

## 平成21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20年度末		平成21年度末	
	金 額	占率	金 額	占率
国 債	4,045,208	30.2	4,926,553	35.2
地 方 債	322,430	2.4	283,654	2.0
社 債	2,946,570	22.0	2,850,101	20.4
うち公社・公団債	1,653,751	12.3	1,699,850	12.1
株 式	1,148,805	8.6	1,320,983	9.4
外 国 証 券	4,913,376	36.6	4,587,080	32.8
公 社 債	4,051,836	30.2	3,990,477	28.5
うち外貨建	1,600,565	11.9	1,783,838	12.7
株 式 等	861,539	6.4	596,602	4.3
うち外貨建	180,876	1.3	46,508	0.3
その他の証券	34,202	0.3	33,029	0.2
合 計	13,410,593	100.0	14,001,401	100.0
うち外貨建	1,781,441	13.3	1,830,346	13.1

#### (2) 地域別地方債保有内訳

(単位：百万円)

区 分	平成20年度末	平成21年度末
北 海 道	7,258	5,416
東 北	7,012	1,143
関 東	127,633	115,789
中 部	63,020	55,249
近 畿	68,335	58,228
中 国	22,440	22,388
四 国	1,059	351
九 州	25,669	25,086
合 計	322,430	283,654

(3) 有価証券残存期間別残高

<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
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

<平成21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
国 債	83,814	122,203	147,994	376,812	364,598	3,831,130	-	4,926,553
地 方 債	21,108	109,763	125,412	18,788	5,980	2,601	-	283,654
社 債	247,854	376,904	639,030	488,490	277,503	798,297	22,020	2,850,101
株 式							1,320,983	1,320,983
外 国 証 券	270,261	273,684	749,553	565,441	748,511	1,383,063	596,564	4,587,080
公 社 債	270,260	273,647	749,553	565,441	748,511	1,383,063	-	3,990,477
株 式 等	1	36	-	-	-	-	596,564	596,602
その他の証券	628	1,177	-	-	-	-	31,224	33,029
合 計	623,667	883,732	1,661,990	1,449,532	1,396,594	6,015,092	1,970,791	14,001,401

(4) 業種別株式保有の状況

(単位：百万円、%)

区 分		平成20年度末		平成21年度末	
		金 額	占率	金 額	占率
水 産 ・ 農 林 業		637	0.1	697	0.1
鉱 業		244	0.0	237	0.0
建 設 業		23,546	2.0	26,808	2.0
製 造 業	食 料 品	31,053	2.7	36,516	2.8
	織 維 製 品	6,319	0.6	7,370	0.6
	パ ル プ ・ 紙	5,415	0.5	5,575	0.4
	化 学	71,528	6.2	97,749	7.4
	医 薬 品	71,058	6.2	79,623	6.0
	石 油 ・ 石 炭 製 品	5,297	0.5	4,507	0.3
	ゴ ム 製 品	4,085	0.4	4,552	0.3
	ガ ラ ス ・ 土 石 製 品	10,743	0.9	11,856	0.9
	鉄 鋼	33,279	2.9	42,604	3.2
	非 鉄 金 属	23,537	2.0	33,876	2.6
	金 属 製 品	3,858	0.3	4,865	0.4
	機 械	56,426	4.9	81,916	6.2
	電 気 機 器	132,128	11.5	172,006	13.0
	輸 送 用 機 器	54,472	4.7	67,091	5.1
	精 密 機 器	7,826	0.7	12,343	0.9
そ の 他 製 品	17,671	1.5	21,659	1.6	
電 気 ・ ガ ス 業		41,273	3.6	41,605	3.1
運 輸 ・ 情 報 通 信 業	陸 運 業	78,020	6.8	82,496	6.2
	海 運 業	7,168	0.6	10,370	0.8
	空 運 業	4,185	0.4	3,425	0.3
	倉 庫 ・ 運 輸 関 連 業	5,378	0.5	5,881	0.4
	情 報 ・ 通 信 業	10,076	0.9	6,990	0.5
商 業	卸 売 業	56,614	4.9	71,429	5.4
	小 売 業	21,529	1.9	23,388	1.8
金 融 ・ 保 険 業	銀 行 業	248,701	21.6	237,560	18.0
	証 券、商 品 先 物 取 引 業	6,215	0.5	7,314	0.6
	保 険 業	67,072	5.8	70,323	5.3
	そ の 他 金 融 業	4,801	0.4	5,405	0.4
不 動 産 業		7,985	0.7	11,151	0.8
サ ー ビ ス 業		30,653	2.7	31,781	2.4
合 計		1,148,805	100.0	1,320,983	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20年度末	平成21年度末
保 險 約 款 貸 付	414,280	390,623
契 約 者 貸 付	371,396	351,500
保 険 料 振 替 貸 付	42,884	39,122
一 般 貸 付 (うち非居住者貸付)	3,454,896 (143,218)	3,053,263 (103,005)
企 業 貸 付 (うち国内企業向け)	3,289,650 (3,241,506)	2,933,245 (2,900,733)
国・国際機関・政府関係機関貸付	36,645	33,054
公 共 団 体 ・ 公 企 業 貸 付	99,007	65,665
住 宅 ロ ー ン	13,481	12,212
消 費 者 ロ ー ン	14,198	8,668
そ の 他	1,912	417
合 計	3,869,177	3,443,887

