

平成31年2月14日

各位

会社名 株式会社T&Dホールディングス
代表者名 代表取締役社長 上原 弘久
(コード番号 8795 東証第一部)

平成31年3月期 第3四半期決算補足資料 (T&Dフィナンシャル生命保険株式会社分)

NEWS RELEASE



T&Dフィナンシャル生命



平成31年2月14日

各 位

T&Dフィナンシャル生命保険株式会社
代表取締役社長 板坂 雅文

平成31年3月期第3四半期決算のお知らせ

T&D保険グループの、T&Dフィナンシャル生命保険株式会社(社長 板坂 雅文)の平成31年3月期第3四半期決算(平成30年4月1日～平成30年12月31日)の業績は添付のとおりであります。

<目次>

| | | | |
|--------------------|-------|----|---|
| 1. 主要業績 | | 1 | 頁 |
| 2. 資産運用の実績(一般勘定) | | 3 | 頁 |
| 3. 四半期貸借対照表 | | 8 | 頁 |
| 4. 四半期損益計算書 | | 12 | 頁 |
| 5. 経常利益等の明細(基礎利益) | | 14 | 頁 |
| 6. ソルベンシー・マージン比率 | | 16 | 頁 |
| 7. 実質純資産 | | 16 | 頁 |
| 8. 特別勘定の状況 | | 17 | 頁 |
| 9. 保険会社及びその子会社等の状況 | | 17 | 頁 |

※本資料において、百分率は、表示未満を四捨五入しております。この端数処理により、各百分率の合計が100%にならないことがあります。

以 上

本件に関するお問い合わせ先

T&Dフィナンシャル生命保険株式会社

企画部 広報課

東京都港区芝浦1-1-1 〒105-0023

電話：03-6745-6808



T&D保険グループ

1. 主要業績

(1) 保有契約高及び新契約高

①保有契約高

(単位：千件、億円、%)

| 区 分 | 前事業年度末 (平成30年3月31日) | | 当第3四半期会計期間末 (平成30年12月31日) | | | |
|--------|------------------------|--------|------------------------------|-------|--------|-------|
| | 件数 | 金額 | 件数 | 前年度末比 | 金額 | 前年度末比 |
| 個人保険 | 234 | 18,801 | 243 | 104.1 | 19,910 | 105.9 |
| 個人年金保険 | 42 | 1,725 | 38 | 89.9 | 1,578 | 91.5 |
| 小計 | 276 | 20,527 | 281 | 102.0 | 21,489 | 104.7 |
| 団体保険 | — | 0 | — | — | 0 | 76.8 |
| 団体年金保険 | — | 22 | — | — | 21 | 94.2 |

(注) 1. 個人年金保険は、年金支払開始前契約の年金支払開始時における年金原資（ただし、変額個人年金保険は、責任準備金（最低保証に係る部分を除く））と年金支払開始後契約の責任準備金の合計であります。

2. 団体年金保険は、責任準備金の金額であります。

②新契約高

(単位：千件、億円、%)

| 区 分 | 前第3四半期累計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年12月31日) | | | | | |
|--------|--|-------|-------|-------|-------|--------------|
| | 件数 | 前年同期比 | 金額 | 前年同期比 | 新契約 | 転換による 純増加 |
| 個人保険 | 25 | 214.7 | 2,736 | 176.3 | 2,736 | — |
| 個人年金保険 | 0 | — | 0 | — | 0 | — |
| 小計 | 25 | 214.7 | 2,736 | 176.3 | 2,736 | — |
| 団体保険 | — | — | — | — | — | — |
| 団体年金保険 | — | — | — | — | — | — |

(単位：千件、億円、%)

| 区 分 | 当第3四半期累計期間 (自 平成30年4月1日 至 平成30年12月31日) | | | | | |
|--------|--|-----------|-------|----------|-------|--------------|
| | 件数 | 前年同期比 | 金額 | 前年同期比 | 新契約 | 転換による 純増加 |
| 個人保険 | 19 | 76.4 | 2,397 | 87.6 | 2,397 | — |
| 個人年金保険 | 1 | 122,900.0 | 85 | 81,692.0 | 85 | — |
| 小計 | 20 | 81.2 | 2,482 | 90.7 | 2,482 | — |
| 団体保険 | — | — | — | — | — | — |
| 団体年金保険 | — | — | — | — | — | — |

(注) 1. 転換は、平成13年度より取り扱っておりません。

2. 個人年金保険は、年金支払開始時における年金原資であります。

(2) 年換算保険料

①保有契約

(単位：百万円、%)

| 区 分 | 前事業年度末 (平成30年3月31日) | 当第3四半期会計期間末 (平成30年12月31日) | |
|----------------|------------------------|------------------------------|-------|
| | | 前年度末比 | |
| 個人保険 | 92,855 | 95,732 | 103.1 |
| 個人年金保険 | 23,214 | 19,929 | 85.8 |
| 合計 | 116,070 | 115,661 | 99.6 |
| うち医療保障・生前給付保障等 | 2,561 | 2,560 | 100.0 |

②新契約

(単位：百万円、%)

| 区 分 | 前第3四半期累計期間 (自平成29年4月1日 至平成29年12月31日) | | 当第3四半期累計期間 (自平成30年4月1日 至平成30年12月31日) | |
|----------------|--|-------|--|----------|
| | 前年同期比 | | 前年同期比 | |
| 個人保険 | 11,126 | 207.2 | 7,343 | 66.0 |
| 個人年金保険 | 2 | — | 1,418 | 70,921.7 |
| 合計 | 11,128 | 207.2 | 8,761 | 78.7 |
| うち医療保障・生前給付保障等 | 135 | 326.9 | 155 | 114.2 |

(注) 1. 年換算保険料とは、1回あたりの保険料について保険料の支払方法に応じた係数を乗じ、1年あたりの保険料に換算した金額であります(一時払契約等は、保険料を保険期間で除した金額)。

