

平成29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28年度末		平成29年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
国 債	9,903,340	41.9	9,894,035	40.0
地 方 債	104,870	0.4	108,229	0.4
社 債	2,953,682	12.5	3,057,356	12.4
うち公社・公団債	1,767,880	7.5	1,818,690	7.4
う ち 外 貨 建	348,744	1.5	449,837	1.8
株 式	1,700,608	7.2	1,823,558	7.4
外 国 証 券	8,809,343	37.3	9,735,095	39.4
公 社 債	7,839,217	33.2	8,708,824	35.2
う ち 外 貨 建	6,181,041	26.2	7,095,092	28.7
株 式 等	970,125	4.1	1,026,270	4.2
う ち 外 貨 建	649,857	2.8	705,297	2.9
そ の 他 の 証 券	142,666	0.6	104,267	0.4
合 計	23,614,509	100.0	24,722,542	100.0
う ち 外 貨 建	7,179,643	30.4	8,250,226	33.4

(2) 地域別地方債保有内訳

(単位：百万円)

区 分	平成28年度末	平成29年度 第2四半期(上半期)末
北 海 道	－	－
東 北	－	－
関 東	53,422	55,762
中 部	22,822	23,899
近 畿	14,822	14,783
中 国	117	117
四 国	－	－
九 州	13,685	13,665
合 計	104,870	108,229

(3) 有価証券残存期間別残高

<平成28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
有 価 証 券	635,300	1,063,020	1,263,507	1,351,573	3,804,468	12,428,073	3,068,565	23,614,509
国 債	61,605	147,363	338,358	294,967	928,252	8,132,793	-	9,903,340
地 方 債	907	5,033	-	2,760	6,029	90,138	-	104,870
社 債	141,269	152,939	133,890	219,351	551,635	1,497,262	257,332	2,953,682
株 式							1,700,608	1,700,608
外 国 証 券	431,518	757,683	791,132	834,494	2,318,400	2,707,878	968,234	8,809,343
公 社 債	431,498	755,860	791,132	834,494	2,318,352	2,707,878	-	7,839,217
株 式 等	19	1,823	-	-	47	-	968,234	970,125
その他の証券	-	-	125	-	151	-	142,389	142,666
買 入 金 銭 債 権	38,989	-	-	-	-	157,821	-	196,810
譲 渡 性 預 金	609,980	-	-	-	-	-	-	609,980
そ の 他	-	-	-	-	-	-	-	-
合 計	1,284,271	1,063,020	1,263,507	1,351,573	3,804,468	12,585,894	3,068,565	24,421,301

<平成29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
有 価 証 券	647,577	1,302,293	1,169,033	1,353,370	4,083,257	12,926,152	3,240,856	24,722,542
国 債	94,793	204,856	341,117	271,306	927,284	8,054,678	-	9,894,035
地 方 債	999	4,026	-	3,494	5,291	94,417	-	108,229
社 債	137,761	111,076	165,767	257,265	563,907	1,531,063	290,514	3,057,356
株 式							1,823,558	1,823,558
外 国 証 券	414,022	982,335	662,026	821,304	2,586,595	3,245,993	1,022,817	9,735,095
公 社 債	414,003	978,953	662,026	821,304	2,586,543	3,245,993	-	8,708,824
株 式 等	19	3,381	-	-	51	-	1,022,817	1,026,270
その他の証券	-	-	121	-	179	-	103,966	104,267
買 入 金 銭 債 権	48,988	-	-	-	-	164,673	-	213,662
譲 渡 性 預 金	643,476	-	-	-	-	-	-	643,476
そ の 他	-	-	-	-	-	-	-	-
合 計	1,340,042	1,302,293	1,169,033	1,353,370	4,083,257	13,090,826	3,240,856	25,579,681

