

2019年8月9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)

2020年3月期 第1四半期決算補足資料 (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



2019年8月9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

2020年3月期第1四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2020年3月期第1四半期決算(2019年4月1日～2019年6月30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

さあ、保険の新次元へ。

T&D 保険グループ

1. 主要業績

(1) 年換算保険料

①保有契約

(単位：百万円、%)

区 分	前事業年度末 (2019年3月31日)	当第1四半期会計期間末 (2019年6月30日)	
		前年度末比	
個人保険	96,300	96,645	100.4
個人年金保険	18,934	18,110	95.6
合計	115,234	114,755	99.6
うち医療保障・生前給付保障等	2,588	2,644	102.2

②新契約

(単位：百万円、%)

区 分	前第1四半期累計期間 (自 2018年4月1日 至 2018年6月30日)		当第1四半期累計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年6月30日)	
	前年同期比		前年同期比	
個人保険	2,632	69.3	1,930	73.3
個人年金保険	465	—	309	66.5
合計	3,098	81.5	2,239	72.3
うち医療保障・生前給付保障等	55	127.4	107	194.7

- (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。

(2) 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 (2019年3月31日)		当第1四半期会計期間末 (2019年6月30日)			
	件数	金額	件数	前年度末比		金額
				前年度末比		
個人保険	245	20,165	248	100.9	20,197	100.2
個人年金保険	36	1,563	36	97.6	1,525	97.6
小計	282	21,729	284	100.4	21,723	100.0
団体保険	—	0	—	—	0	91.2
団体年金保険	—	21	—	—	20	96.0

- (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1四半期累計期間 (自 2018年4月1日 至 2018年6月30日)					
	件数		金額		新契約	転換による 純増加
		前年同期比		前年同期比		
個人保険	7	87.6	1,023	115.4	1,023	—
個人年金保険	0	—	27	—	27	—
小計	7	92.0	1,051	118.5	1,051	—
団体保険	—	—	—	—	—	—
団体年金保険	—	—	—	—	—	—

(単位：千件、億円、%)

区 分	当第1四半期累計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年6月30日)					
	件数		金額		新契約	転換による 純増加
		前年同期比		前年同期比		
個人保険	5	71.4	559	54.7	559	—
個人年金保険	0	77.8	16	61.0	16	—
小計	5	71.7	576	54.9	576	—
団体保険	—	—	—	—	—	—
団体年金保険	—	—	—	—	—	—

(注) 1. 転換は、2001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。

(3) 解約失効高

(単位：千件、億円、%)

区 分	前第1四半期累計期間 (自 2018年4月1日 至 2018年6月30日)			
	件数		金額	
		前年同期比		前年同期比
個人保険	1	121.2	202	153.1
個人年金保険	0	44.1	8	47.8
合計	1	110.9	210	140.9

(単位：千件、億円、%)

区 分	当第1四半期累計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年6月30日)			
	件数		金額	
		前年同期比		前年同期比
個人保険	1	101.4	213	105.7
個人年金保険	0	89.4	5	71.2
合計	1	100.7	219	104.3

(4) 解約失効率 (対年度始)

(単位：%)

区 分	前第1四半期累計期間 (自 2018年4月1日 至 2018年6月30日)	当第1四半期累計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年6月30日)
	個人保険	1.08
個人年金保険	0.48	0.38
合計	1.03	1.01

(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 (2019年3月31日)		当第1四半期会計期間末 (2019年6月30日)	
	金額	構成比	金額	構成比
現預金・コールローン	129,359	9.2	128,484	9.1
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	756,791	53.9	765,843	54.0
有価証券	490,835	34.9	496,451	35.0
公社債	397,031	28.3	393,164	27.7
株式	128	0.0	126	0.0
外国証券	48,021	3.4	57,237	4.0
公社債	48,021	3.4	57,237	4.0
株式等	—	—	—	—
その他の証券	45,653	3.2	45,923	3.2
貸付金	3,032	0.2	2,996	0.2
保険約款貸付	3,031	0.2	2,995	0.2
一般貸付	1	0.0	1	0.0
不動産	10	0.0	11	0.0
繰延税金資産	5,318	0.4	4,129	0.3
その他	19,996	1.4	20,758	1.5
貸倒引当金	△ 0	△ 0.0	△ 0	△ 0.0
合計	1,405,345	100.0	1,418,673	100.0
うち外貨建資産	375,992	26.8	381,483	26.9

