

平成 28 年 11 月 24 日

朝日生命保険相互会社

平成 28 年度第 2 四半期（上半期）報告 補足資料

【目 次】

I. 一般勘定

1. 有価証券関係	
(ア) 有価証券明細表	・ ・ ・ ・ 1
(イ) 有価証券残存期間別残高	・ ・ ・ ・ 2
(ウ) 地域別地方債保有内訳	・ ・ ・ ・ 2
(エ) 業種別株式明細表	・ ・ ・ ・ 3
(オ) デリバティブ取引の時価情報	・ ・ ・ ・ 4
2. 貸付金関係	
(ア) 貸付金明細表	・ ・ ・ ・ 6
(イ) 貸付金残存期間別残高	・ ・ ・ ・ 6
(ウ) 国内企業向け貸付金企業規模別内訳	・ ・ ・ ・ 7
(エ) 貸付金業種別内訳	・ ・ ・ ・ 8
(オ) 貸付金地域別内訳	・ ・ ・ ・ 9
(カ) 貸付金担保別内訳	・ ・ ・ ・ 9
3. 海外投融資関係	
(ア) 資産別明細	・ ・ ・ ・ 10
(イ) 海外投融資の地域別構成	・ ・ ・ ・ 11
(ウ) 外貨建資産の通貨別構成	・ ・ ・ ・ 11

II. 特別勘定

1. 個人変額保険（特別勘定）の状況	
(ア) 有価証券の時価情報	・ ・ ・ ・ 12
(イ) デリバティブ取引の時価情報	・ ・ ・ ・ 12
2. 個人変額年金保険（特別勘定）の状況	・ ・ ・ ・ 12

III. 全社計

1. 資産構成	・ ・ ・ ・ 13
2. 有価証券の時価情報	
(ア) 有価証券の時価情報	・ ・ ・ ・ 14
(イ) デリバティブ取引の運用状況	・ ・ ・ ・ 16
(ウ) デリバティブ取引の時価情報	・ ・ ・ ・ 17

IV. 貸倒引当金残高の内訳	・ ・ ・ ・ 20
----------------	------------

V. 個人保険および個人年金保険の責任準備金の積立状況	・ ・ ・ ・ 20
-----------------------------	------------

I. 一般勘定

1. 有価証券関係

(ア)有価証券明細表(一般勘定)

(単位:百万円、%)

区 分	平成27年度末		平成28年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
国 債	2,061,648	50.2	1,969,087	48.3
地 方 債	47,714	1.2	53,230	1.3
社 債	787,179	19.1	873,810	21.4
うち公社・公団債	370,279	9.0	378,626	9.3
株 式	238,780	5.8	236,022	5.8
外 国 証 券	904,201	22.0	872,892	21.4
公 社 債	690,481	16.8	652,802	16.0
株 式 等	213,720	5.2	220,090	5.4
そ の 他 の 証 券	71,417	1.7	70,699	1.7
合 計	4,110,943	100.0	4,075,742	100.0

(イ) 有価証券残存期間別残高(一般勘定)

<平成27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を含む)	合計
有価証券	67,931	160,845	223,063	388,252	499,621	2,771,228	4,110,943
国債	21,174	44,078	37,317	162,024	77,373	1,719,680	2,061,648
地方債	2,209	8,490	14,373	404	3,006	19,230	47,714
社債	30,000	103,688	88,729	57,821	150,745	356,194	787,179
株式						238,780	238,780
外国証券	14,461	3,384	82,643	164,073	267,019	372,619	904,201
公社債	500	3,384	82,643	164,073	266,660	173,218	690,481
株式等	13,961	-	-	-	358	199,400	213,720
その他の証券	86	1,203	-	3,926	1,476	64,724	71,417
買入金銭債権	-	-	-	-	-	41,906	41,906
譲渡性預金	-	-	-	-	-	-	-
その他	-	-	-	-	-	-	-
合計	67,931	160,845	223,063	388,252	499,621	2,813,135	4,152,850

<平成28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を含む)	合計
有価証券	73,352	146,696	244,657	235,602	539,823	2,835,610	4,075,742
国債	15,043	32,913	26,466	35,351	109,833	1,749,479	1,969,087
地方債	3,917	7,809	13,750	404	3,006	24,341	53,230
社債	42,197	99,558	104,475	74,740	154,774	398,064	873,810
株式						236,022	236,022
外国証券	12,140	5,547	99,965	121,208	270,778	363,251	872,892
公社債	902	5,547	99,965	121,208	252,444	172,733	652,802
株式等	11,237	-	-	-	18,333	190,518	220,090
その他の証券	52	866	-	3,897	1,431	64,451	70,699
買入金銭債権	-	-	-	-	-	36,563	36,563
譲渡性預金	-	-	-	-	-	-	-
その他	-	-	-	-	-	-	-
合計	73,352	146,696	244,657	235,602	539,823	2,872,174	4,112,306