(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20年度末		平成21年度末	
	貸付先数	占率	貸付先数	占率
大 企 業	貸付先数	349	326	62.0
	金 額	2,951,651	2,663,539	91.8
中 堅 企 業	貸付先数	15	12	2.3
	金 額	9,260	14,715	0.5
中 小 企 業	貸付先数	234	188	35.7
	金 額	280,594	222,478	7.7
国内企業向け 貸 付 計	貸付先数	598	526	100.0
	金 額	3,241,506	2,900,733	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	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
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。
- サービス業は、「物品賃貸業」、「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

<平成21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	12,549	47,927	35,872	68,272	75,171	70,544	118,000	428,337
固 定 金 利	316,489	607,388	541,945	535,716	561,010	62,375	-	2,624,926
一 般 貸 付 計	329,039	655,315	577,818	603,988	636,181	132,920	118,000	3,053,263

(4) 貸付金業種別内訳

(単位：百万円、%)

区 分		平成20年度末		区 分		平成21年度末	
		金 額	占率			金 額	占率
国内向け		762,621	22.1		707,170	23.2	
	食料	27,869	0.8	食料	29,180	1.0	
	繊維	15,827	0.5	繊維	16,544	0.5	
	木材・木製品	1,631	0.0	木材・木製品	1,252	0.0	
	パルプ・紙	60,412	1.7	パルプ・紙	46,433	1.5	
	印刷	92	0.0	印刷	56	0.0	
	化学	81,857	2.4	化学	75,142	2.5	
	石油・石炭	63,157	1.8	石油・石炭	59,907	2.0	
	窯業・土石	20,256	0.6	窯業・土石	19,108	0.6	
	鉄鋼	102,092	3.0	鉄鋼	103,455	3.4	
	非鉄金属	12,561	0.4	非鉄金属	13,454	0.4	
	金属製品	781	0.0	金属製品	718	0.0	
	一般機械	34,502	1.0	はん用・生産用・業務用機械	39,849	1.3	
	電気機械	130,783	3.8	電気機械	122,797	4.0	
	輸送用機械	173,188	5.0	輸送用機械	154,273	5.1	
	精密機械	8,946	0.3	その他の製造業	24,995	0.8	
	その他の製造業	28,659	0.8				
	農業	-	-	農業、林業	-	-	
	林業	-	-	漁業	-	-	
	漁業	-	-	鉱業、採石業、砂利採取業	-	-	
	鉱業	-	-	建設業	12,297	0.4	
	建設業	15,111	0.4	電気・ガス・熱供給・水道業	541,171	17.7	
	電気・ガス・熱供給・水道業	636,471	18.4	情報通信業	77,355	2.5	
情報通信業	103,325	3.0	運輸業、郵便業	169,167	5.5		
運輸業	171,249	5.0	卸売業	533,660	17.5		
卸売業	552,248	16.0	小売業	24,364	0.8		
小売業	26,829	0.8	金融業、保険業	548,463	18.0		
金融・保険業	676,120	19.6	不動産業	171,181	5.6		
不動産業	176,276	5.1	物品賃貸業	116,087	3.8		
各種サービス	137,494	4.0	学術研究、専門・技術サービス業	1,025	0.0		
地方公共団体	23,632	0.7	宿泊業	231	0.0		
個人(住宅・消費・納税資金等)	30,296	0.9	飲食業	128	0.0		
			生活関連サービス業、娯楽業	259	0.0		
合計	3,311,678	95.9	教育、学習支援業	-	-		
海外向け			医療・福祉	623	0.0		
政府等	95,074	2.8	その他のサービス	8,289	0.3		
金融機関	34,001	1.0	地方公共団体	15,419	0.5		
商工業等	14,142	0.4	個人(住宅・消費・納税資金等)	23,360	0.8		
合計	143,218	4.1	合計	2,950,258	96.6		
一般貸付計	3,454,896	100.0	海外向け				
			政府等	70,492	2.3		
			金融機関	22,000	0.7		
			商工業等	10,512	0.3		
			合計	103,005	3.4		
			一般貸付計	3,053,263	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20年度末		平成21年度末	
	金 額	占率	金 額	占率
担 保 貸 付	32,962	1.0	17,770	0.6
有 価 証 券 担 保 貸 付	3,517	0.1	2,687	0.1
不 動 産 ・ 動 産 ・ 財 団 担 保 貸 付	20,013	0.6	15,082	0.5
指 名 債 権 担 保 貸 付	9,431	0.3	-	-
保 証 貸 付	153,370	4.4	130,228	4.3
信 用 貸 付	3,240,883	93.8	2,884,384	94.5
そ の 他	27,680	0.8	20,880	0.7
一 般 貸 付 計	3,454,896	100.0	3,053,263	100.0
う ち 劣 後 特 約 付 貸 付	356,000	10.3	288,000	9.4

