

平成24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23年度末		平成24年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
国 債	7,438,011	46.4	8,312,179	49.8
地 方 債	216,051	1.3	190,278	1.1
社 債	2,769,338	17.3	2,713,891	16.3
うち公社・公団債	1,843,143	11.5	1,894,698	11.4
株 式	906,828	5.7	774,635	4.6
外 国 証 券	4,656,121	29.1	4,661,152	27.9
公 社 債	4,105,179	25.6	4,118,348	24.7
うち外貨建	2,385,387	14.9	2,485,854	14.9
株 式 等	550,941	3.4	542,804	3.3
うち外貨建	44,408	0.3	36,602	0.2
そ の 他 の 証 券	36,456	0.2	33,409	0.2
合 計	16,022,808	100.0	16,685,547	100.0
うち外貨建	2,457,174	15.3	2,548,862	15.3

(2) 地域別地方債保有内訳

(単位：百万円)

区 分	平成23年度末	平成24年度 第2四半期(上半期)末
北 海 道	2,387	285
東 北	650	-
関 東	100,991	87,923
中 部	47,011	43,994
近 畿	28,310	23,824
中 国	17,544	15,226
四 国	359	361
九 州	18,796	18,661
合 計	216,051	190,278

(3) 有価証券残存期間別残高

<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
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

<平成24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
有 価 証 券	577,496	1,515,103	1,625,303	1,096,250	1,475,102	9,023,172	1,373,120	16,685,547
国 債	108,843	206,658	422,182	143,905	466,347	6,964,242	-	8,312,179
地 方 債	70,695	104,244	7,605	5,075	-	2,657	-	190,278
社 債	212,346	686,278	417,636	195,881	141,233	1,038,073	22,441	2,713,891
株 式							774,635	774,635
外 国 証 券	185,471	517,921	777,879	751,387	867,521	1,018,198	542,773	4,661,152
公 社 債	185,471	517,890	777,879	751,387	867,521	1,018,198	-	4,118,348
株 式 等	-	30	-	-	-	-	542,773	542,804
その他の証券	139	-	-	-	-	-	33,270	33,409
買入金銭債権	-	-	3,669	-	-	252,711	-	256,380
譲渡性預金	43,996	-	-	-	-	-	-	43,996
そ の 他	-	-	-	-	-	-	-	-
合 計	621,492	1,515,103	1,628,972	1,096,250	1,475,102	9,275,883	1,373,120	16,985,924

(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23年度末		平成24年度 第2四半期(上半期)末	
		金 額	占率	金 額	占率
水産・農林業		157	0.0	125	0.0
鉱業		101	0.0	156	0.0
建設業		26,625	2.9	25,882	3.3
製 造 業	食料品	26,883	3.0	27,131	3.5
	繊維製品	6,346	0.7	5,558	0.7
	パルプ・紙	5,322	0.6	3,588	0.5
	化学	77,485	8.5	60,574	7.8
	医薬品	39,677	4.4	39,849	5.1
	石油・石炭製品	4,815	0.5	3,624	0.5
	ゴム製品	3,850	0.4	3,560	0.5
	ガラス・土石製品	10,514	1.2	8,811	1.1
	鉄鋼	23,412	2.6	15,428	2.0
	非鉄金属	28,566	3.2	22,631	2.9
	金属製品	4,660	0.5	4,281	0.6
	機械	54,442	6.0	43,494	5.6
	電気機器	112,049	12.4	84,785	10.9
	輸送用機器	35,820	4.0	20,379	2.6
	精密機器	5,283	0.6	4,994	0.6
	その他製品	16,420	1.8	14,423	1.9
電気・ガス業		25,660	2.8	21,818	2.8
運 輸 ・ 情 報 通 信 業	陸運業	71,260	7.9	69,902	9.0
	海運業	4,875	0.5	2,425	0.3
	空運業	2,775	0.3	1,940	0.3
	倉庫・運輸関連業	5,610	0.6	5,097	0.7
	情報・通信業	5,507	0.6	5,955	0.8
商 業	卸売業	67,506	7.4	58,603	7.6
	小売業	15,247	1.7	13,792	1.8
金 融 ・ 保 険 業	銀行業	134,318	14.8	117,084	15.1
	証券、商品先物取引業	5,730	0.6	4,814	0.6
	保険業	42,364	4.7	40,147	5.2
	その他金融業	1,680	0.2	1,730	0.2
不動産業		8,281	0.9	8,426	1.1
サービス業		33,574	3.7	33,612	4.3
合 計		906,828	100.0	774,635	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23年度末	平成24年度 第2四半期(上半期)末
保 険 約 款 貸 付	359,161	351,042
契 約 者 貸 付	325,323	318,558
保 険 料 振 替 貸 付	33,838	32,484
一 般 貸 付	2,528,286	2,465,032
(うち非居住者貸付)	(74,957)	(69,382)
企 業 貸 付	2,450,583	2,391,271
(うち国内企業向け)	(2,425,467)	(2,371,549)
国・国際機関・政府関係機関貸付	22,461	21,977
公 共 団 体 ・ 公 企 業 貸 付	42,024	40,223
住 宅 ロ ー ン	9,569	8,682
消 費 者 ロ ー ン	3,310	2,559
そ の 他	337	318
合 計	2,887,447	2,816,074