2. うち医療保障・生前給付保障等欄には、医療保障給付(入院給付、手術給付等)、生前給付保障給付(特定疾病給付、介護給付等)、保険料払込免除給付(障害を事由とするものは除く。特定疾病罹患、介護等を事由とするものを含む。)等に該当する部分の年換算保険料を計上しております。

(3) 解約失効高

(単位：千件、億円、%)

| 区 分 | 前第3四半期累計期間 (自平成29年4月1日 至平成29年12月31日) | | | |
|--------|--|-------|-------|-------|
| | 件数 | | 金額 | |
| | 前年同期比 | | 前年同期比 | |
| 個人保険 | 4 | 115.0 | 449 | 124.4 |
| 個人年金保険 | 0 | 134.6 | 60 | 133.6 |
| 合計 | 5 | 117.3 | 510 | 125.4 |

(単位：千件、億円、%)

| 区 分 | 当第3四半期累計期間 (自平成30年4月1日 至平成30年12月31日) | | | |
|--------|--|-------|-------|-------|
| | 件数 | | 金額 | |
| | 前年同期比 | | 前年同期比 | |
| 個人保険 | 5 | 113.5 | 637 | 141.9 |
| 個人年金保険 | 0 | 55.3 | 27 | 46.1 |
| 合計 | 6 | 105.7 | 665 | 130.5 |

(4) 解約失効率(対年度始)

(単位：%)

| 区 分 | 前第3四半期累計期間 (自平成29年4月1日 至平成29年12月31日) | 当第3四半期累計期間 (自平成30年4月1日 至平成30年12月31日) |
|--------|--|--|
| 個人保険 | 2.69 | 3.39 |
| 個人年金保険 | 2.87 | 1.62 |
| 合計 | 2.71 | 3.24 |

(注) 解約失効率(対年度始)は年換算しておりません。

2. 資産運用の実績（一般勘定）

（1）資産の構成

（単位：百万円、％）

| 区 分 | 前事業年度末 (平成30年3月31日) | | 当第3四半期会計期間末 (平成30年12月31日) | |
|-------------|------------------------|-------|------------------------------|-------|
| | 金額 | 構成比 | 金額 | 構成比 |
| 現預金・コールローン | 110,069 | 8.3 | 120,920 | 8.7 |
| 買現先勘定 | — | — | — | — |
| 債券貸借取引支払保証金 | — | — | — | — |
| 買入金銭債権 | — | — | — | — |
| 商品有価証券 | — | — | — | — |
| 金銭の信託 | 684,632 | 51.8 | 735,038 | 53.1 |
| 有価証券 | 498,229 | 37.7 | 500,000 | 36.1 |
| 公社債 | 416,977 | 31.6 | 405,571 | 29.3 |
| 株式 | 129 | 0.0 | 128 | 0.0 |
| 外国証券 | 35,515 | 2.7 | 48,965 | 3.5 |
| 公社債 | 35,515 | 2.7 | 48,965 | 3.5 |
| 株式等 | — | — | — | — |
| その他の証券 | 45,606 | 3.5 | 45,334 | 3.3 |
| 貸付金 | 3,278 | 0.2 | 3,128 | 0.2 |
| 保険約款貸付 | 3,277 | 0.2 | 3,127 | 0.2 |
| 一般貸付 | 1 | 0.0 | 1 | 0.0 |
| 不動産 | 5 | 0.0 | 11 | 0.0 |
| 繰延税金資産 | 7,590 | 0.6 | 6,347 | 0.5 |
| その他 | 17,026 | 1.3 | 18,343 | 1.3 |
| 貸倒引当金 | △ 0 | △ 0.0 | △ 0 | △ 0.0 |
| 合計 | 1,320,831 | 100.0 | 1,383,789 | 100.0 |
| うち外貨建資産 | 276,297 | 20.9 | 358,830 | 25.9 |

(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 | 前事業年度末 (平成30年3月31日) | | | | | 当第3四半期会計期間末 (平成30年12月31日) | | | | |
|------------|------------------------|-----------|---------|---------|-------|------------------------------|-----------|---------|---------|-------|
| | 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 | 268,984 | 304,987 | 36,002 | 36,731 | 728 | 249,245 | 283,796 | 34,551 | 35,182 | 631 |
| 公社債 | 230,692 | 266,543 | 35,850 | 36,135 | 284 | 219,416 | 253,603 | 34,186 | 34,441 | 254 |
| 金銭の信託 | 38,291 | 38,443 | 151 | 595 | 443 | 29,828 | 30,193 | 365 | 741 | 376 |
| 責任準備金対応債券 | 777,356 | 845,505 | 68,149 | 69,497 | 1,348 | 822,170 | 897,187 | 75,016 | 75,536 | 519 |
| 公社債 | 171,886 | 202,684 | 30,798 | 30,948 | 150 | 161,863 | 191,064 | 29,200 | 29,314 | 113 |
| 金銭の信託 | 605,469 | 642,820 | 37,351 | 38,548 | 1,197 | 660,306 | 706,122 | 45,815 | 46,222 | 406 |
| 子会社・関連会社株式 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |
| その他有価証券 | 129,264 | 131,078 | 1,814 | 2,819 | 1,005 | 155,189 | 158,262 | 3,073 | 3,756 | 683 |
| 公社債 | 13,670 | 14,397 | 726 | 726 | 0 | 23,020 | 24,290 | 1,270 | 1,271 | 1 |
| 株式 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |
| 外国証券 | 34,842 | 35,515 | 673 | 811 | 137 | 47,470 | 48,965 | 1,494 | 1,608 | 113 |
| 公社債 | 34,842 | 35,515 | 673 | 811 | 137 | 47,470 | 48,965 | 1,494 | 1,608 | 113 |
| 株式等 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |
| その他の証券 | 45,000 | 45,606 | 606 | 678 | 72 | 45,000 | 45,334 | 334 | 412 | 77 |
| 買入金銭債権 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |
| 譲渡性預金 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |
| 金銭の信託 | 35,751 | 35,558 | △ 193 | 602 | 795 | 39,698 | 39,671 | △ 26 | 463 | 490 |
| 合計 | 1,175,605 | 1,281,571 | 105,965 | 109,047 | 3,081 | 1,226,605 | 1,339,246 | 112,641 | 114,476 | 1,834 |
| 公社債 | 416,250 | 483,626 | 67,375 | 67,811 | 435 | 404,301 | 468,958 | 64,657 | 65,027 | 369 |
| 株式 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |
| 外国証券 | 34,842 | 35,515 | 673 | 811 | 137 | 47,470 | 48,965 | 1,494 | 1,608 | 113 |
| 公社債 | 34,842 | 35,515 | 673 | 811 | 137 | 47,470 | 48,965 | 1,494 | 1,608 | 113 |
| 株式等 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |
| その他の証券 | 45,000 | 45,606 | 606 | 678 | 72 | 45,000 | 45,334 | 334 | 412 | 77 |
| 買入金銭債権 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |
| 譲渡性預金 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |
| 金銭の信託 | 679,513 | 716,822 | 37,309 | 39,746 | 2,436 | 729,833 | 775,987 | 46,154 | 47,427 | 1,273 |