(ウ) 地域別地方債保有内訳(一般勘定)

(単位:百万円)

区分	平成27年度末	平成28年度 第2四半期(上半期)末
北海道	3,210	3,210
東北	-	-
関東	40,258	42,171
中部	4,245	7,848
近畿	-	-
中国	-	-
四国	-	-
九州	-	-
合計	47,714	53,230

(エ)業種別株式明細表(一般勘定)

(単位:百万円、%)

区 分		平成27年度末		平成28年度第2四半期(上半期)末	
		金 額	占 率	金 額	占 率
水 産 ・ 農 林 業		28	0.0	28	0.0
鉱 業		-	-	-	-
建 設 業		3,433	1.4	3,476	1.5
製 造 業	食 料 品	2,022	0.8	2,026	0.9
	繊 維 製 品	279	0.1	231	0.1
	パ ル プ ・ 紙	84	0.0	81	0.0
	化 学	26,109	10.9	26,781	11.3
	医 薬 品	1,546	0.6	1,465	0.6
	石 油 ・ 石 炭 製 品	-	-	-	-
	ゴ ム 製 品	20,188	8.5	18,160	7.7
	ガ ラ ス ・ 土 石 製 品	134	0.1	133	0.1
	鉄 鋼	1,056	0.4	1,034	0.4
	非 鉄 金 属	8,276	3.5	10,223	4.3
	金 属 製 品	362	0.2	369	0.2
	機 械	4,673	2.0	4,469	1.9
	電 気 機 器	33,700	14.1	38,187	16.2
	輸 送 用 機 器	2,342	1.0	2,351	1.0
精 密 機 器	68	0.0	62	0.0	
そ の 他 製 品	5,881	2.5	5,702	2.4	
電 気 ・ ガ ス 業		338	0.1	338	0.1
運 輸 ・ 情 報 通 信 業	陸 運 業	41,347	17.3	38,303	16.2
	海 運 業	2	0.0	1	0.0
	空 運 業	303	0.1	226	0.1
	倉 庫 ・ 運 輸 関 連 業	1,759	0.7	1,683	0.7
	情 報 ・ 通 信 業	2,977	1.2	2,984	1.3
商 業	卸 売 業	35,166	14.7	31,116	13.2
	小 売 業	3,167	1.3	3,412	1.4
金 融 ・ 保 険 業	銀 行 業	28,294	11.8	28,588	12.1
	証 券、商 品 先 物 取 引 業	6,117	2.6	5,952	2.5
	保 険 業	245	0.1	245	0.1
	そ の 他 金 融 業	4,388	1.8	4,036	1.7
不 動 産 業		1,327	0.6	1,317	0.6
サ ー ビ ス 業		3,154	1.3	3,030	1.3
合 計		238,780	100.0	236,022	100.0

(オ) デリバティブ取引の時価情報(一般勘定)

① 差損益の内訳 (ヘッジ会計適用分・非適用分の内訳) (一般勘定)

(単位:百万円)

平成27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	-	-	2,647	-	-	-	2,647
ヘッジ会計非適用分	-	-	1,102	△55	-	-	1,046
合計	-	-	3,750	△55	-	-	3,694

(注) 平成27年度についてヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ適用分の差損益(通貨関連2,647百万円)およびヘッジ会計非適用分の差損益は、損益計算書に計上されています。

(単位:百万円)

平成28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	-	-	6,581	-	-	-	6,581
ヘッジ会計非適用分	-	-	524	△46	-	-	477
合計	-	-	7,106	△46	-	-	7,059

(注) 平成28年度第2四半期(上半期)についてヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ適用分の差損益(通貨関連6,581百万円)およびヘッジ会計非適用分の差損益は、損益計算書に計上されています。

② 金利関連 (一般勘定)

平成28年度第2四半期(上半期)末、平成27年度末とも保有していません。

③ 通貨関連 (一般勘定)

(単位:百万円)

区分	種類	平成27年度末				平成28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	通貨先渡契約								
	売建	-	-	-	-	-	-	-	-
	買建	-	-	-	-	-	-	-	-
	為替予約								
	売建	697,994	-	3,725	3,725	804,562	-	7,129	7,129
	うち米ドル	578,191	-	5,836	5,836	670,252	-	5,811	5,811
	うち豪ドル	15,628	-	△510	△510	15,115	-	49	49
	うち加ドル	-	-	-	-	34,325	-	800	800
	うちユーロ	104,174	-	△1,600	△1,600	84,869	-	468	468
	買建	7,224	-	24	24	11,213	-	△23	△23
	うち米ドル	7,224	-	24	24	11,213	-	△23	△23
	うち豪ドル	-	-	-	-	-	-	-	-
	うち加ドル	-	-	-	-	-	-	-	-
	うちユーロ	-	-	-	-	-	-	-	-
	通貨オプション								
	売建								
	コール	-	-	-	-	-	-	-	-
	プット	(-)	-	-	-	(-)	-	-	-
	買建	(-)	-	-	-	(-)	-	-	-
	コール	-	-	-	-	-	-	-	-
	プット	(-)	-	-	-	(-)	-	-	-
	通貨スワップ								
	その他								
売建	-	-	-	-	-	-	-	-	
買建	(-)	-	-	-	(-)	-	-	-	
合計									
					3,750			7,106	

