

平成23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・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	・・・	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22年度末		平成23年度末	
	金 額	占率	金 額	占率
国 債	6,402,550	42.3	7,438,011	46.4
地 方 債	260,411	1.7	216,051	1.3
社 債	2,727,292	18.0	2,769,338	17.3
うち公社・公団債	1,708,846	11.3	1,843,143	11.5
株 式	1,112,189	7.3	906,828	5.7
外 国 証 券	4,600,411	30.4	4,656,121	29.1
公 社 債	4,038,420	26.7	4,105,179	25.6
うち外貨建	2,186,936	14.4	2,385,387	14.9
株 式 等	561,991	3.7	550,941	3.4
うち外貨建	37,281	0.2	44,408	0.3
その他の証券	39,128	0.3	36,456	0.2
合 計	15,141,983	100.0	16,022,808	100.0
うち外貨建	2,244,540	14.8	2,457,174	15.3

(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年度末
北 海 道	4,752	2,387
東 北	751	650
関 東	109,974	100,991
中 部	52,362	47,011
近 畿	51,788	28,310
中 国	19,045	17,544
四 国	355	359
九 州	21,380	18,796
合 計	260,411	216,051

(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	15,449,116

<平成23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	515,398	1,410,102	1,780,601	1,206,817	1,313,301	8,280,195	1,516,393	16,022,808
国 債	104,169	158,662	456,896	186,623	304,558	6,227,101	-	7,438,011
地 方 債	64,030	124,593	18,746	1,968	4,066	2,646	-	216,051
社 債	233,552	615,451	524,842	236,366	117,230	1,019,483	22,409	2,769,338
株 式							906,828	906,828
外 国 証 券	113,573	511,255	780,115	781,858	887,445	1,030,963	550,908	4,656,121
公 社 債	113,573	511,222	780,115	781,858	887,445	1,030,963	-	4,105,179
株 式 等	-	32	-	-	-	-	550,908	550,941
その他の証券	71	139	-	-	-	-	36,245	36,456
買入金銭債権	8,062	-	4,119	-	-	265,066	-	277,249
譲渡性預金	33,997	-	-	-	-	-	-	33,997
そ の 他	-	-	-	-	-	-	-	-
合 計	557,458	1,410,102	1,784,720	1,206,817	1,313,301	8,545,261	1,516,393	16,334,054