(6) 貸付金地域別内訳

(単位：百万円、%)

区 分	平成20年度末		平成21年度末	
	金 額	占率	金 額	占率
北 海 道	41,937	1.3	36,859	1.3
東 北	59,295	1.8	62,673	2.1
関 東	2,141,846	65.2	1,882,013	64.2
中 部	246,112	7.5	232,664	7.9
近 畿	561,833	17.1	499,530	17.1
中 国	86,868	2.6	90,922	3.1
四 国	22,490	0.7	28,324	1.0
九 州	123,614	3.8	96,388	3.3
合 計	3,283,998	100.0	2,929,377	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20年度末		平成21年度末	
	金 額	占率	金 額	占率
公 社 債	1,600,565	31.2	1,783,838	37.2
株 式 等	180,876	3.5	46,508	1.0
現 預 金 ・ そ の 他	42,796	0.8	48,784	1.0
外 貨 建 資 産 計	1,824,237	35.5	1,879,131	39.2

イ. 円貨額が確定した外貨建資産

(単位：百万円、%)

区 分	平成20年度末		平成21年度末	
	金 額	占率	金 額	占率
公 社 債	393,828	7.7	389,874	8.1
現 預 金 ・ そ の 他	23,002	0.4	28,000	0.6
円 貨 額 が 確 定 し た 外 貨 建 資 産 計	416,830	8.1	417,874	8.7

ウ. 円貨建資産

(単位：百万円、%)

区 分	平成20年度末		平成21年度末	
	金 額	占率	金 額	占率
非 居 住 者 貸 付	143,218	2.8	103,005	2.2
公 社 債	2,057,442	40.1	1,816,764	37.9
株 式 等	680,663	13.3	550,094	11.5
そ の 他	10,078	0.2	23,691	0.5
円 貨 建 資 産 計	2,891,402	56.3	2,493,555	52.1

エ. 合計

(単位：百万円、%)

