

## 平成18年度決算関係補足資料

. 一般勘定		
1. 商品有価証券関係		
(1) 商品有価証券明細表	. . . . .	2 頁
(2) 商品有価証券売買高	. . . . .	2 頁
2. 有価証券関係		
(1) 有価証券明細表	. . . . .	2 頁
(2) 地域別地方債保有内訳	. . . . .	2 頁
(3) 有価証券残存期間別残高	. . . . .	3 頁
(4) 業種別国内株式保有明細表	. . . . .	4 頁
3. 貸付金関係		
(1) 貸付金明細表	. . . . .	5 頁
(2) 貸付金残存期間別残高	. . . . .	5 頁
(3) 貸付金企業規模別内訳	. . . . .	5 頁
(4) 貸付金業種別内訳	. . . . .	6 頁
(5) 貸付金地域別内訳	. . . . .	7 頁
(6) 貸付金担保別内訳	. . . . .	7 頁
4. 海外投融資関係		
(1) 資産別明細	. . . . .	8 頁
(2) 外貨建資産の通貨別構成	. . . . .	8 頁
(3) 海外投融資の地域別構成	. . . . .	9 頁
5. デリバティブ取引の時価情報	. . . . .	10 頁
. 特別勘定(個人変額保険・個人変額年金保険)		
1. デリバティブ取引の時価情報(個人変額保険)	. . . . .	13 頁
2. デリバティブ取引の時価情報(個人変額年金保険)	. . . . .	14 頁
. 会社計		
1. 資産構成		
(1) 資産の構成	. . . . .	15 頁
(2) 資産の増減	. . . . .	15 頁
2. 有価証券等の時価情報		
(1) 売買目的有価証券の評価損益	. . . . .	16 頁
(2) 有価証券の時価情報	. . . . .	16 頁
(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)		
(3) 金銭の信託の時価情報	. . . . .	17 頁
(4) デリバティブ取引の運用状況	. . . . .	18 頁
(5) デリバティブ取引の時価情報	. . . . .	20 頁
. 貸倒引当金の明細	. . . . .	23 頁

．一般勘定

1．商品有価証券関係（一般勘定）

（1）商品有価証券明細表（一般勘定）

（単位：百万円、％）

区 分	平成17年度末		平成18年度末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
商 品 国 債	-	-	-	-
商 品 地 方 債	-	-	-	-
商 品 政 府 保 証 債	-	-	-	-
合 計	-	-	-	-

（2）商品有価証券売買高（一般勘定）

（単位：百万円）

区 分	平成17年度	平成18年度
商 品 国 債	-	-
商 品 地 方 債	-	-
商 品 政 府 保 証 債	-	-
合 計	-	-

2．有価証券関係（一般勘定）

（1）有価証券明細表（一般勘定）

（単位：百万円、％）

区 分	平成17年度末		平成18年度末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
国 債	6,920,000	30.9	8,540,850	35.3
地 方 債	785,666	3.5	567,153	2.3
社 債	2,780,654	12.4	2,812,672	11.6
うち公社・公団債	1,224,273	5.5	1,251,598	5.2
株 式	5,784,498	25.8	6,122,218	25.3
外 国 証 券	5,828,533	26.0	5,799,318	24.0
公 社 債	4,958,780	22.1	4,483,135	18.5
株 式 等	869,753	3.9	1,316,183	5.4
そ の 他 の 証 券	311,257	1.4	368,939	1.5
合 計	22,410,612	100.0	24,211,152	100.0

（2）地域別地方債保有内訳（一般勘定）

（単位：百万円）

区 分	平成17年度末	平成18年度末
	金 額	金 額
北 海 道	33,199	23,575
東 北	8,157	2,359
関 東	331,405	256,338
中 部	95,017	62,557
近 畿	135,747	77,895
中 国	19,062	8,762
四 国	8,835	4,679
九 州	49,205	39,541
そ の 他	105,036	91,443
合 計	785,666	567,153

（注）上表の「その他」は共同発行市場公募地方債の残高です。

## (3) 有価証券残存期間別残高(一般勘定)

(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 ないものを 含む)	合 計
平成 17 年度 末	国 債	235,429	167,660	840,931	543,638	1,469,346	3,662,995	6,920,000
	地 方 債	81,947	175,178	149,419	76,126	281,754	21,238	785,666
	社 債	177,307	556,630	574,509	431,643	801,674	238,889	2,780,654
	株 式	-	-	-	-	-	5,784,498	5,784,498
	外 国 証 券	245,905	1,075,021	778,027	676,103	725,767	2,327,707	5,828,533
	公 社 債	245,905	1,075,021	778,027	676,103	725,767	1,457,954	4,958,780
	株 式 等	-	-	-	-	-	869,753	869,753
	そ の 他 の 証 券	259	9,149	10,271	120,769	12,981	157,826	311,257
	合 計	740,849	1,983,641	2,353,159	1,848,281	3,291,524	12,193,156	22,410,612
平成 18 年度 末	国 債	211,674	181,635	857,013	541,288	2,117,308	4,631,929	8,540,850
	地 方 債	61,252	89,098	82,429	125,358	180,889	28,125	567,153
	社 債	204,051	386,361	595,612	391,145	980,463	255,037	2,812,672
	株 式	-	-	-	-	-	6,122,218	6,122,218
	外 国 証 券	164,981	940,511	689,053	529,640	642,159	2,832,970	5,799,318
	公 社 債	164,981	940,511	689,053	529,640	642,159	1,516,787	4,483,135
	株 式 等	-	-	-	-	-	1,316,183	1,316,183
	そ の 他 の 証 券	3,073	10,080	7,253	147,801	4,407	196,323	368,939
	合 計	645,033	1,607,687	2,231,363	1,735,234	3,925,229	14,066,603	24,211,152

## (4) 業種別国内株式保有明細表(一般勘定)

(単位:百万円、%)

