

平成28年度第2四半期(上半期)報告 <補足資料>

<目次>

1. 会社計

(1) 有価証券(会社計)

- | | |
|-----------------|------|
| ① 売買目的有価証券の評価損益 | … 1頁 |
| ② 有価証券の時価情報 | … 1頁 |
| ③ 金銭の信託の時価情報 | … 2頁 |
| ④ デリバティブ取引の時価情報 | … 3頁 |

2. 一般勘定

(1) 有価証券関係

- | | |
|-----------------|------|
| ① 有価証券明細表 | … 5頁 |
| ② 有価証券残存期間別残高 | … 5頁 |
| ③ 業種別株式保有明細 | … 6頁 |
| ④ デリバティブ取引の時価情報 | … 7頁 |

(2) 貸付金関係

- | | |
|----------|------|
| ① 貸付金明細表 | … 8頁 |
|----------|------|

(3) 海外投融資関係

- | | |
|---------------|-------|
| ① 資産別明細表 | … 9頁 |
| ② 外貨建資産の通貨別構成 | … 9頁 |
| ③ 海外投融資の地域別構成 | … 10頁 |

3. 個人変額保険・個人変額年金保険特別勘定に関する時価情報

- | | |
|-------------------|-------|
| (1) 売買目的有価証券の評価損益 | … 11頁 |
| (2) 有価証券明細表 | … 11頁 |
| (3) 金銭の信託の時価情報 | … 11頁 |
| (4) デリバティブ取引の時価情報 | … 11頁 |

以上

1. 会社計

(1) 有価証券(会社計)

① 売買目的有価証券の評価損益(会社計)

(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	796,241	△ 75,945	797,452	△ 46,401

(注) 本表には、金銭の信託等の売買目的有価証券を含んでいます。

② 有価証券の時価情報(会社計)

a. 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				
	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	5,383,938	7,410,168	2,026,230	2,026,230	—	5,709,389	7,877,713	2,168,323	2,177,719	9,395
責任準備金対応債券	251,260	292,566	41,305	41,306	0	270,359	316,701	46,342	46,977	634
子会社・関連会社株式	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
その他の有価証券	887,973	1,091,602	203,629	203,739	109	878,153	1,075,733	197,580	198,142	562
公 社 債	854,339	1,040,351	186,011	186,011	—	853,472	1,040,029	186,557	186,557	—
株 式	13,625	25,664	12,039	12,049	10	13,625	24,582	10,956	11,020	63
外 国 証 券	19,842	25,279	5,436	5,536	99	10,889	10,821	△ 68	430	498
公 社 債	19,842	25,279	5,436	5,536	99	10,889	10,821	△ 68	430	498
株 式 等	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
そ の 他 の 証 券	165	307	142	142	—	165	299	134	134	—
買 入 金 銭 債 権	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
譲 渡 性 預 金	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
そ の 他	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
合 計	6,523,172	8,794,337	2,271,165	2,271,276	110	6,857,901	9,270,148	2,412,246	2,422,838	10,592
公 社 債	6,444,682	8,689,521	2,244,838	2,244,838	0	6,679,978	9,068,698	2,388,719	2,397,778	9,058
株 式	13,625	25,664	12,039	12,049	10	13,625	24,582	10,956	11,020	63
外 国 証 券	64,698	78,844	14,146	14,245	99	164,131	176,567	12,436	13,906	1,469
公 社 債	64,698	78,844	14,146	14,245	99	164,131	176,567	12,436	13,906	1,469
株 式 等	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
そ の 他 の 証 券	165	307	142	142	—	165	299	134	134	—
買 入 金 銭 債 権	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
譲 渡 性 預 金	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
そ の 他	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

