

平成30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29年度末		平成30年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
国 債	9,862,813	39.6	9,848,259	38.3
地 方 債	114,815	0.5	123,061	0.5
社 債	3,065,764	12.3	3,220,080	12.5
うち公社・公団債	1,860,806	7.5	2,017,603	7.8
うち外貨建	470,359	1.9	482,606	1.9
株 式	1,933,967	7.8	2,001,771	7.8
外 国 証 券	9,864,763	39.6	10,409,281	40.5
公 社 債	8,800,982	35.3	9,263,952	36.0
うち外貨建	7,193,755	28.9	7,720,112	30.0
株 式 等	1,063,780	4.3	1,145,328	4.5
うち外貨建	760,731	3.1	861,664	3.4
その他の証券	60,773	0.2	118,504	0.5
合 計	24,902,898	100.0	25,720,958	100.0
うち外貨建	8,424,846	33.8	9,064,383	35.2

(2) 地域別地方債保有内訳

(単位：百万円)

区 分	平成29年度末	平成30年度 第2四半期(上半期)末
北 海 道	-	-
東 北	-	-
関 東	58,621	61,453
中 部	25,485	30,258
近 畿	14,746	14,706
中 国	116	115
四 国	-	-
九 州	15,846	16,527
合 計	114,815	123,061

(3) 有価証券残存期間別残高

<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

<平成30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	497,484	1,130,959	1,110,251	1,519,191	4,100,086	13,785,136	3,577,849	25,720,958
国 債	36,834	267,283	333,385	199,969	1,216,273	7,794,512	-	9,848,259
地 方 債	4,010	-	2,794	5,993	-	110,263	-	123,061
社 債	58,431	92,607	173,897	318,644	497,061	1,751,080	328,357	3,220,080
株 式							2,001,771	2,001,771
外 国 証 券	398,207	771,069	599,991	994,200	2,386,751	4,129,279	1,129,783	10,409,281
公 社 債	398,187	771,069	596,584	994,200	2,383,806	4,120,104	-	9,263,952
株 式 等	19	-	3,407	-	2,944	9,174	1,129,783	1,145,328
その他の証券	-	-	183	383	-	-	117,937	118,504
買入金銭債権	3,999	-	-	-	-	159,296	-	163,296
譲渡性預金	248,979	-	-	-	-	-	-	248,979
そ の 他	-	-	-	-	-	-	-	-
合 計	750,463	1,130,959	1,110,251	1,519,191	4,100,086	13,944,433	3,577,849	26,133,234

(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29年度末		平成30年度 第2四半期(上半期)末	
		金 額	占率	金 額	占率
水産・農林業		308	0.0	333	0.0
鉱業		92	0.0	94	0.0
建設業		72,850	3.8	68,378	3.4
製 造 業	食料品	75,310	3.9	71,618	3.6
	繊維製品	11,749	0.6	11,248	0.6
	パルプ・紙	8,191	0.4	8,060	0.4
	化学	218,401	11.3	234,527	11.7
	医薬品	145,839	7.5	183,901	9.2
	石油・石炭製品	7,701	0.4	10,335	0.5
	ゴム製品	7,122	0.4	6,451	0.3
	ガラス・土石製品	25,171	1.3	24,279	1.2
	鉄鋼	23,762	1.2	22,755	1.1
	非鉄金属	46,562	2.4	44,881	2.2
	金属製品	11,161	0.6	10,177	0.5
	機械	141,436	7.3	147,583	7.4
	電気機器	249,618	12.9	232,329	11.6
	輸送用機器	58,865	3.0	55,804	2.8
	精密機器	12,785	0.7	14,495	0.7
	その他製品	53,876	2.8	61,576	3.1
電気・ガス業		31,505	1.6	34,948	1.7
運 輸 ・ 情 報 通 信 業	陸運業	174,378	9.0	200,828	10.0
	海運業	3,439	0.2	3,384	0.2
	空運業	5,127	0.3	4,745	0.2
	倉庫・運輸関連業	8,905	0.5	9,111	0.5
	情報・通信業	19,328	1.0	21,273	1.1
商 業	卸売業	114,684	5.9	117,294	5.9
	小売業	32,031	1.7	30,370	1.5
金 融 ・ 保 険 業	銀行業	179,268	9.3	172,874	8.6
	証券、商品先物取引業	6,823	0.4	6,230	0.3
	保険業	109,985	5.7	114,061	5.7
	その他金融業	4,554	0.2	4,367	0.2
不動産業		25,639	1.3	26,001	1.3
サービス業		47,485	2.5	47,447	2.4
合 計		1,933,967	100.0	2,001,771	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29年度末	平成30年度 第2四半期(上半期)末
保 険 約 款 貸 付	294,742	292,247
契 約 者 貸 付	269,473	266,868
保 険 料 振 替 貸 付	25,268	25,379
一 般 貸 付 (うち非居住者貸付)	2,486,563 (57,808)	2,761,830 (61,106)
企 業 貸 付 (うち国内企業向け)	1,698,260 (1,650,452)	1,688,307 (1,637,200)
国・国際機関・政府関係機関貸付	779,420	1,059,980
公 共 団 体 ・ 公 企 業 貸 付	5,092	10,069
住 宅 ロ ー ン	3,788	3,470
消 費 者 ロ ー ン	1	3
そ の 他	-	-
合 計	2,781,305	3,054,078

