

# 平成22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<br>第2四半期(上半期)末 |       | 平成21年度末    |       |
|----------|-----------------------|-------|------------|-------|
|          | 金 額                   | 占率    | 金 額        | 占率    |
| 国 債      | 6,019,606             | 40.2  | 4,926,553  | 35.2  |
| 地 方 債    | 276,779               | 1.8   | 283,654    | 2.0   |
| 社 債      | 2,778,233             | 18.5  | 2,850,101  | 20.4  |
| うち公社・公団債 | 1,712,066             | 11.4  | 1,699,850  | 12.1  |
| 株 式      | 1,214,441             | 8.1   | 1,320,983  | 9.4   |
| 外 国 証 券  | 4,664,672             | 31.1  | 4,587,080  | 32.8  |
| 公 社 債    | 4,086,301             | 27.3  | 3,990,477  | 28.5  |
| うち外貨建    | 2,184,661             | 14.6  | 1,783,838  | 12.7  |
| 株 式 等    | 578,371               | 3.9   | 596,602    | 4.3   |
| うち外貨建    | 37,658                | 0.3   | 46,508     | 0.3   |
| その他の証券   | 35,818                | 0.2   | 33,029     | 0.2   |
| 合 計      | 14,989,551            | 100.0 | 14,001,401 | 100.0 |
| うち外貨建    | 2,222,320             | 14.8  | 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22年度<br>第2四半期(上半期)末 | 平成21年度末 |
|-------|-----------------------|---------|
| 北 海 道 | 5,410                 | 5,416   |
| 東 北   | 752                   | 1,143   |
| 関 東   | 113,057               | 115,789 |
| 中 部   | 53,790                | 55,249  |
| 近 畿   | 56,563                | 58,228  |
| 中 国   | 21,770                | 22,388  |
| 四 国   | 353                   | 351     |
| 九 州   | 25,082                | 25,086  |
| 合 計   | 276,779               | 283,654 |

### (3) 有価証券残存期間別残高

<平成22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<br>3年以下 | 3年超<br>5年以下 | 5年超<br>7年以下 | 7年超<br>10年以下 | 10年超      | 期間の定め<br>ないもの | 合 計        |
|---------|---------|-------------|-------------|-------------|--------------|-----------|---------------|------------|
| 有 価 証 券 | 520,601 | 1,042,787   | 1,635,249   | 1,521,491   | 1,711,372    | 6,708,800 | 1,849,248     | 14,989,551 |
| 国 債     | 116,937 | 170,667     | 199,475     | 342,495     | 413,640      | 4,776,389 | -             | 6,019,606  |
| 地 方 債   | 37,125  | 119,619     | 104,594     | 7,760       | 5,067        | 2,612     | -             | 276,779    |
| 社 債     | 190,298 | 427,847     | 711,535     | 387,327     | 214,021      | 824,654   | 22,548        | 2,778,233  |
| 株 式     |         |             |             |             |              |           | 1,214,441     | 1,214,441  |
| 外 国 証 券 | 174,876 | 324,120     | 619,644     | 783,908     | 1,078,643    | 1,105,143 | 578,336       | 4,664,672  |
| 公 社 債   | 174,875 | 324,086     | 619,644     | 783,908     | 1,078,643    | 1,105,143 | -             | 4,086,301  |
| 株 式 等   | 1       | 33          | -           | -           | -            | -         | 578,336       | 578,371    |
| その他の証券  | 1,362   | 533         | -           | -           | -            | -         | 33,922        | 35,818     |
| 買入金銭債権  | -       | -           | -           | 5,435       | -            | 295,412   | -             | 300,848    |
| 譲渡性預金   | 11,998  | -           | -           | -           | -            | -         | -             | 11,998     |
| そ の 他   | -       | -           | -           | -           | -            | -         | -             | -          |
| 合 計     | 532,599 | 1,042,787   | 1,635,249   | 1,526,927   | 1,711,372    | 7,004,213 | 1,849,248     | 15,302,399 |

<平成21年度末>

(単位：百万円)

| 区 分     | 1年以下    | 1年超<br>3年以下 | 3年超<br>5年以下 | 5年超<br>7年以下 | 7年超<br>10年以下 | 10年超      | 期間の定め<br>ないもの | 合 計        |
|---------|---------|-------------|-------------|-------------|--------------|-----------|---------------|------------|
| 有 価 証 券 | 623,667 | 883,732     | 1,661,990   | 1,449,532   | 1,396,594    | 6,015,092 | 1,970,791     | 14,001,401 |
| 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     |
| 買入金銭債権  | 19,994  | -           | -           | 4,067       | -            | 293,551   | -             | 317,613    |
| 譲渡性預金   | 11,999  | -           | -           | -           | -            | -         | -             | 11,999     |
| そ の 他   | -       | -           | -           | -           | -            | -         | -             | -          |
| 合 計     | 655,661 | 883,732     | 1,661,990   | 1,453,599   | 1,396,594    | 6,308,644 | 1,970,791     | 14,331,014 |

