

## 平成29年度決算(案) 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年度末	
	金 額	占率	金 額	占率
国 債	9,903,340	41.9	9,862,813	39.6
地 方 債	104,870	0.4	114,815	0.5
社 債	2,953,682	12.5	3,065,764	12.3
うち公社・公団債	1,767,880	7.5	1,860,806	7.5
うち外貨建	348,744	1.5	470,359	1.9
株 式	1,700,608	7.2	1,933,967	7.8
外 国 証 券	8,809,343	37.3	9,864,763	39.6
公 社 債	7,839,217	33.2	8,800,982	35.3
うち外貨建	6,181,041	26.2	7,193,755	28.9
株 式 等	970,125	4.1	1,063,780	4.3
うち外貨建	649,857	2.8	760,731	3.1
その他の証券	142,666	0.6	60,773	0.2
合 計	23,614,509	100.0	24,902,898	100.0
うち外貨建	7,179,643	30.4	8,424,846	33.8

#### (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年度末
北 海 道	-	-
東 北	-	-
関 東	53,422	58,621
中 部	22,822	25,485
近 畿	14,822	14,746
中 国	117	116
四 国	-	-
九 州	13,685	15,846
合 計	104,870	114,815

### (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	571,195	1,153,941	1,238,355	1,475,808	4,024,827	13,070,536	3,368,234	24,902,898
国 債	73,552	209,487	413,259	201,868	1,232,610	7,732,035	-	9,862,813
地 方 債	999	4,018	-	8,800	-	100,996	-	114,815
社 債	95,756	101,971	163,269	280,749	562,395	1,545,798	315,824	3,065,764
株 式							1,933,967	1,933,967
外 国 証 券	400,886	838,464	661,546	984,390	2,229,620	3,691,705	1,058,149	9,864,763
公 社 債	400,868	835,276	661,546	984,390	2,229,102	3,689,798	-	8,800,982
株 式 等	18	3,187	-	-	518	1,906	1,058,149	1,063,780
その他の証券	-	-	279	-	200	-	60,293	60,773
買入金銭債権	48,986	-	-	-	-	160,506	-	209,492
譲渡性預金	441,084	-	-	-	-	-	-	441,084
そ の 他	-	-	-	-	-	-	-	-
合 計	1,061,266	1,153,941	1,238,355	1,475,808	4,024,827	13,231,042	3,368,234	25,553,476