(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28年度末		平成29年度 第2四半期(上半期)末	
		金 額	占率	金 額	占率
水 産 ・ 農 林 業		302	0.0	321	0.0
鉱 業		79	0.0	80	0.0
建 設 業		62,234	3.7	72,704	4.0
製 造 業	食 料 品	67,945	4.0	70,690	3.9
	織 維 製 品	9,311	0.5	10,612	0.6
	パ ル プ ・ 紙	6,155	0.4	6,201	0.3
	化 学	182,944	10.8	208,859	11.5
	医 薬 品	142,575	8.4	145,702	8.0
	石 油 ・ 石 炭 製 品	6,585	0.4	5,808	0.3
	ゴ ム 製 品	7,033	0.4	7,388	0.4
	ガ ラ ス ・ 土 石 製 品	22,145	1.3	25,155	1.4
	鉄 鋼	25,425	1.5	26,171	1.4
	非 鉄 金 属	44,924	2.6	45,401	2.5
	金 属 製 品	10,221	0.6	10,959	0.6
	機 械	126,281	7.4	136,323	7.5
	電 気 機 器	205,226	12.1	236,012	12.9
	輸 送 用 機 器	50,511	3.0	55,601	3.0
	精 密 機 器	8,558	0.5	10,251	0.6
	そ の 他 製 品	39,815	2.3	47,959	2.6
電 気 ・ ガ ス 業		31,689	1.9	33,586	1.8
運 輸 ・ 情 報 通 信 業	陸 運 業	141,161	8.3	143,953	7.9
	海 運 業	4,066	0.2	3,767	0.2
	空 運 業	4,266	0.3	5,175	0.3
	倉 庫 ・ 運 輸 関 連 業	8,385	0.5	9,433	0.5
	情 報 ・ 通 信 業	14,197	0.8	16,687	0.9
商 業	卸 売 業	95,117	5.6	102,546	5.6
	小 売 業	26,204	1.5	27,971	1.5
金 融 ・ 保 險 業	銀 行 業	181,968	10.7	175,624	9.6
	証券、商品先物取引業	7,117	0.4	6,140	0.3
	保 險 業	105,388	6.2	108,186	5.9
	そ の 他 金 融 業	3,459	0.2	4,341	0.2
不 動 産 業		18,326	1.1	20,301	1.1
サ ー ビ ス 業		40,978	2.4	43,635	2.4
合 計		1,700,608	100.0	1,823,558	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28年度末	平成29年度 第2四半期(上半期)末
保 険 約 款 貸 付	303,290	297,198
契 約 者 貸 付	276,962	271,529
保 険 料 振 替 貸 付	26,328	25,669
一 般 貸 付 (うち非居住者貸付)	2,669,398 (17,000)	2,694,824 (10,000)
企 業 貸 付 (うち国内企業向け)	1,771,558 (1,769,558)	1,692,000 (1,692,000)
国・国際機関・政府関係機関貸付	883,368	993,660
公 共 団 体 ・ 公 企 業 貸 付	10,161	5,126
住 宅 ロ ー ン	4,259	4,024
消 費 者 ロ ー ン	50	12
そ の 他	-	-
合 計	2,972,689	2,992,023

(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28年度末		平成29年度 第2四半期(上半期)末	
			占率		占率
大 企 業	貸付先数	184	81.1	179	81.7
	金 額	1,631,211	92.2	1,550,195	91.6
中 堅 企 業	貸付先数	2	0.9	2	0.9
	金 額	3,023	0.2	2,922	0.2
中 小 企 業	貸付先数	41	18.1	38	17.4
	金 額	135,324	7.6	138,882	8.2
国 内 企 業 向 け 貸 付 計	貸付先数	227	100.0	219	100.0
	金 額	1,769,558	100.0	1,692,000	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	資本金 10億円以上	常用する 従業員 50人超	資本金 10億円以上	常用する 従業員 100人超	資本金 10億円以上	常用する 従業員 100人超	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28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
変 動 金 利	26,089	17,905	4,635	45,635	10,566	45,263	48,000	198,096
固 定 金 利	1,167,484	398,788	236,098	197,393	288,025	183,511	-	2,471,301
一般貸付計	1,193,573	416,694	240,733	243,029	298,592	228,774	48,000	2,669,398

<平成29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
変 動 金 利	49,085	17,305	361	33,982	15,017	46,947	40,000	202,699
固 定 金 利	1,204,757	369,249	238,825	173,437	321,267	184,587	-	2,492,125
一般貸付計	1,253,842	386,554	239,187	207,420	336,285	231,534	40,000	2,694,824

(4) 貸付金業種別内訳

(単位：百万円、%)