(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<br>第2四半期(上半期)末 |       | 平成21年度末   |       |
|--------------------------------------|------------|-----------------------|-------|-----------|-------|
|                                      |            | 金 額                   | 占率    | 金 額       | 占率    |
| 水産・農林業                               |            | 723                   | 0.1   | 697       | 0.1   |
| 鉱業                                   |            | 145                   | 0.0   | 237       | 0.0   |
| 建設業                                  |            | 23,503                | 1.9   | 26,808    | 2.0   |
| 製<br>造<br>業                          | 食料品        | 34,050                | 2.8   | 36,516    | 2.8   |
|                                      | 繊維製品       | 7,464                 | 0.6   | 7,370     | 0.6   |
|                                      | パルプ・紙      | 5,446                 | 0.4   | 5,575     | 0.4   |
|                                      | 化学         | 87,307                | 7.2   | 97,749    | 7.4   |
|                                      | 医薬品        | 69,295                | 5.7   | 79,623    | 6.0   |
|                                      | 石油・石炭製品    | 4,632                 | 0.4   | 4,507     | 0.3   |
|                                      | ゴム製品       | 4,107                 | 0.3   | 4,552     | 0.3   |
|                                      | ガラス・土石製品   | 11,675                | 1.0   | 11,856    | 0.9   |
|                                      | 鉄鋼         | 34,719                | 2.9   | 42,604    | 3.2   |
|                                      | 非鉄金属       | 30,052                | 2.5   | 33,876    | 2.6   |
|                                      | 金属製品       | 4,428                 | 0.4   | 4,865     | 0.4   |
|                                      | 機械         | 69,996                | 5.8   | 81,916    | 6.2   |
|                                      | 電気機器       | 148,171               | 12.2  | 172,006   | 13.0  |
|                                      | 輸送用機器      | 58,635                | 4.8   | 67,091    | 5.1   |
|                                      | 精密機器       | 9,831                 | 0.8   | 12,343    | 0.9   |
|                                      | その他製品      | 18,430                | 1.5   | 21,659    | 1.6   |
| 電気・ガス業                               |            | 41,793                | 3.4   | 41,605    | 3.1   |
| 運<br>輸<br>・<br>情<br>報<br>通<br>信<br>業 | 陸運業        | 78,557                | 6.5   | 82,496    | 6.2   |
|                                      | 海運業        | 8,858                 | 0.7   | 10,370    | 0.8   |
|                                      | 空運業        | 4,568                 | 0.4   | 3,425     | 0.3   |
|                                      | 倉庫・運輸関連業   | 5,566                 | 0.5   | 5,881     | 0.4   |
|                                      | 情報・通信業     | 6,505                 | 0.5   | 6,990     | 0.5   |
| 商<br>業                               | 卸売業        | 66,200                | 5.5   | 71,429    | 5.4   |
|                                      | 小売業        | 20,978                | 1.7   | 23,388    | 1.8   |
| 金<br>融<br>・<br>保<br>険<br>業           | 銀行業        | 220,953               | 18.2  | 237,560   | 18.0  |
|                                      | 証券、商品先物取引業 | 5,797                 | 0.5   | 7,314     | 0.6   |
|                                      | 保険業        | 85,423                | 7.0   | 70,323    | 5.3   |
|                                      | その他金融業     | 4,746                 | 0.4   | 5,405     | 0.4   |
| 不動産業                                 |            | 10,641                | 0.9   | 11,151    | 0.8   |
| サービス業                                |            | 31,231                | 2.6   | 31,781    | 2.4   |
| 合 計                                  |            | 1,214,441             | 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22年度<br>第2四半期(上半期)末 | 平成21年度末     |
|-----------------|-----------------------|-------------|
| 保 険 約 款 貸 付     | 381,943               | 390,623     |
| 契 約 者 貸 付       | 343,767               | 351,500     |
| 保 険 料 振 替 貸 付   | 38,175                | 39,122      |
| 一 般 貸 付         | 2,879,561             | 3,053,263   |
| (うち非居住者貸付)      | (99,638)              | (103,005)   |
| 企 業 貸 付         | 2,766,111             | 2,933,245   |
| (うち国内企業向け)      | (2,736,674)           | (2,900,733) |
| 国・国際機関・政府関係機関貸付 | 31,604                | 33,054      |
| 公共団体・公企業貸付      | 62,996                | 65,665      |
| 住 宅 口 - ン       | 11,654                | 12,212      |
| 消 費 者 口 - ン     | 6,797                 | 8,668       |
| そ の 他           | 396                   | 417         |
| 合 計             | 3,261,504             | 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22年度<br>第2四半期(上半期)末 |                | 平成21年度末          |                |
|-----------------|-------------|-----------------------|----------------|------------------|----------------|
|                 |             |                       | 占率             |                  | 占率             |
| 大 企 業           | 貸付先数        | 309                   | 63.6           | 326              | 62.0           |
|                 | 金 額         | 2,502,528             | 91.4           | 2,663,539        | 91.8           |
| 中 堅 企 業         | 貸付先数        | 11                    | 2.3            | 12               | 2.3            |
|                 | 金 額         | 14,166                | 0.5            | 14,715           | 0.5            |
| 中 小 企 業         | 貸付先数        | 166                   | 34.2           | 188              | 35.7           |
|                 | 金 額         | 219,979               | 8.0            | 222,478          | 7.7            |
| 国内企業向け<br>貸 付 計 | 貸付先数<br>金 額 | 486<br>2,736,674      | 100.0<br>100.0 | 526<br>2,900,733 | 100.0<br>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     | 右の、を除外する全業種                 |                   | 小売業、飲食業                     |                    | サービス業                        |                    | 卸売業                         |                   |
|---------|-----------------------------|-------------------|-----------------------------|--------------------|------------------------------|--------------------|-----------------------------|-------------------|
|         | 従業員<br>300人超<br>かつ          | 資本金<br>10億円以上     | 従業員<br>50人超<br>かつ           | 資本金<br>10億円以上      | 従業員<br>100人超<br>かつ           | 資本金<br>10億円以上      | 従業員<br>100人超<br>かつ          | 資本金<br>10億円以上     |
| 大 企 業   |                             |                   |                             |                    |                              |                    |                             |                   |
| 中 堅 企 業 |                             | 資本金3億円超<br>10億円未満 |                             | 資本金5千万円超<br>10億円未満 |                              | 資本金5千万円超<br>10億円未満 |                             | 資本金1億円超<br>10億円未満 |
| 中 小 企 業 | 資本金3億円以下又は<br>常用する従業員300人以下 |                   | 資本金5千万円以下又は<br>常用する従業員50人以下 |                    | 資本金5千万円以下又は<br>常用する従業員100人以下 |                    | 資本金1億円以下又は<br>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年度第2四半期(上半期)末>

