

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	2016年度末		2017年度末	
	金 額	占率	金 額	占率
国 債	14,199,391	47.1	14,263,267	46.0
地 方 債	606,156	2.0	498,341	1.6
社 債	2,165,103	7.2	2,256,677	7.3
うち公社・公団債	466,266	1.5	419,959	1.4
株 式	4,141,988	13.8	4,464,095	14.4
外 国 証 券	8,578,000	28.5	8,841,746	28.5
公 社 債	6,581,757	21.9	6,828,764	22.0
株 式 等	1,996,242	6.6	2,012,982	6.5
そ の 他 の 証 券	430,891	1.4	672,600	2.2
合 計	30,121,531	100.0	30,996,728	100.0

(2) 地域別地方債保有明細表

(単位:百万円)

区 分	2016年度末	2017年度末
北 海 道	23,075	11,495
東 北	300	300
関 東	188,183	159,534
中 部	83,664	75,632
近 畿	157,626	116,732
中 国	30,224	25,570
四 国	—	—
九 州	47,494	44,131
そ の 他	75,586	64,945
合 計	606,156	498,341

(注)「その他」は、共同発行市場公募地方債です。

(3) 有価証券残存期間別残高

(単位:百万円)

区 分	2016年度末						
	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
有 価 証 券	524,238	1,601,076	2,990,926	2,469,878	1,626,311	20,909,099	30,121,531
国 債	189,390	507,274	1,187,234	1,178,740	1,133,414	10,003,337	14,199,391
地 方 債	104,945	229,797	9,196	5,084	35,960	221,172	606,156
社 債	97,014	204,881	181,584	150,091	131,421	1,400,110	2,165,103
株 式	—	—	—	—	—	4,141,988	4,141,988
外 国 証 券	131,502	658,934	1,607,462	1,134,875	324,392	4,720,833	8,578,000
公 社 債	131,149	658,934	1,607,462	1,134,875	324,392	2,724,942	6,581,757
株 式 等	352	—	—	—	—	1,995,890	1,996,242
その 他 の 証 券	1,386	188	5,448	1,086	1,124	421,657	430,891
買 入 金 銭 債 権	—	—	—	—	—	220,118	220,118
譲 渡 性 預 金	49,996	—	—	—	—	—	49,996
そ の 他	—	—	—	—	—	—	—
合 計	574,235	1,601,076	2,990,926	2,469,878	1,626,311	21,129,217	30,391,646

(単位:百万円)

区 分	2017年度末						
	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
有 価 証 券	811,026	1,629,985	2,748,904	1,520,306	2,582,464	21,704,041	30,996,728
国 債	277,532	416,466	1,508,889	988,742	1,413,823	9,657,813	14,263,267
地 方 債	164,238	72,481	100	5,287	86,651	169,581	498,341
社 債	133,463	146,945	177,640	98,516	234,139	1,465,972	2,256,677
株 式	—	—	—	—	—	4,464,095	4,464,095
外 国 証 券	223,328	988,617	1,059,275	427,464	839,547	5,303,512	8,841,746
公 社 債	223,085	988,617	1,059,275	427,464	839,547	3,290,772	6,828,764
株 式 等	242	—	—	—	—	2,012,739	2,012,982
その 他 の 証 券	12,463	5,474	2,998	295	8,302	643,066	672,600
買 入 金 銭 債 権	—	—	—	—	—	214,730	214,730
譲 渡 性 預 金	35,999	—	—	—	—	—	35,999
そ の 他	—	—	—	—	—	10,076	10,076
合 計	847,025	1,629,985	2,748,904	1,520,306	2,582,464	21,928,848	31,257,535

(注) 1. 10年超には、期間の定めのないものを含んでいます。

2. 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) 業種別株式保有明細表

(単位:百万円、%)

区 分		2016年度末		2017年度末	
		金 額	占 率	金 額	占 率
水 産 ・ 農 林 業		1,503	0.0	1,634	0.0
鉱 業		—	—	—	—
建 設 業		83,669	2.0	100,992	2.3
製 造 業	食 料 品	201,907	4.9	221,540	5.0
	織 維 製 品	23,759	0.6	27,168	0.6
	パ ル プ ・ 紙	4,366	0.1	4,338	0.1
	化 学	366,381	8.8	427,426	9.6
	医 薬 品	109,656	2.6	134,506	3.0
	石 油 ・ 石 炭 製 品	6,410	0.2	7,495	0.2
	ゴ ム 製 品	13,548	0.3	13,654	0.3
	ガ ラ ス ・ 土 石 製 品	187,391	4.5	190,541	4.3
	鉄 鋼	69,821	1.7	64,712	1.4
	非 鉄 金 属	17,795	0.4	16,593	0.4
	金 属 製 品	21,476	0.5	21,346	0.5
	機 械	271,557	6.6	274,280	6.1
	電 気 機 器	494,918	11.9	584,842	13.1
	輸 送 用 機 器	463,829	11.2	493,514	11.1
	精 密 機 器	139,401	3.4	189,286	4.2
そ の 他 製 品	42,052	1.0	45,377	1.0	
電 気 ・ ガ ス 業		140,203	3.4	136,985	3.1
運 輸 ・ 情 報 通 信 業	陸 運 業	202,816	4.9	211,321	4.7
	海 運 業	8,866	0.2	7,705	0.2
	空 運 業	3,445	0.1	4,132	0.1
	倉 庫 ・ 運 輸 関 連 業	26,081	0.6	22,722	0.5
	情 報 ・ 通 信 業	26,643	0.6	31,242	0.7
商 業	卸 売 業	258,171	6.2	297,482	6.7
	小 売 業	40,209	1.0	42,868	1.0
金 融 ・ 保 険 業	銀 行 業	439,201	10.6	410,582	9.2
	証 券 ・ 商 品 先 物 取 引 業	16,837	0.4	17,155	0.4
	保 険 業	176,512	4.3	174,751	3.9
	そ の 他 金 融 業	70,656	1.7	82,420	1.8
不 動 産 業		164,997	4.0	151,892	3.4
サ ー ビ ス 業		47,897	1.2	53,580	1.2
合 計		4,141,988	100.0	4,464,095	100.0

