

## 平成20年度決算 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	・・・	10頁
3. 会社計		
a. 資産の構成	・・・	11頁
b. 有価証券の時価情報	・・・	12頁
c. 金銭の信託の時価情報	・・・	13頁
d. デリバティブ取引の時価情報	・・・	14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19年度末		平成20年度末	
	金 額	占率	金 額	占率
国 債	3,568,222	26.4	4,045,208	30.2
地 方 債	454,103	3.4	322,430	2.4
社 債	2,782,717	20.6	2,946,570	22.0
うち公社・公団債	1,440,307	10.7	1,653,751	12.3
株 式	1,664,309	12.3	1,148,805	8.6
外 国 証 券	4,971,538	36.8	4,913,376	36.6
公 社 債	4,356,048	32.3	4,051,836	30.2
うち外貨建	1,703,459	12.6	1,600,565	11.9
株 式 等	615,490	4.6	861,539	6.4
うち外貨建	235,377	1.7	180,876	1.3
その他の証券	54,365	0.4	34,202	0.3
合 計	13,495,257	100.0	13,410,593	100.0
うち外貨建	1,938,836	14.4	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19年度末	平成20年度末
北 海 道	13,002	7,258
東 北	15,174	7,012
関 東	159,491	127,633
中 部	83,380	63,020
近 畿	111,444	68,335
中 国	29,674	22,440
四 国	2,949	1,059
九 州	38,986	25,669
合 計	454,103	322,430

### (3) 有価証券残存期間別残高

<平成19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	348,324	305,076	353,495	560,204	556,637	1,444,483	-	3,568,222
地 方 債	130,357	61,773	109,622	125,063	19,709	7,577	-	454,103
社 債	198,157	516,363	342,479	601,253	587,800	514,469	22,193	2,782,717
株 式							1,664,309	1,664,309
外 国 証 券	476,187	869,040	597,225	158,076	719,578	1,535,999	615,430	4,971,538
公 社 債	476,186	868,981	597,225	158,076	719,578	1,535,999	-	4,356,048
株 式 等	0	58	-	-	-	-	615,430	615,490
その他の証券	136	969	2,906	-	-	-	50,353	54,365
合 計	1,153,164	1,753,222	1,405,729	1,444,598	1,883,727	3,502,529	2,352,287	13,495,257

<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19年度末		平成20年度末	
		金 額	占率	金 額	占率
水産・農林業		1,134	0.1	637	0.1
鉱業		925	0.1	244	0.0
建設業		27,935	1.7	23,546	2.0
製 造 業	食料品	43,787	2.6	31,053	2.7
	繊維製品	9,602	0.6	6,319	0.6
	パルプ・紙	5,496	0.3	5,415	0.5
	化学	119,538	7.2	71,528	6.2
	医薬品	82,995	5.0	71,058	6.2
	石油・石炭製品	6,218	0.4	5,297	0.5
	ゴム製品	4,545	0.3	4,085	0.4
	ガラス・土石製品	16,600	1.0	10,743	0.9
	鉄鋼	58,041	3.5	33,279	2.9
	非鉄金属	41,572	2.5	23,537	2.0
	金属製品	5,229	0.3	3,858	0.3
	機械	89,033	5.3	56,426	4.9
	電気機器	222,238	13.4	132,128	11.5
	輸送用機器	85,807	5.2	54,472	4.7
精密機器	14,420	0.9	7,826	0.7	
その他製品	37,119	2.2	17,671	1.5	
電気・ガス業		52,004	3.1	41,273	3.6
運 輸 ・ 情 報 通 信 業	陸運業	111,147	6.7	78,020	6.8
	海運業	18,392	1.1	7,168	0.6
	空運業	4,862	0.3	4,185	0.4
	倉庫・運輸関連業	6,926	0.4	5,378	0.5
	情報・通信業	14,950	0.9	10,076	0.9
商 業	卸売業	95,996	5.8	56,614	4.9
	小売業	29,188	1.8	21,529	1.9
金 融 ・ 保 険 業	銀行業	322,406	19.4	248,701	21.6
	証券、商品先物取引業	14,586	0.9	6,215	0.5
	保険業	72,396	4.3	67,072	5.8
	その他金融業	9,821	0.6	4,801	0.4
不動産業		9,720	0.6	7,985	0.7
サービス業		29,668	1.8	30,653	2.7
合 計		1,664,309	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19年度末	平成20年度末
保 険 約 款 貸 付	436,673	414,280
契 約 者 貸 付	389,306	371,396
保 険 料 振 替 貸 付	47,366	42,884
一 般 貸 付 (うち非居住者貸付)	3,621,265 (179,165)	3,454,896 (143,218)
企 業 貸 付 (うち国内企業向け)	3,419,145 (3,349,454)	3,289,650 (3,241,506)
国・国際機関・政府関係機関貸付	54,072	36,645
公 共 団 体 ・ 公 企 業 貸 付	108,473	99,007
住 宅 口 - ン	14,281	13,481
消 費 者 口 - ン	22,988	14,198
そ の 他	2,304	1,912
合 計	4,057,938	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19年度末		平成20年度末	
	貸付先数	占率	貸付先数	占率
大 企 業	貸付先数	361	349	58.4
	金 額	3,011,534	2,951,651	91.1
中 堅 企 業	貸付先数	23	15	2.5
	金 額	9,717	9,260	0.3
中 小 企 業	貸付先数	281	234	39.1
	金 額	328,203	280,594	8.7
国内企業向け 貸 付 計	貸付先数	665	598	100.0
	金 額	3,349,454	3,241,506	100.0