(注) ・時価の算定には、期末日のTTM、WMロイターレート、割引レート等を基準として、当社で算出した理論価格を使用しています。
・為替予約の時価欄には差損益を記載しています。

④株式関連（一般勘定）

（単位：百万円）

区分	種類	平成27年度末				平成28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	先渡契約								
	売建	-	-	-	-	-	-	-	-
	買建	-	-	-	-	-	-	-	-
	オプション								
	売建								
	コール	-	-	-	-	-	-	-	-
	プット	(-)	-	-	-	(-)	-	-	-
	買建	-	-	-	-	-	-	-	-
	コール	(-)	-	-	-	(-)	-	-	-
	プット	49,997	-	0	△55	50,000	-	0	△46
	(55)					(46)			
その他									
売建	-	-	-	-	-	-	-	-	
買建	(-)	-	-	-	(-)	-	-	-	
買建	-	-	-	-	-	-	-	-	
買建	(-)	-	-	-	(-)	-	-	-	
合計				△55				△46	

（注）括弧内には、オプション料を記載しています。

⑤債券関連（一般勘定）

平成28年度第2四半期(上半期)末、平成27年度末とも保有していません。

2. 貸付金関係

(ア) 貸付金明細表(一般勘定)

(単位:百万円)

区 分	平成27年度末	平成28年度 第2四半期(上半期)末
保険約款貸付	68,813	62,758
契約者貸付	63,149	57,559
保険料振替貸付	5,664	5,199
一 般 貸 付	552,175	524,566
(うち非居住者貸付)	(-)	(-)
企業貸付	545,346	518,387
(うち国内企業向け貸付)	(545,346)	(518,387)
国・国際機関・政府関係機関貸付	795	706
公共団体・公企業貸付	2,530	2,530
住 宅 ロ ー ン	625	549
消 費 者 ロ ー ン	2,829	2,348
そ の 他	49	44
合 計	620,988	587,325
うち劣後特約付貸付	59,300	64,300

(イ) 貸付金残存期間別残高(一般勘定)

(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を含む)	合 計
平成 27 年度 末	変動金利	2,676	9,632	5,273	2,595	1,741	12,000	33,919
	固定金利	83,714	122,173	135,693	61,058	58,812	56,802	518,255
	一般貸付計	86,390	131,806	140,967	63,654	60,553	68,802	552,175
第 2 四 半 期 成 (28 年 上 半 期 末	変動金利	2,711	10,932	3,323	2,043	1,721	22,000	42,733
	固定金利	79,329	122,705	111,909	61,080	64,461	42,346	481,833
	一般貸付計	82,040	133,638	115,233	63,123	66,183	64,346	524,566

(ウ)国内企業向け貸付金企業規模別内訳(一般勘定)

(単位:件、百万円、%)

区 分		平成27年度末		平成28年度 第2四半期(上半期)末	
			占 率		占 率
大 企 業	貸付先数	105	79.5	99	79.2
	金 額	495,262	90.8	469,623	90.6
中 堅 企 業	貸付先数	1	0.8	1	0.8
	金 額	375	0.1	275	0.1
中 小 企 業	貸付先数	26	19.7	25	20.0
	金 額	49,708	9.1	48,489	9.4
国内企業向け	貸付先数	132	100.0	125	100.0
貸 付 計	金 額	545,346	100.0	518,387	100.0

(注) 1. 業種別企業規模区分は以下の通りです。

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。

<業種別企業規模区分>

業種	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	
大企業	常用 従業員	資本金 10億円以上	常用 従業員	資本金 10億円以上	常用 従業員	資本金 10億円以上	常用 従業員	資本金 10億円以上
中堅企業	300人超 かつ	資本金 3億円超 10億円未満	50人超 かつ	資本金 5千万円超 10億円未満	100人超 かつ	資本金 5千万円超 10億円未満	100人超 かつ	資本金 1億円超 10億円未満
中小企業	資本金3億円以下 又は常用従業員 300人以下		資本金5千万円以下 又は常用従業員 50人以下		資本金5千万円以下 又は常用従業員 100人以下		資本金1億円以下 又は常用従業員 100人以下	

(エ)貸付金業種別内訳(一般勘定)

(単位:百万円、%)

