

# 平成28年度 第2四半期(上半期)報告 補足資料

## 1. 一般勘定

### a. 有価証券関係

(1) 有価証券明細表	・・・	1 頁
(2) 地域別地方債保有内訳	・・・	1 頁
(3) 有価証券残存期間別残高	・・・	2 頁
(4) 業種別株式保有の状況	・・・	3 頁

### b. 貸付金関係

(1) 貸付金明細表	・・・	4 頁
(2) 国内企業向け貸付金企業規模別内訳	・・・	4 頁
(3) 貸付金残存期間別残高	・・・	5 頁
(4) 貸付金業種別内訳	・・・	6 頁
(5) 貸付金担保別内訳	・・・	7 頁
(6) 貸付金地域別内訳	・・・	7 頁

### c. 海外投融資の状況

(1) 資産別明細	・・・	8 頁
(2) 海外投融資の地域別構成	・・・	9 頁
(3) 外貨建資産の通貨別構成	・・・	9 頁

## 2. 個人変額保険・変額個人年金保険 特別勘定

a. 売買目的有価証券の評価損益	・・・	10 頁
b. 金銭の信託の時価情報	・・・	10 頁
c. デリバティブ取引の時価情報	・・・	11 頁

## 3. 会社計

a. 資産の構成	・・・	13 頁
b. 有価証券の時価情報	・・・	14 頁
c. 金銭の信託の時価情報	・・・	15 頁
d. デリバティブ取引の時価情報	・・・	16 頁

## 1. 一般勘定

### a. 有価証券関係

#### (1) 有価証券明細表

(単位：百万円、%)

区 分	平成27年度末		平成28年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
国 債	10,120,674	45.9	10,046,507	43.7
地 方 債	66,816	0.3	106,041	0.5
社 債	2,795,333	12.7	2,971,734	12.9
うち公社・公団債	1,948,847	8.8	1,966,894	8.6
株 式	1,438,497	6.5	1,455,640	6.3
外 国 証 券	7,600,287	34.4	8,363,912	36.4
公 社 債	6,677,711	30.3	7,455,732	32.4
うち外貨建	4,955,239	22.5	5,780,294	25.1
株 式 等	922,576	4.2	908,179	4.0
うち外貨建	598,980	2.7	588,406	2.6
そ の 他 の 証 券	42,349	0.2	46,324	0.2
合 計	22,063,959	100.0	22,990,161	100.0
うち外貨建	5,673,862	25.7	6,570,149	28.6

#### (2) 地域別地方債保有内訳

(単位：百万円)

区 分	平成27年度末	平成28年度 第2四半期(上半期)末
北 海 道	-	-
東 北	-	-
関 東	39,492	54,550
中 部	10,626	22,802
近 畿	8,108	14,865
中 国	118	118
四 国	-	-
九 州	8,471	13,704
合 計	66,816	106,041

### (3) 有価証券残存期間別残高

<平成27年度末>

(単位：百万円)

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 ないもの	合 計
有 価 証 券	1,045,380	1,316,490	1,232,367	1,250,163	2,568,935	12,088,828	2,561,793	22,063,959
国 債	199,294	191,230	219,775	422,022	488,133	8,600,218	-	10,120,674
地 方 債	4,161	1,923	4,048	-	8,806	47,877	-	66,816
社 債	245,288	241,256	106,764	120,586	422,840	1,500,030	158,565	2,795,333
株 式							1,438,497	1,438,497
外 国 証 券	596,636	882,080	901,777	707,442	1,649,097	1,940,701	922,551	7,600,287
公 社 債	596,611	882,080	901,777	707,442	1,649,097	1,940,701	-	6,677,711
株 式 等	24	-	-	-	-	-	922,551	922,576
その他の証券	-	-	-	111	58	-	42,179	42,349
買入金銭債権	6,459	-	-	-	-	164,126	-	170,586
譲渡性預金	368,478	-	-	-	-	-	-	368,478
そ の 他	-	-	-	-	-	-	-	-
合 計	1,420,319	1,316,490	1,232,367	1,250,163	2,568,935	12,252,955	2,561,793	22,603,024

<平成28年度第2四半期(上半期)末>

(単位：百万円)

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 ないもの	合 計
有 価 証 券	982,613	1,118,257	1,201,907	1,151,908	3,222,053	12,696,336	2,617,083	22,990,161
国 債	208,997	140,460	275,007	379,472	623,652	8,418,915	-	10,046,507
地 方 債	4,044	5,042	-	2,748	6,087	88,118	-	106,041
社 債	254,334	204,223	102,909	142,650	523,468	1,536,999	207,147	2,971,734
株 式							1,455,640	1,455,640
外 国 証 券	515,236	768,530	823,991	626,925	2,068,765	2,652,301	908,162	8,363,912
公 社 債	515,218	768,530	823,991	626,925	2,068,765	2,652,301	-	7,455,732
株 式 等	17	-	-	-	-	-	908,162	908,179
その他の証券	-	-	-	111	80	-	46,133	46,324
買入金銭債権	4,038	-	-	-	-	162,175	-	166,214
譲渡性預金	443,692	-	-	-	-	-	-	443,692
そ の 他	-	-	-	-	-	-	-	-
合 計	1,430,344	1,118,257	1,201,907	1,151,908	3,222,053	12,858,512	2,617,083	23,600,067

