２０１９年5月１５日
第一生命保険株式会社

２０１８年度決算関係補足資料

１．有価証券関係（一般勘定）
（１）有価証券明細表　・・・・・　２頁
（２）有価証券残存期間別残高　・・・・・　２頁
（３）業種別国内株式保有明細表　・・・・・　３頁
２．貸付金関係（一般勘定）
（１）貸付金残存期間別残高　・・・・・　４頁
（２）貸付金企業規模別内訳　・・・・・　４頁
（３）貸付金担保別内訳　・・・・・　４頁
（４）貸付金業種別内訳　・・・・・　５頁
３．海外投融資関係（一般勘定）
（１）資産別明細　・・・・・　６頁
（２）外貨建資産の通貨別構成　・・・・・　６頁
（３）海外投融資の地域別構成　・・・・・　７頁
４．デリバティブ取引の時価情報（一般勘定）　・・・・・　８頁
（１）差損益の内訳　・・・・・　８頁
（２）時価情報（ヘッジ会計非適用分）　・・・・・　８頁
（３）時価情報（ヘッジ会計適用分）　・・・・・　１２頁

１．有価証券関係（一般勘定）

（１）有価証券明細表

（単位：百万円、％）

区分	2017年度末		2018年度末	
	金額	占率	金額	占率
国債	13,887,258	46.1	13,674,544	45.7
地方債	119,575	0.4	129,427	0.4
社債	1,906,605	6.3	1,956,735	6.5
うち公社・公団債	399,483	1.3	418,607	1.4
株式	3,696,766	12.3	3,395,945	11.4
外国証券	9,942,625	33.0	10,122,795	33.9
公社債	8,520,524	28.3	8,933,476	29.9
株式等	1,422,100	4.7	1,189,319	4.0
その他の証券	543,845	1.8	610,282	2.0
合計	30,096,677	100.0	29,889,730	100.0

（２）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（期間の定めのないものを含む）	合計
有価証券	633,072	1,339,683	1,099,213	1,291,978	3,370,154	22,362,575	30,096,677
国債	178,397	275,514	77,149	380,021	1,135,715	11,840,458	13,887,258
地方債	4,926	26,098	4,150	5,734	20,076	58,589	119,575
社債	87,277	232,202	166,433	143,435	331,788	945,468	1,906,605
株式	－	－	－	－	－	3,696,766	3,696,766
外国証券	316,437	773,639	798,759	739,477	1,795,454	5,518,856	9,942,625
公社債	311,734	772,340	789,199	724,955	1,759,192	4,163,101	8,520,524
株式等	4,702	1,299	9,560	14,521	36,261	1,355,755	1,422,100
その他の証券	46,033	32,227	52,720	23,309	87,118	302,435	543,845
買入金銭債権	2,013	－	3,060	－	－	186,034	191,108
譲渡性預金	49,995	－	－	－	－	－	49,995
その他	－	－	－	－	－	59,348	59,348

区分	2018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（期間の定めのないものを含む）	合計
有価証券	571,899	1,439,737	1,416,762	1,607,610	3,209,364	21,644,357	29,889,730
国債	154,093	117,533	276,096	453,345	1,229,401	11,444,074	13,674,544
地方債	1,716	27,195	5,747	15,073	9,210	70,484	129,427
社債	99,421	175,236	207,558	207,202	212,166	1,055,149	1,956,735
株式	－	－	－	－	－	3,395,945	3,395,945
外国証券	295,102	1,062,532	868,594	891,096	1,560,423	5,445,046	10,122,795
公社債	290,829	1,061,628	848,430	860,939	1,520,199	4,351,449	8,933,476
株式等	4,273	903	20,164	30,156	40,224	1,093,597	1,189,319
その他の証券	21,565	57,239	58,764	40,893	198,161	233,657	610,282
買入金銭債権	－	1,307	3,354	3,590	6,407	184,532	199,193
譲渡性預金	69,995	－	－	－	－	－	69,995
その他	－	－	－	－	－	24,747	24,747

