

# 平成26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・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	・・・	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	・・・	13 頁
b. 有価証券の時価情報	・・・	14 頁
c. 金銭の信託の時価情報	・・・	15 頁
d. デリバティブ取引の時価情報	・・・	16 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25年度末		平成26年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
国 債	10,010,100	51.3	10,168,320	49.1
地 方 債	72,010	0.4	55,671	0.3
社 債	2,444,732	12.5	2,507,128	12.1
うち公社・公団債	1,784,396	9.1	1,847,755	8.9
株 式	1,218,629	6.2	1,369,809	6.6
外 国 証 券	5,729,106	29.4	6,567,356	31.7
公 社 債	5,191,255	26.6	5,989,424	28.9
うち外貨建	3,709,120	19.0	4,225,198	20.4
株 式 等	537,850	2.8	577,932	2.8
うち外貨建	82,088	0.4	122,169	0.6
そ の 他 の 証 券	32,955	0.2	26,914	0.1
合 計	19,507,535	100.0	20,695,201	100.0
うち外貨建	3,798,956	19.5	4,355,684	21.0

#### (2) 地域別地方債保有内訳

(単位：百万円)

区 分	平成25年度末	平成26年度 第2四半期(上半期)末
北 海 道	-	-
東 北	-	-
関 東	38,409	37,494
中 部	16,668	10,776
近 畿	5,434	2,100
中 国	4,589	-
四 国	-	-
九 州	6,909	5,299
合 計	72,010	55,671

### (3) 有価証券残存期間別残高

<平成25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
有 価 証 券	839,602	1,780,961	1,235,189	1,136,381	1,863,349	10,840,670	1,811,380	19,507,535
国 債	201,883	426,144	190,903	245,158	451,822	8,494,188	-	10,010,100
地 方 債	46,106	17,192	1,952	4,067	2,692	-	-	72,010
社 債	288,458	471,505	244,563	88,745	193,907	1,135,213	22,338	2,444,732
株 式							1,218,629	1,218,629
外 国 証 券	302,792	866,119	797,770	798,411	1,214,928	1,211,268	537,816	5,729,106
公 社 債	302,758	866,119	797,770	798,411	1,214,928	1,211,268	-	5,191,255
株 式 等	34	-	-	-	-	-	537,816	537,850
その他の証券	360	-	-	-	-	-	32,595	32,955
買入金銭債権	39,995	2,240	-	-	-	204,363	-	246,599
譲渡性預金	37,997	-	-	-	-	-	-	37,997
そ の 他	-	-	-	-	-	-	-	-
合 計	917,595	1,783,202	1,235,189	1,136,381	1,863,349	11,045,033	1,811,380	19,792,132

<平成26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
有 価 証 券	818,707	1,786,987	1,345,499	1,310,790	2,083,475	11,352,908	1,996,833	20,695,201
国 債	118,596	446,036	149,120	292,861	506,604	8,655,099	-	10,168,320
地 方 債	22,661	7,374	5,063	-	2,703	17,869	-	55,671
社 債	327,414	387,117	208,333	73,587	279,500	1,208,878	22,296	2,507,128
株 式							1,369,809	1,369,809
外 国 証 券	349,951	946,458	982,982	944,341	1,294,666	1,471,059	577,895	6,567,356
公 社 債	349,914	946,458	982,982	944,341	1,294,666	1,471,059	-	5,989,424
株 式 等	36	-	-	-	-	-	577,895	577,932
その他の証券	83	-	-	-	-	-	26,831	26,914
買入金銭債権	9,998	1,790	-	-	-	190,662	-	202,452
譲渡性預金	72,984	-	-	-	-	-	-	72,984
そ の 他	-	-	-	-	-	-	-	-
合 計	901,690	1,788,778	1,345,499	1,310,790	2,083,475	11,543,570	1,996,833	20,970,638

(注)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います。

(4) 業種別株式保有の状況

(単位：百万円、%)

