

# 平成23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	・・・	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22年度末		平成23年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
国 債	6,402,550	42.3	7,110,950	45.8
地 方 債	260,411	1.7	239,233	1.5
社 債	2,727,292	18.0	2,778,471	17.9
うち公社・公団債	1,708,846	11.3	1,793,621	11.5
株 式	1,112,189	7.3	884,245	5.7
外 国 証 券	4,600,411	30.4	4,491,169	28.9
公 社 債	4,038,420	26.7	3,947,943	25.4
うち外貨建	2,186,936	14.4	2,214,356	14.2
株 式 等	561,991	3.7	543,226	3.5
うち外貨建	37,281	0.2	36,525	0.2
そ の 他 の 証 券	39,128	0.3	35,607	0.2
合 計	15,141,983	100.0	15,539,678	100.0
うち外貨建	2,244,540	14.8	2,270,712	14.6

#### (2) 地域別地方債保有内訳

(単位：百万円)

区 分	平成22年度末	平成23年度 第2四半期(上半期)末
北 海 道	4,752	4,747
東 北	751	750
関 東	109,974	107,465
中 部	52,362	50,299
近 畿	51,788	36,979
中 国	19,045	18,446
四 国	355	357
九 州	21,380	20,186
合 計	260,411	239,233

(3) 有価証券残存期間別残高

<平成22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	409,614	1,217,956	1,469,363	1,564,862	1,565,099	7,180,552	1,734,535	15,141,983
国 債	122,046	120,915	207,825	328,848	380,937	5,241,975	-	6,402,550
地 方 債	44,424	137,815	65,137	5,366	5,044	2,623	-	260,411
社 債	118,500	540,858	631,470	388,344	166,388	859,316	22,413	2,727,292
株 式							1,112,189	1,112,189
外 国 証 券	124,642	417,212	564,930	842,302	1,012,729	1,076,636	561,958	4,600,411
公 社 債	124,609	417,212	564,930	842,302	1,012,729	1,076,636	-	4,038,420
株 式 等	33	-	-	-	-	-	561,958	561,991
その他の証券	-	1,153	-	-	-	-	37,975	39,128
買入金銭債権	2,999	-	-	4,954	-	279,180	-	287,134
譲渡性預金	19,999	-	-	-	-	-	-	19,999
そ の 他	-	-	-	-	-	-	-	-
合 計	432,612	1,217,956	1,469,363	1,569,816	1,565,099	7,459,733	1,734,535	15,499,116

<平成23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	470,639	1,215,194	1,480,191	1,568,322	1,436,027	7,885,058	1,484,243	15,539,678
国 債	118,987	111,059	361,166	316,918	303,307	5,899,510	-	7,110,950
地 方 債	48,946	144,129	34,138	5,316	4,066	2,635	-	239,233
社 債	189,695	506,681	576,890	394,439	123,649	964,679	22,435	2,778,471
株 式							884,245	884,245
外 国 証 券	112,873	452,220	507,996	851,647	1,005,003	1,018,232	543,195	4,491,169
公 社 債	112,842	452,220	507,996	851,647	1,005,003	1,018,232	-	3,947,943
株 式 等	30	-	-	-	-	-	543,195	543,226
その他の証券	136	1,103	-	-	-	-	34,367	35,607
買入金銭債権	2,998	-	2,062	2,441	-	277,826	-	285,329
譲渡性預金	24,997	-	-	-	-	-	-	24,997
そ の 他	-	-	-	-	-	-	-	-
合 計	498,635	1,215,194	1,482,254	1,570,764	1,436,027	8,162,885	1,484,243	15,850,005