(注) 1. 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。

2. 金銭の信託のうち売買目的有価証券以外のものを含み、その帳簿価額、差損益は、それぞれ、232,361百万円、47,610百万円です。

b. 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	13,267	14,017
その他の有価証券	12,301	11,090
非上場国内株式(店頭売買株式を除く)	149	159
非上場外国株式(店頭売買株式を除く)	439	694
非 上 場 外 国 債 券	—	—
そ の 他	11,712	10,236
合 計	25,569	25,108

c. 前項bについて為替等を評価し、前項aと合算した有価証券の時価情報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				
	帳簿価額	時価	差損益	差益		帳簿価額	時価	差損益	差益	
				差益	差損				差益	差損
満期保有目的の債券	5,383,938	7,410,168	2,026,230	2,026,230	—	5,709,389	7,877,713	2,168,323	2,177,719	9,395
責任準備金対応債券	251,260	292,566	41,305	41,306	0	270,359	316,701	46,342	46,977	634
子会社・関連会社株式	13,267	13,267	—	—	—	14,017	14,017	—	—	—
その他の有価証券	900,274	1,109,405	209,130	209,792	661	889,243	1,089,777	200,533	201,688	1,153
公 社 債	854,339	1,040,351	186,011	186,011	—	853,472	1,040,029	186,557	186,557	—
株 式	13,775	25,814	12,039	12,049	10	13,785	24,742	10,956	11,020	63
外国証券	20,281	27,271	6,989	7,089	99	11,584	12,440	856	1,354	498
公 社 債	19,842	25,279	5,436	5,536	99	10,889	10,821	△ 68	430	498
株 式 等	439	1,992	1,552	1,552	—	694	1,618	924	924	—
その他の証券	11,877	15,967	4,090	4,641	551	10,401	12,564	2,162	2,756	593
買入金銭債権	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
譲渡性預金	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
その他	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
合 計	6,548,741	8,825,407	2,276,666	2,277,328	662	6,883,009	9,298,209	2,415,199	2,426,385	11,185
公 社 債	6,444,682	8,689,521	2,244,838	2,244,838	0	6,679,978	9,068,698	2,388,719	2,397,778	9,058
株 式	20,343	32,382	12,039	12,049	10	21,103	32,060	10,956	11,020	63
外国証券	71,837	87,536	15,699	15,798	99	171,525	184,886	13,360	14,830	1,469
公 社 債	64,698	78,844	14,146	14,245	99	164,131	176,567	12,436	13,906	1,469
株 式 等	7,139	8,692	1,552	1,552	—	7,394	8,318	924	924	—
その他の証券	11,877	15,967	4,090	4,641	551	10,401	12,564	2,162	2,756	593
買入金銭債権	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
譲渡性預金	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
その他	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

③金銭の信託の時価情報(会社計)

(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	時価	差損益	差益		貸借対照表計上額	時価	差損益	差益	
				差益	差損				差益	差損
金 銭 の 信 託	280,973	280,973	—	—	—	279,527	279,527	—	—	—

(注) 本表には、合同運用の金銭信託50百万円を含んでいます。

■運用目的の金銭の信託

(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
運用目的の金銭の信託	—	—	—	—

■満期保有目的、責任準備金対応、その他の金銭の信託

(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	差益		帳簿価額	時価	差損益	差益	
				差益	差損				差益	差損
満期保有目的の金銭の信託	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
責任準備金対応の金銭の信託	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
その他の金銭の信託	232,491	280,922	48,431	48,431	—	231,866	279,476	47,610	47,610	—

(注) 金銭の信託には、金銭の信託内で有している現預金及びコールローン等を含んでいます。

④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

- 当社が利用対象としているデリバティブ取引は次の取引です。
- ・金利関連:金利スワップ取引
 - ・通貨関連:為替予約取引
 - ・株式関連:株価指数先物取引

(2) 利用目的及び取引方針

- 当社が利用しているデリバティブ取引は以下の通り、保有資産及び負債の市場リスクを低減させる目的で行っており、投機的なデリバティブ取引は行わない方針です。
- ・金利関連取引:保有資産及び負債の金利リスクをヘッジする目的で行っています。
 - ・通貨関連取引:保有資産及び個人変額保険の最低保証に係る為替リスクをヘッジする目的で行っています。
 - ・株式関連取引:保有資産及び個人変額保険の最低保証に係る株式リスクをヘッジする目的で行っています。

(3) 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市場リスク(金利リスク、為替リスク、株式リスク)がありますが、保有資産及び負債のリスクの低減を主目的として利用しているため、デリバティブ取引と対象となる資産及び負債のリスクは減殺され限定的と認識しています。
- 当社が利用しているデリバティブ取引は、当該取引に係る契約不履行の可能性が小さいと見込まれる相手先を選定しているため、信用リスクは限定的と認識しています。

