ア ニ ア	67,804	4.9	67,804	5.9	-	-	-	-
ア ジ ア	5,671	0.4	-	-	5,671	2.4	-	-
中 南 米	-	-	-	-	-	-	3,916	100.0
中 東	-	-	-	-	-	-	-	-
ア フ リ カ	-	-	-	-	-	-	-	-
国 際 機 関	33,646	2.4	33,646	2.9	-	-	-	-
合 計	1,376,759	100.0	1,143,826	100.0	232,932	100.0	3,916	100.0
当中間会計期間末(平成28年9月30日)								
北 米	578,037	42.0	552,867	47.0	25,170	12.6	-	-
ヨ ー ロ ッ パ	678,978	49.4	510,036	43.4	168,942	84.7	-	-
オ セ ア ニ ア	95,159	6.9	95,159	8.1	-	-	-	-
ア ジ ア	5,280	0.4	-	-	5,280	2.7	-	-
中 南 米	-	-	-	-	-	-	3,783	100.0
中 東	-	-	-	-	-	-	-	-
ア フ リ カ	-	-	-	-	-	-	-	-
国 際 機 関	17,376	1.3	17,376	1.5	-	-	-	-
合 計	1,374,832	100.0	1,175,439	100.0	199,393	100.0	3,783	100.0

## II. 個人変額保険・変額個人年金保険特別勘定

### 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	前事業年度末(平成28年3月31日)		当中間会計期間末(平成28年9月30日)	
	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	70,722	△ 7,113	64,650	△ 3,019
公 社 債	20,385	759	19,161	△ 369
株 式	24,531	△ 4,793	22,250	△ 985
外 国 証 券	20,445	△ 2,675	18,163	△ 1,506
公 社 債	7,880	△ 687	6,241	△ 566
株 式 等	12,564	△ 1,987	11,921	△ 940
そ の 他 の 証 券	5,359	△ 403	5,075	△ 158

(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。

(変額個人年金保険)

(単位:百万円)

区 分	前事業年度末(平成28年3月31日)		当中間会計期間末(平成28年9月30日)	
	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	187,765	△ 43,618	146,704	△ 9,181
公 社 債	20,320	399	17,258	△ 409
株 式	7,716	△ 2,752	6,386	△ 372
外 国 証 券	6,607	△ 1,601	4,550	△ 457
公 社 債	2,513	△ 328	1,467	△ 135
株 式 等	4,093	△ 1,272	3,082	△ 322
そ の 他 の 証 券	153,122	△ 39,664	118,509	△ 7,942

(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)

前事業年度末、当中間会計期間末ともに売買目的有価証券以外の有価証券は保有していません。

(変額個人年金保険)

前事業年度末、当中間会計期間末ともに売買目的有価証券以外の有価証券は保有していません。

### 3. 金銭の信託の時価情報

(個人変額保険)

前事業年度末、当中間会計期間末ともに保有していません。

(変額個人年金保険)

前事業年度末、当中間会計期間末ともに保有していません。

#### 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・変額個人年金保険特別勘定)

##### 【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)

前事業年度末、当中間会計期間末ともに保有していないため記載していません。

##### (2) 金利関連

前事業年度末、当中間会計期間末ともに保有していません。

##### (3) 通貨関連

前事業年度末、当中間会計期間末ともに保有していません。

##### (4) 株式関連

前事業年度末、当中間会計期間末ともに保有していません。

##### (5) 債券関連

前事業年度末、当中間会計期間末ともに保有していません。

##### (6) その他

前事業年度末、当中間会計期間末ともに保有していません。

【変額個人年金保険】

(1) 差損益の内訳(ヘッジ会計適用分・非適用分の内訳)

(単位:百万円)

前事業年度末(平成28年3月31日)						
	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	-	-	-	-	-	-
合計	-	-	-	-	-	-
当中間会計期間末(平成28年9月30日)						
	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
合計	-	0	-	-	-	0