(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おります。

2. その他有価証券の外国証券(公社債)及び金銭の信託のうち、外貨建債券の差損益は、外貨ベースでの評価差額を決算時の為替相場で換算した金額を計上しております。(為替相場の変動による換算差額は(四半期)損益計算書に計上しております。)

・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あります。

(単位: 百万円)

| 区 分 | 前事業年度末 (平成30年3月31日) | 当第3四半期会計期間末 (平成30年12月31日) |
|--------------------|------------------------|------------------------------|
| 満期保有目的の債券 | — | — |
| 非上場外国債券 | — | — |
| 責任準備金対応債券 | — | — |
| 子会社・関連会社株式 | — | — |
| その他有価証券 | 129 | 128 |
| 非上場国内株式(店頭売買株式を除く) | 129 | 128 |
| 非上場外国株式(店頭売買株式を除く) | — | — |
| 非上場外国債券 | — | — |
| 合計 | 129 | 128 |

(3) 金銭の信託の時価情報

(単位：百万円)

| 区 分 | 前事業年度末 (平成30年3月31日) | | | | | 当第3四半期会計期間末 (平成30年12月31日) | | | | |
|-------|------------------------|---------|--------|--------|-------|------------------------------|---------|--------|--------|-----|
| | 貸借対照表 計上額 | 時価 | 差損益 | 差益 | | 四半期貸借対照表 計上額 | 時価 | 差損益 | 差益 | |
| | | | | 差益 | 差損 | | | | 差益 | 差損 |
| 金銭の信託 | 684,632 | 722,135 | 37,502 | 39,144 | 1,641 | 735,038 | 781,219 | 46,181 | 46,964 | 782 |

・運用目的の金銭の信託

(単位：百万円)

| 区 分 | 前事業年度末 (平成30年3月31日) | | 当第3四半期会計期間末 (平成30年12月31日) | |
|----------------|------------------------|--------------------|------------------------------|--------------------|
| | 貸借対照表 計上額 | 当期の損益に含まれた 評価損益 | 四半期貸借対照表 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 | 5,312 | 720 | 5,232 | 712 |

・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 | 前事業年度末 (平成30年3月31日) | | | | | 当第3四半期会計期間末 (平成30年12月31日) | | | | |
|-------------------|------------------------|---------|--------|--------|-------|------------------------------|---------|--------|--------|-----|
| | 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 | 38,291 | 38,443 | 151 | 595 | 443 | 29,828 | 30,193 | 365 | 741 | 376 |
| 責任準備金対応の 金銭の信託 | 605,469 | 642,820 | 37,351 | 38,548 | 1,197 | 660,306 | 706,122 | 45,815 | 46,222 | 406 |
| その他の 金銭の信託 | 35,751 | 35,558 | △ 193 | 602 | 795 | 39,698 | 39,671 | △ 26 | 463 | 490 |

(注) その他の金銭の信託のうち、外貨建債券の差損益は、外貨ベースでの評価差額を決算時の為替相場で換算した金額を計上しております。
(為替相場の変動による換算差額は(四半期)損益計算書に計上しております。)

(4) 土地等の時価情報

前事業年度末、当第3四半期会計期間末とも残高はありません。

(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)

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 | 前事業年度末 (平成30年3月31日) | | | | | |
|-----------|------------------------|---------|---------|------|-----|-------|
| | 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 | 8,962 | △ 1,352 | △ 3,203 | — | — | 4,406 |
| 合計 | 8,962 | △ 1,352 | △ 3,203 | — | — | 4,406 |

(単位：百万円)

| 区 分 | 当第3四半期会計期間末 (平成30年12月31日) | | | | | |
|-----------|------------------------------|-------|---------|------|-----|-------|
| | 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 | 9,814 | △ 310 | △ 2,509 | — | — | 6,994 |
| 合計 | 9,814 | △ 310 | △ 2,509 | — | — | 6,994 |

(注) 1. ヘッジ会計非適用分の差損益は、(四半期)損益計算書に計上されております。
2. 金利関連、通貨関連(為替予約及び通貨スワップ)は、管理信託を用いてデリバティブ取引を行っております。
3. 通貨関連(為替予約及び通貨オプション)、株式関連は、金銭の信託内においてデリバティブ取引を行っております。