区分	平成27年度末		平成28年度 第2四半期(上半期)末	
	金額	占率	金額	占率
製造業	81,543	14.8	77,183	14.7
食料	2,180	0.4	2,150	0.4
繊維	6,000	1.1	6,000	1.1
木材・木製品	-	-	-	-
パルプ・紙	3,884	0.7	3,860	0.7
印刷	72	0.0	54	0.0
化学	12,976	2.4	12,165	2.3
石油・石炭	800	0.1	800	0.2
窯業・土石	540	0.1	523	0.1
鉄鋼	7,000	1.3	9,000	1.7
非鉄金属	30,437	5.5	28,103	5.4
金属製品	-	-	-	-
はん用・生産用・業務用機械	7,291	1.3	7,228	1.4
電気機械	3,500	0.6	1,500	0.3
輸送用機械	6,110	1.1	5,065	1.0
その他の製造業	750	0.1	733	0.1
農業、林業	-	-	-	-
漁業	-	-	-	-
鉱業、採石業、砂利採取業	-	-	-	-
建設業	3,234	0.6	2,801	0.5
電気・ガス・熱供給・水道業	19,773	3.6	18,628	3.6
情報通信業	7,315	1.3	4,154	0.8
運輸業、郵便業	62,327	11.3	61,441	11.7
卸売業	104,523	18.9	93,943	17.9
小売業	2,606	0.5	2,546	0.5
金融業、保険業	184,231	33.4	171,498	32.7
不動産業	26,097	4.7	25,938	4.9
物品賃貸業	47,419	8.6	54,868	10.5
学術研究、専門・技術サービス業	-	-	-	-
宿泊業	382	0.1	348	0.1
飲食業	-	-	-	-
生活関連サービス業、娯楽業	7,861	1.4	6,763	1.3
教育、学習支援業	-	-	-	-
医療・福祉	-	-	-	-
その他のサービス	1,407	0.3	1,553	0.3
地方公共団体	-	-	-	-
個人(住宅・消費・納税資金等)	3,454	0.6	2,898	0.6
合計	552,175	100.0	524,566	100.0
海外向け	-	-	-	-
政府等	-	-	-	-
金融機関	-	-	-	-
商工業(等)	-	-	-	-
合計	-	-	-	-
一般貸付計	552,175	100.0	524,566	100.0

(注) 国内向けの区分は日本銀行の貸出先別貸付金(業種別、設備資金新規貸出)の業種分類に準拠しております。

(オ) 貸付金地域別内訳(一般勘定)

(単位:百万円、%)

区 分	平成27年度末		平成28年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
北 海 道	1,000	0.2	1,000	0.2
東 北	7,397	1.3	6,397	1.2
関 東	455,379	83.0	432,868	83.0
中 部	15,793	2.9	14,143	2.7
近 畿	57,096	10.4	55,268	10.6
中 国	1,800	0.3	1,800	0.3
四 国	1,254	0.2	1,190	0.2
九 州	9,000	1.6	9,000	1.7
合 計	548,720	100.0	521,668	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、貸付先の本社所在地によります。

(カ) 貸付金担保別内訳(一般勘定)

(単位:百万円、%)

区 分	平成27年度末		平成28年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
担保貸付	4,494	0.8	3,569	0.7
有 価 証 券 担 保 貸 付	3,786	0.7	3,028	0.6
不 動 産 ・ 動 産 ・ 財 団 担 保 貸 付	708	0.1	541	0.1
指 名 債 権 担 保 貸 付	-	-	-	-
保証貸付	14,961	2.7	12,361	2.4
信用貸付	529,264	95.9	505,736	96.4
その他	3,454	0.6	2,898	0.6
一般貸付計	552,175	100.0	524,566	100.0
う ち 劣 後 特 約 付 貸 付	59,300	10.7	64,300	12.3

3. 海外投融資関係

(ア) 資産別明細(一般勘定)

(a) 外貨建資産

(単位:百万円、%)

区 分	平成27年度末		平成28年度第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
公 社 債	529,210	58.2	496,547	56.6
株 式	31	0.0	34	0.0
現預金・その他	44,317	4.9	40,223	4.6
小 計	573,558	63.1	536,804	61.2

(b) 円貨額が確定した外貨建資産

(単位:百万円、%)

区 分	平成27年度末		平成28年度第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
公 社 債	-	-	-	-
現預金・その他	-	-	-	-
小 計	-	-	-	-

(c) 円貨建資産

(単位:百万円、%)

区 分	平成27年度末		平成28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	-	-	-	-
公社債(円建外債)・その他	334,984	36.9	340,047	38.8
小 計	334,984	36.9	340,047	38.8

(d) 合計

(単位:百万円、%)

区 分	平成27年度末		平成28年度第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
海外投融資	908,543	100.0	876,851	100.0
うち海外不動産	-	-	-	-