(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29年度末		平成30年度 第2四半期(上半期)末	
			占率		占率
大 企 業	貸付先数	178	80.9	178	78.4
	金額	1,490,559	90.3	1,473,412	90.0
中 堅 企 業	貸付先数	2	0.9	2	0.9
	金額	2,821	0.2	1,150	0.1
中 小 企 業	貸付先数	40	18.2	47	20.7
	金額	157,072	9.5	162,638	9.9
国内企業向け 貸付計	貸付先数 金額	220 1,650,452	100.0 100.0	227 1,637,200	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	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、「物品貸貸業」、「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 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

<平成30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	49,159	61,262	359	26,376	23,307	58,345	30,000	248,811
固 定 金 利	1,238,760	289,071	259,054	170,520	276,502	279,110	-	2,513,019
一 般 貸 付 計	1,287,919	350,334	259,414	196,896	299,810	337,455	30,000	2,761,830

(4) 貸付金業種別内訳

(単位：百万円、%)

区 分		平成29年度末		平成30年度 第2四半期(上半期)末	
		金 額	占率	金 額	占率
製 造 業		249,993	10.1	232,345	8.4
	食料	13,121	0.5	12,952	0.5
	繊維	3,130	0.1	2,115	0.1
	木材・木製品	300	0.0	600	0.0
	パルプ・紙	12,070	0.5	12,830	0.5
	印刷	-	-	-	-
	化学	39,234	1.6	35,953	1.3
	石油・石炭	36,430	1.5	29,430	1.1
	窯業・土石	10,390	0.4	10,387	0.4
	鉄鋼	48,600	2.0	50,600	1.8
	非金属製品	6,150	0.2	6,150	0.2
	金属製品	-	-	212	0.0
	はん用・生産用・業務用機械	19,532	0.8	23,635	0.9
	電気機械	36,766	1.5	22,204	0.8
輸送用機械	20,710	0.8	21,726	0.8	
その他の製造業	3,560	0.1	3,550	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	1,606	0.1	2,203	0.1
	電気・ガス・熱供給・水道業	235,998	9.5	238,635	8.6
	情報通信業	29,600	1.2	29,100	1.1
	運輸業、郵便業	144,435	5.8	147,393	5.3
	卸売業	405,750	16.3	392,000	14.2
	小売業	5,061	0.2	4,757	0.2
	金融業、保険業	328,616	13.2	336,009	12.2
	不動産業	129,676	5.2	133,886	4.8
	物品賃貸業	109,609	4.4	116,261	4.2
	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	10,176	0.4	9,605	0.3
地方公共団体	92	0.0	69	0.0	
個人(住宅・消費・納税資金等)	3,790	0.2	3,474	0.1	
合 計	2,428,755	97.7	2,700,724	97.8	
海 外 向 け	政 府 等	10,000	0.4	10,000	0.4
	金 融 機 関 等	47,808	1.9	51,106	1.9
	商 工 業 等	-	-	-	-
合 計	57,808	2.3	61,106	2.2	
一 般 貸 付 計		2,486,563	100.0	2,761,830	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29年度末 7,733億円、平成30年度第2四半期(上半期)末 1兆539億円)

(5) 貸付金担保別内訳

(単位：百万円、%)