区 分	平成20年度末		平成21年度末	
	金 額	占率	金 額	占率
海 外 投 融 資	5,132,470	100.0	4,790,561	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20年度末				平成21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	金額	894,561	893,554	1,007	8,139	779,676	778,867	809	8,139
	占率	18.2	22.1	0.1	5.7	17.0	19.5	0.1	7.9
ヨーロッパ	金額	1,436,543	1,431,776	4,766	71,000	1,505,485	1,498,592	6,892	56,000
	占率	29.2	35.3	0.6	49.6	32.8	37.6	1.2	54.4
オセアニア	金額	72,924	72,924	-	5,000	45,770	45,770	-	5,000
	占率	1.5	1.8	-	3.5	1.0	1.1	-	4.9
ア ジ ア	金額	10,315	3,455	6,859	11,882	18,518	3,498	15,019	2,682
	占率	0.2	0.1	0.8	8.3	0.4	0.1	2.5	2.6
中 南 米	金額	2,299,899	1,450,992	848,906	19,625	2,001,060	1,427,178	573,881	4,270
	占率	46.8	35.8	98.5	13.7	43.6	35.8	96.2	4.1
中 東	金額	-	-	-	250	-	-	-	168
	占率	-	-	-	0.2	-	-	-	0.2
アフリカ	金額	-	-	-	496	-	-	-	420
	占率	-	-	-	0.3	-	-	-	0.4
国際機関	金額	199,131	199,131	-	26,824	236,569	236,569	-	26,324
	占率	4.1	4.9	-	18.7	5.2	5.9	-	25.6
合 計	金額	4,913,376	4,051,836	861,539	143,218	4,587,080	3,990,477	596,602	103,005
	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20年度末		平成21年度末	
	金額	占率	金額	占率
ユ ー ロ	712,341	39.0	1,020,022	54.3
米 ド ル	756,599	41.5	494,000	26.3
豪 ド ル	286,573	15.7	312,267	16.6
英 ボ ンド	61,962	3.4	37,930	2.0
中 国 元	4,186	0.2	12,262	0.7
韓 国 ウォン	2,257	0.1	2,649	0.1
そ の 他	317	0.0	-	-
合 計	1,824,237	100.0	1,879,131	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20年度末		平成21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	49,454	16,134	58,397	4,710

#### (2) 変額個人年金保険

(単位：百万円)

区 分	平成20年度末		平成21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	1,794,558	288,001	2,414,929	33,127

### 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20年度末			平成21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	-	-	-	-	-	24	24	
	買建	-	-	-	-	-	-	-	
	合 計							24	

#### (2) 変額個人年金保険

(株式関連)

(単位：百万円)

区分	種 類	平成20年度末			平成21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	-	-	-	-	-	150	150	
	買建	-	-	-	-	-	-	-	
	合 計							150	

(通貨関連)

(単位：百万円)

区分	種 類	平成20年度末			平成21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	-	-	-	66,933	-	837	837	
	(米ドル) 買建	-	-	-	66,933	-	837	837	
	合 計							837	

(注)1. 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、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20年度末		平成21年度末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
現預金・コールローン	476,579	2.1	346,141	1.5
買入金銭債権	437,022	1.9	462,598	2.0
有 価 証 券	15,792,810	69.8	17,116,912	74.4
公 社 債	8,402,187	37.2	9,212,802	40.0
株 式	1,721,766	7.6	1,964,122	8.5
外 国 証 券	5,376,798	23.8	5,139,021	22.3
公 社 債	4,337,411	19.2	4,325,734	18.8
株 式 等	1,039,386	4.6	813,286	3.5
その他の証券	292,058	1.3	800,965	3.5
貸 付 金	3,869,177	17.1	3,443,887	15.0
保険約款貸付	414,280	1.8	390,623	1.7
一 般 貸 付	3,454,896	15.3	3,053,263	13.3
不 動 産	997,424	4.4	977,742	4.2
うち投資用	749,069	3.3	735,640	3.2
繰延税金資産	441,632	2.0	303,203	1.3
そ の 他	597,337	2.6	375,754	1.6
貸倒引当金	2,233	0.0	7,923	0.0
会 社 計	22,609,749	100.0	23,018,316	100.0
うち外貨建資産	2,257,772	10.0	2,416,496	10.5

（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	平成21年度
	金 額	金 額
現預金・コールローン	283,808	130,437
買入金銭債権	443,080	25,576
有 価 証 券	231,926	1,324,101
公 社 債	478,305	810,615
株 式	607,899	242,355
外 国 証 券	238,639	237,776
公 社 債	448,422	11,676
株 式 等	209,783	226,099
その他の証券	136,305	508,907
貸 付 金	188,761	425,290
保険約款貸付	22,392	23,657
一 般 貸 付	166,368	401,632
不 動 産	9,492	19,681
うち投資用	5,134	13,428
繰延税金資産	120,050	138,429
そ の 他	264,852	221,582
貸倒引当金	649	5,690
会 社 計	772,817	408,567
うち外貨建資産	225,535	158,723

