

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	2017年度末		2018年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
国 債	14,263,267	46.0	14,206,819	44.6
地 方 債	498,341	1.6	412,796	1.3
社 債	2,256,677	7.3	2,314,443	7.3
うち公社・公団債	419,959	1.4	394,461	1.2
株 式	4,464,095	14.4	4,501,994	14.1
外 国 証 券	8,841,746	28.5	9,685,957	30.4
公 社 債	6,828,764	22.0	7,676,519	24.1
株 式 等	2,012,982	6.5	2,009,437	6.3
そ の 他 の 証 券	672,600	2.2	741,514	2.3
合 計	30,996,728	100.0	31,863,526	100.0

(2) 地域別地方債保有明細表

(単位:百万円)

区 分	2017年度末	2018年度 第2四半期(上半期)末
北 海 道	11,495	9,205
東 北	300	300
関 東	159,534	143,284
中 部	75,632	54,409
近 畿	116,732	107,912
中 国	25,570	18,763
四 国	—	—
九 州	44,131	38,005
そ の 他	64,945	40,914
合 計	498,341	412,796

(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	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

(単位:百万円)

区 分	2018年度第2四半期(上半期)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	749,000	2,179,737	2,400,228	1,100,762	3,236,435	22,197,362	31,863,526
国 債	295,217	919,026	1,200,743	862,867	1,586,501	9,342,464	14,206,819
地 方 債	101,298	38,470	4,571	1,712	140,978	125,765	412,796
社 債	108,890	144,004	185,813	52,425	365,963	1,457,346	2,314,443
株 式	—	—	—	—	—	4,501,994	4,501,994
外 国 証 券	243,584	1,072,560	1,006,099	182,935	1,133,348	6,047,429	9,685,957
公 社 債	243,412	1,072,560	1,006,099	182,935	1,133,348	4,038,164	7,676,519
株 式 等	172	—	—	—	—	2,009,265	2,009,437
その 他 の 証 券	10	5,675	3,001	822	9,643	722,361	741,514
買 入 金 銭 債 権	—	—	—	—	—	214,912	214,912
譲 渡 性 預 金	60,998	—	—	—	—	—	60,998
そ の 他	—	—	—	—	—	15,606	15,606
合 計	809,999	2,179,737	2,400,228	1,100,762	3,236,435	22,427,881	32,155,044