(注) 業種の分類は、証券コード協議会の業種別分類項目によります。

2. 貸付金関係

(1) 貸付金明細表

(単位:百万円)

区 分	2016年度末	2017年度末
保 険 約 款 貸 付	260,726	249,260
契 約 者 貸 付	245,684	235,112
保 険 料 振 替 貸 付	15,042	14,148
一 般 貸 付	4,421,255	4,258,109
(うち非居住者貸付)	(67,560)	(173,032)
企 業 貸 付	4,229,354	4,081,518
(うち国内企業向け)	(4,197,814)	(3,939,485)
国・国際機関・政府関係機関貸付	27,315	22,016
公 共 団 体 ・ 公 企 業 貸 付	143,792	134,768
住 宅 ロ ー ン	1,201	798
消 費 者 ロ ー ン	19,005	18,647
そ の 他	585	361
合 計	4,681,981	4,507,370

(2) 国内企業向け貸付金企業規模別内訳

(単位:百万円、%)

区 分		2016年度末		2017年度末	
			占 率		占 率
大 企 業	貸 付 先 数	683	61.1	658	58.4
	金 額	3,779,101	90.0	3,508,030	89.0
中 堅 企 業	貸 付 先 数	91	8.1	103	9.1
	金 額	20,236	0.5	19,556	0.5
中 小 企 業	貸 付 先 数	344	30.8	366	32.5
	金 額	398,476	9.5	411,897	10.5
国内企業向け貸付計	貸 付 先 数	1,118	100.0	1,127	100.0
	金 額	4,197,814	100.0	3,939,485	100.0

(注) 1.業種による規模の区分は以下のとおりです。

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。

区 分	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	
	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
大企業								
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名以下		資本金5千万円以下 または常用する従業員 50名以下		資本金5千万円以下 または常用する従業員 100名以下		資本金1億円以下 または常用する従業員 100名以下	

(3)貸付金業種別内訳

(単位:百万円、%)

区 分		2016年度末		2017年度末	
		金 額	占 率	金 額	占 率
国 内 向 け	製 造 業	769,199	17.4	726,417	17.1
	食 料	55,118	1.2	34,383	0.8
	織 維	11,766	0.3	8,622	0.2
	木 材 ・ 木 製 品	—	—	—	—
	パ ル プ ・ 紙	43,142	1.0	42,103	1.0
	印 刷	5,326	0.1	5,608	0.1
	化 学	110,949	2.5	116,592	2.7
	石 油 ・ 石 炭	84,650	1.9	84,420	2.0
	窯 業 ・ 土 石	68,688	1.6	68,167	1.6
	鉄 鋼	127,318	2.9	120,897	2.8
	非 鉄 金 属	13,944	0.3	12,400	0.3
	金 属 製 品	2,474	0.1	2,241	0.1
	はん用・生産用・業務用機械	56,403	1.3	54,280	1.3
	電 気 機 械	95,125	2.2	92,743	2.2
	輸 送 用 機 械	88,974	2.0	79,913	1.9
	そ の 他 の 製 造 業	5,318	0.1	4,043	0.1
	農 業 、 林 業	120	0.0	360	0.0
	漁 業	—	—	—	—
	鉱業、採石業、砂利採取業	78	0.0	26	0.0
	建 設 業	16,745	0.4	16,376	0.4
	電気・ガス・熱供給・水道業	658,588	14.9	742,800	17.4
	情 報 通 信 業	92,505	2.1	92,604	2.2
	運 輸 業 、 郵 便 業	307,776	7.0	298,485	7.0
	卸 売 業	891,822	20.2	797,540	18.7
	小 売 業	16,625	0.4	21,488	0.5
	金 融 業 、 保 険 業	1,092,417	24.7	872,466	20.5
	不 動 産 業	338,629	7.7	355,890	8.4
	物 品 賃 貸 業	118,666	2.7	111,362	2.6
	学術研究、専門・技術サービス業	20,700	0.5	20,790	0.5
	宿 泊 業	2,198	0.0	2,025	0.0
	飲 食 業	612	0.0	735	0.0
	生活関連サービス業、娯楽業	3,256	0.1	3,249	0.1
	教 育 、 学 習 支 援 業	722	0.0	461	0.0
医 療 ・ 福 祉	191	0.0	131	0.0	
そ の 他 の サ ー ビ ス	1,865	0.0	1,849	0.0	
地 方 公 共 団 体	764	0.0	569	0.0	
個人(住宅・消費・納税資金等)	20,207	0.5	19,445	0.5	
そ の 他	—	—	—	—	
合 計	4,353,695	98.5	4,085,077	95.9	
海 外 向 け	政 府 等	36,020	0.8	31,000	0.7
	金 融 機 関	15,540	0.4	15,200	0.4
	商 工 業 等	16,000	0.4	126,832	3.0
	合 計	67,560	1.5	173,032	4.1
一 般 貸 付 計		4,421,255	100.0	4,258,109	100.0

(注) 国内向けの貸付の業種の分類は、日本銀行の貸出先別貸出金(業種別、設備資金新規貸出)の業種分類によります。

(4) 貸付金残存期間別残高

(単位:百万円)

区 分	2016年度末						合 計
	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	
変 動 金 利	37,971	6,729	20,459	25,712	9,994	36,974	137,842
固 定 金 利	370,268	643,707	554,976	590,821	853,841	1,269,797	4,283,413
一 般 貸 付 計	408,240	650,437	575,435	616,534	863,835	1,306,772	4,421,255

(単位:百万円)

