

平成21年度 第2四半期(上半期)報告 補足資料

1. 一般勘定

a. 有価証券関係

(1) 有価証券明細表	・・・	1頁
(2) 地域別地方債保有内訳	・・・	1頁
(3) 有価証券残存期間別残高	・・・	2頁
(4) 業種別株式保有の状況	・・・	3頁

b. 貸付金関係

(1) 貸付金明細表	・・・	4頁
(2) 国内企業向け貸付金企業規模別内訳	・・・	4頁
(3) 貸付金残存期間別残高	・・・	5頁
(4) 貸付金業種別内訳	・・・	6頁
(5) 貸付金担保別内訳	・・・	7頁
(6) 貸付金地域別内訳	・・・	7頁

c. 海外投融資の状況

(1) 資産別明細	・・・	8頁
(2) 海外投融資の地域別構成	・・・	9頁
(3) 外貨建資産の通貨別構成	・・・	9頁

2. 個人変額保険・個人変額年金保険 特別勘定

a. 売買目的有価証券の評価損益	・・・	10頁
b. 金銭の信託の時価情報	・・・	10頁
c. デリバティブ取引の時価情報	・・・	11頁

3. 会社計

a. 資産の構成	・・・	12頁
b. 有価証券の時価情報	・・・	13頁
c. 金銭の信託の時価情報	・・・	14頁
d. デリバティブ取引の時価情報	・・・	15頁

1. 一般勘定

a. 有価証券関係

(1) 有価証券明細表

(単位：百万円、%)

区 分	平成21年度 第2四半期(上半期)末		平成20年度末	
	金 額	占率	金 額	占率
国 債	4,148,213	30.8	4,045,208	30.2
地 方 債	295,386	2.2	322,430	2.4
社 債	2,933,943	21.8	2,946,570	22.0
うち公社・公団債	1,693,811	12.6	1,653,751	12.3
株 式	1,368,425	10.1	1,148,805	8.6
外 国 証 券	4,704,391	34.9	4,913,376	36.6
公 社 債	4,052,767	30.1	4,051,836	30.2
うち外貨建	1,640,351	12.2	1,600,565	11.9
株 式 等	651,623	4.8	861,539	6.4
うち外貨建	82,107	0.6	180,876	1.3
その他の証券	35,387	0.3	34,202	0.3
合 計	13,485,747	100.0	13,410,593	100.0
うち外貨建	1,722,459	12.8	1,781,441	13.3

(2) 地域別地方債保有内訳

(単位：百万円)

区 分	平成21年度 第2四半期(上半期)末	平成20年度末
北 海 道	6,601	7,258
東 北	1,145	7,012
関 東	118,865	127,633
中 部	56,141	63,020
近 畿	64,040	68,335
中 国	22,446	22,440
四 国	703	1,059
九 州	25,442	25,669
合 計	295,386	322,430

(3) 有価証券残存期間別残高

<平成21年度第2四半期(上半期)末>

(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 ないもの	合 計
国 債	143,691	166,098	109,303	278,041	456,538	2,994,539	-	4,148,213
地 方 債	16,817	86,800	145,632	34,206	9,338	2,589	-	295,386
社 債	249,914	400,367	514,102	531,421	445,690	770,635	21,810	2,933,943
株 式							1,368,425	1,368,425
外 国 証 券	279,689	326,657	520,558	293,783	1,118,903	1,513,214	651,583	4,704,391
公 社 債	279,649	326,657	520,558	293,783	1,118,903	1,513,214	-	4,052,767
株 式 等	40	-	-	-	-	-	651,583	651,623
その他の証券	859	745	609	-	-	-	33,173	35,387
合 計	690,971	980,669	1,290,208	1,137,453	2,030,471	5,280,979	2,074,993	13,485,747

<平成20年度末>

(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 ないもの	合 計
国 債	337,140	146,078	120,305	402,671	469,126	2,569,886	-	4,045,208
地 方 債	39,248	66,053	139,144	65,085	6,294	6,603	-	322,430
社 債	239,185	393,191	531,473	570,277	463,831	726,969	21,642	2,946,570
株 式							1,148,805	1,148,805
外 国 証 券	322,909	447,887	430,697	180,835	1,136,302	1,533,247	861,496	4,913,376
公 社 債	322,865	447,887	430,697	180,835	1,136,302	1,533,247	-	4,051,836
株 式 等	43	-	-	-	-	-	861,496	861,539
その他の証券	206	1,376	590	-	-	-	32,028	34,202
合 計	938,689	1,054,586	1,222,211	1,218,870	2,075,555	4,836,707	2,063,972	13,410,593

(4) 業種別株式保有の状況

(単位：百万円、%)