(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22年度末		平成23年度 第2四半期(上半期)末	
		金 額	占率	金 額	占率
水産・農林業		156	0.0	156	0.0
鉱業		209	0.0	364	0.0
建設業		25,531	2.3	24,795	2.8
製 造 業	食料品	30,795	2.8	27,351	3.1
	繊維製品	7,289	0.7	6,393	0.7
	パルプ・紙	4,873	0.4	5,224	0.6
	化学	88,318	7.9	75,781	8.6
	医薬品	55,269	5.0	44,825	5.1
	石油・石炭製品	5,503	0.5	4,389	0.5
	ゴム製品	3,523	0.3	3,482	0.4
	ガラス・土石製品	13,090	1.2	11,094	1.3
	鉄鋼	29,997	2.7	23,194	2.6
	非鉄金属	32,514	2.9	26,650	3.0
	金属製品	4,448	0.4	4,360	0.5
	機械	71,577	6.4	51,408	5.8
	電気機器	142,748	12.8	111,559	12.6
	輸送用機器	51,424	4.6	34,935	4.0
	精密機器	9,786	0.9	8,807	1.0
	その他製品	18,548	1.7	15,591	1.8
電気・ガス業		29,615	2.7	25,270	2.9
運 輸 ・ 情 報 通 信 業	陸運業	73,397	6.6	70,459	8.0
	海運業	7,168	0.6	4,883	0.6
	空運業	3,495	0.3	2,975	0.3
	倉庫・運輸関連業	5,750	0.5	5,273	0.6
	情報・通信業	6,692	0.6	6,754	0.8
商 業	卸売業	72,181	6.5	58,645	6.6
	小売業	18,286	1.6	17,008	1.9
金 融 ・ 保 険 業	銀行業	207,677	18.7	125,860	14.2
	証券、商品先物取引業	5,838	0.5	4,661	0.5
	保険業	44,511	4.0	43,107	4.9
	その他金融業	2,087	0.2	1,572	0.2
不動産業		9,394	0.8	8,459	1.0
サービス業		30,485	2.7	28,944	3.3
合 計		1,112,189	100.0	884,245	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22年度末	平成23年度 第2四半期(上半期)末
保 険 約 款 貸 付	373,873	366,083
契 約 者 貸 付	337,347	330,213
保 険 料 振 替 貸 付	36,525	35,869
一 般 貸 付 (うち非居住者貸付)	2,797,488 (91,459)	2,632,459 (80,814)
企 業 貸 付 (うち国内企業向け)	2,697,968 (2,668,925)	2,548,569 (2,519,920)
国・国際機関・政府関係機関貸付	28,626	25,472
公 共 団 体 ・ 公 企 業 貸 付	54,427	43,674
住 宅 ロ ー ン	10,737	10,172
消 費 者 ロ ー ン	5,352	4,213
そ の 他	376	356
合 計	3,171,361	2,998,542

(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22年度末		平成23年度 第2四半期(上半期)末	
			占率		占率
大 企 業	貸付先数	294	66.5	280	68.8
	金額	2,427,810	91.0	2,291,483	90.9
中 堅 企 業	貸付先数	7	1.6	6	1.5
	金額	13,557	0.5	13,510	0.5
中 小 企 業	貸付先数	141	31.9	121	29.7
	金額	227,557	8.5	214,927	8.5
国内企業向け 貸付計	貸付先数 金額	442 2,668,925	100.0 100.0	407 2,519,920	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	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22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	37,293	23,993	28,557	94,981	54,549	48,441	118,000	405,816
固定金利	324,413	548,359	555,290	506,170	371,647	85,789	-	2,391,671
一般貸付計	361,706	572,353	583,847	601,151	426,197	134,231	118,000	2,797,488

<平成23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	35,285	26,564	31,032	70,631	61,496	39,833	118,000	382,844
固定金利	253,763	568,914	579,540	459,934	308,747	78,714	-	2,249,614
一般貸付計	289,049	595,479	610,573	530,566	370,243	118,547	118,000	2,632,459



(5) 貸付金担保別内訳

(単位：百万円、%)