（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）業種別国内株式保有明細表

（単位：百万円、％）

区分		2017年度末		2018年度末	
		金額	占率	金額	占率
水産・農林業		1,291	0.0	1,335	0.0
鉱業		200	0.0	552	0.0
建設業		123,115	3.3	115,051	3.4
製造業	食料品	228,596	6.2	207,215	6.1
	繊維製品	34,907	0.9	26,342	0.8
	パルプ・紙	3,772	0.1	3,565	0.1
	化学	208,605	5.6	189,937	5.6
	医薬品	67,519	1.8	65,930	1.9
	石油・石炭製品	6,386	0.2	3,913	0.1
	ゴム製品	28,554	0.8	24,760	0.7
	ガラス・土石製品	113,081	3.1	98,892	2.9
	鉄鋼	58,817	1.6	48,609	1.4
	非鉄金属	19,063	0.5	15,415	0.5
	金属製品	45,837	1.2	35,345	1.0
	機械	247,753	6.7	190,797	5.6
	電気機器	671,531	18.2	573,859	16.9
	輸送用機器	219,804	5.9	183,591	5.4
	精密機器	140,598	3.8	157,847	4.6
	その他製品	68,856	1.9	68,430	2.0
電気・ガス業		103,212	2.8	123,635	3.6
運輸・情報通信業	陸運業	323,356	8.7	378,360	11.1
	海運業	52	0.0	45	0.0
	空運業	6,313	0.2	4,904	0.1
	倉庫・運輸関連業	5,150	0.1	4,474	0.1
	情報・通信業	100,913	2.7	95,870	2.8
商業	卸売業	154,385	4.2	133,503	3.9
	小売業	131,832	3.6	111,988	3.3
金融・保険業	銀行業	290,914	7.9	233,134	6.9
	証券、商品先物取引業	1,307	0.0	283	0.0
	保険業	21,774	0.6	3,331	0.1
	その他金融業	26,629	0.7	27,325	0.8
不動産業		19,779	0.5	18,442	0.5
サービス業		222,847	6.0	249,252	7.3
合計		3,696,766	100.0	3,395,945	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。

２．貸付金関係（一般勘定）

（１）貸付金残存期間別残高

（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 (期間の定めのないものを含む)	合計
2017年度末	変動金利	7,762	5,560	35,559	10,311	6,731	74,601	140,526
	固定金利	321,793	282,068	384,969	350,956	345,141	378,520	2,063,449
	一般貸付計	329,555	287,629	420,528	361,268	351,872	453,122	2,203,976
2018年度末	変動金利	425	9,106	20,497	7,084	2,618	87,180	126,912
	固定金利	292,448	312,130	372,426	263,580	304,030	336,246	1,880,863
	一般貸付計	292,873	321,236	392,924	270,665	306,649	423,427	2,007,776

（２）貸付金企業規模別内訳＜国内企業向け＞

（単位：件、百万円、％）

区分		2017年度末		2018年度末	
			占率		占率
大企業	貸付先数	223	67.6	213	66.1
	金額	1,604,877	84.9	1,478,341	86.0
中堅企業	貸付先数	9	2.7	7	2.2
	金額	3,908	0.2	4,607	0.3
中小企業	貸付先数	98	29.7	102	31.7
	金額	281,689	14.9	236,564	13.8
国内企業向け貸付計	貸付先数	330	100.0	322	100.0
	金額	1,890,475	100.0	1,719,513	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	①右の②、③、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	常用する従業員300名超かつ	資本金10億円以上	常用する従業員50名超かつ	資本金10億円以上	常用する従業員100名超かつ	資本金10億円以上	常用する従業員100名超かつ	資本金10億円以上
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	

（３）貸付金担保別内訳

（単位：百万円、％）

区分	2017年度末		2018年度末	
	金額	占率	金額	占率
担保貸付	10,993	0.5	13,212	0.7
有価証券担保貸付	9,644	0.4	11,571	0.6
不動産・動産・財団担保貸付	1,152	0.1	1,640	0.1
指名債権担保貸付	196	0.0	－	－
保証貸付	63,820	2.9	132,224	6.6
信用貸付	2,128,719	96.6	1,862,339	92.8
その他	442	0.0	－	－
一般貸付計	2,203,976	100.0	2,007,776	100.0
うち劣後特約付貸付	286,364	13.0	232,663	11.6