(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年度末	
		金 額	占率	金 額	占率
水 産 ・ 農 林 業		302	0.0	308	0.0
鉱 業		79	0.0	92	0.0
建 設 業		62,234	3.7	72,850	3.8
製 造 業	食 料 品	67,945	4.0	75,310	3.9
	織 維 製 品	9,311	0.5	11,749	0.6
	パ ル プ ・ 紙	6,155	0.4	8,191	0.4
	化 学	182,944	10.8	218,401	11.3
	医 薬 品	142,575	8.4	145,839	7.5
	石 油 ・ 石 炭 製 品	6,585	0.4	7,701	0.4
	ゴ ム 製 品	7,033	0.4	7,122	0.4
	ガ ラ ス ・ 土 石 製 品	22,145	1.3	25,171	1.3
	鉄 鋼	25,425	1.5	23,762	1.2
	非 鉄 金 属	44,924	2.6	46,562	2.4
	金 属 製 品	10,221	0.6	11,161	0.6
	機 械	126,281	7.4	141,436	7.3
	電 気 機 器	205,226	12.1	249,618	12.9
	輸 送 用 機 器	50,511	3.0	58,865	3.0
	精 密 機 器	8,558	0.5	12,785	0.7
そ の 他 製 品	39,815	2.3	53,876	2.8	
電 気 ・ ガ ス 業		31,689	1.9	31,505	1.6
運 輸 ・ 情 報 通 信 業	陸 運 業	141,161	8.3	174,378	9.0
	海 運 業	4,066	0.2	3,439	0.2
	空 運 業	4,266	0.3	5,127	0.3
	倉 庫 ・ 運 輸 関 連 業	8,385	0.5	8,905	0.5
	情 報 ・ 通 信 業	14,197	0.8	19,328	1.0
商 業	卸 売 業	95,117	5.6	114,684	5.9
	小 売 業	26,204	1.5	32,031	1.7
金 融 ・ 保 険 業	銀 行 業	181,968	10.7	179,268	9.3
	証 券、商 品 先 物 取 引 業	7,117	0.4	6,823	0.4
	保 険 業	105,388	6.2	109,985	5.7
	そ の 他 金 融 業	3,459	0.2	4,554	0.2
不 動 産 業		18,326	1.1	25,639	1.3
サ ー ビ ス 業		40,978	2.4	47,485	2.5
合 計		1,700,608	100.0	1,933,967	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年度末
保 険 約 款 貸 付	303,290	294,742
契 約 者 貸 付	276,962	269,473
保 険 料 振 替 貸 付	26,328	25,268
一 般 貸 付 (うち非居住者貸付)	2,669,398 (17,000)	2,486,563 (57,808)
企 業 貸 付 (うち国内企業向け)	1,771,558 (1,769,558)	1,698,260 (1,650,452)
国・国際機関・政府関係機関貸付	883,368	779,420
公 共 団 体 ・ 公 企 業 貸 付	10,161	5,092
住 宅 ロ ー ン	4,259	3,788
消 費 者 ロ ー ン	50	1
そ の 他	-	-
合 計	2,972,689	2,781,305

(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年度末		
		占率		占率	
大 企 業	貸付先数	184	178	80.9	
	金 額	1,631,211	1,490,559	90.3	
中 堅 企 業	貸付先数	2	2	0.9	
	金 額	3,023	2,821	0.2	
中 小 企 業	貸付先数	41	40	18.2	
	金 額	135,324	157,072	9.5	
国内企業向け 貸 付 計	貸付先数 金 額	227 1,769,558	100.0 100.0	220 1,650,452	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 除く企業種		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		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 のないもの	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	44,894	62,074	370	26,435	14,423	56,636	40,000	244,834
固 定 金 利	971,412	327,292	230,414	181,810	291,888	238,910	-	2,241,728
一 般 貸 付 計	1,016,306	389,366	230,784	208,246	306,311	295,547	40,000	2,486,563

(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年度末		
	金 額	占率	金 額	占率	
	292,492	11.0	249,993	10.1	
製 造 業	食 料	11,369	0.4	13,121	0.5
	織 維	4,561	0.2	3,130	0.1
	木 材 ・ 木 製 品	800	0.0	300	0.0
	パ ル プ ・ 紙	11,950	0.4	12,070	0.5
	印 刷	-	-	-	-
	化 学	47,436	1.8	39,234	1.6
	石 油 ・ 石 炭	36,680	1.4	36,430	1.5
	窯 業 ・ 土 石	9,836	0.4	10,390	0.4
	鉄 鋼	54,900	2.1	48,600	2.0
	非 鉄 金 属	6,020	0.2	6,150	0.2
	金 属 製 品	-	-	-	-
	はん用・生産用・業務用機械	18,620	0.7	19,532	0.8
	電 気 機 械	53,918	2.0	36,766	1.5
	輸 送 用 機 械	32,722	1.2	20,710	0.8
そ の 他 の 製 造 業	3,680	0.1	3,560	0.1	
国 内 向 け	農 業 、 林 業	-	-	-	-
	漁 業	-	-	-	-
	鉱業、採石業、砂利採取業	-	-	-	-
	建 設 業	1,858	0.1	1,606	0.1
	電気・ガス・熱供給・水道業	262,646	9.8	235,998	9.5
	情 報 通 信 業	30,600	1.1	29,600	1.2
	運 輸 業 、 郵 便 業	137,888	5.2	144,435	5.8
	卸 売 業	470,160	17.6	405,750	16.3
	小 売 業	6,197	0.2	5,061	0.2
	金 融 業 、 保 険 業	333,950	12.5	328,616	13.2
	不 動 産 業	127,926	4.8	129,676	5.2
	物 品 賃 貸 業	95,129	3.6	109,609	4.4
	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	10,176	0.4
	地 方 公 共 団 体	138	0.0	92	0.0
個人(住宅・消費・納税資金等)	4,309	0.2	3,790	0.2	
合 計	2,652,398	99.4	2,428,755	97.7	
海 外 向 け	政 府 等	15,000	0.6	10,000	0.4
	金 融 機 関 等	2,000	0.1	47,808	1.9
	商 工 業 等	-	-	-	-
合 計	17,000	0.6	57,808	2.3	
一 般 貸 付 計	2,669,398	100.0	2,486,563	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年度末 7,733億円)