区 分	2017年度末						合 計
	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	
変 動 金 利	111,114	5,233	26,180	24,290	3,550	49,479	219,848
固 定 金 利	341,485	518,158	620,019	598,506	769,500	1,190,590	4,038,260
一 般 貸 付 計	452,600	523,391	646,199	622,797	773,050	1,240,070	4,258,109

(注)10年超には、期間の定めのないものを含んでいます。

(5) 貸付金地域別内訳

(単位:百万円、%)

区 分	2016年度末		2017年度末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
北 海 道	39,955	0.9	40,807	1.0
東 北 道	56,615	1.3	57,188	1.4
関 東 部	3,352,191	77.4	3,106,226	76.4
中 畿 部	359,795	8.3	364,063	9.0
近 畿 国	275,572	6.4	249,169	6.1
中 国	52,769	1.2	53,785	1.3
四 国	52,864	1.2	48,372	1.2
九 州	143,724	3.3	146,017	3.6
合 計	4,333,488	100.0	4,065,631	100.0

(注)1.個人ローン、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	2016年度末		2017年度末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
担 保 貸 付	16,051	0.4	15,046	0.4
有 価 証 券 担 保 貸 付	4,629	0.1	4,607	0.1
不 動 産・動 産・財 団 担 保 貸 付	10,231	0.2	9,221	0.2
指 名 債 権 担 保 貸 付	1,190	0.0	1,217	0.0
保 証 貸 付	81,070	1.8	68,559	1.6
信 用 貸 付	4,303,925	97.3	4,155,057	97.6
そ の 他	20,207	0.5	19,445	0.5
一 般 貸 付 計	4,421,255	100.0	4,258,109	100.0
うち劣後特約付貸付	503,800	11.4	388,450	9.1

3. 海外投融資関係

(1) 資産別明細表

ア. 外貨建資産

(単位:百万円、%)

区 分	2016年度末		2017年度末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
公 社 債	6,420,171	72.3	6,793,498	72.0
株 式 等	1,548,076	17.4	1,615,405	17.1
現 預 金・そ の 他	39,563	0.4	115,449	1.2
小 計	8,007,810	90.1	8,524,354	90.4

イ. 円貨額が確定した外貨建資産

(単位:百万円、%)

区 分	2016年度末		2017年度末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
貸 付 金	119,856	1.3	131,049	1.4
そ の 他	89	0.0	103	0.0
小 計	119,945	1.4	131,152	1.4

(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計上額としているものです。

ウ. 円貨建資産

(単位:百万円、%)

区 分	2016年度末		2017年度末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
非 居 住 者 貸 付	67,560	0.8	167,200	1.8
公 社 債 (円 建 外 債)	240,001	2.7	212,602	2.3
そ の 他	448,166	5.0	397,576	4.2
小 計	755,728	8.5	777,378	8.2

エ. 合計 (ア+イ+ウ)

(単位:百万円、%)

区 分	2016年度末		2017年度末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
海 外 投 融 資	8,883,484	100.0	9,432,885	100.0
うち 海 外 不 動 産	24,843	0.3	—	—

(2) 外貨建資産の通貨別構成

(単位:百万円、%)

区 分	2016年度末		2017年度末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
米 ド ル	6,944,640	86.4	7,457,063	87.5
ユ ー ロ	472,323	5.9	509,478	6.0
そ の 他	624,504	7.8	557,812	6.5
合 計	8,041,467	100.0	8,524,354	100.0

(3) 海外投融資の地域別構成

(単位:百万円、%)

区 分	2016年度末							
	外国証券						非居住者貸付	
	金額		占率		金額		占率	
北 米	5,949,950	69.4	5,294,087	80.4	655,863	32.9	21,000	31.1
ヨ ー ロ ッ パ	901,215	10.5	758,030	11.5	143,184	7.2	29,500	43.7
オ セ ア ニ ア	249,842	2.9	249,842	3.8	—	—	—	—
ア ジ ア	162,777	1.9	49,723	0.8	113,054	5.7	2,040	3.0
中 南 米	1,152,224	13.4	68,083	1.0	1,084,140	54.3	—	—
中 東	—	—	—	—	—	—	—	—
ア フ リ カ	—	—	—	—	—	—	—	—
国 際 機 関	161,989	1.9	161,989	2.5	—	—	15,020	22.2
合 計	8,578,000	100.0	6,581,757	100.0	1,996,242	100.0	67,560	100.0

(単位:百万円、%)

区 分	2017年度末							
	外国証券						非居住者貸付	
	金額		占率		金額		占率	
北 米	6,231,095	70.5	5,593,665	81.9	637,429	31.7	19,913	11.5
ヨ ー ロ ッ パ	862,074	9.8	709,035	10.4	153,039	7.6	29,500	17.0
オ セ ア ニ ア	270,377	3.1	270,377	4.0	—	—	1,919	1.1
ア ジ ア	156,385	1.8	42,685	0.6	113,699	5.6	1,700	1.0
中 南 米	1,180,624	13.4	71,811	1.1	1,108,813	55.1	110,000	63.6
中 東	—	—	—	—	—	—	—	—
ア フ リ カ	—	—	—	—	—	—	—	—
国 際 機 関	141,188	1.6	141,188	2.1	—	—	10,000	5.8
合 計	8,841,746	100.0	6,828,764	100.0	2,012,982	100.0	173,032	100.0

4. デリバティブ取引

(1) 定性的情報

ア. 取引の内容

当社が利用対象としている主なデリバティブ取引は、以下のとおりです。

- ・ 金利関連：金利先物、金利オプション、金利スワップ、スワップション
- ・ 通貨関連：外国為替予約、通貨オプション、通貨スワップ
- ・ 株式関連：株価指数先物、株式オプション
- ・ 債券関連：債券先物、債券オプション