区 分		平成25年度末		平成26年度 第2四半期(上半期)末	
		金 額	占率	金 額	占率
水産・農林業		158	0.0	184	0.0
鉱業		92	0.0	108	0.0
建設業		39,555	3.2	45,882	3.3
製 造 業	食料品	37,624	3.1	44,587	3.3
	繊維製品	7,076	0.6	7,406	0.5
	パルプ・紙	5,673	0.5	5,187	0.4
	化学	104,837	8.6	121,969	8.9
	医薬品	66,498	5.5	74,566	5.4
	石油・石炭製品	4,622	0.4	4,910	0.4
	ゴム製品	5,413	0.4	5,771	0.4
	ガラス・土石製品	15,801	1.3	14,985	1.1
	鉄鋼	26,509	2.2	28,713	2.1
	非鉄金属	35,802	2.9	40,160	2.9
	金属製品	6,613	0.5	7,162	0.5
	機械	86,835	7.1	103,344	7.5
	電気機器	161,452	13.2	186,104	13.6
	輸送用機器	37,619	3.1	41,715	3.0
	精密機器	5,726	0.5	5,814	0.4
	その他製品	22,366	1.8	24,584	1.8
電気・ガス業		29,875	2.5	32,455	2.4
運 輸 ・ 情 報 通 信 業	陸運業	100,886	8.3	115,420	8.4
	海運業	4,940	0.4	4,550	0.3
	空運業	2,478	0.2	2,807	0.2
	倉庫・運輸関連業	7,179	0.6	7,842	0.6
	情報・通信業	9,174	0.8	10,160	0.7
商 業	卸売業	76,872	6.3	82,780	6.0
	小売業	17,693	1.5	20,098	1.5
金 融 ・ 保 険 業	銀行業	157,581	12.9	181,421	13.2
	証券、商品先物取引業	10,702	0.9	10,090	0.7
	保険業	77,178	6.3	82,600	6.0
	その他金融業	3,123	0.3	3,243	0.2
不動産業		14,868	1.2	14,490	1.1
サービス業		35,793	2.9	38,683	2.8
合 計		1,218,629	100.0	1,369,809	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25年度末	平成26年度 第2四半期(上半期)末
保 險 約 款 貸 付	335,002	328,675
契 約 者 貸 付	304,215	298,472
保 險 料 振 替 貸 付	30,787	30,202
一 般 貸 付 (うち非居住者貸付)	2,130,536 (58,478)	2,073,865 (58,008)
企 業 貸 付 (うち国内企業向け)	2,069,584 (2,056,158)	2,014,577 (2,001,508)
国・国際機関・政府関係機関貸付	16,973	16,717
公 共 団 体 ・ 公 企 業 貸 付	35,740	35,219
住 宅 ロ ー ン	6,898	6,572
消 費 者 ロ ー ン	1,078	779
そ の 他	260	-
合 計	2,465,539	2,402,541

(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25年度末		平成26年度 第2四半期(上半期)末	
			占率		占率
大 企 業	貸付先数	216	74.0	210	74.7
	金額	1,890,876	92.0	1,835,852	91.7
中 堅 企 業	貸付先数	4	1.4	3	1.1
	金額	9,653	0.5	7,060	0.4
中 小 企 業	貸付先数	72	24.7	68	24.2
	金額	155,628	7.6	158,595	7.9
国内企業向け 貸付計	貸付先数 金額	292 2,056,158	100.0 100.0	281 2,001,508	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	①右の②、③、④を除く 全業種	②小売業、飲食業	③サービス業	④卸売業
大 企 業	常用する 従業員 300人超 かつ 資本金10億円以上	常用する 従業員 50人超 かつ 資本金10億円以上	常用する 従業員 100人超 かつ 資本金10億円以上	常用する 従業員 100人超 かつ 資本金10億円以上
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3億円以下または 常用する従業員300人以下	資本金5千万円以下または 常用する従業員50人以下	資本金5千万円以下または 常用する従業員100人以下	資本金1億円以下または 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。
- サービス業は、「物品貸貸業」、「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」、及び「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25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	11,485	28,912	24,251	27,082	78,635	5,294	103,000	278,661
固 定 金 利	250,598	569,545	494,498	281,486	175,343	80,401	-	1,851,874
一 般 貸 付 計	262,083	598,457	518,750	308,569	253,979	85,695	103,000	2,130,536