(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年度末	
	金 額	占率	金 額	占率
担 保 貸 付	550	0.0	12,724	0.5
有 価 証 券 担 保 貸 付	460	0.0	350	0.0
不 動 産 ・ 動 産 ・ 財 団 担 保 貸 付	90	0.0	12,374	0.5
指 名 債 権 担 保 貸 付	-	-	-	-
保 証 貸 付	35,747	1.3	25,953	1.0
信 用 貸 付	2,628,790	98.5	2,444,095	98.3
そ の 他	4,309	0.2	3,790	0.2
一 般 貸 付 計	2,669,398	100.0	2,486,563	100.0
う ち 劣 後 特 約 付 貸 付	185,000	6.9	173,000	7.0

(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年度末	
	金 額	占率	金 額	占率
北 海 道	12,197	0.5	12,377	0.5
東 北	29,000	1.1	22,495	0.9
関 東	2,190,963	82.7	2,037,240	84.0
中 部	99,870	3.8	93,501	3.9
近 畿	229,426	8.7	181,935	7.5
中 国	35,154	1.3	28,229	1.2
四 国	10,100	0.4	10,100	0.4
九 州	41,375	1.6	39,085	1.6
合 計	2,648,088	100.0	2,424,964	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28年度末		平成29年度末	
	金 額	占率	金 額	占率
公 社 債	6,529,786	68.3	7,664,115	67.0
株 式 等	649,857	6.8	760,731	6.6
現 預 金 ・ そ の 他	188,126	2.0	827,815	7.2
外 貨 建 資 産 計	7,367,770	77.1	9,252,661	80.9

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年度末	
	金 額	占率	金 額	占率
貸 付 金	127,077	1.3	141,197	1.2
公 社 債	56,324	0.6	53,338	0.5
現 預 金 ・ そ の 他	25,049	0.3	69,972	0.6
円 貨 額 が 確 定 し た 外 貨 建 資 産 計	208,450	2.2	264,508	2.3

ウ. 円貨建資産

(単位：百万円、%)

区 分	平成28年度末		平成29年度末	
	金 額	占率	金 額	占率
公 社 債	1,601,851	16.8	1,553,889	13.6
株 式 等	320,268	3.4	312,990	2.7
非 居 住 者 貸 付	17,000	0.2	10,000	0.1
そ の 他	39,752	0.4	49,312	0.4
円 貨 建 資 産 計	1,978,872	20.7	1,926,192	16.8

エ. 合計

(単位：百万円、%)