(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。

(4) 業種別株式保有の状況

(単位：百万円、%)

区 分		平成27年度末		平成28年度 第2四半期(上半期)末	
		金 額	占率	金 額	占率
水産・農林業		243	0.0	265	0.0
鉱業		65	0.0	61	0.0
建設業		57,550	4.0	54,410	3.7
製 造 業	食料品	59,741	4.2	62,900	4.3
	繊維製品	8,293	0.6	8,022	0.6
	パルプ・紙	5,637	0.4	5,882	0.4
	化学	135,027	9.4	146,987	10.1
	医薬品	130,259	9.1	127,210	8.7
	石油・石炭製品	4,003	0.3	3,827	0.3
	ゴム製品	6,223	0.4	5,674	0.4
	ガラス・土石製品	16,590	1.2	17,977	1.2
	鉄鋼	22,096	1.5	21,804	1.5
	非鉄金属	33,478	2.3	35,857	2.5
	金属製品	7,536	0.5	7,587	0.5
	機械	93,166	6.5	99,902	6.9
	電気機器	167,453	11.6	169,993	11.7
	輸送用機器	42,913	3.0	43,504	3.0
	精密機器	8,357	0.6	7,730	0.5
	その他製品	39,617	2.8	38,934	2.7
電気・ガス業		33,126	2.3	29,758	2.0
運 輸 ・ 情 報 通 信 業	陸運業	146,552	10.2	131,711	9.0
	海運業	2,933	0.2	2,668	0.2
	空運業	4,032	0.3	3,506	0.2
	倉庫・運輸関連業	8,025	0.6	7,082	0.5
	情報・通信業	13,270	0.9	12,910	0.9
商 業	卸売業	77,494	5.4	72,914	5.0
	小売業	23,465	1.6	22,497	1.5
金 融 ・ 保 険 業	銀行業	146,662	10.2	149,754	10.3
	証券、商品先物取引業	8,334	0.6	6,667	0.5
	保険業	75,724	5.3	99,972	6.9
	その他金融業	3,488	0.2	3,274	0.2
不動産業		15,252	1.1	15,246	1.0
サービス業		41,875	2.9	39,139	2.7
合 計		1,438,497	100.0	1,455,640	100.0

(注)業種区分は、「証券コード協議会」の「業種別分類項目」に準拠しています。

b. 貸付金関係

(1) 貸付金明細表

(単位：百万円)

区 分	平成27年度末	平成28年度 第2四半期(上半期)末
保 険 約 款 貸 付	314,654	307,384
契 約 者 貸 付	286,091	280,572
保 険 料 振 替 貸 付	28,562	26,811
一 般 貸 付 (うち非居住者貸付)	1,881,821 (25,627)	1,825,582 (20,562)
企 業 貸 付 (うち国内企業向け)	1,851,922 (1,844,922)	1,800,450 (1,798,450)
国・国際機関・政府関係機関貸付	10,209	9,962
公 共 団 体 ・ 公 企 業 貸 付	14,295	10,222
住 宅 ロ ー ン	5,171	4,828
消 費 者 ロ ー ン	221	119
そ の 他	-	-
合 計	2,196,475	2,132,967

(2) 国内企業向け貸付金企業規模別内訳

(単位：件、百万円、%)

区 分		平成27年度末		平成28年度 第2四半期(上半期)末	
			占率		占率
大 企 業	貸付先数	196	79.7	192	80.3
	金額	1,708,292	92.6	1,667,166	92.7
中 堅 企 業	貸付先数	6	2.4	5	2.1
	金額	13,306	0.7	3,153	0.2
中 小 企 業	貸付先数	44	17.9	42	17.6
	金額	123,323	6.7	128,129	7.1
国内企業向け 貸 付 計	貸付先数 金額	246 1,844,922	100.0 100.0	239 1,798,450	100.0 100.0

(注)1. 規模の区分は業種により以下のとおり定義しています。

業 種	①右の②、③、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人超 かつ	資本金 10億円以上	常用する 従業員 50人超 かつ	資本金 10億円以上	常用する 従業員 100人超 かつ	資本金 10億円以上	常用する 従業員 100人超 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		
中 小 企 業	資本金3億円以下または 常用する従業員300人以下		資本金5千万円以下または 常用する従業員50人以下		資本金5千万円以下または 常用する従業員100人以下		資本金1億円以下または 常用する従業員100人以下	