（注）保険約款貸付は含んでいません。

（4）貸付金業種別内訳

（単位：百万円、%）

区分			2017年度末		2018年度末	
			金額	占率	金額	占率
国内向け	製造業		335,034	15.2	325,358	16.2
		食料	42,666	1.9	43,029	2.1
		繊維	2,873	0.1	2,956	0.1
		木材・木製品	200	0.0	500	0.0
		パルプ・紙	10,596	0.5	10,680	0.5
		印刷	12,538	0.6	12,518	0.6
		化学	19,776	0.9	21,047	1.0
		石油・石炭	12,260	0.6	10,260	0.5
		窯業・土石	29,338	1.3	29,168	1.5
		鉄鋼	68,000	3.1	79,550	4.0
		非鉄金属	6,258	0.3	5,902	0.3
		金属製品	504	0.0	958	0.0
		はん用・生産用・業務用機械	35,078	1.6	24,199	1.2
		電気機械	69,678	3.2	60,087	3.0
		輸送用機械	15,811	0.7	15,331	0.8
		その他の製造業	9,452	0.4	9,167	0.5
	農業、林業		－	－	－	－
	漁業		－	－	－	－
	鉱業、採石業、砂利採取業		－	－	－	－
	建設業		10,212	0.5	8,852	0.4
	電気・ガス・熱供給・水道業		459,096	20.8	434,447	21.6
	情報通信業		60,566	2.7	41,266	2.1
	運輸業、郵便業		248,850	11.3	249,361	12.4
	卸売業		398,969	18.1	328,398	16.4
	小売業		11,137	0.5	9,694	0.5
	金融業、保険業		368,454	16.7	293,218	14.6
	不動産業		120,239	5.5	138,663	6.9
	物品賃貸業		104,476	4.7	102,091	5.1
	学術研究、専門・技術サービス業		844	0.0	200	0.0
	宿泊業		－	－	－	－
	飲食業		－	－	－	－
	生活関連サービス業・娯楽業		3,805	0.2	3,831	0.2
	教育、学習支援業		－	－	－	－
	医療・福祉		150	0.0	1,150	0.1
	その他のサービス		3,690	0.2	3,204	0.2
	地方公共団体		23,809	1.1	21,448	1.1
	個人（住宅・消費・納税資金等）		442	0.0	－	－
	その他		200	0.0	133	0.0
	合計		2,149,978	97.5	1,961,319	97.7
海外向け	政府等		－	－	－	－
	金融機関		11,544	0.5	8,544	0.4
	商工業等		42,453	1.9	37,912	1.9
	合計		53,998	2.5	46,456	2.3
一般貸付計			2,203,976	100.0	2,007,776	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。

３．海外投融資関係（一般勘定）

（１）資産別明細

①外貨建資産　（単位：百万円、％）

区　　分	2017年度末		2018年度末	
	金　額	占　率	金　額	占　率
公社債	7,670,095	70.3	8,132,626	74.7
株式	854,472	7.8	785,620	7.2
現預金・その他	413,569	3.8	212,957	2.0
小計	8,938,137	82.0	9,131,204	83.8

②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年度末	
	金　額	占　率	金　額	占　率
公社債	－	－	－	－
現預金・その他	301,575	2.8	290,596	2.7
小計	301,575	2.8	290,596	2.7

③円貨建資産　（単位：百万円、％）

区　　分	2017年度末		2018年度末	
	金　額	占　率	金　額	占　率
非居住者貸付	36,545	0.3	29,942	0.3
公社債（円建外債）･その他	1,627,922	14.9	1,439,637	13.2
小計	1,664,467	15.3	1,469,579	13.5

④合　計　（単位：百万円、％）

区　　分	2017年度末		2018年度末	
	金　額	占　率	金　額	占　率
海外投融資	10,904,181	100.0	10,891,380	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