<平成26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	11,109	25,585	26,049	29,098	70,540	5,055	103,000	270,437
固 定 金 利	249,539	608,158	411,355	259,711	197,202	77,462	-	1,803,428
一 般 貸 付 計	260,648	633,743	437,404	288,809	267,743	82,517	103,000	2,073,865

(4) 貸付金業種別内訳

(単位：百万円、%)

区 分		平成25年度末		平成26年度 第2四半期(上半期)末	
		金 額	占率	金 額	占率
製 造 業		460,759	21.6	442,820	21.4
	食料	18,760	0.9	20,460	1.0
	繊維	13,770	0.6	12,600	0.6
	木材・木製品	1,000	0.0	1,000	0.0
	パルプ・紙	27,462	1.3	26,730	1.3
	印刷	21	0.0	16	0.0
	化学	59,038	2.8	60,244	2.9
	石油・石炭	42,730	2.0	42,730	2.1
	窯業・土石	13,346	0.6	13,867	0.7
	鉄鋼	95,442	4.5	86,604	4.2
	非金属製品	10,441	0.5	5,900	0.3
	はん用・生産用・業務用機械	-	-	105	0.0
	電気機械	45,275	2.1	36,693	1.8
	輸送用機械	61,127	2.9	63,567	3.1
その他の製造業	64,644	3.0	64,602	3.1	
	7,700	0.4	7,700	0.4	
国 内 向 け	農業、林業	-	-	-	-
	漁業	-	-	-	-
	鉱業、採石業、砂利採取業	-	-	-	-
	建設業	3,746	0.2	3,403	0.2
	電気・ガス・熱供給・水道業	317,958	14.9	295,094	14.2
	情報通信業	47,981	2.3	48,900	2.4
	運輸業、郵便業	140,022	6.6	133,896	6.5
	卸売業	510,384	24.0	492,031	23.7
	小売業	11,291	0.5	10,098	0.5
	金融業、保険業	341,472	16.0	337,190	16.3
	不動産業	135,516	6.4	139,021	6.7
	物品賃貸業	87,438	4.1	91,323	4.4
	学術研究、専門・技術サービス業	1	0.0	-	-
	宿泊業	99	0.0	80	0.0
	飲食業	13	0.0	9	0.0
	生活関連サービス業、娯楽業	10	0.0	-	-
	教育、学習支援業	-	-	-	-
	医療・福祉	260	0.0	-	-
	その他のサービス	5,825	0.3	13,772	0.7
	地方公共団体	1,297	0.1	862	0.0
個人(住宅・消費・納税資金等)	7,977	0.4	7,351	0.4	
合計	2,072,057	97.3	2,015,856	97.2	
海 外 向 け	政 府 等	45,053	2.1	44,939	2.2
	金 融 機 関 等	12,000	0.6	12,000	0.6
	商 工 業 等	1,425	0.1	1,069	0.1
合計	58,478	2.7	58,008	2.8	
一 般 貸 付 計		2,130,536	100.0	2,073,865	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25年度末		平成26年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
担 保 貸 付	340	0.0	965	0.0
有 価 証 券 担 保 貸 付	185	0.0	832	0.0
不 動 産 ・ 動 産 ・ 財 団 担 保 貸 付	155	0.0	133	0.0
指 名 債 権 担 保 貸 付	-	-	-	-
保 証 貸 付	80,195	3.8	72,527	3.5
信 用 貸 付	2,042,022	95.8	1,993,021	96.1
そ の 他	7,977	0.4	7,351	0.4
一 般 貸 付 計	2,130,536	100.0	2,073,865	100.0
う ち 劣 後 特 約 付 貸 付	223,000	10.5	218,000	10.5

(6) 貸付金地域別内訳

(単位：百万円、%)