(注)1. 業種の区分は以下のとおりです。

業 種	右の、を 除く全業種		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	

2. 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。

3. 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。

### (3) 貸付金残存期間別残高

<平成19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	32,905	45,191	37,322	42,897	111,671	139,259	80,000	489,249
固 定 金 利	446,777	839,710	594,911	512,087	675,317	63,211	-	3,132,016
一 般 貸 付 計	479,683	884,902	632,233	554,985	786,989	202,470	80,000	3,621,265

<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19年度末		平成20年度末	
		金 額	占率	金 額	占率
国内向け		724,119	20.0	762,621	22.1
	製造業				
	食料	29,970	0.8	27,869	0.8
	繊維	12,898	0.4	15,827	0.5
	木材・木製品	1,705	0.0	1,631	0.0
	パルプ・紙	57,488	1.6	60,412	1.7
	印刷	123	0.0	92	0.0
	化学	59,941	1.7	81,857	2.4
	石油・石炭	67,108	1.9	63,157	1.8
	窯業・土石	21,907	0.6	20,256	0.6
	鉄鋼	90,585	2.5	102,092	3.0
	非金属製品	13,718	0.4	12,561	0.4
	一般機械	3,049	0.1	781	0.0
	電気機械	36,977	1.0	34,502	1.0
	輸送用機械	143,491	4.0	130,783	3.8
	精密機械	153,467	4.2	173,188	5.0
	その他の製造業	2,154	0.1	8,946	0.3
		29,532	0.8	28,659	0.8
	農業	-	-	-	-
	林業	-	-	-	-
漁業	-	-	-	-	
鉱業	-	-	-	-	
建設業	17,498	0.5	15,111	0.4	
電気・ガス・熱供給・水道業	693,495	19.2	636,471	18.4	
情報通信業	137,720	3.8	103,325	3.0	
運輸業	167,792	4.6	171,249	5.0	
卸売業	593,051	16.4	552,248	16.0	
小売業	29,602	0.8	26,829	0.8	
金融・保険業	668,034	18.4	676,120	19.6	
不動産業	195,307	5.4	176,276	5.1	
各種サービス	142,965	3.9	137,494	4.0	
地方公共団体	32,328	0.9	23,632	0.7	
個人（住宅・消費・納税資金等）	40,184	1.1	30,296	0.9	
合計	3,442,100	95.1	3,311,678	95.9	
海外向け	政府等	109,474	3.0	95,074	2.8
	金融機関	54,020	1.5	34,001	1.0
	工商業等	15,669	0.4	14,142	0.4
	合計	179,165	4.9	143,218	4.1
総合計	3,621,265	100.0	3,454,896	100.0	

### (5) 貸付金担保別内訳

(単位：百万円、%)

区 分	平成19年度末		平成20年度末	
	金 額	占率	金 額	占率
担 保 貸 付	40,826	1.1	32,962	1.0
有 価 証 券 担 保 貸 付	5,297	0.1	3,517	0.1
不 動 産 ・ 動 産 ・ 財 団 担 保 貸 付	20,940	0.6	20,013	0.6
指 名 債 権 担 保 貸 付	14,588	0.4	9,431	0.3
保 証 貸 付	175,609	4.8	153,370	4.4
信 用 貸 付	3,367,559	93.0	3,240,883	93.8
そ の 他	37,270	1.0	27,680	0.8
一 般 貸 付 計	3,621,265	100.0	3,454,896	100.0
う ち 劣 後 特 約 付 貸 付	317,000	8.8	356,000	10.3

