

2016年度決算関係補足資料

| | |
|--|-----|
| I. 一般勘定 | |
| 1. 商品有価証券関係 | |
| (1) 商品有価証券明細表 | 2頁 |
| (2) 商品有価証券売買高 | 2頁 |
| 2. 有価証券関係 | |
| (1) 有価証券明細表 | 2頁 |
| (2) 地域別地方債保有内訳 | 2頁 |
| (3) 有価証券残存期間別残高 | 3頁 |
| (4) 業種別国内株式保有明細表 | 4頁 |
| 3. 貸付金関係 | |
| (1) 貸付金明細表 | 5頁 |
| (2) 貸付金残存期間別残高 | 5頁 |
| (3) 貸付金企業規模別内訳 | 5頁 |
| (4) 貸付金業種別内訳 | 6頁 |
| (5) 貸付金地域別内訳 | 7頁 |
| (6) 貸付金担保別内訳 | 7頁 |
| 4. 海外投融資関係 | |
| (1) 資産別明細 | 8頁 |
| (2) 外貨建資産の通貨別構成 | 8頁 |
| (3) 海外投融資の地域別構成 | 9頁 |
| 5. デリバティブ取引の時価情報 | 10頁 |
| II. 特別勘定(個人変額保険・個人変額年金保険) | |
| 1. デリバティブ取引の時価情報(個人変額保険) | 14頁 |
| 2. デリバティブ取引の時価情報(個人変額年金保険) | 15頁 |
| III. 会社計 | |
| 1. 資産構成 | |
| (1) 資産の構成 | 16頁 |
| (2) 資産の増減 | 16頁 |
| 2. 有価証券等の時価情報 | |
| (1) 売買目的有価証券の評価損益 | 17頁 |
| (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) | 17頁 |
| (3) 金銭の信託の時価情報 | 18頁 |
| (4) デリバティブ取引の運用状況 | 19頁 |
| (5) デリバティブ取引の時価情報 | 21頁 |
| IV. 貸倒引当金の明細 | 27頁 |

．一般勘定

1．商品有価証券関係（一般勘定）

（1）商品有価証券明細表（一般勘定）

2015年度末、2016年度末ともに残高がないため、記載していません。

（2）商品有価証券売買高（一般勘定）

2015年度、2016年度ともに売買高がないため、記載していません。

2．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 | 2015年度末 | | 2016年度末 | |
|-------------|------------|-------|------------|-------|
| | 金 額 | 占 率 | 金 額 | 占 率 |
| 国 債 | 14,394,575 | 48.9 | 13,967,855 | 47.1 |
| 地 方 債 | 125,047 | 0.4 | 109,098 | 0.4 |
| 社 債 | 1,853,195 | 6.3 | 1,975,300 | 6.7 |
| うち公社・公団債 | 527,917 | 1.8 | 445,919 | 1.5 |
| 株 式 | 3,353,552 | 11.4 | 3,474,743 | 11.7 |
| 外 国 証 券 | 9,091,602 | 30.9 | 9,512,246 | 32.1 |
| 公 社 債 | 6,907,918 | 23.5 | 8,260,182 | 27.9 |
| 株 式 等 | 2,183,683 | 7.4 | 1,252,063 | 4.2 |
| そ の 他 の 証 券 | 589,444 | 2.0 | 620,006 | 2.1 |
| 合 計 | 29,407,417 | 100.0 | 29,659,250 | 100.0 |

（2）地域別地方債保有内訳（一般勘定）

（単位：百万円）

| 区 分 | 2015年度末 | 2016年度末 |
|-------|---------|---------|
| | 金 額 | 金 額 |
| 北 海 道 | 3,544 | 3,489 |
| 東 北 | - | - |
| 関 東 | 56,065 | 49,298 |
| 中 部 | 25,600 | 22,217 |
| 近 畿 | 16,687 | 16,488 |
| 中 国 | 4,928 | 4,924 |
| 四 国 | - | - |
| 九 州 | 16,214 | 11,081 |
| そ の 他 | 2,005 | 1,598 |
| 合 計 | 125,047 | 109,098 |

（注）上表の「その他」は共同発行市場公募地方債の残高です。

(3) 有価証券残存期間別残高(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 ないものを 含む) | 合 計 |
|-------------|---------|---------|-------------|-------------|-------------|--------------|--------------------------------|------------|
| 2015 年度末 | 有 価 証 券 | 860,955 | 1,477,133 | 1,472,819 | 920,254 | 2,103,598 | 22,572,655 | 29,407,417 |
| | 国 債 | 108,757 | 291,868 | 323,800 | 81,278 | 760,723 | 12,828,146 | 14,394,575 |
| | 地 方 債 | 16,466 | 8,806 | 28,553 | 2,797 | 19,924 | 48,498 | 125,047 |
| | 社 債 | 237,819 | 315,084 | 258,946 | 155,260 | 226,255 | 659,828 | 1,853,195 |
| | 株 式 | - | - | - | - | - | 3,353,552 | 3,353,552 |
| | 外 国 証 券 | 475,072 | 800,229 | 820,076 | 671,911 | 1,036,864 | 5,287,448 | 9,091,602 |
| | 公 社 債 | 467,946 | 796,450 | 818,875 | 664,634 | 1,020,799 | 3,139,212 | 6,907,918 |
| | 株 式 等 | 7,125 | 3,779 | 1,200 | 7,276 | 16,065 | 2,148,235 | 2,183,683 |
| | その他の証券 | 22,839 | 61,144 | 41,442 | 9,006 | 59,829 | 395,181 | 589,444 |
| | 買入金銭債権 | 12,210 | 5,283 | - | - | - | 215,712 | 233,206 |
| | 譲渡性預金 | - | - | - | - | - | - | - |
| そ の 他 | 2,640 | - | - | - | - | 50,166 | 52,806 | |
| 2016 年度末 | 有 価 証 券 | 520,493 | 1,344,770 | 1,352,622 | 1,079,153 | 2,897,918 | 22,464,291 | 29,659,250 |
| | 国 債 | 36,262 | 346,870 | 152,306 | 297,985 | 910,335 | 12,224,094 | 13,967,855 |
| | 地 方 債 | 3,627 | 6,794 | 30,515 | 4,381 | 21,582 | 42,196 | 109,098 |
| | 社 債 | 162,816 | 224,979 | 216,739 | 142,690 | 394,343 | 833,731 | 1,975,300 |
| | 株 式 | - | - | - | - | - | 3,474,743 | 3,474,743 |
| | 外 国 証 券 | 315,351 | 671,420 | 907,718 | 602,022 | 1,514,610 | 5,501,122 | 9,512,246 |
| | 公 社 債 | 311,838 | 666,258 | 906,513 | 583,178 | 1,494,081 | 4,298,312 | 8,260,182 |
| | 株 式 等 | 3,513 | 5,162 | 1,204 | 18,844 | 20,529 | 1,202,809 | 1,252,063 |
| | その他の証券 | 2,434 | 94,704 | 45,342 | 32,074 | 57,046 | 388,403 | 620,006 |
| | 買入金銭債権 | 3,066 | 2,077 | 541 | 2,576 | - | 183,951 | 192,213 |
| | 譲渡性預金 | 49,998 | - | - | - | - | - | 49,998 |
| そ の 他 | - | - | - | - | - | 50,191 | 50,191 | |

(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。

(4) 業種別国内株式保有明細表(一般勘定)

(単位:百万円、%)

| 区 分 | 2015年度末 | | 2016年度 | | |
|-----------------|------------|---------|-----------|---------|------|
| | 金 額 | 占 率 | 金 額 | 占 率 | |
| 水産・農林業 | 219 | 0.0 | 242 | 0.0 | |
| 鉱業 | 200 | 0.0 | 200 | 0.0 | |
| 建設業 | 103,135 | 3.1 | 108,340 | 3.1 | |
| 製 造 業 | 食料品 | 230,778 | 6.9 | 224,692 | 6.5 |
| | 繊維製品 | 27,722 | 0.8 | 31,442 | 0.9 |
| | パルプ・紙 | 2,982 | 0.1 | 3,419 | 0.1 |
| | 化学 | 140,718 | 4.2 | 182,076 | 5.2 |
| | 医薬品 | 74,281 | 2.2 | 55,602 | 1.6 |
| | 石油・石炭製品 | 3,394 | 0.1 | 4,633 | 0.1 |
| | ゴム製品 | 22,770 | 0.7 | 25,804 | 0.7 |
| | ガラス・土石製品 | 97,758 | 2.9 | 119,314 | 3.4 |
| | 鉄鋼 | 53,786 | 1.6 | 62,363 | 1.8 |
| | 非鉄金属 | 13,307 | 0.4 | 17,929 | 0.5 |
| | 金属製品 | 40,101 | 1.2 | 46,294 | 1.3 |
| | 機械 | 156,378 | 4.7 | 204,880 | 5.9 |
| | 電気機器 | 462,475 | 13.8 | 553,055 | 15.9 |
| | 輸送用機器 | 193,517 | 5.8 | 219,540 | 6.3 |
| 精密機器 | 101,576 | 3.0 | 106,092 | 3.1 | |
| その他製品 | 78,639 | 2.3 | 79,704 | 2.3 | |
| 電気・ガス業 | 105,522 | 3.1 | 102,152 | 2.9 | |
| 運 輸 ・ 情 報 通 信 業 | 陸運業 | 336,784 | 10.0 | 319,236 | 9.2 |
| | 海運業 | 44 | 0.0 | 55 | 0.0 |
| | 空運業 | 4,788 | 0.1 | 3,209 | 0.1 |
| | 倉庫・運輸関連業 | 4,274 | 0.1 | 4,642 | 0.1 |
| | 情報・通信業 | 81,682 | 2.4 | 92,337 | 2.7 |
| 商 業 | 卸売業 | 114,824 | 3.4 | 140,751 | 4.1 |
| | 小売業 | 111,611 | 3.3 | 112,405 | 3.2 |
| 金 融 ・ 保 険 業 | 銀行業 | 346,105 | 10.3 | 416,199 | 12.0 |
| | 証券、商品先物取引業 | 7,249 | 0.2 | 5,378 | 0.2 |
| | 保険業 | 238,548 | 7.1 | 21,657 | 0.6 |
| | その他金融業 | 20,894 | 0.6 | 24,712 | 0.7 |
| 不動産業 | 22,100 | 0.7 | 20,947 | 0.6 | |
| サービス業 | 155,374 | 4.6 | 165,429 | 4.8 | |
| 合 計 | 3,353,552 | 100.0 | 3,474,743 | 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。