区 分		平成21年度 第2四半期(上半期)末		平成20年度末	
		金 額	占率	金 額	占率
水産・農林業		743	0.1	637	0.1
鉱業		277	0.0	244	0.0
建設業		27,569	2.0	23,546	2.0
製 造 業	食料品	36,694	2.7	31,053	2.7
	繊維製品	7,821	0.6	6,319	0.6
	パルプ・紙	5,840	0.4	5,415	0.5
	化学	95,725	7.0	71,528	6.2
	医薬品	87,452	6.4	71,058	6.2
	石油・石炭製品	5,764	0.4	5,297	0.5
	ゴム製品	5,920	0.4	4,085	0.4
	ガラス・土石製品	13,847	1.0	10,743	0.9
	鉄鋼	41,950	3.1	33,279	2.9
	非鉄金属	37,664	2.8	23,537	2.0
	金属製品	4,982	0.4	3,858	0.3
	機械	77,833	5.7	56,426	4.9
	電気機器	177,443	13.0	132,128	11.5
	輸送用機器	71,074	5.2	54,472	4.7
	精密機器	11,187	0.8	7,826	0.7
	その他製品	22,373	1.6	17,671	1.5
電気・ガス業		40,126	2.9	41,273	3.6
運 輸 ・ 情 報 通 信 業	陸運業	87,284	6.4	78,020	6.8
	海運業	9,653	0.7	7,168	0.6
	空運業	3,551	0.3	4,185	0.4
	倉庫・運輸関連業	6,189	0.5	5,378	0.5
	情報・通信業	12,424	0.9	10,076	0.9
商 業	卸売業	67,590	4.9	56,614	4.9
	小売業	26,464	1.9	21,529	1.9
金 融 ・ 保 険 業	銀行業	256,015	18.7	248,701	21.6
	証券、商品先物取引業	7,935	0.6	6,215	0.5
	保険業	69,654	5.1	67,072	5.8
	その他金融業	5,344	0.4	4,801	0.4
不動産業		11,231	0.8	7,985	0.7
サービス業		32,793	2.4	30,653	2.7
合 計		1,368,425	100.0	1,148,805	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。

b. 貸付金関係

(1) 貸付金明細表

(単位：百万円)

区 分	平成21年度 第2四半期(上半期)末	平成20年度末
保 険 約 款 貸 付	399,913	414,280
契 約 者 貸 付	358,885	371,396
保 険 料 振 替 貸 付	41,028	42,884
一 般 貸 付 (うち非居住者貸付)	3,208,107 (114,187)	3,454,896 (143,218)
企 業 貸 付 (うち国内企業向け)	3,067,181 (3,033,776)	3,289,650 (3,241,506)
国・国際機関・政府関係機関貸付	34,769	36,645
公共団体・公企業貸付	80,650	99,007
住 宅 口 - ン	12,952	13,481
消 費 者 口 - ン	11,110	14,198
そ の 他	1,443	1,912
合 計	3,608,021	3,869,177

(2) 国内企業向け貸付金企業規模別内訳

(単位：件、百万円、%)

区 分	平成21年度 第2四半期(上半期)末		平成20年度末	
		占率		占率
大 企 業	貸付先数	340	349	58.4
	金 額	2,759,763	2,951,651	91.1
中 堅 企 業	貸付先数	16	15	2.5
	金 額	12,176	9,260	0.3
中 小 企 業	貸付先数	215	234	39.1
	金 額	261,836	280,594	8.7
国内企業向け 貸 付 計	貸付先数 金 額	571 3,033,776	598 3,241,506	100.0 100.0

(注)1. 規模の区分は業種により以下のとおり定義しています。

業 種	右の、を除外する全業種		小売業、飲食業		サービス業		卸売業	
	従業員 300人超 かつ	資本金 10億円以上	従業員 50人超 かつ	資本金 10億円以上	従業員 100人超 かつ	資本金 10億円以上	従業員 100人超 かつ	資本金 10億円以上
大 企 業								
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人以下		資本金5千万円以下又は 常用する従業員50人以下		資本金5千万円以下又は 常用する従業員100人以下		資本金1億円以下又は 常用する従業員100人以下	

- 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。
- 従業員数及び資本金額は、資料作成時点で当社が把握しているものによります。
- サービス業とは、「物品貸業」、「学術研究・専門・技術サービス業」、「宿泊業」、「生活関連サービス業、娯楽業」、「教育、学習支援業」、「医療・福祉」、および「その他のサービス」で構成されます。
- 規模の区分は、日本銀行の「貸出先別貸出金(業種別、設備資金新規貸出)」の規模区分に準拠しています。

(3) 貸付金残存期間別残高

<平成21年度第2四半期(上半期)末>

(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	合 計
変 動 金 利	15,912	56,328	30,868	46,772	94,429	71,127	138,000	453,438
固 定 金 利	425,686	564,121	580,008	555,617	560,061	69,173	-	2,754,668
一 般 貸 付 計	441,598	620,449	610,876	602,390	654,491	140,301	138,000	3,208,107