(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		2017年度末		2018年度 第2四半期(上半期)末	
		金 額	占 率	金 額	占 率
水 産 ・ 農 林 業		1,634	0.0	1,899	0.0
鉱 業		—	—	—	—
建 設 業		100,992	2.3	96,933	2.2
製 造 業	食 料 品	221,540	5.0	227,138	5.0
	織 維 製 品	27,168	0.6	26,892	0.6
	パ ル プ ・ 紙	4,338	0.1	4,297	0.1
	化 学	427,426	9.6	418,674	9.3
	医 薬 品	134,506	3.0	135,625	3.0
	石 油 ・ 石 炭 製 品	7,495	0.2	9,248	0.2
	ゴ ム 製 品	13,654	0.3	14,672	0.3
	ガ ラ ス ・ 土 石 製 品	190,541	4.3	205,706	4.6
	鉄 鋼	64,712	1.4	63,155	1.4
	非 鉄 金 属	16,593	0.4	18,938	0.4
	金 属 製 品	21,346	0.5	20,628	0.5
	機 械	274,280	6.1	259,312	5.8
	電 気 機 器	584,842	13.1	551,973	12.3
	輸 送 用 機 器	493,514	11.1	469,187	10.4
	精 密 機 器	189,286	4.2	214,522	4.8
	そ の 他 製 品	45,377	1.0	45,950	1.0
電 気 ・ ガ ス 業		136,985	3.1	151,608	3.4
運 輸 ・ 情 報 通 信 業	陸 運 業	211,321	4.7	238,707	5.3
	海 運 業	7,705	0.2	7,361	0.2
	空 運 業	4,132	0.1	5,009	0.1
	倉 庫 ・ 運 輸 関 連 業	22,722	0.5	24,882	0.6
	情 報 ・ 通 信 業	31,242	0.7	36,734	0.8
商 業	卸 売 業	297,482	6.7	331,368	7.4
	小 売 業	42,868	1.0	43,525	1.0
金 融 ・ 保 険 業	銀 行 業	410,582	9.2	388,404	8.6
	証 券 ・ 商 品 先 物 取 引 業	17,155	0.4	16,343	0.4
	保 険 業	174,751	3.9	183,838	4.1
	そ の 他 金 融 業	82,420	1.8	80,035	1.8
不 動 産 業		151,892	3.4	150,378	3.3
サ ー ビ ス 業		53,580	1.2	59,036	1.3
合 計		4,464,095	100.0	4,501,994	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	2017年度末	2018年度 第2四半期(上半期)末
保 険 約 款 貸 付	249,260	244,651
契 約 者 貸 付	235,112	230,932
保 険 料 振 替 貸 付	14,148	13,719
一 般 貸 付	4,258,109	4,166,178
(うち非居住者貸付)	(173,032)	(178,092)
企 業 貸 付	4,081,518	3,995,396
(うち国内企業向け)	(3,939,485)	(3,848,304)
国・国際機関・政府関係機関貸付	22,016	21,946
公 共 団 体 ・ 公 企 業 貸 付	134,768	129,906
住 宅 ロ ー ン	798	—
消 費 者 ロ ー ン	18,647	18,629
そ の 他	361	300
合 計	4,507,370	4,410,830

(2) 国内企業向け貸付金企業規模別内訳

(単位:百万円、%)

区 分		2017年度末		2018年度 第2四半期(上半期)末	
			占 率		占 率
大 企 業	貸 付 先 数	658	58.4	652	57.3
	金 額	3,508,030	89.0	3,410,775	88.6
中 堅 企 業	貸 付 先 数	103	9.1	101	8.9
	金 額	19,556	0.5	19,614	0.5
中 小 企 業	貸 付 先 数	366	32.5	384	33.8
	金 額	411,897	10.5	417,913	10.9
国内企業向け貸付計	貸 付 先 数	1,127	100.0	1,137	100.0
	金 額	3,939,485	100.0	3,848,304	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	2017年度末		2018年度 第2四半期(上半期)末		
	金額	占率	金額	占率	
国内向け	製造業	726,417	17.1	713,220	17.1
	食料	34,383	0.8	35,234	0.8
	繊維	8,622	0.2	5,379	0.1
	木材・木製品	—	—	—	—
	パルプ・紙	42,103	1.0	44,732	1.1
	印刷	5,608	0.1	5,547	0.1
	化学	116,592	2.7	116,838	2.8
	石油・石炭	84,420	2.0	79,420	1.9
	窯業・土石	68,167	1.6	68,057	1.6
	鉄鋼	120,897	2.8	117,927	2.8
	非鉄金属	12,400	0.3	12,716	0.3
	金属製品	2,241	0.1	2,640	0.1
	はん用・生産用・業務用機械	54,280	1.3	48,647	1.2
	電気機械	92,743	2.2	92,163	2.2
	輸送用機械	79,913	1.9	79,807	1.9
	その他の製造業	4,043	0.1	4,108	0.1
	農業、林業	360	0.0	326	0.0
	漁業	—	—	—	—
	鉱業、採石業、砂利採取業	26	0.0	—	—
	建設業	16,376	0.4	12,673	0.3
	電気・ガス・熱供給・水道業	742,800	17.4	751,447	18.0
	情報通信業	92,604	2.2	91,849	2.2
	運輸業、郵便業	298,485	7.0	294,066	7.1
	卸売業	797,540	18.7	774,928	18.6
	小売業	21,488	0.5	14,276	0.3
	金融業、保険業	872,466	20.5	822,173	19.7
	不動産業	355,890	8.4	359,764	8.6
	物品賃貸業	111,362	2.6	104,341	2.5
	学術研究、専門・技術サービス業	20,790	0.5	20,768	0.5
	宿泊業	2,025	0.0	1,933	0.0
	飲食業	735	0.0	849	0.0
	生活関連サービス業、娯楽業	3,249	0.1	3,056	0.1
	教育、学習支援業	461	0.0	381	0.0
医療・福祉	131	0.0	147	0.0	
その他のサービス	1,849	0.0	2,777	0.1	
地方公共団体	569	0.0	474	0.0	
個人(住宅・消費・納税資金等)	19,445	0.5	18,629	0.4	
その他	—	—	—	—	
合計	4,085,077	95.9	3,988,086	95.7	
海外向け	政府等	31,000	0.7	31,000	0.7
	金融機関	15,200	0.4	15,030	0.4
	商工業等	126,832	3.0	132,062	3.2
	合計	173,032	4.1	178,092	4.3
一般貸付計	4,258,109	100.0	4,166,178	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	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