区 分		平成17年度末		平成18年度末	
		金 額	占 率	金 額	占 率
水産・農林業		659	0.0	795	0.0
鉱業		590	0.0	589	0.0
建設業		107,625	1.9	106,813	1.7
製 造 業	食料品	145,113	2.5	160,392	2.6
	繊維製品	71,541	1.2	61,127	1.0
	パルプ・紙	13,675	0.2	11,971	0.2
	化学	254,113	4.4	256,116	4.2
	医薬品	224,550	3.9	268,639	4.4
	石油・石炭製品	16,596	0.3	17,369	0.3
	ゴム製品	23,848	0.4	24,449	0.4
	ガラス・土石製品	138,098	2.4	153,934	2.5
	鉄鋼	144,559	2.5	233,125	3.8
	非鉄金属	41,607	0.7	40,880	0.7
	金属製品	51,305	0.9	50,897	0.8
	機械	248,973	4.3	252,581	4.1
	電気機器	1,094,929	18.9	1,223,499	20.0
	輸送用機器	580,249	10.0	628,393	10.3
	精密機器	143,042	2.5	151,923	2.5
	その他製品	133,686	2.3	114,994	1.9
電気・ガス業		378,555	6.5	490,309	8.0
運 輸 ・ 情 報 通 信 業	陸運業	306,553	5.3	349,196	5.7
	海運業	2,050	0.0	2,463	0.0
	空運業	5,010	0.1	4,694	0.1
	倉庫・運輸関連業	9,043	0.2	8,626	0.1
	情報・通信業	78,893	1.4	92,283	1.5
商 業	卸売業	156,277	2.7	174,124	2.8
	小売業	217,902	3.8	184,470	3.0
金 融 ・ 保 険 業	銀行業	821,827	14.2	727,927	11.9
	証券、商品先物取引業	102,892	1.8	91,013	1.5
	保険業	79,786	1.4	73,123	1.2
	その他金融業	63,243	1.1	42,484	0.7
不動産業		49,050	0.8	56,366	0.9
サービス業		78,641	1.4	66,638	1.1
合 計		5,784,498	100.0	6,122,218	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。

### 3. 貸付金関係（一般勘定）

#### （1）貸付金明細表（一般勘定）

（単位：百万円）

区 分	平成17年度末	平成18年度末
保 険 約 款 貸 付	685,964	659,269
保 険 料 振 替 貸 付	113,937	105,435
契 約 者 貸 付	572,027	553,834
一 般 貸 付	4,875,254	4,403,301
（うち非居住者貸付）	(250,350)	(224,660)
企 業 貸 付	4,154,916	3,805,855
（うち国内企業向け）	(4,050,477)	(3,725,485)
国・国際機関・政府関係機関貸付	161,689	160,876
公 共 団 体 ・ 公 企 業 貸 付	425,902	399,542
住 宅 口 ー ン	38,117	35,927
（うち信託貸付金）	(26,443)	(25,874)
消 費 者 口 ー ン	93,377	152
そ の 他	1,251	947
合 計	5,561,219	5,062,571

#### （2）貸付金残存期間別残高（一般勘定）

（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を含む)	合 計
平 成 17 年 度 末							
変 動 金 利	84,759	86,394	105,471	101,535	69,607	47,693	495,462
固 定 金 利	474,292	1,139,179	941,853	728,494	722,354	373,618	4,379,791
一 般 貸 付 計	559,051	1,225,574	1,047,325	830,030	791,961	421,311	4,875,254
平 成 18 年 度 末							
変 動 金 利	34,496	102,535	85,646	101,530	57,051	38,326	419,587
固 定 金 利	385,521	871,563	714,350	769,587	709,679	533,011	3,983,713
一 般 貸 付 計	420,017	974,099	799,997	871,118	766,731	571,337	4,403,301

#### （3）貸付金企業規模別内訳＜国内企業向け＞（一般勘定）

（単位：件、百万円、%）

区 分	平成17年度末		平成18年度末	
	貸付先数	占 率	貸付先数	占 率
大 企 業	827	40.2	767	42.6
	金 額	3,292,551	3,046,336	81.8
中 堅 企 業	193	9.4	162	9.0
	金 額	71,939	57,712	1.5
中 小 企 業	1,036	50.4	870	48.4
	金 額	685,986	621,436	16.7
国内企業向け 貸付計	2,056	100.0	1,799	100.0
	金 額	4,050,477	3,725,485	100.0

（注）1. 業種の区分は以下のとおりです。

2. 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。

業 種	右の、を除外全業種	小売業、飲食業	サービス業	卸売業
大 企 業	従業員 300名超 かつ 資本金10億円 以上	従業員 50名超 かつ 資本金10億円 以上	従業員 100名超 かつ 資本金10億円 以上	従業員 100名超 かつ 資本金10億円 以上
中 堅 企 業	従業員 300名超 かつ 資本金3億円超 10億円未満	従業員 50名超 かつ 資本金5千万円超 10億円未満	従業員 100名超 かつ 資本金5千万円超 10億円未満	従業員 100名超 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名以下	資本金5千万円以下又は 常用する従業員50名以下	資本金5千万円以下又は 常用する従業員100名以下	資本金1億円以下又は 常用する従業員100名以下

## (4) 貸付金業種別内訳 (一般勘定)

(単位:百万円、%)

区 分	平成17年度末		平成18年度末		
	金 額	占 率	金 額	占 率	
国 内 向 け	製 造 業	986,933	20.2	865,796	19.7
	食 料	96,907	2.0	79,831	1.8
	織 維	19,443	0.4	19,358	0.4
	木 材 ・ 木 製 品	3,445	0.1	2,997	0.1
	パ ル プ ・ 紙	70,278	1.4	70,985	1.6
	印 刷	16,418	0.3	14,646	0.3
	化 学	85,429	1.8	89,767	2.0
	石 油 ・ 石 炭	66,490	1.4	38,094	0.9
	窯 業 ・ 土 石	35,793	0.7	29,451	0.7
	鉄 鋼	121,234	2.5	85,838	1.9
	非 鉄 金 属	30,304	0.6	30,432	0.7
	金 属 製 品	6,568	0.1	5,858	0.1
	一 般 機 械	129,232	2.7	134,537	3.1
	電 気 機 械	165,726	3.4	143,414	3.3
	輸 送 用 機 械	90,649	1.9	75,776	1.7
	精 密 機 械	14,256	0.3	13,742	0.3
	そ の 他 の 製 造 業	34,753	0.7	31,061	0.7
	農 業	300	0.0	234	0.0
	林 業	-	-	-	-
	漁 業	-	-	-	-
	鉱 業	1,200	0.0	940	0.0
	建 設 業	30,616	0.6	24,690	0.6
	電 気 ・ ガ ス ・ 熱 供 給 ・ 水 道 業	443,922	9.1	454,423	10.3
	情 報 通 信 業	175,984	3.6	131,979	3.0
	運 輸 業	309,135	6.3	290,436	6.6
	卸 売 業	569,349	11.7	493,505	11.2
小 売 業	88,942	1.8	69,404	1.6	
金 融 ・ 保 険 業	1,247,165	25.6	1,254,779	28.5	
不 動 産 業	235,643	4.8	228,967	5.2	
各 種 サ ー ビ ス	377,027	7.7	298,169	6.8	
地 方 公 共 団 体	23,062	0.5	28,299	0.6	
個人(住宅・消費・納税資金等)	131,494	2.7	36,079	0.8	
そ の 他	4,125	0.1	933	0.0	
合 計	4,624,904	94.9	4,178,640	94.9	
海 外 向 け	政 府 等	145,911	3.0	144,290	3.3
	金 融 機 関	12,600	0.3	17,000	0.4
	商 工 業 等	91,838	1.9	63,370	1.4
	合 計	250,350	5.1	224,660	5.1
総 合 計	4,875,254	100.0	4,403,301	100.0	