<平成20年度末>

(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	合 計
変 動 金 利	12,713	65,060	29,010	36,785	99,703	113,347	168,000	524,620
固 定 金 利	467,086	674,491	547,665	522,633	636,457	81,940	-	2,930,276
一 般 貸 付 計	479,800	739,552	576,676	559,418	736,161	195,288	168,000	3,454,896

(4) 貸付金業種別内訳

(単位：百万円、%)

区 分	平成21年度 第2四半期(上半期)末		平成20年度末		
	金 額	占率	金 額	占率	
	738,194	23.0	762,621	22.1	
製 造 業	食料	27,553	0.9	27,869	0.8
	繊維	16,691	0.5	15,827	0.5
	木材・木製品	1,264	0.0	1,631	0.0
	パルプ・紙	49,897	1.6	60,412	1.7
	印刷	76	0.0	92	0.0
	化学	77,970	2.4	81,857	2.4
	石油・石炭	63,032	2.0	63,157	1.8
	窯業・土石	19,884	0.6	20,256	0.6
	鉄鋼	103,774	3.2	102,092	3.0
	非金属製品	9,405	0.3	12,561	0.4
	金製品	750	0.0	781	0.0
	はん用・生産用・業務用機械	42,785	1.3	-	-
	一般機械	-	-	34,502	1.0
	電気機械	131,181	4.1	130,783	3.8
	輸送用機械	165,349	5.2	173,188	5.0
	精密機械	-	-	8,946	0.3
その他の製造業	28,577	0.9	28,659	0.8	
国 内 向 け	農業、林業	-	-	-	-
	漁業	-	-	-	-
	鉱業、採石業、砂利採取業	-	-	-	-
	建設業	13,963	0.4	15,111	0.4
	電気・ガス・熱供給・水道業	591,963	18.5	636,471	18.4
	情報通信業	86,290	2.7	103,325	3.0
	運輸業、郵便業	171,440	5.3	171,249	5.0
	卸売業	522,940	16.3	552,248	16.0
	小売業	25,763	0.8	26,829	0.8
	金融業、保険業	606,808	18.9	676,120	19.6
	不動産業	173,224	5.4	176,276	5.1
	物品賃貸業	109,149	3.4	-	-
	学術研究、専門・技術サービス業	1,032	0.0	-	-
	宿泊業	261	0.0	-	-
	飲食業	166	0.0	-	-
	生活関連サービス業、娯楽業	247	0.0	-	-
	教育、学習支援業	1,000	0.0	-	-
	医療・福祉	654	0.0	-	-
	その他のサービス	5,566	0.2	-	-
	各種サービス	-	-	137,494	4.0
地方公共団体	18,613	0.6	23,632	0.7	
個人(住宅・消費・納税資金等)	26,638	0.8	30,296	0.9	
合 計	3,093,919	96.4	3,311,678	95.9	
海 外 向 け	政 府 等	80,782	2.5	95,074	2.8
	金 融 機 関 等	22,000	0.7	34,001	1.0
	商 工 業 等	11,404	0.4	14,142	0.4
合 計	114,187	3.6	143,218	4.1	
総 合 計	3,208,107	100.0	3,454,896	100.0	

(注)国内向けの区分は、日本銀行の「貸出先別貸出金(業種別、設備資金新規貸出)」の業種分類に準拠しています。

(5) 貸付金担保別内訳

(単位：百万円、%)

区 分	平成21年度 第2四半期(上半期)末		平成20年度末	
	金 額	占率	金 額	占率
担 保 貸 付	28,450	0.9	32,962	1.0
有価証券担保貸付	4,581	0.1	3,517	0.1
不動産・動産・財団担保貸付	19,509	0.6	20,013	0.6
指名債権担保貸付	4,359	0.1	9,431	0.3
保 証 貸 付	129,408	4.0	153,370	4.4
信 用 貸 付	3,026,185	94.3	3,240,883	93.8
そ の 他	24,062	0.8	27,680	0.8
一 般 貸 付 計	3,208,107	100.0	3,454,896	100.0
うち劣後特約付貸付	301,000	9.4	356,000	10.3

(6) 貸付金地域別内訳

(単位：百万円、%)

区 分	平成21年度 第2四半期(上半期)末		平成20年度末	
	金 額	占率	金 額	占率
北 海 道	40,823	1.3	41,937	1.3
東 北	63,925	2.1	59,295	1.8
関 東	1,960,229	63.9	2,141,846	65.2
中 部	235,459	7.7	246,112	7.5
近 畿	539,888	17.6	561,833	17.1
中 国	88,893	2.9	86,868	2.6
四 国	21,756	0.7	22,490	0.7
九 州	118,880	3.9	123,614	3.8
合 計	3,069,856	100.0	3,283,998	100.0