(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年度末	
		金 額	占率	金 額	占率
水 産 ・ 農 林 業		156	0.0	157	0.0
鉱 業		209	0.0	101	0.0
建 設 業		25,531	2.3	26,625	2.9
製 造 業	食 料 品	30,795	2.8	26,883	3.0
	織 維 製 品	7,289	0.7	6,346	0.7
	パ ル プ ・ 紙	4,873	0.4	5,322	0.6
	化 学	88,318	7.9	77,485	8.5
	医 薬 品	55,269	5.0	39,677	4.4
	石 油 ・ 石 炭 製 品	5,503	0.5	4,815	0.5
	ゴ ム 製 品	3,523	0.3	3,850	0.4
	ガ ラ ス ・ 土 石 製 品	13,090	1.2	10,514	1.2
	鉄 鋼	29,997	2.7	23,412	2.6
	非 鉄 金 属	32,514	2.9	28,566	3.2
	金 属 製 品	4,448	0.4	4,660	0.5
	機 械	71,577	6.4	54,442	6.0
	電 気 機 器	142,748	12.8	112,049	12.4
	輸 送 用 機 器	51,424	4.6	35,820	4.0
	精 密 機 器	9,786	0.9	5,283	0.6
そ の 他 製 品	18,548	1.7	16,420	1.8	
電 気 ・ ガ ス 業		29,615	2.7	25,660	2.8
運 輸 ・ 情 報 通 信 業	陸 運 業	73,397	6.6	71,260	7.9
	海 運 業	7,168	0.6	4,875	0.5
	空 運 業	3,495	0.3	2,775	0.3
	倉 庫 ・ 運 輸 関 連 業	5,750	0.5	5,610	0.6
	情 報 ・ 通 信 業	6,692	0.6	5,507	0.6
商 業	卸 売 業	72,181	6.5	67,506	7.4
	小 売 業	18,286	1.6	15,247	1.7
金 融 ・ 保 険 業	銀 行 業	207,677	18.7	134,318	14.8
	証 券、商 品 先 物 取 引 業	5,838	0.5	5,730	0.6
	保 険 業	44,511	4.0	42,364	4.7
	そ の 他 金 融 業	2,087	0.2	1,680	0.2
不 動 産 業		9,394	0.8	8,281	0.9
サ ー ビ ス 業		30,485	2.7	33,574	3.7
合 計		1,112,189	100.0	906,828	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年度末
保 険 約 款 貸 付	373,873	359,161
契 約 者 貸 付	337,347	325,323
保 険 料 振 替 貸 付	36,525	33,838
一 般 貸 付 (うち非居住者貸付)	2,797,488 (91,459)	2,528,286 (74,957)
企 業 貸 付 (うち国内企業向け)	2,697,968 (2,668,925)	2,450,583 (2,425,467)
国・国際機関・政府関係機関貸付	28,626	22,461
公 共 団 体 ・ 公 企 業 貸 付	54,427	42,024
住 宅 ロ ー ン	10,737	9,569
消 費 者 ロ ー ン	5,352	3,310
そ の 他	376	337
合 計	3,171,361	2,887,447

(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年度末	
	貸付先数	占率	貸付先数	占率
大 企 業	294	66.5	263	69.0
	金額 2,427,810	91.0	金額 2,197,074	90.6
中 堅 企 業	7	1.6	5	1.3
	金額 13,557	0.5	金額 11,865	0.5
中 小 企 業	141	31.9	113	29.7
	金額 227,557	8.5	金額 216,528	8.9
国 内 企 業 向 け 貸 付 計	442	100.0	381	100.0
	金額 2,668,925	100.0	金額 2,425,467	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	従業員 300人超 かつ 資本金3億円超 10億円未満	従業員 50人超 かつ 資本金5千万円超 10億円未満	従業員 100人超 かつ 資本金5千万円超 10億円未満	従業員 100人超 かつ 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	4,609	31,080	31,268	42,500	85,507	29,303	118,000	342,268
固 定 金 利	266,499	533,937	574,846	444,314	276,296	90,123	-	2,186,017
一 般 貸 付 計	271,108	565,018	606,114	486,814	361,803	119,426	118,000	2,528,286

(4) 貸付金業種別内訳

(単位：百万円、%)