(4) リスク管理体制

- 当社が利用しているデリバティブ取引は、社内で決裁された限度額の範囲内で取引しています。
- 運用部門が行った取引の相手先からの報告書は、管理部門が直接受領して運用部門からの報告と照合し、管理部門は運用部門と独立してデリバティブ取引のポジション及び損益を把握できる体制をとっています。また、デリバティブ取引に関するリスク管理は、担当所管において厳格に行うとともに、全体のリスク状況については、リスク管理部門を通じ、取締役会及び経営会議において定期的に報告しています。

(5) 定量的情報に関する補足説明

- 当社が利用しているデリバティブ取引に、ヘッジ会計は適用していません。

■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)

		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		—	—	—	—	—	—
ヘッジ会計非適用分		422	737	△ 230	—	—	929
合計		422	737	△ 230	—	—	929

		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		—	—	—	—	—	—
ヘッジ会計非適用分		512	826	1,294	—	—	2,633
合計		512	826	1,294	—	—	2,633

(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。

(2) ヘッジ会計が適用されていないもの

(a) 金利関連

(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	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	金利スワップ								
	固定金利受取/変動金利支払	1,000	1,000	422	422	1,000	1,000	512	512
	合計				422				512

(注) 差損益欄には、時価を記載しています。

(参考) 金利スワップ残存期間別残高

(単位:百万円、%)

		平成27年度末						
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	合計
固定受取/変動支払スワップ想定元本		—	—	—	—	—	1,000	1,000
	平均受取固定金利	—	—	—	—	—	1.89	1.89
	平均支払変動金利	—	—	—	—	—	0.12	0.12
	合計	—	—	—	—	—	1,000	1,000

		平成28年度第2四半期(上半期)末						
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	合計
固定受取/変動支払スワップ想定元本		—	—	—	—	—	1,000	1,000
	平均受取固定金利	—	—	—	—	—	1.89	1.89
	平均支払変動金利	—	—	—	—	—	△ 0.00	△ 0.00
	合計	—	—	—	—	—	1,000	1,000

(b) 通貨関連

(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	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	50,035	—	737	737	153,275	—	826	826
	(米ドル)	31,792	—	714	714	128,765	—	1,203	1,203
	(ユーロ)	15,387	—	25	25	24,510	—	△ 376	△ 376
	(オーストラリアドル)	2,855	—	△ 2	△ 2	—	—	—	—
	合 計				737			826	

(注) 1. 為替予約の為替相場は、先物相場を使用しています。
2. 差損益欄には、時価を記載しています。

(c) 株式関連

(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	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								
	売建	72,793	—	△ 230	△ 230	107,273	—	1,294	1,294
	合 計				△ 230			1,294	

(注) 差損益欄には、時価を記載しています。

(d) 債券関連

該当ありません。

(e) その他

該当ありません。

(3) ヘッジ会計が適用されているもの

(a) 金利関連

該当ありません。

(b) 通貨関連

該当ありません。

(c) 株式関連

該当ありません。

(d) 債券関連

該当ありません。

(e) その他

該当ありません。

2. 一般勘定

(1) 有価証券関係(一般勘定)

① 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	6,233,852	96.2	6,342,979	93.2
地 方 債	—	—	—	—
社 債	117,324	1.8	243,585	3.6
うち公社・公団債	113,424	1.8	206,743	3.0
株 式	33,364	0.5	33,078	0.5
外 国 証 券	93,140	1.4	183,373	2.7
公 社 債	70,134	1.1	164,063	2.4
株 式 等	23,005	0.4	19,310	0.3
そ の 他 の 証 券	1,654	0.0	1,573	0.0
合 計	6,479,336	100.0	6,804,589	100.0

② 有価証券残存期間別残高(一般勘定)

(単位:百万円)