(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23年度末		平成24年度 第2四半期(上半期)末	
		占率		占率
大 企 業	貸付先数	263	253	69.5
	金額	2,197,074	2,152,954	90.8
中 堅 企 業	貸付先数	5	5	1.4
	金額	11,865	11,832	0.5
中 小 企 業	貸付先数	113	106	29.1
	金額	216,528	206,763	8.7
国内企業向け 貸付計	貸付先数	381	364	100.0
	金額	2,425,467	2,371,549	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

<平成24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	4,622	32,485	26,953	60,523	75,629	17,115	118,000	335,330
固 定 金 利	284,037	536,715	608,972	371,434	248,234	80,307	-	2,129,701
一 般 貸 付 計	288,659	569,200	635,926	431,958	323,864	97,423	118,000	2,465,032

(5) 貸付金担保別内訳

(単位：百万円、%)

区 分	平成23年度末		平成24年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
担 保 貸 付	1,721	0.1	1,523	0.1
有 価 証 券 担 保 貸 付	1,224	0.0	1,073	0.0
不 動 産 ・ 動 産 ・ 財 団 担 保 貸 付	451	0.0	407	0.0
指 名 債 権 担 保 貸 付	45	0.0	42	0.0
保 証 貸 付	96,919	3.8	89,876	3.6
信 用 貸 付	2,416,765	95.6	2,362,391	95.8
そ の 他	12,880	0.5	11,241	0.5
一 般 貸 付 計	2,528,286	100.0	2,465,032	100.0
う ち 劣 後 特 約 付 貸 付	263,000	10.4	263,000	10.7

(6) 貸付金地域別内訳

(単位：百万円、%)

区 分	平成23年度末		平成24年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
北 海 道	22,527	0.9	21,880	0.9
東 北	51,584	2.1	51,189	2.1
関 東	1,592,676	65.3	1,607,433	67.4
中 部	171,362	7.0	161,190	6.8
近 畿	424,228	17.4	367,063	15.4
中 国	88,191	3.6	87,401	3.7
四 国	23,041	0.9	22,573	0.9
九 州	66,836	2.7	65,675	2.8
合 計	2,440,448	100.0	2,384,408	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23年度末		平成24年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
公 社 債	2,412,766	49.9	2,512,259	52.2
株 式 等	44,408	0.9	36,602	0.8
現 預 金 ・ そ の 他	41,377	0.9	37,021	0.8
外 貨 建 資 産 計	2,498,552	51.7	2,585,883	53.7

(イ) 円貨額が確定した外貨建資産

(単位：百万円、%)

区 分	平成23年度末		平成24年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
公 社 債	291,216	6.0	224,770	4.7
現 預 金 ・ そ の 他	22,999	0.5	19,999	0.4
円 貨 額 が 確 定 し た 外 貨 建 資 産 計	314,215	6.5	244,769	5.1

(ウ) 円貨建資産

(単位：百万円、%)

区 分	平成23年度末		平成24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	74,957	1.6	69,382	1.4
公 社 債	1,428,575	29.6	1,407,723	29.2
株 式 等	506,533	10.5	506,202	10.5
そ の 他	10,118	0.2	1,622	0.0
円 貨 建 資 産 計	2,020,185	41.8	1,984,930	41.2

(エ) 合計

(単位：百万円、%)