### (6) 貸付金地域別内訳

(単位：百万円、%)

区 分	平成19年度末		平成20年度末	
	金 額	占率	金 額	占率
北 海 道	45,564	1.3	41,937	1.3
東 北	62,109	1.8	59,295	1.8
関 東	2,248,364	66.0	2,141,846	65.2
中 部	249,035	7.3	246,112	7.5
近 畿	567,837	16.7	561,833	17.1
中 国	90,585	2.7	86,868	2.6
四 国	23,206	0.7	22,490	0.7
九 州	118,127	3.5	123,614	3.8
合 計	3,404,830	100.0	3,283,998	100.0

(注)1. 個人ローン、非居住者貸付、保険約款貸付等は含みません。

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19年度末		平成20年度末	
	金 額	占率	金 額	占率
公 社 債	1,703,459	30.8	1,600,565	31.2
株 式 等	235,377	4.3	180,876	3.5
現 預 金 ・ そ の 他	33,033	0.6	42,796	0.8
外 貨 建 資 産 計	1,971,870	35.7	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19年度末		平成20年度末	
	金 額	占率	金 額	占率
公 社 債	470,418	8.5	393,828	7.7
現 預 金 ・ そ の 他	48,958	0.9	23,002	0.4
円 貨 額 が 確 定 し た 外 貨 建 資 産 計	519,376	9.4	416,830	8.1

ウ. 円貨建資産

(単位：百万円、%)

区 分	平成19年度末		平成20年度末	
	金 額	占率	金 額	占率
非 居 住 者 貸 付	179,165	3.2	143,218	2.8
公 社 債	2,182,170	39.5	2,057,442	40.1
株 式 等	380,112	6.9	680,663	13.3
そ の 他	289,686	5.2	10,078	0.2
円 貨 建 資 産 計	3,031,135	54.9	2,891,402	56.3

エ. 合計

(単位：百万円、%)

区 分	平成19年度末		平成20年度末	
	金 額	占率	金 額	占率
海 外 投 融 資	5,522,382	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19年度末				平成20年度末			
	金額	外国証券		非居住者 貸付	金額	外国証券		非居住者 貸付
		公社債	株式等			公社債	株式等	
北 米	1,550,597	1,549,756	840	8,139	894,561	893,554	1,007	8,139
	31.2	35.6	0.1	4.5	18.2	22.1	0.1	5.7
ヨーロッパ	1,078,616	1,075,772	2,844	101,000	1,436,543	1,431,776	4,766	71,000
	21.7	24.7	0.5	56.4	29.2	35.3	0.6	49.6
オセアニア	34,086	34,086	-	5,000	72,924	72,924	-	5,000
	0.7	0.8	-	2.8	1.5	1.8	-	3.5
ア ジ ア	12,536	3,493	9,043	12,282	10,315	3,455	6,859	11,882
	0.3	0.1	1.5	6.9	0.2	0.1	0.8	8.3
中 南 米	2,101,165	1,498,403	602,762	20,695	2,299,899	1,450,992	848,906	19,625
	42.3	34.4	97.9	11.6	46.8	35.8	98.5	13.7
中 東	-	-	-	277	-	-	-	250
	-	-	-	0.2	-	-	-	0.2
アフリカ	-	-	-	573	-	-	-	496
	-	-	-	0.3	-	-	-	0.3
国際機関	194,536	194,536	-	31,197	199,131	199,131	-	26,824
	3.9	4.5	-	17.4	4.1	4.9	-	18.7
合 計	4,971,538	4,356,048	615,490	179,165	4,913,376	4,051,836	861,539	143,218
	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の子会社及びS P C向け貸付（担保もしくは親会社保証付）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19年度末		平成20年度末	
	金 額	占率	金 額	占率
米 ド ル	1,286,221	65.2	756,599	41.5
ユ ー ロ	582,981	29.6	712,341	39.0
豪 ド ル	93,660	4.7	286,573	15.7
英 ボ ンド	58	0.0	61,962	3.4
中 国 元	4,155	0.2	4,186	0.2
韓 国 ウォン	4,249	0.2	2,257	0.1
そ の 他	543	0.0	317	0.0
合 計	1,971,870	100.0	1,824,237	100.0