区分	平成22年度末		平成23年度末		
	金額	占率	金額	占率	
	666,033	23.8	566,056	22.4	
製造業	食料	19,007	0.7	19,207	0.8
	繊維	14,125	0.5	13,913	0.6
	木材・木製品	1,088	0.0	1,045	0.0
	パルプ・紙	44,383	1.6	38,305	1.5
	印刷	50	0.0	41	0.0
	化学	75,265	2.7	70,450	2.8
	石油・石炭	58,656	2.1	54,665	2.2
	窯業・土石	17,459	0.6	15,992	0.6
	鉄鋼	101,032	3.6	97,535	3.9
	非鉄金属	13,150	0.5	11,798	0.5
	金属製品	152	0.0	92	0.0
	はん用・生産用・業務用機械	37,765	1.3	29,751	1.2
	電気機械	117,278	4.2	77,088	3.0
	輸送用機械	141,788	5.1	122,012	4.8
その他の製造業	24,828	0.9	14,156	0.6	
国内向け	農業、林業	-	-	-	-
	漁業	-	-	-	-
	鉱業、採石業、砂利採取業	-	-	-	-
	建設業	10,888	0.4	9,022	0.4
	電気・ガス・熱供給・水道業	451,185	16.1	399,553	15.8
	情報通信業	80,590	2.9	81,508	3.2
	運輸業、郵便業	157,398	5.6	149,904	5.9
	卸売業	505,034	18.1	500,788	19.8
	小売業	20,587	0.7	15,695	0.6
	金融業、保険業	492,232	17.6	421,155	16.7
	不動産業	168,372	6.0	161,462	6.4
	物品賃貸業	116,774	4.2	119,598	4.7
	学術研究、専門・技術サービス業	1,010	0.0	1,370	0.1
	宿泊業	199	0.0	169	0.0
	飲食業	101	0.0	44	0.0
	生活関連サービス業、娯楽業	147	0.0	50	0.0
	教育、学習支援業	-	-	-	-
	医療・福祉	559	0.0	337	0.0
	その他のサービス	8,246	0.3	6,710	0.3
	地方公共団体	10,576	0.4	7,019	0.3
個人(住宅・消費・納税資金等)	16,089	0.6	12,880	0.5	
合計	2,706,028	96.7	2,453,328	97.0	
海外向け	政府等	62,417	2.2	49,842	2.0
	金融機関	22,000	0.8	22,000	0.9
	商工業等	7,042	0.3	3,115	0.1
合計	91,459	3.3	74,957	3.0	
一般貸付計	2,797,488	100.0	2,528,286	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22年度末		平成23年度末	
	金 額	占率	金 額	占率
担 保 貸 付	13,069	0.5	1,721	0.1
有 価 証 券 担 保 貸 付	1,626	0.1	1,224	0.0
不 動 産 ・ 動 産 ・ 財 団 担 保 貸 付	11,443	0.4	451	0.0
指 名 債 権 担 保 貸 付	-	-	45	0.0
保 証 貸 付	122,801	4.4	96,919	3.8
信 用 貸 付	2,645,527	94.6	2,416,765	95.6
そ の 他	16,089	0.6	12,880	0.5
一 般 貸 付 計	2,797,488	100.0	2,528,286	100.0
う ち 劣 後 特 約 付 貸 付	283,500	10.1	263,000	10.4

(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年度末	
	金 額	占率	金 額	占率
北 海 道	27,963	1.0	22,527	0.9
東 北	54,320	2.0	51,584	2.1
関 東	1,748,467	65.0	1,592,676	65.3
中 部	194,089	7.2	171,362	7.0
近 畿	471,196	17.5	424,228	17.4
中 国	88,513	3.3	88,191	3.6
四 国	24,276	0.9	23,041	0.9
九 州	81,110	3.0	66,836	2.7
合 計	2,689,938	100.0	2,440,448	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22年度末		平成23年度末	
	金 額	占率	金 額	占率
公 社 債	2,207,258	46.2	2,412,766	49.9
株 式 等	37,281	0.8	44,408	0.9
現 預 金 ・ そ の 他	34,880	0.7	41,377	0.9
外 貨 建 資 産 計	2,279,420	47.7	2,498,552	51.7

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年度末	
	金 額	占率	金 額	占率
公 社 債	329,197	6.9	291,216	6.0
現 預 金 ・ そ の 他	23,000	0.5	22,999	0.5
円 貨 額 が 確 定 し た 外 貨 建 資 産 計	352,197	7.4	314,215	6.5

ウ. 円貨建資産

(単位：百万円、%)

区 分	平成22年度末		平成23年度末	
	金 額	占率	金 額	占率
非 居 住 者 貸 付	91,459	1.9	74,957	1.6
公 社 債	1,522,286	31.9	1,428,575	29.6
株 式 等	524,709	11.0	506,533	10.5
そ の 他	5,713	0.1	10,118	0.2
円 貨 建 資 産 計	2,144,169	44.9	2,020,185	41.8

エ. 合計

(単位：百万円、%)