(注)1. 個人ローン、非居住者貸付、保険約款貸付等を含みません。

2. 地域区分は、資料作成時点で当社が把握している貸付先の本社所在地によります。

c. 海外投融資の状況

(1) 資産別明細

(ア) 外貨建資産

(単位：百万円、%)

区 分	平成21年度 第2四半期(上半期)末		平成20年度末	
	金 額	占率	金 額	占率
公 社 債	1,640,351	33.4	1,600,565	31.2
株 式 等	82,107	1.7	180,876	3.5
現 預 金 ・ そ の 他	46,991	1.0	42,796	0.8
外 貨 建 資 産 計	1,769,451	36.0	1,824,237	35.5

(イ) 円貨額が確定した外貨建資産

(単位：百万円、%)

区 分	平成21年度 第2四半期(上半期)末		平成20年度末	
	金 額	占率	金 額	占率
公 社 債	393,828	8.0	393,828	7.7
現 預 金 ・ そ の 他	28,001	0.6	23,002	0.4
円 貨 額 が 確 定 し た 外 貨 建 資 産 計	421,829	8.6	416,830	8.1

(ウ) 円貨建資産

(単位：百万円、%)

区 分	平成21年度 第2四半期(上半期)末		平成20年度末	
	金 額	占率	金 額	占率
非 居 住 者 貸 付	114,187	2.3	143,218	2.8
公 社 債	2,018,587	41.1	2,057,442	40.1
株 式 等	569,516	11.6	680,663	13.3
そ の 他	22,495	0.5	10,078	0.2
円 貨 建 資 産 計	2,724,786	55.4	2,891,402	56.3

(エ) 合計

(単位：百万円、%)

区 分	平成21年度 第2四半期(上半期)末		平成20年度末	
	金 額	占率	金 額	占率
海 外 投 融 資	4,916,067	100.0	5,132,470	100.0
(うち海外不動産)	(-)	(-)	(-)	(-)

(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) 海外投融資の地域別構成

(単位：百万円、%)

区 分	平成21年度第2四半期(上半期)末				平成20年度末				
	外国証券	公社債	株式等	非居住者 貸付	外国証券	公社債	株式等	非居住者 貸付	
北 米	金額	701,237	700,436	801	8,139	894,561	893,554	1,007	8,139
	占率	14.9	17.3	0.1	7.1	18.2	22.1	0.1	5.7
ヨーロッパ	金額	1,611,962	1,605,557	6,404	66,000	1,436,543	1,431,776	4,766	71,000
	占率	34.3	39.6	1.0	57.8	29.2	35.3	0.6	49.6
オセアニア	金額	49,875	49,875	-	5,000	72,924	72,924	-	5,000
	占率	1.1	1.2	-	4.4	1.5	1.8	-	3.5
ア ジ ア	金額	13,529	3,489	10,039	2,682	10,315	3,455	6,859	11,882
	占率	0.3	0.1	1.5	2.3	0.2	0.1	0.8	8.3
中 南 米	金額	2,079,179	1,444,801	634,378	5,124	2,299,899	1,450,992	848,906	19,625
	占率	44.2	35.6	97.4	4.5	46.8	35.8	98.5	13.7
中 東	金額	-	-	-	209	-	-	-	250
	占率	-	-	-	0.2	-	-	-	0.2
アフリカ	金額	-	-	-	458	-	-	-	496
	占率	-	-	-	0.4	-	-	-	0.3
国際機関	金額	248,607	248,607	-	26,573	199,131	199,131	-	26,824
	占率	5.3	6.1	-	23.3	4.1	4.9	-	18.7
合 計	金額	4,704,391	4,052,767	651,623	114,187	4,913,376	4,051,836	861,539	143,218
	占率	100.0	100.0	100.0	100.0	100.0	100.0	100.0	100.0

(注)1. 本表は発行会社の国籍に基づき作成されています。

2. 中南米向け外国証券は、その大部分が中南米に設立されたS P C (特定目的会社)が発行する円建の債券、優先出資証券、オルタナティブ投資等であり、発行会社の国籍に基づき中南米に分類されているものの、実質的には日本や北米・ヨーロッパ地域への投資です。又、貸付は同地域に設立された本邦企業100%出資のS P C向け貸付(親会社の保証付)となっています。

(3) 外貨建資産の通貨別構成

(単位：百万円、%)

区 分	平成21年度 第2四半期(上半期)末		平成20年度末	
	金 額	占率	金 額	占率
ユ ー ロ	982,672	55.5	712,341	39.0
米 ド ル	456,160	25.8	756,599	41.5
豪 ド ル	291,583	16.5	286,573	15.7
英 ボ ンド	29,062	1.6	61,962	3.4
中 国 元	7,455	0.4	4,186	0.2
韓 国 ウォン	2,516	0.1	2,257	0.1
そ の 他	-	-	317	0.0
合 計	1,769,451	100.0	1,824,237	100.0