区 分	平成25年度末		平成26年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
北 海 道	12,644	0.6	12,357	0.6
東 北	38,486	1.9	38,134	1.9
関 東	1,453,114	70.4	1,427,047	71.1
中 部	143,402	6.9	141,380	7.0
近 畿	295,836	14.3	283,926	14.1
中 国	61,620	3.0	48,886	2.4
四 国	19,223	0.9	17,538	0.9
九 州	39,751	1.9	39,234	2.0
合 計	2,064,080	100.0	2,008,505	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25年度末		平成26年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
公 社 債	3,716,868	62.4	4,233,514	62.8
株 式 等	82,088	1.4	122,169	1.8
現 預 金 ・ そ の 他	57,246	1.0	58,745	0.9
外 貨 建 資 産 計	3,856,203	64.8	4,414,430	65.5

(イ) 円貨額が確定した外貨建資産

(単位：百万円、%)

区 分	平成25年度末		平成26年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
公 社 債	110,323	1.9	92,712	1.4
現 預 金 ・ そ の 他	60,793	1.0	33,178	0.5
円 貨 額 が 確 定 し た 外 貨 建 資 産 計	171,117	2.9	125,890	1.9

(ウ) 円貨建資産

(単位：百万円、%)

区 分	平成25年度末		平成26年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
非 居 住 者 貸 付	58,478	1.0	58,008	0.9
公 社 債	1,371,811	23.0	1,671,513	24.8
株 式 等	455,762	7.7	455,762	6.8
そ の 他	41,478	0.7	11,169	0.2
円 貨 建 資 産 計	1,927,531	32.4	2,196,454	32.6

(エ) 合計

(単位：百万円、%)

区 分	平成25年度末		平成26年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
海 外 投 融 資	5,954,851	100.0	6,736,775	100.0

(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25年度末					平成26年度第2四半期(上半期)末				
	金額	外国証券			非居住者 貸付	金額	外国証券			非居住者 貸付
		占率	公社債	株式等			占率	公社債	株式等	
北 米	金額	939,976	939,312	663	5,000	1,022,909	1,022,245	663	5,000	
	占率	16.4	18.1	0.1	8.6	15.6	17.1	0.1	8.6	
ヨーロッパ	金額	2,355,682	2,355,682	-	32,000	2,528,503	2,528,503	-	32,000	
	占率	41.1	45.4	-	54.7	38.5	42.2	-	55.2	
オセアニア	金額	237,751	237,751	-	5,000	398,451	398,451	-	5,000	
	占率	4.1	4.6	-	8.6	6.1	6.7	-	8.6	
ア ジ ア	金額	79,868	2,013	77,855	-	121,283	2,049	119,234	-	
	占率	1.4	0.0	14.5	-	1.8	0.0	20.6	-	
中 南 米	金額	1,690,304	1,230,973	459,331	1,425	1,990,999	1,532,966	458,033	1,069	
	占率	29.5	23.7	85.4	2.4	30.3	25.6	79.3	1.8	
中 東	金額	-	-	-	-	-	-	-	-	
	占率	-	-	-	-	-	-	-	-	
ア フ リ カ	金額	-	-	-	-	-	-	-	-	
	占率	-	-	-	-	-	-	-	-	
国際機関	金額	425,522	425,522	-	15,053	505,207	505,207	-	14,939	
	占率	7.4	8.2	-	25.7	7.7	8.4	-	25.8	
合 計	金額	5,729,106	5,191,255	537,850	58,478	6,567,356	5,989,424	577,932	58,008	
	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もしくは優先出資証券、または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。また、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25年度末		平成26年度 第2四半期(上半期)末	
	金額	占率	金額	占率
米 ド ル	1,290,939	33.5	1,542,787	34.9
ユ ー ロ	1,339,265	34.7	1,379,134	31.2
豪 ド ル	1,059,538	27.5	1,282,828	29.1
英 ポ ン ド	88,240	2.3	90,401	2.0
中 国 元	43,753	1.1	46,313	1.0
インドネシアルピア	21	0.0	38,131	0.9
ベトナムドン	33,203	0.9	33,193	0.8
そ の 他	1,240	0.0	1,640	0.0
合 計	3,856,203	100.0	4,414,430	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25年度末		平成26年度 第2四半期(上半期)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	60,140	7,709	62,493	10,027

#### (2) 変額個人年金保険

(単位：百万円)