(注) 1. 保険約款貸付は含みません。

2. 国内向けの業種区分は日本銀行の「貸出先別貸出金(業種別、設備資金新規貸出)」の業種区分に準拠しています。

## (5) 貸付金地域別内訳 (一般勘定)

(単位:百万円、%)

区 分	平成17年度末		平成18年度末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
北 海 道	38,508	0.9	38,112	0.9
東 北	60,317	1.3	51,305	1.2
関 東	3,273,054	72.9	3,037,685	73.6
中 部	321,898	7.2	304,690	7.4
近 畿	592,920	13.2	506,887	12.3
中 国	70,267	1.6	66,633	1.6
四 国	41,791	0.9	35,763	0.9
九 州	91,978	2.0	87,865	2.1
合 計	4,490,736	100.0	4,128,943	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、貸付先の本社所在地によります。

## (6) 貸付金担保別内訳 (一般勘定)

(単位:百万円、%)

区 分	平成17年度末		平成18年度末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
担 保 貸 付	76,664	1.6	60,280	1.4
有価証券担保貸付	19,687	0.4	14,708	0.3
不動産・動産・財団担保貸付	51,036	1.0	42,086	1.0
指名債権担保貸付	5,940	0.1	3,485	0.1
保 証 貸 付	230,654	4.7	209,351	4.8
信 用 貸 付	4,438,762	91.0	4,097,973	93.1
そ の 他	129,172	2.6	35,696	0.8
一 般 貸 付 計	4,875,254	100.0	4,403,301	100.0
うち劣後特約付貸付	514,583	10.6	535,500	12.2

(注) 保険約款貸付は含みません。

#### 4. 海外投融資関係（一般勘定）

##### （1）資産別明細（一般勘定）

###### 外貨建資産

（単位：百万円、％）

区 分	平成17年度末		平成18年度末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
公 社 債	4,309,570	68.8	4,118,848	66.4
株 式	423,630	6.8	537,563	8.7
現 預 金 ・ そ の 他	85,218	1.4	76,338	1.2
小 計	4,818,419	77.0	4,732,750	76.3

###### 円貨額が確定した外貨建資産

（単位：百万円、％）

区 分	平成17年度末		平成18年度末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
公 社 債	-	-	-	-
現 預 金 ・ そ の 他	92,706	1.5	101,459	1.6
小 計	92,706	1.5	101,459	1.6

###### 円貨建資産

（単位：百万円、％）

区 分	平成17年度末		平成18年度末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
非 居 住 者 貸 付	250,350	4.0	224,660	3.6
公社債（円建外債）・その他	1,099,465	17.6	1,146,558	18.5
小 計	1,349,815	21.6	1,371,219	22.1

###### 合 計

（単位：百万円、％）

海 外 投 融 資	6,260,941	100.0	6,205,429	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）外貨建資産の通貨別構成（一般勘定）

（単位：百万円、％）

区 分	平成17年度末		平成18年度末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
米 ド ル	2,591,153	53.8	2,537,433	53.6
ユ ー ロ	1,618,520	33.6	1,521,082	32.1
イ ギ リ ス ポ ン ド	384,034	8.0	405,717	8.6
カ ナ ダ ド ル	95,151	2.0	76,274	1.6
オ ー ス ト ラ リ ア ド ル	37,580	0.8	41,857	0.9
香 港 ド ル	24,013	0.5	35,987	0.8
ス ウ ェ ー デ ン ク ロ ー ネ	43,182	0.9	33,068	0.7
そ の 他 共 計	4,818,419	100.0	4,732,750	100.0



## (3) 海外投融資の地域別構成(一般勘定)

(単位:百万円、%)

区 分	外国証券						非居住者貸付		
	金額		占率		株式等		金額	占率	
	金額	占率	金額	占率	金額	占率	金額	占率	
平成17年度末	北 米	2,594,947	44.5	2,499,491	50.4	95,456	11.0	78,578	31.4
	ヨ ー ロ ッ パ	1,889,411	32.4	1,804,575	36.4	84,835	9.8	92,312	36.9
	オ セ ア ニ ア	59,929	1.0	56,192	1.1	3,736	0.4	10,000	4.0
	ア ジ ア	73,341	1.3	44,353	0.9	28,987	3.3	9,547	3.8
	中 南 米	1,015,983	17.4	359,286	7.2	656,697	75.5	6,424	2.6
	中 東	-	-	-	-	-	-	-	-
	ア フ リ カ	39	0.0	-	-	39	0.0	-	-
	国 際 機 関	194,879	3.3	194,879	3.9	-	-	53,487	21.4
	合 計	5,828,533	100.0	4,958,780	100.0	869,753	100.0	250,350	100.0
平成18年度末	北 米	2,476,412	42.7	2,363,735	52.7	112,676	8.6	52,627	23.4
	ヨ ー ロ ッ パ	1,777,078	30.6	1,669,941	37.2	107,137	8.1	90,048	40.1
	オ セ ア ニ ア	21,650	0.4	17,288	0.4	4,362	0.3	10,000	4.5
	ア ジ ア	108,851	1.9	14,460	0.3	94,390	7.2	7,079	3.2
	中 南 米	1,270,738	21.9	273,122	6.1	997,615	75.8	4,305	1.9
	中 東	-	-	-	-	-	-	-	-
	ア フ リ カ	-	-	-	-	-	-	-	-
	国 際 機 関	144,586	2.5	144,586	3.2	-	-	60,600	27.0
	合 計	5,799,318	100.0	4,483,135	100.0	1,316,183	100.0	224,660	100.0

(注) 地域区分は発行会社および貸付先企業の国籍等に基づいています。

## 5. デリバティブ取引の時価情報（一般勘定）（ヘッジ会計適用・非適用分の合算値）

差損益の内訳（ヘッジ会計適用分・非適用分の内訳）

（単位：百万円）

区 分	平成17年度末						平成18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	3,681	29,507	-	-	-	33,189	1,017	22,930	-	-	-	23,948
ヘッジ会計非適用分	28	2,814	-	51	13	2,881	16	1,064	-	266	12	826
合 計	3,710	32,322	-	51	13	36,070	1,033	23,994	-	266	12	24,774

（注）上表のうち損益計算書に計上されている金額は以下のとおりです。

平成17年度末：ヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ適用分の差損益（通貨関連 29,507百万円）及びヘッジ会計非適用分の差損益（2,881百万円）の合計 32,389百万円

平成18年度末：ヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ適用分の差損益（通貨関連 22,930百万円）及びヘッジ会計非適用分の差損益（826百万円）の合計 23,757百万円