(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 (2019年3月31日)					当第1四半期会計期間末 (2019年6月30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	241,430	281,412	39,982	40,220	237	238,557	281,843	43,286	43,377	90
公社債	211,562	250,055	38,492	38,585	93	208,651	249,679	41,027	41,077	49
金銭の信託	29,867	31,357	1,490	1,635	144	29,905	32,164	2,258	2,299	41
責任準備金対応債券	830,799	928,648	97,849	97,988	139	825,114	941,916	116,801	116,823	21
公社債	161,090	194,466	33,375	33,430	55	160,110	196,142	36,032	36,047	15
金銭の信託	669,708	734,182	64,473	64,558	84	665,004	745,773	80,769	80,775	6
子会社・関連会社株式	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
その他有価証券	163,592	170,108	6,516	6,662	146	183,774	193,330	9,556	9,577	21
公社債	22,957	24,378	1,420	1,420	0	22,894	24,402	1,508	1,508	0
株式	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
外国証券	45,065	48,021	2,956	2,988	32	53,042	57,237	4,194	4,207	12
公社債	45,065	48,021	2,956	2,988	32	53,042	57,237	4,194	4,207	12
株式等	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
その他の証券	45,000	45,653	653	669	16	45,000	45,923	923	923	—
買入金銭債権	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
譲渡性預金	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
金銭の信託	50,569	52,055	1,485	1,583	97	62,837	65,767	2,929	2,938	9
合計	1,235,821	1,380,169	144,347	144,872	524	1,247,446	1,417,091	169,644	169,778	133
公社債	395,611	468,899	73,288	73,437	148	391,655	470,224	78,568	78,633	64
株式	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
外国証券	45,065	48,021	2,956	2,988	32	53,042	57,237	4,194	4,207	12
公社債	45,065	48,021	2,956	2,988	32	53,042	57,237	4,194	4,207	12
株式等	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
その他の証券	45,000	45,653	653	669	16	45,000	45,923	923	923	—
買入金銭債権	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
譲渡性預金	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
金銭の信託	750,145	817,594	67,449	67,776	327	757,748	843,706	85,957	86,014	56

(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 (2019年3月31日)	当第1四半期会計期間末 (2019年6月30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	128	126
非上場国内株式(店頭売買株式を除く)	128	126
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	128	126

(3) 金銭の信託の時価情報

(単位：百万円)

区 分	前事業年度末 (2019年3月31日)					当第1四半期会計期間末 (2019年6月30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	756,791	822,755	65,963	66,193	229	765,843	848,871	83,027	83,075	47

・運用目的の金銭の信託

(単位：百万円)

区 分	前事業年度末 (2019年3月31日)		当第1四半期会計期間末 (2019年6月30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	5,161	840	5,165	218

・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 (2019年3月31日)					当第1四半期会計期間末 (2019年6月30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	29,867	31,357	1,490	1,635	144	29,905	32,164	2,258	2,299	41
責任準備金対応の 金銭の信託	669,708	734,182	64,473	64,558	84	665,004	745,773	80,769	80,775	6
その他の 金銭の信託	50,569	52,055	1,485	1,583	97	62,837	65,767	2,929	2,938	9

(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1四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 (2019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	11,561	△ 72	△ 2,434	—	—	9,054
合計	11,561	△ 72	△ 2,434	—	—	9,054

(単位：百万円)

区 分	当第1四半期会計期間末 (2019年6月30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	12,773	△ 499	△ 2,278	—	—	9,995
合計	12,773	△ 499	△ 2,278	—	—	9,995

(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(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 (2019年3月31日)				当第1四半期会計期間末 (2019年6月30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	16,213	15,317	11,561	11,561	15,413	14,558	12,773	12,773
	(豪ドル/豪ドル)	15,509	14,634	11,452	11,452	14,730	13,894	12,615	12,615
	(米ドル/米ドル)	703	683	108	108	683	663	158	158
合計				11,561				12,773	