区 分	平成25年度末		平成26年度 第2四半期(上半期)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	1,884,146	202,152	1,653,138	182,763

### 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25年度末			平成26年度第2四半期(上半期)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	-	-	-	-	-	-	-	
	買建	-	-	-	199	-	1	1	
	合 計							1	

(通貨関連)

(単位：百万円)

区分	種 類	平成25年度末			平成26年度第2四半期(上半期)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	589	-	△4	△4	-	-	-	
	(米ドル)	362	-	△2	△2	-	-	-	
	(ユーロ)	84	-	△0	△0	-	-	-	
	(英ポンド)	55	-	△0	△0	-	-	-	
	(豪ドル)	20	-	△0	△0	-	-	-	
	(カナダドル)	23	-	△0	△0	-	-	-	
	(シンガポールドル)	3	-	△0	△0	-	-	-	
	(ニュージーランドドル)	0	-	△0	△0	-	-	-	
	(スイスフラン)	24	-	△0	△0	-	-	-	
	(スウェーデンクローナ)	8	-	△0	△0	-	-	-	
	(デンマーククローネ)	3	-	△0	△0	-	-	-	
	(ノルウェークローネ)	3	-	△0	△0	-	-	-	
	買建	-	-	-	-	295	-	0	0
	(米ドル)	-	-	-	-	188	-	0	0
	(ユーロ)	-	-	-	-	38	-	0	0
	(英ポンド)	-	-	-	-	27	-	0	0
	(豪ドル)	-	-	-	-	8	-	△0	△0
	(カナダドル)	-	-	-	-	12	-	0	0
	(シンガポールドル)	-	-	-	-	0	-	0	0
	(ニュージーランドドル)	-	-	-	-	0	-	0	0
	(スイスフラン)	-	-	-	-	11	-	0	0
	(スウェーデンクローナ)	-	-	-	-	3	-	0	0
	(デンマーククローネ)	-	-	-	-	1	-	0	0
	(ノルウェークローネ)	-	-	-	-	1	-	0	0
		合 計							0

(注) 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) 変額個人年金保険

(株式関連)

(単位：百万円)

区分	種 類	平成25年度末			平成26年度第2四半期(上半期)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	-	-	-	-	-	-	-	
	買建	-	-	-	-	-	-	-	
	合 計								

(通貨関連)

(単位：百万円)

区分	種 類	平成25年度末			平成26年度第2四半期(上半期)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)	-	-	-	-	-	-	-	
	(ユーロ)	-	-	-	-	-	-	-	
	買建	-	-	-	-	-	-	-	
	(米ドル)	-	-	-	-	-	-	-	
	(ユーロ)	-	-	-	-	-	-	-	
	合 計								

(注) 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。

### 3. 会社計

#### a. 資産の構成（会社計）

##### （1）資産の構成

（単位：百万円、％）

区 分	平成25年度末		平成26年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
現預金・コールローン	571,588	2.2	373,065	1.4
買入金銭債権	289,088	1.1	242,596	0.9
有 価 証 券	22,034,382	83.2	22,975,753	84.9
公 社 債	13,651,052	51.6	13,800,529	51.0
株 式	1,738,128	6.6	1,898,046	7.0
外 国 証 券	6,162,983	23.3	6,995,974	25.8
公 社 債	5,445,390	20.6	6,232,335	23.0
株 式 等	717,593	2.7	763,639	2.8
そ の 他 の 証 券	482,218	1.8	281,203	1.0
貸 付 金	2,465,539	9.3	2,402,541	8.9
保 険 約 款 貸 付	335,002	1.3	328,675	1.2
一 般 貸 付	2,130,536	8.0	2,073,865	7.7
不 動 産	701,212	2.6	684,213	2.5
う ち 投 資 用	497,088	1.9	483,340	1.8
繰延税金資産	123,415	0.5	66,403	0.2
そ の 他	294,299	1.1	324,463	1.2
貸倒引当金	△2,189	△0.0	△1,849	△0.0
会 社 計	26,477,337	100.0	27,067,186	100.0
う ち 外 貨 建 資 産	4,301,000	16.2	4,855,608	17.9

