

平成27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26年度末		平成27年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
国 債	10,213,385	48.7	10,181,328	48.0
地 方 債	49,523	0.2	60,297	0.3
社 債	2,485,133	11.8	2,622,952	12.4
うち公社・公団債	1,797,622	8.6	1,859,765	8.8
株 式	1,644,083	7.8	1,536,944	7.2
外 国 証 券	6,563,751	31.3	6,766,818	31.9
公 社 債	5,983,458	28.5	6,218,480	29.3
うち外貨建	4,256,300	20.3	4,514,922	21.3
株 式 等	580,292	2.8	548,338	2.6
うち外貨建	124,530	0.6	124,805	0.6
そ の 他 の 証 券	35,633	0.2	41,734	0.2
合 計	20,991,510	100.0	21,210,076	100.0
うち外貨建	4,425,977	21.1	4,725,763	22.3

(2) 地域別地方債保有内訳

(単位：百万円)

区 分	平成26年度末	平成27年度 第2四半期(上半期)末
北 海 道	-	-
東 北	-	-
関 東	32,189	39,495
中 部	9,186	9,599
近 畿	2,604	4,928
中 国	-	-
四 国	-	-
九 州	5,542	6,273
合 計	49,523	60,297

(3) 有価証券残存期間別残高

<平成26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
有 価 証 券	460,438	1,940,963	1,225,223	1,274,308	2,148,176	11,650,155	2,292,245	20,991,510
国 債	135,083	386,580	149,841	349,860	459,687	8,732,331	-	10,213,385
地 方 債	7,445	5,172	5,057	-	8,611	23,237	-	49,523
社 債	201,465	387,528	153,054	72,591	358,154	1,280,067	32,270	2,485,133
株 式							1,644,083	1,644,083
外 国 証 券	116,443	1,161,681	917,268	851,856	1,321,723	1,614,519	580,257	6,563,751
公 社 債	116,408	1,161,681	917,268	851,856	1,321,723	1,614,519	-	5,983,458
株 式 等	35	-	-	-	-	-	580,257	580,292
その他の証券	-	-	-	-	-	-	35,633	35,633
買入金銭債権	19,992	1,343	-	-	-	181,243	-	202,579
譲渡性預金	99,983	-	-	-	-	-	-	99,983
そ の 他	-	-	-	-	-	-	-	-
合 計	580,414	1,942,307	1,225,223	1,274,308	2,148,176	11,831,399	2,292,245	21,294,073

<平成27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
有 価 証 券	619,762	1,805,735	1,397,038	1,129,154	2,058,253	11,937,965	2,262,167	21,210,076
国 債	174,049	316,646	206,670	352,116	422,971	8,708,873	-	10,181,328
地 方 債	3,138	5,109	4,053	-	8,639	39,355	-	60,297
社 債	119,485	391,993	111,029	108,320	376,986	1,379,944	135,193	2,622,952
株 式							1,536,944	1,536,944
外 国 証 券	323,089	1,091,984	1,075,284	668,709	1,249,655	1,809,791	548,302	6,766,818
公 社 債	323,054	1,091,984	1,075,284	668,709	1,249,655	1,809,791	-	6,218,480
株 式 等	35	-	-	-	-	-	548,302	548,338
その他の証券	-	-	-	8	-	-	41,726	41,734
買入金銭債権	68,370	511	-	-	-	169,034	-	237,916
譲渡性預金	119,974	-	-	-	-	-	-	119,974
そ の 他	-	-	-	-	-	-	-	-
合 計	808,107	1,806,246	1,397,038	1,129,154	2,058,253	12,106,999	2,262,167	21,567,967