区 分	平成23年度末		平成24年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
海 外 投 融 資	4,832,952	100.0	4,815,583	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23年度末				平成24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	702,431	701,631	799	5,000	545,493	544,702	791	5,000
	占率	15.1	17.1	0.1	6.7	11.7	13.2	0.1	7.2
ヨーロッパ	金額	1,652,438	1,645,605	6,833	42,000	1,758,442	1,755,890	2,552	37,000
	占率	35.5	40.1	1.2	56.0	37.7	42.6	0.5	53.3
オセアニア	金額	225,762	225,762	-	5,000	208,072	208,072	-	5,000
	占率	4.8	5.5	-	6.7	4.5	5.1	-	7.2
ア ジ ア	金額	28,607	-	28,607	-	26,638	-	26,638	-
	占率	0.6	-	5.2	-	0.6	-	4.9	-
中 南 米	金額	1,711,367	1,196,666	514,700	2,848	1,709,309	1,196,487	512,822	2,492
	占率	36.8	29.2	93.4	3.8	36.7	29.1	94.5	3.6
中 東	金額	-	-	-	6	-	-	-	1
	占率	-	-	-	0.0	-	-	-	0.0
ア フ リ カ	金額	-	-	-	267	-	-	-	229
	占率	-	-	-	0.4	-	-	-	0.3
国際機関	金額	335,513	335,513	-	19,835	413,195	413,195	-	19,659
	占率	7.2	8.2	-	26.5	8.9	10.0	-	28.3
合 計	金額	4,656,121	4,105,179	550,941	74,957	4,661,152	4,118,348	542,804	69,382
	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23年度末		平成24年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
ユ ー ロ	871,122	34.9	933,719	36.1
豪 ド ル	703,501	28.2	808,880	31.3
米 ド ル	824,206	33.0	748,345	28.9
英 ポ ンド	71,214	2.9	68,407	2.6
中 国 元	26,516	1.1	24,886	1.0
韓 国 ウ ォ ン	1,984	0.1	1,640	0.1
そ の 他	7	0.0	4	0.0
合 計	2,498,552	100.0	2,585,883	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23年度末		平成24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	50,083	△5,064	45,078	△7,453

(2) 変額個人年金保険

(単位：百万円)

区 分	平成23年度末		平成24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	2,210,515	△13,329	2,116,331	△65,705

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23年度末			平成24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	609	-	34	34	1,546	-	39	
	合 計							39	

(通貨関連)

(単位：百万円)

区分	種 類	平成23年度末			平成24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	-	-	-	-	111	-	0	
	(米ドル)	-	-	-	-	111	-	0	
	買建	-	-	-	-	114	-	△0	
	(米ドル)	-	-	-	-	114	-	△0	
	合 計							△0	

(注) 外貨建金銭債権債務等に為替予約が付されていることにより、決済時における円貨額が確定している外貨建金銭債権債務等で、貸借対照表において当該円貨額で表示されているものについては、開示の対象より除いています。

(2) 変額個人年金保険

(株式関連)

(単位：百万円)

区分	種 類	平成23年度末			平成24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	25,243	-	1,470	1,470	17,953	-	574	
	合 計							574	

(通貨関連)

(単位：百万円)

区分	種 類	平成23年度末			平成24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	-	-	-	-	3,371	-	4	
	(米ドル)	-	-	-	-	3,371	-	4	
	買建	-	-	-	-	3,377	-	△4	
	(米ドル)	-	-	-	-	3,377	-	△4	
	合 計							△0	

(注) 外貨建金銭債権債務等に為替予約が付されていることにより、決済時における円貨額が確定している外貨建金銭債権債務等で、貸借対照表において当該円貨額で表示されているものについては、開示の対象より除いています。

3. 会社計

a. 資産の構成（会社計）

（1）資産の構成

（単位：百万円、％）

区 分	平成23年度末		平成24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	484,269	2.0	655,113	2.7
買入金銭債権	353,742	1.5	313,467	1.3
有 価 証 券	18,843,387	78.6	19,369,421	78.7
公 社 債	11,589,212	48.4	12,363,084	50.3
株 式	1,438,948	6.0	1,274,539	5.2
外 国 証 券	5,092,508	21.3	5,044,266	20.5
公 社 債	4,342,927	18.1	4,343,042	17.7
株 式 等	749,581	3.1	701,223	2.9
そ の 他 の 証 券	722,717	3.0	687,531	2.8
貸 付 金	2,887,447	12.0	2,816,074	11.4
保 険 約 款 貸 付	359,161	1.5	351,042	1.4
一 般 貸 付	2,528,286	10.6	2,465,032	10.0
不 動 産	903,609	3.8	876,498	3.6
う ち 投 資 用	671,810	2.8	648,838	2.6
繰延税金資産	210,683	0.9	234,363	1.0
そ の 他	283,961	1.2	340,534	1.4
貸倒引当金	△4,057	△0.0	△3,635	△0.0
会 社 計	23,963,043	100.0	24,601,839	100.0
う ち 外 貨 建 資 産	2,938,648	12.3	2,974,235	12.1