(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

前事業年度末、当中間会計期間末ともに保有していません。

(3) 通貨関連

(単位:百万円)

区分	種類	前事業年度末(平成28年3月31日)				当中間会計期間末(平成28年9月30日)			
		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	-	-	-	-	0	-	0	0
	売建	-	-	-	-	0	-	0	0
	合計	-	-	-	-	-	-	-	0

(注) 各期末の為替相場は先物相場を使用しています。

(4) 株式関連

前事業年度末、当中間会計期間末ともに保有していません。

(5) 債券関連

前事業年度末、当中間会計期間末ともに保有していません。

(6) その他

前事業年度末、当中間会計期間末ともに保有していません。

### 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	前事業年度末(平成28年3月31日)		当中間会計期間末(平成28年9月30日)	
	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	340,608	△ 55,881	289,867	△ 14,508
公 社 債	79,667	2,574	75,176	△ 1,127
株 式	52,020	△ 11,428	47,031	△ 1,798
外 国 証 券	50,437	△ 6,959	44,075	△ 3,480
公 社 債	17,700	△ 1,595	13,885	△ 1,250
株 式 等	32,737	△ 5,364	30,189	△ 2,230
その他の証券	158,482	△ 40,068	123,584	△ 8,101

(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	前事業年度末(平成28年3月31日)								
	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	9,402	10,729	1,327	1,327	-	9,402	1,327	1,327	-
公 社 債	5,460	5,916	456	456	-	5,460	456	456	-
買入金銭債権	3,942	4,813	870	870	-	3,942	870	870	-
責任準備金対応債券	1,950,319	2,439,098	488,778	488,778	-	1,950,319	488,778	488,778	-
公 社 債	1,950,319	2,439,098	488,778	488,778	-	1,950,319	488,778	488,778	-
子会社・関連会社株式	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他の有価証券	2,445,994	2,743,804	297,810	327,161	29,351	2,479,534	264,270	280,048	15,778
公 社 債	953,876	1,055,248	101,372	101,520	148	953,747	101,500	101,520	19
株 式	202,046	321,889	119,842	128,465	8,622	202,046	119,842	128,465	8,622
外 国 証 券	1,198,924	1,274,401	75,477	92,917	17,440	1,232,593	41,808	45,804	3,995
公 社 債	1,067,877	1,143,826	75,949	89,688	13,738	1,101,545	42,280	42,575	294
株 式 等	131,047	130,575	△ 472	3,229	3,701	131,047	△ 472	3,229	3,701
その他の証券	37,779	37,491	△ 287	2,852	3,140	37,779	△ 287	2,852	3,140
買入金銭債権	11,366	12,773	1,406	1,406	-	11,366	1,406	1,406	-
譲渡性預金	42,000	42,000	-	-	-	42,000	-	-	-
合 計	4,405,716	5,193,632	787,916	817,267	29,351	4,439,256	754,376	770,154	15,778
公 社 債	2,909,656	3,500,263	590,607	590,755	148	2,909,527	590,735	590,755	19
株 式	202,046	321,889	119,842	128,465	8,622	202,046	119,842	128,465	8,622
外 国 証 券	1,198,924	1,274,401	75,477	92,917	17,440	1,232,593	41,808	45,804	3,995
公 社 債	1,067,877	1,143,826	75,949	89,688	13,738	1,101,545	42,280	42,575	294
株 式 等	131,047	130,575	△ 472	3,229	3,701	131,047	△ 472	3,229	3,701
その他の証券	37,779	37,491	△ 287	2,852	3,140	37,779	△ 287	2,852	3,140
有価証券合計	4,348,407	5,134,046	785,639	814,990	29,351	4,381,947	752,099	767,877	15,778
買入金銭債権	15,309	17,586	2,277	2,277	-	15,309	2,277	2,277	-
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. 外貨建その他有価証券の為替換算差額の一部等については、損益計算書に計上しています。上表では、決算処理後の差損益を適切に開示するため、帳簿価額ベースに加えて、同為替換算差額等33,539百万円を損益計算書に計上した後のベースでの差損益についても記載しています。