②金利関連

(単位：百万円)

| 区分 | 取引の種類 | 前事業年度末 (平成30年3月31日) | | | | 当第3四半期会計期間末 (平成30年12月31日) | | | |
|-----------|-------------------|------------------------|--------|-------|-------|------------------------------|--------|-------|-------|
| | | 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 |
| 市場取引以外の取引 | 金利スワップ | | | | | | | | |
| | 固定金利受取/ 変動金利支払 | 17,731 | 16,778 | 8,962 | 8,962 | 16,166 | 15,274 | 9,814 | 9,814 |
| | (豪ドル/豪ドル) | 17,039 | 16,104 | 8,907 | 8,907 | 15,462 | 14,590 | 9,741 | 9,741 |
| | (米ドル/米ドル) | 692 | 673 | 55 | 55 | 703 | 683 | 73 | 73 |
| 合計 | | | | 8,962 | | | | 9,814 | |

(注) 1. スワップの時価は、管理受託会社から入手した価格を使用して算出しております。

2. 差損益の欄には時価(現在価値)を記載しております。

③通貨関連

(単位：百万円)

| 区分 | 取引の種類 | 前事業年度末 (平成30年3月31日) | | | | 当第3四半期会計期間末 (平成30年12月31日) | | | |
|-----------|---------|------------------------|-------|---------|---------|------------------------------|-------|---------|---------|
| | | 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 |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約 | | | | | | | | |
| | 売建 | — | — | — | — | 3,167 | — | 63 | 63 |
| | (豪ドル) | — | — | — | — | — | — | — | — |
| | (米ドル) | — | — | — | — | 3,167 | — | 63 | 63 |
| | 買建 | — | — | — | — | 9,051 | — | △ 312 | △ 312 |
| | (豪ドル) | — | — | — | — | 6,522 | — | △ 284 | △ 284 |
| | (米ドル) | — | — | — | — | 2,529 | — | △ 27 | △ 27 |
| | 通貨オプション | | | | | | | | |
| | 売建 | | | | | | | | |
| | コール | — | — | — | — | — | — | — | — |
| | | (—) | (—) | (—) | (—) | (—) | (—) | (—) | (—) |
| | プット | — | — | — | — | — | — | — | — |
| | | (—) | (—) | (—) | (—) | (—) | (—) | (—) | (—) |
| | 買建 | | | | | | | | |
| | コール | — | — | — | — | — | — | — | — |
| | | (—) | (—) | (—) | (—) | (—) | (—) | (—) | (—) |
| | プット | 2,636 | 1,985 | (228) | (△ 422) | 2,224 | 1,656 | (179) | (△ 381) |
| | (米ドル) | (651) | (505) | | | (560) | (426) | | |
| | | 1,505 | 1,128 | (163) | (△ 240) | 1,302 | 956 | (112) | (△ 241) |
| (ユーロ) | (403) | (313) | | | (354) | (267) | | | |
| | 1,130 | 857 | (65) | (△ 181) | 922 | 700 | (66) | (△ 139) | |
| | (247) | (192) | | | (206) | (159) | | | |
| 通貨スワップ | 20,625 | — | △ 929 | △ 929 | 33,538 | — | 319 | 319 | |
| (豪ドル) | 18,030 | — | △ 893 | △ 893 | 15,956 | — | △ 477 | △ 477 | |
| (米ドル) | 735 | — | △ 38 | △ 38 | 714 | — | △ 11 | △ 11 | |
| (ブラジルリアル) | 1,860 | — | 1 | 1 | 11,556 | — | 828 | 828 | |
| (インドルピー) | — | — | — | — | 5,310 | — | △ 19 | △ 19 | |
| 合計 | | | | △ 1,352 | | | | △ 310 | |

(注) 1. 為替予約及びスワップの時価は、管理受託会社から入手した価格等を使用して算出しております。

2. 為替予約の時価の欄には差金決済額(差損益)を記載しております。

3. 括弧内には、契約額等の欄にはオプション料、時価の欄にはオプションの時価、差損益の欄にはオプション料とオプションの時価の差額を記載しております。

4. オプションの時価は、取引相手先から入手した価格を使用して算出しております。

5. スワップの差損益の欄には時価(現在価値)を記載しております。

④株式関連

(単位：百万円)

| 区分 | 取引の種類 | 前事業年度末 (平成30年3月31日) | | | 当第3四半期会計期間末 (平成30年12月31日) | | | | |
|------------|-----------|------------------------|---------|-----------|------------------------------|---------|---------|-----------|-----------|
| | | 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 |
| 市場取引以外の取引 | 株価指数オプション | | | | | | | | |
| | 売建 | | | | | | | | |
| | コール | — | — | | | — | — | | |
| | | (—) | (—) | (—) | (—) | (—) | (—) | (—) | (—) |
| | プット | — | — | | | — | — | | |
| | | (—) | (—) | (—) | (—) | (—) | (—) | (—) | (—) |
| | 買建 | | | | | | | | |
| | コール | 56 | 32 | | | 32 | 10 | | |
| | | (18) | (10) | (53) | (35) | (10) | (2) | (30) | (20) |
| | (日経225) | 56 | 32 | | | 32 | 10 | | |
| | | (18) | (10) | (53) | (35) | (10) | (2) | (30) | (20) |
| | プット | 13,675 | 10,321 | | | 10,842 | 6,215 | | |
| | | (3,541) | (2,646) | (301) | (△ 3,239) | (2,805) | (1,508) | (276) | (△ 2,529) |
| | (日経225) | 8,184 | 6,204 | | | 6,557 | 4,465 | | |
| | (1,738) | (1,324) | (275) | (△ 1,463) | (1,409) | (940) | (271) | (△ 1,138) | |
| (S&P500) | 63 | — | | | — | — | | | |
| | (24) | (—) | (0) | (△ 24) | (—) | (—) | (—) | (—) | |
| (ダウユーロ50種) | 66 | — | | | — | — | | | |
| | (25) | (—) | (11) | (△ 14) | (—) | (—) | (—) | (—) | |
| (MSCIコクサイ) | 5,360 | 4,116 | | | 4,284 | 1,749 | | | |
| | (1,752) | (1,322) | (14) | (△ 1,737) | (1,395) | (568) | (4) | (△ 1,390) | |
| 合計 | | | | △ 3,203 | | | | △ 2,509 | |