- 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。
- 従業員数及び資本金額は、資料作成時点で当社が把握しているものによります。
- サービス業は、「物品賃貸業」、「学術研究、専門・技術サービス業」、「宿泊業」、「生活関連サービス業、娯楽業」、「教育、学習支援業」、「医療・福祉」、及び「その他のサービス」で構成されます。
- 規模の区分は、日本銀行の「貸出先別貸出金(業種別、設備資金新規貸出)」の規模区分に準拠しています。

### (3) 貸付金残存期間別残高

<平成27年度末>

(単位：百万円)

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	合 計
変 動 金 利	21,826	24,008	14,796	48,592	26,896	4,080	38,000	178,200
固 定 金 利	273,435	493,794	328,386	217,657	264,109	126,237	-	1,703,620
一 般 貸 付 計	295,261	517,802	343,182	266,249	291,006	130,317	38,000	1,881,821

<平成28年度第2四半期(上半期)末>

(単位：百万円)

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	合 計
変 動 金 利	17,226	25,455	10,159	43,673	26,788	33,734	48,000	205,038
固 定 金 利	279,260	411,946	289,321	247,442	249,256	143,316	-	1,620,543
一 般 貸 付 計	296,487	437,402	299,480	291,116	276,045	177,051	48,000	1,825,582

(4) 貸付金業種別内訳

(単位：百万円、%)

区 分		平成27年度末		平成28年度 第2四半期(上半期)末	
		金 額	占率	金 額	占率
製 造 業		364,773	19.4	329,465	18.0
	食料	19,813	1.1	19,596	1.1
	繊維	12,592	0.7	4,576	0.3
	木材・木製品	1,000	0.1	1,000	0.1
	パルプ・紙	20,967	1.1	18,970	1.0
	印刷	2	0.0	-	-
	化学	52,749	2.8	51,604	2.8
	石油・石炭	37,680	2.0	36,680	2.0
	窯業・土石	12,037	0.6	11,209	0.6
	鉄鋼	61,900	3.3	57,900	3.2
	非金属製品	5,780	0.3	6,040	0.3
	はん用・生産用・業務用機械	26,605	1.4	26,213	1.4
	電気機械	61,291	3.3	59,122	3.2
輸送用機械	45,656	2.4	32,864	1.8	
その他の製造業	6,700	0.4	3,690	0.2	
国 内 向 け	農業、林業	-	-	-	-
	漁業	-	-	-	-
	鉱業、採石業、砂利採取業	-	-	-	-
	建設業	2,243	0.1	2,224	0.1
	電気・ガス・熱供給・水道業	266,577	14.2	246,102	13.5
	情報通信業	38,900	2.1	37,900	2.1
	運輸業、郵便業	138,561	7.4	131,403	7.2
	卸売業	481,480	25.6	491,370	26.9
	小売業	6,886	0.4	6,570	0.4
	金融業、保険業	298,830	15.9	321,069	17.6
	不動産業	136,363	7.2	124,013	6.8
	物品賃貸業	104,650	5.6	97,563	5.3
	学術研究、専門・技術サービス業	-	-	-	-
	宿泊業	24	0.0	1,006	0.1
	飲食業	1	0.0	0	0.0
	生活関連サービス業、娯楽業	-	-	-	-
	教育、学習支援業	-	-	-	-
	医療・福祉	-	-	-	-
	その他のサービス	11,321	0.6	11,220	0.6
地方公共団体	184	0.0	161	0.0	
個人(住宅・消費・納税資金等)	5,393	0.3	4,947	0.3	
合 計	1,856,193	98.6	1,805,020	98.9	
海 外 向 け	政 府 等	18,627	1.0	18,562	1.0
	金 融 機 関 等	7,000	0.4	2,000	0.1
	商 工 業 等	-	-	-	-
合 計	25,627	1.4	20,562	1.1	
一 般 貸 付 計		1,881,821	100.0	1,825,582	100.0

(注)国内向けの区分は、日本銀行の「貸出先別貸出金(業種別、設備資金新規貸出)」の業種分類に準拠しています。

(5) 貸付金担保別内訳

(単位：百万円、%)

区 分	平成27年度末		平成28年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
担 保 貸 付	685	0.0	617	0.0
有 価 証 券 担 保 貸 付	580	0.0	520	0.0
不 動 産 ・ 動 産 ・ 財 団 担 保 貸 付	105	0.0	97	0.0
指 名 債 権 担 保 貸 付	-	-	-	-
保 証 貸 付	39,863	2.1	38,368	2.1
信 用 貸 付	1,835,879	97.6	1,781,649	97.6
そ の 他	5,393	0.3	4,947	0.3
一 般 貸 付 計	1,881,821	100.0	1,825,582	100.0
う ち 劣 後 特 約 付 貸 付	135,000	7.2	192,000	10.5

(6) 貸付金地域別内訳

(単位：百万円、%)