区 分		平成28年度末		平成29年度 第2四半期(上半期)末	
		金 額	占率	金 額	占率
国内向け		292,492	11.0	262,296	9.7
	食料	11,369	0.4	11,180	0.4
	繊維	4,561	0.2	3,146	0.1
	木材・木製品	800	0.0	800	0.0
	パルプ・紙	11,950	0.4	10,070	0.4
	印刷	-	-	-	-
	化学	47,436	1.8	39,508	1.5
	石油・石炭	36,680	1.4	36,680	1.4
	窯業・土石	9,836	0.4	9,107	0.3
	鉄鋼	54,900	2.1	54,900	2.0
	非金属製品	6,020	0.2	6,000	0.2
	はん用・生産用・業務用機械	-	-	-	-
	電気機械	18,620	0.7	19,326	0.7
	輸送用機械	53,918	2.0	50,298	1.9
	その他の製造業	32,722	1.2	17,711	0.7
		3,680	0.1	3,570	0.1
	農業、林業	-	-	-	-
	漁業	-	-	-	-
	鉱業、採石業、砂利採取業	-	-	-	-
	建設業	1,858	0.1	1,908	0.1
	電気・ガス・熱供給・水道業	262,646	9.8	260,038	9.6
	情報通信業	30,600	1.1	30,600	1.1
	運輸業、郵便業	137,888	5.2	133,303	4.9
	卸売業	470,160	17.6	433,050	16.1
	小売業	6,197	0.2	5,357	0.2
	金融業、保険業	333,950	12.5	331,931	12.3
	不動産業	127,926	4.8	124,448	4.6
	物品賃貸業	95,129	3.6	98,346	3.6
	学術研究、専門・技術サービス業	-	-	-	-
	宿泊業	1,000	0.0	1,000	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	-	-	-	-
	その他のサービス	11,119	0.4	11,018	0.4
	地方公共団体	138	0.0	115	0.0
	個人(住宅・消費・納税資金等)	4,309	0.2	4,037	0.1
	合 計	2,652,398	99.4	2,684,824	99.6
海外向け	政 府 等	15,000	0.6	10,000	0.4
	金融機関等	2,000	0.1	-	-
	商工業等	-	-	-	-
	合 計	17,000	0.6	10,000	0.4
一 般 貸 付 計		2,669,398	100.0	2,694,824	100.0

(注)1. 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。

2. 「国内向け貸付の合計」ならびに「一般貸付計」には日本国政府向け貸出を含みます。

(平成28年度末 8,769億円、平成29年度第2四半期(上半期)末 9,873億円)

(5) 貸付金担保別内訳

(単位：百万円、%)

区 分	平成28年度末		平成29年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
担 保 貸 付	550	0.0	4,914	0.2
有 価 証 券 担 保 貸 付	460	0.0	400	0.0
不動産・動産・財団担保貸付	90	0.0	4,514	0.2
指 名 債 権 担 保 貸 付	-	-	-	-
保 証 貸 付	35,747	1.3	28,367	1.1
信 用 貸 付	2,628,790	98.5	2,657,504	98.6
そ の 他	4,309	0.2	4,037	0.1
一 般 貸 付 計	2,669,398	100.0	2,694,824	100.0
う ち 劣 後 特 約 付 貸 付	185,000	6.9	180,500	6.7

(6) 貸付金地域別内訳

(単位：百万円、%)

区 分	平成28年度末		平成29年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
北 海 道	12,197	0.5	12,237	0.5
東 北	29,000	1.1	24,823	0.9
関 東	2,190,963	82.7	2,237,007	83.4
中 部	99,870	3.8	101,593	3.8
近 畿	229,426	8.7	233,685	8.7
中 国	35,154	1.3	25,059	0.9
四 国	10,100	0.4	10,100	0.4
九 州	41,375	1.6	36,280	1.4
合 計	2,648,088	100.0	2,680,787	100.0

(注)1. 個人ローン、非居住者貸付、保険約款貸付等は含みません。

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28年度末		平成29年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
公 社 債	6,529,786	68.3	7,544,929	69.5
株 式 等	649,857	6.8	705,297	6.5
現 預 金 ・ そ の 他	188,126	2.0	448,350	4.1
外 貨 建 資 産 計	7,367,770	77.1	8,698,576	80.1

(イ) 円貨額が確定した外貨建資産

(単位：百万円、%)

区 分	平成28年度末		平成29年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
貸 付 金	127,077	1.3	141,197	1.3
公 社 債	56,324	0.6	53,338	0.5
現 預 金 ・ そ の 他	25,049	0.3	25,057	0.2
円 貨 額 が 確 定 し た 外 貨 建 資 産 計	208,450	2.2	219,592	2.0

(ウ) 円貨建資産

(単位：百万円、%)

区 分	平成28年度末		平成29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	17,000	0.2	10,000	0.1
公 社 債	1,601,851	16.8	1,560,394	14.4
株 式 等	320,268	3.4	320,973	3.0
そ の 他	39,752	0.4	49,427	0.5
円 貨 建 資 産 計	1,978,872	20.7	1,940,796	17.9