2. 個人変額保険・変額個人年金保険 特別勘定

a. 売買目的有価証券の評価損益

(1) 個人変額保険

(単位：百万円)

区 分	平成21年度 第2四半期(上半期)末		平成20年度末	
	貸借対照表 計上額	当期の損益に含 まれた評価損益	貸借対照表 計上額	当期の損益に含 まれた評価損益
売 買 目 的 有 価 証 券 等	56,055	8,103	49,454	16,134

(2) 変額個人年金保険

(単位：百万円)

区 分	平成21年度 第2四半期(上半期)末		平成20年度末	
	貸借対照表 計上額	当期の損益に含 まれた評価損益	貸借対照表 計上額	当期の損益に含 まれた評価損益
売 買 目 的 有 価 証 券 等	2,352,635	107,819	1,794,558	288,001

b. 金銭の信託の時価情報

個人変額保険、変額個人年金保険ともに残高がないため記載していません。

c. デリバティブ取引の時価情報

(1) 個人変額保険

(株式関連)

(単位：百万円)

区分	種類	平成21年度第2四半期(上半期)末				平成20年度末			
		契約額等		時価	差損益	契約額等		時価	差損益
		うち1年超				うち1年超			
取引所	株価指数先物								
	売建	568	-	569	1	-	-	-	-
	買建	-	-	-	-	-	-	-	-
	合計								1

(注) 差損益欄には、契約額と時価との差額を記載しています。

(2) 変額個人年金保険

(株式関連)

(単位：百万円)

区分	種類	平成21年度第2四半期(上半期)末				平成20年度末			
		契約額等		時価	差損益	契約額等		時価	差損益
		うち1年超				うち1年超			
取引所	株価指数先物								
	売建	7,740	-	7,476	264	-	-	-	-
	買建	1,949	-	1,925	23	-	-	-	-
	合計								240

(注) 差損益欄には、契約額と時価との差額を記載しています。

(通貨関連)

(単位：百万円)

区分	種類	平成21年度第2四半期(上半期)末				平成20年度末			
		契約額等		時価	差損益	契約額等		時価	差損益
		うち1年超				うち1年超			
店頭	為替予約								
	売建 (米ドル)	163,806	-	162,359	1,447	-	-	-	-
	買建 (米ドル)	80,585	-	80,995	409	-	-	-	-
	合計								1,856

(注) 1. 外貨建金銭債権債務等に為替予約が付されていることにより、決済時における円貨額が確定している外貨建金銭債権債務等で、貸借対照表において当該円貨額で表示されているものについては、開示の対象より除いています。

2. 差損益欄には、契約額と時価との差額を記載しています。

3. 会社計

a. 資産の構成

(1) 資産の構成

(単位：百万円、%)

区 分	平成21年度 第2四半期(上半期)末		平成20年度末	
	金 額	占率	金 額	占率
現預金・コールローン	453,803	2.0	476,579	2.1
買入金銭債権	454,722	2.0	437,022	1.9
有 価 証 券	16,502,600	72.4	15,792,810	69.8
公 社 債	8,578,052	37.6	8,402,187	37.2
株 式	1,957,313	8.6	1,721,766	7.6
外 国 証 券	5,200,684	22.8	5,376,798	23.8
公 社 債	4,367,282	19.2	4,337,411	19.2
株 式 等	833,401	3.7	1,039,386	4.6
その他の証券	766,548	3.4	292,058	1.3
貸 付 金	3,608,021	15.8	3,869,177	17.1
保 険 約 款 貸 付	399,913	1.8	414,280	1.8
一 般 貸 付	3,208,107	14.1	3,454,896	15.3
不 動 産	991,635	4.4	997,424	4.4
う ち 投 資 用	745,350	3.3	749,069	3.3
繰延税金資産	333,799	1.5	441,632	2.0
そ の 他	456,594	2.0	597,337	2.6
貸倒引当金	7,243	0.0	2,233	0.0
会 社 計	22,793,932	100.0	22,609,749	100.0
う ち 外 貨 建 資 産	2,280,290	10.0	2,257,772	10.0

(注)「不動産」については土地・建物・建設仮勘定を合計した金額を計上しています。

(2) 資産の増減

(単位：百万円)

区 分	平成20年度 第2四半期(上半期)	平成21年度 第2四半期(上半期)
	金 額	金 額
現預金・コールローン	323,244	22,775
買入金銭債権	217,319	17,700
有 価 証 券	173,870	709,789
公 社 債	388,209	175,865
株 式	93,014	235,547
外 国 証 券	119,962	176,113
公 社 債	182,270	29,871
株 式 等	62,307	205,984
その他の証券	1,361	474,490
貸 付 金	113,847	261,156
保 険 約 款 貸 付	12,302	14,366
一 般 貸 付	101,545	246,789
不 動 産	4,886	5,789
う ち 投 資 用	8,154	3,718
繰延税金資産	50,994	107,833
そ の 他	235,268	140,742
貸倒引当金	359	5,009
会 社 計	189,031	184,182
う ち 外 貨 建 資 産	96,527	22,517