(注) 「円貨額が確定した外貨建資産」は、為替予約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。

(イ)海外投融資の地域別構成(一般勘定)

(単位:百万円、%)

区分	平成27年度末							
	外国証券						非居住者貸付	
			公社債		株式等			
	金額	占率	金額	占率	金額	占率	金額	占率
北米	214,858	23.8	210,149	23.2	4,709	0.5	-	-
ヨーロッパ	282,741	31.3	281,994	31.2	747	0.1	-	-
オセアニア	-	-	-	-	-	-	-	-
アジア	530	0.1	500	0.1	30	0.0	-	-
中南米	302,228	33.4	93,996	10.4	208,232	23.0	-	-
中東	-	-	-	-	-	-	-	-
アフリカ	-	-	-	-	-	-	-	-
国際機関	103,841	11.5	103,841	11.5	-	-	-	-
合計	904,201	100.0	690,481	76.4	213,720	23.6	-	-

(単位:百万円、%)

区分	平成28年度第2四半期(上半期)末							
	外国証券						非居住者貸付	
			公社債		株式等			
	金額	占率	金額	占率	金額	占率	金額	占率
北米	225,528	25.8	221,013	25.3	4,515	0.5	-	-
ヨーロッパ	247,780	28.4	247,142	28.3	637	0.1	-	-
オセアニア	-	-	-	-	-	-	-	-
アジア	529	0.1	500	0.1	29	0.0	-	-
中南米	307,974	35.3	93,066	10.7	214,907	24.6	-	-
中東	-	-	-	-	-	-	-	-
アフリカ	-	-	-	-	-	-	-	-
国際機関	91,080	10.4	91,080	10.4	-	-	-	-
合計	872,892	100.0	652,802	74.8	220,090	25.2	-	-

(注)外国証券は発行国、非居住者貸付は債務者の居住地により区分しています。

(ウ)外貨建資産の通貨別構成(一般勘定)

(単位:百万円、%)

区分	平成27年度末		平成28年度 第2四半期(上半期)末	
	金額	占率	金額	占率
米ドル	451,459	78.7	403,735	75.2
ユーロ	108,198	18.9	86,202	16.1
カナダドル	-	-	33,964	6.3
その他の	13,900	2.4	12,902	2.4
合計	573,558	100.0	536,804	100.0

II. 特別勘定

1. 個人変額保険(特別勘定)の状況

(ア) 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	平成27年度末		平成28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	27,615	△3,779	25,647	△525

(注)「当期の損益に含まれた評価損益」には振戻損益を含んでいます。

② 有価証券の明細

(単位:百万円)

区 分	平成27年度末	平成28年度 第2四半期(上半期)末
	貸借対照表計上額	貸借対照表計上額
公社債	6,753	6,762
株式	10,453	9,696
外国証券	10,407	9,188
公社債	3,546	2,922
株式等	6,861	6,266
その他の証券	-	-
合計	27,615	25,647

(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。

(イ) デリバティブ取引の時価情報

① 金利関連

平成28年度第2四半期(上半期)末、平成27年度末とも保有していません。

② 通貨関連

平成28年度第2四半期(上半期)末、平成27年度末とも保有していません。

③ 株式関連

平成28年度第2四半期(上半期)末、平成27年度末とも保有していません。

④ 債券関連

平成28年度第2四半期(上半期)末、平成27年度末とも保有していません。

2. 個人変額年金保険(特別勘定)の状況

個人変額年金保険については、実績はありません。

Ⅲ. 全社計

1. 資産構成

(一般勘定・特別勘定の資産構成)

(単位:百万円)

区 分	平成28年度第2四半期(上半期)末		
	一般勘定	特別勘定	計
現預金・コールローン	185,824	1,244	187,069
金銭の信託	-	-	-
公社債	2,896,128	6,762	2,902,890
株式	236,022	9,696	245,718
外国証券	872,892	9,188	882,081
貸付金	587,325	-	587,325
不動産	403,737	-	403,737
資産計	5,388,930	27,791	5,416,526
うち外貨建資産	837,945	9,236	847,182

2. 有価証券の時価情報(全社計)

(ア) 有価証券の時価情報(全社計)

① 売買目的有価証券の評価損益(全社計)

(単位:百万円)

区 分	平成27年度末		平成28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	27,615	△3,779	25,647	△525

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)(全社計)

(単位:百万円)