(単位:百万円)

区 分	2018年度第2四半期(上半期)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	109,606	14,120	8,303	15,337	3,525	61,153	212,046
固 定 金 利	378,793	484,416	645,731	540,641	764,692	1,139,855	3,954,132
一 般 貸 付 計	488,400	498,537	654,035	555,978	768,217	1,201,009	4,166,178

(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	2017年度末		2018年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
北 海 道	40,807	1.0	40,787	1.0
東 北	57,188	1.4	57,745	1.5
関 東	3,106,226	76.4	3,027,481	76.3
中 部	364,063	9.0	360,398	9.1
近 畿	249,169	6.1	238,734	6.0
中 国	53,785	1.3	52,761	1.3
四 国	48,372	1.2	42,777	1.1
九 州	146,017	3.6	148,770	3.7
合 計	4,065,631	100.0	3,969,457	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	2017年度末		2018年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
担 保 貸 付	15,046	0.4	14,953	0.4
有 価 証 券 担 保 貸 付	4,607	0.1	3,783	0.1
不 動 産・動 産・財 団 担 保 貸 付	9,221	0.2	9,921	0.2
指 名 債 権 担 保 貸 付	1,217	0.0	1,249	0.0
保 証 貸 付	68,559	1.6	67,398	1.6
信 用 貸 付	4,155,057	97.6	4,065,197	97.6
そ の 他	19,445	0.5	18,629	0.4
一 般 貸 付 計	4,258,109	100.0	4,166,178	100.0
うち劣後特約付貸付	388,450	9.1	344,950	8.3

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	2017年度末		2018年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
公 社 債	6,793,498	72.0	7,746,841	74.5
株 式 等	1,615,405	17.1	1,661,694	16.0
現 預 金・そ の 他	115,449	1.2	147,605	1.4
小 計	8,524,354	90.4	9,556,142	91.9

イ. 円貨額が確定した外貨建資産

(単位:百万円、%)

区 分	2017年度末		2018年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
貸 付 金	131,049	1.4	131,049	1.3
そ の 他	103	0.0	101	0.0
小 計	131,152	1.4	131,150	1.3

(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	2017年度末		2018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	167,200	1.8	167,030	1.6
公 社 債 (円 建 外 債)	212,602	2.3	200,292	1.9
そ の 他	397,576	4.2	347,742	3.3
小 計	777,378	8.2	715,064	6.9

エ. 合計 (ア+イ+ウ)

(単位:百万円、%)

区 分	2017年度末		2018年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
海 外 投 融 資	9,432,885	100.0	10,402,357	100.0

(2) 外貨建資産の通貨別構成

(単位:百万円、%)