(注) 1. 括弧内には、契約額等の欄にはオプション料、時価の欄にはオプションの時価、差損益の欄にはオプション料とオプションの時価の差額を記載しております。

2. オプションの時価は、取引相手先から入手した価格を使用して算出しております。

3. S&P500、ダウユーロ50種及びMSCIコクサイは、円建契約であります。

⑤債券関連

前事業年度末、当第3四半期会計期間末とも有しておりません。

⑥その他

前事業年度末、当第3四半期会計期間末とも有しておりません。

3. 四半期貸借対照表

(単位：百万円)

| 科 目 | 前事業年度末 (平成30年3月31日) | 当第3四半期会計期間末 (平成30年12月31日) |
|------------|------------------------|------------------------------|
| (資産の部) | | |
| 現金及び預貯金 | 111,627 | 121,652 |
| 現金 | 0 | 0 |
| 預貯金 | 111,626 | 121,652 |
| コールローン | 539 | 909 |
| 金銭の信託 | 684,632 | 735,038 |
| 有価証券 | 541,025 | 532,250 |
| 国債 | 412,736 | 402,162 |
| 社債 | 4,240 | 3,408 |
| 株式 | 129 | 128 |
| 外国証券 | 35,562 | 49,001 |
| その他の証券 | 88,356 | 77,548 |
| 貸付金 | 3,278 | 3,128 |
| 保険約款貸付 | 3,277 | 3,127 |
| 一般貸付 | 1 | 1 |
| 有形固定資産 | 12 | 16 |
| 建物 | 5 | 11 |
| リース資産 | 0 | — |
| その他の有形固定資産 | 6 | 5 |
| 無形固定資産 | 998 | 1,494 |
| ソフトウェア | 998 | 1,494 |
| その他の無形固定資産 | 0 | 0 |
| 代理店貸 | 8 | 7 |
| 再保険貸 | 2,290 | 1,922 |
| その他資産 | 13,877 | 15,004 |
| 未収金 | 2,180 | 1,766 |
| 前払費用 | 352 | 527 |
| 未収収益 | 1,282 | 1,664 |
| 預託金 | 217 | 214 |
| 金融派生商品 | 8,964 | 10,642 |
| 金融商品等差入担保金 | 871 | 164 |
| 仮払金 | 7 | 22 |
| その他の資産 | 1 | 2 |
| 繰延税金資産 | 7,590 | 6,347 |
| 貸倒引当金 | △ 0 | △ 0 |
| 資産の部合計 | 1,365,878 | 1,417,771 |

(単位：百万円)

| 科 目 | 前事業年度末 (平成30年3月31日) | 当第3四半期会計期間末 (平成30年12月31日) |
|--------------|------------------------|------------------------------|
| (負債の部) | | |
| 保険契約準備金 | 1,274,376 | 1,290,035 |
| 支払備金 | 9,654 | 9,258 |
| 責任準備金 | 1,264,128 | 1,280,222 |
| 契約者配当準備金 | 594 | 554 |
| 代理店借 | 658 | 383 |
| 再保険借 | 792 | 689 |
| その他負債 | 10,528 | 44,450 |
| 債券貸借取引受入担保金 | — | 33,078 |
| 未払法人税等 | 8 | 6 |
| 未払金 | 234 | 244 |
| 未払費用 | 1,374 | 674 |
| 前受収益 | 0 | — |
| 預り金 | 30 | 74 |
| 金融派生商品 | 931 | 793 |
| 金融商品等受入担保金 | 7,738 | 9,226 |
| 仮受金 | 212 | 352 |
| その他の負債 | 0 | — |
| 退職給付引当金 | 4,932 | 4,668 |
| 価格変動準備金 | 1,667 | 2,074 |
| 負債の部合計 | 1,292,955 | 1,342,301 |
| (純資産の部) | | |
| 資本金 | 56,000 | 56,000 |
| 資本剰余金 | 46,000 | 46,000 |
| 資本準備金 | 46,000 | 46,000 |
| 利益剰余金 | △ 30,383 | △ 28,743 |
| その他利益剰余金 | △ 30,383 | △ 28,743 |
| 繰越利益剰余金 | △ 30,383 | △ 28,743 |
| 株主資本合計 | 71,616 | 73,256 |
| その他有価証券評価差額金 | 1,306 | 2,213 |
| 評価・換算差額等合計 | 1,306 | 2,213 |
| 純資産の部合計 | 72,922 | 75,469 |
| 負債及び純資産の部合計 | 1,365,878 | 1,417,771 |

注記

(四半期貸借対照表関係)

1. 消費貸借契約により貸し付けている有価証券の四半期貸借対照表価額は、29,290百万円であります。

2. 契約者配当準備金の異動状況は次のとおりであります。

| | |
|---------------------|--------|
| 当期首現在高 | 594百万円 |
| 当第3四半期累計期間契約者配当金支払額 | 39百万円 |
| 利息による増加等 | 0百万円 |
| 契約者配当準備金戻入額 | 0百万円 |
| 当第3四半期会計期間末現在高 | 554百万円 |

3. 当第3四半期会計期間末における金融商品の四半期貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません（注2）参照）。