区 分	平成27年度末					平成28年度第2四半期(上半期)末				
	帳簿価額	時価	差 損 益			帳簿価額	時価	差 損 益		
			差益	差損				差益	差損	
満期保有目的の債券	410,888	469,869	58,981	58,981	△0	393,232	448,713	55,480	55,488	△7
責任準備金対応債券	2,236,439	2,675,317	438,878	438,878	△0	2,201,690	2,641,368	439,678	443,658	△3,979
子会社・関連会社株式	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他有価証券	1,300,882	1,381,849	80,966	115,534	△34,567	1,325,106	1,398,256	73,149	111,412	△38,262
公社債	442,035	452,393	10,357	11,217	△859	479,201	494,024	14,823	15,593	△770
株式	156,708	221,663	64,954	81,052	△16,097	158,459	218,944	60,484	74,422	△13,937
外国証券	626,439	636,374	9,935	22,842	△12,907	608,936	614,587	5,651	21,039	△15,388
公社債	514,167	529,210	15,043	21,341	△6,298	484,260	496,547	12,287	20,244	△7,957
株式等	112,271	107,164	△5,107	1,501	△6,609	124,675	118,040	△6,635	794	△7,430
その他の証券	75,699	71,417	△4,281	421	△4,702	78,508	70,699	△7,809	357	△8,166
買入金銭債権	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
譲渡性預金	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
合 計	3,948,210	4,527,036	578,826	613,394	△34,567	3,920,029	4,488,338	568,309	610,559	△42,249
公社債	2,886,185	3,353,081	466,896	467,756	△860	2,881,305	3,351,923	470,618	475,368	△4,750
株式	156,708	221,663	64,954	81,052	△16,097	158,459	218,944	60,484	74,422	△13,937
外国証券	787,710	833,766	46,055	58,963	△12,907	765,191	805,439	40,247	55,635	△15,388
公社債	675,438	726,601	51,163	57,461	△6,298	640,515	687,399	46,883	54,840	△7,957
株式等	112,271	107,164	△5,107	1,501	△6,609	124,675	118,040	△6,635	794	△7,430
その他の証券	75,699	71,417	△4,281	421	△4,702	78,508	70,699	△7,809	357	△8,166
買入金銭債権	41,906	47,107	5,200	5,200	△0	36,563	41,331	4,768	4,775	△7
譲渡性預金	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
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27年度末	平成28年度 第2四半期(上半期)末
満期保有目的の債券	-	-
非上場外国債券	-	-
その他	-	-
責任準備金対応債券	-	-
子会社・関連会社株式	5,093	5,093
その他有価証券	118,581	114,036
非上場国内株式(店頭売買株式を除く)	12,024	11,984
非上場外国株式(店頭売買株式を除く)	106,557	102,051
非上場外国債券	-	-
その他	-	-
合 計	123,674	119,129

○満期保有目的の債券

(単位:百万円)

区分	平成27年度末			平成28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	410,864	469,846	58,981	392,578	448,066	55,488
公社債	207,711	225,370	17,659	200,413	216,529	16,116
外国証券	161,270	197,391	36,120	156,255	190,851	34,596
買入金銭債権	41,883	47,083	5,200	35,909	40,684	4,775
その他	-	-	-	-	-	-
時価が貸借対照表計上額を超えないもの	23	23	△0	654	646	△7
公社債	-	-	-	-	-	-
外国証券	-	-	-	-	-	-
買入金銭債権	23	23	△0	654	646	△7
その他	-	-	-	-	-	-

○責任準備金対応債券

(単位:百万円)

区分	平成27年度末			平成28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	2,233,817	2,672,696	438,878	2,100,914	2,544,573	443,658
公社債	2,233,817	2,672,696	438,878	2,100,914	2,544,573	443,658
外国証券	-	-	-	-	-	-
その他	-	-	-	-	-	-
時価が貸借対照表計上額を超えないもの	2,621	2,621	△0	100,775	96,795	△3,979
公社債	2,621	2,621	△0	100,775	96,795	△3,979
外国証券	-	-	-	-	-	-
その他	-	-	-	-	-	-

○その他有価証券

(単位:百万円)

区分	平成27年度末			平成28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	895,727	1,011,261	115,534	901,383	1,012,795	111,412
公社債	379,908	391,126	11,217	440,580	456,174	15,593
株式	89,298	170,351	81,052	87,964	162,386	74,422
外国証券	413,991	436,834	22,842	360,093	381,133	21,039
その他の証券	12,527	12,948	421	12,744	13,101	357
買入金銭債権	-	-	-	-	-	-
譲渡性預金	-	-	-	-	-	-
その他	-	-	-	-	-	-
貸借対照表計上額が帳簿価額を超えないもの	405,155	370,588	△34,567	423,723	385,460	△38,262
公社債	62,126	61,266	△859	38,620	37,850	△770
株式	67,409	51,312	△16,097	70,495	56,557	△13,937
外国証券	212,447	199,540	△12,907	248,842	233,454	△15,388
その他の証券	63,171	58,468	△4,702	65,764	57,598	△8,166
買入金銭債権	-	-	-	-	-	-
譲渡性預金	-	-	-	-	-	-
その他	-	-	-	-	-	-