（単位：百万円、％）

区　　分	2017年度末		2018年度末	
	金　額	占　率	金　額	占　率
米ドル	4,665,738	52.2	4,699,602	51.5
ユーロ	2,236,863	25.0	2,353,535	25.8
オーストラリアドル	655,013	7.3	598,275	6.6
イギリスポンド	269,558	3.0	304,560	3.3
メキシコペソ	138,580	1.6	236,425	2.6
ニュージーランドドル	208,633	2.3	170,931	1.9
ポーランドズロチ	192,438	2.2	160,308	1.8
その他共計	8,938,137	100.0	9,131,204	100.0

（３）海外投融資の地域別構成

（単位：百万円、％）

区分		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
2017年度末	北米	4,019,420	40.4	3,644,056	42.8	375,364	26.4	9,731	18.0
	ヨーロッパ	3,168,884	31.9	2,936,942	34.5	231,941	16.3	11,112	20.6
	オセアニア	814,234	8.2	775,313	9.1	38,921	2.7	5,000	9.3
	アジア	255,259	2.6	121,359	1.4	133,899	9.4	2,130	3.9
	中南米	1,493,860	15.0	852,399	10.0	641,461	45.1	26,024	48.2
	中東	18,126	0.2	18,126	0.2	－	－	－	－
	アフリカ	21,610	0.2	21,099	0.2	511	0.0	－	－
	国際機関	151,228	1.5	151,228	1.8	－	－	－	－
	合計	9,942,625	100.0	8,520,524	100.0	1,422,100	100.0	53,998	100.0
2018年度末	北米	4,192,980	41.4	3,892,340	43.6	300,640	25.3	8,864	19.1
	ヨーロッパ	3,263,628	32.2	3,020,627	33.8	243,001	20.4	5,464	11.8
	オセアニア	726,696	7.2	687,722	7.7	38,974	3.3	5,000	10.8
	アジア	291,551	2.9	174,600	2.0	116,950	9.8	1,255	2.7
	中南米	1,500,896	14.8	1,011,520	11.3	489,375	41.1	25,872	55.7
	中東	178	0.0	－	－	178	0.0	－	－
	アフリカ	198	0.0	－	－	198	0.0	－	－
	国際機関	146,665	1.4	146,665	1.6	－	－	－	－
	合計	10,122,795	100.0	8,933,476	100.0	1,189,319	100.0	46,456	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。

４．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）

（単位：百万円）

区　　分	2017年度末						2018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	△ 12,843	178,877	△ 24	－	－	166,008	13,289	△ 5,068	－	－	－	8,220
ヘッジ会計非適用分	△ 8,379	△ 5,452	△ 968	△ 453	639	△ 14,613	△ 8,118	△ 14,724	△ 6,842	5,255	78	△ 24,350
合　　計	△ 21,223	173,424	△ 993	△ 453	639	151,394	5,170	△ 19,792	△ 6,842	5,255	78	△ 16,130

（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。
2017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162,282百万円、株式関連△24百万円）及び
ヘッジ会計非適用分の差損益（△14,613百万円）の合計147,643百万円
2018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△12,770百万円）及び
ヘッジ会計非適用分の差損益（△24,350百万円）の合計△37,121百万円

（２）時価情報（ヘッジ会計非適用分）

①金利関連

（単位：百万円）

区分	種　　類	2017年度末				2018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	円建金利スワップ								
	固定金利受取／変動金利支払	121,000	121,000	986	986	31,000	31,000	805	805
	固定金利支払／変動金利受取	61,000	34,000	△ 2	△ 2	62,000	46,000	△ 849	△ 849
	外貨建金利スワップ								
	固定金利支払／変動金利受取	－	－	－	－	114,319	58,824	△ 1,549	△ 1,549
	円建金利スワップション								
	売建								
	固定金利受取／変動金利支払	10,000	－			－	－		
		(19)	(－)	19	△ 0	(－)	(－)	－	－
	固定金利支払／変動金利受取	10,000	－			－	－		
		(39)	(－)	0	38	(－)	(－)	－	－
	買建								
	固定金利支払／変動金利受取	1,130,000	705,000			1,430,000	1,270,000		
		(11,670)	(4,579)	2,268	△ 9,401	(7,285)	(6,064)	761	△ 6,524
合　　計					△ 8,379				△ 8,118