時価情報

（a）金利関連

（単位：百万円）

区 分	種 類	平成17年度末					平成18年度末				
		契約額等		時価	差損益	うちヘッジ会計 適用分	契約額等		時価	差損益	うちヘッジ会計 適用分
			うち1年超					うち1年超			
取引所	金利先物 売建	4,978	-	4,976	2	-	7,448	-	7,448	0	-
	買建	4,968	-	4,963	4	-	-	-	-	-	-
店頭	金利スワップ 固定金利受取 / 変動金利支払	220,557	193,657	3,708	3,708	3,681	219,028	191,478	1,033	1,033	1,017
	固定金利支払 / 変動金利受取	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
合 計					3,710	3,681				1,033	1,017

（注）差損益欄には、先物取引については契約額と時価との差額を記載し、スワップ取引については時価を記載しています。

（参考）金利スワップ残存期間別残高

（単位：百万円、%）

区 分	1年以下	1年超	3年超	5年超	7年超	10年超	合計	
		3年以下	5年以下	7年以下	10年以下			
平成17年度末	受取側固定スワップ想定元本	26,900	55,860	67,010	33,000	34,550	3,237	220,557
	平均受取固定金利	0.44	0.54	0.82	1.14	1.18	1.41	0.81
	平均支払変動金利	0.09	0.10	0.10	0.10	0.08	0.09	0.10
	支払側固定スワップ想定元本	-	-	-	-	-	-	-
	平均支払固定金利	-	-	-	-	-	-	-
	平均受取変動金利	-	-	-	-	-	-	-
合 計	26,900	55,860	67,010	33,000	34,550	3,237	220,557	
平成18年度末	受取側固定スワップ想定元本	27,550	71,640	46,180	55,700	17,958	-	219,028
	平均受取固定金利	0.36	0.76	0.98	1.20	1.75	-	0.95
	平均支払変動金利	0.62	0.66	0.63	0.62	0.62	-	0.63
	支払側固定スワップ想定元本	-	-	-	-	-	-	-
	平均支払固定金利	-	-	-	-	-	-	-
	平均受取変動金利	-	-	-	-	-	-	-
合 計	27,550	71,640	46,180	55,700	17,958	-	219,028	

## (b) 通貨関連

(単位: 百万円)

区分	種類	平成17年度末				平成18年度末			
		契約額等	時価	差損益	うちヘッジ会計 適用分	契約額等	時価	差損益	うちヘッジ会計 適用分
店頭	為替予約								
	売建	2,787,814	2,822,617	34,803	29,510	2,016,690	2,041,513	24,822	22,934
	(米ドル)	1,400,354	1,400,335	18	262	1,042,768	1,055,561	12,793	12,425
	(ユーロ)	1,053,995	1,084,829	30,834	25,921	725,372	738,187	12,814	11,437
	(英ポンド)	224,119	228,566	4,446	4,158	191,271	189,373	1,897	1,967
	(加ドル)	58,066	57,214	851	807	32,332	33,327	995	922
	(スウェーデンクローネ)	31,110	31,924	814	730	19,298	19,095	202	201
	(豪ドル)	20,038	19,616	421	230	5,646	5,967	320	317
	(香港ドル)	129	129	0	-	-	-	-	-
	買建	382,790	385,271	2,480	2	127,148	127,976	827	3
	(ユーロ)	165,261	167,248	1,987	2	57,592	58,268	676	3
	(米ドル)	174,740	174,708	32	0	55,145	55,175	30	-
	(英ポンド)	26,063	26,087	23	-	7,960	7,999	39	0
	(中国元)	5,174	5,852	677	-	6,023	6,112	88	-
(スウェーデンクローネ)	331	328	3	-	293	286	6	-	
(香港ドル)	121	120	0	-	131	130	0	-	
(タイバーツ)	-	-	-	-	2	2	0	-	
(豪ドル)	11,098	10,926	171	-	-	-	-	-	
	合計			32,322	29,507			23,994	22,930

- (注) 1. 年度末の為替相場は先物相場を使用しています。  
2. 為替予約等により決済時における円貨額が確定しており、貸借対照表において当該円貨額で表示されている外貨建金銭債権債務等に係る当該為替予約等は、開示の対象より除いています。  
3. 差損益欄には、契約額と時価との差額を記載しています。  
4. 上表において、残存期間1年超の取引はありません。

## (c) 株式関連

平成17年度末以降期末残高がないため、記載していません。

## (d) 債券関連

(単位：百万円)

区分	種類	平成17年度末				平成18年度末			
		契約額等	時価	差損益	うちヘッジ会計 適用分	契約額等	時価	差損益	うちヘッジ会計 適用分
取引所	円建債券先物								
	売建	-	-	-	-	1,339	1,341	2	-
	買建	7,947	7,874	73	-	8,450	8,451	1	-
	外貨建債券先物								
売建	103,535	103,211	323	-	126,244	125,998	246	-	
買建	30,352	30,259	92	-	81,520	81,384	136	-	
店頭	外貨建債券先渡契約								
	売建	11,761	11,745	16	-	40,669	40,615	54	-
	買建	51,588	51,504	83	-	65,972	66,075	103	-
	債券店頭オプション								
	売建								
	コール	-	-	-	-	7,447			
	(-)					(27)	21	5	-
	プット	23,493				-			
	(228)		347	118		(-)			
	買建								
コール	23,493				5,066				
(29)		5	24		(8)	3	4	-	
プット	-				7,447				
(-)					(34)	32	2	-	
合計				51				266	-

(注) 1.括弧内には、貸借対照表に計上したオプション料を記載しています。

2.差損益欄には、先物取引及び先渡契約については契約額と時価との差額を記載し、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。

3.上表において、残存期間1年超の取引はありません。

## (e) その他

(単位：百万円)

区分	種類	平成17年度末				平成18年度末					
		契約額等	うち1年超	時価	差損益	うちヘッジ会計 適用分	契約額等	うち1年超	時価	差損益	うちヘッジ会計 適用分
店頭	クレジット・フォルト・スワップ オプション売建	5,000	4,000	9	9	-	4,000	4,000	4	4	-
	オプション買建	4,000	4,000	4	4	-	6,000	6,000	16	16	-
	合計	9,000	8,000	13	13	-	10,000	10,000	12	12	-

(注) 差損益欄には、時価を記載しています。

・特別勘定（個人変額保険・個人変額年金保険）

1. デリバティブ取引の時価情報（個人変額保険特別勘定）（ヘッジ会計適用・非適用分の合算値）

差損益の内訳（ヘッジ会計適用分・非適用分の内訳）

（単位：百万円）

区 分	平成17年度末						平成18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	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ヘッジ会計非適用分	-	4	-	-	-	4	-	8	-	-	-	8
合 計	-	4	-	-	-	4	-	8	-	-	-	8