（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20年度末		平成21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	2,382,216	△305,962	3,115,510	379,063

(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20年度末、平成21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20年度末					平成21年度末				
	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	2,359,908	2,366,372	6,464	40,002	△33,537	2,227,110	2,215,247	△11,863	21,015	△32,878
責任準備金対応債券	6,388,640	6,530,354	141,714	167,687	△25,973	7,039,142	7,171,915	132,772	153,118	△20,345
子会社・関連会社株式	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他の有価証券	4,122,091	3,867,031	△255,060	120,460	△375,520	4,282,786	4,352,545	69,758	225,140	△155,382
公 社 債	747,669	745,826	△1,843	10,540	△12,383	800,567	801,836	1,268	9,915	△8,646
株 式	1,195,691	992,636	△203,055	59,635	△262,691	1,105,836	1,164,082	58,245	167,203	△108,957
外 国 証 券	2,126,550	2,082,780	△43,769	47,073	△90,843	2,019,909	2,025,790	5,881	39,589	△33,708
公 社 債	1,872,676	1,871,670	△1,006	46,829	△47,836	1,972,184	1,982,697	10,512	39,530	△29,018
株 式 等	253,874	211,110	△42,763	244	△43,007	47,724	43,093	△4,631	58	△4,690
その他の証券	40,082	33,691	△6,391	3,209	△9,600	31,442	31,223	△219	3,509	△3,728
買入金銭債権	5,097	5,098	1	1	-	313,030	317,613	4,582	4,922	△340
譲渡性預金	7,000	6,998	△1	-	△1	12,000	11,999	△0	-	△0
その他	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
合 計	12,870,639	12,763,758	△106,881	328,150	△435,031	13,549,040	13,739,708	190,667	399,274	△208,606
公 社 債	7,316,052	7,472,940	156,888	185,097	△28,208	8,059,041	8,206,367	147,326	173,624	△26,297
株 式	1,195,691	992,636	△203,055	59,635	△262,691	1,105,836	1,164,082	58,245	167,203	△108,957
外 国 証 券	4,306,717	4,252,394	△54,322	80,206	△134,529	4,027,689	4,008,422	△19,267	50,014	△69,282
公 社 債	4,052,842	4,041,283	△11,559	79,962	△91,521	3,979,965	3,965,328	△14,636	49,955	△64,592
株 式 等	253,874	211,110	△42,763	244	△43,007	47,724	43,093	△4,631	58	△4,690
その他の証券	40,082	33,691	△6,391	3,209	△9,600	31,442	31,223	△219	3,509	△3,728
買入金銭債権	5,097	5,098	1	1	-	313,030	317,613	4,582	4,922	△340
譲渡性預金	7,000	6,998	△1	-	△1	12,000	11,999	△0	-	△0
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20年度末	平成21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	62,415
その他の有価証券	1,036,032	649,743
非上場国内株式(店頭売買株式を除く)	96,603	95,149
非上場外国株式(店頭売買株式を除く)	649,341	552,626
非上場外国債券	-	-
その他	290,087	1,968
合 計	1,096,262	712,158

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20年度末、平成21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20年度末、平成21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

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年度末	平成21年度末	平成20年度末	平成21年度末
金利スワップ	1,009	899	32	38
為替予約	23,894	26,494	2,120	1,543
通貨オプション(買建)	3,126	580	196	89
株式オプション(買建)	2,194	2,703	480	211
合計			2,384	1,544

(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20年度末					合 計	平成21年度末					合 計
	金利関連	通貨関連	株式関連	債券関連	その他		金利関連	通貨関連	株式関連	債券関連	その他	
ヘッジ会計適用分	2,237	50,154	-	-	-	52,391	2,895	56,107	-	-	-	59,002
ヘッジ会計非適用分	-	13,080	△4,995	-	-	8,084	-	1,591	△20,707	-	-	△19,116
合 計	2,237	63,234	△4,995	-	-	60,476	2,895	57,699	△20,707	-	-	39,886

(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20年度末通貨関連 9,045百万円、平成21年度末通貨関連 25,912百万円となっています。