区 分	平成27年度末		平成28年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
北 海 道	10,945	0.6	11,052	0.6
東 北	29,166	1.6	26,089	1.4
関 東	1,337,765	72.3	1,329,929	73.9
中 部	116,610	6.3	103,203	5.7
近 畿	269,667	14.6	244,675	13.6
中 国	38,389	2.1	37,857	2.1
四 国	10,100	0.5	10,100	0.6
九 州	38,155	2.1	37,165	2.1
合 計	1,850,799	100.0	1,800,072	100.0

(注)1. 個人ローン、非居住者貸付、保険約款貸付等を含みません。

2. 地域区分は、資料作成時点で当社が把握している貸付先の本社所在地によります。



c. 海外投融資の状況

(1) 資産別明細

(ア) 外貨建資産

(単位：百万円、%)

区 分	平成27年度末		平成28年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
公 社 債	5,074,882	64.0	5,981,742	67.7
株 式 等	598,980	7.6	588,406	6.7
現 預 金 ・ そ の 他	51,943	0.7	119,636	1.4
外 貨 建 資 産 計	5,725,806	72.2	6,689,785	75.7

(イ) 円貨額が確定した外貨建資産

(単位：百万円、%)

区 分	平成27年度末		平成28年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
貸 付 金	94,277	1.2	104,383	1.2
公 社 債	92,712	1.2	67,404	0.8
現 預 金 ・ そ の 他	28,035	0.4	25,019	0.3
円 貨 額 が 確 定 し た 外 貨 建 資 産 計	215,024	2.7	196,807	2.2

(ウ) 円貨建資産

(単位：百万円、%)

区 分	平成27年度末		平成28年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
非 居 住 者 貸 付	25,627	0.3	20,562	0.2
公 社 債	1,629,759	20.6	1,608,033	18.2
株 式 等	323,595	4.1	319,773	3.6
そ の 他	7,033	0.1	4,820	0.1
円 貨 建 資 産 計	1,986,017	25.1	1,953,189	22.1

(エ) 合計

(単位：百万円、%)

区 分	平成27年度末		平成28年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
海 外 投 融 資	7,926,847	100.0	8,839,783	100.0

(注)「円貨額が確定した外貨建資産」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価額としているものです。

## (2) 海外投融資の地域別構成

(単位：百万円、%)

区 分	平成27年度末				平成28年度第2四半期(上半期)末				
	金額	占率	外国証券		非居住者 貸付	金額	占率	外国証券	
			公社債	株式等				公社債	株式等
北 米	金額	2,256,145	1,789,626	466,519	-	2,903,802	2,437,283	466,519	-
	占率	29.7	26.8	50.6	-	34.7	32.7	51.4	-
ヨーロッパ	金額	2,152,924	2,149,440	3,483	12,000	2,113,983	2,113,983	-	12,000
	占率	28.3	32.2	0.4	46.8	25.3	28.4	-	58.4
オセアニア	金額	360,807	360,807	-	5,000	327,694	327,694	-	-
	占率	4.7	5.4	-	19.5	3.9	4.4	-	-
ア ジ ア	金額	118,688	2,135	116,552	-	112,911	2,166	110,744	-
	占率	1.6	0.0	12.6	-	1.3	0.0	12.2	-
中 南 米	金額	2,193,716	1,857,695	336,020	-	2,399,350	2,068,434	330,915	-
	占率	28.9	27.8	36.4	-	28.7	27.7	36.4	-
中 東	金額	-	-	-	-	-	-	-	-
	占率	-	-	-	-	-	-	-	-
ア フ リ カ	金額	3,555	3,555	-	-	3,580	3,580	-	-
	占率	0.0	0.1	-	-	0.0	0.0	-	-
国際機関	金額	514,450	514,450	-	8,627	502,590	502,590	-	8,562
	占率	6.8	7.7	-	33.7	6.0	6.7	-	41.6
合 計	金額	7,600,287	6,677,711	922,576	25,627	8,363,912	7,455,732	908,179	20,562
	占率	100.0	100.0	100.0	100.0	100.0	100.0	100.0	100.0

(注)1. 本表は発行会社の国籍に基づき作成されています。

2. 中南米向け外国証券は、その大部分が中南米に設立されたS P C(特別目的会社)が発行する債券もしくは優先出資証券、または海外投資信託等であり、発行会社の国籍に基づき中南米に分類されているものの、実質的には日本や北米・ヨーロッパ地域への投資です。

## (3) 外貨建資産の通貨別構成

(単位：百万円、%)