3. 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 | 2015年度末 | 2016年度末 |
|---------------------|-------------|-------------|
| 保 険 約 款 貸 付 | 405,056 | 381,830 |
| 保 険 料 振 替 貸 付 | 40,085 | 36,279 |
| 契 約 者 貸 付 | 364,970 | 345,551 |
| 一 般 貸 付 | 2,420,995 | 2,276,021 |
| （うち非居住者貸付） | (45,090) | (41,008) |
| 企 業 貸 付 | 2,062,430 | 2,002,079 |
| （うち国内企業向け） | (2,027,640) | (1,963,771) |
| 国・国際機関・政府関係機関貸付 | 17,181 | 8,647 |
| 公 共 団 体 ・ 公 企 業 貸 付 | 340,485 | 264,618 |
| 住 宅 口 ー ン | 861 | 637 |
| 消 費 者 口 ー ン | 36 | 38 |
| そ の 他 | - | - |
| 合 計 | 2,826,052 | 2,657,852 |

（2）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 |
|---------|-------|-------------|-------------|-------------|--------------|-------------------------|-----------|
| 2015年度末 | 変動金利 | 6,525 | 11,949 | 19,583 | 7,500 | 6,834 | 91,750 |
| | 固定金利 | 301,581 | 426,542 | 309,549 | 306,254 | 480,722 | 2,329,244 |
| | 一般貸付計 | 308,107 | 438,492 | 329,133 | 313,754 | 487,556 | 2,420,995 |
| 2016年度末 | 変動金利 | 4,165 | 20,402 | 20,115 | 6,500 | 6,390 | 125,669 |
| | 固定金利 | 269,345 | 347,924 | 338,646 | 370,821 | 407,408 | 2,150,352 |
| | 一般貸付計 | 273,511 | 368,326 | 358,761 | 377,321 | 413,799 | 2,276,021 |

（3）貸付金企業規模別内訳＜国内企業向け＞（一般勘定）

（単位：件、百万円、％）

| 区 分 | 2015年度末 | | 2016年度末 | |
|---------------|---------|-----------|-----------|-------|
| | 貸付先数 | 占 率 | 貸付先数 | 占 率 |
| 大 企 業 | 貸付先数 | 237 | 225 | 67.4 |
| | 金 額 | 1,727,946 | 1,667,247 | 84.9 |
| 中 堅 企 業 | 貸付先数 | 10 | 11 | 3.3 |
| | 金 額 | 13,820 | 12,083 | 0.6 |
| 中 小 企 業 | 貸付先数 | 102 | 98 | 29.3 |
| | 金 額 | 285,873 | 284,440 | 14.5 |
| 国内企業向け 貸付計 | 貸付先数 | 349 | 334 | 100.0 |
| | 金 額 | 2,027,640 | 1,963,771 | 100.0 |

（注）1. 業種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。

| 業 種 | 右の、を除外全業種 | | 小売業、飲食業 | | サービス業 | | 卸売業 | |
|---------|-----------------------------|-------------------|-----------------------------|--------------------|------------------------------|--------------------|-----------------------------|-------------------|
| 大 企 業 | 常用する 従業員 300名超 | 資本金10億円 以上 | 常用する 従業員 50名超 | 資本金10億円 以上 | 常用する 従業員 100名超 | 資本金10億円 以上 | 常用する 従業員 100名超 | 資本金10億円 以上 |
| 中 堅 企 業 | かつ | 資本金3億円超 10億円未満 | かつ | 資本金5千万円超 10億円未満 | かつ | 資本金5千万円超 10億円未満 | 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 常用する従業員300名以下 | | 資本金5千万円以下又は 常用する従業員50名以下 | | 資本金5千万円以下又は 常用する従業員100名以下 | | 資本金1億円以下又は 常用する従業員100名以下 | |

(4) 貸付金業種別内訳 (一般勘定)

(単位: 百万円、%)

| 区 分 | 2015年度末 | | 2016年度末 | |
|-------------------------------|-----------|-------|-----------|-------|
| | 金 額 | 占 率 | 金 額 | 占 率 |
| 製 造 業 | 375,787 | 15.5 | 357,511 | 15.7 |
| 食 料 | 34,747 | 1.4 | 36,782 | 1.6 |
| 織 維 | 4,209 | 0.2 | 2,025 | 0.1 |
| 木 材 ・ 木 製 品 | 500 | 0.0 | 500 | 0.0 |
| パ ル プ ・ 紙 | 29,948 | 1.2 | 19,876 | 0.9 |
| 印 刷 | 15,035 | 0.6 | 13,775 | 0.6 |
| 化 学 | 25,894 | 1.1 | 21,774 | 1.0 |
| 石 油 ・ 石 炭 | 19,942 | 0.8 | 18,070 | 0.8 |
| 窯 業 ・ 土 石 | 29,486 | 1.2 | 29,157 | 1.3 |
| 鉄 鋼 | 69,300 | 2.9 | 82,300 | 3.6 |
| 非 鉄 金 属 | 7,059 | 0.3 | 6,803 | 0.3 |
| 金 属 製 品 | 730 | 0.0 | 611 | 0.0 |
| はん用・生産用・業務用機械 | 46,544 | 1.9 | 36,756 | 1.6 |
| 電 気 機 械 | 73,099 | 3.0 | 72,858 | 3.2 |
| 輸 送 用 機 械 | 14,182 | 0.6 | 11,976 | 0.5 |
| そ の 他 の 製 造 業 | 5,109 | 0.2 | 4,244 | 0.2 |
| 農 業 、 林 業 | - | - | - | - |
| 漁 業 | - | - | - | - |
| 鉱 業 、 採 石 業 、 砂 利 採 取 業 | - | - | - | - |
| 建 設 業 | 10,466 | 0.4 | 10,054 | 0.4 |
| 電 気 ・ ガ ス ・ 熱 供 給 ・ 水 道 業 | 415,564 | 17.2 | 377,353 | 16.6 |
| 情 報 通 信 業 | 49,839 | 2.1 | 55,673 | 2.4 |
| 運 輸 業 、 郵 便 業 | 262,877 | 10.9 | 250,411 | 11.0 |
| 卸 売 業 | 478,206 | 19.8 | 466,615 | 20.5 |
| 小 売 業 | 12,365 | 0.5 | 11,226 | 0.5 |
| 金 融 業 、 保 険 業 | 497,095 | 20.5 | 444,127 | 19.5 |
| 不 動 産 業 | 132,061 | 5.5 | 119,709 | 5.3 |
| 物 品 賃 貸 業 | 104,154 | 4.3 | 107,851 | 4.7 |
| 学 術 研 究 、 専 門 ・ 技 術 サ ー ビ ス 業 | 877 | 0.0 | 954 | 0.0 |
| 宿 泊 業 | 0 | 0.0 | - | - |
| 飲 食 業 | - | - | - | - |
| 生 活 関 連 サ ー ビ ス 業 ・ 娯 楽 業 | 3,235 | 0.1 | 3,163 | 0.1 |
| 教 育 、 学 習 支 援 業 | - | - | - | - |
| 医 療 ・ 福 祉 | 150 | 0.0 | 150 | 0.0 |
| そ の 他 の サ ー ビ ス | 3,460 | 0.1 | 3,100 | 0.1 |
| 地 方 公 共 団 体 | 28,530 | 1.2 | 26,169 | 1.1 |
| 個 人 (住 宅 ・ 消 費 ・ 納 税 資 金 等) | 897 | 0.0 | 675 | 0.0 |
| そ の 他 | 333 | 0.0 | 266 | 0.0 |
| 合 計 | 2,375,904 | 98.1 | 2,235,013 | 98.2 |
| 海 外 向 け | | | | |
| 政 府 等 | 10,300 | 0.4 | 2,700 | 0.1 |
| 金 融 機 関 | 11,544 | 0.5 | 11,544 | 0.5 |
| 商 工 業 等 | 23,246 | 1.0 | 26,763 | 1.2 |
| 合 計 | 45,090 | 1.9 | 41,008 | 1.8 |
| 一 般 貸 付 計 | 2,420,995 | 100.0 | 2,276,021 | 100.0 |

(注) 1. 保険約款貸付は含んでいません。
2. 国内向けの業種区分は日本銀行の「貸出先別貸出金(業種別、設備資金新規貸出)」の業種区分に準拠しています。

(5) 貸付金地域別内訳 (一般勘定)

(単位:百万円、%)

| 区 分 | 2015年度末 | | 2016年度末 | |
|-------|-----------|-------|-----------|-------|
| | 金 額 | 占 率 | 金 額 | 占 率 |
| 北 海 道 | 38,559 | 1.6 | 34,051 | 1.5 |
| 東 北 | 38,206 | 1.6 | 35,662 | 1.6 |
| 関 東 | 1,822,780 | 76.7 | 1,735,914 | 77.7 |
| 中 部 | 176,428 | 7.4 | 160,276 | 7.2 |
| 近 畿 | 166,492 | 7.0 | 146,379 | 6.6 |
| 中 国 | 45,412 | 1.9 | 42,627 | 1.9 |
| 四 国 | 19,766 | 0.8 | 13,648 | 0.6 |
| 九 州 | 67,360 | 2.8 | 65,776 | 2.9 |
| 合 計 | 2,375,007 | 100.0 | 2,234,337 | 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 (一般勘定)

(単位:百万円、%)

| 区 分 | 2015年度末 | | 2016年度末 | |
|---------------|-----------|-------|-----------|-------|
| | 金 額 | 占 率 | 金 額 | 占 率 |
| 担 保 貸 付 | 4,053 | 0.2 | 3,667 | 0.2 |
| 有価証券担保貸付 | 2,254 | 0.1 | 2,338 | 0.1 |
| 不動産・動産・財団担保貸付 | 1,743 | 0.1 | 1,301 | 0.1 |
| 指名債権担保貸付 | 56 | 0.0 | 27 | 0.0 |
| 保 証 貸 付 | 93,774 | 3.9 | 83,113 | 3.7 |
| 信 用 貸 付 | 2,322,269 | 95.9 | 2,188,565 | 96.2 |
| そ の 他 | 897 | 0.0 | 675 | 0.0 |
| 一 般 貸 付 計 | 2,420,995 | 100.0 | 2,276,021 | 100.0 |
| うち劣後特約付貸付 | 258,800 | 10.7 | 302,800 | 13.3 |

(注) 保険約款貸付は含んでいません。

4. 海外投融資関係（一般勘定）

（1）資産別明細（一般勘定）

外貨建資産

（単位：百万円、％）

| 区 分 | 2015年度末 | | 2016年度末 | |
|---------------|-----------|------|-----------|------|
| | 金 額 | 占 率 | 金 額 | 占 率 |
| 公 社 債 | 5,971,800 | 59.6 | 7,503,550 | 72.5 |
| 株 式 | 1,341,231 | 13.4 | 675,410 | 6.5 |
| 現 預 金 ・ そ の 他 | 348,732 | 3.5 | 228,808 | 2.2 |
| 小 計 | 7,661,764 | 76.5 | 8,407,769 | 81.2 |