(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 (2019年3月31日)				当第1四半期会計期間末 (2019年6月30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	—	—	—	—	—	—	—	—
	(豪ドル)	—	—	—	—	—	—	—	—
	(米ドル)	—	—	—	—	—	—	—	—
	買建	7,027	—	30	30	6,915	—	△ 135	△ 135
	(豪ドル)	7,027	—	30	30	6,915	—	△ 135	△ 135
	(米ドル)	—	—	—	—	—	—	—	—
	通貨オプション								
	売建								
	コール	—	—	—	—	—	—	—	—
		(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)
	プット	—	—	—	—	—	—	—	—
		(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)
	買建								
	コール	—	—	—	—	—	—	—	—
		(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)
	プット	1,985	1,438	(147)	(△ 357)	1,764	1,346	(140)	(△ 309)
	(米ドル)	(505)	(371)			(450)	(350)		
		1,128	786	(89)	(△ 223)	994	775	(86)	(△ 190)
	(ユーロ)	(313)	(223)			(277)	(220)		
	857	652	(58)	(△ 133)	770	570	(54)	(△ 118)	
	(192)	(148)			(173)	(130)			
通貨スワップ	31,524	—	254	254	35,099	—	△ 54	△ 54	
(豪ドル)	15,864	—	△ 256	△ 256	15,233	—	△ 499	△ 499	
(米ドル)	714	—	△ 5	△ 5	688	—	△ 5	△ 5	
(ブラジルリアル)	9,634	—	681	681	8,231	—	579	579	
(インドルピー)	5,310	—	△ 165	△ 165	10,945	—	△ 129	△ 129	
合計				△ 72				△ 499	

(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 (2019年3月31日)				当第1四半期会計期間末 (2019年6月30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	—	—	—	—	—	—	—	—
	(日経225)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)
	プット	—	—	—	—	—	—	—	—
	(日経225)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)
	買建								
	コール	32	10			22	—		
	(日経225)	(10)	(2)	(31)	(21)	(7)	(—)	(21)	(14)
	プット	32	10			22	—		
(日経225)	(10)	(2)	(31)	(21)	(7)	(—)	(21)	(14)	
(MSCIコクサイ)	10,321	2,845			9,706	2,634			
	(2,646)	(604)	(190)	(△ 2,456)	(2,465)	(562)	(172)	(△ 2,293)	
(MSCIコクサイ)	6,204	2,845			5,849	2,634			
	(1,324)	(604)	(188)	(△ 1,136)	(1,245)	(562)	(170)	(△ 1,074)	
(MSCIコクサイ)	4,116	—			3,857	—			
	(1,322)	(—)	(2)	(△ 1,319)	(1,220)	(—)	(1)	(△ 1,218)	
合計				△ 2,434				△ 2,278	

(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. 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1四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1四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 (2019年3月31日)	当第1四半期会計期間末 (2019年6月30日)
(資産の部)		
現金及び預貯金	129,906	129,208
現金	0	0
預貯金	129,906	129,208
コールローン	1,037	743
金銭の信託	756,791	765,843
有価証券	522,517	525,652
国債	394,424	392,156
社債	2,607	1,007
株式	128	126
外国証券	48,057	57,272
その他の証券	77,298	75,089
貸付金	3,032	2,996
保険約款貸付	3,031	2,995
一般貸付	1	1
有形固定資産	15	15
建物	10	11
その他の有形固定資産	4	4
無形固定資産	1,677	1,774
ソフトウェア	1,677	1,774
その他の無形固定資産	0	0
代理店貸	5	4
再保険貸	1,752	1,655
その他資産	16,766	17,554
未収金	2,262	987
前払費用	452	758
未収収益	1,428	1,585
預託金	212	210
金融派生商品	12,283	13,444
金融商品等差入担保金	125	493
仮払金	0	73
その他の資産	2	2
繰延税金資産	5,318	4,129
貸倒引当金	△ 0	△ 0
資産の部合計	1,438,819	1,449,577

(単位：百万円)

科 目	前事業年度末 (2019年3月31日)	当第1四半期会計期間末 (2019年6月30日)
(負債の部)		
保険契約準備金	1,300,935	1,289,013
支払備金	9,475	9,608
責任準備金	1,290,919	1,278,874
契約者配当準備金	540	530
代理店借	408	364
再保険借	611	562
その他負債	52,621	72,626
債券貸借取引受入担保金	40,297	59,001
未払法人税等	8	2
未払金	192	226
未払費用	1,078	668
前受収益	0	—
預り金	31	97
金融派生商品	436	859
金融商品等受入担保金	10,411	11,512
仮受金	164	258
退職給付引当金	4,701	4,568
価格変動準備金	2,219	2,361
負債の部合計	1,361,498	1,369,496
(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	△ 29,372	△ 28,802
その他利益剰余金	△ 29,372	△ 28,802
繰越利益剰余金	△ 29,372	△ 28,802
株主資本合計	72,627	73,197
その他有価証券評価差額金	4,693	6,883
評価・換算差額等合計	4,693	6,883
純資産の部合計	77,321	80,080
負債及び純資産の部合計	1,438,819	1,449,577