（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	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
円建受取側固定スワップ想定元本	－	－	－	－	21,000	100,000	121,000
平均受取固定金利	－	－	－	－	0.25	0.67	0.60
平均支払変動金利	－	－	－	－	0.02	△ 0.00	0.00
円建支払側固定スワップ想定元本	27,000	16,000	10,000	－	－	8,000	61,000
平均支払固定金利	△ 0.13	△ 0.14	0.09	－	－	0.82	0.03
平均受取変動金利	0.01	0.00	0.02	－	－	0.01	0.01
外貨建支払側固定スワップ想定元本	－	－	－	－	－	－	－
平均支払固定金利	－	－	－	－	－	－	－
平均受取変動金利	－	－	－	－	－	－	－
合　　計	27,000	16,000	10,000	－	21,000	108,000	182,000

区　　分	2018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
円建受取側固定スワップ想定元本	－	－	－	－	21,000	10,000	31,000
平均受取固定金利	－	－	－	－	0.25	0.64	0.37
平均支払変動金利	－	－	－	－	0.00	0.01	0.01
円建支払側固定スワップ想定元本	16,000	－	32,000	－	－	14,000	62,000
平均支払固定金利	△ 0.14	－	0.03	－	－	0.69	0.14
平均受取変動金利	0.01	－	△ 0.00	－	－	0.01	0.00
外貨建支払側固定スワップ想定元本	55,495	55,495	－	－	－	3,329	114,319
平均支払固定金利	2.92	2.96	－	－	－	3.00	2.94
平均受取変動金利	2.61	2.61	－	－	－	2.72	2.61
合　　計	71,495	55,495	32,000	－	21,000	27,329	207,319

②通貨関連

（単位：百万円）

区分	種　類	2017年度末 契約額等	2017年度末 時価	2017年度末 差損益	2018年度末 契約額等	2018年度末 時価	2018年度末 差損益
店頭	為替予約						
	売建	2,486,021	19,645	19,645	1,396,821	△ 3,796	△ 3,796
	（米ドル）	1,185,073	1,876	1,876	548,856	△ 5,787	△ 5,787
	（ユーロ）	739,523	9,606	9,606	415,446	1,820	1,820
	（オーストラリアドル）	260,895	6,061	6,061	99,060	628	628
	（イギリスポンド）	29,672	308	308	27,726	△ 732	△ 732
	（カナダドル）	81,880	803	803	13,979	17	17
	（その他）	188,975	989	989	291,752	256	256
	買建	2,390,220	△ 29,000	△ 29,000	959,220	△ 1,237	△ 1,237
	（米ドル）	1,131,508	△ 7,486	△ 7,486	466,740	2,126	2,126
	（ユーロ）	805,963	△ 17,312	△ 17,312	243,773	△ 3,310	△ 3,310
	（オーストラリアドル）	207,906	△ 3,152	△ 3,152	8,142	△ 42	△ 42
	（カナダドル）	57,305	△ 290	△ 290	3,606	－	－
	（イギリスポンド）	11,133	△ 30	△ 30	－	－	－
	（その他）	176,402	△ 728	△ 728	236,956	△ 11	△ 11
	通貨オプション						
	売建						
	プット	251,112			100,900		
		(11,351)	9,466	1,885	(2,914)	276	2,638
	（米ドル）	251,112			100,900		
		(11,351)	9,466	1,885	(2,914)	276	2,638
	買建						
	コール	10,076			－		
		(－)	－	－	(－)	－	－
	（米ドル）	10,076			－		
		(－)	－	－	(－)	－	－
	プット	719,375			821,224		
		(14,112)	16,130	2,017	(16,676)	4,348	△ 12,327
	（米ドル）	708,956			779,801		
		(14,059)	16,130	2,070	(16,223)	3,968	△ 12,255
	（イギリスポンド）	10,418			41,422		
		(53)	－	△ 53	(452)	379	△ 72
合　計				△ 5,452			△ 14,724