（注）上表の差損益は、全て損益計算書に計上されています。

時価情報

（b）通貨関連

（単位：百万円）

区 分	種 類	平成17年度末				平成18年度末			
		契約額等	時価	差損益	うちヘッジ会計 適用分	契約額等	時価	差損益	うちヘッジ会計 適用分
店 頭	為替予約								
	売建	3,013	3,025	12	-	1,723	1,708	14	-
	（米ドル）	1,063	1,068	5	-	614	609	5	-
	（スウェーデンクローネ）	-	-	-	-	506	496	10	-
	（ノルウェークローネ）	-	-	-	-	270	268	2	-
	（ユーロ）	718	728	9	-	258	261	2	-
	（英ポンド）	261	266	4	-	45	46	0	-
	（加ドル）	161	165	3	-	14	15	0	-
	（シンガポールドル）	-	-	-	-	11	11	0	-
	（豪ドル）	367	353	14	-	-	-	-	-
	（スイスフラン）	285	286	1	-	-	-	-	-
	（ポーランドズロチ）	155	156	1	-	-	-	-	-
	買建	3,006	3,022	16	-	1,633	1,626	6	-
	（ノルウェークローネ）	22	23	0	-	296	296	0	-
	（ユーロ）	841	860	19	-	280	281	0	-
	（スウェーデンクローネ）	16	16	0	-	277	275	2	-
	（米ドル）	869	870	0	-	276	277	0	-
	（英ポンド）	265	266	1	-	271	266	5	-
	（ポーランドズロチ）	251	247	3	-	97	97	0	-
	（スイスフラン）	345	352	7	-	87	87	0	-
（シンガポールドル）	31	31	0	-	44	44	0	-	
（豪ドル）	362	353	9	-	-	-	-	-	
合 計			4	-			8	-	

（注）1 年度末の為替相場は先物相場を使用しています。

2 為替予約等により決済時における円貨額が確定しており、貸借対照表において当該円貨額で表示されている外貨建金銭債権債務等に係る当該為替予約等は、開示の対象より除いています。

3 差損益欄には、契約額と時価との差額を記載しています。

4 上表において、残存期間1年超の取引はありません。

（a）金利関連、（c）株式関連、（d）債券関連は平成17年度末以降期末残高がないため、記載していません。

2. デリバティブ取引の時価情報（個人変額年金保険特別勘定）（ヘッジ会計適用・非適用分の合算値）

差損益の内訳（ヘッジ会計適用分・非適用分の内訳）

（単位：百万円）

区 分	平成17年度末						平成18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	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ヘッジ会計非適用分	-	0	-	-	-	0	-	-	-	-	-	-
合 計	-	0	-	-	-	0	-	-	-	-	-	-

（注）上表の差損益は、全て損益計算書に計上されています。

時価情報

（b）通貨関連

（単位：百万円）

区 分	種 類	平成17年度末				平成18年度末			
		契約額等	時価	差損益	うちヘッジ会計 適用分	契約額等	時価	差損益	うちヘッジ会計 適用分
店 頭	為替予約								
	売建	5	5	0	-	-	-	-	-
	（スイスフラン）	2	2	0	-	-	-	-	-
	（米ドル）	2	2	0	-	-	-	-	-
	買建	5	5	0	-	-	-	-	-
	（ユーロ）	2	2	0	-	-	-	-	-
	（米ドル）	2	2	0	-	-	-	-	-
合 計			0	-			-	-	

- （注）1. 年度末の為替相場は先物相場を使用しています。  
 2. 為替予約等により決済時における円貨額が確定しており、貸借対照表において当該円貨額で表示されている外貨建金銭債権債務等に係る当該為替予約等は、開示の対象より除いています。  
 3. 差損益欄には、契約額と時価との差額を記載しています。  
 4. 上表において、残存期間1年超の取引はありません。

（a）金利関連、（c）株式関連、（d）債券関連は平成17年度末以降期末残高がないため、記載していません。

## ・会社計

### 1. 資産構成

#### (1) 資産の構成

(単位：百万円、%)

区 分	平成17年度末		平成18年度末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
現預金・コールローン	486,699	1.5	539,350	1.6
買 現 先 勘 定	-	-	-	-
債券貸借取引支払保証金	-	-	-	-
買 入 金 銭 債 権	548,068	1.7	462,329	1.4
商 品 有 価 証 券	-	-	-	-
金 銭 の 信 託	33,854	0.1	32,564	0.1
有 価 証 券	24,011,864	73.9	25,902,665	77.1
公 社 債	10,862,339	33.4	12,316,047	36.7
株 式	6,315,120	19.4	6,674,631	19.9
外 国 証 券	6,276,260	19.3	6,277,996	18.7
公 社 債	5,158,094	15.9	4,687,535	14.0
株 式 等	1,118,166	3.4	1,590,460	4.7
そ の 他 の 証 券	558,144	1.7	633,989	1.9
貸 付 金	5,561,219	17.1	5,062,571	15.1
保 険 約 款 貸 付	685,964	2.1	659,269	2.0
一 般 貸 付	4,875,254	15.0	4,403,301	13.1
不 動 産	1,205,626	3.7	1,167,249	3.5
繰 延 税 金 資 産	-	-	-	-
そ の 他	650,453	2.0	423,006	1.3
貸 倒 引 当 金	11,169	0.0	11,534	0.0
合 計	32,486,618	100.0	33,578,200	100.0
う ち 外 貨 建 資 産	5,268,612	16.2	5,211,905	15.5

#### (2) 資産の増減

(単位：百万円)

区 分	平成17年度	平成18年度
現預金・コールローン	44,470	52,650
買 現 先 勘 定	-	-
債券貸借取引支払保証金	20,298	-
買 入 金 銭 債 権	27,945	85,739
商 品 有 価 証 券	-	-
金 銭 の 信 託	27,746	1,290
有 価 証 券	2,600,172	1,890,800
公 社 債	784,485	1,453,707
株 式	1,648,422	359,511
外 国 証 券	38,624	1,735
公 社 債	345,443	470,558
株 式 等	384,068	472,294
そ の 他 の 証 券	128,639	75,845
貸 付 金	244,084	498,648
保 険 約 款 貸 付	26,474	26,695
一 般 貸 付	217,610	471,952
不 動 産	35,966	38,377
繰 延 税 金 資 産	-	-
そ の 他	235,882	227,447
貸 倒 引 当 金	3,043	365
合 計	2,638,911	1,091,582
う ち 外 貨 建 資 産	92,977	56,707

## 2. 有価証券等の時価情報

### (1) 売買目的有価証券の評価損益

(単位：百万円)

区 分	平成17年度末		平成18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	1,633,459	223,494	1,722,316	2,950
一 般 勘 定	32,207	1,889	30,803	1,632
特 別 勘 定	1,601,251	221,605	1,691,512	1,318