(注)「不動産」については土地・建物・建設仮勘定を合計した金額を計上しています。

b. 有価証券の時価情報

(1) 売買目的有価証券の評価損益

(単位：百万円)

区 分	平成21年度第2四半期(上半期)末		平成20年度末	
	貸借対照表計上額	当期の損益に含まれた評価損益	貸借対照表計上額	当期の損益に含まれた評価損益
売買目的有価証券	3,016,852	267,635	2,382,216	305,962

(注)本表では、「運用目的の金銭の信託」を通じて保有している有価証券も対象となっていますが、平成21年度第2四半期(上半期)末、平成20年度末ともに残高はありません。

(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	平成21年度第2四半期(上半期)末					平成20年度末				
	帳簿価額	時価	差損益	うち差益	うち差損	帳簿価額	時価	差損益	うち差益	うち差損
満期保有目的の債券	2,360,020	2,334,713	25,306	19,557	44,863	2,359,908	2,366,372	6,464	40,002	33,537
責任準備金対応債券	6,351,693	6,520,237	168,544	184,401	15,857	6,388,640	6,530,354	141,714	167,687	25,973
子会社・関連会社株式	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他の有価証券	4,084,041	4,098,580	14,539	216,033	201,493	4,122,091	3,867,031	255,060	120,460	375,520
公社債	825,812	829,910	4,097	12,450	8,352	747,669	745,826	1,843	10,540	12,383
株式	1,179,168	1,213,669	34,500	165,101	130,600	1,195,691	992,636	203,055	59,635	262,691
外国証券	2,012,497	1,991,645	20,851	35,214	56,065	2,126,550	2,082,780	43,769	47,073	90,843
公社債	1,899,902	1,888,686	11,216	33,546	44,763	1,872,676	1,871,670	1,006	46,829	47,836
株式等	112,594	102,959	9,634	1,668	11,302	253,874	211,110	42,763	244	43,007
その他の証券	36,568	33,363	3,205	3,266	6,471	40,082	33,691	6,391	3,209	9,600
買入金銭債権	17,994	17,994	0	-	0	5,097	5,098	1	1	-
譲渡性預金	12,000	11,997	2	-	2	7,000	6,998	1	-	1
その他	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
合計	12,795,755	12,953,532	157,776	419,991	262,215	12,870,639	12,763,758	106,881	328,150	435,031
公社債	7,373,444	7,561,896	188,451	208,038	19,586	7,316,052	7,472,940	156,888	185,097	28,208
株式	1,179,168	1,213,669	34,500	165,101	130,600	1,195,691	992,636	203,055	59,635	262,691
外国証券	4,176,578	4,114,610	61,968	43,585	105,553	4,306,717	4,252,394	54,322	80,206	134,529
公社債	4,063,984	4,011,651	52,333	41,917	94,250	4,052,842	4,041,283	11,559	79,962	91,521
株式等	112,594	102,959	9,634	1,668	11,302	253,874	211,110	42,763	244	43,007
その他の証券	36,568	33,363	3,205	3,266	6,471	40,082	33,691	6,391	3,209	9,600
買入金銭債権	17,994	17,994	0	-	0	5,097	5,098	1	1	-
譲渡性預金	12,000	11,997	2	-	2	7,000	6,998	1	-	1
その他	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

(注)本表には、C D(譲渡性預金)等、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を含んでいます。

・時価のない有価証券の帳簿価額は以下のとおりです。

(単位：百万円)

区 分	平成21年度第2四半期(上半期)末	平成20年度末
満期保有目的の債券	-	-
非上場外国債券	-	-
その他	-	-
責任準備金対応債券	-	-
子会社・関連会社株式	60,230	60,230
その他の有価証券	943,928	1,036,032
非上場国内株式(店頭売買株式を除く)	95,190	96,603
非上場外国株式(店頭売買株式を除く)	548,181	649,341
非上場外国債券	-	-
その他	300,556	290,087
合計	1,004,158	1,096,262

(注)本表記載の「その他」には、貸付信託受益証券等の買入金銭債権を含んでいます。

c . 金銭の信託の時価情報

(1) 運用目的の金銭の信託

平成21年度第2四半期(上半期)末、平成20年度末ともに残高がないため記載していません。

(2) 運用目的以外の金銭の信託

平成21年度第2四半期(上半期)末、平成20年度末ともに残高がないため記載していません。

d . デリバティブ取引の時価情報（ヘッジ会計適用・非適用の合算値）

【定性的情報】

（１）取引の内容

当社では、資産運用方針および運用する資金特性に応じて、以下のデリバティブ取引を活用しています。

	取引所取引	店頭取引
金利派生商品	-	金利スワップ
為替派生商品	-	為替予約、通貨オプション
債券派生商品	債券先物、債券先物オプション	債券現物オプション
株式派生商品	株価指数先物	個別株オプション、株価指数オプション