区 分	平成22年度末		平成23年度末	
	金 額	占率	金 額	占率
海 外 投 融 資	4,775,787	100.0	4,832,952	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	974,769	973,953	816	8,139	702,431	701,631	799	5,000
	21.2	24.1	0.1	8.9	15.1	17.1	0.1	6.7
ヨ ー ロ ッ パ	1,551,979	1,544,808	7,171	50,000	1,652,438	1,645,605	6,833	42,000
	33.7	38.3	1.3	54.7	35.5	40.1	1.2	56.0
オセアニア	26,859	26,859	-	5,000	225,762	225,762	-	5,000
	0.6	0.7	-	5.5	4.8	5.5	-	6.7
ア ジ ア	13,996	-	13,996	-	28,607	-	28,607	-
	0.3	-	2.5	-	0.6	-	5.2	-
中 南 米	1,799,559	1,259,552	540,007	3,559	1,711,367	1,196,666	514,700	2,848
	39.1	31.2	96.1	3.9	36.8	29.2	93.4	3.8
中 東	-	-	-	87	-	-	-	6
	-	-	-	0.1	-	-	-	0.0
ア フ リ カ	-	-	-	343	-	-	-	267
	-	-	-	0.4	-	-	-	0.4
国 際 機 関	233,245	233,245	-	24,329	335,513	335,513	-	19,835
	5.1	5.8	-	26.6	7.2	8.2	-	26.5
合 計	4,600,411	4,038,420	561,991	91,459	4,656,121	4,105,179	550,941	74,957
	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年度末	
	金 額	占率	金 額	占率
ユ ー ロ	980,322	43.0	871,122	34.9
米 ド ル	920,525	40.4	824,206	33.0
豪 ド ル	296,273	13.0	703,501	28.2
英 ボ ン ド	68,405	3.0	71,214	2.9
中 国 元	11,413	0.5	26,516	1.1
韓 国 ウ ォ ン	2,472	0.1	1,984	0.1
そ の 他	7	0.0	7	0.0
合 計	2,279,420	100.0	2,498,552	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	52,939	△5,520	50,083	△5,064

(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	2,280,587	△54,709	2,210,515	△13,329

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	-	-	-	609	-	34	34	
合 計								34	

(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	25,243	-	1,470	1,470	
合 計								1,470	

(通貨関連)

(単位：百万円)

区分	種 類	平成22年度末			平成23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	40,928	-	△1,097	-	-	-	-	
	(米ドル)	40,928	-	△1,097	-	-	-	-	
	買建	-	-	-	-	-	-	-	
合 計								△1,097	

(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22年度末		平成23年度末	
	金額	占率	金額	占率
現預金・コールローン	543,938	2.3	484,269	2.0
買入金銭債権	390,037	1.6	353,742	1.5
有価証券	18,068,631	76.1	18,843,387	78.6
公 社 債	10,519,245	44.3	11,589,212	48.4
株 式	1,656,284	7.0	1,438,948	6.0
外 国 証 券	5,139,553	21.7	5,092,508	21.3
公 社 債	4,333,994	18.3	4,342,927	18.1
株 式 等	805,558	3.4	749,581	3.1
その他の証券	753,548	3.2	722,717	3.0
貸付金	3,171,361	13.4	2,887,447	12.0
保険約款貸付	373,873	1.6	359,161	1.5
一般貸付	2,797,488	11.8	2,528,286	10.6
不 動 産	940,803	4.0	903,609	3.8
うち投資用	701,341	3.0	671,810	2.8
繰延税金資産	319,829	1.3	210,683	0.9
そ の 他	310,398	1.3	283,961	1.2
貸倒引当金	△8,127	△0.0	△4,057	△0.0
会 社 計	23,736,871	100.0	23,963,043	100.0
うち外貨建資産	2,814,061	11.9	2,938,648	12.3