(エ) 合計

(単位：百万円、%)

区 分	平成28年度末		平成29年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
海 外 投 融 資	9,555,093	100.0	10,858,965	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28年度末				平成29年度第2四半期(上半期)末			
		外国証券	公社債	株式等	非居住者 貸付	外国証券	公社債	株式等	非居住者 貸付
北 米	金額	3, 148, 957	2, 682, 438	466, 519	-	3, 578, 751	3, 112, 231	466, 519	-
	占率	35. 7	34. 2	48. 1	-	36. 8	35. 7	45. 5	-
ヨーロッパ	金額	2, 162, 077	2, 160, 206	1, 871	12, 000	2, 438, 033	2, 434, 600	3, 433	5, 000
	占率	24. 5	27. 6	0. 2	70. 6	25. 0	28. 0	0. 3	50. 0
オセアニア	金額	363, 939	363, 939	-	-	351, 982	351, 982	-	-
	占率	4. 1	4. 6	-	-	3. 6	4. 0	-	-
ア ジ ア	金額	115, 598	2, 144	113, 453	-	117, 503	2, 148	115, 354	-
	占率	1. 3	0. 0	11. 7	-	1. 2	0. 0	11. 2	-
中 南 米	金額	2, 524, 203	2, 135, 921	388, 281	-	2, 802, 929	2, 361, 965	440, 963	-
	占率	28. 7	27. 2	40. 0	-	28. 8	27. 1	43. 0	-
中 東	金額	-	-	-	-	-	-	-	-
	占率	-	-	-	-	-	-	-	-
ア フ リ カ	金額	3, 523	3, 523	-	-	3, 523	3, 523	-	-
	占率	0. 0	0. 0	-	-	0. 0	0. 0	-	-
国 際 機 関	金額	491, 044	491, 044	-	5, 000	442, 372	442, 372	-	5, 000
	占率	5. 6	6. 3	-	29. 4	4. 5	5. 1	-	50. 0
合 計	金額	8, 809, 343	7, 839, 217	970, 125	17, 000	9, 735, 095	8, 708, 824	1, 026, 270	10, 000
	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、中南米に設立されたSPC(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・アジア地域への投資です。

(3) 外貨建資産の通貨別構成

(単位：百万円、%)

区 分	平成28年度末		平成29年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
米 ド ル	4,686,636	63.6	5,538,431	63.7
ユ ー ロ	1,157,582	15.7	1,427,178	16.4
豪 ド ル	1,221,366	16.6	1,338,328	15.4
ニュージーランドドル	115,395	1.6	196,218	2.3
ポーランドズロチ	73,108	1.0	82,789	1.0
中 国 元	42,175	0.6	44,298	0.5
インドネシアルピア	38,300	0.5	38,120	0.4
ベトナムドン	33,180	0.5	33,185	0.4
そ の 他	24	0.0	24	0.0
合 計	7,367,770	100.0	8,698,576	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28年度末		平成29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	61, 272	8, 123	62, 971	8, 953

(2) 変額個人年金保険

(単位：百万円)

区 分	平成28年度末		平成29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	507, 831	69, 649	323, 554	57, 419

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28年度末				平成29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28年度末				平成29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	256	-	△2	△2	90	-	△0	△0
	(米ドル)	256	-	△2	△2	-	-	-	-
	(ユーロ)	-	-	-	-	-	-	-	-
	(豪ドル)	-	-	-	-	90	-	△0	△0
	買建	256	-	2	2	90	-	△0	△0
	(米ドル)	256	-	2	2	90	-	△0	△0
	(ユーロ)	-	-	-	-	-	-	-	-
合 計					△0				△0

(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28年度末				平成29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	21,368	-	△299	△299	20,418	-	600	600
	合 計				△299				600

(通貨関連)

(単位：百万円)

区分	種 類	平成28年度末				平成29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	2,208	-	△24	△24	281	-	△0	△0
	(米ドル)	2,208	-	△24	△24	-	-	-	-
	(ユーロ)	-	-	-	-	-	-	-	-
	(豪ドル)	-	-	-	-	281	-	△0	△0
	買建	2,205	-	24	24	293	-	△0	△0
	(米ドル)	2,205	-	24	24	293	-	△0	△0
	(ユーロ)	-	-	-	-	-	-	-	-
	合 計				△0				△1