## 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

#### (1) 個人変額保険

(単位:百万円)

区 分	平成19年度末		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	69,292	2,977	49,454	16,134

#### (2) 個人変額年金保険

(単位:百万円)

区 分	平成19年度末		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	1,768,268	80,818	1,794,558	288,001

### b. 金銭の信託の時価情報

個人変額保険、個人変額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

個人変額保険、個人変額年金保険ともに残高がないため、記載していません。

### 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19年度末		平成20年度末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
現預金・コールローン	760,387	3.3	476,579	2.1
買入金銭債権	880,103	3.8	437,022	1.9
有 価 証 券	16,024,737	68.5	15,792,810	69.8
公 社 債	7,923,881	33.9	8,402,187	37.2
株 式	2,329,665	10.0	1,721,766	7.6
外 国 証 券	5,615,437	24.0	5,376,798	23.8
公 社 債	4,785,834	20.5	4,337,411	19.2
株 式 等	829,603	3.5	1,039,386	4.6
その他の証券	155,752	0.7	292,058	1.3
貸 付 金	4,057,938	17.4	3,869,177	17.1
保険約款貸付	436,673	1.9	414,280	1.8
一 般 貸 付	3,621,265	15.5	3,454,896	15.3
不 動 産	1,006,917	4.3	997,424	4.4
うち投資用	754,203	3.2	749,069	3.3
繰延税金資産	321,582	1.4	441,632	2.0
そ の 他	332,485	1.4	597,337	2.6
貸倒引当金	1,584	0.0	2,233	0.0
会 社 計	23,382,567	100.0	22,609,749	100.0
うち外貨建資産	2,483,308	10.6	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19年度	平成20年度
	金 額	金 額
現預金・コールローン	140,876	283,808
買入金銭債権	47,201	443,080
有 価 証 券	256,286	231,926
公 社 債	3,980	478,305
株 式	573,625	607,899
外 国 証 券	344,490	238,639
公 社 債	393,044	448,422
株 式 等	48,553	209,783
その他の証券	23,171	136,305
貸 付 金	128,264	188,761
保険約款貸付	22,745	22,392
一 般 貸 付	105,519	166,368
不 動 産	69,213	9,492
うち投資用	64,163	5,134
繰延税金資産	285,338	120,050
そ の 他	73,187	264,852
貸倒引当金	3,292	649
会 社 計	96,130	772,817
うち外貨建資産	7,508	225,535

（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19年度末		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	2,529,479	△348,903	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おりますが、平成19年度末、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19年度末					平成20年度末				
	帳簿価額	時価	差損益	うち差益		帳簿価額	時価	差損益	うち差益	
				うち差益	うち差損				うち差益	うち差損
満期保有目的の債券	2,411,189	2,395,822	△15,366	15,156	△30,522	2,359,908	2,366,372	6,464	40,002	△33,537
責任準備金対応債券	5,786,998	5,912,892	125,893	132,462	△6,568	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	5,186,077	5,389,536	203,459	368,456	△164,997	4,122,091	3,867,031	△255,060	120,460	△375,520
公 社 債	883,581	884,656	1,075	12,855	△11,779	747,669	745,826	△1,843	10,540	△12,383
株 式	1,260,079	1,516,285	256,206	335,092	△78,885	1,195,691	992,636	△203,055	59,635	△262,691
外 国 証 券	2,474,482	2,412,327	△62,155	9,838	△71,993	2,126,550	2,082,780	△43,769	47,073	△290,843
公 社 債	2,124,680	2,078,246	△46,433	6,788	△53,222	1,872,676	1,871,670	△1,006	46,829	△47,836
株 式 等	349,801	334,080	△15,721	3,049	△18,771	253,874	211,110	△42,763	244	△43,007
その他の証券	43,912	52,256	8,344	10,618	△2,273	40,082	33,691	△6,391	3,209	△9,600
買入金銭債権	416,022	416,074	52	52	-	5,097	5,098	1	1	-
譲渡性預金	108,000	107,935	△64	-	△64	7,000	6,998	△1	-	△1
その他	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
合 計	13,384,265	13,698,251	313,986	516,075	△202,089	12,870,639	12,763,758	△106,881	328,150	△435,031
公 社 債	6,803,967	6,943,525	139,557	154,615	△15,057	7,316,052	7,472,940	156,888	185,097	△28,208
株 式	1,260,079	1,516,285	256,206	335,092	△78,885	1,195,691	992,636	△203,055	59,635	△262,691
外 国 証 券	4,752,284	4,662,173	△90,110	15,696	△105,807	4,306,717	4,252,394	△54,322	80,206	△134,529
公 社 債	4,402,482	4,328,093	△74,389	12,646	△87,036	4,052,842	4,041,283	△11,559	79,962	△91,521
株 式 等	349,801	334,080	△15,721	3,049	△18,771	253,874	211,110	△42,763	244	△43,007
その他の証券	43,912	52,256	8,344	10,618	△2,273	40,082	33,691	△6,391	3,209	△9,600
買入金銭債権	416,022	416,074	52	52	-	5,097	5,098	1	1	-
譲渡性預金	108,000	107,935	△64	-	△64	7,000	6,998	△1	-	△1
その他	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