（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25年度 第2四半期（上半期）	平成26年度 第2四半期（上半期）
	金 額	金 額
現預金・コールローン	△299,512	△198,522
買入金銭債権	△5,106	△46,492
有 価 証 券	302,266	941,370
公 社 債	303,124	149,476
株 式	187,815	159,917
外 国 証 券	△91,567	832,991
公 社 債	△87,498	786,945
株 式 等	△4,069	46,046
そ の 他 の 証 券	△97,105	△201,015
貸 付 金	△92,152	△62,997
保 険 約 款 貸 付	△6,047	△6,327
一 般 貸 付	△86,104	△56,670
不 動 産	△16,420	△16,998
う ち 投 資 用	△12,057	△13,748
繰延税金資産	17,344	△57,012
そ の 他	27,995	30,163
貸倒引当金	1,045	340
会 社 計	△64,538	589,849
う ち 外 貨 建 資 産	11,536	554,607

（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(会社計)

(1) 売買目的有価証券の評価損益

(単位：百万円)

区 分	平成25年度末		平成26年度第2四半期(上半期)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	2,526,847	434	2,280,551	△10,214

(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25年度末、平成26年度第2四半期(上半期)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25年度末					平成26年度第2四半期(上半期)末				
	帳簿価額	時価	差損益	差益	差損	帳簿価額	時価	差損益	差益	差損
満期保有目的の債券	1,849,463	2,043,711	194,248	194,450	△202	2,137,626	2,375,831	238,205	238,607	△401
責任準備金対応債券	11,017,008	12,016,439	999,431	1,002,270	△2,839	11,202,172	12,401,141	1,198,969	1,199,127	△158
子会社・関連会社株式	33,173	26,949	△6,224	-	△6,224	33,173	25,414	△7,759	-	△7,759
その他有価証券	5,696,439	6,295,483	599,044	636,213	△37,169	6,095,274	6,955,070	859,795	880,944	△21,148
公 社 債	1,049,875	1,072,292	22,416	22,590	△173	1,056,711	1,091,432	34,721	34,753	△32
株 式	773,053	1,122,423	349,370	379,075	△29,705	773,732	1,268,688	494,955	512,360	△17,405
外 国 証 券	3,576,239	3,784,083	207,844	214,507	△6,663	3,984,330	4,293,188	308,858	312,466	△3,608
公 社 債	3,570,313	3,779,335	209,022	214,432	△5,409	3,979,867	4,289,313	309,446	312,347	△2,900
株 式 等	5,926	4,747	△1,178	75	△1,253	4,463	3,874	△588	119	△707
その他の証券	24,635	32,087	7,451	8,062	△610	17,589	26,324	8,734	8,820	△86
買入金銭債権	234,635	246,599	11,963	11,978	△14	189,909	202,452	12,542	12,543	△0
譲渡性預金	38,000	37,997	△2	-	△2	73,000	72,984	△15	-	△15
そ の 他	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
合 計	18,596,085	20,382,584	1,786,499	1,832,935	△46,436	19,468,246	21,757,457	2,289,210	2,318,679	△29,468
公 社 債	12,504,427	13,542,685	1,038,257	1,041,418	△3,161	12,696,399	13,949,794	1,253,395	1,253,627	△232
株 式	773,053	1,122,423	349,370	379,075	△29,705	773,732	1,268,688	494,955	512,360	△17,405
外 国 証 券	5,021,333	5,400,791	379,458	392,399	△12,941	5,717,615	6,237,213	519,598	531,327	△11,728
公 社 債	4,982,232	5,369,094	386,861	392,324	△5,463	5,679,977	6,207,924	527,947	531,208	△3,260
株 式 等	39,100	31,697	△7,402	75	△7,477	37,637	29,289	△8,348	119	△8,467
その他の証券	24,635	32,087	7,451	8,062	△610	17,589	26,324	8,734	8,820	△86
買入金銭債権	234,635	246,599	11,963	11,978	△14	189,909	202,452	12,542	12,543	△0
譲渡性預金	38,000	37,997	△2	-	△2	73,000	72,984	△15	-	△15
そ の 他	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