（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．各期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。

③株式関連

（単位：百万円）

区分	種類	2017年度末 契約額等	2017年度末 時価	2017年度末 差損益	2018年度末 契約額等	2018年度末 時価	2018年度末 差損益
取引所	円建株価指数オプション						
	買建						
	プット	149,967 (4,391)	3,538	△ 853	150,000 (6,363)	1,625	△ 4,738
	外貨建株価指数オプション						
	買建						
	プット	49,761 (1,394)	1,278	△ 115	59,028 (2,280)	177	△ 2,103
合計				△ 968			△ 6,842

（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。

④債券関連

（単位：百万円）

区分	種類	2017年度末 契約額等	2017年度末 時価	2017年度末 差損益	2018年度末 契約額等	2018年度末 時価	2018年度末 差損益
取引所	円建債券先物						
	売建	16,603	18	18	48,974	△ 74	△ 74
	外貨建債券先物						
	売建	467,001	△ 5,904	△ 5,904	271,908	△ 3,705	△ 3,705
	買建	527,241	5,431	5,431	380,803	8,423	8,423
	外貨建債券先物オプション						
	買建						
	コール	50,995 (351)	531	179	－ (－)	－	－
	プット	50,995 (298)	39	△ 258	－ (－)	－	－
店頭	外貨建債券先渡契約						
	売建	80,181	△ 512	△ 512	5,814	△ 51	△ 51
	買建	108,853	277	277	26,979	209	209
	円建債券店頭オプション						
	売建						
	コール	4,977 (29)	41	△ 12	40,490 (34)	58	△ 24
	プット	92,197 (422)	274	147	173,973 (252)	59	193
	買建						
	コール	92,197 (269)	458	189	173,973 (192)	519	326
	プット	4,977 (44)	36	△ 8	40,490 (43)	1	△ 41
合計				△ 453			5,255

（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。

⑤その他

（単位：百万円）

区分	種類	2017年度末 契約額等	うち1年超	時価	差損益	2018年度末 契約額等	うち1年超	時価	差損益
店頭	クレジット・デフォルト・スワップ								
	プロテクション売建	32,000	29,000	617	617	24,000	11,500	208	208
	プロテクション買建	1,000	1,000	22	22	5,800	5,800	△ 130	△ 130
合計					639				78

（注）差損益欄には、時価を記載しています。

（３）時価情報（ヘッジ会計適用分）

①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	うち1年超	時価	差損益	2018年度末 契約額等	うち1年超	時価	差損益
原則的処理方法	円建金利スワップ									
	固定金利受取／変動金利支払	貸付金	4,000	4,000	△ 7	△ 7	14,450	14,450	116	116
	固定金利受取／変動金利支払	保険負債	600,000	600,000	△ 10,484	△ 10,484	700,000	700,000	15,672	15,672
金利スワップの特例処理	円建金利スワップ									
	固定金利受取／変動金利支払	貸付金	16,800	15,300	137	137	15,300	15,300	203	203
	固定金利支払／変動金利受取	借入金	283,000	283,000	△ 2,489	△ 2,489	283,000	283,000	△ 2,703	△ 2,703
合計						△ 12,843				13,289

（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	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
円建受取側固定スワップ想定元本	1,500	3,000	8,000	6,000	2,300	600,000	620,800
平均受取固定金利	0.37	0.46	0.04	△ 0.02	1.19	0.43	0.42
平均支払変動金利	0.01	△ 0.02	0.03	△ 0.00	0.07	0.01	0.01
円建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	－	0.12	0.12	－	－	－	0.12
合計	1,500	142,000	152,000	6,000	2,300	600,000	903,800

区分	2018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
円建受取側固定スワップ想定元本	－	7,000	10,450	2,300	10,000	700,000	729,750
平均受取固定金利	－	0.17	0.04	1.19	0.10	0.47	0.45
平均支払変動金利	－	△ 0.01	0.03	0.07	△ 0.08	0.00	0.00
円建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	－	0.13	0.13	－	－	－	0.13
合計	－	146,000	154,450	2,300	10,000	700,000	1,012,750