区 分	平成27年度末		平成28年度 第2四半期(上半期)末	
	金額	占率	金額	占率
米 ド ル	3,096,182	54.1	4,085,135	61.1
豪 ド ル	1,360,829	23.8	1,224,478	18.3
ユ ー ロ	1,035,806	18.1	1,125,612	16.8
メ キ シ コ ペ ソ	47,117	0.8	74,467	1.1
ポーランドズロチ	-	-	44,639	0.7
中 国 元	45,274	0.8	39,463	0.6
インドネシアルピア	38,278	0.7	38,114	0.6
ベトナムドン	33,200	0.6	33,191	0.5
ニュージーランドドル	12,545	0.2	24,663	0.4
英 ボ ン ド	56,569	1.0	18	0.0
合 計	5,725,806	100.0	6,689,785	100.0

## 2. 個人変額保険・変額個人年金保険 特別勘定

### a. 売買目的有価証券の評価損益

#### (1) 個人変額保険

(単位：百万円)

区 分	平成27年度末		平成28年度 第2四半期(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	59,020	6,311	56,976	4,066

#### (2) 変額個人年金保険

(単位：百万円)

区 分	平成27年度末		平成28年度 第2四半期(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	959,807	115,243	700,535	78,403

### b. 金銭の信託の時価情報

個人変額保険、変額個人年金保険ともに残高がないため記載していません。

c. デリバティブ取引の時価情報

(1) 個人変額保険

(株式関連)

(単位：百万円)

区分	種 類	平成27年度末			平成28年度第2四半期(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	564	-	21	21	-	-	-	
	合 計				21			-	

(通貨関連)

(単位：百万円)

区分	種 類	平成27年度末			平成28年度第2四半期(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	-	-	-	-	-	-	-	
	(米ドル)	-	-	-	-	-	-	-	
	(ユーロ)	-	-	-	-	-	-	-	
	買建	-	-	-	-	-	-	-	
	(米ドル)	-	-	-	-	-	-	-	
	(ユーロ)	-	-	-	-	-	-	-	
	合 計				-			-	

(注) 外貨建金銭債権債務等に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、開示の対象より除いています。

(2) 変額個人年金保険

(株式関連)

(単位：百万円)

区分	種 類	平成27年度末			平成28年度第2四半期(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	-	-	-	-	-	-	-	
	合 計								

(通貨関連)

(単位：百万円)

区分	種 類	平成27年度末			平成28年度第2四半期(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	-	-	-	-	-	-	-	
	(米ドル)	-	-	-	-	-	-	-	
	(ユーロ)	-	-	-	-	-	-	-	
	買建	-	-	-	-	-	-	-	
	(米ドル)	-	-	-	-	-	-	-	
	(ユーロ)	-	-	-	-	-	-	-	
	合 計								

(注) 外貨建金銭債権債務等に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、開示の対象より除いています。

### 3. 会社計

#### a. 資産の構成（会社計）

##### （1）資産の構成

（単位：百万円、％）

区 分	平成27年度末		平成28年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
現預金・コールローン	554,506	2.0	713,652	2.5
買入金銭債権	206,301	0.7	200,237	0.7
有 価 証 券	23,632,461	85.5	24,267,173	84.8
公 社 債	13,729,622	49.7	13,739,969	48.0
株 式	1,771,946	6.4	1,723,977	6.0
外 国 証 券	7,919,394	28.7	8,620,449	30.1
公 社 債	6,863,072	24.8	7,606,780	26.6
株 式 等	1,056,321	3.8	1,013,669	3.5
そ の 他 の 証 券	211,498	0.8	182,775	0.6
貸 付 金	2,196,475	7.9	2,132,967	7.5
保 険 約 款 貸 付	314,654	1.1	307,384	1.1
一 般 貸 付	1,881,821	6.8	1,825,582	6.4
不 動 産	614,369	2.2	611,905	2.1
う ち 投 資 用	429,136	1.6	429,266	1.5
繰延税金資産	75,322	0.3	136,778	0.5
そ の 他	363,649	1.3	553,013	1.9
貸倒引当金	△1,502	△0.0	△1,400	△0.0
会 社 計	27,641,583	100.0	28,614,327	100.0
う ち 外 貨 建 資 産	6,045,143	21.9	6,946,442	24.3

（注）「不動産」については土地・建物・建設仮勘定を合計した金額を計上しています。

##### （2）資産の増減

（単位：百万円）

区 分	平成27年度 第2四半期（上半期）	平成28年度 第2四半期（上半期）
	金 額	金 額
現預金・コールローン	△20,479	159,145
買入金銭債権	33,380	△6,064
有 価 証 券	△144,899	634,712
公 社 債	△31,776	10,347
株 式	△219,201	△47,969
外 国 証 券	137,644	701,055
公 社 債	203,836	743,707
株 式 等	△66,192	△42,652
そ の 他 の 証 券	△31,566	△28,722
貸 付 金	△20,581	△63,508
保 険 約 款 貸 付	△5,120	△7,270
一 般 貸 付	△15,460	△56,238
不 動 産	△5,670	△2,463
う ち 投 資 用	△3,693	129
繰延税金資産	50,466	61,455
そ の 他	62,369	189,364
貸倒引当金	155	102
会 社 計	△45,257	972,743
う ち 外 貨 建 資 産	233,450	901,298