(2) 金利関連（会社計）

（単位：百万円）

区 分	種 類	平成20年度末			差損益	平成21年度末			差損益
		契約額等	うち1年超	時価		契約額等	うち1年超	時価	
店 頭	金利スワップ								
	固定金利受取/変動金利支払	87,157	83,387	2,276	2,276	85,750	80,836	2,910	2,910
	固定金利支払/変動金利受取	13,774	4,247	△38	△38	4,247	1,848	△14	△14
	合 計				2,237				2,895

(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20年度末				平成21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	1,896,964	390,315	1,852,750	44,213	2,111,736	422,029	25,435	25,435
	(ユーロ)	727,685	137,420	725,015	2,670	1,088,602	104,808	38,853	38,853
	(米ドル)	781,064	-	780,793	270	627,919	8,052	△12,335	△12,335
	(豪ドル)	330,025	252,895	283,555	46,469	355,157	309,168	△3,271	△3,271
	(英ポンド)	57,975	-	63,172	△5,197	39,937	-	2,195	2,195
	買建	54,037	-	54,324	287	89,675	-	2,301	2,301
	(ユーロ)	38,068	-	38,248	180	47,607	-	1,023	1,023
	(米ドル)	15,705	-	15,813	108	42,067	-	1,278	1,278
	通貨オプション								
	売建								
	ブット	108,360	-			-	-		
	(ユーロ)	(2,073)		10,126	△8,053	(-)			
	(ユーロ)	108,360				-			
	(ユーロ)	(2,073)		10,126	△8,053	(-)			
	買建								
	コール	-	-			18,320	-		
	(米ドル)	(-)				(692)		350	△342
	(米ドル)	-	-			18,320	-		
	(米ドル)	(-)				(692)		350	△342
	ブット	312,628	7,203			39,707	39,707		
	(米ドル)	(30,545)		16,224	△14,321	(6,304)		6,413	108
	(米ドル)	7,203	7,203			39,707	39,707		
(ユーロ)	(1,083)		822	△261	(6,304)		6,413	108	
(ユーロ)	305,425	-			-	-			
(ユーロ)	(29,461)		15,401	△14,060	-	-			
合計									
					22,126				27,503

- (注)1. 平成21年度末の為替予約の時価は、差金決済した場合の決済額(差損益)に変更しています。  
 なお、変更しない場合の金額は、ユーロ売建が 1,049,749百万円、米ドル売建が 640,255百万円、豪ドル売建が 358,429百万円、英ポンド売建が 37,742百万円、ユーロ買建が 48,630百万円、米ドル買建が 43,346百万円です。
2. 括弧内には、オプション料を記載しています。
3. 外貨建金銭債権債務等にて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、平成21年度末が米ドル売建の契約額 263,263百万円、時価 19,359百万円、差損益 19,359百万円、豪ドル売建の契約額 184,807百万円、時価 10,836百万円、差損益 10,836百万円です。  
 上記注1の変更をしない場合の平成21年度末の時価は、米ドル売建が 243,904百万円、豪ドル売建が 173,971百万円です。
4. オプション取引の差損益欄には、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20年度末				平成21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	8,760	-	△174	△174
	買建	1,912	-	1,973	61	1,900	-	93	93
	株価指数オプション								
	売建								
	コール	18,000	-			-	-		
	(1,092)	(1,092)		41	1,050	(-)		-	-
	ブット	11,000	-			-	-		
	(982)	(982)		2	979	(-)		-	-
	買建								
コール	84,900	-			-	-			
(5,600)	(5,600)		2,533	△3,066	(-)		-	-	
ブット	46,000	-			-	-			
(5,324)	(5,324)		954	△4,369	(-)		-	-	
店頭	株価指数オプション								
	買建								
	コール	65,042	-			-	-		
	(4,529)	(4,529)		3,786	△742	(-)		-	-
ブット	154,450	6,100			270,375	34,000			
(7,108)	(7,108)		30,957	23,849	(24,908)		4,282	△20,626	
合 計					△4,995				△20,707

(注)1. 平成21年度末の株価指数先物の時価は、差金決済した場合の決済額（差損益）に変更しています。

なお、変更しない場合の金額は、売建が 8,935百万円、買建が 1,994百万円です。

2. 括弧内には、オプション料を記載しています。

3. オプション取引の差損益欄には、オプション料と時価との差額を記載しています。