(イ)デリバティブ取引の運用状況(全社計)

(1)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通りです。

- ・金利関連：金利スワップ取引等
- ・通貨関連：為替予約取引、通貨オプション取引等
- ・株式関連：株価指数先物取引、株価指数オプション取引、個別株オプション取引等
- ・債券関連：債券先物取引、債券オプション取引等

(2)取組方針

当社では、保有する現物資産が持つ市場リスク(金利・為替・株価等の変動によるリスク)を回避(ヘッジ)することを主目的に、デリバティブ取引を活用しています。なお、ヘッジ会計の適用要件を満たすデリバティブ取引については、ヘッジ会計を適用しています。

(3)利用目的

当社がデリバティブ取引を利用する主な目的は以下の通りです。

- ・金利関連のデリバティブ取引：現物資産の金利変動リスクを回避すること。
- ・通貨関連のデリバティブ取引：現物資産の為替変動リスクを回避すること。
- ・株式関連および債券関連のデリバティブ取引：現物資産の価格変動リスクを回避すること。

(4)リスクの内容

当社が利用対象としているデリバティブ取引は、保有する現物資産の市場リスク(株式関連・為替関連等)を回避することを主目的としているため、デリバティブ取引の持つ市場リスクは減殺され、限定的であると認識しています。

また、取引形態は、取引所を通じた取引あるいは信用度が高いと判断される取引先を相手とした店頭取引を行っており、取引先の倒産等により契約が履行されないリスクは小さいと認識しています。

(5)リスク管理体制

当社では、デリバティブ取引の目的や種類毎に取引限度額等を規定するとともに、独立したリスク管理統括部のチェックを通じて投融资執行部への牽制が働く体制をとっています。デリバティブ取引に係るリスクにつきましては、現物資産に係るリスクと併せて管理の徹底を図っています。リスク管理統括部においては、全てのデリバティブ取引についてのポジションおよび損益の管理を実施するとともに、運用ルールの遵守状況についてのチェックや、把握・分析したリスク量の経営層への報告等を通じて、厳正なリスク管理を行っています。

(6)定量的情報に関する補足説明

①差損益に関する補足説明

当社ではデリバティブ取引を、主として保有する現物資産の市場リスクを回避(ヘッジ)することを目的に利用していることから、デリバティブ取引自体の損益に加えて、ヘッジ対象である現物資産等の状況を勘案することにより、損益の状況が的確に把握できます。

②時価算定に関する補足説明

- ・株価指数オプション取引等

取引先金融機関から提示された価格等を使用しています。

- ・為替予約取引

期末日の TTM 等に基づき当社で算出した理論価格を使用しています。

(ウ)デリバティブ取引の時価情報(全社計)

(1) 差損益の内訳 (ヘッジ会計適用分・非適用分の内訳) (全社計)

(単位:百万円)

平成27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	-	-	2,647	-	-	-	2,647
ヘッジ会計非適用分	-	-	1,102	△55	-	-	1,046
合計	-	-	3,750	△55	-	-	3,694

(注) 平成27年度についてヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ適用分の差損益(通貨関連2,647百万円)およびヘッジ会計非適用分の差損益は、損益計算書に計上されています。

(単位:百万円)

平成28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	-	-	6,581	-	-	-	6,581
ヘッジ会計非適用分	-	-	524	△46	-	-	477
合計	-	-	7,106	△46	-	-	7,059

(注) 平成28年度第2四半期(上半期)についてヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ適用分の差損益(通貨関連6,581百万円)およびヘッジ会計非適用分の差損益は、損益計算書に計上されています。

(2) ヘッジ会計が適用されていないもの

①金利関連(全社計)

平成28年度第2四半期(上半期)末、平成27年度末とも保有していません。

②通貨関連(全社計)

(単位:百万円)

区分	種類	平成27年度末				平成28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	通貨先渡契約								
	売建	-	-	-	-	-	-	-	-
	買建	-	-	-	-	-	-	-	-
	為替予約								
	売建	55,318	-	1,077	1,077	54,132	-	547	547
	うち米ドル	55,303	-	1,077	1,077	54,040	-	547	547
	うち豪ドル	14	-	△0	△0	13	-	0	0
	うち加ドル	-	-	-	-	79	-	0	0
	うちユーロ	-	-	-	-	-	-	-	-
	買建	7,224	-	24	24	11,213	-	△23	△23
	うち米ドル	7,224	-	24	24	11,213	-	△23	△23
	うち豪ドル	-	-	-	-	-	-	-	-
	うち加ドル	-	-	-	-	-	-	-	-
	うちユーロ	-	-	-	-	-	-	-	-
	通貨オプション								
	売建								
	コール	-	-	-	-	-	-	-	-
		(-)	-	-	-	(-)	-	-	-
	プット	-	-	-	-	-	-	-	-
		(-)	-	-	-	(-)	-	-	-
	買建	-	-	-	-	-	-	-	-
	コール	-	-	-	-	-	-	-	-
		(-)	-	-	-	(-)	-	-	-
プット	-	-	-	-	-	-	-	-	
	(-)	-	-	-	(-)	-	-	-	
通貨スワップ	-	-	-	-	-	-	-	-	
その他									
売建	-	-	-	-	-	-	-	-	
	(-)	-	-	-	(-)	-	-	-	
買建	-	-	-	-	-	-	-	-	
	(-)	-	-	-	(-)	-	-	-	
合計					1,102			524	