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、49,304百万円であります。

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	540百万円
当第1四半期累計期間契約者配当金支払額	10百万円
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1四半期会計期間末現在高	530百万円

3. 第1四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	129,208	129,208	—
(2) コールローン	743	743	—
(3) 金銭の信託	765,843	848,871	83,027
① 運用目的	5,165	5,165	—
② 満期保有目的	29,905	32,164	2,258
③ 責任準備金対応	665,004	745,773	80,769
④ その他	65,767	65,767	—
(4) 有価証券	525,526	602,586	77,060
① 売買目的有価証券	29,201	29,201	—
② 満期保有目的の債券	208,651	249,679	41,027
③ 責任準備金対応債券	160,110	196,142	36,032
④ その他有価証券	127,562	127,562	—
(5) 貸付金	2,996	3,687	691
① 保険約款貸付	2,995	—	—
貸倒引当金(*1)	△ 0	—	—
	2,995	3,686	691
② 一般貸付	1	—	—
貸倒引当金(*1)	△ 0	—	—
	0	0	—
資産計	1,424,317	1,585,097	160,779
債券貸借取引受入担保金	59,001	59,001	—
負債計	59,001	59,001	—
金融派生商品(*2)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	12,584	12,584	—
金融派生商品計	12,584	12,584	—

(*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、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、6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) (*2)	126
合計	126

(*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。

(*2) 当第1四半期会計期間において、非上場株式について2百万円減損処理を行っております。

4. 四半期損益計算書

(単位：百万円)

科 目	前第1四半期累計期間 (自 2018年4月1日 至 2018年6月30日)	当第1四半期累計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年6月30日)
経常収益	43,593	39,880
保険料等収入	34,000	23,936
保険料	33,988	23,897
再保険収入	12	39
資産運用収益	8,104	2,386
利息及び配当金等収入	2,064	2,071
預貯金利息	9	2
有価証券利息・配当金	2,025	2,025
貸付金利息	25	23
その他利息配当金	4	19
金銭の信託運用益	3,221	—
有価証券売却益	1,081	—
金融派生商品収益	1,085	301
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	651	13
その他経常収益	1,488	13,557
年金特約取扱受入金	1,344	1,376
保険金据置受入金	0	—
責任準備金戻入額	—	12,044
退職給付引当金戻入額	140	133
その他の経常収益	4	2
経常費用	42,943	38,769
保険金等支払金	26,528	25,626
保険金	9,459	9,701
年金	6,777	4,804
給付金	510	529
解約返戻金	8,872	9,469
その他返戻金	814	1,021
再保険料	94	100
責任準備金等繰入額	11,819	133
支払備金繰入額	47	133
責任準備金繰入額	11,771	—
契約者配当金積立利息繰入額	0	0
資産運用費用	1,054	10,074
支払利息	0	1
金銭の信託運用損	—	8,527
有価証券売却損	5	—
有価証券評価損	—	2
為替差損	1,026	1,522
貸倒引当金繰入額	0	—
その他運用費用	21	20
事業費	3,108	2,538
その他経常費用	432	395
保険金据置支払金	14	18
税金	313	234
減価償却費	43	95
その他の経常費用	61	46
経常利益	650	1,111

(単位：百万円)

科 目	前第1四半期累計期間 (自 2018年4月1日 至 2018年6月30日)	当第1四半期累計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年6月30日)
特別利益	—	—
特別損失	125	142
固定資産等処分損	—	0
価格変動準備金繰入額	125	142
契約者配当準備金戻入額	0	0
税引前四半期純利益	524	969
法人税及び住民税	0	60
法人税等調整額	174	339
法人税等合計	174	399
四半期純利益	349	569

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355円90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1四半期累計期間 (自2018年4月1日 至2018年6月30日)	当第1四半期累計期間 (自2019年4月1日 至2019年6月30日)
基礎利益 A	(注1、2) △ 375	(注3、4) △ 380
キャピタル収益	5,525	14,503
金銭の信託運用益	3,221	—
売買目的有価証券運用益	—	—
有価証券売却益	1,081	—
金融派生商品収益	1,085	301
為替差益	—	—
その他キャピタル収益	137	14,201
キャピタル費用	4,336	13,771
金銭の信託運用損	—	8,527
売買目的有価証券運用損	—	—
有価証券売却損	5	—
有価証券評価損	—	2
金融派生商品費用	—	—
為替差損	1,026	1,522
その他キャピタル費用	3,305	3,719
キャピタル損益 B	(注1、2) 1,188	(注3、4) 731
キャピタル損益含み基礎利益 A+B	813	350
臨時収益	10	760
再保険収入	—	—
危険準備金戻入額	—	760
個別貸倒引当金戻入額	—	—
その他臨時収益	(注5) 10	(注6) 0
臨時費用	173	—
再保険料	—	—
危険準備金繰入額	173	—
個別貸倒引当金繰入額	—	—
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	—	—
臨時損益 C	△ 163	760
経常利益 A+B+C	650	1,111