(注)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います。

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す。

(単位：百万円)

区 分	平成25年度末	平成26年度第2四半期(上半期)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	72,290	115,403
その他有価証券	515,586	515,445
非上場国内株式(店頭売買株式を除く)	24,580	24,495
非上場外国株式(店頭売買株式を除く)	490,321	490,321
非 上 場 外 国 債 券	-	-
そ の 他	685	628
合 計	587,876	630,848

**c. 金銭の信託の時価情報(会社計)**

**(1) 運用目的の金銭の信託**

平成25年度末、平成26年度第2四半期(上半期)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25年度末、平成26年度第2四半期(上半期)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（会社計）

##### 【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、金利スワップション
為替派生商品	－	為替予約、通貨スワップ、通貨オプション
株式派生商品	株価指数先物、株価指数オプション	個別株オプション、株価指数オプション、 株価指数先渡
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

##### （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

当社が利用している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。（デリバティブ取引の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を含みます。）

##### （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. リスク管理規定

「資産運用リスク管理方針」及び「資産運用リスク管理規程」において、デリバティブ取引についての利用目的、取組対象、及びリスク管理体制等を規定しています。また、資産運用部門の細則等において、各部それぞれの役割に応じた具体的な取組みを規定しています。

## 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25年9月末	平成26年9月末	平成25年9月末	平成26年9月末
金利スワップ 金利スワップション(買建)	1,486	2,975	33	30
為替予約	36,618	38,473	1,062	976
通貨スワップ 通貨オプション(買建)	1,285	1,131	87	231
株式オプション(買建) 株価指数先渡	1,247	1,563	100	96
債券オプション(買建)	298	-	3	-
合計			414	504

(注1) 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。

(注2) 取引種類別の信用リスク相当額は、取引相手先が当社に対して有する与信額を考慮しないグロスベースのカレント・エクスポージャー方式で算出しており、合計(ネットベースのカレント・エクスポージャー方式にて算出)とは一致しません。

### 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25年度末						平成26年度第2四半期(上半期)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	1,834	△272,703	-	-	-	△270,869	1,569	△255,591	-	-	-	△254,022
ヘッジ会計非適用分	△847	△23,153	△1,323	1,043	-	△24,281	△1,707	△14,601	△14,062	979	-	△29,391
合 計	986	△295,857	△1,323	1,043	-	△295,150	△137	△270,193	△14,062	979	-	△283,414

(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25年度末通貨関連 △249,187百万円、平成26年度第2四半期(上半期)末通貨関連 △236,999百万円となっています。

(2) 金利関連（会社計）

(ヘッジ会計が適用されていないもの)

(単位：百万円)

区分	種 類	平成25年度末				平成26年度 第2四半期(上半期)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 固定金利支払/変動金利受取	34,500	-	△94	△94	34,500	-	△55	△55
	金利スワップション 買建 固定金利支払/変動金利受取	120,000	120,000			210,000	150,000		
		(1,254)		500	△753	(2,082)		430	△1,651
	合 計				△847				△1,707

(注)1.( )内には、オプション料を記載しています。

2. 差損益欄には、金利スワップ取引については時価を記載し、  
金利スワッ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。

(ヘッジ会計が適用されているもの)

(単位：百万円)

ヘッジ会計の方法	種 類	主なヘッジ対象	平成25年度末			平成26年度 第2四半期(上半期)末		
			契約額等		時価	契約額等		時価
			うち1年超			うち1年超		
特例処理	金利スワップ 固定金利受取/変動金利支払	貸付金	54,726	48,721	1,834	53,010	47,432	1,569
	合 計				1,834			1,569

(3) 通貨関連 (会社計)

(ヘッジ会計が適用されていないもの)

(単位：百万円)