円貨額が確定した外貨建資産

（単位：百万円、％）

| 区 分 | 2015年度末 | | 2016年度末 | |
|---------------|---------|-----|---------|-----|
| | 金 額 | 占 率 | 金 額 | 占 率 |
| 公 社 債 | - | - | - | - |
| 現 預 金 ・ そ の 他 | 508,712 | 5.1 | 354,058 | 3.4 |
| 小 計 | 508,712 | 5.1 | 354,058 | 3.4 |

円貨建資産

（単位：百万円、％）

| 区 分 | 2015年度末 | | 2016年度末 | |
|-----------------|-----------|------|-----------|------|
| | 金 額 | 占 率 | 金 額 | 占 率 |
| 非 居 住 者 貸 付 | 31,868 | 0.3 | 22,666 | 0.2 |
| 公 社 債（円建外債）・その他 | 1,818,674 | 18.1 | 1,569,179 | 15.2 |
| 小 計 | 1,850,542 | 18.5 | 1,591,846 | 15.4 |

合 計

（単位：百万円、％）

| 区 分 | 2015年度末 | | 2016年度末 | |
|-----------|------------|-------|------------|-------|
| | 金 額 | 占 率 | 金 額 | 占 率 |
| 海 外 投 融 資 | 10,021,019 | 100.0 | 10,353,674 | 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）外貨建資産の通貨別構成（一般勘定）

（単位：百万円、％）

| 区 分 | 2015年度末 | | 2016年度末 | |
|------------|-----------|-------|-----------|-------|
| | 金 額 | 占 率 | 金 額 | 占 率 |
| 米 ド ル | 3,995,166 | 52.1 | 4,673,054 | 55.6 |
| ユ ー ロ | 1,757,767 | 22.9 | 1,721,716 | 20.5 |
| オーストラリアドル | 674,012 | 8.8 | 679,085 | 8.1 |
| イギリスポンド | 315,117 | 4.1 | 254,239 | 3.0 |
| カナダドル | 86,172 | 1.1 | 238,371 | 2.8 |
| メキシコペソ | 250,197 | 3.3 | 217,141 | 2.6 |
| ニュージーランドドル | 150,378 | 2.0 | 200,635 | 2.4 |
| そ の 他 共 計 | 7,661,764 | 100.0 | 8,407,769 | 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 | 外国証券 | | | | | | 非居住者貸付 | | |
|---------|-------|-----------|-------|-----------|-------|-----------|--------|--------|-------|
| | 金額 | | 占率 | | 金額 | | 占率 | | |
| | 金額 | 占率 | 金額 | 占率 | 金額 | 占率 | 金額 | 占率 | |
| 2015年度末 | 北 米 | 3,676,241 | 40.4 | 2,887,566 | 41.8 | 788,675 | 36.1 | 11,715 | 26.0 |
| | ヨーロッパ | 2,538,727 | 27.9 | 2,341,305 | 33.9 | 197,421 | 9.0 | 11,212 | 24.9 |
| | オセアニア | 823,877 | 9.1 | 639,442 | 9.3 | 184,435 | 8.4 | 5,000 | 11.1 |
| | アジア | 265,358 | 2.9 | 109,762 | 1.6 | 155,595 | 7.1 | 1,500 | 3.3 |
| | 中南米 | 1,591,568 | 17.5 | 734,273 | 10.6 | 857,295 | 39.3 | 5,362 | 11.9 |
| | 中 東 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| | アフリカ | 26,074 | 0.3 | 25,813 | 0.4 | 260 | 0.0 | - | - |
| | 国際機関 | 169,754 | 1.9 | 169,754 | 2.5 | - | - | 10,300 | 22.8 |
| | 合 計 | 9,091,602 | 100.0 | 6,907,918 | 100.0 | 2,183,683 | 100.0 | 45,090 | 100.0 |
| 2016年度末 | 北 米 | 4,109,374 | 43.2 | 3,840,644 | 46.5 | 268,729 | 21.5 | 10,263 | 25.0 |
| | ヨーロッパ | 2,665,186 | 28.0 | 2,461,926 | 29.8 | 203,260 | 16.2 | 10,369 | 25.3 |
| | オセアニア | 837,203 | 8.8 | 794,624 | 9.6 | 42,579 | 3.4 | 5,000 | 12.2 |
| | アジア | 216,677 | 2.3 | 109,851 | 1.3 | 106,826 | 8.5 | 1,500 | 3.7 |
| | 中南米 | 1,504,340 | 15.8 | 874,219 | 10.6 | 630,121 | 50.3 | 11,175 | 27.3 |
| | 中 東 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| | アフリカ | 23,089 | 0.2 | 22,543 | 0.3 | 546 | 0.0 | - | - |
| | 国際機関 | 156,373 | 1.6 | 156,373 | 1.9 | - | - | 2,700 | 6.6 |
| | 合 計 | 9,512,246 | 100.0 | 8,260,182 | 100.0 | 1,252,063 | 100.0 | 41,008 | 100.0 |

(注) 地域区分は発行会社及び貸付先企業の国籍等に基づいています。

5. 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）

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 | 2015年度末 | | | | | | 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 | 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 | 3,540 | 107,571 | 194 | 3,276 | - | 100,948 | 23,531 | 136,742 | 1,246 | 717 | - | 159,745 |
| ヘッジ会計非適用分 | 11,407 | 717 | 6,351 | 407 | 529 | 16,919 | 14,517 | 11,690 | 2,678 | 763 | 554 | 27,569 |
| 合 計 | 14,948 | 108,288 | 6,156 | 3,683 | 529 | 84,028 | 38,049 | 148,433 | 1,432 | 46 | 554 | 187,314 |

（注）上表のうち損益計算書に計上されている金額は以下のとおりです。

2015年度末：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108,459百万円、株式関連194百万円）及びヘッジ会計非適用分の差損益（16,919百万円）の合計91,733百万円

2016年度末：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140,284百万円、株式関連1,246百万円）及びヘッジ会計非適用分の差損益（27,569百万円）の合計166,608百万円

時価情報

（a）金利関連

（単位：百万円）

| 区 分 | 種 類 | 2015年度末 | | | | | 2016年度末 | | | | |
|-----------------|-----------------------|-----------------------|--------------------|--------|-------|-----------------------|---------------------|----------|--------|--------|----------------|
| | | 契約額等 | | 時価 | 差損益 | うちヘッジ 会計適用分 | 契約額等 | | 時価 | 差損益 | うちヘッジ 会計適用分 |
| | | | うち1年超 | | | | | うち1年超 | | | |
| 店 頭 | 金利スワップ | | | | | | | | | | |
| | 固定金利受取 / 変動金利支払 | 323,940 | 319,940 | 362 | 362 | 482 | 622,970 | 619,800 | 20,368 | 20,368 | 20,369 |
| | 固定金利支払 / 変動金利受取 | 285,200 | 285,200 | 4,255 | 4,255 | 4,022 | 327,100 | 327,100 | 3,090 | 3,090 | 3,161 |
| | 金利スワップション | | | | | | | | | | |
| | 売建 | | | | | | | | | | |
| | 固定金利支払 / 変動金利受取 | 350,000 (1,672) | 350,000 (1,672) | 983 | 689 | - | 350,000 (1,672) | - (-) | 67 | 1,604 | - |
| | 買建 | | | | | | | | | | |
| | 固定金利受取 / 変動金利支払 | 100,000 (2,457) | - (-) | 2,760 | 303 | - | - (-) | - (-) | - | - | - |
| 固定金利支払 / 変動金利受取 | 1,150,000 (18,570) | 1,070,000 (17,647) | 6,521 | 12,048 | - | 1,150,000 (18,214) | 855,000 (14,947) | 2,019 | 16,194 | - | |
| 合 計 | | | | 14,948 | 3,540 | | | | 38,049 | 23,531 | |

（注）1. 括弧内には、貸借対照表に計上したオプション料を記載しています。

2. 差損益欄には、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。

（参考）金利スワップ残存期間別残高

（単位：百万円、%）

| 区分 | 1年以下 | 1年超 | 3年超 | 5年超 | 7年超 | 10年超 | 合計 | |
|---------|---------------|--------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| | | 3年以下 | 5年以下 | 7年以下 | 10年以下 | | | |
| 2015年度末 | 受取側固定スワップ想定元本 | 4,000 | 4,840 | 3,000 | 9,800 | 2,300 | 323,940 | |
| | 平均受取固定金利 | 1.85 | 1.20 | 0.46 | 0.66 | 1.19 | 0.55 | |
| | 平均支払変動金利 | 0.12 | 0.08 | 0.00 | 0.05 | 0.10 | 0.02 | |
| | 支払側固定スワップ想定元本 | - | - | 139,000 | 144,000 | - | 2,200 | 285,200 |
| | 平均支払固定金利 | - | - | 0.28 | 0.42 | - | 1.08 | 0.36 |
| | 平均受取変動金利 | - | - | 0.26 | 0.26 | - | 0.02 | 0.26 |
| 合 計 | 4,000 | 4,840 | 142,000 | 153,800 | 2,300 | 302,200 | 609,140 | |
| 2016年度末 | 受取側固定スワップ想定元本 | 3,170 | 4,500 | 7,000 | 6,000 | 2,300 | 600,000 | 622,970 |
| | 平均受取固定金利 | 1.60 | 0.00 | 0.17 | 0.02 | 1.19 | 0.43 | 0.43 |
| | 平均支払変動金利 | 0.02 | 0.00 | 0.02 | 0.03 | 0.06 | 0.02 | 0.02 |
| | 支払側固定スワップ想定元本 | - | 43,000 | 139,000 | 144,000 | - | 1,100 | 327,100 |
| | 平均支払固定金利 | - | 0.13 | 0.28 | 0.42 | - | 1.08 | 0.29 |
| | 平均受取変動金利 | - | 0.01 | 0.11 | 0.11 | - | 0.03 | 0.09 |
| 合 計 | 3,170 | 47,500 | 146,000 | 150,000 | 2,300 | 601,100 | 950,070 | |