区 分	2017年度末		2018年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
米 ド ル	7,457,063	87.5	8,483,873	88.8
ユ ー ロ	509,478	6.0	511,379	5.4
そ の 他	557,812	6.5	560,889	5.9
合 計	8,524,354	100.0	9,556,142	100.0

(3) 海外投融資の地域別構成

(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

(単位:百万円、%)

区 分	2018年度第2四半期(上半期)末							
	外国証券						非居住者貸付	
	金額		占率		金額		占率	
北 米	6,993,858	72.2	6,355,020	82.8	638,838	31.8	25,178	14.1
ヨ ー ロ ッ パ	896,645	9.3	752,545	9.8	144,100	7.2	29,500	16.6
オ セ ア ニ ア	324,647	3.4	324,647	4.2	—	—	1,884	1.1
ア ジ ア	166,660	1.7	52,456	0.7	114,203	5.7	1,530	0.9
中 南 米	1,159,722	12.0	47,427	0.6	1,112,295	55.4	110,000	61.8
中 東	—	—	—	—	—	—	—	—
ア フ リ カ	—	—	—	—	—	—	—	—
国 際 機 関	144,422	1.5	144,422	1.9	—	—	10,000	5.6
合 計	9,685,957	100.0	7,676,519	100.0	2,009,437	100.0	178,092	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上で原則C S A（市場動向やリスク等に応じて取引先との間で相互に担保資産の差し入れを行なう契約）を用いた店頭取引であり、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]

期末日の情報ベンダーが提供する価格

[外国為替予約等の店頭取引の場合]

期末日のT T M、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あ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	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

(単位:百万円)

区 分	2018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
ヘッジ会計適用分	45,610	△131,673	—	—	—	△86,062
ヘッジ会計非適用分	—	△6,802	—	—	—	△6,802
合 計	45,610	△138,475	—	—	—	△92,865

(注) ヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ適用分の差損益(2017年度末:通貨関連79,785百万円、2018年度第2四半期(上半期)末:通貨関連△129,860百万円)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	2017年度末				2018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		
	金利スワップ 固定金利受取/変動金利支払	1,200	1,200	4	4	—	—	—	—
	合 計				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		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

(単位:百万円、%)

区 分		2018年度第2四半期(上半期)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	—	—	—	—	—	—	—
	平均受取金利	—	—	—	—	—	—	—
	平均支払金利	—	—	—	—	—	—	—

○通貨関連

(単位:百万円)

区 分	2017年度末				2018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	47,797	—	1,688	1,688	73,533	—	△2,909	△2,909
	米ドル	45,857	—	1,697	1,697	71,636	—	△2,879	△2,879
	豪ドル	1,939	—	△9	△9	1,897	—	△29	△29
	買建	—	—	—	—	15,864	—	59	59
	スウェーデン・クローナ	—	—	—	—	7,974	—	0	0
	米ドル	—	—	—	—	7,889	—	59	59
通貨スワップ									
円払/豪ドル受	88,870	88,870	△4,389	△4,389	121,279	121,279	△4,043	△4,043	
円払/米ドル受	—	—	—	—	7,170	7,170	91	91	
合 計				△2,701				△6,802	

(注) 為替予約およびスワップ取引の差損益は、時価を記載しています。

○株式関連

2017年度末および2018年度第2四半期(上半期)末とも保有していません。

○債券関連

2017年度末および2018年度第2四半期(上半期)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	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

(単位:百万円)

ヘッジ会計の方法	種類	主なヘッジ対象	2018年度第2四半期(上半期)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	45,456
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	3,466	3,375	154
合 計					45,610

【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		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

(単位:百万円、%)

区 分		2018年度第2四半期(上半期)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	91	3,500	7,100	8,875	14,500	202,000	236,066
変動金利支払	平均受取金利	1.60	1.50	1.69	1.73	1.90	1.88	1.86
スワップ	平均支払金利	0.10	0.03	0.02	0.11	0.07	0.02	0.03

