

平成23年度第2四半期（上半期）報告補足資料

資料中、「第2四半期（上半期）」は「4月1日～9月30日」を表しております。

・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. 個人変額保険特別勘定に関する有価証券等の時価情報		
(1) 売買目的有価証券の評価損益	13頁
(2) 金銭の信託の時価情報	13頁
(3) デリバティブ取引の時価情報	13頁
2. 個人変額年金保険特別勘定に関する有価証券等の時価情報		
(1) 売買目的有価証券の評価損益	14頁
(2) 金銭の信託の時価情報	14頁
(3) デリバティブ取引の時価情報	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	25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22年度末		平成23年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
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22年度 第2四半期(上半期)	平成23年度 第2四半期(上半期)
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22年度末		平成23年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
国 債	10,879,230	46.9	12,574,144	53.8
地 方 債	309,255	1.3	311,769	1.3
社 債	2,246,485	9.7	2,149,831	9.2
うち公社・公団債	795,308	3.4	789,914	3.4
株 式	2,538,013	10.9	2,253,770	9.6
外 国 証 券	7,035,698	30.3	5,929,734	25.3
公 社 債	5,581,739	24.1	4,475,997	19.1
株 式 等	1,453,959	6.3	1,453,736	6.2
そ の 他 の 証 券	192,683	0.8	172,632	0.7
合 計	23,201,366	100.0	23,391,884	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22年度末	平成23年度 第2四半期(上半期)末
	金 額	金 額
北 海 道	5,126	4,157
東 北	-	-
関 東	114,868	115,489
中 部	35,463	36,793
近 畿	40,284	43,243
中 国	3,017	3,224
四 国	547	272
九 州	21,158	19,543
そ の 他	88,788	89,045
合 計	309,255	311,769

（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	平成22年度末						合 計
	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)	
有 価 証 券	525,927	1,994,070	2,206,607	1,372,797	2,582,345	14,519,618	23,201,366
国 債	222,228	516,918	347,507	193,633	1,490,966	8,107,975	10,879,230
地 方 債	10,980	95,550	128,943	20,516	25,473	27,791	309,255
社 債	115,348	308,295	695,785	536,389	272,534	318,131	2,246,485
株 式	-	-	-	-	-	2,538,013	2,538,013
外 国 証 券	173,518	1,028,686	1,024,426	617,232	778,224	3,413,610	7,035,698
公 社 債	173,518	1,028,124	1,019,762	615,757	778,224	1,966,352	5,581,739
株 式 等	-	561	4,664	1,474	-	1,447,258	1,453,959
その他の証券	3,852	44,619	9,944	5,025	15,146	114,094	192,683
買入金銭債権	-	5,336	4,066	-	-	281,712	291,115
譲渡性預金	16,000	-	-	-	-	-	16,000
そ の 他	1,000	479	-	-	-	19,698	21,178
区 分	平成23年度第2四半期(上半期)末						合 計
	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)	
有 価 証 券	326,368	2,213,753	1,564,189	1,280,751	2,758,959	15,247,861	23,391,884
国 債	90,970	682,704	277,487	327,123	1,955,248	9,240,609	12,574,144
地 方 債	9,526	192,842	29,954	20,643	30,575	28,228	311,769
社 債	98,311	610,839	505,072	391,746	219,849	324,011	2,149,831
株 式	-	-	-	-	-	2,253,770	2,253,770
外 国 証 券	123,841	683,205	747,354	534,028	543,752	3,297,551	5,929,734
公 社 債	123,841	682,842	743,203	532,699	543,752	1,849,658	4,475,997
株 式 等	-	363	4,151	1,329	-	1,447,892	1,453,736
その他の証券	3,719	44,161	4,320	7,208	9,532	103,688	172,632
買入金銭債権	733	3,566	2,122	-	-	285,008	291,430
譲渡性預金	25,000	-	-	-	-	-	25,000
そ の 他	-	460	-	-	-	18,035	18,495

(注)「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号)に基づく有価証券として取り扱うものを含んでいます。