- (注) 1. 本表には、「金銭の信託」等の売買目的有価証券を含めています。  
2. 「当期の損益に含まれた評価損益」には期始の振戻損益を含めています。

### (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	帳簿価額	時 価	差 損 益	うち差益			
				うち差益	うち差損		
平成17年度末	満期保有目的の債券	182,018	173,223	8,795	79	8,875	
	公 社 債	122,026	117,446	4,580	79	4,660	
	外 国 公 社 債	59,992	55,776	4,215	-	4,215	
	責任準備金対応債券	4,229,463	4,273,708	44,245	59,538	15,293	
	公 社 債	4,229,463	4,273,708	44,245	59,538	15,293	
	子会社・関連会社株式	-	-	-	-	-	
	そ の 他 有 価 証 券	14,755,042	17,854,410	3,099,367	3,208,542	109,174	
	公 社 債	6,136,573	6,134,832	1,740	44,043	45,784	
	株 式	2,865,209	5,695,211	2,830,002	2,840,359	10,356	
	外 国 証 券	5,205,085	5,451,941	246,856	299,733	52,877	
	公 社 債	4,745,547	4,898,788	153,241	204,169	50,928	
	株 式 等	459,538	553,153	93,614	95,564	1,949	
	そ の 他 の 証 券	248,182	272,431	24,249	24,405	155	
	買入金銭債権	169,992	169,992	-	-	-	
	譲渡性預金	130,000	130,000	-	-	-	
	そ の 他	-	-	-	-	-	
	合 計	19,166,524	22,301,342	3,134,817	3,268,161	133,343	
	平成18年度末	公 社 債	10,488,062	10,525,987	37,924	103,662	65,737
		株 式	2,865,209	5,695,211	2,830,002	2,840,359	10,356
外 国 証 券		5,265,077	5,507,718	242,640	299,733	57,093	
公 社 債		4,805,539	4,954,565	149,025	204,169	55,144	
株 式 等		459,538	553,153	93,614	95,564	1,949	
そ の 他 の 証 券		248,182	272,431	24,249	24,405	155	
買入金銭債権		169,992	169,992	-	-	-	
譲渡性預金		130,000	130,000	-	-	-	
そ の 他		-	-	-	-	-	
満期保有目的の債券		182,711	176,581	6,129	306	6,436	
公 社 債		122,583	119,278	3,304	306	3,611	
外 国 公 社 債		60,127	57,303	2,824	-	2,824	
責任準備金対応債券		4,796,242	4,888,316	92,074	96,378	4,304	
公 社 債		4,796,242	4,888,316	92,074	96,378	4,304	
子会社・関連会社株式		-	-	-	-	-	
そ の 他 有 価 証 券		15,132,601	18,658,322	3,525,721	3,587,064	61,343	
公 社 債		6,916,880	7,001,850	84,970	94,060	9,090	
株 式		2,973,562	6,037,300	3,063,738	3,091,770	28,032	
外 国 証 券		4,779,847	5,127,119	347,271	371,050	23,778	
公 社 債	4,219,528	4,423,007	203,478	226,017	22,538		
株 式 等	560,319	704,112	143,792	145,032	1,240		
そ の 他 の 証 券	242,347	272,089	29,741	30,183	442		
買入金銭債権	119,962	119,962	-	-	-		
譲渡性預金	100,000	100,000	-	-	-		
そ の 他	-	-	-	-	-		
合 計	20,111,554	23,723,221	3,611,666	3,683,750	72,083		
公 社 債	11,835,706	12,009,446	173,739	190,745	17,005		
株 式	2,973,562	6,037,300	3,063,738	3,091,770	28,032		
外 国 証 券	4,839,975	5,184,422	344,447	371,050	26,603		
公 社 債	4,279,656	4,480,310	200,654	226,017	25,363		
株 式 等	560,319	704,112	143,792	145,032	1,240		
そ の 他 の 証 券	242,347	272,089	29,741	30,183	442		
買入金銭債権	119,962	119,962	-	-	-		
譲渡性預金	100,000	100,000	-	-	-		
そ の 他	-	-	-	-	-		

- (注) 1. 本表には、CD(譲渡性預金)等、証券取引法上の有価証券に準じた取扱いを行うことが適当と認められるものを含んでいます。  
2. 「金銭の信託」のうち売買目的有価証券以外に区分されるものがありますが、資産内容が預金であるため本表に含めていません。  
なお、帳簿価額および時価は平成17年度末が1,647百万円、平成18年度末が1,761百万円です。



・時価のない有価証券の帳簿価額は次のとおりです。

(単位：百万円)

区 分	平成17年度末	平成18年度末
満期保有目的の債券	-	-
非上場外国公社債	-	-
その他	-	-
責任準備金対応債券	-	-
子会社・関連会社株式	26,154	33,466
非上場国内株式(店頭売買株式を除く)	19,334	21,315
非上場外国株式(店頭売買株式を除く)	6,820	6,820
その他	-	5,331
その他の有価証券	661,661	1,026,866
非上場国内株式(店頭売買株式を除く)	69,953	63,602
非上場外国株式(店頭売買株式を除く)	309,779	603,622
非上場外国公社債	0	0
その他	281,928	359,641
合 計	687,815	1,060,332

(注) 本表には、CD(譲渡性預金)等、証券取引法上の有価証券に準じた取扱いを行うことが適当と認められるものを含んでいます。

### (3) 金銭の信託の時価情報

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額	時価	差損益	うち差益	
				うち差益	うち差損
平成17年度末	33,854	33,854	1,889	2,114	224
平成18年度末	32,564	32,564	1,632	2,142	3,775

(注) 本表記載の時価相当額の算定は、金銭の信託の受託者が合理的に算定した価格によっています。  
差損益には金銭の信託内で設定しているデリバティブ取引に係る差損益も含んでいます。

・運用目的の金銭の信託

(単位：百万円)

区 分	平成17年度末		平成18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
運用目的の金銭の信託	32,207	1,889	30,803	1,632

(注) 「当期の損益に含まれた評価損益」には期始の振戻損益を含めています。

・満期保有目的・責任準備金対応・その他の金銭の信託

(単位：百万円)

区 分	平成17年度末					平成18年度末				
	帳簿価額	時価	差損益	うち差益		帳簿価額	時価	差損益	うち差益	
				うち差益	うち差損				うち差益	うち差損
満期保有目的の金銭の信託	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
責任準備金対応の金銭の信託	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他の金銭の信託	1,647	1,647	-	-	-	1,761	1,761	-	-	-

(注) 「その他の金銭の信託」には資産内容が預金である金銭の信託を記載しています。

#### (4) デリバティブ取引の運用状況

当社では、有価証券投資に係る市場リスクのヘッジを目的とした有価証券関連のデリバティブ取引、外貨建資産に係る為替リスクのヘッジを目的とした通貨関連のデリバティブ取引、貸付金の収益の安定および向上を目的とした金利スワップ関連取引等を行っております。

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（金利・為替等市場の変動が収益に影響を及ぼすリスク）と信用リスク（取引相手が倒産等により契約不履行に陥るリスク）があります。例えば、金利スワップ取引では、金利の変動による市場リスクだけでなく、取引相手のデフォルトによる信用リスクも認識する必要があります。