区 分	平成28年度末		平成29年度末	
	金 額	占率	金 額	占率
海 外 投 融 資	9,555,093	100.0	11,443,362	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	-	3,525,959	3,054,114	471,844	47,808
	占率	35.7	34.2	48.1	-	35.7	34.7	44.4	82.7
ヨーロッパ	金額	2,162,077	2,160,206	1,871	12,000	2,763,472	2,759,766	3,706	5,000
	占率	24.5	27.6	0.2	70.6	28.0	31.4	0.3	8.6
オセアニア	金額	363,939	363,939	-	-	420,619	420,619	-	-
	占率	4.1	4.6	-	-	4.3	4.8	-	-
ア ジ ア	金額	115,598	2,144	113,453	-	117,521	2,140	115,380	-
	占率	1.3	0.0	11.7	-	1.2	0.0	10.8	-
中 南 米	金額	2,524,203	2,135,921	388,281	-	2,630,390	2,157,541	472,849	-
	占率	28.7	27.2	40.0	-	26.7	24.5	44.4	-
中 東	金額	-	-	-	-	-	-	-	-
	占率	-	-	-	-	-	-	-	-
アフリカ	金額	3,523	3,523	-	-	3,567	3,567	-	-
	占率	0.0	0.0	-	-	0.0	0.0	-	-
国際機関	金額	491,044	491,044	-	5,000	403,232	403,232	-	5,000
	占率	5.6	6.3	-	29.4	4.1	4.6	-	8.6
合 計	金額	8,809,343	7,839,217	970,125	17,000	9,864,763	8,800,982	1,063,780	57,808
	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・オセアニ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年度末	
	金 額	占率	金 額	占率
米 ド ル	4,686,636	63.6	5,772,976	62.4
ユ ー ロ	1,157,582	15.7	1,867,816	20.2
豪 ド ル	1,221,366	16.6	1,199,622	13.0
ニュージーランドドル	115,395	1.6	201,812	2.2
ポーランドズロチ	73,108	1.0	94,996	1.0
中 国 元	42,175	0.6	44,106	0.5
インドネシアルピア	38,300	0.5	38,116	0.4
ベトナムドン	33,180	0.5	33,190	0.4
そ の 他	24	0	23	0
合 計	7,367,770	100.0	9,252,661	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	59,951	6,356

#### (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	249,711	46,606

### 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	2,892	-	13	13
	(米ドル)	256	-	△2	△2	1,194	-	4	4
	(ユーロ)	-	-	-	-	1,297	-	7	7
	(豪ドル)	-	-	-	-	58	-	0	0
	(カナダドル)	-	-	-	-	49	-	0	0
	(英ポンド)	-	-	-	-	227	-	1	1
	(スウェーデンクローナ)	-	-	-	-	10	-	0	0
	(シンガポールドル)	-	-	-	-	16	-	0	0
	(ポーランドズロチ)	-	-	-	-	21	-	0	0
	(南アフリカランド)	-	-	-	-	14	-	0	0
	買建	256	-	2	2	296	-	△0	△0
	(米ドル)	256	-	2	2	202	-	△0	△0
	(ユーロ)	-	-	-	-	37	-	△0	△0
	(豪ドル)	-	-	-	-	6	-	0	0
	(カナダドル)	-	-	-	-	9	-	△0	△0
	(スイスフラン)	-	-	-	-	9	-	0	0
	(英ポンド)	-	-	-	-	20	-	△0	△0
	(ニュージーランドドル)	-	-	-	-	0	-	0	0
	(スウェーデンクローナ)	-	-	-	-	3	-	△0	△0
	(シンガポールドル)	-	-	-	-	1	-	△0	△0
	(香港ドル)	-	-	-	-	5	-	-	-
		合 計				△0			13

(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	9,434	-	223	
	合 計				△299			223	

(通貨関連)

(単位：百万円)