(b) 通貨関連

(単位: 百万円)

| 区分 | 種類 | 2015年度末 | | | | 2016年度末 | | | |
|-------------|-------------|-----------|---------|---------|----------------|-----------|---------|---------|----------------|
| | | 契約額等 | 時価 | 差損益 | うちヘッジ会計 適用分 | 契約額等 | 時価 | 差損益 | うちヘッジ会計 適用分 |
| | | | | | | | | | |
| 店 頭 | 為替予約 | | | | | | | | |
| | 売建 | 4,839,772 | 117,775 | 117,775 | 108,567 | 6,134,678 | 153,971 | 153,971 | 140,242 |
| | (米ドル) | 2,263,196 | 65,670 | 65,670 | 54,939 | 3,335,288 | 87,935 | 87,935 | 81,896 |
| | (ユーロ) | 1,307,528 | 48,273 | 48,273 | 43,872 | 1,363,112 | 12,369 | 12,369 | 8,294 |
| | (オーストラリアドル) | 436,096 | 14,847 | 14,847 | 10,043 | 489,617 | 25,774 | 25,774 | 22,627 |
| | (カナダドル) | 51,214 | 1,026 | 1,026 | 1,015 | 172,040 | 8,999 | 8,999 | 8,876 |
| | (イギリスポンド) | 236,075 | 9,067 | 9,067 | 8,654 | 147,752 | 1,065 | 1,065 | 1,271 |
| | (その他) | 545,660 | 10,637 | 10,637 | 12,160 | 626,867 | 17,827 | 17,827 | 17,274 |
| | 買建 | 824,982 | 6,074 | 6,074 | 108 | 1,025,693 | 5,957 | 5,957 | 42 |
| | (米ドル) | 435,498 | 10,225 | 10,225 | 114 | 594,554 | 3,978 | 3,978 | 157 |
| | (ユーロ) | 117,199 | 949 | 949 | 4 | 332,726 | 563 | 563 | 43 |
| | (オーストラリアドル) | 85,866 | 2,950 | 2,950 | 0 | 16,947 | 524 | 524 | 0 |
| | (カナダドル) | 27,318 | 0 | 0 | - | 16,164 | 153 | 153 | - |
| | (イギリスポンド) | 62,940 | 4 | 4 | 17 | 6,956 | 23 | 23 | 1 |
| | (その他) | 96,160 | 246 | 246 | 27 | 58,344 | 2,195 | 2,195 | 159 |
| | 通貨オプション | | | | | | | | |
| | 売建 | | | | | | | | |
| | コール | - | - | - | - | 93,491 | - | 690 | - |
| | (米ドル) | (-) | - | - | - | (690) | - | 690 | - |
| | 買建 | | | | | | | | |
| | コール | 57,179 | - | - | - | - | - | - | - |
| | (ユーロ) | (722) | 0 | 722 | - | (-) | - | - | - |
| | プット | 57,179 | - | - | - | - | - | - | - |
| | (米ドル) | (722) | 0 | 722 | - | (-) | - | - | - |
| | (ユーロ) | 241,613 | - | - | - | 521,866 | - | - | - |
| | (米ドル) | (5,242) | 3,440 | 1,801 | - | (7,321) | 2,668 | 4,652 | - |
| | (ユーロ) | 219,498 | 3,435 | 1,217 | - | (6,656) | 2,445 | 4,210 | - |
| (オーストラリアドル) | (-) | - | - | - | 108,899 | 223 | 441 | - | |
| (その他) | 22,115 | 4 | 584 | - | (664) | - | - | - | |
| 通貨スワップ | 205,817 | 887 | 887 | 887 | 266,142 | 3,541 | 3,541 | 3,541 | |
| (米ドル) | 155,920 | 2,941 | 2,941 | 2,941 | 204,574 | 953 | 953 | 953 | |
| (ユーロ) | 49,897 | 2,053 | 2,053 | 2,053 | 61,568 | 4,494 | 4,494 | 4,494 | |
| 合 計 | | | 108,288 | 107,571 | | | 148,433 | 136,742 | |

(注) 1. 括弧内には、貸借対照表に計上したオプション料を記載しています。

2. 年度末の為替相場は先物相場を使用しています。

3. 為替予約等により決済時における円貨額が確定しており、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係る当該為替予約等は、開示の対象より除いています。

4. 差損益欄には、為替予約及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。

5. 上表において、残存期間1年超の取引はありません(通貨スワップ取引除く)。

(c) 株式関連

(単位:百万円)

| 区分 | 種類 | 2015年度末 | | | | 2016年度末 | | | |
|-----|-------------------|-------------------|-----|-------|----------------|-------------------|-------|-------|----------------|
| | | 契約額等 | 時価 | 差損益 | うちヘッジ会計 適用分 | 契約額等 | 時価 | 差損益 | うちヘッジ会計 適用分 |
| | | | | | | | | | |
| 取引所 | 円建株価指数先物 | | | | | | | | |
| | 売建 | 9,780 | 8 | 8 | - | - | - | - | - |
| | 買建 | - | - | - | - | 15,387 | 158 | 158 | - |
| | 外貨建株価指数先物 | | | | | | | | |
| | 売建 | - | - | - | - | 5,942 | 217 | 217 | - |
| | 買建 | - | - | - | - | 10,935 | 49 | 49 | - |
| | 円建株価指数オプション | | | | | | | | |
| | 売建 | | | | | | | | |
| | コール | 59,972 (144) | 2 | 141 | - | - (-) | - | - | - |
| | 買建 | | | | | | | | |
| | プット | 99,990 (6,366) | 53 | 6,312 | - | 80,000 (2,362) | 10 | 2,352 | - |
| | 外貨建株価指数オプション | | | | | | | | |
| 売建 | | | | | | | | | |
| コール | 31,954 (886) | 135 | 751 | - | - (-) | - | - | - | |
| 買建 | | | | | | | | | |
| コール | 9,583 (48) | 0 | 47 | - | - (-) | - | - | - | |
| プット | 31,956 (1,363) | 583 | 779 | - | - (-) | - | - | - | |
| 店頭 | 国内株式先渡契約 | | | | | | | | |
| | 売建 | 10,288 | 194 | 194 | 194 | 26,264 | 1,246 | 1,246 | 1,246 |
| | 買建 | 9,784 | 112 | 112 | - | - | - | - | - |
| 合 計 | | | | 6,156 | 194 | | | 1,432 | 1,246 |

- (注) 1. 括弧内には、貸借対照表に計上したオプション料を記載しています。
2. 差損益欄には、先物取引及び先渡契約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。
3. 上表において、残存期間1年超の取引はありません。

(d) 債券関連

(単位: 百万円)

| 区分 | 種類 | 2015年度末 | | | | 2016年度末 | | | |
|--------------|-------------|---------|-------|-------|------------|---------|-----|-----|------------|
| | | 契約額等 | 時価 | 差損益 | うちヘッジ会計適用分 | 契約額等 | 時価 | 差損益 | うちヘッジ会計適用分 |
| 取引所 | 円建債券先物 | | | | | | | | |
| | 売建 | 21,057 | 26 | 26 | - | 9,298 | 18 | 18 | - |
| | 買建 | - | - | - | - | 4,499 | 9 | 9 | - |
| | 外貨建債券先物 | | | | | | | | |
| 売建 | - | - | - | - | 203,592 | 619 | 619 | - | |
| 買建 | 39,526 | 35 | 35 | - | 103,911 | 974 | 974 | - | |
| 店頭 | 円建債券店頭オプション | | | | | | | | |
| | 売建 | | | | | | | | |
| | コール | 40,994 | | | | 18,784 | | | |
| | (191) | | 522 | 331 | - | (47) | 90 | 42 | - |
| | ブット | 45,379 | | | | 99,556 | | | |
| | (112) | | 113 | 1 | - | (693) | 496 | 197 | - |
| | 買建 | | | | | | | | |
| | コール | 45,379 | | | | 99,556 | | | |
| | (101) | | 91 | 9 | - | (453) | 675 | 222 | - |
| | ブット | 40,994 | | | | 18,784 | | | |
| (235) | | 109 | 126 | - | (119) | 160 | 41 | - | |
| 外貨建債券店頭オプション | | | | | | | | | |
| 売建 | | | | | | | | | |
| コール | 114,736 | | | | 62,192 | | | | |
| (2,265) | | 3,837 | 1,572 | 1,572 | (902) | 1,030 | 127 | 127 | |
| 買建 | | | | | | | | | |
| ブット | 114,736 | | | | 62,192 | | | | |
| (2,265) | | 561 | 1,703 | 1,703 | (902) | 313 | 589 | 589 | |
| 合計 | | | 3,683 | 3,276 | | | 46 | 717 | |

- (注) 1. 括弧内には、貸借対照表に計上したオプション料を記載しています。
2. 差損益欄には、先物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。
3. 上表において、残存期間1年超の取引はありません。

(e) その他

(単位: 百万円)

| 区分 | 種類 | 2015年度末 | | | | 2016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 | クレジット・フォルト・スワップ オプション売建 | 24,500 | 24,500 | 529 | 529 | 28,000 | 25,000 | 674 | 674 |
| | オプション買建 | - | - | - | - | 11,385 | 11,385 | 119 | 119 |
| 合計 | | | | 529 | - | | | 554 | - |

- (注) 差損益欄には、時価を記載しています。

・特別勘定（個人変額保険・個人変額年金保険）

1. デリバティブ取引の時価情報（個人変額保険特別勘定）（ヘッジ会計適用分・非適用分の合算値）
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 | 2015年度末 | | | | | 2016年度末 | | | | |
|-----------|---------|------|------|------|----|---------|------|------|------|----|
| | 金利関連 | 通貨関連 | 株式関連 | 債券関連 | 合計 | 金利関連 | 通貨関連 | 株式関連 | 債券関連 | 合計 |
| ヘッジ会計適用分 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| ヘッジ会計非適用分 | - | 8 | - | - | 8 | - | 1 | - | - | 1 |
| 合 計 | - | 8 | - | - | 8 | - | 1 | - | - | 1 |