○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	2017年度末			2018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	外貨建債券						
	売建		3,376,632	—	79,785	3,936,937	—	△129,860
	米ドル		3,058,604	—	76,837	3,593,056	—	△124,245
	ユーロ		183,159	—	319	189,578	—	△4,816
	豪ドル		134,867	—	2,628	146,322	—	△800
	その他	—	—	—	7,980	—	2	
繰延ヘッジ	通貨スワップ	外貨建債券						
	ユーロ		35,575	35,575	△1,641	35,575	35,575	△1,985
	豪ドル		4,305	4,305	192	4,305	4,305	172
合 計					78,337			△131,673

(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

2017年度末および2018年度第2四半期(上半期)末とも保有していません。

○債券関連

2017年度末および2018年度第2四半期(上半期)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	2017年度末	2018年度 第2四半期(上半期)末
有 価 証 券	5,722,506	5,587,220
評 価 差 額	3,559,231	3,674,732
オ フ バ ラ ン ス	2,163,274	1,912,487
土 地	410,367	426,005
再 評 価 差 額	197,711	197,787
オ フ バ ラ ン ス	212,655	228,217
そ の 他	49,791	43,597
合 計	6,182,665	6,056,823

- (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(2017年度末:通貨関連79,785百万円、2018年度第2四半期(上半期)末:通貨関連△129,860百万円)、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	2017年度末		2018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	57,986	△869	59,320	2,291

(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	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	—	—	—	—	—	—
ヘッジ会計非適用分	—	1	—	—	—	1
合 計	—	1	—	—	—	1

(単位:百万円)

区 分	2018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
ヘッジ会計適用分	—	—	—	—	—	—
ヘッジ会計非適用分	—	△16	58	—	—	41
合 計	—	△16	58	—	—	41

(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

2017年度末および2018年度第2四半期(上半期)末とも保有していません。

○通貨関連

(単位:百万円)

区 分	2017年度末				2018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	1,216	—	△0	△0	803	—	△16	△16
	米ドル	813	—	△1	△1	562	—	△11	△11
	ユーロ	336	—	1	1	239	—	△5	△5
	その他	66	—	0	0	1	—	△0	△0
	買建	1,656	—	1	1	—	—	—	—
	米ドル	1,027	—	4	4	—	—	—	—
	ユーロ	550	—	△2	△2	—	—	—	—
その他	78	—	△0	△0	—	—	—	—	
合 計				1				△16	

(注) 為替予約の差損益は、時価を記載しています。

○株式関連

(単位:百万円)

区 分	2017年度末				2018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 買建	—	—	—	—	891	—	71	71
	外国株価指数先物 売建	—	—	—	—	868	—	△12	△12
合 計				—	—				58

(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

2017年度末および2018年度第2四半期(上半期)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

2017年度末および2018年度第2四半期(上半期)末とも保有していません。

○通貨関連

2017年度末および2018年度第2四半期(上半期)末とも保有していません。

○株式関連

2017年度末および2018年度第2四半期(上半期)末とも保有していません。

○債券関連

2017年度末および2018年度第2四半期(上半期)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	2017年度末		2018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	312,669	2,479	299,060	△4,418

(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
2017年度末および2018年度第2四半期(上半期)末とも保有していません。
- 通貨関連
2017年度末および2018年度第2四半期(上半期)末とも保有していません。
- 株式関連
2017年度末および2018年度第2四半期(上半期)末とも保有していません。
- 債券関連
2017年度末および2018年度第2四半期(上半期)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
2017年度末および2018年度第2四半期(上半期)末とも保有していません。
- 通貨関連
2017年度末および2018年度第2四半期(上半期)末とも保有していません。
- 株式関連
2017年度末および2018年度第2四半期(上半期)末とも保有していません。
- 債券関連
2017年度末および2018年度第2四半期(上半期)末とも保有していません。

Ⅲ. その他(会社計)