区 分	平成22年度末		平成23年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
担 保 貸 付	13,069	0.5	12,589	0.5
有 価 証 券 担 保 貸 付	1,626	0.1	1,379	0.1
不 動 産 ・ 動 産 ・ 財 団 担 保 貸 付	11,443	0.4	11,164	0.4
指 名 債 権 担 保 貸 付	—	—	45	0.0
保 証 貸 付	122,801	4.4	111,581	4.2
信 用 貸 付	2,645,527	94.6	2,493,902	94.7
そ の 他	16,089	0.6	14,386	0.5
一 般 貸 付 計	2,797,488	100.0	2,632,459	100.0
う ち 劣 後 特 約 付 貸 付	283,500	10.1	255,000	9.7

(6) 貸付金地域別内訳

(単位：百万円、%)

区 分	平成22年度末		平成23年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
北 海 道	27,963	1.0	27,063	1.1
東 北	54,320	2.0	53,785	2.1
関 東	1,748,467	65.0	1,652,147	65.1
中 部	194,089	7.2	177,966	7.0
近 畿	471,196	17.5	449,429	17.7
中 国	88,513	3.3	81,499	3.2
四 国	24,276	0.9	23,738	0.9
九 州	81,110	3.0	71,627	2.8
合 計	2,689,938	100.0	2,537,258	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22年度末		平成23年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
公 社 債	2,207,258	46.2	2,234,187	47.9
株 式 等	37,281	0.8	36,525	0.8
現 預 金 ・ そ の 他	34,880	0.7	38,107	0.8
外 貨 建 資 産 計	2,279,420	47.7	2,308,820	49.5

(イ) 円貨額が確定した外貨建資産

(単位：百万円、%)

区 分	平成22年度末		平成23年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
公 社 債	329,197	6.9	293,209	6.3
現 預 金 ・ そ の 他	23,000	0.5	32,993	0.7
円 貨 額 が 確 定 し た 外 貨 建 資 産 計	352,197	7.4	326,203	7.0

(ウ) 円貨建資産

(単位：百万円、%)

区 分	平成22年度末		平成23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	91,459	1.9	80,814	1.7
公 社 債	1,522,286	31.9	1,440,377	30.9
株 式 等	524,709	11.0	506,700	10.9
そ の 他	5,713	0.1	4,861	0.1
円 貨 建 資 産 計	2,144,169	44.9	2,032,754	43.5

(エ) 合計

(単位：百万円、%)

区 分	平成22年度末		平成23年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
海 外 投 融 資	4,775,787	100.0	4,667,777	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22年度末				平成23年度第2四半期(上半期)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	974,769	973,953	816	8,139	802,038	801,263	775	8,139
	占率	21.2	24.1	0.1	8.9	17.9	20.3	0.1	10.1
ヨーロッパ	金額	1,551,979	1,544,808	7,171	50,000	1,544,618	1,539,254	5,364	42,000
	占率	33.7	38.3	1.3	54.7	34.4	39.0	1.0	52.0
オセアニア	金額	26,859	26,859	-	5,000	159,462	159,462	-	5,000
	占率	0.6	0.7	-	5.5	3.6	4.0	-	6.2
ア ジ ア	金額	13,996	-	13,996	-	20,258	-	20,258	-
	占率	0.3	-	2.5	-	0.5	-	3.7	-
中 南 米	金額	1,799,559	1,259,552	540,007	3,559	1,719,756	1,202,929	516,827	3,203
	占率	39.1	31.2	96.1	3.9	38.3	30.5	95.1	4.0
中 東	金額	-	-	-	87	-	-	-	47
	占率	-	-	-	0.1	-	-	-	0.1
アフリカ	金額	-	-	-	343	-	-	-	305
	占率	-	-	-	0.4	-	-	-	0.4
国際機関	金額	233,245	233,245	-	24,329	245,033	245,033	-	22,118
	占率	5.1	5.8	-	26.6	5.5	6.2	-	27.4
合 計	金額	4,600,411	4,038,420	561,991	91,459	4,491,169	3,947,943	543,226	80,814
	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22年度末		平成23年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
ユ ー ロ	980,322	43.0	878,562	38.1
米 ド ル	920,525	40.4	832,430	36.1
豪 ド ル	296,273	13.0	513,197	22.2
英 ポ ンド	68,405	3.0	64,473	2.8
中 国 元	11,413	0.5	18,474	0.8
韓 国 ウ ォ ン	2,472	0.1	1,672	0.1
そ の 他	7	0.0	9	0.0
合 計	2,279,420	100.0	2,308,820	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22年度末		平成23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
売買目的有価証券等	52,939	△5,520	45,899	△10,197