（注）上表の差損益は、全て損益計算書に計上されています。

時価情報

（b）通貨関連

（単位：百万円）

| 区 分 | 種 類 | 2015年度末 | | | | 2016年度末 | | | |
|-----|-------------|---------|----|-----|----------------|---------|----|-----|----------------|
| | | 契約額等 | 時価 | 差損益 | うちヘッジ会計 適用分 | 契約額等 | 時価 | 差損益 | うちヘッジ会計 適用分 |
| | | | | | | | | | |
| 店 頭 | 為替予約 | | | | | | | | |
| | 売建 | 868 | 2 | 2 | - | 779 | 3 | 3 | - |
| | （米ドル） | 580 | 2 | 2 | - | 389 | 1 | 1 | - |
| | （カナダドル） | 42 | 0 | 0 | - | 107 | 1 | 1 | - |
| | （オーストラリアドル） | 55 | 1 | 1 | - | 73 | 0 | 0 | - |
| | （イギリスポンド） | 63 | 0 | 0 | - | - | - | - | - |
| | （ユーロ） | 56 | 0 | 0 | - | - | - | - | - |
| | （その他） | 70 | 2 | 2 | - | 209 | 0 | 0 | - |
| | 買建 | 586 | 11 | 11 | - | 609 | 1 | 1 | - |
| | （ユーロ） | 364 | 10 | 10 | - | 410 | 1 | 1 | - |
| | （イギリスポンド） | 27 | 0 | 0 | - | 79 | 0 | 0 | - |
| | （米ドル） | 147 | 0 | 0 | - | 67 | 0 | 0 | - |
| | （カナダドル） | 13 | 0 | 0 | - | - | - | - | - |
| | （その他） | 32 | 0 | 0 | - | 51 | 1 | 1 | - |
| | 合 計 | | | 8 | - | | | 1 | - |

（注）1 年度末の為替相場は先物相場を使用しています。

2 為替予約等により決済時における円貨額が確定しており、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係る当該為替予約等は、開示の対象より除いています。

3 差損益欄には、時価を記載しています。

4 上表において、残存期間1年超の取引はありません。

（a）金利関連、（c）株式関連、（d）債券関連は2015年度末、2016年度末ともに期末残高がないため、記載していません。

2. デリバティブ取引の時価情報（個人変額年金保険特別勘定）（ヘッジ会計適用分・非適用分の合算値）

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 | 2015年度末 | | | | | 2016年度末 | | | | |
|-----------|---------|------|------|------|----|---------|------|------|------|----|
| | 金利関連 | 通貨関連 | 株式関連 | 債券関連 | 合計 | 金利関連 | 通貨関連 | 株式関連 | 債券関連 | 合計 |
| ヘッジ会計適用分 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| ヘッジ会計非適用分 | - | 0 | - | - | 0 | - | 0 | - | - | 0 |
| 合 計 | - | 0 | - | - | 0 | - | 0 | - | - | 0 |

（注）上表の差損益は、全て損益計算書に計上されています。

時価情報

（b）通貨関連

（単位：百万円）

| 区 分 | 種 類 | 2015年度末 | | | | 2016年度末 | | | |
|-----|-----------|---------|----|-----|------------|---------|----|-----|------------|
| | | 契約額等 | 時価 | 差損益 | うちヘッジ会計適用分 | 契約額等 | 時価 | 差損益 | うちヘッジ会計適用分 |
| 店 頭 | 為替予約 | | | | | | | | |
| | 売建 | 28 | 0 | 0 | - | 5 | 0 | 0 | - |
| | （米ドル） | 13 | 0 | 0 | - | 5 | 0 | 0 | - |
| | （ユーロ） | 7 | 0 | 0 | - | - | - | - | - |
| | （カナダドル） | 5 | 0 | 0 | - | - | - | - | - |
| | （イギリスポンド） | 0 | 0 | 0 | - | - | - | - | - |
| | （その他） | 0 | 0 | 0 | - | - | - | - | - |
| | 買建 | 27 | 0 | 0 | - | 8 | 0 | 0 | - |
| | （米ドル） | 16 | 0 | 0 | - | 8 | 0 | 0 | - |
| | （ユーロ） | 5 | 0 | 0 | - | - | - | - | - |
| | （イギリスポンド） | 3 | 0 | 0 | - | - | - | - | - |
| | （カナダドル） | 1 | 0 | 0 | - | - | - | - | - |
| | 合 計 | | | 0 | - | | | 0 | - |

（注）1 年度末の為替相場は先物相場を使用しています。

2 為替予約等により決済時における円貨額が確定しており、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係る当該為替予約等は、開示の対象より除いています。

3 差損益欄には、時価を記載しています。

4 上表において、残存期間1年超の取引はありません。

（a）金利関連、（c）株式関連、（d）債券関連は2015年度末、2016年度末ともに期末残高がないため、記載していません。

・会社計

１．資産構成

(１) 資産の構成

(単位：百万円、%)

| 区 分 | 2015年度末 | | 2016年度末 | |
|-------------|------------|-------|------------|-------|
| | 金 額 | 占 率 | 金 額 | 占 率 |
| 現預金・コールローン | 645,237 | 1.8 | 536,954 | 1.5 |
| 買 現 先 勘 定 | - | - | - | - |
| 債券貸借取引支払保証金 | - | - | - | - |
| 買 入 金 銭 債 権 | 233,206 | 0.6 | 192,213 | 0.5 |
| 商 品 有 価 証 券 | - | - | - | - |
| 金 銭 の 信 託 | 52,806 | 0.1 | 50,191 | 0.1 |
| 有 価 証 券 | 30,250,119 | 84.3 | 30,498,102 | 85.5 |
| 公 社 債 | 16,581,440 | 46.2 | 16,217,992 | 45.4 |
| 株 式 | 3,560,485 | 9.9 | 3,666,952 | 10.3 |
| 外 国 証 券 | 9,451,844 | 26.3 | 9,868,430 | 27.7 |
| 公 社 債 | 7,038,357 | 19.6 | 8,369,334 | 23.5 |
| 株 式 等 | 2,413,487 | 6.7 | 1,499,095 | 4.2 |
| そ の 他 の 証 券 | 656,349 | 1.8 | 744,727 | 2.1 |
| 貸 付 金 | 2,826,052 | 7.9 | 2,657,852 | 7.4 |
| 保 険 約 款 貸 付 | 405,056 | 1.1 | 381,830 | 1.1 |
| 一 般 貸 付 | 2,420,995 | 6.7 | 2,276,021 | 6.4 |
| 不 動 産 | 1,157,543 | 3.2 | 1,116,371 | 3.1 |
| 繰 延 税 金 資 産 | - | - | - | - |
| そ の 他 | 731,228 | 2.0 | 636,431 | 1.8 |
| 貸 倒 引 当 金 | 1,237 | 0.0 | 1,472 | 0.0 |
| 合 計 | 35,894,956 | 100.0 | 35,686,645 | 100.0 |
| うち外貨建資産 | 8,044,233 | 22.4 | 8,793,240 | 24.6 |

(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 | 2015年度 | 2016年度 |
|-------------|---------|-----------|
| 現預金・コールローン | 373,490 | 108,282 |
| 買 現 先 勘 定 | - | - |
| 債券貸借取引支払保証金 | - | - |
| 買 入 金 銭 債 権 | 26,528 | 40,993 |
| 商 品 有 価 証 券 | - | - |
| 金 銭 の 信 託 | 16,683 | 2,614 |
| 有 価 証 券 | 423,246 | 247,983 |
| 公 社 債 | 239,405 | 363,447 |
| 株 式 | 446,545 | 106,467 |
| 外 国 証 券 | 347,569 | 416,585 |
| 公 社 債 | 87,072 | 1,330,977 |
| 株 式 等 | 260,496 | 914,392 |
| そ の 他 の 証 券 | 131,462 | 88,377 |
| 貸 付 金 | 203,243 | 168,199 |
| 保 険 約 款 貸 付 | 23,498 | 23,226 |
| 一 般 貸 付 | 179,744 | 144,973 |
| 不 動 産 | 38,485 | 41,171 |
| 繰 延 税 金 資 産 | - | - |
| そ の 他 | 113,629 | 94,797 |
| 貸 倒 引 当 金 | 868 | 235 |
| 合 計 | 933,812 | 208,310 |
| うち外貨建資産 | 144,573 | 749,006 |

(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. 有価証券等の時価情報

(1) 売買目的有価証券の評価損益

(単位：百万円)

| 区 分 | 2015年度末 | | 2016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 | 892,868 | 113,091 | 889,043 | 10,481 |
| 一 般 勘 定 | 50,166 | 4,459 | 50,191 | 2,122 |
| 特 別 勘 定 | 842,702 | 108,631 | 838,851 | 8,359 |