(単位:百万円)

| 区 分   | 1年以下    | 1年超<br>3年以下 | 3年超<br>5年以下 | 5年超<br>7年以下 | 7年超<br>10年以下 | 10年超    | 期間の定め<br>のないもの | 合 計       |
|-------|---------|-------------|-------------|-------------|--------------|---------|----------------|-----------|
| 変動金利  | 12,609  | 44,049      | 36,214      | 63,320      | 71,766       | 70,041  | 118,000        | 416,000   |
| 固定金利  | 285,822 | 563,273     | 539,815     | 547,978     | 461,753      | 64,917  | -              | 2,463,561 |
| 一般貸付計 | 298,431 | 607,322     | 576,029     | 611,298     | 533,520      | 134,958 | 118,000        | 2,879,561 |

<平成21年度末>

(単位:百万円)

| 区 分   | 1年以下    | 1年超<br>3年以下 | 3年超<br>5年以下 | 5年超<br>7年以下 | 7年超<br>10年以下 | 10年超    | 期間の定め<br>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22年度<br>第2四半期(上半期)末 |           | 平成21年度末 |         |      |
|------------------|------------------|-----------------------|-----------|---------|---------|------|
|                  |                  | 金 額                   | 占率        | 金 額     | 占率      |      |
| 製<br>造<br>業      |                  | 673,691               | 23.4      | 707,170 | 23.2    |      |
|                  | 食料               | 21,552                | 0.7       | 29,180  | 1.0     |      |
|                  | 繊維               | 16,284                | 0.6       | 16,544  | 0.5     |      |
|                  | 木材・木製品           | 1,240                 | 0.0       | 1,252   | 0.0     |      |
|                  | パルプ・紙            | 45,905                | 1.6       | 46,433  | 1.5     |      |
|                  | 印刷               | 53                    | 0.0       | 56      | 0.0     |      |
|                  | 化学               | 74,936                | 2.6       | 75,142  | 2.5     |      |
|                  | 石油・石炭            | 49,781                | 1.7       | 59,907  | 2.0     |      |
|                  | 窯業・土石            | 18,118                | 0.6       | 19,108  | 0.6     |      |
|                  | 鉄鋼               | 101,640               | 3.5       | 103,455 | 3.4     |      |
|                  | 非金属製品            | 13,303                | 0.5       | 13,454  | 0.4     |      |
|                  | 鉄金               | 186                   | 0.0       | 718     | 0.0     |      |
|                  | はん用・生産用・業務用機械    | 39,137                | 1.4       | 39,849  | 1.3     |      |
|                  | 電気機械             | 123,131               | 4.3       | 122,797 | 4.0     |      |
|                  | 輸送用機械            | 143,504               | 5.0       | 154,273 | 5.1     |      |
|                  | その他の製造業          | 24,915                | 0.9       | 24,995  | 0.8     |      |
|                  | 国<br>内<br>向<br>け | 農業、林業                 | -         | -       | -       | -    |
|                  |                  | 漁業                    | -         | -       | -       | -    |
|                  |                  | 鉱業、採石業、砂利採取業          | -         | -       | -       | -    |
|                  |                  | 建設業                   | 11,568    | 0.4     | 12,297  | 0.4  |
|                  |                  | 電気・ガス・熱供給・水道業         | 471,906   | 16.4    | 541,171 | 17.7 |
| 情報通信業            |                  | 77,220                | 2.7       | 77,355  | 2.5     |      |
| 運輸業、郵便業          |                  | 164,126               | 5.7       | 169,167 | 5.5     |      |
| 卸売業              |                  | 514,666               | 17.9      | 533,660 | 17.5    |      |
| 小売業              |                  | 24,094                | 0.8       | 24,364  | 0.8     |      |
| 金融業、保険業          |                  | 508,373               | 17.7      | 548,463 | 18.0    |      |
| 不動産業             |                  | 170,055               | 5.9       | 171,181 | 5.6     |      |
| 物品賃貸業            |                  | 122,148               | 4.2       | 116,087 | 3.8     |      |
| 学術研究、専門・技術サービス業  |                  | 1,011                 | 0.0       | 1,025   | 0.0     |      |
| 宿泊業              |                  | 214                   | 0.0       | 231     | 0.0     |      |
| 飲食業              |                  | 116                   | 0.0       | 128     | 0.0     |      |
| 生活関連サービス業、娯楽業    |                  | 188                   | 0.0       | 259     | 0.0     |      |
| 教育、学習支援業         |                  | -                     | -         | -       | -       |      |
| 医療・福祉            |                  | 590                   | 0.0       | 623     | 0.0     |      |
| その他のサービス         |                  | 8,525                 | 0.3       | 8,289   | 0.3     |      |
| 地方公共団体           |                  | 12,972                | 0.5       | 15,419  | 0.5     |      |
| 個人(住宅・消費・納税資金等)  | 18,452           | 0.6                   | 23,360    | 0.8     |         |      |
| 合 計              | 2,779,923        | 96.5                  | 2,950,258 | 96.6    |         |      |
| 海<br>外<br>向<br>け | 政 府 等            | 70,201                | 2.4       | 70,492  | 2.3     |      |
|                  | 金 融 機 関 等        | 22,000                | 0.8       | 22,000  | 0.7     |      |
|                  | 商 工 業 等          | 7,436                 | 0.3       | 10,512  | 0.3     |      |
| 合 計              | 99,638           | 3.5                   | 103,005   | 3.4     |         |      |
| 一 般 貸 付 計        | 2,879,561        | 100.0                 | 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22年度<br>第2四半期(上半期)末 |       | 平成21年度末   |       |
|---------------|-----------------------|-------|-----------|-------|
|               | 金 額                   | 占率    | 金 額       | 占率    |
| 担 保 貸 付       | 16,435                | 0.6   | 17,770    | 0.6   |
| 有価証券担保貸付      | 1,873                 | 0.1   | 2,687     | 0.1   |
| 不動産・動産・財団担保貸付 | 14,561                | 0.5   | 15,082    | 0.5   |
| 指名債権担保貸付      | -                     | -     | -         | -     |
| 保 証 貸 付       | 126,925               | 4.4   | 130,228   | 4.3   |
| 信 用 貸 付       | 2,717,749             | 94.4  | 2,884,384 | 94.5  |
| そ の 他         | 18,452                | 0.6   | 20,880    | 0.7   |
| 一 般 貸 付 計     | 2,879,561             | 100.0 | 3,053,263 | 100.0 |
| うち劣後特約付貸付     | 285,000               | 9.9   | 288,000   | 9.4   |