平成27年度末							
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
国 債	—	13,243	—	16,630	320,234	5,883,743	6,233,852
地 方 債	—	—	—	—	—	—	—
社 債	20,282	571	—	—	1,631	94,838	117,324
株 式	—	—	—	—	—	33,364	33,364
外 国 証 券	4,054	8,824	16,746	3,848	565	59,100	93,140
公 社 債	—	1,822	13,615	2,296	—	52,400	70,134
株 式 等	4,054	7,002	3,131	1,552	565	6,700	23,005
そ の 他 の 証 券	—	682	—	664	—	307	1,654
合 計	24,336	23,322	16,746	21,143	322,431	6,071,355	6,479,336
平成28年度第2四半期(上半期)末							
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
国 債	12,442	—	—	24,605	353,192	5,952,738	6,342,979
地 方 債	—	—	—	—	—	—	—
社 債	10,010	—	—	—	1,629	231,945	243,585
株 式	—	—	—	—	—	33,078	33,078
外 国 証 券	3,503	4,913	2,317	1,416	457	170,763	183,373
公 社 債	—	—	—	—	—	164,063	164,063
株 式 等	3,503	4,913	2,317	1,416	457	6,700	19,310
そ の 他 の 証 券	—	550	722	—	—	299	1,573
合 計	25,957	5,464	3,040	26,022	355,280	6,388,824	6,804,589

(注)「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号)に基づく有価証券として取り扱うものを含んでいます。

③業種別株式保有明細(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	—	—	—	—	
鉱業	—	—	—	—	
建設業	1,758	5.3	1,560	4.7	
製 造 業	食品	1,214	3.6	962	2.9
	繊維製品	—	—	—	—
	パルプ・紙	—	—	—	—
	化学	1,143	3.4	1,174	3.5
	医薬品	1,420	4.3	1,411	4.3
	石油・石炭製品	—	—	—	—
	ゴム製品	—	—	—	—
	ガラス・土石製品	107	0.3	115	0.3
	鉄鋼	—	—	—	—
	非鉄金属	—	—	—	—
	金属製品	418	1.3	386	1.2
	機械	1,279	3.8	1,408	4.3
	電気機器	4,229	12.7	4,025	12.2
運輸・情報通信業	輸送用機器	2,394	7.2	2,233	6.8
	精密機器	389	1.2	356	1.1
その他製品	433	1.3	496	1.5	
電気・ガス業	476	1.4	406	1.2	
運輸・情報通信業	陸運業	1,753	5.3	1,543	4.7
	海運業	—	—	—	—
	空運業	—	—	—	—
	倉庫・運輸関連業	—	—	—	—
	情報・通信業	3,042	9.1	3,276	9.9
商業	卸売業	—	—	56	0.2
	小売業	3,057	9.2	3,023	9.1
金融・保険業	銀行業	—	—	—	—
	証券、商品先物取引業	—	—	—	—
	保険業	6,717	20.1	7,477	22.6
	その他金融業	935	2.8	861	2.6
不動産業	—	—	—	—	
サービス業	2,594	7.8	2,301	7.0	
合計	33,364	100.0	33,078	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。

④デリバティブ取引の時価情報(一般勘定)(ヘッジ会計適用分・非適用分の合算値)

(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)

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	—	—	—	—	—	—
ヘッジ会計非適用分	422	737	△ 230	—	—	929
合計	422	737	△ 230	—	—	929
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	—	—	—	—	—	—
ヘッジ会計非適用分	512	826	1,294	—	—	2,633
合計	512	826	1,294	—	—	2,633

(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。

(2) 金利関連 (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	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	金利スワップ 固定金利受取/変動金利支払	1,000	1,000	422	422	1,000	1,000	512	512
	合計				422				512

(注) 差損益欄には、時価を記載しています。

(参考) 金利スワップ残存期間別残高 (単位:百万円、%)

平成27年度末							
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	合計
固定受取/変動支払スワップ想定元本	—	—	—	—	—	1,000	1,000
平均受取固定金利	—	—	—	—	—	1.89	1.89
平均支払変動金利	—	—	—	—	—	0.12	0.12
合計	—	—	—	—	—	1,000	1,000
平成28年度第2四半期(上半期)末							
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	合計
固定受取/変動支払スワップ想定元本	—	—	—	—	—	1,000	1,000
平均受取固定金利	—	—	—	—	—	1.89	1.89
平均支払変動金利	—	—	—	—	—	△ 0.00	△ 0.00
合計	—	—	—	—	—	1,000	1,000