また、一般的には、デリバティブ取引には、流動性の高さ、取引コストの低さ、リスク特性の変更が可能であることなどの利点がある一方で、レバレッジ、商品特性等に起因する現物資産にはないリスクも存在していることに留意し、きめ細かな管理を行う必要があると考えております。

##### 取引の内容

平成 18 年度に当社が利用していたデリバティブ取引は以下の通りです。

- ・金利関連：金利先物取引、金利スワップ取引
- ・通貨関連：為替予約取引、通貨オプション取引
- ・株式関連：株価指数先物取引
- ・債券関連：債券先物取引、債券オプション取引、債券先渡契約取引
- ・その他：クレジット・デリバティブ取引

##### 取組方針

当社では、保有資産の残高を踏まえ、必要な範囲内でデリバティブ取引を用いることとし、主に保有している現物資産に係る市場リスクのヘッジを目的とした取引を行っております。従って、投機的なデリバティブ取引は行わない方針です。

##### デリバティブ取引に対するヘッジ会計の適用

当社では、平成 18 年度において、以下の取引についてヘッジ会計を適用しております。

- ・貸付金をヘッジ対象、金利スワップをヘッジ手段とする取引
- ・公社債をヘッジ対象、金利スワップをヘッジ手段とする取引
- ・外貨建債券をヘッジ対象、為替予約をヘッジ手段とする取引
- ・外貨建定期預金をヘッジ対象、為替予約をヘッジ手段とする取引

ヘッジ会計の適用にあたっては、「金融商品に係る会計基準の設定に関する意見書」等における適用要件を満たすため、方針文書・規程等を整備するとともに、これらの方針・規程等に基づき、ヘッジ対象のリスクの種類および選択したヘッジ手段を明確にし、また事前有効性の確認、事後有効性の検証を行う等、社内体制を整備して運営しております。

## リスク管理体制

当社では、デリバティブ取引について、ヘッジ対象の現物資産と一体で日々の損益を管理するとともに、ポジション等に係るリスク・リミットの設定やトラッキング・エラー、バリュー・アット・リスク（VaR：最大損失予想額）等の定期的な測定等により、厳正な市場リスク管理を行っております。

一方、取引所取引以外の店頭（相対）のデリバティブ取引における信用リスクについては、取引の相手先ごとに取引の上限枠を設定することなどにより管理を行っております。なお、平成18年度末の店頭デリバティブ取引の信用リスク相当額（カレント・エクスポージャー方式による再構築コスト）は次表の通りです。

（単位：億円）

区 分	平成17年度末		平成18年度末	
	契約金額・ 想定元本額	信用リスク 相当額	契約金額・ 想定元本額	信用リスク 相当額
金 利 ス ワ ッ プ	2,205	17	2,190	21
為 替 予 約	32,843	399	22,288	264
通 貨 オ ブ シ ョ ン	-	-	-	-
債 券 先 渡 契 約	633	0	1,066	1
債 券 オ ブ シ ョ ン	469	0	199	0
クレジット・デリバティブ	90	0	100	0
合 計	36,241	418	25,844	288

資産運用におけるリスク管理に関しては、これらのデリバティブ取引も含めて、社内規程を策定し、リスク管理の基本方針・具体的取組内容を明確に定めております。デリバティブ取引に関するリスク管理は、担当所管において厳格に行うとともに、全体のリスクの状況については、リスク管理の専門組織である「リスク管理統括部」が一元的に把握し、四半期毎の「ALM委員会」等に定期的に報告しており、リスクのコントロールには細心の注意を払っております。

## 定量的情報に関する補足説明

当社のデリバティブ取引は、主に保有している現物資産に係る市場リスクのヘッジを目的としていることから、デリバティブ取引自体の想定元本額（契約額）や含み損益額に加えて、ヘッジ対象である現物資産の状況を勘案することにより的確に状況が把握できます。

すなわち、デリバティブ取引の契約額等をヘッジ対象の現物資産の残高と合わせて見ることによって、現物資産のうちどの程度がデリバティブ取引によってヘッジされているのか、また、デリバティブ取引の含み損益をヘッジ対象の現物資産の含み損益と合わせて見ることによって、デリバティブ取引で市場の変化による運用収益の変動がどの程度回避されているのか、等がわかります。

## (5) 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)

## 差損益の内訳(ヘッジ会計適用分・非適用分の内訳)

(単位:百万円)

区 分	平成17年度末						平成18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	3,681	29,507	-	-	-	33,189	1,017	22,930	-	-	-	23,948
ヘッジ会計非適用分	28	3,054	289	51	13	2,831	16	991	48	266	12	704
合 計	3,710	32,562	289	51	13	36,021	1,033	23,921	48	266	12	24,653

(注) 上表のうち損益計算書に計上されている金額は以下のとおりです。

平成17年度末:ヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ適用分の差損益(通貨関連 29,507百万円)及びヘッジ会計非適用分の差損益(2,831百万円)の合計 32,339百万円

平成18年度末:ヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ適用分の差損益(通貨関連 22,930百万円)及びヘッジ会計非適用分の差損益(704百万円)の合計 23,635百万円

## 時価情報

## (a) 金利関連

(単位:百万円)

区 分	種 類	平成17年度末					平成18年度末				
		契約額等		時価	差損益	うちヘッジ会計 適用分	契約額等		時価	差損益	うちヘッジ会計 適用分
			うち1年超					うち1年超			
取引所	金利先物 売建	4,978	-	4,976	2	-	7,448	-	7,448	0	-
	買建	4,968	-	4,963	4	-	-	-	-	-	
店頭	金利スワップ 固定金利受取/変動金利支払	220,557	193,657	3,708	3,708	3,681	219,028	191,478	1,033	1,033	1,017
	固定金利支払/変動金利受取	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
合 計					3,710	3,681				1,033	1,017

(注) 差損益欄には、先物取引については契約額と時価との差額を記載し、スワップ取引については時価を記載しています。

## (参考) 金利スワップ残存期間別残高

(単位:百万円、%)

区 分	1年以下	1年超	3年超	5年超	7年超	10年超	合計	
		3年以下	5年以下	7年以下	10年以下			
平成17年度末	受取側固定スワップ想定元本	26,900	55,860	67,010	33,000	34,550	3,237	220,557
	平均受取固定金利	0.44	0.54	0.82	1.14	1.18	1.41	0.81
	平均支払変動金利	0.09	0.10	0.10	0.10	0.08	0.09	0.10
	支払側固定スワップ想定元本	-	-	-	-	-	-	-
	平均支払固定金利	-	-	-	-	-	-	-
平均受取変動金利	-	-	-	-	-	-	-	
合 計	26,900	55,860	67,010	33,000	34,550	3,237	220,557	
平成18年度末	受取側固定スワップ想定元本	27,550	71,640	46,180	55,700	17,958	-	219,028
	平均受取固定金利	0.36	0.76	0.98	1.20	1.75	-	0.95
	平均支払変動金利	0.62	0.66	0.63	0.62	0.62	-	0.63
	支払側固定スワップ想定元本	-	-	-	-	-	-	-
	平均支払固定金利	-	-	-	-	-	-	-
平均受取変動金利	-	-	-	-	-	-	-	
合 計	27,550	71,640	46,180	55,700	17,958	-	219,028	