3. 投資事業組合及び外国投資事業組合は「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」に含めて開示していますが、投資事業組合が保有する「その他有価証券」の評価差額については持分相当額34百万円を投資事業組合の貸借対照表価額に含めて計上しています。



(単位:百万円)

区 分	当中間会計期間末(平成28年9月30日)									
	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	8,633	9,852	1,218	1,218	-	8,633	1,218	1,218	-	
公 社 債	5,104	5,495	390	390	-	5,104	390	390	-	
買入金銭債権	3,528	4,356	828	828	-	3,528	828	828	-	
責任準備金対応債券	1,958,826	2,454,531	495,704	496,252	548	1,958,826	495,704	496,252	548	
公 社 債	1,958,826	2,454,531	495,704	496,252	548	1,958,826	495,704	496,252	548	
子会社・関連会社株式	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
その他の有価証券	2,582,900	2,761,301	178,401	274,464	96,063	2,499,791	261,510	284,315	22,805	
公 社 債	951,077	1,053,976	102,898	103,549	651	950,490	103,485	103,652	166	
株 式	202,063	315,917	113,854	123,531	9,677	202,063	113,854	123,531	9,677	
外 国 証 券	1,322,734	1,283,127	△ 39,607	43,551	83,158	1,240,212	42,914	53,299	10,385	
公 社 債	1,206,119	1,175,439	△ 30,680	42,208	72,888	1,123,597	51,841	51,956	115	
株 式 等	116,614	107,688	△ 8,926	1,342	10,269	116,614	△ 8,926	1,342	10,269	
その他の証券	56,620	56,588	△ 31	2,544	2,575	56,620	△ 31	2,544	2,575	
買入金銭債権	8,405	9,692	1,287	1,287	-	8,405	1,287	1,287	-	
譲渡性預金	42,000	42,000	-	-	-	42,000	-	-	-	
合 計	4,550,360	5,225,685	675,324	771,936	96,611	4,467,251	758,433	781,787	23,353	
公 社 債	2,915,009	3,514,002	598,993	600,192	1,199	2,914,422	599,580	600,295	714	
株 式	202,063	315,917	113,854	123,531	9,677	202,063	113,854	123,531	9,677	
外 国 証 券	1,322,734	1,283,127	△ 39,607	43,551	83,158	1,240,212	42,914	53,299	10,385	
公 社 債	1,206,119	1,175,439	△ 30,680	42,208	72,888	1,123,597	51,841	51,956	115	
株 式 等	116,614	107,688	△ 8,926	1,342	10,269	116,614	△ 8,926	1,342	10,269	
その他の証券	56,620	56,588	△ 31	2,544	2,575	56,620	△ 31	2,544	2,575	
有価証券合計	4,496,427	5,169,635	673,208	769,820	96,611	4,413,317	756,317	779,671	23,353	
買入金銭債権	11,933	14,049	2,116	2,116	-	11,933	2,116	2,116	-	
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いを行うことが適当と認められるもの等を含んでいます。

2. 外貨建その他有価証券の為替換算差額の一部等については、損益計算書に計上しています。上表では、決算処理後の差損益を適切に開示するため、帳簿価額ベースに加えて、同為替換算差額等△83,109百万円を損益計算書に計上した後のベースでの差損益についても記載しています。

## ○満期保有目的の債券

(単位:百万円)

区 分	前事業年度末(平成28年3月31日)			当中間会計期間末(平成28年9月30日)		
	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	9,402	10,729	1,327	8,633	9,852	1,218
公 社 債	5,460	5,916	456	5,104	5,495	390
買入金銭債権	3,942	4,813	870	3,528	4,356	828
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	前事業年度末(平成28年3月31日)			当中間会計期間末(平成28年9月30日)		
	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	1,950,319	2,439,098	488,778	1,921,560	2,417,813	496,252
公 社 債	1,950,319	2,439,098	488,778	1,921,560	2,417,813	496,252
時価が貸借対照表計上額を 超えないもの	-	-	-	37,266	36,717	△ 548
公 社 債	-	-	-	37,266	36,717	△ 548