（注）「不動産」については土地・建物・建設仮勘定を合計した金額を計上しています。

b. 有価証券の時価情報(会社計)

(1) 売買目的有価証券の評価損益

(単位：百万円)

区 分	平成27年度末		平成28年度第2四半期(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	1,568,501	△154,511	1,277,012	△54,135

(注)本表では、「運用目的の金銭の信託」を通じて保有している有価証券も対象となっておりますが、平成27年度末、平成28年度第2四半期(上半期)末ともに残高はありません。

(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	平成27年度末					平成28年度第2四半期(上半期)末				
	帳簿価額	時価	差損益	差益	差損	帳簿価額	時価	差損益	差益	差損
満期保有目的の債券	2,041,222	2,440,281	399,058	399,058	-	1,986,550	2,395,755	409,204	409,205	△0
責任準備金対応債券	11,339,015	13,821,953	2,482,938	2,483,535	△597	11,371,640	13,832,678	2,461,037	2,469,985	△8,947
子会社・関連会社株式	33,173	30,947	△2,226	-	△2,226	33,173	39,372	6,198	6,198	-
その他有価証券	7,240,388	8,225,320	984,931	1,023,014	△38,082	8,310,571	9,230,265	919,693	982,895	△63,201
公 社 債	1,184,247	1,278,218	93,970	94,116	△145	1,303,528	1,410,924	107,396	107,496	△99
株 式	776,568	1,346,271	569,703	599,181	△29,477	782,567	1,339,771	557,204	588,619	△31,415
外 国 証 券	4,722,636	5,020,859	298,222	304,894	△6,672	5,590,193	5,824,798	234,604	264,143	△29,538
公 社 債	4,703,936	5,002,079	298,143	304,459	△6,315	5,576,847	5,810,899	234,052	263,309	△29,256
株 式 等	18,700	18,779	78	435	△356	13,346	13,898	551	833	△281
その他の証券	32,812	40,905	8,093	9,858	△1,765	37,624	44,865	7,240	9,308	△2,068
買入金銭債権	155,622	170,586	14,963	14,963	△0	152,958	166,214	13,256	13,328	△72
譲渡性預金	368,500	368,478	△21	-	△21	443,700	443,692	△7	-	△7
そ の 他	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
合 計	20,653,800	24,518,502	3,864,702	3,905,609	△40,906	21,701,937	25,498,071	3,796,134	3,868,284	△72,150
公 社 債	12,888,854	15,503,294	2,614,440	2,614,647	△207	13,016,886	15,620,877	2,603,990	2,612,780	△8,789
株 式	776,568	1,346,271	569,703	599,181	△29,477	782,567	1,339,771	557,204	588,619	△31,415
外 国 証 券	6,431,442	7,088,965	657,522	666,957	△9,434	7,268,200	7,882,651	614,450	644,247	△29,796
公 社 債	6,379,567	7,039,238	659,670	666,522	△6,851	7,221,680	7,829,380	607,700	637,216	△29,515
株 式 等	51,874	49,727	△2,147	435	△2,582	46,520	53,270	6,750	7,031	△281
その他の証券	32,812	40,905	8,093	9,858	△1,765	37,624	44,865	7,240	9,308	△2,068
買入金銭債権	155,622	170,586	14,963	14,963	△0	152,958	166,214	13,256	13,328	△72
譲渡性預金	368,500	368,478	△21	-	△21	443,700	443,692	△7	-	△7
そ の 他	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

(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：百万円)

区 分	平成27年度末	平成28年度第2四半期(上半期)末
満期保有目的の債券	-	-
非上場外国債券	-	-
そ の 他	-	-
責任準備金対応債券	-	-
子会社・関連会社株式	581,258	604,907
その他有価証券	372,326	368,632
非上場国内株式(店頭売買株式を除く)	15,599	15,594
非上場外国株式(店頭売買株式を除く)	355,258	351,558
非上場外国債券	-	-
そ の 他	1,468	1,479
合 計	953,585	973,539

**c. 金銭の信託の時価情報(会社計)**

**(1) 運用目的の金銭の信託**

平成27年度末、平成28年度第2四半期(上半期)末ともに残高がないため、記載していません。

**(2) 運用目的以外の金銭の信託**

平成27年度末、平成28年度第2四半期(上半期)末ともに残高がないため、記載していません。



#### d. デリバティブ取引の時価情報（会社計）

##### 【定性的情報】

##### （１）取引の内容

当社では、資産運用方針および運用する資金特性に応じて、以下のデリバティブ取引を活用しています。

	取引所取引	店頭取引
金利派生商品	－	金利スワップ、金利スワップション
為替派生商品	－	為替予約、通貨スワップ、通貨オプション
株式派生商品	株価指数先物、株価指数オプション	個別株オプション、株価指数オプション、 株価指数先渡
債券派生商品	債券先物、債券先物オプション	債券現物オプション