### (6) 貸付金地域別内訳

(単位：百万円、%)

| 区 分   | 平成22年度<br>第2四半期(上半期)末 |       | 平成21年度末   |       |
|-------|-----------------------|-------|-----------|-------|
|       | 金 額                   | 占率    | 金 額       | 占率    |
| 北 海 道 | 33,848                | 1.2   | 36,859    | 1.3   |
| 東 北   | 57,367                | 2.1   | 62,673    | 2.1   |
| 関 東   | 1,783,755             | 64.6  | 1,882,013 | 64.2  |
| 中 部   | 210,173               | 7.6   | 232,664   | 7.9   |
| 近 畿   | 475,345               | 17.2  | 499,530   | 17.1  |
| 中 国   | 90,560                | 3.3   | 90,922    | 3.1   |
| 四 国   | 24,843                | 0.9   | 28,324    | 1.0   |
| 九 州   | 85,576                | 3.1   | 96,388    | 3.3   |
| 合 計   | 2,761,471             | 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<br>第2四半期(上半期)末 |      | 平成21年度末   |      |
|---------------|-----------------------|------|-----------|------|
|               | 金 額                   | 占率   | 金 額       | 占率   |
| 公 社 債         | 2,184,661             | 45.2 | 1,783,838 | 37.2 |
| 株 式 等         | 37,658                | 0.8  | 46,508    | 1.0  |
| 現 預 金 ・ そ の 他 | 41,188                | 0.9  | 48,784    | 1.0  |
| 外 貨 建 資 産 計   | 2,263,508             | 46.9 | 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22年度<br>第2四半期(上半期)末 |     | 平成21年度末 |     |
|--------------------------------|-----------------------|-----|---------|-----|
|                                | 金 額                   | 占率  | 金 額     | 占率  |
| 公 社 債                          | 337,012               | 7.0 | 389,874 | 8.1 |
| 現 預 金 ・ そ の 他                  | 22,998                | 0.5 | 28,000  | 0.6 |
| 円 貨 額 が 確 定 し た<br>外 貨 建 資 産 計 | 360,011               | 7.5 | 417,874 | 8.7 |

(ウ) 円貨建資産

(単位: 百万円、%)

| 区 分         | 平成22年度<br>第2四半期(上半期)末 |      | 平成21年度末   |      |
|-------------|-----------------------|------|-----------|------|
|             | 金 額                   | 占率   | 金 額       | 占率   |
| 非 居 住 者 貸 付 | 99,638                | 2.1  | 103,005   | 2.2  |
| 公 社 債       | 1,564,626             | 32.4 | 1,816,764 | 37.9 |
| 株 式 等       | 540,712               | 11.2 | 550,094   | 11.5 |
| そ の 他       | 2,483                 | 0.1  | 23,691    | 0.5  |
| 円 貨 建 資 産 計 | 2,207,460             | 45.7 | 2,493,555 | 52.1 |