## (b) 通貨関連

(単位: 百万円)

区分	種類	平成17年度末				平成18年度末			
		契約額等	時価	差損益	うちヘッジ会計 適用分	契約額等	時価	差損益	うちヘッジ会計 適用分
店	為替予約								
	売建	2,849,162	2,884,496	35,333	29,510	2,063,010	2,088,155	25,144	22,934
	(米ドル)	1,423,374	1,423,621	247	262	1,062,384	1,075,276	12,891	12,425
	(ユーロ)	1,069,623	1,100,765	31,141	25,921	738,483	751,535	13,052	11,437
	(英ポンド)	229,504	234,017	4,512	4,158	192,677	190,797	1,880	1,967
	(加ドル)	61,890	61,098	792	807	32,940	33,948	1,008	922
	(スウェーデンクローネ)	31,142	31,956	814	730	27,329	27,117	212	201
	(豪ドル)	24,452	23,829	622	230	5,810	6,134	324	317
	(ノルウェークローネ)	-	-	-	-	3,278	3,237	41	-
	(スイスフラン)	5,690	5,709	19	-	65	66	0	-
	(シンガポールドル)	-	-	-	-	32	33	0	-
	(デンマーククローネ)	-	-	-	-	7	7	0	-
	(ポーランドズロチ)	3,355	3,368	13	-	-	-	-	-
	(香港ドル)	129	129	0	-	-	-	-	-
	買建	435,141	437,913	2,771	2	165,857	167,079	1,222	3
	(ユーロ)	179,402	181,680	2,278	2	68,023	68,833	810	3
	(米ドル)	189,177	189,180	2	0	65,735	65,744	8	-
	(英ポンド)	31,680	31,702	22	-	13,916	14,056	140	0
	(中国元)	5,174	5,852	677	-	6,023	6,112	88	-
	(ノルウェークローネ)	502	518	16	-	3,759	3,875	115	-
(スウェーデンクローネ)	354	351	2	-	3,072	3,025	46	-	
(ポーランドズロチ)	5,258	5,176	82	-	2,162	2,229	66	-	
(スイスフラン)	7,196	7,345	148	-	2,007	2,028	20	-	
(シンガポールドル)	690	698	7	-	900	912	12	-	
(香港ドル)	121	120	0	-	131	130	0	-	
(豪ドル)	15,445	15,149	296	-	120	125	5	-	
(タイバーツ)	-	-	-	-	2	2	0	-	
(加ドル)	138	137	1	-	2	2	0	-	
頭	合計			32,562	29,507			23,921	22,930

- (注) 1. 年度末の為替相場は先物相場を使用しています。  
2. 為替予約等により決済時における円貨額が確定しており、貸借対照表において当該円貨額で表示されている外貨建金銭債権債務等に係る当該為替予約等は、開示の対象より除いています。  
3. 差損益欄には、契約額と時価との差額を記載しています。  
4. 上表において、残存期間1年超の取引はありません。

## (c) 株式関連

(単位:百万円)

区分	種類	平成17年度末				平成18年度末			
		契約額等	時価	差損益	うちヘッジ会計適用分	契約額等	時価	差損益	うちヘッジ会計適用分
取引所	円建株価指数先物 買建				10,862				11,142
	外貨建株価指数先物 買建	1,030	1,040	10	-	3,291	3,330	38	-
合計				289	-			48	-

- (注) 1. 差損益欄には、契約額と時価との差額を記載しています。  
2. 上表において、残存期間1年超の取引はありません。

## (d) 債券関連

(単位:百万円)

区分	種類	平成17年度末				平成18年度末				
		契約額等	時価	差損益	うちヘッジ会計適用分	契約額等	時価	差損益	うちヘッジ会計適用分	
取引所	円建債券先物 売建				-				-	-
	買建	7,947	7,874	73	-	8,450	8,451	1	-	
	外貨建債券先物 売建	103,535	103,211	323	-	126,244	125,998	246	-	
	買建	30,352	30,259	92	-	81,520	81,384	136	-	
店頭	外貨建債券先渡契約 売建	11,761	11,745	16	-	40,669	40,615	54	-	
	買建	51,588	51,504	83	-	65,972	66,075	103	-	
	債券店頭オプション 売建 コール	-	-	-	-	7,447 (27)	21	5	-	
	プット	23,493 (228)	347	118	-	- (-)	-	-	-	
	買建 コール	23,493 (29)	5	24	-	5,066 (8)	3	4	-	
	プット	- (-)	-	-	-	7,447 (34)	32	2	-	
	合計				51	-			266	-

- (注) 1. 括弧内には、貸借対照表に計上したオプション料を記載しています。  
2. 差損益欄には、先物取引及び先渡契約については契約額と時価との差額を記載し、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。  
3. 上表において、残存期間1年超の取引はありません。

## (e) その他

(単位:百万円)

区分	種類	平成17年度末				平成18年度末					
		契約額等	うち1年超	時価	差損益	うちヘッジ会計適用分	契約額等	うち1年超	時価	差損益	うちヘッジ会計適用分
店頭	クレジット・フォルト・スワップ プロテクション売建		5,000					4,000			
	プロテクション買建	4,000	4,000	4	4	-	6,000	6,000	16	16	-
合計		9,000	8,000	13	13	-	10,000	10,000	12	12	-

- (注) 差損益欄には、時価を記載しています。

・貸倒引当金の明細

(単位：百万円)

摘 要	平成17年度	平成18年度	増 減
(1)貸倒引当金残高			
(ア)一般貸倒引当金	5,152	6,477	1,325
(イ)個別貸倒引当金	6,016	5,056	959
(ウ)特定海外債権引当勘定	-	-	-
(2)個別貸倒引当金			
(ア)繰入額	15,046	5,064	9,981
(イ)取崩額	15,992	5,443	10,549
[償却に伴う取崩額を除く]			
(ウ)純繰入額	946	378	568
(3)特定海外債権引当勘定			
(ア)対象国数	1カ国	1カ国	
(イ)債権額	-	-	-
(ウ)繰入額	-	-	-
(エ)取崩額	-	-	-
[償却に伴う取崩額を除く]			
(4)貸付金償却	30	1,981	1,951

(注) 1. 個別貸倒引当金残高は、経営破綻の事実が発生している債務者及び実質的に経営破綻に陥っている債務者に対する債権のうち担保・保証等による回収が見込まれない部分（取立不能見込額）を直接減額したものです。なおその金額は次のとおりです。

・平成17年度末： 9,029百万円  
 ・平成18年度末： 7,606百万円

2. (3)(イ)の債権額については、対象債権の額から担保・保証等による回収可能見込額を控除した後の額を記載しています。