

2016年11月28日

各 位

会 社 名 第一生命ホールディングス株式会社
 代表者名 代表取締役社長 渡邊 光一郎
 (コード番号: 8750 東証第一部)
 問合せ先 経営企画ユニット I Rグループ
 (TEL 050-3780-6930)

(訂正)「2016年9月末ヨーロッパ・エンベディッド・バリュアの開示について」の一部訂正について

2016年11月18日に公表しました「2016年9月末ヨーロッパ・エンベディッド・バリュアの開示について」の記載事項の一部に誤りがありましたので、以下のとおり訂正させていただきます。

なお、本訂正による第一生命グループのヨーロッパ・エンベディッド・バリュア (EEV) への影響はありません。

訂正箇所 (訂正箇所には下線を付して表示しています)

P. 44 付録B EEV計算における主な前提条件 (第一生命、第一フロンティア生命、ネオファースト生命、TAL)

1. 経済前提 (2) 主な動的前提 ① 金利モデル

○金利スワップションのインプライド・ボラティリティ

(訂正前)

		2016年3月31日				2016年9月30日			
オプション 期間	スワップ 期間	日本 円 (換算後)	米 ドル	ユーロ	豪 ドル	日本 円	米 ドル	ユーロ	豪 ドル
5年	5年	-	42.4%	70.3%	28.8%	29.5%	52.3%	104.6%	29.6%
5年	7年	38.8%	40.4%	63.1%	27.7%	30.5%	49.5%	87.4%	30.5%
5年	10年	39.7%	38.4%	58.7%	25.9%	32.0%	46.6%	78.0%	29.5%
7年	5年	40.3%	38.4%	56.0%	26.1%	31.9%	47.3%	73.5%	29.4%
7年	7年	40.2%	37.0%	53.7%	25.0%	32.3%	45.6%	69.2%	28.5%
7年	10年	40.8%	34.7%	53.6%	23.6%	33.0%	45.2%	67.6%	27.6%
10年	5年	-	33.8%	50.5%	23.5%	34.7%	37.6%	64.1%	29.0%
10年	7年	-	32.7%	51.5%	22.6%	34.7%	36.9%	64.9%	27.7%
10年	10年	42.3%	32.1%	53.5%	21.5%	35.0%	39.2%	-	26.7%

(データ: Bloomberg)

(訂正後)

		2016年3月31日				2016年9月30日			
オプション 期間	スワップ 期間	日本 円 (換算後)	米 ドル	ユーロ	豪 ドル	日本 円	米 ドル	ユーロ	豪 ドル
5年	5年	-	42.4%	70.3%	28.8%	29.5bp	52.3%	104.6%	29.6%
5年	7年	38.8bp	40.4%	63.1%	27.7%	30.5bp	49.5%	87.4%	30.5%
5年	10年	39.7bp	38.4%	58.7%	25.9%	32.0bp	46.6%	78.0%	29.5%
7年	5年	40.3bp	38.4%	56.0%	26.1%	31.9bp	47.3%	73.5%	29.4%
7年	7年	40.2bp	37.0%	53.7%	25.0%	32.3bp	45.6%	69.2%	28.5%
7年	10年	40.8bp	34.7%	53.6%	23.6%	33.0bp	45.2%	67.6%	27.6%
10年	5年	-	33.8%	50.5%	23.5%	34.7bp	37.6%	64.1%	29.0%
10年	7年	-	32.7%	51.5%	22.6%	34.7bp	36.9%	64.9%	27.7%
10年	10年	42.3bp	32.1%	53.5%	21.5%	35.0bp	39.2%	-	26.7%

(データ: Bloomberg)