(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(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 | 帳簿価額 | 時価 | 差損益 | | | |
|-------------|---------------|------------|------------|-----------|-----------|---------|
| | | | 差益 | 差損 | | |
| 2015年度末 | 満期保有目的の債券 | 45,712 | 51,296 | 5,583 | 5,583 | - |
| | 公 社 債 | 45,712 | 51,296 | 5,583 | 5,583 | - |
| | 外 国 公 社 債 | - | - | - | - | - |
| | 責任準備金対応債券 | 12,027,685 | 15,449,932 | 3,422,247 | 3,422,586 | 339 |
| | 公 社 債 | 11,948,259 | 15,369,411 | 3,421,152 | 3,421,152 | - |
| | 外 国 公 社 債 | 79,425 | 80,520 | 1,095 | 1,434 | 339 |
| | 子会社・関連会社株式 | 26,570 | 61,653 | 35,082 | 35,101 | 18 |
| | そ の 他 有 価 証 券 | 12,927,650 | 15,628,568 | 2,700,917 | 2,874,655 | 173,738 |
| | 公 社 債 | 3,782,592 | 4,378,846 | 596,253 | 596,857 | 603 |
| | 株 式 | 1,677,678 | 2,990,485 | 1,312,806 | 1,409,264 | 96,457 |
| | 外 国 証 券 | 6,759,695 | 7,526,318 | 766,622 | 830,252 | 63,629 |
| | 公 社 債 | 6,150,829 | 6,828,492 | 677,663 | 714,258 | 36,594 |
| | 株 式 等 | 608,865 | 697,825 | 88,959 | 115,994 | 27,035 |
| | そ の 他 の 証 券 | 484,658 | 497,071 | 12,412 | 25,441 | 13,028 |
| | 買入金銭債権 | 220,436 | 233,206 | 12,769 | 12,787 | 17 |
| | 譲渡性預金 | - | - | - | - | - |
| | 金銭の信託 | 2,587 | 2,640 | 52 | 52 | - |
| | 合 計 | 25,027,619 | 31,191,450 | 6,163,830 | 6,337,926 | 174,095 |
| | 公 社 債 | 15,776,565 | 19,799,554 | 4,022,989 | 4,023,592 | 603 |
| | 株 式 | 1,677,678 | 2,990,485 | 1,312,806 | 1,409,264 | 96,457 |
| 外 国 証 券 | 6,864,951 | 7,667,606 | 802,655 | 866,642 | 63,987 | |
| 公 社 債 | 6,230,255 | 6,909,013 | 678,758 | 715,692 | 36,933 | |
| 株 式 等 | 634,695 | 758,592 | 123,896 | 150,950 | 27,053 | |
| そ の 他 の 証 券 | 485,399 | 497,958 | 12,558 | 25,587 | 13,028 | |
| 買入金銭債権 | 220,436 | 233,206 | 12,769 | 12,787 | 17 | |
| 譲渡性預金 | - | - | - | - | - | |
| 金銭の信託 | 2,587 | 2,640 | 52 | 52 | - | |
| 2016年度末 | 満期保有目的の債券 | 46,014 | 50,534 | 4,519 | 4,519 | - |
| | 公 社 債 | 46,014 | 50,534 | 4,519 | 4,519 | - |
| | 外 国 公 社 債 | - | - | - | - | - |
| | 責任準備金対応債券 | 12,001,580 | 14,764,373 | 2,762,792 | 2,782,071 | 19,278 |
| | 公 社 債 | 11,911,257 | 14,672,992 | 2,761,734 | 2,780,815 | 19,081 |
| | 外 国 公 社 債 | 90,322 | 91,380 | 1,058 | 1,255 | 197 |
| | 子会社・関連会社株式 | 304 | 302 | 2 | 7 | 10 |
| | そ の 他 有 価 証 券 | 14,459,160 | 17,184,631 | 2,725,470 | 2,865,886 | 140,416 |
| | 公 社 債 | 3,617,249 | 4,094,982 | 477,733 | 485,227 | 7,493 |
| | 株 式 | 1,647,671 | 3,335,538 | 1,687,866 | 1,712,564 | 24,698 |
| | 外 国 証 券 | 8,443,706 | 8,964,471 | 520,764 | 625,317 | 104,552 |
| | 公 社 債 | 7,776,125 | 8,169,860 | 393,734 | 488,696 | 94,961 |
| | 株 式 等 | 667,581 | 794,611 | 127,030 | 136,621 | 9,591 |
| | そ の 他 の 証 券 | 514,139 | 547,427 | 33,288 | 36,687 | 3,398 |
| | 買入金銭債権 | 186,393 | 192,213 | 5,819 | 6,090 | 270 |
| | 譲渡性預金 | 50,000 | 49,998 | 1 | - | 1 |
| | 金銭の信託 | - | - | - | - | - |
| | 合 計 | 26,507,060 | 31,999,841 | 5,492,780 | 5,652,485 | 159,704 |
| | 公 社 債 | 15,574,521 | 18,818,509 | 3,243,987 | 3,270,562 | 26,575 |
| | 株 式 | 1,647,671 | 3,335,538 | 1,687,866 | 1,712,564 | 24,698 |
| 外 国 証 券 | 8,534,167 | 9,055,980 | 521,813 | 626,573 | 104,759 | |
| 公 社 債 | 7,866,447 | 8,261,240 | 394,793 | 489,951 | 95,158 | |
| 株 式 等 | 667,719 | 794,739 | 127,020 | 136,621 | 9,601 | |
| そ の 他 の 証 券 | 514,306 | 547,601 | 33,295 | 36,694 | 3,398 | |
| 買入金銭債権 | 186,393 | 192,213 | 5,819 | 6,090 | 270 | |
| 譲渡性預金 | 50,000 | 49,998 | 1 | - | 1 | |
| 金銭の信託 | - | - | - | - | - | |

(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 | 2015年度末 | | 2016年度末 | |
|--------------------|-----------|---------|-----------|---------|
| | 帳簿価額 | 時価 | 帳簿価額 | 時価 |
| 満期保有目的の債券 | - | - | - | - |
| 非上場外国公社債 | - | - | - | - |
| その他 | - | - | - | - |
| 責任準備金対応債券 | - | - | - | - |
| 子会社・関連会社株式 | 1,100,671 | 58,751 | 1,100,671 | 58,751 |
| 非上場国内株式(店頭売買株式を除く) | 236,944 | 12,684 | 236,944 | 12,684 |
| 非上場外国株式(店頭売買株式を除く) | 783,945 | - | 783,945 | - |
| その他 | 79,781 | 46,067 | 79,781 | 46,067 |
| その他の有価証券 | 813,855 | 611,909 | 813,855 | 611,909 |
| 非上場国内株式(店頭売買株式を除く) | 126,122 | 126,521 | 126,122 | 126,521 |
| 非上場外国株式(店頭売買株式を除く) | 665,001 | 459,050 | 665,001 | 459,050 |
| 非上場外国公社債 | - | - | - | - |
| その他 | 22,731 | 26,337 | 22,731 | 26,337 |
| 合 計 | 1,914,526 | 670,660 | 1,914,526 | 670,660 |

- (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. 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うち、外国証券の為替を評価した差損益は以下のとおりです。
 (2015年度末：48,179百万円、2016年度末：1,746百万円)

(3) 金銭の信託の時価情報

(単位：百万円)

| 区 分 | 貸借対照表計上額 | 時価 | 差損益 | | |
|---------|----------|--------|-------|--------|--------|
| | | | 差益 | 差損 | 合計 |
| 2015年度末 | 52,806 | 52,806 | 4,407 | 7,143 | 11,551 |
| 2016年度末 | 50,191 | 50,191 | 2,024 | 17,996 | 15,971 |

- (注) 1. 本表記載の時価相当額の算定は、金銭の信託の受託者が合理的に算定した価格によっています。
 2. 差損益には金銭の信託内で設定しているデリバティブ取引に係る差損益も含んでいます。

・運用目的の金銭の信託

(単位：百万円)

| 区 分 | 2015年度末 | | 2016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 |
| 運用目的の金銭の信託 | 50,166 | 4,459 | 50,191 | 2,122 |

・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 | 2015年度末 | | | | | 2016年度末 | | | | |
|---------------|---------|-------|-----|-----|----|---------|----|-----|-----|----|
| | 帳簿価額 | 時価 | 差損益 | 差損益 | | 帳簿価額 | 時価 | 差損益 | 差損益 | |
| | | | | 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 | 2,587 | 2,640 | 52 | 52 | - | - | - | - | - | - |

(4) デリバティブ取引の運用状況

当社では、有価証券投資に係る市場リスクのヘッジを目的とした有価証券関連のデリバティブ取引、外貨建資産等に係る為替リスクのヘッジを目的とした通貨関連のデリバティブ取引、貸付金の収益及び借入金の費用の安定を目的とした金利スワップ関連取引等を行っております。

当社が利用しているデリバティブ取引には、現物資産等と同様に市場リスク（金利・為替等市場の変動が収益に影響を及ぼすリスク）と信用リスク（取引相手が倒産等により契約不履行に陥るリスク）があります。例えば、金利スワップ取引では、金利の変動による市場リスクだけでなく、取引相手のデフォルトによる信用リスクも認識する必要があります。

また、一般的に、デリバティブ取引には、流動性の高さ、取引コストの低さ、リスク特性の変更が可能であることなどの利点がある一方で、レバレッジ、商品特性等に起因する現物資産等にはないリスクも存在していることに留意し、きめ細かな管理を行う必要があると考えております。

取引の内容

2016年度に当社が利用していたデリバティブ取引は以下の通りです。

- ・ 金利関連：金利先物取引、金利スワップ取引、金利スワップション取引
- ・ 通貨関連：為替予約取引、通貨オプション取引、通貨スワップ取引
- ・ 株式関連：株価指数先物取引、株価指数オプション取引、株式先渡取引
- ・ 債券関連：債券先物取引、債券先物オプション取引、債券オプション取引、債券先渡取引
- ・ その他：クレジット・デフォルト・スワップ取引

取組方針

当社では、保有資産の残高を踏まえ、必要な範囲内でデリバティブ取引を用いることとし、主に保有している現物資産等に係る市場リスクのヘッジを目的とした取引を行っております。従って、投機的なデリバティブ取引は行わない方針です。

デリバティブ取引に対するヘッジ会計の適用

当社では、2016年度において、以下の取引についてヘッジ会計を適用しております。

- ・ 貸付金・借入金・保険負債をヘッジ対象、金利スワップをヘッジ手段とする取引
- ・ 国内株式をヘッジ対象、株式先渡をヘッジ手段とする取引
- ・ 外貨建債券・外貨建定期預金・外貨建株式をヘッジ対象、為替予約をヘッジ手段とする取引
- ・ 外貨建債券をヘッジ対象、外貨建債券オプションをヘッジ手段とする取引
- ・ 外貨建債券・外貨建社債（負債）・外貨建貸付金をヘッジ対象、通貨スワップをヘッジ手段とする取引

ヘッジ会計の適用にあたっては、「金融商品に係る会計基準の設定に関する意見書」等における適用要件を満たすため、方針文書・規程等を整備するとともに、これらの方針・規程等に基づき、ヘッジ対象のリスクの種類及び選択したヘッジ手段を明確にし、また事前有効性の確認、事後有効性の検証を行う等、社内体制を整備して運営しております。

リスク管理体制

当社では、デリバティブ取引について、ヘッジ対象の現物資産等と一体で日々の損益を管理するとともに、ポジション等に係るリスク・リミットの設定やトラッキング・エラー（保有資産のリターンとベンチマークのリターンとの乖離の大きさを示す指標）バリュー・アット・リスク（VaR：最大損失予想額）等の定期的な測定等により、厳正な市場リスク管理を行っております。

一方、取引所取引以外の店頭（相対）のデリバティブ取引における信用リスクについては、取引の相手先ごとに取引の上限枠を設定することなどにより管理を行っております。なお、2016年度末の店頭デリバティブ取引の信用リスク相当額（カレント・エクスポージャー方式による再構築コスト）は次表の通りです。

（単位：億円）

| 区 分 | 2015 年度末 | | 2016 年度末 | |
|------------------|----------------|--------------|----------------|--------------|
| | 契約金額・ 想定元本額 | 信用リスク 相当額 | 契約金額・ 想定元本額 | 信用リスク 相当額 |
| 金 利 ス ワ ッ プ | 6,091 | 47 | 9,500 | 93 |
| 金利スワップション | 16,000 | 155 | 15,000 | 46 |
| 為 替 予 約 | 62,986 | 812 | 76,833 | 420 |
| 通貨オプション | 2,987 | 14 | 6,153 | 85 |
| 通貨スワップ | 4,549 | 140 | 7,809 | 638 |
| 債券オプション | 4,022 | 47 | 3,610 | 27 |
| 株式先渡契約 | 200 | 4 | 262 | 27 |
| クレジット・デフォルト・スワップ | 245 | 2 | 393 | 12 |
| 合 計 | 97,083 | 1,224 | 119,564 | 1,352 |

資産運用におけるリスク管理に関しては、これらのデリバティブ取引も含めて、社内規程を策定し、リスク管理の基本方針・具体的取組内容を明確に定めております。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、全体のリスクの状況については、リスク管理の専門組織である「リスク管理統括部」が一元的に把握し、「ERM委員会」等に定期的に報告しており、リスクのコントロールには細心の注意を払っております。