(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22年度末		平成23年度 第2四半期(上半期)末	
		金 額	占 率	金 額	占 率
水産・農林業		353	0.0	366	0.0
鉱業		438	0.0	398	0.0
建設業		52,179	2.1	47,117	2.1
製 造 業	食料品	91,758	3.6	100,597	4.5
	繊維製品	24,715	1.0	21,945	1.0
	パルプ・紙	2,804	0.1	2,820	0.1
	化学	114,109	4.5	100,587	4.5
	医薬品	39,115	1.5	31,004	1.4
	石油・石炭製品	7,059	0.3	5,559	0.2
	ゴム製品	11,305	0.4	11,408	0.5
	ガラス・土石製品	59,107	2.3	50,676	2.2
	鉄鋼	75,509	3.0	54,363	2.4
	非鉄金属	13,210	0.5	11,377	0.5
	金属製品	28,437	1.1	28,161	1.2
	機械	105,425	4.2	91,442	4.1
	電気機器	520,476	20.5	459,946	20.4
	輸送用機器	183,781	7.2	117,638	5.2
精密機器	70,905	2.8	64,398	2.9	
その他製品	56,963	2.2	50,152	2.2	
電気・ガス業		114,653	4.5	97,630	4.3
運 輸 ・ 情 報 通 信 業	陸運業	169,624	6.7	165,832	7.4
	海運業	1,134	0.0	898	0.0
	空運業	1,403	0.1	1,307	0.1
	倉庫・運輸関連業	4,443	0.2	3,617	0.2
	情報・通信業	33,539	1.3	32,504	1.4
商 業	卸売業	92,580	3.6	82,297	3.7
	小売業	69,578	2.7	68,129	3.0
金 融 ・ 保 険 業	銀行業	321,418	12.7	298,576	13.2
	証券、商品先物取引業	17,734	0.7	6,550	0.3
	保険業	179,098	7.1	175,168	7.8
	その他金融業	13,131	0.5	12,113	0.5
不動産業		18,114	0.7	13,549	0.6
サービス業		43,901	1.7	45,631	2.0
合 計		2,538,013	100.0	2,253,770	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22年度末	平成23年度 第2四半期(上半期)末
保 険 約 款 貸 付	539,497	530,600
保 険 料 振 替 貸 付	66,650	64,492
契 約 者 貸 付	472,847	466,108
一 般 貸 付	3,087,925	2,924,004
(うち非居住者貸付)	(116,056)	(100,165)
企 業 貸 付	2,648,620	2,539,263
(うち国内企業向け)	(2,595,745)	(2,486,463)
国・国際機関・政府関係機関貸付	58,213	40,337
公 共 団 体 ・ 公 企 業 貸 付	351,694	315,540
住 宅 口 ー ン	29,245	28,727
(うち信託貸付金)	(25,105)	(25,057)
消 費 者 口 ー ン	61	54
そ の 他	89	81
合 計	3,627,422	3,454,605

（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	(期間の定めのないものを含む)	
平成22年度末	変 動 金 利	33,851	71,207	34,263	31,812	10,048	25,377	206,559
	固 定 金 利	225,283	588,242	568,425	523,482	452,251	523,680	2,881,365
	一 般 貸 付 計	259,134	659,450	602,689	555,294	462,299	549,057	3,087,925
平成23年度 第2四半期 (上半期)末	変 動 金 利	40,780	59,925	27,786	22,467	7,150	25,317	183,426
	固 定 金 利	271,079	474,904	566,224	496,718	405,392	526,259	2,740,578
	一 般 貸 付 計	311,859	534,830	594,010	519,185	412,543	551,576	2,924,004

（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22年度末		平成23年度 第2四半期(上半期)末	
		金額	占 率	金額	占 率
大 企 業	貸付先数	392	51.5	351	51.5
	金 額	2,197,946	84.7	2,110,707	84.9
中 堅 企 業	貸付先数	48	6.3	43	6.3
	金 額	11,157	0.4	9,733	0.4
中 小 企 業	貸付先数	321	42.2	288	42.2
	金 額	386,641	14.9	366,022	14.7
国内企業向け 貸付計	貸付先数 金 額	761 2,595,745	100.0 100.0	682 2,486,463	100.0 100.0