区 分	平成29年度末		平成30年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
担 保 貸 付	12,724	0.5	17,473	0.6
有 価 証 券 担 保 貸 付	350	0.0	300	0.0
不 動 産 ・ 動 産 ・ 財 団 担 保 貸 付	12,374	0.5	17,173	0.6
指 名 債 権 担 保 貸 付	-	-	-	-
保 証 貸 付	25,953	1.0	24,640	0.9
信 用 貸 付	2,444,095	98.3	2,716,242	98.3
そ の 他	3,790	0.2	3,474	0.1
一 般 貸 付 計	2,486,563	100.0	2,761,830	100.0
う ち 劣 後 特 約 付 貸 付	173,000	7.0	163,000	5.9

(6) 貸付金地域別内訳

(単位：百万円、%)

区 分	平成29年度末		平成30年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
北 海 道	12,377	0.5	12,312	0.5
東 北	22,495	0.9	20,822	0.8
関 東	2,037,240	84.0	2,305,953	85.5
中 部	93,501	3.9	96,745	3.6
近 畿	181,935	7.5	182,957	6.8
中 国	28,229	1.2	27,344	1.0
四 国	10,100	0.4	10,100	0.4
九 州	39,085	1.6	41,015	1.5
合 計	2,424,964	100.0	2,697,250	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29年度末		平成30年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
公 社 債	7,664,115	67.0	8,202,718	67.8
株 式 等	760,731	6.6	861,664	7.1
現 預 金 ・ そ の 他	827,815	7.2	994,639	8.2
外 貨 建 資 産 計	9,252,661	80.9	10,059,023	83.1

(イ) 円貨額が確定した外貨建資産

(単位：百万円、%)

区 分	平成29年度末		平成30年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
貸 付 金	141,197	1.2	141,197	1.2
公 社 債	53,338	0.5	-	-
現 預 金 ・ そ の 他	69,972	0.6	49,994	0.4
円 貨 額 が 確 定 し た 外 貨 建 資 産 計	264,508	2.3	191,191	1.6

(ウ) 円貨建資産

(単位：百万円、%)

区 分	平成29年度末		平成30年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
公 社 債	1,553,889	13.6	1,543,839	12.8
株 式 等	312,990	2.7	293,725	2.4
非 居 住 者 貸 付	10,000	0.1	10,000	0.1
そ の 他	49,312	0.4	4,385	0.0
円 貨 建 資 産 計	1,926,192	16.8	1,851,950	15.3

(エ) 合計

(単位：百万円、%)

区 分	平成29年度末		平成30年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
海 外 投 融 資	11,443,362	100.0	12,102,165	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29年度末				平成30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	3,525,959	3,054,114	471,844	47,808	3,608,691	3,136,195	472,496	51,106
	占率	35.7	34.7	44.4	82.7	34.7	33.9	41.3	83.6
ヨーロッパ	金額	2,763,472	2,759,766	3,706	5,000	3,205,109	3,195,730	9,378	5,000
	占率	28.0	31.4	0.3	8.6	30.8	34.5	0.8	8.2
オセアニア	金額	420,619	420,619	-	-	453,127	453,127	-	-
	占率	4.3	4.8	-	-	4.4	4.9	-	-
ア ジ ア	金額	117,521	2,140	115,380	-	93,922	2,132	91,790	-
	占率	1.2	0.0	10.8	-	0.9	0.0	8.0	-
中 南 米	金額	2,630,390	2,157,541	472,849	-	2,697,610	2,125,947	571,663	-
	占率	26.7	24.5	44.4	-	25.9	22.9	49.9	-
中 東	金額	-	-	-	-	-	-	-	-
	占率	-	-	-	-	-	-	-	-
ア フ リ カ	金額	3,567	3,567	-	-	3,691	3,691	-	-
	占率	0.0	0.0	-	-	0.0	0.0	-	-
国際機関	金額	403,232	403,232	-	5,000	347,128	347,128	-	5,000
	占率	4.1	4.6	-	8.6	3.3	3.7	-	8.2
合 計	金額	9,864,763	8,800,982	1,063,780	57,808	10,409,281	9,263,952	1,145,328	61,106
	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29年度末		平成30年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
米 ド ル	5,772,976	62.4	6,032,360	60.0
ユ ー ロ	1,867,816	20.2	2,423,615	24.1
豪 ド ル	1,199,622	13.0	1,199,993	11.9
ニュージーランドドル	201,812	2.2	201,802	2.0
ポーランドズロチ	94,996	1.0	109,407	1.1
中 国 元	44,106	0.5	42,904	0.4
ベトナムドン	33,190	0.4	33,190	0.3
インドネシアルピア	38,116	0.4	15,723	0.2
そ の 他	23	0.0	23	0.0
合 計	9,252,661	100.0	10,059,023	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29年度末		平成30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	59,951	6,356	61,890	8,696