なお、店頭取引において、リスクが過大となるような複雑な仕組みの取引はありません。

イ. 取組方針

当社では、デリバティブ取引を、運用資産、保険負債または社債のリスクに対する主要なヘッジ手段と位置付けており、原則として、ヘッジ目的に利用を限定しています。

ウ. 利用目的

当社が利用しているデリバティブ取引の主な目的は、以下のとおりです。

- ・ 「金利関連取引」は、当社の貸付金および借入金等の変動金利を固定化する目的または保険負債の金利リスクをヘッジする目的で利用しています。
- ・ 「通貨関連取引」は、外貨建資産・負債の為替レートを事前に確定する目的、および為替変動による損失を一定範囲内に限定する等、為替リスクを回避する目的で利用しています。
- ・ 「株式関連取引」は、近い将来に購入・売却を予定している株式を対象に実際の取引時点までの価格変動リスクを回避する目的、および株式ポートフォリオの価格変動リスクを回避する目的で利用しています。
- ・ 「債券関連取引」は、近い将来に購入・売却を予定している債券を対象に実際の取引時点までの価格変動リスクを回避する目的で利用しています。

上記取引のうち、「金利関連取引」の一部については、金利スワップの特例処理および繰延ヘッジを適用しています。また、為替リスクを回避する目的の「通貨関連取引」の一部については、時価ヘッジ、繰延ヘッジおよび通貨スワップの振当処理を適用しています。

エ. リスクの内容

当社が利用しているデリバティブ取引は、原則として、運用資産、保険負債または社債のリスクのヘッジを目的としているため、デリバティブ取引のもつ市場リスクは減殺され、限定的なものになっています。

また、取引形態は、取引所を通じた取引、あるいは、格付等を勘案し信用度が高いと判断される取引先を選別した店頭取引であり、取引相手が倒産等により契約不履行に陥り、損失を被るリスクは限定的です。

オ. リスク管理体制

当社では、デリバティブ取引の取扱いについて利用方針等を規定化するとともに、取引種類および取引先ごとの残高与信枠を設定しているほか、取引先ごとに再構築コストをベースとした信用リスク相当額を算出（カレント・エクスポージャー方式）し、その上限枠を設定するなどしてリスクを抑制しています。また、取引先の選定にあたっては、格付等を勘案し信用度が高いと判断される取引先を選別しています。

全体のポジション状況については、リスク管理検証委員会等において、ヘッジ対象となる運用資産とトータルで残高・損益を把握する等、包括的な管理を行なっています。また、取引を執行する部署（フロントオフィス）と事務管理部署（バックオフィス）を分離し、フロント・バック間で相互牽制が働く組織体制をとり、適切なリスク管理を行なっています。

カ. 定量的情報に関する補足説明

① 時価算定に関する補足説明

[金利スワップ取引]

将来キャッシュ・フローの差額を現在価値に割り引いた理論価格

[外国為替予約等の店頭取引の場合]

期末日のTTM、WMロイターレート、割引レート等を基準とした理論価格、または情報ベンダーが提供する価格

[株価指数先物、債券先物等の取引所取引の場合]

期末日の終値または清算価格等

② 差損益に関する補足説明

当社では、デリバティブ取引を、原則として、運用資産、保険負債または社債のリスクをヘッジする手段として利用しており、いわゆるトレーディング目的の取引はありません。

例えば、運用資産に関する金利スワップ取引は、主に変動金利を固定化する目的で利用しています。また、保険負債に関する金利スワップ取引は、金利変動による保険負債の変動の影響をコントロールする目的で利用しています。

このように、取引単位で損益をとらえるのではなく、ヘッジ対象となる運用資産、保険負債または社債と合わせて管理を行なっています。

(2) 定量的情報

ア. 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)

区 分	2016年度末					
	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	51,422	△28,235	—	—	—	23,186
ヘッジ会計非適用分	△5	638	—	—	—	633
合 計	51,416	△27,597	—	—	—	23,819

(単位:百万円)

区 分	2017年度末					
	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	51,453	78,337	—	—	—	129,790
ヘッジ会計非適用分	4	△2,701	—	—	—	△2,697
合 計	51,457	75,636	—	—	—	127,093

(注) ヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ適用分の差損益(2016年度末:通貨関連△29,786百万円、2017年度末:通貨関連79,785百万円)およびヘッジ会計非適用分の差損益は、損益計算書に計上しています。

イ. ヘッジ会計が適用されていないもの

○金利関連

(単位:百万円)

店 頭	区 分	2016年度末				2017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		
	金利スワップ 固定金利受取/変動金利支払	200	200	△5	△5	1,200	1,200	4	4
	合 計				△5				4

(注) 金利スワップの差損益は、時価を記載しています。

【ご参考】 金利スワップ契約の残存期間別構成

(単位:百万円、%)

区 分		2016年度末						
		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
固定金利受取 変動金利支払 スワップ	想 定 元 本	—	—	—	—	—	200	200
	平均受取金利	—	—	—	—	—	0.46	0.46
	平均支払金利	—	—	—	—	—	0.02	0.02

(単位:百万円、%)

区 分		2017年度末						
		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
固定金利受取 変動金利支払 スワップ	想 定 元 本	—	—	—	—	—	1,200	1,200
	平均受取金利	—	—	—	—	—	0.68	0.68
	平均支払金利	—	—	—	—	—	0.01	0.01

○通貨関連

(単位:百万円)

区 分	2016年度末				2017年度末				
	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	117,654	—	591	591	47,797	—	1,688	1,688
	米ドル	106,317	—	575	575	45,857	—	1,697	1,697
	英ポンド	6,973	—	△23	△23	—	—	—	—
	豪ドル	4,363	—	38	38	1,939	—	△9	△9
	買建	11,171	—	46	46	—	—	—	—
	米ドル	11,171	—	46	46	—	—	—	—
	通貨オプション								
	売建								
	ユーロ	105,400	—	—	499	(-)	—	—	—
	(499)								
	米ドル	105,400	—	—	499	(-)	—	—	—
	(499)								
	買建								
ブット	89,250	—	—	—	—	—	—	—	
(499)			0	△499	(-)	—	—	—	
米ドル	89,250	—	—	—	—	—	—	—	
(499)			0	△499	(-)	—	—	—	
通貨スワップ									
円払/豪ドル受	—	—	—	—	88,870	88,870	△4,389	△4,389	
合 計				638				△2,701	