#### (2) 変額個人年金保険

(単位：百万円)

区 分	平成22年度末		平成23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
売買目的有価証券等	2,280,587	△54,709	2,106,231	△135,453

### 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22年度末			平成23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				1,563	43		43	

(通貨関連)

(単位：百万円)

区分	種 類	平成22年度末			平成23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	-	-	-	114	-	△0	△0	
	(米ドル)	-	-	-	114	-	△0	△0	
	買建	-	-	-	116	-	0	0	
	(米ドル)	-	-	-	116	-	0	0	
	合 計							0	

(注) 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。

(2) 変額個人年金保険

(株式関連)

(単位：百万円)

区分	種 類	平成22年度末			平成23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	2,376	-	16	49,826	-	1,849	1,849	
	合 計							16	

(通貨関連)

(単位：百万円)

区分	種 類	平成22年度末			平成23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	40,298	-	△1,097	△1,097	25,928	-	△80	△80
	(米ドル)	40,298	-	△1,097	△1,097	25,928	-	△80	△80
	買建	-	-	-	-	3,369	-	4	4
	(米ドル)	-	-	-	-	3,369	-	4	4
	合 計				△1,097			△76	

(注) 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。

### 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22年度末		平成23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	543,938	2.3	457,883	1.9
買入金銭債権	390,037	1.6	373,976	1.6
有 価 証 券	18,068,631	76.1	18,232,086	77.0
公 社 債	10,519,245	44.3	11,240,092	47.4
株 式	1,656,284	7.0	1,365,710	5.8
外 国 証 券	5,139,553	21.7	4,928,760	20.8
公 社 債	4,333,994	18.3	4,208,090	17.8
株 式 等	805,558	3.4	720,669	3.0
そ の 他 の 証 券	753,548	3.2	697,523	2.9
貸 付 金	3,171,361	13.4	2,998,542	12.7
保 険 約 款 貸 付	373,873	1.6	366,083	1.5
一 般 貸 付	2,797,488	11.8	2,632,459	11.1
不 動 産	940,803	4.0	925,512	3.9
う ち 投 資 用	701,341	3.0	688,679	2.9
繰延税金資産	319,829	1.3	293,646	1.2
そ の 他	310,398	1.3	411,795	1.7
貸倒引当金	△8,127	△0.0	△4,507	△0.0
会 社 計	23,736,871	100.0	23,688,936	100.0
う ち 外 貨 建 資 産	2,814,061	11.9	2,748,312	11.6

（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22年度 第2四半期（上半期）	平成23年度 第2四半期（上半期）
	金 額	金 額
現預金・コールローン	81,763	△86,054
買入金銭債権	△40,748	△16,061
有 価 証 券	782,705	163,455
公 社 債	988,809	720,847
株 式	△215,565	△290,574
外 国 証 券	43,783	△210,792
公 社 債	77,884	△125,903
株 式 等	△34,101	△84,889
そ の 他 の 証 券	△34,321	△56,024
貸 付 金	△182,382	△172,818
保 険 約 款 貸 付	△8,680	△7,789
一 般 貸 付	△173,702	△165,028
不 動 産	△10,326	△15,290
う ち 投 資 用	△9,743	△12,661
繰延税金資産	24,380	△26,182
そ の 他	14,299	101,396
貸倒引当金	△988	3,620
会 社 計	668,703	△47,935
う ち 外 貨 建 資 産	360,954	△65,748

（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22年度末		平成23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	2,926,647	△24,144	2,695,081	△126,731