1. 資産構成

(1) 資産の構成(2018年度第2四半期(上半期)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	1,021,331	2.6	1,012,656	2.6
買現先勘定	—	—	—	—
債券貸借取引支払保証金	—	—	—	—
買入金銭債権	214,912	0.5	214,912	0.6
商品有価証券	—	—	—	—
金銭の信託	15,606	0.0	15,606	0.0
有価証券	32,675,818	82.1	31,863,526	81.8
公 社 債	17,118,857	43.0	16,934,059	43.5
株 式	4,634,220	11.6	4,501,994	11.6
外 国 証 券	9,882,147	24.8	9,685,957	24.9
公 社 債	7,766,986	19.5	7,676,519	19.7
株 式 等	2,115,160	5.3	2,009,437	5.2
その他の証券	1,040,593	2.6	741,514	1.9
貸付金	4,410,830	11.1	4,410,830	11.3
保険約款貸付	244,651	0.6	244,651	0.6
一般貸付	4,166,178	10.5	4,166,178	10.7
不動産	864,391	2.2	864,391	2.2
繰延税金資産	—	—	—	—
その他の	594,558	1.5	585,394	1.5
貸倒引当金	△4,940	△0.0	△4,940	△0.0
合 計	39,792,508	100.0	38,962,377	100.0
うち外貨建資産	9,757,498	24.5	9,556,142	24.5

(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2017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	—	423,862	—	459,275
買現先勘定	—	—	—	—
債券貸借取引支払保証金	—	—	—	—
買入金銭債権	181	—	181	—
商品有価証券	—	—	—	—
金銭の信託	—	5,529	—	5,529
有価証券	—	893,856	—	866,797
公 社 債	△90,786	—	△84,226	—
株 式	40,434	—	37,899	—
外 国 証 券	—	891,902	—	844,211
公 社 債	—	871,168	—	847,755
株 式 等	—	20,734	—	△3,544
その他の証券	—	52,306	—	68,913
貸付金	△96,539	—	△96,539	—
保険約款貸付	△4,608	—	△4,608	—
一般貸付	△91,931	—	△91,931	—
不動産	△4,508	—	△4,508	—
繰延税金資産	—	—	—	—
その他の	5,631	—	27,191	—
貸倒引当金	159	—	159	—
合 計	—	1,228,173	—	1,258,087
うち外貨建資産	—	1,076,237	—	1,031,787

(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(2018年度第2四半期(上半期))

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「5. 中間損益計算書」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	2017年度末		2018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	785,232	△4,583	812,291	10,380
一般勘定	—	—	—	—
特別勘定	785,232	△4,583	812,291	10,380

(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	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	—

(単位:百万円)

区 分	2018年度第2四半期(上半期)末				
	帳簿価額	時価	差損益	差益	差損
満期保有目的の債券	4,441,626	5,162,408	720,781	722,575	△1,793
責任準備金対応債券	7,758,128	8,978,348	1,220,219	1,228,150	△7,930
子会社株式及び関連会社株式	—	—	—	—	—
その他有価証券	15,036,958	18,710,867	3,673,909	3,830,639	△156,730
公社債	5,014,894	5,388,830	373,936	384,004	△10,068
株式	1,683,929	4,375,763	2,691,833	2,701,969	△10,136
外国証券	7,600,093	8,139,171	539,078	669,883	△130,804
公社債	6,855,140	7,221,596	366,456	492,489	△126,032
株式等	744,952	917,574	172,621	177,393	△4,771
その他の証券	647,048	715,188	68,139	73,793	△5,653
買入金銭債権	14,320	15,308	988	988	—
譲渡性預金	61,000	60,998	△1	0	△1
金銭の信託	15,671	15,606	△65	—	△65
合 計	27,236,713	32,851,624	5,614,910	5,781,365	△166,454
公社債	16,560,123	18,868,595	2,308,472	2,319,617	△11,145
株式	1,683,929	4,375,763	2,691,833	2,701,969	△10,136
外国証券	8,055,016	8,592,822	537,805	675,536	△137,731
公社債	7,310,063	7,675,247	365,183	498,142	△132,959
株式等	744,952	917,574	172,621	177,393	△4,771
その他の証券	647,048	715,188	68,139	73,793	△5,653
買入金銭債権	213,923	222,651	8,727	10,448	△1,721
譲渡性預金	61,000	60,998	△1	0	△1
金銭の信託	15,671	15,606	△65	—	△65