（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23年度 第2四半期（上半期）	平成24年度 第2四半期（上半期）
	金 額	金 額
現預金・コールローン	△86,054	170,844
買入金銭債権	△16,061	△40,275
有 価 証 券	163,455	526,034
公 社 債	720,847	773,871
株 式	△290,574	△164,408
外 国 証 券	△210,792	△48,242
公 社 債	△125,903	115
株 式 等	△84,889	△48,357
そ の 他 の 証 券	△56,024	△35,186
貸 付 金	△172,818	△71,372
保 険 約 款 貸 付	△7,789	△8,118
一 般 貸 付	△165,028	△63,254
不 動 産	△15,290	△27,111
う ち 投 資 用	△12,661	△22,972
繰延税金資産	△26,182	23,680
そ の 他	101,396	56,572
貸倒引当金	3,620	422
会 社 計	△47,935	638,795
う ち 外 貨 建 資 産	△65,748	35,587

（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23年度末		平成24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	2,820,578	55,959	2,688,916	△72,848

(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23年度末、平成24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23年度末					平成24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	1,961,880	2,030,383	68,503	69,972	△1,469	1,834,482	1,922,692	88,210	88,826	△616
責任準備金対応債券	9,368,136	9,882,655	514,519	522,706	△8,187	10,202,677	10,870,789	668,112	675,216	△7,104
子会社・関連会社株式	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他有価証券	4,245,609	4,399,505	153,896	260,300	△106,403	4,242,397	4,341,716	99,318	258,755	△159,437
公 社 債	696,718	717,872	21,154	22,392	△1,238	703,712	718,622	14,910	16,509	△1,599
株 式	800,682	836,448	35,765	121,254	△85,488	742,943	700,011	△42,931	81,278	△124,209
外 国 証 券	2,412,211	2,498,033	85,821	100,852	△15,031	2,475,446	2,589,945	114,498	142,323	△27,824
公 社 債	2,392,962	2,480,691	87,729	100,507	△12,778	2,462,021	2,578,916	116,895	142,163	△25,268
株 式 等	19,249	17,341	△1,908	345	△2,253	13,425	11,029	△2,396	159	△2,555
その他の証券	37,152	35,904	△1,247	3,382	△4,629	34,555	32,758	△1,796	4,002	△5,799
買入金銭債権	264,844	277,249	12,404	12,418	△13	241,739	256,380	14,640	14,640	-
譲渡性預金	34,000	33,997	△2	-	△2	44,000	43,996	△3	-	△3
そ の 他	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
合 計	15,575,626	16,312,544	736,918	852,978	△116,060	16,279,557	17,135,198	855,640	1,022,799	△167,158
公 社 債	10,402,246	10,951,216	548,970	557,475	△8,505	11,201,440	11,899,142	697,702	705,759	△8,057
株 式	800,682	836,448	35,765	121,254	△85,488	742,943	700,011	△42,931	81,278	△124,209
外 国 証 券	4,036,700	4,177,728	141,027	158,449	△17,421	4,014,878	4,202,907	188,029	217,118	△29,088
公 社 債	4,017,450	4,160,386	142,936	158,103	△15,167	4,001,452	4,191,878	190,425	216,958	△26,533
株 式 等	19,249	17,341	△1,908	345	△2,253	13,425	11,029	△2,396	159	△2,555
その他の証券	37,152	35,904	△1,247	3,382	△4,629	34,555	32,758	△1,796	4,002	△5,799
買入金銭債権	264,844	277,249	12,404	12,418	△13	241,739	256,380	14,640	14,640	-
譲渡性預金	34,000	33,997	△2	-	△2	44,000	43,996	△3	-	△3
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23年度末	平成24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	44,854	44,542
その他有価証券	559,300	558,682
非上場国内株式(店頭売買株式を除く)	26,189	25,702
非上場外国株式(店頭売買株式を除く)	532,480	532,283
非上場外国債券	-	-
そ の 他	630	696
合 計	604,155	603,224

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23年度末、平成24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23年度末、平成24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. リスク管理規定

「資産運用リスク管理方針」及び「資産運用リスク管理規程」において、デリバティブ取引についての利用目的、取組対象、及びリスク管理体制等を規定しています。また、資産運用部門の細則等において、各部それぞれの役割に応じた具体的な取組みを規定しています。