##### （２）取組方針

当社では、主に保有する資産または負債の価値が変動するリスクを回避する目的で、デリバティブ取引を活用しています。

また、運用する資金特性にそぐわないデリバティブ取引（例えば、原資産の価格変動に対する当該取引時価の変動率が大きいレバレッジの高い取引等）は行わないこととしています。

##### （３）利用目的

当社では、外貨建資産に係る為替リスク等の回避を目的としたヘッジ取引、もしくはリスクを一定範囲内に限定したデリバティブ取引を行っています。

なお、ヘッジ会計の適用要件を満たすヘッジ取引については、ヘッジ会計を適用しています。

##### （４）リスクの内容

当社が利用しているデリバティブ取引には、現物資産と同様に、市場リスクと信用リスクがあります。

###### ア. 市場リスク

金利、株価、為替等の市場の変動およびキャッシュフローの変動によって保有するポートフォリオやポジションの価値が変動するリスクをいいます。

###### イ. 信用リスク

与信先の信用状態の変化により保有するポートフォリオやポジションの価値が変動するリスクをいいます。（デリバティブ取引の取引相手先のデフォルト（債務不履行）により、保有するポジションから期待する経済効果を得られないリスクを含みます。）

##### （５）リスク管理体制

###### ア. リスク管理の基本方針

保有する資産または負債に対して効果的にデリバティブ取引が活用されているか、また、投資案件ごとに設定した運用方針、運用ルール、報告体制が遵守されているか等を定期的に確認することで、リスクの顕在化を未然に防止することをリスク管理の基本としています。

## イ. リスク管理部署

収益部門から独立した資産運用リスク管理部署が、デリバティブ取引のリスク状況を株式、債券等原資産とあわせて管理しています。

## ウ. リスク管理規定

「資産運用リスク管理方針」および「資産運用リスク管理規程」において、デリバティブ取引についての利用目的、取組対象、およびリスク管理体制等を規定しています。また、資産運用部門の細則等において、各部それぞれの役割に応じた具体的な取組みを規定しています。

## エ. リスク管理

ヘッジ取引を行う場合は、ヘッジ対象である原資産とヘッジ手段としてのデリバティブ取引をあわせてリスクを定量的に把握・分析・管理しています。

ヘッジ取引に該当しない取引を行う場合は、取引限度額、許容リスク量を設定するとともにロス・カット・ルールを策定し、ポジション状況、リスク状況および損益状況を管理しています。

## (6) 定量的情報に関する補足説明

### ア. デリバティブ取引に関わる信用リスクの状況

債権債務の関係が法的に相殺可能である契約については、取引相手先が当社に対して有する与信額を考慮したネットベースのカレント・エクスポージャー方式で信用リスク相当額を算出しています。

(単位：億円)

	契約金額・想定元本額		信用リスク相当額	
	平成27年9月末	平成28年9月末	平成27年9月末	平成28年9月末
金利スワップ 金利スワップション(買建)	3,348	2,790	25	14
為替予約	45,124	60,931	1,999	4,333
通貨スワップ 通貨オプション(買建)	1,817	3,583	463	442
株式オプション(買建) 株価指数先渡	899	249	110	15
合 計			1,503	4,423

(注1) 契約金額・想定元本額は、取引を執行する際の計算基礎として位置付けられているものであり、リスク量を表す指標ではありません。

(注2) 取引種類別の信用リスク相当額は、取引相手先が当社に対して有する与信額を考慮しないグロスベースのカレント・エクスポージャー方式で算出しており、合計(ネットベースのカレント・エクスポージャー方式にて算出)とは一致しません。

### イ. 差損益に関する補足説明

ヘッジ取引については、ヘッジ手段とヘッジ対象の対応関係を明確にした上で取り組んでおり、ヘッジ手段としてのデリバティブ取引の損益を単独で認識するのではなく、ヘッジ対象としての資産・負債の損益と合算して認識する必要があります。

したがって、ヘッジ手段とヘッジ対象を一体として管理することで、為替変動リスク、金利変動リスク等が減殺されている効果を確認しています。

【定量的情報】

(1) 差損益の内訳（ヘッジ会計適用分・非適用分の内訳）（会社計）

(単位：百万円)

区 分	平成27年度末						平成28年度第2四半期(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	929	21,443	-	-	-	22,372	735	265,674	-	-	-	266,409
ヘッジ会計非適用分	△1,455	3,998	294	-	-	2,838	△967	17,752	1,514	-	-	18,299
合 計	△525	25,442	294	-	-	25,211	△232	283,426	1,514	-	-	284,709

(注)ヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ適用分、及びヘッジ会計非適用分の差損益は、損益計算書に計上されています。  
 なお時価ヘッジ適用分の差損益は、平成27年度末通貨関連 20,770百万円、平成28年度第2四半期(上半期)末通貨関連 253,014百万円となっています。