(注) ・時価の算定には、期末日のTTM、WMロイターレート、割引レート等を基準として、当社で算出した理論価格を使用しています。

・為替予約の時価欄には差損益を記載しています。

③株式関連（全社計）

（単位：百万円）

区分	種類	平成27年度末				平成28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	先渡契約	-	-	-	-	-	-	-	-
	売建	-	-	-	-	-	-	-	-
	買建	-	-	-	-	-	-	-	-
	オプション								
	売建	-	-	-	-	-	-	-	-
	コール	(-)	-	-	-	(-)	-	-	-
	プット	-	-	-	-	-	-	-	-
	買建	(-)	-	-	-	(-)	-	-	-
	コール	-	-	-	-	-	-	-	-
	プット	49,997	-	-	-	50,000	-	-	-
	合計	(55)	-	0	△55	(46)	-	0	△46
その他									
売建	-	-	-	-	-	-	-	-	
買建	(-)	-	-	-	(-)	-	-	-	
合計	(-)	-	-	-	(-)	-	-	-	
合計				△55				△46	

（注）括弧内には、オプション料を記載しています。

④債券関連（全社計）

平成28年度第2四半期（上半期）末、平成27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

①金利関連（全社計）

平成28年度第2四半期(上半期)末、平成27年度末とも保有していません。

②通貨関連（全社計）

(単位:百万円)

ヘッジ会計の方法	種類	平成27年度末				平成28年度第2四半期(上半期)末			
		主なヘッジ対象	契約額等		時価	主なヘッジ対象	契約額等		時価
				うち1年超				うち1年超	
時価ヘッジ	通貨先渡契約								
	売建		-	-	-		-	-	-
	買建		-	-	-		-	-	-
	為替予約								
	売建	外貨建債券	642,676	-	2,647	外貨建債券	750,429	-	6,581
	うち米ドル		522,887	-	4,758		616,212	-	5,264
	うち豪ドル		15,613	-	△510		15,101	-	49
	うち加ドル		-	-	-		34,246	-	799
	うちユーロ		104,174	-	△1,600		84,869	-	468
	買建		-	-	-		-	-	-
	うち米ドル		-	-	-		-	-	-
	うち豪ドル		-	-	-		-	-	-
	うち加ドル		-	-	-		-	-	-
	うちユーロ		-	-	-		-	-	-
	通貨オプション								
	売建		-	-	-		-	-	-
	コール		(-)	-	-		(-)	-	-
	プット		(-)	-	-		(-)	-	-
	買建		(-)	-	-		(-)	-	-
	コール		-	-	-		-	-	-
プット		(-)	-	-		(-)	-	-	
通貨スワップ		-	-	-		-	-	-	
その他		-	-	-		-	-	-	
売建		-	-	-		-	-	-	
買建		(-)	-	-		(-)	-	-	
		-	-	-		-	-	-	
		(-)	-	-		(-)	-	-	
合計				2,647				6,581	

(注)・時価の算定には、期末日のTTM、WMロイターレート、割引レート等を基準として、当社で算出した理論価格を使用しています。

・為替予約の時価欄には差損益を記載しています。

③株式関連（全社計）

平成28年度第2四半期(上半期)末、平成27年度末とも保有していません。

④債券関連（全社計）

平成28年度第2四半期(上半期)末、平成27年度末とも保有していません。

IV. 貸倒引当金残高の内訳

(単位:百万円)

区 分	平成27年度末	平成28年度 第2四半期(上半期)末	比 較
貸 倒 引 当 金	578	520	△ 58
一 般 貸 倒 引 当 金	18	17	△ 1
個 別 貸 倒 引 当 金	560	502	△ 57
特定海外債権引当勘定	-	-	-

V. 個人保険および個人年金保険の責任準備金の積立状況

区 分		平成27年度 第2四半期(上半期)末	平成28年度 第2四半期(上半期)末	平成27年度末
積立方式	標準責任準備金 対象契約	平成8年大蔵省告示 第48号に定める方式	同 左	同 左
	標準責任準備金 対象外契約	平準純保険料式	同 左	同 左
	積立率 (危険準備金を除く)	100.0%	100.0%	100.0%

- (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おります。
 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、上記には含んでおりません。
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おります。