(2) 変額個人年金保険

(単位：百万円)

区 分	平成29年度末		平成30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	249,711	46,606	197,594	43,194

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29年度末			平成30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	-	-	-	308	-	△1	△1	
	合 計							△1	

(通貨関連)

(単位：百万円)

区分	種 類	平成29年度末			平成30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	2,892	-	13	13	129	-	0	0
	(米ドル)	1,194	-	4	4	129	-	0	0
	(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	296	-	△0	△0	737	-	0	0
	(米ドル)	202	-	△0	△0	563	-	0	0
	(ユーロ)	37	-	△0	△0	73	-	0	0
	(豪ドル)	6	-	0	0	9	-	0	0
	(カナダドル)	9	-	△0	△0	18	-	0	0
	(スイスフラン)	9	-	0	0	17	-	0	0
	(デンマーククローネ)	-	-	-	-	1	-	0	0
	(英ポンド)	20	-	△0	△0	42	-	0	0
	(ノルウェークローネ)	-	-	-	-	1	-	0	0
	(スウェーデンクローナ)	3	-	△0	△0	4	-	0	0
	(シンガポールドル)	1	-	△0	△0	-	-	-	-
	(香港ドル)	5	-	-	-	3	-	0	0
						13			0

(注) 外貨建金銭債権債務等が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29年度末			平成30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	9,434	-	223	223	3,617	-	259	
	合 計							259	

(通貨関連)

(単位：百万円)

区分	種 類	平成29年度末			平成30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	-	-	-	-	1,368	-	△4	△4
	(米ドル)	-	-	-	-	810	-	△3	△3
	(ユーロ)	-	-	-	-	373	-	0	0
	(豪ドル)	-	-	-	-	9	-	0	0
	(カナダドル)	-	-	-	-	28	-	0	0
	(スイスフラン)	-	-	-	-	14	-	0	0
	(デンマーククローネ)	-	-	-	-	1	-	0	0
	(英ポンド)	-	-	-	-	110	-	0	0
	(ノルウェークローネ)	-	-	-	-	3	-	0	0
	(スウェーデンクローナ)	-	-	-	-	4	-	0	0
	(シンガポールドル)	-	-	-	-	11	-	0	0
	(香港ドル)	-	-	-	-	4	-	0	0
	買建	-	-	-	-	154	-	1	1
	(米ドル)	-	-	-	-	154	-	1	1
	(ユーロ)	-	-	-	-	-	-	-	-
		合 計							△3

(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29年度末		平成30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	1,488,981	4.7	1,539,793	4.7
買入金銭債権	283,252	0.9	265,405	0.8
有 価 証 券	25,819,731	81.9	26,612,324	81.8
公 社 債	13,442,526	42.6	13,554,956	41.6
株 式	2,091,344	6.6	2,172,353	6.7
外 国 証 券	10,118,472	32.1	10,657,091	32.7
公 社 債	8,930,146	28.3	9,372,695	28.8
株 式 等	1,188,325	3.8	1,284,395	3.9
その他の証券	167,387	0.5	227,923	0.7
貸 付 金	2,781,305	8.8	3,054,078	9.4
保 険 約 款 貸 付	294,742	0.9	292,247	0.9
一 般 貸 付	2,486,563	7.9	2,761,830	8.5
不 動 産	571,641	1.8	564,600	1.7
う ち 投 資 用	388,745	1.2	383,365	1.2
繰延税金資産	154,714	0.5	159,143	0.5
そ の 他	438,228	1.4	354,999	1.1
貸倒引当金	△921	△0.0	△832	△0.0
会 社 計	31,536,934	100.0	32,549,513	100.0
う ち 外 貨 建 資 産	9,496,828	30.1	10,296,165	31.6