(2) 金利関連（会社計）

(ヘッジ会計が適用されていないもの)

(単位：百万円)

区分	種 類	平成27年度末			平成28年度 第2四半期(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	金利スワップション 買建 固定金利支払/変動金利受取	290,000	170,000			230,000	70,000		
		(1,622)		167	△1,455	(1,019)		52	△967
	合 計				△1,455				△967

(注)1.( )内には、オプション料を記載しています。  
 2. 差損益欄には、オプション料と時価との差額を記載しています。

(ヘッジ会計が適用されているもの)

(単位：百万円)

ヘッジ会計の方法	種 類	主なヘッジ対象	平成27年度末			平成28年度 第2四半期(上半期)末		
			契約額等		時価	契約額等		時価
			うち1年超			うち1年超		
繰延ヘッジ	金利スワップ 固定金利受取/変動金利支払	貸付金	-	-	-	10,000	10,000	47
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	49,532	33,828	929	39,051	30,674	687
	合 計				929			735

(3) 通貨関連 (会社計)

(ヘッジ会計が適用されていないもの)

(単位：百万円)

区分	種 類	平成27年度末				平成28年度第2四半期(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	467,436	-	264	264	579,765	29,077	20,360	20,360									
	(米ドル)	52,861	-	△4,623	△4,623	314,739	29,077	10,662	10,662									
	(豪ドル)	212,376	-	5,437	5,437	217,889	-	8,707	8,707									
	(ユーロ)	199,397	-	△471	△471	43,850	-	887	887									
	買建	157,402	-	4,201	4,201	234,268	678	△1,595	△1,595									
	(米ドル)	4,807	-	△5	△5	234,163	678	△1,594	△1,594									
	(ユーロ)	152,314	-	4,205	4,205	68	-	△0	△0									
	通貨オプション																	
	売建																	
	コール	360,000	-			172,500	-											
	(2,225)			1,063	1,161	(55)		4	50									
	(米ドル)	360,000	-			172,500	-											
	(2,225)			1,063	1,161	(55)		4	50									
	買建																	
プット	303,000	-			147,000	-												
(2,453)			823	△1,629	(1,389)		327	△1,062										
(米ドル)	303,000	-			147,000	-												
(2,453)			823	△1,629	(1,389)		327	△1,062										
合 計									3,998									17,752

(注)1. ( )内には、オプション料を記載しています。

2. 差損益欄には、為替予約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。

(ヘッジ会計が適用されているもの)

(単位：百万円)

ヘッジ会計の方法	種 類	主なヘッジ対象	平成27年度末			平成28年度第2四半期(上半期)末												
			契約額等		時価	契約額等		時価										
				うち1年超			うち1年超											
時価ヘッジ	為替予約																	
	売建	外貨建資産	4,103,209	403,200	20,770	5,208,635	545,572	253,014										
	(米ドル)		1,978,336	146,484	95,624	2,980,397	373,431	235,861										
	(ユーロ)		998,011	-	△2,146	1,113,465	-	11,935										
(豪ドル)	1,005,363		256,715	△80,961	960,015	169,651	△6,781											
繰延ヘッジ	通貨スワップ	外貨建資産	-	-	-	7,462	7,462	△37										
	(米ドル)		-	-	-	7,462	7,462	△37										
振当処理	為替予約																	
	売建	外貨建資産	98,327	61,590	△29,576	70,433	56,281	△13,843										
	(豪ドル)		84,048	58,533	△25,489	56,281	56,281	△11,513										
	(米ドル)		14,279	3,057	△4,087	14,152	-	△2,330										
	通貨スワップ	外貨建資産	94,277	94,277	9,889	104,383	104,383	18,802										
	(米ドル)		94,277	94,277	9,889	104,383	104,383	18,802										
通貨スワップ	外貨建負債	99,480	99,480	20,359	99,480	99,480	7,739											
(米ドル)		99,480	99,480	20,359	99,480	99,480	7,739											
合 計								21,443										265,674

(4) 株式関連 (会社計)

(ヘッジ会計が適用されていないもの)

(単位：百万円)

区分	種 類	平成27年度末			平成28年度第2四半期(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	133,413	-	△1,444	△1,444	149,813	-	1,550	1,550
	買建	1,899	-	33	33	4,072	-	△24	△24
店頭	株価指数先渡								
	売建	42,600	-	2,188	2,188	-	-	-	-
	株価指数オプション								
	売建								
	コール	155,208	-	953	590	32,579	-	52	107
	(1,543)					(160)			
買建									
プット	99,999	-	467	△1,073	24,999	-	32	△118	
(1,541)					(150)				
合 計				294				1,514	

(注)1. ( )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。

(ヘッジ会計が適用されているもの)

平成27年度末、平成28年度第2四半期(上半期)末ともに残高がないため、記載していません。