（２）取組方針

当社では、主に保有する資産または負債の価値が変動するリスクを回避する目的で、デリバティブ取引を活用しています。

また、運用する資金特性にそぐわないデリバティブ取引（例えば、原資産の価格変動に対する当該取引時価の変動率が大きいレバレッジの高い取引等）は行わないこととしています。

（３）利用目的

当社では、外貨建資産に係る為替リスク等の回避を目的としたヘッジ取引、もしくはリスクを一定範囲内に限定したデリバティブ取引を行っています。

なお、ヘッジ会計の適用要件を満たすヘッジ取引については、ヘッジ会計を適用しています。

（４）リスクの内容

デリバティブ取引には、現物資産と同様に、市場リスクと信用リスクがあります。

ア．市場リスク

金利、株価、為替等の市場の変動及びキャッシュフローの変動によって保有するポートフォリオやポジションの価値が変動するリスクをいいます。

イ．信用リスク

与信先の信用状態の変化により保有するポートフォリオやポジションの価値が変動するリスクをいいます。

なお、デリバティブ取引の取組みには、取引相手先のデフォルト（債務不履行）により、保有するポジションから期待する経済効果を得られないリスクがあります。

（５）リスク管理体制

ア．リスク管理の基本方針

保有する資産または負債に対して効果的にデリバティブ取引が活用されているか、また、投資案件ごとに設定した運用方針、運用ルール、報告体制が遵守されているか等を定期的に確認することで、リスクの顕在化を未然に防止することをリスク管理の基本としています。

イ．リスク管理部署

収益部門から独立した資産運用リスク管理部署が、デリバティブ取引のリスク状況を株式、債券等原資産とあわせて管理しています。

ウ．リスク管理規程

デリバティブ取引に対する利用目的、取組方針、及びリスク管理体制等を「デリバティブ取引に対する当社の取組方針」として、「資産運用リスク管理規程」に規定しています。また、資産運用各部署は、それぞれの役割に応じた具体的な取組みをリスク管理基準として整備しています。

エ．リスク管理

ヘッジ取引を行う場合は、ヘッジ対象である原資産とヘッジ手段としてのデリバティブ取引をあわせてリスクを定量的に把握・分析・管理しています。

ヘッジ取引に該当しない取引を行う場合は、取引限度額、許容リスク量を設定するとともにロス・カット・ルールを策定し、ポジション状況、リスク状況及び損益状況を管理しています。

(6) 定量的情報に関する補足説明

ア．デリバティブ取引に関わる信用リスクの状況

債権債務の関係が法的に相殺可能である契約については、取引相手先が当社に対して有する与信額を考慮したネットベースのカレント・エクスポージャー方式で信用リスク相当額を算出しています。

(単位：億円)

	契約金額・想定元本額		信用リスク相当額	
	平成 20 年 9 月末	平成 21 年 9 月末	平成 20 年 9 月末	平成 21 年 9 月末
金利スワップ	1,385	914	15	35
為替予約	24,556	25,135	1,913	1,858
通貨オプション(買建)	3,263	346	46	83
債券オプション(買建)	2,321	0	9	0
株式オプション(買建)	1,854	2,958	191	316
合計			1,906	2,153

(注) 契約金額・想定元本額は、取引を執行する際の計算基礎として位置付けられているものであり、リスク量を表す指標ではありません。

イ．差損益に関する補足説明

ヘッジ取引については、ヘッジ手段とヘッジ対象の対応関係を明確にした上で取り組んでおり、ヘッジ手段としてのデリバティブ取引の損益を単独で認識するのではなく、ヘッジ対象としての資産・負債の損益と合算して認識する必要があります。

したがって、ヘッジ手段とヘッジ対象を一体として管理することで、為替変動リスク、金利変動リスク等が減殺されている効果を確認しています。

【定量的情報】

(1) 差損益の内訳(ヘッジ会計適用分・非適用分の内訳)(会社計)

(単位:百万円)

区 分	平成21年度第2四半期(上半期)末						平成20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	2,698	84,996	-	-	-	87,695	2,237	50,154	-	-	-	52,391
ヘッジ会計非適用分	-	24,994	11,061	-	-	13,932	-	13,080	4,995	-	-	8,084
合 計	2,698	109,990	11,061	-	-	101,627	2,237	63,234	4,995	-	-	60,476