（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29年度 第2四半期（上半期）	平成30年度 第2四半期（上半期）
	金 額	金 額
現預金・コールローン	251,968	50,811
買入金銭債権	31,314	△17,846
有 価 証 券	977,421	792,593
公 社 債	△2,922	112,430
株 式	80,793	81,008
外 国 証 券	944,199	538,618
公 社 債	871,105	442,548
株 式 等	73,094	96,069
その他の証券	△44,649	60,535
貸 付 金	19,333	272,773
保 険 約 款 貸 付	△6,092	△2,494
一 般 貸 付	25,426	275,267
不 動 産	△9,065	△7,041
う ち 投 資 用	△6,965	△5,380
繰延税金資産	△26,694	4,428
そ の 他	△7,869	△83,228
貸倒引当金	157	88
会 社 計	1,236,565	1,012,578
う ち 外 貨 建 資 産	1,342,064	799,337

（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29年度末		平成30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	917,228	△24,463	896,618	9,133

(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29年度末、平成30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29年度末					平成30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	1,888,273	2,202,331	314,058	314,058	△0	1,814,520	2,113,090	298,569	298,570	△0
責任準備金対応債券	11,206,795	13,156,647	1,949,852	1,995,109	△45,256	11,446,454	13,093,736	1,647,282	1,734,122	△86,840
子会社・関連会社株式	33,173	53,967	20,793	20,793	-	33,173	58,353	25,179	25,179	-
その他の有価証券	10,436,630	11,493,745	1,057,115	1,228,009	△170,894	10,886,492	11,983,079	1,096,587	1,288,732	△192,145
公 社 債	1,649,259	1,714,504	65,245	82,711	△17,466	1,731,561	1,777,077	45,515	70,045	△24,530
株 式	838,599	1,812,663	974,063	986,723	△12,659	839,403	1,878,288	1,038,884	1,054,618	△15,734
外国証券	7,260,364	7,257,270	△3,094	137,507	△140,601	7,813,495	7,799,049	△14,446	136,648	△151,095
公 社 債	7,039,984	7,034,408	△5,576	134,670	△140,246	7,427,584	7,412,049	△15,534	133,129	△148,663
株 式 等	220,380	222,862	2,482	2,837	△355	385,911	386,999	1,087	3,519	△2,431
その他の証券	44,983	58,729	13,746	13,806	△60	94,941	116,389	21,448	21,448	△0
買入金銭債権	202,323	209,492	7,169	7,261	△92	158,089	163,296	5,207	5,971	△764
譲渡性預金	441,100	441,084	△15	-	△15	249,000	248,979	△20	-	△20
その他の	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
合 計	23,564,872	26,906,692	3,341,819	3,557,971	△216,152	24,180,641	27,248,259	3,067,618	3,346,605	△278,986
公 社 債	12,978,148	15,023,825	2,045,676	2,103,337	△57,660	13,145,885	14,873,838	1,727,952	1,826,416	△98,463
株 式	838,599	1,812,663	974,063	986,723	△12,659	839,403	1,878,288	1,038,884	1,054,618	△15,734
外国証券	9,059,717	9,360,895	301,178	446,843	△145,665	9,693,320	9,967,467	274,147	438,150	△164,003
公 社 債	8,806,163	9,084,066	277,902	423,212	△145,309	9,274,235	9,522,115	247,879	409,452	△161,572
株 式 等	253,554	276,829	23,275	23,631	△355	419,085	445,352	26,267	28,698	△2,431
その他の証券	44,983	58,729	13,746	13,806	△60	94,941	116,389	21,448	21,448	△0
買入金銭債権	202,323	209,492	7,169	7,261	△92	158,089	163,296	5,207	5,971	△764
譲渡性預金	441,100	441,084	△15	-	△15	249,000	248,979	△20	-	△20
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29年度末	平成30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	-	-
その他の	-	-
責任準備金対応債券	-	-
子会社・関連会社株式	612,315	589,923
その他の有価証券	309,293	252,493
非上場国内株式(店頭売買株式を除く)	13,620	15,800
非上場外国株式(店頭売買株式を除く)	293,558	234,558
非上場外国債券	-	-
その他の	2,114	2,134
合 計	921,609	842,417

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29年度末、平成30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29年度末、平成30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
その他	－	マルチ・アセット指数オプション