(エ) 合計

(単位: 百万円、%)

| 区 分       | 平成22年度<br>第2四半期(上半期)末 |       | 平成21年度末   |       |
|-----------|-----------------------|-------|-----------|-------|
|           | 金 額                   | 占率    | 金 額       | 占率    |
| 海 外 投 融 資 | 4,830,980             | 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22年度第2四半期(上半期)末 |           |           |            | 平成21年度末 |           |           |            |         |
|-------|-------------------|-----------|-----------|------------|---------|-----------|-----------|------------|---------|
|       | 外国証券              | 公社債       | 株式等       | 非居住者<br>貸付 | 外国証券    | 公社債       | 株式等       | 非居住者<br>貸付 |         |
| 北 米   | 金額                | 824,368   | 823,564   | 804        | 8,139   | 779,676   | 778,867   | 809        | 8,139   |
|       | 占率                | 17.7      | 20.2      | 0.1        | 8.2     | 17.0      | 19.5      | 0.1        | 7.9     |
| ヨーロッパ | 金額                | 1,708,454 | 1,701,671 | 6,783      | 56,000  | 1,505,485 | 1,498,592 | 6,892      | 56,000  |
|       | 占率                | 36.6      | 41.6      | 1.2        | 56.2    | 32.8      | 37.6      | 1.2        | 54.4    |
| オセアニア | 金額                | 48,732    | 48,732    | -          | 5,000   | 45,770    | 45,770    | -          | 5,000   |
|       | 占率                | 1.0       | 1.2       | -          | 5.0     | 1.0       | 1.1       | -          | 4.9     |
| ア ジ ア | 金額                | 13,778    | -         | 13,778     | -       | 18,518    | 3,498     | 15,019     | 2,682   |
|       | 占率                | 0.3       | -         | 2.4        | -       | 0.4       | 0.1       | 2.5        | 2.6     |
| 中 南 米 | 金額                | 1,834,078 | 1,277,074 | 557,004    | 3,915   | 2,001,060 | 1,427,178 | 573,881    | 4,270   |
|       | 占率                | 39.3      | 31.3      | 96.3       | 3.9     | 43.6      | 35.8      | 96.2       | 4.1     |
| 中 東   | 金額                | -         | -         | -          | 128     | -         | -         | -          | 168     |
|       | 占率                | -         | -         | -          | 0.1     | -         | -         | -          | 0.2     |
| アフリカ  | 金額                | -         | -         | -          | 382     | -         | -         | -          | 420     |
|       | 占率                | -         | -         | -          | 0.4     | -         | -         | -          | 0.4     |
| 国際機関  | 金額                | 235,259   | 235,259   | -          | 26,073  | 236,569   | 236,569   | -          | 26,324  |
|       | 占率                | 5.0       | 5.8       | -          | 26.2    | 5.2       | 5.9       | -          | 25.6    |
| 合 計   | 金額                | 4,664,672 | 4,086,301 | 578,371    | 99,638  | 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22年度<br>第2四半期(上半期)末 |       | 平成21年度末   |       |
|-----------|-----------------------|-------|-----------|-------|
|           | 金 額                   | 占率    | 金 額       | 占率    |
| ユ ー ロ     | 1,166,099             | 51.5  | 1,020,022 | 54.3  |
| 米 ド ル     | 705,557               | 31.2  | 494,000   | 26.3  |
| 豪 ド ル     | 307,824               | 13.6  | 312,267   | 16.6  |
| 英 ポ ンド    | 70,354                | 3.1   | 37,930    | 2.0   |
| 中 国 元     | 11,251                | 0.5   | 12,262    | 0.7   |
| 韓 国 ウ ォ ン | 2,416                 | 0.1   | 2,649     | 0.1   |
| そ の 他     | 3                     | 0.0   | -         | -     |
| 合 計       | 2,263,508             | 100.0 | 1,879,131 | 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<br>第2四半期(上半期)末 |                    | 平成21年度末      |                    |
|-------------------|-----------------------|--------------------|--------------|--------------------|
|                   | 貸借対照表<br>計上額          | 当期の損益に含<br>まれた評価損益 | 貸借対照表<br>計上額 | 当期の損益に含<br>まれた評価損益 |
| 売 買 目 的 有 価 証 券 等 | 51,442                | 8,167              | 58,397       | 4,710              |

#### (2) 変額個人年金保険

(単位：百万円)

| 区 分               | 平成22年度<br>第2四半期(上半期)末 |                    | 平成21年度末      |                    |
|-------------------|-----------------------|--------------------|--------------|--------------------|
|                   | 貸借対照表<br>計上額          | 当期の損益に含<br>まれた評価損益 | 貸借対照表<br>計上額 | 当期の損益に含<br>まれた評価損益 |
| 売 買 目 的 有 価 証 券 等 | 2,264,922             | 90,131             | 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22年度第2四半期(上半期)末 |   |    |     |
|-----|--------|-------------------|---|----|-----|
|     |        | 契約額等              |   | 時価 | 差損益 |
|     |        | うち1年超             |   |    |     |
| 取引所 | 株価指数先物 |                   |   |    |     |
|     | 売建     | -                 | - | -  | -   |
|     | 買建     | 793               | - | 22 | 22  |
| 合計  |        |                   |   |    | 22  |

| 平成21年度末 |   |    |     |
|---------|---|----|-----|
| 契約額等    |   | 時価 | 差損益 |
| うち1年超   |   |    |     |
| 673     | - | 24 | 24  |
| -       | - | -  | -   |
| 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22年度第2四半期(上半期)末 |   |     |     |
|-----|--------|-------------------|---|-----|-----|
|     |        | 契約額等              |   | 時価  | 差損益 |
|     |        | うち1年超             |   |     |     |
| 取引所 | 株価指数先物 |                   |   |     |     |
|     | 売建     | -                 | - | -   | -   |
|     | 買建     | 19,530            | - | 563 | 563 |
| 合計  |        |                   |   |     | 563 |

| 平成21年度末 |   |     |     |
|---------|---|-----|-----|
| 契約額等    |   | 時価  | 差損益 |
| うち1年超   |   |     |     |
| 8,086   | - | 150 | 150 |
| -       | - | -   | -   |
| 合計      |   |     | 150 |