(注) 本表には、CD（譲渡性預金）等、金融商品取引法上の有価証券として取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19年度末	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	56,033	60,230
その他の有価証券	637,007	1,036,032
非上場国内株式(店頭売買株式を除く)	92,654	96,603
非上場外国株式(店頭売買株式を除く)	280,341	649,341
非上場外国債券	-	-
その他	264,011	290,087
合 計	693,040	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（会社計）

（ 1 ）運用目的の金銭の信託

平成19年度末、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19年度末、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、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

#### （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、各投資案件毎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19年度末	平成20年度末	平成19年度末	平成20年度末
金利スワップ	6,400	1,009	50	32
為替予約	15,596	23,894	1,059	2,120
通貨オプション(買建)	6,820	3,126	147	196
株式オプション(買建)	3,000	2,194	203	480
合計			889	2,384

(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19年度末						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	1,297	6,537	-	-	-	5,240	2,237	50,154	-	-	-	52,391
ヘッジ会計非適用分	3,513	11,473	2,139	-	-	5,820	-	13,080	4,995	-	-	8,084
合 計	2,216	4,936	2,139	-	-	580	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19年度末通貨関連 25,989百万円、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19年度末				平成20年度末			
		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
店 頭	金利スワップ								
	固定金利受取 / 変動金利支払	92,923	71,436	1,351	1,351	87,157	83,387	2,276	2,276
	固定金利支払 / 変動金利受取	542,167	517,398	3,477	3,477	13,774	4,247	38	38
	その他								
	キャップ付金利スワップ								
	固定金利受取 / 変動金利支払	5,000	-	89	89	-	-	-	-
	合 計				2,216				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19年度末				平成20年度末			
		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
店 頭	為替予約								
	売建	959,377	440,450	975,329	15,951	1,896,964	390,315	1,852,750	44,213
	(米ドル)	329,799	-	306,533	23,265	781,064	-	780,793	270
	(ユーロ)	535,922	347,699	573,404	37,482	727,685	137,420	725,015	2,670
	(豪ドル)	92,751	92,751	94,492	1,741	330,025	252,895	283,555	46,469
	(英ポンド)	56	-	55	1	57,975	-	63,172	5,197
	買建	94,328	-	94,760	432	54,037	-	54,324	287
	(ユーロ)	72	-	72	0	38,068	-	38,248	180
	(米ドル)	178	-	178	0	15,705	-	15,813	108
	(豪ドル)	94,059	-	94,492	432	-	-	-	-
	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	682,000	-	-	-	312,628	7,203	-	-
	(ユーロ)	(6,889)	-	7,891	1,002	(30,545)	-	16,224	14,321
(米ドル)	-	-	-	-	305,425	-	-	-	
(豪ドル)	(-)	-	-	-	(29,461)	-	15,401	14,060	
合 計				14,516				22,126	

(注)1. 括弧内には、オプション料を記載しています。

2. 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19年度末が米ドル売建の契約額 505,914百万円、時価 486,462百万円、差損益 19,452百万円、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。

3. 差損益欄には、先渡取引については契約額等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19年度末				平成20年度末			
		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
取引所	株価指数先物								
	売建	-	-	-	-	174,389	-	197,146	22,756
	買建	4,286	-	4,290	3	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	-	-	-	-	84,900	-		
	プット	(-)	-	-	-	(5,600)	-	2,533	3,066
店頭	買建								
	コール	-	-	-	-	65,042	-		
	プット	(-)	-	-	-	(4,529)	-	3,786	742
	買建	300,000	-			154,450	6,100		
	買建	(4,443)		2,300	2,143	(7,108)		30,957	23,849
	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。