(注) 1. 差損益欄には、為替予約およびスワップ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。
2. ()内には、貸借対照表に計上したオプション料を記載しています。

○株式関連

2016年度末および2017年度末とも保有していません。

○債券関連

2016年度末および2017年度末とも保有していません。

ウ. ヘッジ会計が適用されているもの

○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	2016年度末		
			契約額等	時価	
				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	保険負債	232,600	232,600	51,026
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	16,755	8,755	395
合 計					51,422

(単位:百万円)

ヘッジ会計の方法	種類	主なヘッジ対象	2017年度末		
			契約額等	時価	
				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	保険負債	231,400	231,400	51,256
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	8,562	3,562	197
合 計					51,453

【ご参考】金利スワップ契約の残存期間別構成

(単位:百万円、%)

区 分		2016年度末						合計
		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	
固定金利受取	想 定 元 本	8,000	5,227	7,500	7,500	16,028	205,100	249,355
変動金利支払	平均受取金利	1.90	2.12	1.56	1.75	1.79	1.89	1.87
スワップ	平均支払金利	0.21	0.20	0.02	0.03	0.12	0.02	0.04

(単位:百万円、%)

区 分		2017年度末						合計
		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	
固定金利受取	想 定 元 本	5,000	3,636	7,100	8,926	14,500	200,800	239,962
変動金利支払	平均受取金利	2.15	1.51	1.69	1.73	1.90	1.88	1.87
スワップ	平均支払金利	0.21	0.01	△0.00	0.11	0.06	0.01	0.02

○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	2016年度末			2017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 売建	外貨建 債券	2,852,379	—	△29,786	3,376,632	—	79,785
	米ドル		2,560,560	—	△23,153	3,058,604	—	76,837
	ユーロ		168,759	—	△173	183,159	—	319
	豪ドル		123,059	—	△6,459	134,867	—	2,628
繰延ヘッジ	通貨スワップ	外貨建 債券						
	ユーロ		35,575	35,575	1,472	35,575	35,575	△1,641
	豪ドル		4,305	4,305	78	4,305	4,305	192
合 計				△28,235			78,337	

(注) 為替予約等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、貸借対照表において当該円貨額で表示されている外貨建金銭債権債務等にかかる取引を除いています。

○株式関連

2016年度末および2017年度末とも保有していません。

○債券関連

2016年度末および2017年度末とも保有していません。

5. 一般勘定資産全体の含み損益の状況

(単位:百万円)

区 分	2016年度末	2017年度末
有 価 証 券	5,622,615	5,722,506
評 価 差 額	3,517,282	3,559,231
オ フ バ ラ ン ス	2,105,332	2,163,274
土 地	365,593	410,367
再 評 価 差 額	196,936	197,711
オ フ バ ラ ン ス	168,657	212,655
そ の 他	52,724	49,791
合 計	6,040,933	6,182,665

- (注) 1. 有価証券は、時価のある有価証券に加え、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(外貨建の子会社株式及び関連会社株式等)の為替評価等の含み損益相当額を記載しています。
2. 有価証券には、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。
3. 土地は「土地の再評価に関する法律」に基づき、明治生命は1999年度末に、安田生命は2000年度末に時価評価を実施しました。これによる評価差額を「再評価差額」に記載しています。なお、土地には借地権を含んでいます。
4. 「その他」には、デリバティブ取引等の含み損益相当額を記載しています。なお、デリバティブ取引は一部ヘッジ会計を適用しました。本表にはヘッジ会計(繰延ヘッジ・特例処理)適用分の含み損益を記載しています。ヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ適用分の差損益(2016年度末:通貨関連△29,786百万円、2017年度末:通貨関連79,785百万円)、およびヘッジ会計非適用分については、評価損益を損益計算書に計上しており、含み損益相当額はありません。

Ⅱ. 個人変額保険・変額個人年金保険特別勘定

1. 個人変額保険

(1) 売買目的有価証券の評価損益

(単位:百万円)

区 分	2016年度末		2017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	57,871	2,995	57,986	△869

(2) デリバティブ取引の定量的情報

ア. 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)

区 分	2016年度末					合計
	金利関連	通貨関連	株式関連	債券関連	その他	
ヘッジ会計適用分	—	—	—	—	—	—
ヘッジ会計非適用分	—	0	—	—	—	0
合 計	—	0	—	—	—	0

(単位:百万円)

区 分	2017年度末					合計
	金利関連	通貨関連	株式関連	債券関連	その他	
ヘッジ会計適用分	—	—	—	—	—	—
ヘッジ会計非適用分	—	1	—	—	—	1
合 計	—	1	—	—	—	1

(注) 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。

イ. ヘッジ会計が適用されていないもの

○金利関連

2016年度末および2017年度末とも保有していません。

○通貨関連

(単位:百万円)

区 分	2016年度末				2017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	34	—	△0	△0	1,216	—	△0	△0
	米ドル	—	—	—	—	813	—	△1	△1
	ユーロ	25	—	△0	△0	336	—	1	1
	ポーランドズロチ	9	—	△0	△0	—	—	—	—
	その他	—	—	—	—	66	—	0	0
	買建	35	—	0	0	1,656	—	1	1
	米ドル	25	—	0	0	1,027	—	4	4
	ユーロ	—	—	—	—	550	—	△2	△2
	豪ドル	9	—	0	0	11	—	0	0
その他	—	—	—	—	67	—	△0	△0	
合 計				0				1	