(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28年度末		平成29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	1,082,100	3.6	1,334,068	4.3
買入金銭債権	230,518	0.8	261,833	0.8
有価証券	24,732,137	82.4	25,709,559	82.2
公 社 債	13,481,682	44.9	13,478,760	43.1
株 式	1,911,643	6.4	1,992,437	6.4
外国証券	9,070,061	30.2	10,014,260	32.0
公 社 債	7,977,870	26.6	8,848,975	28.3
株 式 等	1,092,190	3.6	1,165,285	3.7
その他の証券	268,750	0.9	224,100	0.7
貸付金	2,972,689	9.9	2,992,023	9.6
保険約款貸付	303,290	1.0	297,198	1.0
一般貸付	2,669,398	8.9	2,694,824	8.6
不動産	578,811	1.9	569,745	1.8
うち投資用	401,966	1.3	395,000	1.3
繰延税金資産	124,609	0.4	97,915	0.3
その他	307,248	1.0	299,379	1.0
貸倒引当金	△1,132	△0.0	△975	△0.0
会 社 計	30,026,983	100.0	31,263,548	100.0
うち外貨建資産	7,629,500	25.4	8,971,565	28.7

（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28年度 第2四半期（上半期）	平成29年度 第2四半期（上半期）
	金 額	金 額
現預金・コールローン	159,145	251,968
買入金銭債権	△6,064	31,314
有価証券	634,712	977,421
公 社 債	10,347	△2,922
株 式	△47,969	80,793
外国証券	701,055	944,199
公 社 債	743,707	871,105
株 式 等	△42,652	73,094
その他の証券	△28,722	△44,649
貸付金	△63,508	19,333
保険約款貸付	△7,270	△6,092
一般貸付	△56,238	25,426
不動産	△2,463	△9,065
うち投資用	129	△6,965
繰延税金資産	61,455	△26,694
その他	189,364	△7,869
貸倒引当金	102	157
会 社 計	972,743	1,236,565
うち外貨建資産	901,298	1,342,064

（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28年度末		平成29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	1,117,627	△41,831	987,016	4,311

(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いますが、平成28年度末、平成29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28年度末					平成29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	1,942,014	2,303,448	361,434	361,434	-	1,915,491	2,272,352	356,861	356,861	△0
責任準備金対応債券	11,088,673	13,056,296	1,967,623	2,023,431	△55,808	11,142,398	13,065,389	1,922,991	1,985,764	△62,772
子会社・関連会社株式	33,173	35,754	2,580	2,580	-	33,173	33,369	196	196	-
その他の有価証券	9,405,982	10,375,805	969,822	1,103,170	△133,348	10,364,398	11,501,285	1,136,887	1,219,161	△82,273
公 社 債	1,484,122	1,562,503	78,381	83,050	△4,668	1,605,336	1,690,914	85,577	87,108	△1,531
株 式	784,201	1,584,632	800,430	808,738	△8,307	803,341	1,703,810	900,468	910,473	△10,004
外国証券	6,209,300	6,281,051	71,751	190,963	△119,211	7,020,484	7,147,019	126,535	197,063	△70,527
公 社 債	6,136,882	6,207,918	71,036	190,150	△119,114	6,896,575	7,019,643	123,067	193,529	△70,461
株 式 等	72,417	73,132	714	812	△97	123,908	127,376	3,467	3,533	△66
その他の証券	127,421	140,826	13,404	14,070	△665	84,805	102,402	17,597	17,597	△0
買入金銭債権	190,936	196,810	5,874	6,349	△475	206,930	213,662	6,731	6,918	△187
譲渡性預金	610,000	609,980	△19	-	△19	643,500	643,476	△23	-	△23
その他の	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
合 計	22,469,844	25,771,305	3,301,461	3,490,618	△189,156	23,455,462	26,872,397	3,416,935	3,561,982	△145,047
公 社 債	12,883,510	14,958,180	2,074,669	2,134,598	△59,928	12,974,043	15,010,207	2,036,163	2,099,433	△63,270
株 式	784,201	1,584,632	800,430	808,738	△8,307	803,341	1,703,810	900,468	910,473	△10,004
外国証券	7,873,773	8,280,876	407,102	526,862	△119,760	8,742,840	9,198,838	455,998	527,560	△71,562
公 社 債	7,768,181	8,171,988	403,806	523,468	△119,662	8,585,757	9,038,091	452,334	523,830	△71,495
株 式 等	105,591	108,887	3,295	3,393	△97	157,082	160,746	3,663	3,729	△66
その他の証券	127,421	140,826	13,404	14,070	△665	84,805	102,402	17,597	17,597	△0
買入金銭債権	190,936	196,810	5,874	6,349	△475	206,930	213,662	6,731	6,918	△187
譲渡性預金	610,000	609,980	△19	-	△19	643,500	643,476	△23	-	△23
その他の	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