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

### 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年度末	
	金 額	占率	金 額	占率
現預金・コールローン	1,082,100	3.6	1,488,981	4.7
買入金銭債権	230,518	0.8	283,252	0.9
有 価 証 券	24,732,137	82.4	25,819,731	81.9
公 社 債	13,481,682	44.9	13,442,526	42.6
株 式	1,911,643	6.4	2,091,344	6.6
外 国 証 券	9,070,061	30.2	10,118,472	32.1
公 社 債	7,977,870	26.6	8,930,146	28.3
株 式 等	1,092,190	3.6	1,188,325	3.8
その他の証券	268,750	0.9	167,387	0.5
貸 付 金	2,972,689	9.9	2,781,305	8.8
保険約款貸付	303,290	1.0	294,742	0.9
一般貸付	2,669,398	8.9	2,486,563	7.9
不 動 産	578,811	1.9	571,641	1.8
うち投資用	401,966	1.3	388,745	1.2
繰延税金資産	124,609	0.4	154,714	0.5
そ の 他	307,248	1.0	438,228	1.4
貸倒引当金	△1,132	△0.0	△921	△0.0
会 社 計	30,026,983	100.0	31,536,934	100.0
うち外貨建資産	7,629,500	25.4	9,496,828	30.1

(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	平成29年度
	金 額	金 額
現預金・コールローン	527,593	406,881
買入金銭債権	24,216	52,733
有 価 証 券	1,099,676	1,087,593
公 社 債	△247,939	△39,156
株 式	139,696	179,701
外 国 証 券	1,150,666	1,048,411
公 社 債	1,114,797	952,276
株 式 等	35,869	96,135
その他の証券	57,252	△101,362
貸 付 金	776,213	△191,383
保険約款貸付	△11,363	△8,548
一般貸付	787,576	△182,834
不 動 産	△35,557	△7,169
うち投資用	△27,169	△13,220
繰延税金資産	49,287	30,104
そ の 他	△56,400	130,979
貸倒引当金	370	211
会 社 計	2,385,399	1,509,951
うち外貨建資産	1,584,356	1,867,328

(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	917,228	△24,463

(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	-	1,888,273	2,202,331	314,058	314,058	△0
責任準備金対応債券	11,088,673	13,056,296	1,967,623	2,023,431	△55,808	11,206,795	13,156,647	1,949,852	1,995,109	△45,256
子会社・関連会社株式	33,173	35,754	2,580	2,580	-	33,173	53,967	20,793	20,793	-
その他の有価証券	9,405,982	10,375,805	969,822	1,103,170	△133,348	10,436,630	11,493,745	1,057,115	1,228,009	△170,894
公 社 債	1,484,122	1,562,503	78,381	83,050	△4,668	1,649,259	1,714,504	65,245	82,711	△17,466
株 式	784,201	1,584,632	800,430	808,738	△8,307	838,599	1,812,663	974,063	986,723	△12,659
外 国 証 券	6,209,300	6,281,051	71,751	190,963	△119,211	7,260,364	7,257,270	△3,094	137,507	△140,601
公 社 債	6,136,882	6,207,918	71,036	190,150	△119,114	7,039,984	7,034,408	△5,576	134,670	△140,246
株 式 等	72,417	73,132	714	812	△97	220,380	222,862	2,482	2,837	△355
その他の証券	127,421	140,826	13,404	14,070	△665	44,983	58,729	13,746	13,806	△60
買入金銭債権	190,936	196,810	5,874	6,349	△475	202,323	209,492	7,169	7,261	△92
譲渡性預金	610,000	609,980	△19	-	△19	441,100	441,084	△15	-	△15
その他	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
合 計	22,469,844	25,771,305	3,301,461	3,490,618	△189,156	23,564,872	26,906,692	3,341,819	3,557,971	△216,152
公 社 債	12,883,510	14,958,180	2,074,669	2,134,598	△59,928	12,978,148	15,023,825	2,045,676	2,103,337	△57,660
株 式	784,201	1,584,632	800,430	808,738	△8,307	838,599	1,812,663	974,063	986,723	△12,659
外 国 証 券	7,873,773	8,280,876	407,102	526,862	△119,760	9,059,717	9,360,895	301,178	446,843	△145,665
公 社 債	7,768,181	8,171,988	403,806	523,468	△119,662	8,806,163	9,084,066	277,902	423,212	△145,309
株 式 等	105,591	108,887	3,295	3,393	△97	253,554	276,829	23,275	23,631	△355
その他の証券	127,421	140,826	13,404	14,070	△665	44,983	58,729	13,746	13,806	△60
買入金銭債権	190,936	196,810	5,874	6,349	△475	202,323	209,492	7,169	7,261	△92
譲渡性預金	610,000	609,980	△19	-	△19	441,100	441,084	△15	-	△15
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28年度末	平成29年度末
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	612,315
その他の有価証券	369,119	309,293
非上場国内株式(店頭売買株式を除く)	15,701	13,620
非上場外国株式(店頭売買株式を除く)	351,558	293,558
非 上 場 外 国 債 券	-	-
そ の 他	1,859	2,114
合 計	974,026	921,609