(注) 為替予約の差損益は、時価を記載しています。

○株式関連

2016年度末および2017年度末とも保有していません。

○債券関連

2016年度末および2017年度末とも保有していません。

ウ. ヘッジ会計が適用されているもの

○金利関連

2016年度末および2017年度末とも保有していません。

○通貨関連

2016年度末および2017年度末とも保有していません。

○株式関連

2016年度末および2017年度末とも保有していません。

○債券関連

2016年度末および2017年度末とも保有していません。

2. 変額個人年金保険

(1) 売買目的有価証券の評価損益

(単位:百万円)

区 分	2016年度末		2017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	324,825	△9,507	312,669	2,479

(2) デリバティブ取引の定量的情報

ア. ヘッジ会計が適用されていないもの

- 金利関連
2016年度末および2017年度末とも保有していません。
- 通貨関連
2016年度末および2017年度末とも保有していません。
- 株式関連
2016年度末および2017年度末とも保有していません。
- 債券関連
2016年度末および2017年度末とも保有していません。

イ. ヘッジ会計が適用されているもの

- 金利関連
2016年度末および2017年度末とも保有していません。
- 通貨関連
2016年度末および2017年度末とも保有していません。
- 株式関連
2016年度末および2017年度末とも保有していません。
- 債券関連
2016年度末および2017年度末とも保有していません。

Ⅲ. 個人保険および個人年金保険の責任準備金の積立方式、積立率

		2016年度末	2017年度末
積立方式	標準責任準備金 対象契約	内閣総理大臣が定める方式 (平成8年大蔵省告示第48号)	内閣総理大臣が定める方式 (平成8年大蔵省告示第48号)
	標準責任準備金 対象外契約	平準純保険料式	平準純保険料式
積立率（危険準備金を除く）		100%	100%

- (注) 1. 積立方式および積立率は、個人保険および個人年金保険を対象としています。なお、団体保険および団体年金保険の責任準備金は積立方式という概念がないため、上記には含みません。
2. 積立率については、標準責任準備金対象契約に関しては平成8年大蔵省告示第48号に定める方式により、また、標準責任準備金対象外契約に関しては平準純保険料式により計算した保険料積立金、および未経過保険料に対する積立率を記載しています。

IV. その他(会社計)

1. 資産構成

(1) 資産の構成(2017年度末)

(単位:百万円、%)

区 分	会 社 計		うち一般勘定	
	金 額	占率	金 額	占率
現預金・コールローン	597,469	1.5	553,381	1.5
買現先勘定	—	—	—	—
債券貸借取引支払保証金	—	—	—	—
買入金銭債権	214,730	0.6	214,730	0.6
商品有価証券	—	—	—	—
金銭の信託	10,076	0.0	10,076	0.0
有価証券	31,781,961	82.4	30,996,728	82.2
公 社 債	17,209,644	44.6	17,018,286	45.1
株 式	4,593,785	11.9	4,464,095	11.8
外 国 証 券	8,990,244	23.3	8,841,746	23.5
公 社 債	6,895,817	17.9	6,828,764	18.1
株 式 等	2,094,426	5.4	2,012,982	5.3
その他の証券	988,287	2.6	672,600	1.8
貸付金	4,507,370	11.7	4,507,370	12.0
保険約款貸付	249,260	0.6	249,260	0.7
一般貸付	4,258,109	11.0	4,258,109	11.3
不動産	868,899	2.3	868,899	2.3
繰延税金資産	—	—	—	—
その他の	588,927	1.5	558,203	1.5
貸倒引当金	△5,100	△0.0	△5,100	△0.0
合 計	38,564,334	100.0	37,704,290	100.0
うち外貨建資産	8,681,260	22.5	8,524,354	22.6

(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(対2016年度末)

(単位:百万円)

区 分	会 社 計		うち一般勘定	
	増減	増減	増減	増減
現預金・コールローン	—	183,960	—	172,558
買現先勘定	—	—	—	—
債券貸借取引支払保証金	—	—	—	—
買入金銭債権	△5,387	—	△5,387	—
商品有価証券	—	—	—	—
金銭の信託	—	10,076	—	10,076
有価証券	—	918,551	—	875,197
公 社 債	—	87,367	—	47,636
株 式	—	314,499	—	322,106
外 国 証 券	—	286,704	—	263,745
公 社 債	—	272,205	—	247,006
株 式 等	—	14,499	—	16,739
その他の証券	—	229,979	—	241,708
貸付金	△174,611	—	△174,611	—
保険約款貸付	△11,465	—	△11,465	—
一般貸付	△163,145	—	△163,145	—
不動産	△9,599	—	△9,599	—
繰延税金資産	—	—	—	—
その他の	79,120	—	72,590	—
貸倒引当金	748	—	748	—
合 計	—	1,002,859	—	941,573
うち外貨建資産	—	512,122	—	482,886

(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. 資産運用収支(2017年度)

特別勘定の資産運用収支は、「特別勘定資産運用益(損)」として一括計上しています。
(本資料「6.損益計算書」参照)

3. 有価証券の時価情報

(1) 売買目的有価証券の評価損益

(単位:百万円)

区 分	2016年度末		2017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	741,879	3,419	785,232	△4,583
一般勘定	—	—	—	—
特別勘定	741,879	3,419	785,232	△4,583

(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	2016年度末				
	帳簿価額	時価	差損益	差益	差損
満期保有目的の債券	4,715,320	5,537,852	822,531	823,812	△1,281
責任準備金対応債券	7,250,615	8,578,042	1,327,426	1,327,428	△1
子会社株式及び関連会社株式	—	—	—	—	—
その他の有価証券	13,550,699	17,067,658	3,516,959	3,602,161	△85,202
公社債	4,867,245	5,322,149	454,903	456,657	△1,753
株式	1,670,383	4,018,610	2,348,227	2,353,377	△5,149
外国証券	6,580,194	7,247,738	667,544	745,092	△77,548
公社債	5,934,260	6,461,472	527,211	597,262	△70,050
株式等	645,934	786,266	140,332	147,830	△7,497
その他の証券	361,309	406,195	44,885	45,633	△748
買入金銭債権	21,567	22,968	1,400	1,400	—
譲渡性預金	50,000	49,996	△3	0	△3
金銭の信託	—	—	—	—	—
合計	25,516,636	31,183,553	5,666,917	5,753,402	△86,485
公社債	16,515,746	19,103,521	2,587,775	2,589,550	△1,774
株式	1,670,383	4,018,610	2,348,227	2,353,377	△5,149
外国証券	6,700,479	7,374,594	674,114	751,679	△77,565
公社債	6,054,545	6,588,327	533,781	603,849	△70,067
株式等	645,934	786,266	140,332	147,830	△7,497
その他の証券	361,309	406,195	44,885	45,633	△748
買入金銭債権	218,717	230,634	11,917	13,162	△1,245
譲渡性預金	50,000	49,996	△3	0	△3
金銭の信託	—	—	—	—	—