(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28年度末	平成29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	604,907	608,726
そ の 他 有 価 証 券	369,119	369,097
非上場国内株式(店頭売買株式を除く)	15,701	15,653
非上場外国株式(店頭売買株式を除く)	351,558	351,558
非 上 場 外 国 債 券	-	-
そ の 他	1,859	1,884
合 計	974,026	977,823

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28年度末、平成29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28年度末、平成29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28年9月末	平成29年9月末	平成28年9月末	平成29年9月末
金利スワップ				
金利スワップション(買建)	2,790	1,156	14	5
為替予約	60,931	86,885	4,333	1,512
通貨スワップ				
通貨オプション(買建)	3,583	4,129	442	588
株式オプション(買建)				
株価指数先渡	249	0	15	0
合 計			4,423	819

(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28年度末						平成29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	268	△254,479	-	-	-	△254,210	135	△268,419	-	-	-	△268,284
ヘッジ会計非適用分	△630	△21,230	1,421	-	-	△20,440	△195	△70,442	308	-	-	△70,330
合 計	△361	△275,710	1,421	-	-	△274,650	△60	△338,862	308	-	-	△338,615

（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28年度末通貨関連 △255,228百万円、平成29年度第2四半期（上半期）末通貨関連
 △269,159百万円となっています。

(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28年度末				平成29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	170,000 (635)	-	4	△630	70,000 (196)	-	0	△195
合 計					△630				△195

（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28年度末			平成29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	貸付金	15,000	15,000	△119	15,000	15,000	△99
	固定金利受取／変動金利支払							
特例処理	金利スワップ	貸付金	33,828	17,520	388	30,674	17,378	234
	固定金利受取／変動金利支払							
合 計					268			135

(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28年度末				平成29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	298,747	818	△15,806	△15,806	1,102,525	-	△92,387	△92,387
	(ユーロ)	40,713	-	438	438	762,643	-	△77,269	△77,269
	(豪ドル)	187,661	-	△14,281	△14,281	217,533	-	△12,565	△12,565
	(米ドル)	66,485	818	△1,977	△1,977	117,807	-	△2,372	△2,372
	買建	533,720	-	△5,205	△5,205	1,237,703	-	21,945	21,945
	(ユーロ)	1,078	-	△1	△1	812,695	-	17,812	17,812
	(米ドル)	532,305	-	△5,204	△5,204	425,007	-	4,133	4,133
	通貨オプション								
	買建								
	プット	54,750	-			-	-		
	(397)			177	△219	(-)		-	-
	(米ドル)	54,750	-			-	-		
	(397)			177	△219	(-)		-	-
合 計					△21,230				△70,442

(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28年度末			平成29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		5,424,477	320,453	△255,228	6,293,686	934,364	△269,159
	(米ドル)	外貨建資産	3,227,455	233,066	△140,801	3,717,991	258,020	△89,145
	(ユーロ)		1,146,493	-	△6,205	1,354,422	614,178	△41,609
繰延ヘッジ	通貨スワップ		26,780	26,780	△574	26,780	26,780	△1,431
	(米ドル)	外貨建資産	24,326	24,326	△614	24,326	24,326	△1,178
	(ユーロ)		2,454	2,454	40	2,454	2,454	△253
振当処理	為替予約							
	売建	外貨建資産	58,502	55,505	△20,963	54,654	-	△23,198
	(豪ドル)		55,505	55,505	△20,033	54,654	-	△23,198
	(米ドル)		2,996	-	△929	-	-	-
	通貨スワップ	外貨建資産	127,077	127,077	6,470	141,197	141,197	4,890
	(米ドル)		127,077	127,077	6,470	141,197	141,197	4,890
	通貨スワップ	外貨建負債	99,480	99,480	15,816	244,924	244,924	20,479
	(米ドル)		99,480	99,480	15,816	244,924	244,924	20,479
合 計					△254,479			△268,419

(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28年度末				平成29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	100,015	-	1,763	1,763	11,181	-	△492	△492
	買建	23,952	-	△342	△342	31,153	-	1,021	1,021
	株価指数オプション								
	買建								
	プット	-	-			17,280	-		
	合 計	(-)		-	-	(244)		23	△220
					1,421				308

(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28年度末、平成29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。