(通貨関連)

(単位：百万円)

| 区分 | 種類           | 平成22年度第2四半期(上半期)末 |   |     |     |     |
|----|--------------|-------------------|---|-----|-----|-----|
|    |              | 契約額等              |   | 時価  | 差損益 |     |
|    |              | うち1年超             |   |     |     |     |
| 店頭 | 為替予約         |                   |   |     |     |     |
|    | 売建           |                   |   |     |     |     |
|    | (米ドル)        | 53,313            | - | 583 | 583 |     |
|    | (ユーロ)        | 749               | - | 2   | 2   |     |
|    | (英ポンド)       | 546               | - | 0   | 0   |     |
|    | (豪ドル)        | 197               | - | 1   | 1   |     |
|    | (NZドル)       | 224               | - | 0   | 0   |     |
|    | (加ドル)        | 244               | - | 0   | 0   |     |
|    | (スウェーデンクローナ) | 93                | - | 0   | 0   |     |
|    | (デンマーククローネ)  | 30                | - | 0   | 0   |     |
|    | (ノルウェークローネ)  | 32                | - | 0   | 0   |     |
|    | 買建           | -                 | - | -   | -   |     |
|    | 合計           |                   |   |     |     | 578 |

| 平成21年度末 |   |     |     |
|---------|---|-----|-----|
| 契約額等    |   | 時価  | 差損益 |
| うち1年超   |   |     |     |
| 66,933  | - | 837 | 837 |
| -       | - | -   | -   |
| -       | - | -   | -   |
| -       | - | -   | -   |
| -       | - | -   | -   |
| -       | - | -   | -   |
| -       | - | -   | -   |
| -       | - | -   | -   |
| -       | - | -   | -   |
| -       | - | -   | -   |
| 合計      |   |     | 837 |

(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<br>第2四半期(上半期)末 |       | 平成21年度末    |       |
|------------|-----------------------|-------|------------|-------|
|            | 金 額                   | 占率    | 金 額        | 占率    |
| 現預金・コールローン | 427,905               | 1.8   | 346,141    | 1.5   |
| 買入金銭債権     | 421,850               | 1.8   | 462,598    | 2.0   |
| 有 価 証 券    | 17,899,617            | 75.6  | 17,116,912 | 74.4  |
| 公 社 債      | 10,201,612            | 43.1  | 9,212,802  | 40.0  |
| 株 式        | 1,748,556             | 7.4   | 1,964,122  | 8.5   |
| 外 国 証 券    | 5,182,804             | 21.9  | 5,139,021  | 22.3  |
| 公 社 債      | 4,403,619             | 18.6  | 4,325,734  | 18.8  |
| 株 式 等      | 779,185               | 3.3   | 813,286    | 3.5   |
| その他の証券     | 766,643               | 3.2   | 800,965    | 3.5   |
| 貸 付 金      | 3,261,504             | 13.8  | 3,443,887  | 15.0  |
| 保険約款貸付     | 381,943               | 1.6   | 390,623    | 1.7   |
| 一 般 貸 付    | 2,879,561             | 12.2  | 3,053,263  | 13.3  |
| 不 動 産      | 967,415               | 4.1   | 977,742    | 4.2   |
| う ち 投 資 用  | 725,897               | 3.1   | 735,640    | 3.2   |
| 繰延税金資産     | 327,584               | 1.4   | 303,203    | 1.3   |
| そ の 他      | 390,053               | 1.6   | 375,754    | 1.6   |
| 貸倒引当金      | 8,911                 | 0.0   | 7,923      | 0.0   |
| 会 社 計      | 23,687,020            | 100.0 | 23,018,316 | 100.0 |
| うち外貨建資産    | 2,777,451             | 11.7  | 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21年度<br>第2四半期（上半期） | 平成22年度<br>第2四半期（上半期） |
|------------|----------------------|----------------------|
|            | 金 額                  | 金 額                  |
| 現預金・コールローン | 22,775               | 81,763               |
| 買入金銭債権     | 17,700               | 40,748               |
| 有 価 証 券    | 709,789              | 782,705              |
| 公 社 債      | 175,865              | 988,809              |
| 株 式        | 235,547              | 215,565              |
| 外 国 証 券    | 176,113              | 43,783               |
| 公 社 債      | 29,871               | 77,884               |
| 株 式 等      | 205,984              | 34,101               |
| その他の証券     | 474,490              | 34,321               |
| 貸 付 金      | 261,156              | 182,382              |
| 保険約款貸付     | 14,366               | 8,680                |
| 一 般 貸 付    | 246,789              | 173,702              |
| 不 動 産      | 5,789                | 10,326               |
| う ち 投 資 用  | 3,718                | 9,743                |
| 繰延税金資産     | 107,833              | 24,380               |
| そ の 他      | 140,742              | 14,299               |
| 貸倒引当金      | 5,009                | 988                  |
| 会 社 計      | 184,182              | 668,703              |
| うち外貨建資産    | 22,517               | 360,954              |