(注)ヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ適用分、及びヘッジ会計非適用分の差損益は、損益計算書に計上されています。
 なお時価ヘッジ適用分の差損益は、平成21年度第2四半期(上半期)末通貨関連 36,156百万円、平成20年度末通貨関連 9,045百万円となっています。

(2) 金利関連(会社計)

(単位:百万円)

区分	種 類	平成21年度第2四半期(上半期)末				平成20年度末			
		契約額等		時価	差損益	契約額等		時価	差損益
		うち1年超				うち1年超			
店頭	金利スワップ								
	固定金利受取/変動金利支払	85,621	80,933	2,713	2,713	87,157	83,387	2,276	2,276
	固定金利支払/変動金利受取	5,786	2,895	14	14	13,774	4,247	38	38
	合 計				2,698				2,237

(注)差損益欄には、時価を記載しています。

(3) 通貨関連(会社計)

(単位:百万円)

区分	種 類	平成21年度第2四半期(上半期)末				平成20年度末			
		契約額等		時価	差損益	契約額等		時価	差損益
		うち1年超				うち1年超			
店頭	為替予約								
	売建	1,983,039	413,951	1,923,492	59,546	1,896,964	390,315	1,852,750	44,213
	(ユーロ)	965,886	137,208	950,436	15,450	727,685	137,420	725,015	2,670
	(米ドル)	642,613	-	614,345	28,268	781,064	-	780,793	270
	(豪ドル)	343,328	276,743	329,605	13,722	330,025	252,895	283,555	46,469
	(英ポンド)	31,199	-	29,094	2,105	57,975	-	63,172	5,197
	買建	80,689	-	81,098	409	54,037	-	54,324	287
	(米ドル)	80,681	-	81,091	409	15,705	-	15,813	108
	(ユーロ)	5	-	5	0	38,068	-	38,248	180
	通貨オプション								
	売建								
	ブット	-	-	-	-	108,360	-	-	-
	(ユーロ)	(-)	-	-	-	(2,073)	-	10,126	8,053
	買建								
	ブット	34,681	34,681	-	-	108,360	-	10,126	8,053
	(米ドル)	(5,447)	-	6,641	1,194	(2,073)	-	10,126	8,053
	(ユーロ)	34,681	34,681	-	-	312,628	7,203	-	-
ブット	(5,447)	-	6,641	1,194	(30,545)	7,203	16,224	14,321	
(米ドル)	34,681	34,681	-	-	7,203	7,203	-	-	
(ユーロ)	(5,447)	-	6,641	1,194	(1,083)	-	822	261	
ブット	-	-	-	-	305,425	-	-	-	
(ユーロ)	(-)	-	-	-	(29,461)	-	15,401	14,060	
	合 計				61,150				22,126

(注)1.括弧内には、オプション料を記載しています。

- 外貨建金銭債権債務等が為替予約が付されていることにより、決済時における円貨額が確定している外貨建金銭債権債務等で、貸借対照表において当該円貨額で表示されているものについては、開示の対象より除いています。
 なお、開示の対象より除いている為替予約は、平成21年度第2四半期(上半期)末が米ドル売建の契約額 269,038百万円、時価 239,733百万円、差損益 29,305百万円、豪ドル売建の契約額 180,612百万円、時価 161,078百万円、差損益 19,534百万円、平成20年度末が米ドル売建の契約額 270,994百万円、時価 261,046百万円、差損益 9,948百万円、豪ドル売建の契約額 167,860百万円、時価 136,700百万円、差損益 31,160百万円です。
- 差損益欄には、先渡取引については契約額と時価との差額を記載し、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) 株式関連(会社計)

(単位:百万円)

区分	種類	平成21年度第2四半期(上半期)末				平成20年度末			
		契約額等		時価	差損益	契約額等		時価	差損益
			うち1年超				うち1年超		
取引所	株価指数先物								
	売建	38,662	-	37,910	752	174,389	-	197,146	22,756
	買建	4,998	-	4,892	106	1,912	-	1,973	61
	株価指数オプション								
	売建								
	コール	-	-	-	-	18,000	-	-	-
	プット	(-)	-	-	-	(1,092)	-	41	1,050
	買建								
	コール	-	-	-	-	11,000	-	2	979
	プット	(-)	-	-	-	(982)	-	2	979
店頭	株価指数オプション								
	買建								
	コール	-	-	-	-	65,042	-	-	-
	プット	(-)	-	-	-	(4,529)	-	3,786	742
	買建	295,825	29,700	-	-	154,450	6,100	-	-
	コール	(25,015)	-	13,308	11,707	(7,108)	-	30,957	23,849
	プット	-	-	-	-	-	-	-	-
	買建	-	-	-	-	-	-	-	-
	コール	-	-	-	-	-	-	-	-
	プット	-	-	-	-	-	-	-	-
合計									
									4,995

(注)1. 括弧内には、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契約額と時価との差額を記載し、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。