(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	2017年度末			2018年度第2四半期(上半期)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	4,482,952	5,292,148	809,196	4,366,328	5,088,904	722,575
公 社 債	4,220,155	5,011,203	791,048	4,128,576	4,836,193	707,616
外 国 証 券	119,183	125,914	6,731	101,247	106,746	5,498
買 入 金 銭 債 権	143,614	155,030	11,416	136,503	145,963	9,460
時価が貸借対照表計上額を 超えないもの	57,349	56,690	△658	75,298	73,504	△1,793
公 社 債	2,800	2,786	△13	2,800	2,787	△12
外 国 証 券	249	248	△0	9,398	9,338	△60
買 入 金 銭 債 権	54,300	53,654	△645	63,100	61,378	△1,721

イ. 責任準備金対応債券

(単位:百万円)

区 分	2017年度末			2018年度第2四半期(上半期)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	7,427,523	8,852,888	1,425,365	7,352,298	8,580,448	1,228,150
公 社 債	7,394,452	8,819,512	1,425,060	7,305,121	8,533,116	1,227,995
外 国 証 券	33,070	33,376	305	47,176	47,331	154
時価が貸借対照表計上額を 超えないもの	122,298	118,896	△3,401	405,830	397,899	△7,930
公 社 債	—	—	—	108,731	107,666	△1,064
外 国 証 券	122,298	118,896	△3,401	297,099	290,233	△6,866

ウ. その他有価証券

(単位:百万円)

区 分	2017年度末			2018年度第2四半期(上半期)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	10,087,737	13,817,132	3,729,394	10,077,513	13,908,153	3,830,639
公 社 債	4,762,611	5,195,056	432,444	4,492,836	4,876,840	384,004
株 式	1,548,692	4,227,017	2,678,324	1,605,036	4,307,006	2,701,969
外 国 証 券	3,346,851	3,903,453	556,602	3,475,011	4,144,894	669,883
そ の 他 の 証 券	399,140	459,711	60,570	466,308	540,101	73,793
買 入 金 銭 債 権	15,626	16,816	1,190	14,320	15,308	988
譲 渡 性 預 金	5,000	5,000	0	24,000	24,000	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	4,229,967	4,058,766	△171,200	4,959,444	4,802,714	△156,730
公 社 債	212,170	205,822	△6,347	522,057	511,989	△10,068
株 式	123,241	112,743	△10,498	78,893	68,756	△10,136
外 国 証 券	3,671,159	3,521,586	△149,572	4,125,081	3,994,276	△130,804
そ の 他 の 証 券	192,396	187,615	△4,780	180,740	175,086	△5,653
買 入 金 銭 債 権	—	—	—	—	—	—
譲 渡 性 預 金	31,000	30,999	△0	37,000	36,998	△1
金 銭 の 信 託	—	—	—	15,671	15,606	△65

・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	2017年度末	2018年度 第2四半期(上半期)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	875,118	877,099
そ の 他 有 価 証 券	415,356	366,497
非 上 場 国 内 株 式	27,776	27,691
非 上 場 外 国 株 式	377,126	327,126
そ の 他 外 国 証 券	458	601
そ の 他	9,994	11,078
合 計	1,290,474	1,243,597

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	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

(単位:百万円)

区 分	2018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
ヘッジ会計適用分	45,610	△131,673	—	—	—	△86,062
ヘッジ会計非適用分	—	△7,495	473	—	—	△7,021
合 計	45,610	△139,168	473	—	—	△93,084