(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26年度末		平成27年度 第2四半期(上半期)末	
		金 額	占率	金 額	占率
水産・農林業		214	0.0	203	0.0
鉱業		99	0.0	80	0.0
建設業		50,864	3.1	54,099	3.5
製 造 業	食料品	57,127	3.5	58,546	3.8
	繊維製品	9,216	0.6	8,325	0.5
	パルプ・紙	5,546	0.3	5,337	0.3
	化学	175,605	10.7	143,033	9.3
	医薬品	107,912	6.6	119,757	7.8
	石油・石炭製品	4,483	0.3	4,164	0.3
	ゴム製品	7,567	0.5	6,405	0.4
	ガラス・土石製品	16,580	1.0	17,275	1.1
	鉄鋼	32,536	2.0	24,177	1.6
	非鉄金属	41,498	2.5	38,330	2.5
	金属製品	7,990	0.5	8,119	0.5
	機械	115,867	7.0	95,230	6.2
	電気機器	211,092	12.8	185,122	12.0
	輸送用機器	51,811	3.2	48,410	3.1
	精密機器	7,160	0.4	7,443	0.5
	その他製品	30,934	1.9	34,875	2.3
電気・ガス業		36,955	2.2	37,095	2.4
運 輸 ・ 情 報 通 信 業	陸運業	155,941	9.5	141,352	9.2
	海運業	5,288	0.3	3,967	0.3
	空運業	4,048	0.2	4,145	0.3
	倉庫・運輸関連業	9,063	0.6	7,815	0.5
	情報・通信業	11,310	0.7	12,651	0.8
商 業	卸売業	83,182	5.1	78,923	5.1
	小売業	25,082	1.5	24,808	1.6
金 融 ・ 保 険 業	銀行業	218,247	13.3	209,389	13.6
	証券、商品先物取引業	11,557	0.7	9,735	0.6
	保険業	88,707	5.4	89,397	5.8
	その他金融業	3,667	0.2	3,553	0.2
不動産業		15,425	0.9	14,177	0.9
サービス業		41,495	2.5	40,990	2.7
合 計		1,644,083	100.0	1,536,944	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26年度末	平成27年度 第2四半期(上半期)末
保 險 約 款 貸 付	323,711	318,591
契 約 者 貸 付	294,286	289,544
保 險 料 振 替 貸 付	29,424	29,046
一 般 貸 付 (うち非居住者貸付)	1,998,985 (41,472)	1,983,524 (25,757)
企 業 貸 付 (うち国内企業向け)	1,957,219 (1,944,505)	1,952,692 (1,945,628)
国・国際機関・政府関係機関貸付	10,510	10,367
公 共 団 体 ・ 公 企 業 貸 付	24,704	14,489
住 宅 ロ ー ン	6,005	5,614
消 費 者 ロ ー ン	544	360
そ の 他	-	-
合 計	2,322,696	2,302,115

(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26年度末		平成27年度 第2四半期(上半期)末	
		占率		占率
大 企 業	貸付先数	205	205	78.2
	金額	1,792,926	1,802,131	92.6
中 堅 企 業	貸付先数	5	5	1.9
	金額	3,082	3,440	0.2
中 小 企 業	貸付先数	59	52	19.8
	金額	148,496	140,057	7.2
国内企業向け 貸 付 計	貸付先数 金額	269 1,944,505	262 1,945,628	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26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	11,094	32,625	18,449	43,560	46,288	4,722	73,000	229,739
固 定 金 利	283,816	571,605	401,769	208,473	219,399	84,182	-	1,769,245
一 般 貸 付 計	294,910	604,230	420,218	252,033	265,687	88,904	73,000	1,998,985

<平成27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	19,089	26,561	17,835	55,094	34,617	4,417	73,000	230,616
固 定 金 利	306,120	512,706	375,043	206,556	243,678	108,802	-	1,752,908
一 般 貸 付 計	325,209	539,268	392,879	261,651	278,296	113,219	73,000	1,983,524

(4) 貸付金業種別内訳

(単位：百万円、%)