(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。  
平成22年度末、平成23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22年度末					平成23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	2,095,625	2,089,927	△5,698	24,408	△30,107	1,986,661	2,021,377	34,715	41,685	△6,969
責任準備金対応債券	8,333,155	8,544,014	210,859	232,254	△21,395	9,076,611	9,585,279	508,667	516,788	△8,121
子会社・関連会社株式	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他有価証券	4,360,904	4,346,301	△14,603	177,158	△191,761	4,166,752	4,191,194	24,441	208,191	△183,750
公 社 債	695,158	701,617	6,458	10,211	△3,752	678,798	699,657	20,858	21,941	△1,082
株 式	979,418	976,197	△3,220	131,757	△134,978	861,721	816,025	△45,695	80,330	△126,025
外 国 証 券	2,350,106	2,323,607	△26,499	21,966	△48,465	2,291,982	2,331,177	39,194	89,525	△50,330
公 社 債	2,323,427	2,298,275	△25,152	21,587	△46,740	2,270,795	2,313,669	42,873	89,237	△46,364
株 式 等	26,679	25,332	△1,346	378	△1,725	21,186	17,508	△3,678	288	△3,966
その他の証券	38,401	37,744	△657	3,899	△4,556	37,152	34,007	△3,144	3,135	△6,280
買入金銭債権	277,818	287,134	9,315	9,323	△8	272,098	285,329	13,231	13,259	△28
譲渡性預金	20,000	19,999	△0	-	△0	25,000	24,997	△2	-	△2
そ の 他	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
合 計	14,789,686	14,980,243	190,556	433,821	△243,264	15,230,025	15,797,851	567,825	766,666	△198,840
公 社 債	9,383,794	9,610,562	226,767	251,289	△24,522	10,107,797	10,650,943	543,146	551,692	△8,546
株 式	979,418	976,197	△3,220	131,757	△134,978	861,721	816,025	△45,695	80,330	△126,025
外 国 証 券	4,090,252	4,048,605	△41,646	37,550	△79,197	3,926,256	3,986,547	60,290	118,248	△57,957
公 社 債	4,063,573	4,023,272	△40,300	37,171	△77,471	3,905,070	3,969,039	63,968	117,960	△53,991
株 式 等	26,679	25,332	△1,346	378	△1,725	21,186	17,508	△3,678	288	△3,966
その他の証券	38,401	37,744	△657	3,899	△4,556	37,152	34,007	△3,144	3,135	△6,280
買入金銭債権	277,818	287,134	9,315	9,323	△8	272,098	285,329	13,231	13,259	△28
譲渡性預金	20,000	19,999	△0	-	△0	25,000	24,997	△2	-	△2
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22年度末	平成23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	39,898	39,898
その他有価証券	634,919	554,448
非上場国内株式(店頭売買株式を除く)	96,757	26,311
非上場外国株式(店頭売買株式を除く)	536,626	526,491
非上場外国債券	-	-
そ の 他	1,536	1,645
合 計	674,818	594,346

**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22年度末、平成23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22年度末、平成23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
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22年9月末	平成23年9月末	平成22年9月末	平成23年9月末
金利スワップ	1,206	1,258	47	42
為替予約	26,823	28,669	1,916	2,424
通貨オプション(買建)	814	1,233	108	213
債券オプション(買建)	-	551	-	9
株式オプション(買建)	2,325	2,345	261	232
合計			1,996	2,839

(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22年度末						平成23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	3,105	△4,011	-	-	-	△905	3,315	117,452	-	-	-	120,767
ヘッジ会計非適用分	△169	△7,410	△6,798	△186	-	△14,563	△490	61,358	△338	△1,593	-	58,935
合 計	2,936	△11,421	△6,798	△186	-	△ 15,469	2,824	178,810	△338	△1,593	-	179,702

(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22年度末通貨関連 △35,929百万円、平成23年度第2四半期(上半期)末通貨関連 73,824百万円となっています。

(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22年度末				平成23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	34,500	△169	△169	47,000	47,000	△490	△490
	合 計				△169				△490