(注) ヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ適用分の差損益(2017年度末:通貨関連79,785百万円、2018年度第2四半期(上半期)末:通貨関連△129,860百万円)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	2017年度末				2018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		
	金利スワップ 固定金利受取/変動金利支払	1,200	1,200	4	4	—	—	—	—
	合 計			4	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		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	—	—	—	—	—	1,200	1,200	
	平均受取金利	—	—	—	—	—	0.68	0.68	
	平均支払金利	—	—	—	—	—	0.01	0.01	

(単位:百万円、%)

区 分		2018年度第2四半期(上半期)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	—	—	—	—	—	—	—	
	平均受取金利	—	—	—	—	—	—	—	
	平均支払金利	—	—	—	—	—	—	—	

○通貨関連

(単位:百万円)

区 分	2017年度末				2018年度第2四半期(上半期)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	88,295	—	1,768	1,768	102,280	—	△3,646	△3,646
	米ドル	62,385	—	1,661	1,661	82,159	—	△3,092	△3,092
	豪ドル	11,454	—	68	68	10,029	—	△342	△342
	ユーロ	13,904	—	37	37	10,012	—	△211	△211
	英ポンド	127	—	0	0	26	—	0	0
	その他	422	—	0	0	52	—	△0	△0
	買建	19,226	—	61	61	18,837	—	103	103
	米ドル	9,566	—	64	64	9,507	—	87	87
	スウェーデン・クローナ	101	—	△0	△0	7,974	—	0	0
	ユーロ	6,914	—	△0	△0	1,009	—	12	12
	豪ドル	2,302	—	△0	△0	304	—	3	3
	その他	340	—	△0	△0	41	—	0	0
通貨スワップ									
円払/豪ドル受	88,870	88,870	△4,389	△4,389	121,279	121,279	△4,043	△4,043	
円払/米ドル受	—	—	—	—	7,170	7,170	91	91	
合 計				△2,558				△7,495	

(注) 為替予約およびスワップ取引の差損益は、時価を記載しています。

○株式関連

(単位:百万円)

区 分	2017年度末				2018年度第2四半期(上半期)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	2,706	—	39	39	6,169	—	482	482
	外国株価指数先物								
	売建	—	—	—	—	2,818	—	△32	△32
買建	2,820	—	△93	△93	2,453	—	24	24	
合 計				△53				473	

(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

2017年度末および2018年度第2四半期(上半期)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	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

(単位:百万円)

ヘッジ会計の方法	種類	主なヘッジ対象	2018年度第2四半期(上半期)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	45,456
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	3,466	3,375	154
合 計					45,610

【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		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

(単位:百万円、%)

区 分		2018年度第2四半期(上半期)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	91	3,500	7,100	8,875	14,500	202,000	236,066
	平均受取金利	1.60	1.50	1.69	1.73	1.90	1.88	1.86
	平均支払金利	0.10	0.03	0.02	0.11	0.07	0.02	0.03

○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	2017年度末			2018年度第2四半期(上半期)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 売建	外貨建 債券	3,376,632	—	79,785	3,936,937	—	△129,860	
	米ドル		3,058,604	—	76,837	3,593,056	—	△124,245	
	ユーロ		183,159	—	319	189,578	—	△4,816	
	豪ドル		134,867	—	2,628	146,322	—	△800	
	その他		—	—	—	7,980	—	2	
繰延ヘッジ	通貨スワップ	外貨建 債券							
	ユーロ		35,575	35,575	△1,641	35,575	35,575	△1,985	
	豪ドル		4,305	4,305	192	4,305	4,305	172	
合 計					78,337			△131,673	

(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

2017年度末および2018年度第2四半期(上半期)末とも保有していません。

○債券関連

2017年度末および2018年度第2四半期(上半期)末とも保有していません。