(単位：百万円)

| | 四半期貸借対照表 計上額 | 時価 | 差額 |
|------------------|-----------------|-----------|---------|
| (1) 現金及び預貯金 | 121,652 | 121,652 | — |
| (2) コールローン | 909 | 909 | — |
| (3) 金銭の信託 | 735,038 | 781,219 | 46,181 |
| ① 運用目的 | 5,232 | 5,232 | — |
| ② 満期保有目的 | 29,828 | 30,193 | 365 |
| ③ 責任準備金対応 | 660,306 | 706,122 | 45,815 |
| ④ その他 | 39,671 | 39,671 | — |
| (4) 有価証券 | 532,121 | 595,509 | 63,387 |
| ① 売買目的有価証券 | 32,250 | 32,250 | — |
| ② 満期保有目的の債券 | 219,416 | 253,603 | 34,186 |
| ③ 責任準備金対応債券 | 161,863 | 191,064 | 29,200 |
| ④ その他有価証券 | 118,590 | 118,590 | — |
| (5) 貸付金 | 3,128 | 3,717 | 589 |
| ① 保険約款貸付 | 3,127 | — | — |
| 貸倒引当金(*1) | △ 0 | — | — |
| | 3,127 | 3,716 | 589 |
| ② 一般貸付 | 1 | — | — |
| 貸倒引当金(*1) | △ 0 | — | — |
| | 0 | 0 | — |
| 資産計 | 1,392,850 | 1,503,007 | 110,157 |
| 債券貸借取引受入担保金 | 33,078 | 33,078 | — |
| 負債計 | 33,078 | 33,078 | — |
| 金融派生商品(*2) | | | |
| ヘッジ会計が適用されていないもの | 9,849 | 9,849 | — |
| 金融派生商品計 | 9,849 | 9,849 | — |

(*1) 貸付金に対応する貸倒引当金を控除しております。

(*2) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

資産

(1) 現金及び預貯金

時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(2) コールローン

短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(3) 金銭の信託

信託財産を構成している債券の時価は、「(4) 有価証券」と同様の方法によって算定しており、信託財産を構成している金融派生商品の時価は、管理受託会社又は取引相手先から入手した価格等を使用して算定しております。

(4) 有価証券

債券は主として日本証券業協会が公表する公社債店頭売買参考統計値等、業界団体が公表する価格等又は取引金融機関から提示された価格等によっております。また、投資信託については、12月末日の公表されている基準価格によっております。

(5) 貸付金

保険約款貸付は、過去の実績に基づく返済率から将来キャッシュ・フローを生成し、リスク・フリー・レートで割り引いて時価を算定しております。

一般貸付は、時価が帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

負債

債券貸借取引受入担保金

短期間の取り組みであるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

金融派生商品

為替予約取引、金利スワップ取引及び通貨スワップ取引は、管理信託を用いて行っており、時価は管理受託会社から入手した価格等を使用して算定しております。

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品は次のとおりであり、金融商品の時価情報の「(4) 有価証券 ④ その他有価証券」には含めておりません。

(単位：百万円)

| 区分 | 四半期貸借対照表計上額 |
|-----------|-------------|
| 非上場株式(*1) | 128 |
| 合計 | 128 |

(*1) 非上場株式については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから時価の開示対象とはしておりません。

4. 四半期損益計算書

(単位：百万円)

| 科 目 | 前第3四半期累計期間 (自平成29年4月1日 至平成29年12月31日) | 当第3四半期累計期間 (自平成30年4月1日 至平成30年12月31日) |
|---------------|--|--|
| 経常収益 | 168,908 | 112,433 |
| 保険料等収入 | 136,375 | 98,722 |
| 保険料 | 136,085 | 98,659 |
| 再保険収入 | 290 | 63 |
| 資産運用収益 | 27,175 | 9,072 |
| 利息及び配当金等収入 | 5,561 | 6,275 |
| 預貯金利息 | 41 | 26 |
| 有価証券利息・配当金 | 5,426 | 6,148 |
| 貸付金利息 | 85 | 75 |
| その他利息配当金 | 7 | 25 |
| 金銭の信託運用益 | 14,082 | 806 |
| 有価証券売却益 | 1,507 | 1,423 |
| 金融派生商品収益 | 388 | 567 |
| 貸倒引当金戻入額 | 0 | — |
| その他運用収益 | 0 | 0 |
| 特別勘定資産運用益 | 5,635 | — |
| その他経常収益 | 5,357 | 4,638 |
| 年金特約取扱受入金 | 4,411 | 3,970 |
| 保険金据置受入金 | 36 | 0 |
| 支払備金戻入額 | 520 | 395 |
| 退職給付引当金戻入額 | 292 | 263 |
| その他の経常収益 | 96 | 8 |
| 経常費用 | 166,859 | 109,634 |
| 保険金等支払金 | 94,880 | 79,968 |
| 保険金 | 26,765 | 27,226 |
| 年金 | 29,620 | 20,854 |
| 給付金 | 1,984 | 1,282 |
| 解約返戻金 | 32,662 | 27,728 |
| その他返戻金 | 3,434 | 2,476 |
| 再保険料 | 412 | 400 |
| 責任準備金等繰入額 | 61,178 | 16,094 |
| 責任準備金繰入額 | 61,178 | 16,094 |
| 契約者配当金積立利息繰入額 | 0 | 0 |
| 資産運用費用 | 256 | 3,584 |
| 支払利息 | 0 | 1 |
| 有価証券売却損 | 12 | 9 |
| 為替差損 | 172 | 2,007 |
| 貸倒引当金繰入額 | — | 0 |
| その他運用費用 | 70 | 61 |
| 特別勘定資産運用損 | — | 1,504 |
| 事業費 | 9,325 | 8,767 |
| その他経常費用 | 1,218 | 1,219 |
| 保険金据置支払金 | 33 | 44 |
| 税金 | 1,052 | 888 |
| 減価償却費 | 28 | 173 |
| その他の経常費用 | 103 | 112 |
| 経常利益 | 2,049 | 2,799 |