エ. リスク管理

ヘッジ取引を行う場合は、ヘッジ対象である原資産とヘッジ手段としてのデリバティブ取引をあわせてリスクを定量的に把握・分析・管理しています。

ヘッジ取引に該当しない取引を行う場合は、取引限度額、許容リスク量を設定するとともにロス・カット・ルールを策定し、ポジション状況、リスク状況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9月末	平成24年9月末	平成23年9月末	平成24年9月末
金 利 ス ワ ッ プ	1,258	1,032	42	35
為 替 予 約	28,669	26,841	2,424	1,168
通貨オプション(買建)	1,233	397	213	98
債券オプション(買建)	551	490	9	2
株式オプション(買建)	2,345	1,834	232	164
合 計			2,839	602

(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23年度末						平成24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	2,966	△79,272	-	-	-	△76,306	2,948	△21,202	-	-	-	△18,253
ヘッジ会計非適用分	△250	△29,641	△5,832	465	-	△35,258	△288	4,921	△3,914	86	-	805
合 計	2,715	△108,913	△5,832	465	-	△111,564	2,660	△16,280	△3,914	86	-	△17,448

(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23年度末通貨関連 △93,225百万円、平成24年度第2四半期(上半期)末通貨関連 △28,330百万円となっています。

(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23年度末			平成24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	△250	△250	34,500	34,500	△288	△288
	合 計				△250				△288

(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23年度末			平成24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	貸付金						
	固定金利受取/変動金利支払		10,000	-	89	10,000	-	54
	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	62,369	58,142	2,877	58,566	53,919	2,893
	固定金利支払/変動金利受取		464	62	△1	197	-	△0
	合 計				2,966		2,948	

(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23年度末				平成24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	767,930	32,179	△33,644	△33,644	678,288	78,469	3,191	3,191
	(米ドル)	289,502	-	△7,612	△7,612	261,272	-	5,753	5,753
	(ユーロ)	251,282	-	△8,073	△8,073	240,143	9,048	7,118	7,118
	(豪ドル)	225,522	32,179	△17,963	△17,963	176,352	69,420	△9,674	△9,674
	買建	28,274	-	△178	△178	12,957	-	156	156
	(ユーロ)	5,012	-	△27	△27	8,263	-	160	160
	(米ドル)	22,592	-	△149	△149	4,693	-	△3	△3
	通貨オプション								
	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	39,707	39,707	-	-	39,707	39,707	-	-
(6,304)			6,967	662	(6,304)		7,878	1,573	
(米ドル)	39,707	39,707	-	-	39,707	39,707	-	-	
(6,304)			6,967	662	(6,304)		7,878	1,573	
合 計				△29,641				4,921	

(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、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23年度末			平成24年度第2四半期(上半期)末		
			契約額等		時価	契約額等		時価
			うち1年超			うち1年超		
時価ヘッジ	為替予約							
	売建	外貨建資産	1,569,215	457,857	△93,225	1,747,179	414,438	△28,330
	(ユーロ)		580,503	74,982	△29,556	694,264	114,836	9,167
	(豪ドル)		416,395	382,875	△38,969	513,830	299,601	△45,109
	(米ドル)		506,742	-	△18,968	472,848	-	9,168
振当処理	売建	外貨建資産	322,528	256,055	13,953	245,711	143,884	7,127
	(豪ドル)		165,699	165,699	△8,618	156,184	97,150	△9,300
	(米ドル)		156,829	90,355	22,571	89,527	46,733	16,428
合 計				△79,272			△21,202	

(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23年度末			平成24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	16,019	-	△6	△6	4,823	-	△86	
	買建	30,379	-	1,726	1,726	22,832	-	610	
店頭	株価指数オプション								
	買建								
	ブット	183,400 (11,203)	34,000	3,650	△7,553	183,400 (9,242)	34,000	4,803 △4,438	
合 計					△5,832			△3,914	

- (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23年度末、平成24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23年度末			平成24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	85,203	-	49	49	-	-	-	
店頭	債券店頭オプション取引								
	売建								
	コール	78,077 (1,175)	-	699	476	24,978 (307)	-	157 150	
	ブット	- (-)	-	-	-	24,023 (311)	-	72 239	
	買建								
	コール	- (-)	-	-	-	24,978 (109)	-	157 48	
ブット	78,077 (1,421)	-	1,362	△59	24,023 (423)	-	72 △351		
合 計					465			86	

- (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23年度末、平成24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。