定量的情報に関する補足説明

当社のデリバティブ取引は、主に保有している現物資産等に係る市場リスクのヘッジを目的としていることから、デリバティブ取引自体の想定元本額（契約額）や含み損益額に加えて、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的確に状況が把握できます。

すなわち、デリバティブ取引の契約額等をヘッジ対象の現物資産等の残高と合わせて見ることによって、現物資産等のうちの程度がデリバティブ取引によってヘッジされているのか、また、デリバティブ取引の含み損益をヘッジ対象の現物資産等の含み損益と合わせて見ることによって、デリバティブ取引で市場の変化による運用収益の変動がどの程度回避されているのか、等がわかります。

(5) デリバティブ取引の時価情報(ヘッジ会計適用分・非適用分の合算値)

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 | 2015年度末 | | | | | | 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 | 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 | 3,540 | 107,571 | 194 | 3,276 | - | 100,948 | 23,531 | 136,742 | 1,246 | 717 | - | 159,745 |
| ヘッジ会計非適用分 | 11,407 | 601 | 6,255 | 472 | 529 | 18,207 | 14,517 | 10,473 | 2,767 | 888 | 554 | 26,316 |
| 合 計 | 14,948 | 106,969 | 6,060 | 3,748 | 529 | 82,740 | 38,049 | 147,216 | 1,521 | 171 | 554 | 186,061 |

(注) 上表のうち損益計算書に計上されている金額は以下のとおりです。
 2015年度末: 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108,459百万円、株式関連194百万円)及びヘッジ会計非適用分の差損益(18,207百万円)の合計90,445百万円
 2016年度末: 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140,284百万円、株式関連1,246百万円)及びヘッジ会計非適用分の差損益(26,316百万円)の合計165,354百万円

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 | 2015年度末 | | | | 2016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 | 金利スワップ | | | | | | | | |
| | 固定金利受取/変動金利支払 | 308,140 | 308,140 | 119 | 119 | 170 | - | 1 | 1 |
| | 固定金利支払/変動金利受取 | 2,200 | 2,200 | 232 | 232 | 44,100 | 44,100 | 71 | 71 |
| | 金利スワップション | | | | | | | | |
| | 売建 | | | | | | | | |
| | 固定金利支払/変動金利受取 | 350,000 (1,672) | 350,000 (1,672) | 983 | 689 | 350,000 (1,672) | - (-) | 67 | 1,604 |
| | 買建 | | | | | | | | |
| | 固定金利受取/変動金利支払 | 100,000 (2,457) | - (-) | 2,760 | 303 | - (-) | - (-) | - | - |
| | 固定金利支払/変動金利受取 | 1,150,000 (18,570) | 1,070,000 (17,647) | 6,521 | 12,048 | 1,150,000 (18,214) | 855,000 (14,947) | 2,019 | 16,194 |
| | 合 計 | | | | 11,407 | | | | 14,517 |

(注) 1. 括弧内には、貸借対照表に計上したオプション料を記載しています。
 2. 差損益欄には、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。

(参考) 金利スワップ残存期間別残高

(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 | 合計 |
|---------|---------------|-------------|-------------|-------------|--------------|---------|---------|
| 2015年度末 | 受取側固定スワップ想定元本 | - | 340 | - | 7,800 | - | 308,140 |
| | 平均受取固定金利 | - | 1.23 | - | 0.71 | - | 0.52 |
| | 平均支払変動金利 | - | 0.01 | - | 0.06 | - | 0.01 |
| | 支払側固定スワップ想定元本 | - | - | - | - | - | 2,200 |
| | 平均支払固定金利 | - | - | - | - | - | 1.08 |
| | 平均受取変動金利 | - | - | - | - | - | 0.02 |
| 合 計 | - | 340 | - | 7,800 | - | 302,200 | 310,340 |
| 2016年度末 | 受取側固定スワップ想定元本 | 170 | - | - | - | - | 170 |
| | 平均受取固定金利 | 1.23 | - | - | - | - | 1.23 |
| | 平均支払変動金利 | 0.03 | - | - | - | - | 0.03 |
| | 支払側固定スワップ想定元本 | - | 43,000 | - | - | - | 1,100 |
| | 平均支払固定金利 | - | 0.13 | - | - | - | 1.08 |
| | 平均受取変動金利 | - | 0.01 | - | - | - | 0.03 |
| 合 計 | 170 | 43,000 | - | - | - | 1,100 | 44,270 |

(b) 通貨関連

(単位：百万円)

| 区分 | 種類 | 2015年度末 | | | 2016年度末 | | |
|-------------|-------------|-----------|--------|---------|-----------|--------|--------|
| | | 契約額等 | 時価 | 差損益 | 契約額等 | 時価 | 差損益 |
| 店頭 | 為替予約 | | | | | | |
| | 売建 | 1,365,473 | 7,730 | 7,730 | 1,091,756 | 12,300 | 12,300 |
| | (米ドル) | 526,871 | 11,083 | 11,083 | 453,609 | 5,041 | 5,041 |
| | (ユーロ) | 380,362 | 3,329 | 3,329 | 323,330 | 3,793 | 3,793 |
| | (オーストラリアドル) | 144,063 | 5,117 | 5,117 | 83,011 | 3,058 | 3,058 |
| | (イギリスポンド) | 99,762 | 288 | 288 | 51,626 | 121 | 121 |
| | (カナダドル) | 41,461 | 235 | 235 | 44,472 | 27 | 27 |
| | (その他) | 172,951 | 1,618 | 1,618 | 135,706 | 556 | 556 |
| | 買建 | 846,900 | 5,808 | 5,808 | 1,033,614 | 5,788 | 5,788 |
| | (米ドル) | 445,562 | 10,217 | 10,217 | 592,246 | 4,083 | 4,083 |
| | (ユーロ) | 124,280 | 1,175 | 1,175 | 345,442 | 643 | 643 |
| | (オーストラリアドル) | 87,757 | 2,960 | 2,960 | 17,037 | 524 | 524 |
| | (カナダドル) | 29,184 | 13 | 13 | 16,427 | 153 | 153 |
| | (イギリスポンド) | 63,702 | 24 | 24 | 9,057 | 26 | 26 |
| | (その他) | 96,413 | 234 | 234 | 53,402 | 2,004 | 2,004 |
| | 通貨オプション | | | | | | |
| | 売建 | | | | | | |
| | コール | - | - | - | 93,491 | - | 690 |
| | (米ドル) | (-) | - | - | (690) | - | 690 |
| (ユーロ) | - | - | - | 93,491 | - | - | |
| (オーストラリアドル) | (-) | - | - | (690) | - | 690 | |
| 買建 | | | | | | | |
| コール | 57,179 | - | - | - | - | - | |
| (ユーロ) | (722) | 0 | 722 | (-) | - | - | |
| (オーストラリアドル) | 57,179 | - | - | - | - | - | |
| (ユーロ) | (722) | 0 | 722 | (-) | - | - | |
| プット | 241,613 | - | - | 521,866 | - | - | |
| (米ドル) | (5,242) | 3,440 | 1,801 | (7,321) | 2,668 | 4,652 | |
| (ユーロ) | 219,498 | - | - | 412,966 | - | - | |
| (オーストラリアドル) | (4,652) | 3,435 | 1,217 | (6,656) | 2,445 | 4,210 | |
| (ユーロ) | - | - | - | 108,899 | - | - | |
| (オーストラリアドル) | (-) | - | - | (664) | 223 | 441 | |
| (オーストラリアドル) | 22,115 | - | - | - | - | - | |
| (ユーロ) | (589) | 4 | 584 | (-) | - | - | |
| 合 計 | | | 601 | | | 10,473 | |

(注) 1. 括弧内には、貸借対照表に計上したオプション料を記載しています。

2. 年度末の為替相場は先物相場を使用しています。

3. 差損益欄には、為替予約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。

4. 上表において、残存期間1年超の取引はありません。

(c) 株式関連

(単位:百万円)

| 区分 | 種類 | 2015年度末 | | | 2016年度末 | | |
|-----|-------------------|-------------------|-----|----------|-------------------|-------|-------|
| | | 契約額等 | 時価 | 差損益 | 契約額等 | 時価 | 差損益 |
| 取引所 | 円建株価指数先物 | | | | | | |
| | 売建 | 9,945 | 12 | 12 | - | - | - |
| | 買建 | 8,238 | 4 | 4 | 25,313 | 268 | 268 |
| | 外貨建株価指数先物 | | | | | | |
| | 売建 | 2,849 | 58 | 58 | 5,942 | 217 | 217 |
| | 買建 | 9,072 | 155 | 155 | 20,109 | 71 | 71 |
| | 円建株価指数オプション | | | | | | |
| | 売建 | | | | | | |
| | コール | 59,972 (144) | 2 | 141 | - (-) | - | - |
| | 買建 | | | | | | |
| | プット | 99,990 (6,366) | 53 | 6,312 | 80,000 (2,362) | 10 | 2,352 |
| | 外貨建株価指数オプション | | | | | | |
| | 売建 | | | | | | |
| | コール | 31,954 (886) | 135 | 751 | - (-) | - | - |
| 買建 | | | | | | | |
| コール | 9,583 (48) | 0 | 47 | - (-) | - | - | |
| プット | 31,956 (1,363) | 583 | 779 | - (-) | - | - | |
| 店頭 | 国内株式先渡契約 | | | | | | |
| 買建 | 9,784 | 112 | 112 | - | - | - | |
| | 合計 | | | 6,255 | | 2,767 | |

(注) 1. 括弧内には、貸借対照表に計上したオプション料を記載しています。

2. 差損益欄には、先物取引及び先渡契約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。

3. 上表において、残存期間1年超の取引はありません。

(d) 債券関連

(単位：百万円)

| 区分 | 種類 | 2015年度末 | | | 2016年度末 | | |
|-------|-------------|---------|-----|--------|---------|-------|-------|
| | | 契約額等 | 時価 | 差損益 | 契約額等 | 時価 | 差損益 |
| 取引所 | 円建債券先物 | | | | | | |
| | 売建 | 21,057 | 26 | 26 | 9,298 | 18 | 18 |
| | 買建 | 2,425 | 4 | 4 | 66,772 | 102 | 102 |
| | 外貨建債券先物 | | | | | | |
| 売建 | | - | - | - | 222,731 | 915 | 915 |
| | 買建 | 157,667 | 24 | 24 | 198,713 | 1,301 | 1,301 |
| 店頭 | 円建債券店頭オプション | | | | | | |
| | 売建 | | | | | | |
| | コール | 40,994 | | | 18,784 | | |
| | (191) | | 522 | 331 | (47) | 90 | 42 |
| | プット | 45,379 | | | 99,556 | | |
| | (112) | | 113 | 1 | (693) | 496 | 197 |
| 買建 | | | | | | | |
| コール | 45,379 | | | 99,556 | | | |
| (101) | | 91 | 9 | (453) | 675 | 222 | |
| プット | 40,994 | | | 18,784 | | | |
| (235) | | 109 | 126 | (119) | 160 | 41 | |
| 合計 | | | | 472 | | | 888 |