②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 契約額等	2017年度末 契約額等 うち1年超	2017年度末 時価	2017年度末 差損益	2018年度末 契約額等	2018年度末 契約額等 うち1年超	2018年度末 時価	2018年度末 差損益
原則的処理方法	通貨スワップ	外貨建債券	273,422	250,038	16,595	16,595	256,613	212,995	7,701	7,701
	（米ドル）		199,735	176,351	17,303	17,303	181,959	149,098	5,178	5,178
	（ユーロ）		61,568	61,568	△ 1,226	△ 1,226	62,543	51,786	1,720	1,720
	（イギリスポンド）		12,119	12,119	517	517	12,110	12,110	803	803
ヘッジ対象に係る損益を認識する方法	為替予約									
	売建		5,252,956	－	163,366	163,366	4,970,497	－	△ 12,710	△ 12,710
	（米ドル）		2,792,212	－	100,027	100,027	2,408,422	－	△ 34,423	△ 34,423
	（ユーロ）		1,422,032	－	28,035	28,035	1,591,097	－	26,561	26,561
	（オーストラリアドル）		360,649	－	15,883	15,883	341,336	－	△ 1,842	△ 1,842
	（イギリスポンド）		132,251	－	2,504	2,504	141,192	－	△ 3,380	△ 3,380
	（カナダドル）		112,785	－	7,260	7,260	62,405	－	△ 36	△ 36
	（その他）		433,024	－	9,654	9,654	426,043	－	409	409
	買建		118,466	－	△ 2,217	△ 2,217	16,165	－	△ 59	△ 59
	（米ドル）		118,253	－	△ 2,214	△ 2,214	15,458	－	△ 53	△ 53
	（ユーロ）		83	－	△ 1	△ 1	341	－	△ 5	△ 5
	（オーストラリアドル）		－	－	－	－	291	－	△ 0	△ 0
	（イギリスポンド）	外貨建債券	62	－	△ 0	△ 0	－	－	－	－
	（その他）		67	－	△ 1	△ 1	73	－	△ 0	△ 0
	通貨オプション									
	売建									
	コール		93,057	－			－	－		
			(1,686)	(－)	824	861	(－)	(－)	－	－
	（米ドル）		93,057	－			－	－		
			(1,686)	(－)	824	861	(－)	(－)	－	－
	買建									
	プット		93,057	－			－	－		
			(1,686)	(－)	1,958	271	(－)	(－)	－	－
	（米ドル）		93,057	－			－	－		
			(1,686)	(－)	1,958	271	(－)	(－)	－	－
為替予約等の振当処理	為替予約									
	売建	外貨建定期預金	262,693	－	－	－	252,646	－	－	－
	（米ドル）		32,904	－	－	－	103,525	－	－	－
	（オーストラリアドル）		119,405	－	－	－	79,522	－	－	－
	（その他）		110,383	－	－	－	69,597	－	－	－
	通貨スワップ	外貨建社債（負債）	476,277	476,277	－	－	476,277	476,277	－	－
	（米ドル）		476,277	476,277	－	－	476,277	476,277	－	－
	通貨スワップ	外貨建貸付金	38,081	38,081	－	－	37,142	33,598	－	－
	（米ドル）		32,116	32,116	－	－	31,178	27,633	－	－
	（ユーロ）		5,964	5,964	－	－	5,964	5,964	－	－
合　計						178,877				△ 5,068

（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．各期末の為替相場は先物相場を使用しています。
３．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に含めて記載しています。
４．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、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。（注３．を除く）

③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	2017年度末				2018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	9,559	－	△ 24	△ 24	－	－	－	－
合　　計						△ 24				－

（注）差損益欄には、時価を記載しています。

④債券関連

2017年度末、2018年度末ともに期末残高がないため、記載していません。

⑤その他

2017年度末、2018年度末ともに期末残高がないため、記載していません。