○その他有価証券

(単位:百万円)

区 分	前事業年度末(平成28年3月31日)			当中間会計期間末(平成28年9月30日)		
	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	1,803,935	2,131,097	327,161	1,416,048	1,690,513	274,464
公 社 債	949,360	1,050,880	101,520	928,210	1,031,760	103,549
株 式	155,990	284,456	128,465	155,890	279,422	123,531
外 国 証 券	676,615	769,533	92,917	308,490	352,041	43,551
そ の 他 の 証 券	10,601	13,453	2,852	15,213	17,757	2,544
買 入 金 銭 債 権	11,366	12,773	1,406	8,243	9,531	1,287
貸借対照表計上額が帳簿価額を超えないもの	642,058	612,707	△ 29,351	1,166,852	1,070,788	△ 96,063
公 社 債	4,516	4,368	△ 148	22,867	22,215	△ 651
株 式	46,055	37,432	△ 8,622	46,172	36,495	△ 9,677
外 国 証 券	522,309	504,868	△ 17,440	1,014,243	931,085	△ 83,158
そ の 他 の 証 券	27,177	24,037	△ 3,140	41,406	38,830	△ 2,575
買 入 金 銭 債 権	-	-	-	161	161	-
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	前事業年度末 (平成28年3月31日)	当中間会計期間末 (平成28年9月30日)
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	1,801	1,594
そ の 他 の 有 価 証 券	112,858	102,593
非 上 場 国 内 株 式	11,221	10,885
非上場外国株式等(店頭売買株式を除く)	101,636	91,707
合 計	114,659	104,187

(注) 前事業年度末の非上場外国株式等(店頭売買株式を除く)には、外貨建てのものが含まれており、その為替換算差額には損益計算書に計上せず貸借対照表価額に含めて計上しているものがあります。当該為替換算差額の金額は、722百万円です。

3. 金銭の信託の時価情報

(単位:百万円)

区 分	前事業年度末(平成28年3月31日)					当中間会計期間末(平成28年9月30日)				
	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	
				差 益	差 損				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)

前事業年度末(平成28年3月31日)						
	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	64	-	-	-	-	64
ヘッジ会計非適用分	-	13,272	△ 1,199	-	-	12,072
合計	64	13,272	△ 1,199	-	-	12,137
当中間会計期間末(平成28年9月30日)						
	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	67	-	-	-	-	67
ヘッジ会計非適用分	-	31,185	△ 1,100	-	-	30,085
合計	67	31,185	△ 1,100	-	-	30,153

(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

前事業年度末、当中間会計期間末ともに保有していません。

###### ②通貨関連

(単位:百万円)

区分	種類	前事業年度末(平成28年3月31日)				当中間会計期間末(平成28年9月30日)			
		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	為替予約建	994,366	-	981,094	13,272	1,028,246	-	997,060	31,185
	アメリカドル	569,853	-	551,967	17,885	580,826	-	553,790	27,036
	ユーロ	424,513	-	429,126	△ 4,612	447,419	-	443,269	4,149
	合計				13,272				31,185

(注) 各期末の為替相場は先物相場を使用しています。

###### ③株式関連

(単位:百万円)

区分	種類	前事業年度末(平成28年3月31日)				当中間会計期間末(平成28年9月30日)			
		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	株価指数先物買建	145	-	148	2	403	-	396	△ 7
店頭	株価指数先物売建	8,345	-	8,363	△ 17	17,602	-	17,389	212
	株価指数オプション売建	11,821	-	554	△ 554	-	-	-	-
	コール	(0)				(-)			
	プット	34,257	-	0	△ 445	12,936	-	1	△ 12
	合計	52,612	20,605	11,283	△ 184	44,044	12,528	8,566	△ 1,293
	合計	(11,468)			△ 1,199	(9,860)			△ 1,100