(注) 1. 括弧内には、貸借対照表に計上したオプション料を記載しています。

2. 差損益欄には、先物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。

3. 上表において、残存期間1年超の取引はありません。

(e) その他

(単位：百万円)

| 区分 | 種類 | 2015年度末 | | | 2016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 | |
| | | | | | | | | | |
| 店頭 | クレジット・フォルト・スワップ | | | | | | | | |
| | オプション売建 | 24,500 | 24,500 | 529 | 529 | 28,000 | 25,000 | 674 | 674 |
| オプション買建 | | - | - | - | - | 11,385 | 11,385 | 119 | 119 |
| | 合計 | | | | 529 | | | | 554 |

(注) 差損益欄には、時価を記載しています。

③ヘッジ会計が適用されているもの

(a) 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 | 2015年度末 | | | | 2016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 | | |
| 原則的処理方法 | 金利スワップ | | | | | | | | | |
| | 固定金利受取/変動金利支払 | 貸付金 | - | - | - | - | 3,000 | 3,000 | △ 18 | △ 18 |
| | 固定金利受取/変動金利支払 | 保険負債 | - | - | - | - | 600,000 | 600,000 | △ 20,541 | △ 20,541 |
| 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 | 15,800 | 11,800 | 482 | 482 | 19,800 | 16,800 | 189 | 189 |
| | 固定金利支払/変動金利受取 | 借入金 | 283,000 | 283,000 | △ 4,022 | △ 4,022 | 283,000 | 283,000 | △ 3,161 | △ 3,161 |
| 合計 | | | | | | △ 3,540 | | | | △ 23,531 |

(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、%)

| 区分 | 1年以下 | 1年超 | 3年超 | 5年超 | 7年超 | 10年超 | 合計 | |
|---------|---------------|-------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| | | 3年以下 | 5年以下 | 7年以下 | 10年以下 | | | |
| 2015年度末 | 受取側固定スワップ想定元本 | 4,000 | 4,500 | 3,000 | 2,000 | 2,300 | - | 15,800 |
| | 平均受取固定金利 | 1.85 | 1.20 | 0.46 | 0.45 | 1.19 | - | 1.13 |
| | 平均支払変動金利 | 0.12 | 0.09 | △ 0.00 | △ 0.01 | 0.10 | - | 0.07 |
| | 支払側固定スワップ想定元本 | - | - | 139,000 | 144,000 | - | - | 283,000 |
| | 平均支払固定金利 | - | - | 0.28 | 0.42 | - | - | 0.35 |
| | 平均受取変動金利 | - | - | 0.26 | 0.26 | - | - | 0.26 |
| 合計 | 4,000 | 4,500 | 142,000 | 146,000 | 2,300 | - | 298,800 | |
| 2016年度末 | 受取側固定スワップ想定元本 | 3,000 | 4,500 | 7,000 | 6,000 | 2,300 | 600,000 | 622,800 |
| | 平均受取固定金利 | 1.62 | △ 0.00 | 0.17 | △ 0.02 | 1.19 | 0.43 | 0.43 |
| | 平均支払変動金利 | 0.02 | △ 0.00 | 0.02 | 0.03 | 0.06 | 0.02 | 0.02 |
| | 支払側固定スワップ想定元本 | - | - | 139,000 | 144,000 | - | - | 283,000 |
| | 平均支払固定金利 | - | - | 0.28 | 0.42 | - | - | 0.35 |
| | 平均受取変動金利 | - | - | 0.11 | 0.11 | - | - | 0.11 |
| 合計 | 3,000 | 4,500 | 146,000 | 150,000 | 2,300 | 600,000 | 905,800 | |

(b) 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 | 2015年度末 | | | | 2016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 | |
| | | | | | | | | | | | |
| 原則的処理方法 | 通貨スワップ | 外貨建債券 | 205,817 | 205,817 | 887 | 887 | 266,142 | 252,943 | 3,541 | 3,541 | |
| | (米ドル) | | 155,920 | 155,920 | 2,941 | 2,941 | 204,574 | 191,375 | 953 | 953 | |
| | (ユーロ) | | 49,897 | 49,897 | 2,053 | 2,053 | 61,568 | 61,568 | 4,494 | 4,494 | |
| ヘッジ対象に係る損益を認識する方法 | 為替予約 | 外貨建債券 | | | | | | | | | |
| | 売建 | | 3,609,448 | - | 108,567 | 108,567 | 5,215,748 | - | 140,242 | 140,242 | |
| | (米ドル) | | 1,794,006 | - | 54,939 | 54,939 | 2,948,262 | - | 81,896 | 81,896 | |
| | (ユーロ) | | 961,588 | - | 43,872 | 43,872 | 1,090,351 | - | 8,294 | 8,294 | |
| | (オーストラリアドル) | | 301,556 | - | 10,043 | 10,043 | 415,851 | - | 22,627 | 22,627 | |
| | (カナダドル) | | 18,773 | - | 1,015 | 1,015 | 138,358 | - | 8,876 | 8,876 | |
| | (イギリスポンド) | | 158,245 | - | 8,654 | 8,654 | 125,768 | - | 1,271 | 1,271 | |
| | (その他) | | 375,277 | - | 12,160 | 12,160 | 497,156 | - | 17,274 | 17,274 | |
| | 買建 | | 2,895 | - | 108 | 108 | 27,390 | - | 42 | 42 | |
| | (米ドル) | | 2,203 | - | 114 | 114 | 18,150 | - | 157 | 157 | |
| | (ユーロ) | | 248 | - | 4 | 4 | 3,000 | - | 43 | 43 | |
| | (イギリスポンド) | | 159 | - | 17 | 17 | 60 | - | 1 | 1 | |
| | (オーストラリアドル) | | 2 | - | 0 | 0 | 0 | - | 0 | 0 | |
| | (その他) | | 281 | - | 27 | 27 | 6,178 | - | 159 | 159 | |
| 為替予約等の振当処理 | 為替予約 | 外貨建定期預金 | | | | | | | | | |
| | 売建 | | 473,975 | - | - | - | 314,849 | - | - | - | |
| | (オーストラリアドル) | | 179,108 | - | - | - | 122,516 | - | - | - | |
| | (米ドル) | | 124,888 | - | - | - | 81,866 | - | - | - | |
| | (その他) | | 169,978 | - | - | - | 110,465 | - | - | - | |
| | 通貨スワップ | | 外貨建社債(負債) | 215,727 | 215,727 | - | - | 476,277 | 476,277 | - | - |
| | (米ドル) | | | 215,727 | 215,727 | - | - | 476,277 | 476,277 | - | - |
| | 通貨スワップ | | 外貨建貸付金 | 33,402 | 33,402 | - | - | 38,521 | 38,521 | - | - |
| | (米ドル) | | | 33,402 | 33,402 | - | - | 32,557 | 32,557 | - | - |
| (ユーロ) | - | - | | - | - | 5,964 | 5,964 | - | - | | |
| 合 計 | | | | | | | | | 136,742 | | |

(注) 1. 年度末の為替相場は先物相場を使用しています。

2. 為替予約及び通貨スワップの振当処理によるものは、ヘッジ対象とされている外貨建定期預金、外貨建社債(負債)及び外貨建貸付金と一体処理されているため、その時価は、当該外貨建定期預金、外貨建社債(負債)及び外貨建貸付金の時価を含めて記載しています。

3. 差損益欄には、為替予約及び通貨スワップ取引については時価を記載しています。(注2.を除く)

(c) 株式関連

(単位:百万円)

| ヘッジ会計の方法 | 種 類 | 主なヘッジ対象 | 2015年度末 | | | | 2016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 |
| | | | | | | | | | | |
| ヘッジ対象に係る損益を認識する方法 | 国内株式先渡契約 売建 | 国内株式 | 10,288 | - | 194 | 194 | 26,264 | - | 1,246 | 1,246 |
| 合 計 | | | | | | 194 | | | | 1,246 |

(注) 差損益欄には、時価を記載しています。

(d) 債券関連

(単位:百万円)

| ヘッジ会計の方法 | 種 類 | 主なヘッジ対象 | 2015年度末 | | | | 2016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 |
| | | | | | | | | | | |
| 原則的処理方法 | 外貨建債券店頭オプション | 外貨建債券 | | | | | | | | |
| | 売建 | | 114,736 | - | 3,837 | 1,572 | 62,192 | - | 1,030 | 127 |
| | コール | | (2,265) | - | | | (902) | - | | |
| 買建 | 114,736 | - | 561 | 1,703 | 62,192 | - | 313 | 589 | | |
| ブット | (2,265) | - | | | (902) | - | | | | |
| 合 計 | | | | | | | | | | 717 |

(注) 1. 括弧内には、貸借対照表に計上したオプション料を記載しています。

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。

(e) その他は、2015年度末、2016年度末ともに期末残高がないため、記載していません。

・貸倒引当金の明細

(単位：百万円)

| 摘 要 | 2015年度末 | 2016年度末 | 増 減 |
|---------------|---------|---------|-----|
| (1)貸倒引当金残高 | | | |
| 一般貸倒引当金 | 487 | 737 | 249 |
| 個別貸倒引当金 | 749 | 735 | 14 |
| 特定海外債権引当勘定 | - | - | - |
| (2)個別貸倒引当金 | | | |
| 繰入額 | 752 | 1,504 | 752 |
| 取崩額 | 931 | 1,506 | 574 |
| [償却に伴う取崩額を除く] | | | |
| 繰入額 | 179 | 1 | 177 |
| (3)特定海外債権引当勘定 | | | |
| 対象国数 | - | - | - |
| 債権額 | - | - | - |
| 繰入額 | - | - | - |
| 取崩額 | - | - | - |
| [償却に伴う取崩額を除く] | | | |
| (4)貸付金償却 | 59 | 41 | 18 |

(注) 経営破綻の事実が発生している債務者及び実質的に経営破綻に陥っている債務者に対する債権について、担保・保証等による回収が見込まれない部分(取立不能見込額)を債権額から直接減額した金額は、以下のとおりです。

・2015年度末 : 58百万円

・2016年度末 : 55百万円