(3) 通貨関連 (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	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 (米ドル)	50,035	—	737	737	153,275	—	826	826
	(ユーロ)	31,792	—	714	714	128,765	—	1,203	1,203
	(オーストラリアドル)	15,387	—	25	25	24,510	—	△ 376	△ 376
		2,855	—	△ 2	△ 2	—	—	—	—
	合計				737				826

(注) 1. 為替予約の為替相場は、先物相場を使用しています。
2. 差損益欄には、時価を記載しています。

(4) 株式関連 (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	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 売建	72,793	—	△ 230	△ 230	107,273	—	1,294	1,294
	合計				△ 230				1,294

(注) 差損益欄には、時価を記載しています。

(5) 債券関連
該当ありません。

(6) その他
該当ありません。

(2) 貸付金関係(一般勘定)

① 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	171,649	175,951
契 約 者 貸 付	155,413	159,352
保 険 料 振 替 貸 付	16,235	16,598
一 般 貸 付	—	13
そ の 他	—	13
合 計	171,649	175,964

(注)一般貸付の「その他」の内容は従業員貸付です。

(3)海外投融資関係(一般勘定)

①資産別明細表(一般勘定)

■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	70,134	70.6	164,063	85.7
株 式	1,992	2.0	1,618	0.8
現 預 金 ・ そ の 他	19,690	19.8	18,320	9.6
外 貨 建 資 産 計	91,817	92.4	184,002	96.1

■円貨額が確定した外貨建資産

該当ありません。

■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	7,576	7.6	7,402	3.9
円 貨 建 資 産 計	7,576	7.6	7,402	3.9

■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	99,394	100.0	191,404	100.0

②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	82,500	89.9	178,338	96.9
ユ ー ロ	6,151	6.7	5,450	3.0
オーストラリアドル	2,914	3.2	—	—
イギリスポンド	248	0.3	208	0.1
新 台 湾 ド ル	2	0.0	—	—
シンガポールドル	—	—	4	0.0
外 貨 建 資 産 計	91,817	100.0	184,002	100.0

③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		公社債		株式等		非居住者貸付	
	金額	占率	金額	占率	金額	占率	金額	占率
北 米	72,644	78.0	67,242	95.9	5,402	23.5	—	—
ヨーロッパ	4,428	4.8	—	—	4,428	19.2	—	—
オセアニア	2,892	3.1	2,892	4.1	—	—	—	—
ア ジ ア	—	—	—	—	—	—	—	—
中 南 米	13,175	14.1	—	—	13,175	57.3	—	—
中 東	—	—	—	—	—	—	—	—
ア フ リ カ	—	—	—	—	—	—	—	—
国際機関	—	—	—	—	—	—	—	—
合 計	93,140	100.0	70,134	100.0	23,005	100.0	—	—
区分	平成28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	
	金額	占率	金額	占率	金額	占率	金額	占率
北 米	168,195	91.7	164,063	100.0	4,132	21.4	—	—
ヨーロッパ	3,534	1.9	—	—	3,534	18.3	—	—
オセアニア	—	—	—	—	—	—	—	—
ア ジ ア	—	—	—	—	—	—	—	—
中 南 米	11,642	6.3	—	—	11,642	60.3	—	—
中 東	—	—	—	—	—	—	—	—
ア フ リ カ	—	—	—	—	—	—	—	—
国際機関	—	—	—	—	—	—	—	—
合 計	183,373	100.0	164,063	100.0	19,310	100.0	—	—

3. 個人変額保険・個人変額年金保険特別勘定に関する時価情報

当社は、個人変額保険と個人変額年金保険に係る資産は合同運用を行っていますので、合計を記載しています。

(1) 売買目的有価証券の評価損益(特別勘定)

(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	
	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	794,025	△ 76,099	796,433	△ 46,231

(2) 有価証券明細表(特別勘定)

(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
	貸借対照表計上額	貸借対照表計上額
公 社 債	158,244	155,977
株 式	50,046	49,069
外 国 証 券	378,833	381,005
公 社 債	62,504	62,009
株 式 等	316,328	318,995
そ の 他 の 証 券	206,902	210,381
合 計	794,025	796,433

(3) 金銭の信託の時価情報(特別勘定)

該当ありません。

(4) デリバティブ取引の時価情報(特別勘定)(ヘッジ会計適用分・非適用分の合算値)

該当ありません。