(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年度第2四半期(上半期)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 | 2,910,065         | 84,963         | 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いますが、平成22年度第2四半期(上半期)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22年度第2四半期(上半期)末 |            |         |         |         | 平成21年度末    |            |         |         |         |
|------------|-------------------|------------|---------|---------|---------|------------|------------|---------|---------|---------|
|            | 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  | 2,057,902         | 2,122,817  | 64,914  | 67,303  | 2,388   | 2,227,110  | 2,215,247  | 11,863  | 21,015  | 32,878  |
| 責任準備金対応債券  | 8,035,626         | 8,581,472  | 545,846 | 547,493 | 1,647   | 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   | 4,456,053         | 4,480,014  | 23,961  | 228,562 | 204,601 | 4,282,786  | 4,352,545  | 69,758  | 225,140 | 155,382 |
| 公 社 債      | 731,995           | 750,204    | 18,209  | 22,163  | 3,953   | 800,567    | 801,836    | 1,268   | 9,915   | 8,646   |
| 株 式        | 1,094,500         | 1,040,214  | 54,286  | 109,327 | 163,613 | 1,105,836  | 1,164,082  | 58,245  | 167,203 | 108,957 |
| 外国証券       | 2,295,358         | 2,343,060  | 47,702  | 79,471  | 31,769  | 2,019,909  | 2,025,790  | 5,881   | 39,589  | 33,708  |
| 公 社 債      | 2,266,304         | 2,317,187  | 50,883  | 79,434  | 28,550  | 1,972,184  | 1,982,697  | 10,512  | 39,530  | 29,018  |
| 株 式 等      | 29,054            | 25,873     | 3,181   | 36      | 3,218   | 47,724     | 43,093     | 4,631   | 58      | 4,690   |
| その他の証券     | 36,440            | 33,688     | 2,752   | 2,510   | 5,263   | 31,442     | 31,223     | 219     | 3,509   | 3,728   |
| 買入金銭債権     | 285,758           | 300,848    | 15,090  | 15,090  | -       | 313,030    | 317,613    | 4,582   | 4,922   | 340     |
| 譲渡性預金      | 12,000            | 11,998     | 1       | -       | 1       | 12,000     | 11,999     | 0       | -       | 0       |
| そ の 他      | -                 | -          | -       | -       | -       | -          | -          | -       | -       | -       |
| 合 計        | 14,549,582        | 15,184,304 | 634,722 | 843,360 | 208,637 | 13,549,040 | 13,739,708 | 190,667 | 399,274 | 208,606 |
| 公 社 債      | 9,056,410         | 9,638,291  | 581,880 | 585,848 | 3,968   | 8,059,041  | 8,206,367  | 147,326 | 173,624 | 26,297  |
| 株 式        | 1,094,500         | 1,040,214  | 54,286  | 109,327 | 163,613 | 1,105,836  | 1,164,082  | 58,245  | 167,203 | 108,957 |
| 外国証券       | 4,064,472         | 4,159,263  | 94,791  | 130,582 | 35,791  | 4,027,689  | 4,008,422  | 19,267  | 50,014  | 69,282  |
| 公 社 債      | 4,035,417         | 4,133,390  | 97,973  | 130,545 | 32,572  | 3,979,965  | 3,965,328  | 14,636  | 49,955  | 64,592  |
| 株 式 等      | 29,054            | 25,873     | 3,181   | 36      | 3,218   | 47,724     | 43,093     | 4,631   | 58      | 4,690   |
| その他の証券     | 36,440            | 33,688     | 2,752   | 2,510   | 5,263   | 31,442     | 31,223     | 219     | 3,509   | 3,728   |
| 買入金銭債権     | 285,758           | 300,848    | 15,090  | 15,090  | -       | 313,030    | 317,613    | 4,582   | 4,922   | 340     |
| 譲渡性預金      | 12,000            | 11,998     | 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年度第2四半期(上半期)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         | 79,897            | 62,415  |
| その他の有価証券           | 649,796           | 649,743 |
| 非上場国内株式(店頭売買株式を除く) | 94,993            | 95,149  |
| 非上場外国株式(店頭売買株式を除く) | 552,626           | 552,626 |
| 非上場外国債券            | -                 | -       |
| そ の 他              | 2,177             | 1,968   |
| 合 計                | 729,694           | 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22年度第2四半期(上半期)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22年度第2四半期(上半期)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（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21年9月末   | 平成22年9月末 | 平成21年9月末 | 平成22年9月末 |
| 金利スワップ      | 914        | 1,206    | 35       | 47       |
| 為替予約        | 25,135     | 26,823   | 1,858    | 1,916    |
| 通貨オプション(買建) | 346        | 814      | 83       | 108      |
| 株式オプション(買建) | 2,958      | 2,325    | 316      | 261      |
| 合計          |            |          | 2,153    | 1,996    |

(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年度第2四半期(上半期)末 |         |       |      |     |         | 平成21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  | 3,803             | 97,138  | -     | -    | -   | 100,941 | 2,895   | 56,107 | -      | -    | -   | 59,002 |
| ヘッジ会計非適用分 | 220               | 3,284   | 3,775 | 426  | -   | 284     | -       | 1,591  | 20,707 | -    | -   | 19,116 |
| 合 計       | 3,582             | 100,422 | 3,775 | 426  | -   | 100,656 | 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22年度第2四半期(上半期)末通貨関連 56,136百万円、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)

(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<br>第2四半期(上半期)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 | 金利スワップ<br>固定金利支払/変動金利受取 | 34,500                | 34,500 | 220 | 220 | -       | - | -  | -   |
|    | 合 計                     |                       |        |     | 220 |         |   |    | -   |

