

2016年 7月 29日

各位

会社名 株式会社かんぽ生命保険
代表者名 取締役兼代表執行役社長 石井 雅実
(コード番号：7181 東証第一部)

2016年3月末の経済価値ベースのソルベンシー比率の開示

株式会社かんぽ生命保険（東京都千代田区、取締役兼代表執行役社長 石井 雅実）は、2016年3月末の経済価値ベースのソルベンシー比率^{注1}（Economic Solvency Ratio、以下「ESR」）を計算しましたので、下記のとおりお知らせします。

なお、当期からEVの算出に当たり、リスク・フリー・レートの補外方法として終局金利を適用しています。これに伴い、経済価値ベースの統合リスク量の計測においても終局金利を適用する等の内部モデルの変更を行っています。

記

2016年3月末のESRは、167%となりました。

	2016年3月末
経済価値ベースの資本量（EV ^{注2} ） [=①]	3兆1,500億円
経済価値ベースの統合リスク量 ^{注3} [=②]	1兆8,800億円
ESR [=①/②]	167%

(注1) 経済価値ベースのソルベンシー比率（ESR）とは、リスクに対して十分な資本を確保しているかを示す保険会社の財務の健全性指標のひとつであり、資産・負債を経済価値に基づいて評価した資本量をリスク量で除して算出しています。当社では、欧州ソルベンシーIIの考え方に概ね準じて算出しています。

(注2) 2016年6月30日付け「終局金利を用いた2016年3月末ヨーロピアン・エンベディッド・バリュアの開示について」参照。

(注3) 経済価値ベースの統合リスク量は、内部モデルに基づいて算出しています（EVの変動をリスクと捉え、保有期間1年、信頼水準99.5%、税引後、分散効果考慮後、税・契約者配当の損失吸収効果考慮後で算出）。

内部モデルは必要に応じて見直す場合があります、算出方法及び算出結果はその影響を受ける可能性があります。

以上