(注) 括弧内にはオプション料を記載しています。

④債券関連

前事業年度末、当中間会計期間末ともに保有していません。

⑤その他

前事業年度末、当中間会計期間末ともに保有していません。

(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	前事業年度末(平成28年3月31日)			当中間会計期間末(平成28年9月30日)		
			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	4	263	263	4
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	2,860	60	2,860	2,860	63
合 計					64			67

(参考)金利スワップ残存期間別残高

(単位:百万円、%)

前事業年度末(平成28年3月31日)							
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	-	0.32	0.51	0.51	0.61	-	0.46
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
当中間会計期間末(平成28年9月30日)							
受取側固定スワップ想定元本	-	1,000	1,923	200	-	-	3,123
平均受取固定金利	-	0.62	0.89	1.43	-	-	0.84
平均支払変動金利	-	0.21	0.46	0.56	-	-	0.39
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	1,923	200	-	-	3,123

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	前事業年度末(平成28年3月31日)			当中間会計期間末(平成28年9月30日)		
			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	71,931	-	((注)2)	75,896	-	((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に含めています。

③株式関連

前事業年度末、当中間会計期間末ともに保有していません。

④債券関連

前事業年度末、当中間会計期間末ともに保有していません。

⑤その他

前事業年度末、当中間会計期間末ともに保有していません。

## 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	当中間会計期間末(平成28年9月30日)						
	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	9	9	-	9	-	9	100.0%
危険債権	157	157	-	157	-	157	100.0%
要管理債権	-	-	-	-	-	-	-
小計 (A)	166	166	-	166	-	166	100.0%
正常債権 (B)	1,562,791	1,254,519	308,271				
合計 (A+B)	1,562,957	1,254,686	308,271				
						(A)/(A+B)	0.01%

区 分	前事業年度末(平成28年3月31日)		
	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	1	1	100.0%
危険債権	164	163	99.7%
要管理債権	-	-	-
小計 (A)	165	165	99.7%
正常債権 (B)	1,531,765		
合計 (A+B)	1,531,931		
		(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か月以上延滞貸付金及び条件緩和貸付金です。なお、3か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か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か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)

	前事業年度末(平成28年3月31日)			当中間会計期間末(平成28年9月30日)				
	債権額	保全額計	保全率	債権額	担保・保証 等	引当金	保全額計	保全率
リスク管理債権	165	165	99.7%	166	166	-	166	100.0%

#### (参考)貸付金に関わる自己査定分類金額

(単位:百万円)

	前事業年度末 (平成28年3月31日)	当中間会計期間末 (平成28年9月30日)
第Ⅱ分類	253	288
第Ⅲ分類	0	-
第Ⅳ分類	-	-
合計額	253	288

## 2. 貸倒引当金の明細

(単位:百万円)

摘 要	前事業年度	当中間会計期間
	(自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	(自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)
(1) 貸倒引当金残高の内訳		
(イ) 一般貸倒引当金	146	150
(ロ) 個別貸倒引当金	379	378
(ハ) 特定海外債権引当勘定	—	—
(2) 個別貸倒引当金		
(イ) 繰入額	5	1
(ロ) 取崩額 [償却等に伴う取崩額を除く]	11	2
(ハ) 繰入額	△ 6	△ 0
(3) 特定海外債権引当勘定		
(イ) 対象国数	—	—
(ロ) 債権額	—	—
(ハ) 繰入額	—	—
(ニ) 取崩額	—	—
(4) 貸付金償却	—	—

## 3. 土地の時価情報

(単位:百万円)

	前事業年度末 (平成28年3月31日)	当中間会計期間末 (平成28年9月30日)
時 価	150,201	152,595
貸借対照表価額	173,421	173,060
差 損 益	△ 23,220	△ 20,464

(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。