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29年3月末	平成30年3月末	平成29年3月末	平成30年3月末
金利スワップ 金利スワップション(買建)	2,188	803	6	6
為替予約	63,154	74,670	1,131	3,082
通貨スワップ 通貨オプション(買建)	3,080	4,129	440	518
株式オプション(買建) 株価指数先渡	-	-	-	-
合 計			530	2,939

(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	701	169,860	-	-	-	170,561
ヘッジ会計非適用分	△630	△21,230	1,421	-	-	△20,440	-	9,851	△0	-	-	9,851
合 計	△361	△275,710	1,421	-	-	△274,650	701	179,712	△0	-	-	180,413

(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年度末通貨関連 180,238百万円となっています。

(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	-	-	-	
	合 計				△630			-	

(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	15,000	15,000	△119	15,000	15,000	△79
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	33,828	17,520	388	17,520	14,236	119
	固定金利支払/変動金利受取		-	-	-	47,808	47,808	660
合 計					268			701

(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	333,609	-	13,762	13,762
	(豪ドル)	187,661	-	△14,281	△14,281	214,582	-	11,972	11,972
	(米ドル)	66,485	818	△1,977	△1,977	89,636	-	1,886	1,886
	(ユーロ)	40,713	-	438	438	21,527	-	△55	△55
	買建	533,720	-	△5,205	△5,205	276,116	-	△3,911	△3,911
	(米ドル)	532,305	-	△5,204	△5,204	171,648	-	△3,618	△3,618
	(ユーロ)	1,078	-	△1	△1	53,012	-	△325	△325
	(豪ドル)	149	-	149	0	51,245	-	32	32
	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			9,851	

- (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	外貨建資産						
	売建		5,424,477	320,453	△255,228	6,803,557	187,916	180,238
	(米ドル)		3,227,455	233,066	△140,801	3,704,596	127,932	141,139
	(ユーロ)		1,146,493	-	△6,205	1,821,424	-	9,954
	(豪ドル)	868,089	87,387	△101,535	981,860	59,984	23,450	
繰延ヘッジ	通貨スワップ	外貨建資産	26,780	26,780	△574	26,780	26,780	615
	(米ドル)		24,326	24,326	△614	24,326	24,326	808
	(ユーロ)		2,454	2,454	40	2,454	2,454	△193
振当処理	為替予約	外貨建資産						
	売建		58,502	55,505	△20,963	53,778	-	△18,082
	(豪ドル)		55,505	55,505	△20,033	53,778	-	△18,082
	(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	12,310
	(米ドル)		127,077	127,077	6,470	141,197	141,197	12,310
	通貨スワップ	外貨建負債	99,480	99,480	15,816	244,924	244,924	△5,221
(米ドル)	99,480		99,480	15,816	244,924	244,924	△5,221	
合計					△254,479		169,860	

(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	9,758	-	△231	△231
	買建	23,952	-	△342	△342	10,903	-	231	231
	合 計				1,421				△0

(注) 差損益欄には、時価を記載しています。

(ヘッジ会計が適用されているもの)

平成28年度末、平成29年度末ともに残高がないため、記載していません。