(単位:百万円)

区 分	2017年度末				
	帳簿価額	時価	差損益	差益	差損
満期保有目的の債券	4,540,301	5,348,839	808,537	809,196	△658
責任準備金対応債券	7,549,821	8,971,785	1,421,963	1,425,365	△3,401
子会社株式及び関連会社株式	—	—	—	—	—
その他の有価証券	14,317,705	17,875,899	3,558,193	3,729,394	△171,200
公社債	4,974,782	5,400,878	426,096	432,444	△6,347
株式	1,671,934	4,339,760	2,667,825	2,678,324	△10,498
外国証券	7,018,010	7,425,040	407,029	556,602	△149,572
公社債	6,282,089	6,553,962	271,872	407,224	△135,351
株式等	735,920	871,077	135,157	149,378	△14,221
その他の証券	591,537	647,327	55,790	60,570	△4,780
買入金銭債権	15,626	16,816	1,190	1,190	—
譲渡性預金	36,000	35,999	△0	0	△0
金銭の信託	9,814	10,076	262	262	—
合計	26,407,828	32,196,523	5,788,694	5,963,956	△175,261
公社債	16,592,190	19,234,381	2,642,191	2,648,552	△6,361
株式	1,671,934	4,339,760	2,667,825	2,678,324	△10,498
外国証券	7,292,812	7,703,477	410,664	563,639	△152,974
公社債	6,556,891	6,832,399	275,507	414,261	△138,753
株式等	735,920	871,077	135,157	149,378	△14,221
その他の証券	591,537	647,327	55,790	60,570	△4,780
買入金銭債権	213,540	225,501	11,960	12,606	△645
譲渡性預金	36,000	35,999	△0	0	△0
金銭の信託	9,814	10,076	262	262	—

(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。

ア. 満期保有目的の債券

(単位:百万円)

区 分	2016年度末			2017年度末		
	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	4,664,197	5,488,010	823,812	4,482,952	5,292,148	809,196
公 社 債	4,395,085	5,200,549	805,464	4,220,155	5,011,203	791,048
外 国 証 券	108,062	114,649	6,587	119,183	125,914	6,731
買 入 金 銭 債 権	161,050	172,811	11,761	143,614	155,030	11,416
時価が貸借対照表計上額を 超えないもの	51,123	49,841	△1,281	57,349	56,690	△658
公 社 債	2,800	2,780	△19	2,800	2,786	△13
外 国 証 券	12,223	12,206	△17	249	248	△0
買 入 金 銭 債 権	36,100	34,854	△1,245	54,300	53,654	△645

イ. 責任準備金対応債券

(単位:百万円)

区 分	2016年度末			2017年度末		
	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	7,249,715	8,577,144	1,327,428	7,427,523	8,852,888	1,425,365
公 社 債	7,249,715	8,577,144	1,327,428	7,394,452	8,819,512	1,425,060
外 国 証 券	—	—	—	33,070	33,376	305
時価が貸借対照表計上額を 超えないもの	900	898	△1	122,298	118,896	△3,401
公 社 債	900	898	△1	—	—	—
外 国 証 券	—	—	—	122,298	118,896	△3,401

ウ. その他有価証券

(単位:百万円)

区 分	2016年度末			2017年度末		
	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	10,622,245	14,224,406	3,602,161	10,087,737	13,817,132	3,729,394
公 社 債	4,662,842	5,119,499	456,657	4,762,611	5,195,056	432,444
株 式	1,573,628	3,927,005	2,353,377	1,548,692	4,227,017	2,678,324
外 国 証 券	4,023,370	4,768,463	745,092	3,346,851	3,903,453	556,602
そ の 他 の 証 券	334,836	380,470	45,633	399,140	459,711	60,570
買 入 金 銭 債 権	21,567	22,968	1,400	15,626	16,816	1,190
譲 渡 性 預 金	6,000	6,000	0	5,000	5,000	0
金 銭 の 信 託	—	—	—	9,814	10,076	262
貸借対照表計上額が帳簿価額を 超えないもの	2,928,453	2,843,251	△85,202	4,229,967	4,058,766	△171,200
公 社 債	204,402	202,649	△1,753	212,170	205,822	△6,347
株 式	96,754	91,605	△5,149	123,241	112,743	△10,498
外 国 証 券	2,556,823	2,479,275	△77,548	3,671,159	3,521,586	△149,572
そ の 他 の 証 券	26,473	25,724	△748	192,396	187,615	△4,780
買 入 金 銭 債 権	—	—	—	—	—	—
譲 渡 性 預 金	44,000	43,996	△3	31,000	30,999	△0
金 銭 の 信 託	—	—	—	—	—	—

・ 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	2016年度末	2017年度末
満期保有目的の債券	—	—
責任準備金対応債券	—	—
子会社株式及び関連会社株式	891,559	875,118
そ の 他 の 有 価 証 券	466,167	415,356
非 上 場 国 内 株 式	28,456	27,776
非 上 場 外 国 株 式	427,126	377,126
そ の 他 外 国 証 券	1,168	458
そ の 他	9,416	9,994
合 計	1,357,727	1,290,474