(単位：百万円)

| 科 目 | 前第3四半期累計期間 (自平成29年4月1日 至平成29年12月31日) | 当第3四半期累計期間 (自平成30年4月1日 至平成30年12月31日) |
|-------------|--|--|
| 特別利益 | — | — |
| 特別損失 | 326 | 407 |
| 固定資産等処分損 | 2 | — |
| 価格変動準備金繰入額 | 323 | 407 |
| 契約者配当準備金戻入額 | 0 | 0 |
| 税引前四半期純利益 | 1,723 | 2,391 |
| 法人税及び住民税 | 182 | △ 138 |
| 法人税等調整額 | 326 | 890 |
| 法人税等合計 | 508 | 752 |
| 四半期純利益 | 1,214 | 1,639 |

注記

(四半期損益計算書関係)

1株当たり四半期純利益の金額は1,024円93銭であります。

5. 経常利益等の明細（基礎利益）

（単位：百万円）

| 区 分 | 前第3四半期累計期間 (自平成29年4月1日 至平成29年12月31日) | 当第3四半期累計期間 (自平成30年4月1日 至平成30年12月31日) |
|-------------------|--|--|
| 基礎利益 A | (注1、2) Δ 542 | (注3、4) Δ 1,211 |
| キャピタル収益 | 16,229 | 12,639 |
| 金銭の信託運用益 | 14,082 | 806 |
| 売買目的有価証券運用益 | — | — |
| 有価証券売却益 | 1,507 | 1,423 |
| 金融派生商品収益 | 388 | 567 |
| 為替差益 | — | — |
| その他キャピタル収益 | 251 | 9,842 |
| キャピタル費用 | 13,996 | 10,353 |
| 金銭の信託運用損 | — | — |
| 売買目的有価証券運用損 | — | — |
| 有価証券売却損 | 12 | 9 |
| 有価証券評価損 | — | — |
| 金融派生商品費用 | — | — |
| 為替差損 | 172 | 2,007 |
| その他キャピタル費用 | 13,810 | 8,336 |
| キャピタル損益 B | (注1、2) 2,233 | (注3、4) 2,286 |
| キャピタル損益含み基礎利益 A+B | 1,690 | 1,074 |
| 臨時収益 | 358 | 1,768 |
| 再保険収入 | — | — |
| 危険準備金戻入額 | 148 | 1,768 |
| 個別貸倒引当金戻入額 | — | — |
| その他臨時収益 | (注5) 210 | — |
| 臨時費用 | 0 | 44 |
| 再保険料 | — | — |
| 危険準備金繰入額 | — | — |
| 個別貸倒引当金繰入額 | 0 | 0 |
| 特定海外債権引当勘定繰入額 | — | — |
| 貸付金償却 | — | — |
| その他臨時費用 | — | (注6) 44 |
| 臨時損益 C | 358 | 1,724 |
| 経常利益 A+B+C | 2,049 | 2,799 |

- (注) 1. 前第3四半期累計期間において、次の金額をキャピタル損益から控除し、基礎利益に含めて記載しております。
 金銭の信託運用益のうち、インカム損益に相当する有価証券利息 5,833百万円
 金融派生商品収益のうち、インカム損益に相当する金利スワップ及び通貨スワップの受取利息・支払利息 808百万円
2. 前第3四半期累計期間において、次の金額を基礎利益から控除し、キャピタル損益に含めて記載しております。
 外国為替連動型保険の負債に係る市場為替レート変動に伴う損益 Δ7,169百万円
 マーケット・バリュー・アジャストメントに係る解約返戻金額変動に伴う損益 251百万円
3. 当第3四半期累計期間において、次の金額をキャピタル損益から控除し、基礎利益に含めて記載しております。
 金銭の信託運用益のうち、インカム損益に相当する有価証券利息 8,287百万円
 金融派生商品収益のうち、インカム損益に相当する金利スワップ及び通貨スワップの受取利息・支払利息 48百万円
4. 当第3四半期累計期間において、次の金額を基礎利益から控除し、キャピタル損益に含めて記載しております。
 外国為替連動型保険の負債に係る市場為替レート変動に伴う損益 9,441百万円
 マーケット・バリュー・アジャストメントに係る解約返戻金額変動に伴う損益 401百万円
5. 前第3四半期累計期間におけるその他臨時収益には、主に変額個人年金保険の最低保証リスクに係る責任準備金のうち平成16年3月31日以前に締結した契約に対する責任準備金の戻入額199百万円を計上しております。
6. 当第3四半期累計期間におけるその他臨時費用には、主に変額個人年金保険の最低保証リスクに係る責任準備金のうち平成16年3月31日以前に締結した契約に対する責任準備金の繰入額50百万円を計上しております。

(ご参考) 基礎利益明細表

(単位：百万円)