(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<br>第2四半期(上半期)末 |        |       | 平成21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<br>固定金利受取/変動金利支払 | 貸付金     | 15,472                | 15,472 | 320   | 15,472  | 15,472 | 381   |
|          | 固定金利支払/変動金利受取           |         | 26                    | -      | 0     | 110     | -      | 0     |
| 特例処理     | 固定金利受取/変動金利支払           | 貸付金     | 67,809                | 62,045 | 3,492 | 70,278  | 65,364 | 2,528 |
|          | 固定金利支払/変動金利受取           |         | 2,869                 | 1,051  | 9     | 4,137   | 1,848  | 14    |
|          | 合 計                     |         |                       | 3,803  |       |         | 2,895  |       |

(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年度第2四半期(上半期)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      | 779,622           | 4,837  | 1,932  | 1,932   | 948,019 | 30,265 | 476    | 476    |
|     | (ユーロ)   | 386,598           | 2,738  | 8,209  | 8,209   | 477,400 | -      | 12,758 | 12,758 |
|     | (米ドル)   | 339,050           | -      | 12,069 | 12,069  | 402,171 | 8,052  | 6,978  | 6,978  |
|     | (豪ドル)   | 51,851            | 2,098  | 1,919  | 1,919   | 68,201  | 22,212 | 6,245  | 6,245  |
|     | 買建      | -                 | -      | -      | -       | 89,675  | -      | 2,301  | 2,301  |
|     | (ユーロ)   | -                 | -      | -      | -       | 47,607  | -      | 1,023  | 1,023  |
|     | (米ドル)   | -                 | -      | -      | -       | 42,067  | -      | 1,278  | 1,278  |
|     | 通貨オプション |                   |        |        |         |         |        |        |        |
|     | 買建      |                   |        |        |         |         |        |        |        |
|     | コール     | -                 | -      | -      | -       | 18,320  | -      | -      | -      |
|     | (米ドル)   | (-)               | -      | -      | -       | (692)   | -      | 350    | 342    |
|     | プット     | 81,445            | 39,707 | -      | -       | 39,707  | 39,707 | -      | -      |
|     | (米ドル)   | (7,102)           | -      | 8,453  | 1,351   | (6,304) | -      | 6,413  | 108    |
|     |         | 81,445            | 39,707 | 8,453  | 1,351   | 39,707  | 39,707 | 6,413  | 108    |
|     | (7,102) | -                 | 8,453  | 1,351  | (6,304) | -       | 6,413  | 108    |        |
| 合 計 |         |                   |        | 3,284  |         |         |        | 1,591  |        |

(注)1.( )内には、オプション料を記載しています。

2. 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。

(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年度第2四半期(上半期)末 |         |        | 平成21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     |         | 1,519,296         | 430,601 | 56,136 | 1,163,717 | 391,764 | 25,912 |
|          | (ユーロ)  |         | 775,873           | 121,425 | 34,267 | 611,201   | 104,808 | 26,095 |
|          | (米ドル)  |         | 399,514           | 34,955  | 18,865 | 225,747   | -       | 5,357  |
|          | (豪ドル)  |         | 274,221           | 274,221 | 2,992  | 286,956   | 286,956 | 2,973  |
|          | (英ポンド) | 69,688  | -                 | 10      | 39,811 | -         | 2,200   |        |
| 振当処理     | 売建     | 外貨建資産   | 383,391           | 339,488 | 41,002 | 448,070   | 387,335 | 30,195 |
|          | (米ドル)  |         | 205,303           | 161,400 | 29,071 | 263,263   | 202,528 | 19,359 |
|          | (豪ドル)  |         | 178,088           | 178,088 | 11,930 | 184,807   | 184,807 | 10,836 |
| 合 計      |        |         |                   | 97,138  |        |           | 56,107  |        |

(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年度第2四半期(上半期)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        | 72,647            | -      | 1,646 | 1,646 | 8,760    | -      | 174   | 174    |
|     | 買建        | 23,307            | -      | 585   | 585   | 1,900    | -      | 93    | 93     |
| 店頭  | 株価指数オプション |                   |        |       |       |          |        |       |        |
|     | 売建        |                   |        |       |       |          |        |       |        |
|     | コール       | 148,500           | -      | 0     | 209   | (-)      | -      | -     | -      |
|     |           | (209)             |        |       |       |          |        |       |        |
|     | 買建        | 69,350            | -      | 3,913 | 608   | (-)      | -      | -     | -      |
|     | (3,304)   |                   |        |       |       |          |        |       |        |
|     | プット       | 163,150           | 34,000 | 7,606 | 3,532 | 270,375  | 34,000 | 4,282 | 20,626 |
|     |           | (11,138)          |        |       |       | (24,908) |        |       |        |
|     | 合計        |                   |        |       | 3,775 |          |        |       | 20,707 |

(注)1. 括弧内には、オプション料を記載しています。

2. 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。

(ヘッジ会計が適用されているもの)

平成22年度第2四半期(上半期)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。

(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年度第2四半期(上半期)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 | 債券店頭オプション取引 |                   |   |    |     |         |   |    |     |
|    | 売建          |                   |   |    |     |         |   |    |     |
|    | プット         | 74,366            | - | 34 | 426 | (-)     | - | -  | -   |
|    |             | (461)             |   |    |     |         |   |    |     |
|    | 合計          |                   |   |    | 426 |         |   |    | -   |

(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、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年度第2四半期(上半期)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。