(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	平成23年度
	金額	金額
現預金・コールローン	197,796	△59,669
買入金銭債権	△72,561	△36,294
有価証券	951,719	774,755
公 社 債	1,306,442	1,069,967
株 式	△307,837	△217,336
外 国 証 券	531	△47,044
公 社 債	8,259	8,933
株 式 等	△7,727	△55,977
その他の証券	△47,417	△30,830
貸付金	△272,525	△283,913
保険約款貸付	△16,750	△14,711
一般貸付	△255,775	△269,201
不 動 産	△36,939	△37,193
うち投資用	△34,299	△29,530
繰延税金資産	16,625	△109,145
そ の 他	△65,355	△26,436
貸倒引当金	△204	4,070
会 社 計	718,555	226,171
うち外貨建資産	397,565	124,586

(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	2,820,578	55,959

(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22年度末、平成23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22年度末					平成23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	2,095,625	2,089,927	△5,698	24,408	△30,107	1,961,880	2,030,383	68,503	69,972	△1,469
責任準備金対応債券	8,333,155	8,544,014	210,859	232,254	△21,395	9,368,136	9,882,655	514,519	522,706	△8,187
子会社・関連会社株式	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他の有価証券	4,360,904	4,346,301	△14,603	177,158	△191,761	4,245,609	4,399,505	153,896	260,300	△106,403
公 社 債	695,158	701,617	6,458	10,211	△3,752	696,718	717,872	21,154	22,392	△1,238
株 式	979,418	976,197	△3,220	131,757	△134,978	800,682	836,448	35,765	121,254	△85,488
外 国 証 券	2,350,106	2,323,607	△26,499	21,966	△48,465	2,412,211	2,498,033	85,821	100,852	△15,031
公 社 債	2,323,427	2,298,275	△25,152	21,587	△46,740	2,392,962	2,480,691	87,729	100,507	△12,778
株 式 等	26,679	25,332	△1,346	378	△1,725	19,249	17,341	△1,908	345	△2,253
その他の証券	38,401	37,744	△657	3,899	△4,556	37,152	35,904	△1,247	3,382	△4,629
買入金銭債権	277,818	287,134	9,315	9,323	△8	264,844	277,249	12,404	12,418	△13
譲渡性預金	20,000	19,999	△0	-	△0	34,000	33,997	△2	-	△2
その他	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
合 計	14,789,686	14,980,243	190,556	433,821	△243,264	15,575,626	16,312,544	736,918	852,978	△116,060
公 社 債	9,383,794	9,610,562	226,767	251,289	△24,522	10,402,246	10,951,216	548,970	557,475	△8,505
株 式	979,418	976,197	△3,220	131,757	△134,978	800,682	836,448	35,765	121,254	△85,488
外 国 証 券	4,090,252	4,048,605	△41,646	37,550	△79,197	4,036,700	4,177,728	141,027	158,449	△17,421
公 社 債	4,063,573	4,023,272	△40,300	37,171	△77,471	4,017,450	4,160,386	142,936	158,103	△15,167
株 式 等	26,679	25,332	△1,346	378	△1,725	19,249	17,341	△1,908	345	△2,253
その他の証券	38,401	37,744	△657	3,899	△4,556	37,152	35,904	△1,247	3,382	△4,629
買入金銭債権	277,818	287,134	9,315	9,323	△8	264,844	277,249	12,404	12,418	△13
譲渡性預金	20,000	19,999	△0	-	△0	34,000	33,997	△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	44,854
その他の有価証券	634,919	559,300
非上場国内株式(店頭売買株式を除く)	96,757	26,189
非上場外国株式(店頭売買株式を除く)	536,626	532,480
非 上 場 外 国 債 券	-	-
そ の 他	1,536	630
合 計	674,818	604,155