区分	平成26年度末		平成27年度 第2四半期(上半期)末		
	金額	占率	金額	占率	
	413,506	20.7	389,984	19.7	
製造業	食料	19,760	1.0	19,490	1.0
	繊維	12,600	0.6	12,600	0.6
	木材・木製品	1,000	0.1	1,000	0.1
	パルプ・紙	23,966	1.2	21,392	1.1
	印刷	11	0.0	7	0.0
	化学	54,935	2.7	54,162	2.7
	石油・石炭	41,600	2.1	41,600	2.1
	窯業・土石	13,370	0.7	12,407	0.6
	鉄鋼	80,468	4.0	65,432	3.3
	非金属製品	5,860	0.3	5,820	0.3
	金・銀・銅・鉄・鋼・鉛・亜鉛・錫・アルミニウム・ニッケル・コバルト・マンガン・チタン・タングステン・モリブデン・バナジウム・ニオブ・タングステン・ニッケル・コバルト・マンガン・チタン・タングステン・モリブデン・バナジウム・ニオブ・タングステン	40	0.0	20	0.0
	はん用・生産用・業務用機械	35,281	1.8	34,348	1.7
	電気機械	63,097	3.2	61,763	3.1
	輸送用機械	53,916	2.7	53,342	2.7
その他の製造業	7,600	0.4	6,600	0.3	
国内向け	農業、林業	-	-	-	-
	漁業	-	-	-	-
	鉱業、採石業、砂利採取業	-	-	-	-
	建設業	3,614	0.2	3,247	0.2
	電気・ガス・熱供給・水道業	294,476	14.7	288,863	14.6
	情報通信業	38,900	1.9	38,900	2.0
	運輸業、郵便業	136,341	6.8	135,117	6.8
	卸売業	497,277	24.9	487,090	24.6
	小売業	8,214	0.4	7,776	0.4
	金融業、保険業	315,414	15.8	360,638	18.2
	不動産業	135,572	6.8	134,583	6.8
	物品賃貸業	95,897	4.8	93,571	4.7
	学術研究、専門・技術サービス業	-	-	-	-
	宿泊業	62	0.0	43	0.0
	飲食業	5	0.0	2	0.0
	生活関連サービス業、娯楽業	-	-	-	-
	教育、学習支援業	-	-	-	-
	医療・福祉	-	-	-	-
	その他のサービス	11,247	0.6	11,672	0.6
地方公共団体	431	0.0	299	0.0	
個人(住宅・消費・納税資金等)	6,550	0.3	5,975	0.3	
合計	1,957,512	97.9	1,957,766	98.7	
海外向け	政府等	28,758	1.4	18,693	0.9
	金融機関	12,000	0.6	7,000	0.4
	商工業等	714	0.0	64	0.0
合計	41,472	2.1	25,757	1.3	
一般貸付計	1,998,985	100.0	1,983,524	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26年度末		平成27年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
担 保 貸 付	851	0.0	761	0.0
有 価 証 券 担 保 貸 付	731	0.0	649	0.0
不 動 産 ・ 動 産 ・ 財 団 担 保 貸 付	120	0.0	112	0.0
指 名 債 権 担 保 貸 付	-	-	-	-
保 証 貸 付	52,736	2.6	42,750	2.2
信 用 貸 付	1,938,846	97.0	1,934,037	97.5
そ の 他	6,550	0.3	5,975	0.3
一 般 貸 付 計	1,998,985	100.0	1,983,524	100.0
う ち 劣 後 特 約 付 貸 付	181,000	9.1	181,000	9.1

(6) 貸付金地域別内訳

(単位：百万円、%)

区 分	平成26年度末		平成27年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
北 海 道	11,223	0.6	11,087	0.6
東 北	38,013	1.9	34,527	1.8
関 東	1,398,304	71.7	1,408,946	72.2
中 部	130,898	6.7	127,818	6.5
近 畿	273,284	14.0	278,973	14.3
中 国	49,717	2.5	41,008	2.1
四 国	10,243	0.5	10,167	0.5
九 州	39,275	2.0	39,261	2.0
合 計	1,950,962	100.0	1,951,791	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26年度末		平成27年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
公 社 債	4,301,446	63.4	4,600,957	64.8
株 式 等	124,530	1.8	124,805	1.8
現 預 金 ・ そ の 他	47,511	0.7	47,564	0.7
外 貨 建 資 産 計	4,473,488	65.9	4,773,327	67.2

(イ) 円貨額が確定した外貨建資産

(単位：百万円、%)

区 分	平成26年度末		平成27年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
貸 付 金	39,405	0.6	82,220	1.2
公 社 債	92,712	1.4	92,712	1.3
現 預 金 ・ そ の 他	28,013	0.4	28,031	0.4
円 貨 額 が 確 定 し た 外 貨 建 資 産 計	160,130	2.4	202,963	2.9

(ウ) 円貨建資産

(単位：百万円、%)

区 分	平成26年度末		平成27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	41,472	0.6	25,757	0.4
公 社 債	1,634,445	24.1	1,610,846	22.7
株 式 等	455,762	6.7	423,532	6.0
そ の 他	21,310	0.3	68,842	1.0
円 貨 建 資 産 計	2,152,990	31.7	2,128,978	30.0

(エ) 合計

(単位：百万円、%)