- (注) 1. 前第1四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 2,598百万円
 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 69百万円
2. 前第1四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。
 外国通貨に連動する保険負債に係る市場為替レート変動に伴う損益 △637百万円
 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 137百万円
3. 当第1四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。
 金銭の信託運用損のうち、インカム損益に相当する有価証券利息・配当金 3,022百万円
 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 △49百万円
4. 当第1四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。
 外国通貨に連動する保険負債に係る市場為替レート変動に伴う損益 14,152百万円
 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 △697百万円
5. 前第1四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2004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7百万円を計上しております。
6. 当第1四半期累計期間におけるその他臨時収益には、主に第三分野保険の追加責任準備金の戻入額1百万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1四半期累計期間 (自 2018年4月1日 至 2018年6月30日)	当第1四半期累計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年6月30日)
基礎収益	41,510	42,537
保険料等収入	34,000	23,936
保険料	33,988	23,897
再保険収入	12	39
資産運用収益	2,715	2,084
利息及び配当金等収入	2,064	2,071
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	651	13
その他経常収益	1,488	12,796
年金特約取扱受入金	1,344	1,376
保険金据置受入金	0	—
支払備金戻入額	—	—
責任準備金戻入額	—	11,284
退職給付引当金戻入額	140	133
その他	4	2
その他基礎収益	3,305	3,719
基礎費用	41,885	42,918
保険金等支払金	26,528	25,626
保険金	9,459	9,701
年金	6,777	4,804
給付金	510	529
解約返戻金	8,872	9,469
その他返戻金	814	1,021
再保険料	94	100
責任準備金等繰入額	11,655	133
資産運用費用	22	22
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	21	20
特別勘定資産運用損	—	—
事業費	3,108	2,538
その他経常費用	432	395
保険金据置支払金	14	18
税金	313	234
減価償却費	43	95
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	61	46
その他基礎費用	137	14,201
基礎利益	△ 375	△ 380

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 (2019年3月31日)	当第1四半期会計期間末 (2019年6月30日)
ソルベンシー・マージン総額 (A)	94,481	96,600
資本金等	72,627	73,197
価格変動準備金	2,219	2,361
危険準備金	12,742	11,982
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%)	5,864	8,600
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	2,190	1,569
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	△ 1,164	△ 1,112
リスクの合計額 $\sqrt{(R_1+R_8)^2+(R_2+R_3+R_7)^2}+R_4$ (B)	17,150	17,707
保険リスク相当額 R_1	779	777
第三分野保険の保険リスク相当額 R_8	146	130
予定利率リスク相当額 R_2	4,441	4,416
最低保証リスク相当額 R_7	295	285
資産運用リスク相当額 R_3	11,862	12,439
経営管理リスク相当額 R_4	525	541
ソルベンシー・マージン比率 $\frac{(A)}{(1/2) \times (B)} \times 100$	1,101.7%	1,091.0%

- (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1四半期会計期間末は、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 (2019年3月31日)	当第1四半期会計期間末 (2019年6月30日)
実質純資産	232,963	257,643

- (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1四半期会計期間末は、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 (2019年3月31日)		当第1四半期会計期間末 (2019年6月30日)	
	件数	金額	件数	金額
個人変額保険		1,593		1,560
変額個人年金保険		31,948		29,388
特別勘定計		33,541		30,949

(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 (2019年3月31日)		当第1四半期会計期間末 (2019年6月30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）	2,312	8,653	2,301	8,624
合計	2,313	8,657	2,302	8,628

②変額個人年金保険

(単位：件、百万円)

区 分	前事業年度末 (2019年3月31日)		当第1四半期会計期間末 (2019年6月30日)	
	件数	金額	件数	金額
変額個人年金保険	14,274	68,409	13,233	64,131

9. 保険会社及びその子会社等の状況

当第1四半期会計期間末現在、子会社等の該当はありません。