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. リスク管理方針

デリバティブ取引についての基本的な取組姿勢を「資産運用リスク管理方針」に定め、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23年3月末	平成24年3月末	平成23年3月末	平成24年3月末
金 利 ス ワ ッ プ	1,172	1,073	39	36
為 替 予 約	30,551	26,879	1,325	903
通貨オプション(買建)	477	3,727	103	200
債券オプション(買建)	403	780	0	13
株式オプション(買建)	2,336	1,834	202	153
合 計			805	486

(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	2,966	△79,272	-	-	-	△76,306
ヘッジ会計非適用分	△169	△7,410	△6,798	△186	-	△14,563	△250	△29,641	△5,832	465	-	△35,258
合 計	2,936	△11,421	△6,798	△186	-	△15,469	2,715	△108,913	△5,832	465	-	△111,564

（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年度末通貨関連 △93,225百万円となっています。

(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	34,500	34,500	△250	△250
	合 計				△169				△250

（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	10,000	-	89
	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	62,369	58,142	2,877
	固定金利支払/変動金利受取		1,848	464	△6	464	62	△1
	合 計				3,105			2,966

(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	767,930	32,179	△33,644	△33,644
	(米ドル)	557,963	54,060	1,939	1,939	289,502	-	△7,612	△7,612
	(ユーロ)	365,884	-	△17,903	△17,903	251,282	-	△8,073	△8,073
	(豪ドル)	14,394	-	△959	△959	225,522	32,179	△17,963	△17,963
	買建	182,942	-	7,554	7,554	28,274	-	△178	△178
	(米ドル)	76,135	-	1,838	1,838	22,592	-	△149	△149
	(ユーロ)	106,706	-	5,714	5,714	5,012	-	△27	△27
	通貨オプション								
	売建								
	コール	8,400	-			-	-		
	(56)			57	△0	(-)			
	(米ドル)	8,400	-			-	-		
	(56)			57	△0	(-)			
	プット	8,000	-			-	-		
	(62)			15	46	(-)			
	(米ドル)	8,000	-			-	-		
	(62)			15	46	(-)			
	買建								
	コール	-	-			333,000	-		
(-)					(4,219)		7,738	3,519	
(米ドル)	-	-			243,000	-			
(-)					(3,113)		7,249	4,136	
(豪ドル)					90,000	-			
					(1,105)		488	△616	
プット	47,707	39,707			39,707	39,707			
(6,375)					(6,304)		6,967	662	
(米ドル)	47,707	39,707		8,289	1,914	39,707			
(6,375)				8,289	1,914	(6,304)		662	
合 計					△7,410			△29,641	

(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	1,569,215	457,857	△93,225
	(ユーロ)		709,294	165,218	△27,604	580,503	74,982	△29,556
	(米ドル)		504,134	49,454	2,032	506,742	-	△18,968
	(豪ドル)		276,608	276,608	△10,037	416,395	382,875	△38,969
	(英ポンド)	68,145	-	△320	65,573	-	△5,731	
振当処理	売建	外貨建資産	375,692	337,692	31,918	322,528	256,055	13,953
	(豪ドル)		177,973	177,973	2,370	165,699	165,699	△8,618
	(米ドル)		197,719	159,719	29,548	156,829	90,355	22,571
合 計					△4,011		△79,272	

(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	-	-	-	-	16,019	-	△6	△6
	買建	4,668	-	105	105	30,379	-	1,726	1,726
店頭	株価指数オプション								
	買建	233,625	34,000			183,400	34,000		
	ブット	(12,434)		5,530	△6,904	(11,203)		3,650	△7,553
	合 計				△6,798				△5,832

(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	-	-	-	-	85,203	-	49	49
店頭	債券店頭オプション取引								
	売建								
	コール	43,751	-			78,077	-		
		(126)		63	63	(1,175)		699	476
	買建								
	ブット	40,327	-			78,077	-		
		(346)		97	△249	(1,421)		1,362	△59
	合 計				△186				465

(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年度末ともに残高がないため、記載していません。