区 分	平成26年度末		平成27年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
海 外 投 融 資	6,786,610	100.0	7,105,269	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26年度末				平成27年度第2四半期(上半期)末				
	金額	占率	外国証券		非居住者 貸付	金額	占率	外国証券	
			公社債	株式等				公社債	株式等
北 米	金額	1,391,664	1,391,000	663	5,000	1,635,852	1,635,852	0	-
	占率	21.2	23.2	0.1	12.1	24.2	26.3	0.0	-
ヨーロッパ	金額	1,956,811	1,956,811	-	22,000	1,932,724	1,929,121	3,603	12,000
	占率	29.8	32.7	-	53.0	28.6	31.0	0.7	46.6
オセアニア	金額	436,302	436,302	-	5,000	388,796	388,796	-	5,000
	占率	6.6	7.3	-	12.1	5.7	6.3	-	19.4
ア ジ ア	金額	124,139	2,065	122,074	-	122,466	2,084	120,381	-
	占率	1.9	0.0	21.0	-	1.8	0.0	22.0	-
中 南 米	金額	2,107,294	1,649,740	457,554	714	2,163,924	1,739,571	424,353	64
	占率	32.1	27.6	78.8	1.7	32.0	28.0	77.4	0.2
中 東	金額	-	-	-	-	-	-	-	-
	占率	-	-	-	-	-	-	-	-
ア フ リ カ	金額	3,539	3,539	-	-	3,566	3,566	-	-
	占率	0.1	0.1	-	-	0.1	0.1	-	-
国際機関	金額	543,999	543,999	-	8,758	519,488	519,488	-	8,693
	占率	8.3	9.1	-	21.1	7.7	8.4	-	33.8
合 計	金額	6,563,751	5,983,458	580,292	41,472	6,766,818	6,218,480	548,338	25,757
	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(特別目的会社)が発行する債券もしくは優先出資証券、または海外投資信託等であり、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26年度末		平成27年度 第2四半期(上半期)末	
	金額	占率	金額	占率
米 ド ル	2,044,058	45.7	2,324,619	48.7
豪 ド ル	1,447,192	32.4	1,372,096	28.7
ユ ー ロ	795,519	17.8	857,157	18.0
英 ポ ン ド	64,453	1.4	64,597	1.4
中 国 元	50,794	1.1	49,105	1.0
インドネシアルピア	38,255	0.9	38,113	0.8
ベトナムドン	33,189	0.7	33,192	0.7
メキシコペソ	-	-	22,544	0.5
ニュージーランドドル	-	-	11,898	0.2
そ の 他	25	0.0	0	0.0
合 計	4,473,488	100.0	4,773,327	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26年度末		平成27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	67,145	13,301	61,406	8,717

(2) 変額個人年金保険

(単位：百万円)

区 分	平成26年度末		平成27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	1,555,320	212,893	1,239,727	141,163

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26年度末			平成27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	-	-	-	287	-	△11	△11	
	合 計							△11	

(通貨関連)

(単位：百万円)

区分	種 類	平成26年度末			平成27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	-	-	-	75	-	△0	△0	
	(米ドル)	-	-	-	36	-	△0	△0	
	(ユーロ)	-	-	-	-	-	-	-	
	(スウェーデンクローナ)	-	-	-	38	-	△0	△0	
	買建	-	-	-	74	-	0	0	
	(米ドル)	-	-	-	35	-	0	0	
	(ユーロ)	-	-	-	-	-	-	-	
	(スウェーデンクローナ)	-	-	-	38	-	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26年度末			平成27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	8,800	-	95	95	-	-	-	
	買建	-	-	-	-	-	-	-	
	合 計				95			-	

(通貨関連)

(単位：百万円)

区分	種 類	平成26年度末			平成27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	-	-	-	-	1,524	-	△3	
	(米ドル)	-	-	-	-	798	-	△0	
	(ユーロ)	-	-	-	-	-	-	-	
	(スウェーデンクローナ)	-	-	-	-	725	-	△2	
	買建	-	-	-	-	1,524	-	3	
	(米ドル)	-	-	-	-	836	-	0	
	(ユーロ)	-	-	-	-	-	-	-	
	(スウェーデンクローナ)	-	-	-	-	688	-	2	
		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。