| 区 分 | 前第3四半期累計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年12月31日) | 当第3四半期累計期間 (自 平成30年4月1日 至 平成30年12月31日) |
|------------------|--|--|
| 基礎収益 | 166,740 | 117,972 |
| 保険料等収入 | 136,375 | 98,722 |
| 保険料 | 136,085 | 98,659 |
| 再保険収入 | 290 | 63 |
| 資産運用収益 | 11,196 | 6,275 |
| 利息及び配当金等収入 | 5,561 | 6,275 |
| 有価証券償還益 | — | — |
| 一般貸倒引当金戻入額 | 0 | — |
| その他運用収益 | 0 | 0 |
| 特別勘定資産運用益 | 5,635 | — |
| その他経常収益 | 5,357 | 4,638 |
| 年金特約取扱受入金 | 4,411 | 3,970 |
| 保険金据置受入金 | 36 | 0 |
| 支払備金戻入額 | 520 | 395 |
| 責任準備金戻入額 | — | — |
| 退職給付引当金戻入額 | 292 | 263 |
| その他 | 96 | 8 |
| その他基礎収益 | 13,810 | 8,336 |
| 基礎費用 | 167,283 | 119,184 |
| 保険金等支払金 | 94,880 | 79,968 |
| 保険金 | 26,765 | 27,226 |
| 年金 | 29,620 | 20,854 |
| 給付金 | 1,984 | 1,282 |
| 解約返戻金 | 32,662 | 27,728 |
| その他返戻金 | 3,434 | 2,476 |
| 再保険料 | 412 | 400 |
| 責任準備金等繰入額 | 61,536 | 17,818 |
| 資産運用費用 | 71 | 1,567 |
| 支払利息 | 0 | 1 |
| 有価証券償還損 | — | — |
| 一般貸倒引当金繰入額 | — | 0 |
| 賃貸用不動産等減価償却費 | — | — |
| その他運用費用 | 70 | 61 |
| 特別勘定資産運用損 | — | 1,504 |
| 事業費 | 9,325 | 8,767 |
| その他経常費用 | 1,218 | 1,219 |
| 保険金据置支払金 | 33 | 44 |
| 税金 | 1,052 | 888 |
| 減価償却費 | 28 | 173 |
| 退職給付引当金繰入額 | — | — |
| 保険業法第113条繰延資産償却費 | — | — |
| その他 | 103 | 112 |
| その他基礎費用 | 251 | 9,842 |
| 基礎利益 | △ 542 | △ 1,211 |

6. ソルベンシー・マージン比率

(単位：百万円)

| 項目 | 前事業年度末 (平成30年3月31日) | 当第3四半期会計期間末 (平成30年12月31日) |
|--|------------------------|------------------------------|
| ソルベンシー・マージン総額 (A) | 93,006 | 93,936 |
| 資本金等 | 71,616 | 73,257 |
| 価格変動準備金 | 1,667 | 2,074 |
| 危険準備金 | 15,041 | 13,273 |
| 一般貸倒引当金 | 0 | 0 |
| (その他有価証券評価差額金(税効果控除前)・繰延ヘッジ損益(税効果控除前))×90%(マイナスの場合100%) | 1,632 | 2,765 |
| 土地の含み損益×85%(マイナスの場合100%) | — | — |
| 全期チルメル式責任準備金相当額超過額 | 4,568 | 3,853 |
| 配当準備金中の未割当額 | — | △ 0 |
| 税効果相当額 | — | — |
| 負債性資本調達手段等 | — | — |
| 全期チルメル式責任準備金相当額超過額及び負債性資本調達手段等のうち、マージンに算入されない額 | — | — |
| 控除項目 | △ 1,520 | △ 1,288 |
| リスクの合計額 $\sqrt{(R_1+R_8)^2+(R_2+R_3+R_7)^2}+R_4$ (B) | 14,781 | 16,714 |
| 保険リスク相当額 R_1 | 771 | 780 |
| 第三分野保険の保険リスク相当額 R_8 | 156 | 155 |
| 予定利率リスク相当額 R_2 | 3,553 | 4,253 |
| 最低保証リスク相当額 R_7 | 391 | 316 |
| 資産運用リスク相当額 R_3 | 10,350 | 11,603 |
| 経営管理リスク相当額 R_4 | 456 | 513 |
| ソルベンシー・マージン比率 $\frac{(A)}{(1/2) \times (B)} \times 100$ | 1,258.3% | 1,124.0% |

- (注) 1. 前事業年度末は、保険業法施行規則第86条、第87条及び平成8年大蔵省告示第50号の規定に基づいて算出しております。当第3四半期会計期間末は、これらの規定に準じて、当社が合理的と判断する方法で算出しております。
2. 資本金等は、(四半期)貸借対照表の純資産の部合計から、その他有価証券評価差額金を除いた額を記載しております。
3. 最低保証リスク相当額 R_7 は、標準的方式を用いて算出しております。

7. 実質純資産

(単位：百万円)

| 項目 | 前事業年度末 (平成30年3月31日) | 当第3四半期会計期間末 (平成30年12月31日) |
|-------|------------------------|------------------------------|
| 実質純資産 | 197,338 | 203,811 |

- (注) 前事業年度末は、保険業法第132条第2項に規定する区分等を定める命令及び平成11年1月金融監督庁・大蔵省告示第2号の規定に基づいて算出しております。当第3四半期会計期間末は、これらの規定に準じて、当社が合理的と判断する方法で算出しております。

8. 特別勘定の状況

(1) 特別勘定資産残高の状況

(単位：百万円)

| 区 分 | 前事業年度末 (平成30年3月31日) | | 当第3四半期会計期間末 (平成30年12月31日) | |
|----------|------------------------|--------|------------------------------|--------|
| | 件数 | 金額 | 件数 | 金額 |
| 個人変額保険 | | 1,707 | | 1,551 |
| 変額個人年金保険 | | 43,365 | | 32,469 |
| 特別勘定計 | | 45,072 | | 34,021 |

(2) 保有契約高

①個人変額保険

(単位：件、百万円)

| 区 分 | 前事業年度末 (平成30年3月31日) | | 当第3四半期会計期間末 (平成30年12月31日) | |
|-----------|------------------------|-------|------------------------------|-------|
| | 件数 | 金額 | 件数 | 金額 |
| 変額保険（有期型） | 1 | 4 | 1 | 4 |
| 変額保険（終身型） | 2,371 | 8,802 | 2,333 | 8,697 |
| 合計 | 2,372 | 8,806 | 2,334 | 8,701 |

②変額個人年金保険

(単位：件、百万円)

| 区 分 | 前事業年度末 (平成30年3月31日) | | 当第3四半期会計期間末 (平成30年12月31日) | |
|----------|------------------------|--------|------------------------------|--------|
| | 件数 | 金額 | 件数 | 金額 |
| 変額個人年金保険 | 20,560 | 93,104 | 15,596 | 71,866 |

9. 保険会社及びその子会社等の状況

当第3四半期会計期間末現在、子会社等の該当はありません。