（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9月末	平成30年9月末	平成29年9月末	平成30年9月末
金利スワップ 金利スワップション(買建)	1,156	834	5	15
為替予約	86,885	75,059	1,512	967
通貨スワップ 通貨オプション(買建)	4,129	4,239	588	485
マルチ・アセット指数オ プション	-	196	-	23
合 計			819	630

(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29年度末						平成30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	701	169,860	-	-	-	170,561	1,076	△170,254	-	-	-	△169,177
ヘッジ会計非適用分	-	9,851	△0	-	-	9,851	-	△194	368	1,121	△20	1,275
合 計	701	179,712	△0	-	-	180,413	1,076	△170,448	368	1,121	△20	△167,902

(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29年度末通貨関連 180,238百万円、平成30年度第2四半期(上半期)末通貨関連 △180,845百万円となっています。

(2) 金利関連（会社計）

（ヘッジ会計が適用されていないもの）

平成29年度末、平成30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。

（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29年度末			平成30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						
	固定金利受取/変動金利支払		15,000	15,000	△79	15,000	15,000	△86
特例処理	金利スワップ	貸付金						
	固定金利受取/変動金利支払		17,520	14,236	119	17,378	10,095	87
	固定金利支払/変動金利受取		47,808	47,808	660	51,106	51,106	1,074
合 計					701			1,076

(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29年度末				平成30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	333,609	-	13,762	13,762	405,722	-	△5,113	△5,113
	(豪ドル)	214,582	-	11,972	11,972	205,306	-	△132	△132
	(米ドル)	89,636	-	1,886	1,886	161,880	-	△4,347	△4,347
	(ユーロ)	21,527	-	△55	△55	32,635	-	△508	△508
	買建	276,116	-	△3,911	△3,911	207,777	-	4,918	4,918
	(米ドル)	171,648	-	△3,618	△3,618	201,903	-	4,926	4,926
	(ユーロ)	53,012	-	△325	△325	5,516	-	△8	△8
	(豪ドル)	51,245	-	32	32	41	-	0	0
	合 計				9,851				△194

(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)

(単位：百万円)

ヘッジ会計の方法	種 類	主なヘッジ対象	平成29年度末			平成30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	外貨建資産						
	売建		6,803,557	187,916	180,238	6,892,491	94,333	△180,845
	(米ドル)		3,704,596	127,932	141,139	3,280,594	35,518	△130,238
	(ユーロ)		1,821,424	-	9,954	2,382,654	-	△20,208
	(豪ドル)	981,860	59,984	23,450	924,772	58,814	△28,647	
繰延ヘッジ	通貨スワップ	外貨建資産	26,780	26,780	615	37,806	37,806	△897
	(米ドル)		24,326	24,326	808	35,351	35,351	△665
	(ユーロ)		2,454	2,454	△193	2,454	2,454	△232
振当処理	為替予約	外貨建資産	53,778	-	△18,082	-	-	-
	売建		53,778	-	△18,082	-	-	-
	(豪ドル)							
	通貨スワップ	外貨建資産	141,197	141,197	12,310	141,197	141,197	2,093
(米ドル)	141,197		141,197	12,310	141,197	141,197	2,093	
通貨スワップ	外貨建負債	244,924	244,924	△5,221	244,924	244,924	9,395	
(米ドル)		244,924	244,924	△5,221	244,924	244,924	9,395	
合 計					169,860		△170,254	

(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29年度末			平成30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	9,758	-	△231	△231	-	-	-	
	買建	10,903	-	231	231	9,989	-	368	
	合 計				△0			368	

(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29年度末、平成30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。

(5) 債券関連 (会社計)

(ヘッジ会計が適用されているもの)

平成29年度末、平成30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。

(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29年度末			平成30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	債券先物								
	売建	-	-	-	-	217,853	-	2,053	
	買建	-	-	-	-	146,611	-	△932	
	合 計				-			1,121	

(注) 差損益欄には、時価を記載しています。

(6) その他

(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29年度末			平成30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	マルチ・アセット指数オプション								
	売 建								
	コール	-	-	-	-	21,561	-	15	
		(-)				(5)		△9	
店頭	買 建								
	コール	-	-	-	-	19,648	-	407	
		(-)				(418)		△10	
	合 計				-			△20	

(注) 1. 括弧内には、オプション料を記載しています。

2. 差損益欄には、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29年度末、平成30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。