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26年度末		平成27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	666,675	2.4	646,196	2.4
買入金銭債権	243,446	0.9	276,827	1.0
有 価 証 券	23,204,047	84.8	23,059,148	84.4
公 社 債	13,798,711	50.4	13,766,935	50.4
株 式	2,147,529	7.8	1,928,328	7.1
外 国 証 券	6,987,702	25.5	7,125,347	26.1
公 社 債	6,230,580	22.8	6,434,416	23.6
株 式 等	757,122	2.8	690,930	2.5
そ の 他 の 証 券	270,104	1.0	238,537	0.9
貸 付 金	2,322,696	8.5	2,302,115	8.4
保 険 約 款 貸 付	323,711	1.2	318,591	1.2
一 般 貸 付	1,998,985	7.3	1,983,524	7.3
不 動 産	661,398	2.4	655,727	2.4
う ち 投 資 用	464,290	1.7	460,597	1.7
繰 延 税 金 資 産	—	—	50,466	0.2
そ の 他	264,512	1.0	326,882	1.2
貸 倒 引 当 金	△1,757	△0.0	△1,601	△0.0
会 社 計	27,361,019	100.0	27,315,761	100.0
う ち 外 貨 建 資 産	4,900,998	17.9	5,134,448	18.8

（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26年度 第2四半期（上半期）	平成27年度 第2四半期（上半期）
	金 額	金 額
現預金・コールローン	△198,522	△20,479
買入金銭債権	△46,492	33,380
有 価 証 券	941,370	△144,899
公 社 債	149,476	△31,776
株 式	159,917	△219,201
外 国 証 券	832,991	137,644
公 社 債	786,945	203,836
株 式 等	46,046	△66,192
そ の 他 の 証 券	△201,015	△31,566
貸 付 金	△62,997	△20,581
保 険 約 款 貸 付	△6,327	△5,120
一 般 貸 付	△56,670	△15,460
不 動 産	△16,998	△5,670
う ち 投 資 用	△13,748	△3,693
繰 延 税 金 資 産	△57,012	50,466
そ の 他	30,163	62,369
貸 倒 引 当 金	340	155
会 社 計	589,849	△45,257
う ち 外 貨 建 資 産	554,607	233,450

（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26年度末		平成27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	2,212,537	34,090	1,849,072	△122,335

(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26年度末、平成27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26年度末					平成27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	2,059,190	2,383,300	324,109	324,244	△134	2,047,547	2,362,234	314,687	314,780	△93
責任準備金対応債券	11,209,377	12,711,116	1,501,738	1,502,085	△346	11,230,784	12,740,437	1,509,652	1,510,687	△1,034
子会社・関連会社株式	33,173	23,372	△9,801	-	△9,801	33,173	30,414	△2,759	-	△2,759
その他有価証券	6,109,247	7,344,762	1,235,515	1,242,124	△6,609	6,593,333	7,643,185	1,049,851	1,067,234	△17,383
公 社 債	1,091,825	1,139,283	47,458	47,638	△180	1,184,013	1,234,851	50,838	51,277	△438
株 式	773,544	1,542,884	769,339	775,208	△5,868	772,560	1,432,866	660,306	670,483	△10,177
外 国 証 券	3,928,950	4,325,405	396,455	396,996	△541	4,256,764	4,577,096	320,331	325,697	△5,366
公 社 債	3,927,074	4,323,648	396,574	396,960	△386	4,249,285	4,569,874	320,589	325,661	△5,072
株 式 等	1,876	1,757	△118	36	△155	7,479	7,221	△257	36	△294
その他の証券	24,589	34,626	10,036	10,036	-	33,920	40,479	6,558	7,929	△1,370
買入金銭債権	190,337	202,579	12,241	12,244	△2	226,074	237,916	11,842	11,847	△4
譲渡性預金	100,000	99,983	△16	-	△16	120,000	119,974	△25	-	△25
その他	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
合 計	19,410,990	22,462,552	3,051,562	3,068,453	△16,891	19,904,840	22,776,272	2,871,432	2,892,702	△21,270
公 社 債	12,700,583	14,272,895	1,572,311	1,572,927	△615	12,813,739	14,396,719	1,582,980	1,584,516	△1,536
株 式	773,544	1,542,884	769,339	775,208	△5,868	772,560	1,432,866	660,306	670,483	△10,177
外 国 証 券	5,621,934	6,309,582	687,648	698,037	△10,388	5,938,544	6,548,315	609,770	617,926	△8,156
公 社 債	5,586,884	6,284,453	697,569	698,000	△431	5,897,891	6,510,678	612,787	617,890	△5,102
株 式 等	35,050	25,129	△9,920	36	△9,957	40,653	37,636	△3,017	36	△3,053
その他の証券	24,589	34,626	10,036	10,036	-	33,920	40,479	6,558	7,929	△1,370
買入金銭債権	190,337	202,579	12,241	12,244	△2	226,074	237,916	11,842	11,847	△4
譲渡性預金	100,000	99,983	△16	-	△16	120,000	119,974	△25	-	△25
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26年度末	平成27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	115,403	114,739
その他有価証券	515,935	483,999
非上場国内株式(店頭売買株式を除く)	24,573	27,451
非上場外国株式(店頭売買株式を除く)	490,321	455,258
非上場外国債券	-	-
その他	1,040	1,288
合 計	631,338	598,738