区分	種 類	平成25年度末				平成26年度第2四半期(上半期)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	469,899	50,302	△19,717	△19,717	514,050	40,275	△18,064	△18,064	
	(豪ドル)	205,745	-	△17,572	△17,572	242,897	-	△4,403	△4,403	
	(米ドル)	188,256	50,302	△1,853	△1,853	166,042	40,275	△11,338	△11,338	
	(ユーロ)	73,839	-	△269	△269	79,602	-	759	759	
	(英ポンド)	956	-	△10	△10	24,441	-	△3,076	△3,076	
	買建	7,248	489	49	49	83,676	489	4,060	4,060	
	(米ドル)	4,253	489	17	17	52,476	489	3,574	3,574	
	(英ポンド)	583	-	6	6	25,229	-	510	510	
	(豪ドル)	84	-	1	1	4,313	-	△20	△20	
	(ユーロ)	2,102	-	22	22	1,525	-	△3	△3	
	通貨オプション									
	買建									
	プット	22,043	-			3,500	-			
	(米ドル)	(3,526)		40	△3,485	(596)			△596	
	22,043	-			3,500	-				
(米ドル)	(3,526)		40	△3,485	(596)			△596		
合 計								△23,153	△14,601	

- (注)1. ( )内には、オプション料を記載しています。  
 2. 差損益欄には、為替予約については時価を記載し、  
 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。

(ヘッジ会計が適用されているもの)

(単位：百万円)

ヘッジ会計の方法	種 類	主なヘッジ対象	平成25年度末			平成26年度第2四半期(上半期)末			
			契約額等		時価	契約額等		時価	
				うち1年超			うち1年超		
時価ヘッジ	為替予約								
	売建	外貨建資産	2,731,567	863,992	△249,187	3,143,704	961,904	△236,999	
	(ユーロ)		1,191,205	138,831	△99,877	1,290,227	227,460	△29,423	
	(米ドル)		792,016	341,757	△32,510	912,955	416,119	△84,193	
(豪ドル)	667,744		383,402	△107,162	856,250	318,324	△119,920		
振当処理	為替予約								
	売建	外貨建資産	126,581	108,961	△30,331	105,942	105,942	△32,788	
	(豪ドル)		94,347	94,347	△26,543	91,348	91,348	△29,543	
	(米ドル)		32,233	14,613	△3,788	14,594	14,594	△3,245	
	通貨スワップ	外貨建資産	-	-	-	10,180	10,180	△686	
	(米ドル)		-	-	-	10,180	10,180	△686	
通貨スワップ	外貨建負債	99,480	99,480	6,815	99,480	99,480	14,883		
(米ドル)		99,480	99,480	6,815	99,480	99,480	14,883		
合 計								△272,703	△255,591

(4) 株式関連 (会社計)

(ヘッジ会計が適用されていないもの)

(単位：百万円)

区分	種 類	平成25年度末			平成26年度第2四半期(上半期)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	257,919	-	3,809	3,809	194,602	-	△5,327	△5,327
	買建	3,999	-	△5	△5	2,981	-	57	57
店頭	株価指数先渡								
	売建	108,510	-	350	350	111,693	-	△7,424	△7,424
	株価指数オプション								
	売建								
	コール	-	-	-	-	12,000	-		
	(-)	(-)	-	-	(142)		72	69	
	プット	5,099	-	6	78	834	-		
	(85)	(85)			(10)		0	10	
	買建								
	コール	60,000	30,000			12,000	-		
(1,131)	(1,131)		712	△419	(208)		72	△136	
プット	24,200	-			32,672	-			
(5,179)	(5,179)		42	△5,136	(1,468)		156	△1,311	
合 計				△1,323				△14,062	

(注) 1. ( )内には、オプション料を記載しています。

2. 差損益欄には、先物取引及び先渡取引については時価を記載し、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。

(ヘッジ会計が適用されているもの)

平成25年度末、平成26年度第2四半期(上半期)末ともに残高がないため、記載していません。

(5) 債券関連 (会社計)

(ヘッジ会計が適用されていないもの)

(単位：百万円)

区分	種 類	平成25年度末			平成26年度第2四半期(上半期)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	債券先物								
	売建	293,251	-	1,043	1,043	309,677	-	979	979
合 計				1,043				979	

(注) 差損益欄には、時価を記載しています。

(ヘッジ会計が適用されているもの)

平成25年度末、平成26年度第2四半期(上半期)末ともに残高がないため、記載していません。