(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22年度末			平成23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		
繰延ヘッジ	金利スワップ 固定金利受取/変動金利支払	貸付金	15,176	10,000	254	15,176	10,000	179
	固定金利支払/変動金利受取		-	-	-	-	-	-
特例処理	固定金利受取/変動金利支払	貸付金	65,714	61,969	2,856	62,583	58,376	3,138
	固定金利支払/変動金利受取		1,848	464	△6	1,051	197	△2
	合 計				3,105			3,315

(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22年度末				平成23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	938,374	54,060	△16,924	△16,924	935,776	29,761	54,701	54,701
	(米ドル)	557,963	54,060	1,939	1,939	460,958	29,761	23,348	23,348
	(ユーロ)	365,884	-	△17,903	△17,903	365,991	-	22,799	22,799
	(豪ドル)	14,394	-	△959	△959	107,572	-	8,544	8,544
	買建	182,942	-	7,554	7,554	158,559	-	△2,770	△2,770
	(ユーロ)	106,706	-	5,714	5,714	116,891	-	△2,697	△2,697
	(米ドル)	76,135	-	1,838	1,838	41,636	-	△72	△72
	通貨オプション								
	売建								
	コール	8,400	-			81,360	-		
	(豪ドル)	(56)	-	57	△0	(905)	-	2	903
	(米ドル)	(-)	-	-	-	(905)	-	2	903
	プット	8,400	-			-	-		
	(米ドル)	(56)	-	57	△0	(-)	-	-	-
	買建								
	プット	8,000	-			-	-		
(豪ドル)	(62)	-	15	46	(-)	-	-	-	
(米ドル)	(62)	-	15	46	(-)	-	-	-	
買建									
プット	47,707	39,707			123,317	39,707			
(豪ドル)	(6,375)	-	8,289	1,914	(10,014)	-	18,537	8,523	
(米ドル)	(-)	-	-	-	83,610	-	9,343	5,633	
	47,707	39,707			39,707	39,707			
	(6,375)	-	8,289	1,914	(6,304)	-	9,194	2,890	
合 計				△7,410				61,358	

(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22年度末			平成23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	外貨建資産						
	売建		1,558,182	491,281	△35,929	1,448,722	505,665	73,824
	(ユーロ)		709,294	165,218	△27,604	611,523	99,013	38,566
	(米ドル)		504,134	49,454	2,032	437,033	95,803	24,088
	(豪ドル)	276,608	276,608	△10,037	332,554	310,849	6,328	
振当処理	売建	外貨建資産	375,692	337,692	31,918	323,868	255,258	43,627
	(豪ドル)		177,973	177,973	2,370	164,522	164,522	11,175
	(米ドル)		197,719	159,719	29,548	159,345	90,735	32,451
合 計				△4,011			117,452	

(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22年度末				平成23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	-	-	-	-	53,024	-	569	569
	買建	4,668	-	105	105	54,762	-	1,951	1,951
	株価指数オプション								
	買建	-	-	-	-	28,750	-		
	コール	(-)	-	-	-	(322)		69	△252
プット	-	-	-	-	22,500	-			
		(-)	-	-	(158)		72	△86	
店頭	株価指数オプション								
	買建								
	プット	233,625	34,000			234,500	34,000		
		(12,434)		5,530	△6,904	(10,995)		8,474	△2,520
	合 計				△6,798				△338

(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22年度末、平成23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22年度末				平成23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	-	-	-	-	47,542	-	649	649
店頭	債券店頭オプション取引								
	売建								
	コール	43,751	-			72,550	-		
		(126)		63	63	(1,281)		3,611	△2,329
	プット	-	-			12,669	-		
		(-)				(56)		40	16
	買建								
コール	-	-			12,669	-			
	(-)				(46)		17	△29	
プット	40,327	-			42,437	-			
	(346)		97	△249	(854)		953	99	
	合 計				△186				△1,593

(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22年度末、平成23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。