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26年度末、平成27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26年度末、平成27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およ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」および「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、およ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、リスク状況およ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26年9月末	平成27年9月末	平成26年9月末	平成27年9月末
金利スワップ 金利スワップション(買建)	2,975	3,348	30	25
為替予約	38,473	45,124	976	1,999
通貨スワップ 通貨オプション(買建)	1,131	1,817	231	463
株式オプション(買建) 株価指数先渡	1,563	899	96	110
合 計			504	1,503

(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26年度末						平成27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	1,259	△162,558	-	-	-	△161,298	1,016	△88,473	-	-	-	△87,456
ヘッジ会計非適用分	△1,813	△27,321	△13,501	-	-	△42,637	△1,651	12,119	7,192	-	-	17,660
合 計	△554	△189,879	△13,501	-	-	△203,936	△634	△76,354	7,192	-	-	△69,795

(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26年度末通貨関連 △157,797百万円、平成27年度第2四半期(上半期)末通貨関連 △71,106百万円となっています。

(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26年度末			平成27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	金利スワップション 買建 固定金利支払/変動金利受取	240,000	120,000						
		(2,241)		427	△1,813	(2,176)		525	△1,651
	合 計				△1,813				△1,651

(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、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26年度末			平成27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	56,121	45,532	1,259	54,827	39,051	1,016
	合 計				1,259			1,016

(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26年度末				平成27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	529,108	91,785	△27,047	△27,047	373,586	35,662	12,725	12,725
	(豪ドル)	248,901	-	4,199	4,199	250,681	-	21,875	21,875
	(ユーロ)	82,651	52,580	915	915	63,434	-	△1,678	△1,678
	(米ドル)	195,284	39,205	△32,212	△32,212	55,993	35,662	△7,516	△7,516
	買建	167,843	-	△274	△274	33,455	-	△606	△606
	(豪ドル)	-	-	-	-	29,802	-	△687	△687
	(米ドル)	167,168	-	△267	△267	2,294	-	79	79
合 計					△27,321				12,119

(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)

(単位：百万円)

ヘッジ会計の方法	種 類	主なヘッジ対象	平成26年度末			平成27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	3,089,178	933,569	△157,797	3,535,871	759,224	△71,106
	(米ドル)		1,209,952	503,818	△102,165	1,500,694	265,161	△73,391
	(豪ドル)		1,017,864	302,024	△88,091	1,095,713	494,062	1,378
(ユーロ)	801,998		127,726	35,704	842,476	-	24	
繰延ヘッジ	為替予約							
	買建	予定取引	-	-	-	470,294	-	△21,282
(米ドル)	-		-	-	470,294	-	△21,282	
振当処理	為替予約							
	売建	外貨建資産	101,308	101,308	△35,195	99,231	73,304	△27,077
	(豪ドル)		86,789	86,789	△30,126	84,868	58,941	△21,887
	(米ドル)		14,519	14,519	△5,068	14,363	14,363	△5,189
	通貨スワップ	外貨建資産	39,405	39,405	△2,506	82,220	82,220	△73
	(米ドル)		39,405	39,405	△2,506	82,220	82,220	△73
通貨スワップ	外貨建負債	99,480	99,480	32,941	99,480	99,480	31,066	
(米ドル)		99,480	99,480	32,941	99,480	99,480	31,066	
合 計					△162,558			△88,473

(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26年度末			平成27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	116,589	-	△1,441	△1,441	112,309	-	1,549	1,549
	買建	1,533	-	△5	△5	5,415	-	△44	△44
店頭	株価指数先渡								
	売建	104,122	-	△11,548	△11,548	89,928	-	5,688	5,688
	株価指数オプション								
	売建								
	プット	423	-			-	-		
		(1)		0	0	(-)		-	-
	買建								
	プット	19,503	-			-	-		
		(529)		23	△506	(-)		-	-
	合 計				△ 13,501				7,192

(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26年度末、平成27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。