4. デリバティブ取引の定量的情報

(1) 差損益の内訳(ヘッジ会計適用分・非適用分の内訳)

(単位:百万円)

区 分	2016年度末					
	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	51,422	△28,235	—	—	—	23,186
ヘッジ会計非適用分	△5	632	△25	—	—	601
合 計	51,416	△27,603	△25	—	—	23,788

(単位:百万円)

区 分	2017年度末					
	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	51,453	78,337	—	—	—	129,790
ヘッジ会計非適用分	4	△2,558	△53	—	—	△2,608
合 計	51,457	75,778	△53	—	—	127,182

(注) ヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ適用分の差損益(2016年度末:通貨関連△29,786百万円、2017年度末:通貨関連79,785百万円)およびヘッジ会計非適用分の差損益は、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

○金利関連

(単位:百万円)

店 頭	区 分	2016年度末			2017年度末				
		契約額等	時価		契約額等	時価		差損益	
			うち1年超	差損益		うち1年超	差損益		
	固定金利受取／変動金利支払	200	200	△5	△5	1,200	1,200	4	4
	合 計			△5	△5				4

(注) 金利スワップの差損益は、時価を記載しています。

【ご参考】金利スワップ契約の残存期間別構成

(単位:百万円、%)

区 分		2016年度末						
		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
固定金利受取 変動金利支払 スワップ	想 定 元 本	—	—	—	—	—	200	200
	平均受取金利	—	—	—	—	—	0.46	0.46
	平均支払金利	—	—	—	—	—	0.02	0.02

(単位:百万円、%)

区 分		2017年度末						
		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
固定金利受取 変動金利支払 スワップ	想 定 元 本	—	—	—	—	—	1,200	1,200
	平均受取金利	—	—	—	—	—	0.68	0.68
	平均支払金利	—	—	—	—	—	0.01	0.01

○通貨関連

(単位:百万円)

区 分	2016年度末				2017年度末					
	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	為替予約									
	売建	118,008	—	592	592	88,295	—	1,768	1,768	
	米ドル	106,347	—	575	575	62,385	—	1,661	1,661	
	ユーロ	224	—	1	1	13,904	—	37	37	
	豪ドル	4,363	—	38	38	11,454	—	68	68	
	英ポンド	6,979	—	△23	△23	127	—	0	0	
	その他	92	—	0	0	422	—	0	0	
	買建	11,993	—	38	38	19,226	—	61	61	
	米ドル	11,742	—	40	40	9,566	—	64	64	
	ユーロ	146	—	△1	△1	6,914	—	△0	△0	
	豪ドル	93	—	0	0	2,302	—	△0	△0	
	その他	9	—	0	0	442	—	△1	△1	
	頭	通貨オプション								
		売建								
コール		105,400	—	—	499	(-)	—	—	—	
米ドル		(499)	—	—	499	(-)	—	—	—	
買建		105,400	—	—	—	—	—	—	—	
プット		(499)	—	0	△499	(-)	—	—	—	
米ドル	89,250	—	0	△499	(-)	—	—	—		
通貨スワップ										
円払/豪ドル受	—	—	—	—	88,870	88,870	△4,389	△4,389		
合 計				632				△2,558		

(注) 1. 差損益欄には、為替予約およびスワップ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。

2. ()内には、貸借対照表に計上したオプション料を記載しています。

○株式関連

(単位:百万円)

区 分	2016年度末				2017年度末				
	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	2,192	—	△29	△29	2,706	—	39	39
	外国株価指数先物								
買建	1,098	—	3	3	2,820	—	△93	△93	
合 計				△25				△53	

(注) 株価指数先物および外国株価指数先物の差損益は、時価を記載しています。

○債券関連

2016年度末および2017年度末とも保有していません。

(3)ヘッジ会計が適用されているもの

○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	2016年度末		
			契約額等		時価
				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	保険負債	232,600	232,600	51,026
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	16,755	8,755	395
合 計					51,422

(単位:百万円)

ヘッジ会計の方法	種類	主なヘッジ対象	2017年度末		
			契約額等		時価
				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	保険負債	231,400	231,400	51,256
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	8,562	3,562	197
合 計					51,453

【ご参考】金利スワップ契約の残存期間別構成

(単位:百万円、%)

区 分		2016年度末						合計
		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	
固定金利受取 変動金利支払 スワップ	想 定 元 本	8,000	5,227	7,500	7,500	16,028	205,100	249,355
	平均受取金利	1.90	2.12	1.56	1.75	1.79	1.89	1.87
	平均支払金利	0.21	0.20	0.02	0.03	0.12	0.02	0.04

(単位:百万円、%)

区 分		2017年度末						合計
		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	
固定金利受取 変動金利支払 スワップ	想 定 元 本	5,000	3,636	7,100	8,926	14,500	200,800	239,962
	平均受取金利	2.15	1.51	1.69	1.73	1.90	1.88	1.87
	平均支払金利	0.21	0.01	△0.00	0.11	0.06	0.01	0.02

○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	2016年度末			2017年度末			
			契約額等	うち1年超		時価	契約額等	うち1年超	
時価ヘッジ	為替予約	外貨建債券							
	売建		2,852,379	—	△29,786	3,376,632	—	79,785	
	米ドル		2,560,560	—	△23,153	3,058,604	—	76,837	
	ユーロ		168,759	—	△173	183,159	—	319	
	豪ドル	123,059	—	△6,459	134,867	—	2,628		
繰延ヘッジ	通貨スワップ	外貨建債券							
	ユーロ		35,575	35,575	1,472	35,575	35,575	△1,641	
	豪ドル		4,305	4,305	78	4,305	4,305	192	
合 計					△28,235			78,337	

(注) 為替予約等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、貸借対照表において当該円貨額で表示されている外貨建金銭債権債務等にかかる取引を除いています。

○株式関連

2016年度末および2017年度末とも保有していません。

○債券関連

2016年度末および2017年度末とも保有していません。