（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	常用する 従業員 300名超 かつ	資本金10億円 以上	常用する 従業員 50名超 かつ	資本金10億円 以上	常用する 従業員 100名超 かつ	資本金10億円 以上	常用する 従業員 100名超 かつ	資本金10億円 以上
中 堅 企 業	300名超 かつ	資本金3億円超 10億円未満	50名超 かつ	資本金5千万円超 10億円未満	100名超 かつ	資本金5千万円超 10億円未満	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22年度末		平成23年度 第2四半期(上半期)末		
	金 額	占 率	金 額	占 率	
国内向け	製 造 業	505,762	16.4	448,447	15.3
	食 料	35,859	1.2	25,659	0.9
	織 維	5,360	0.2	5,317	0.2
	木 材 ・ 木 製 品	1,259	0.0	982	0.0
	パ ル プ ・ 紙	35,513	1.2	34,666	1.2
	印 刷	21,361	0.7	20,724	0.7
	化 学	56,092	1.8	36,102	1.2
	石 油 ・ 石 炭	24,307	0.8	24,307	0.8
	窯 業 ・ 土 石	16,866	0.5	17,772	0.6
	鉄 鋼	68,992	2.2	65,722	2.2
	非 鉄 金 属	13,591	0.4	14,487	0.5
	金 属 製 品	2,105	0.1	1,880	0.1
	はん用・生産用・業務用機械	72,143	2.3	66,062	2.3
	電 気 機 械	84,877	2.7	79,851	2.7
	輸 送 用 機 械	54,171	1.8	43,262	1.5
	そ の 他 の 製 造 業	13,259	0.4	11,647	0.4
	農 業 、 林 業	-	-	-	-
	漁 業	-	-	-	-
	鉱 業 、 採 石 業 、 砂 利 採 取 業	-	-	-	-
	建 設 業	18,220	0.6	16,630	0.6
	電 気 ・ ガ ス ・ 熱 供 給 ・ 水 道 業	366,050	11.9	331,376	11.3
	情 報 通 信 業	38,762	1.3	38,143	1.3
	運 輸 業 、 郵 便 業	249,093	8.1	247,588	8.5
	卸 売 業	543,995	17.6	546,974	18.7
	小 売 業	26,922	0.9	23,978	0.8
	金 融 業 、 保 険 業	782,920	25.4	750,177	25.7
	不 動 産 業	198,629	6.4	193,465	6.6
	物 品 賃 貸 業	162,046	5.2	150,432	5.1
	学 術 研 究 、 専 門 ・ 技 術 サ ー ビ ス 業	287	0.0	251	0.0
	宿 泊 業	1,343	0.0	1,076	0.0
	飲 食 業	1,581	0.1	1,291	0.0
生 活 関 連 サ ー ビ ス 業 ・ 娯 楽 業	3,548	0.1	3,579	0.1	
教 育 、 学 習 支 援 業	194	0.0	174	0.0	
医 療 ・ 福 祉	65	0.0	60	0.0	
そ の 他 の サ ー ビ ス	2,196	0.1	1,658	0.1	
地 方 公 共 団 体	40,273	1.3	39,151	1.3	
個 人 (住 宅 ・ 消 費 ・ 納 税 資 金 等)	29,306	0.9	28,782	1.0	
そ の 他	666	0.0	600	0.0	
合 計	2,971,868	96.2	2,823,839	96.6	
海外向け	政 府 等	63,180	2.0	47,365	1.6
	金 融 機 関	18,000	0.6	18,000	0.6
	商 工 業 等	34,875	1.1	34,799	1.2
	合 計	116,056	3.8	100,165	3.4
一 般 貸 付 計	3,087,925	100.0	2,924,004	100.0	

(注) 1. 保険約款貸付は含んでいません。
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22年度末		平成23年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
北 海 道	41,235	1.4	38,470	1.4
東 北	27,614	0.9	27,132	1.0
関 東	2,259,714	76.8	2,180,125	78.0
中 部	195,120	6.6	182,399	6.5
近 畿	287,507	9.8	231,576	8.3
中 国	38,679	1.3	39,637	1.4
四 国	21,062	0.7	20,347	0.7
九 州	71,769	2.4	75,497	2.7
合 計	2,942,704	100.0	2,795,186	100.0

(注) 1. 個人ローン、非居住者貸付、保険約款貸付等を含んでいません。
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22年度末		平成23年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
担 保 貸 付	21,452	0.7	19,663	0.7
有価証券担保貸付	3,359	0.1	2,963	0.1
不動産・動産・財団担保貸付	17,428	0.6	16,158	0.6
指名債権担保貸付	664	0.0	541	0.0
保 証 貸 付	136,593	4.4	127,566	4.4
信 用 貸 付	2,900,714	93.9	2,748,121	94.0
そ の 他	29,164	0.9	28,653	1.0
一 般 貸 付 計	3,087,925	100.0	2,924,004	100.0
うち劣後特約付貸付	383,063	12.4	387,563	13.3

(注) 保険約款貸付は含んでいません。

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22年度末		平成23年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
公 社 債	5,050,119	68.0	3,915,059	61.1
株 式	298,584	4.0	359,229	5.6
現 預 金 ・ そ の 他	86,590	1.2	211,622	3.3
小 計	5,435,294	73.2	4,485,911	70.0

円貨額が確定した外貨建資産

（単位：百万円、％）

区 分	平成22年度末		平成23年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
公 社 債	-	-	-	-
現 預 金 ・ そ の 他	180,749	2.4	165,698	2.6
小 計	180,749	2.4	165,698	2.6

円貨建資産

（単位：百万円、％）

区 分	平成22年度末		平成23年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
非 居 住 者 貸 付	116,056	1.6	100,165	1.6
公社債（円建外債）・その他	1,690,067	22.8	1,659,292	25.9
小 計	1,806,123	24.3	1,759,457	27.4

合 計

（単位：百万円、％）

海 外 投 融 資	7,422,167	100.0	6,411,066	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22年度末		平成23年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
米 ド ル	2,799,123	51.5	2,609,327	58.2
ユ ー ロ	2,022,757	37.2	1,256,037	28.0
オーストラリアドル	156,212	2.9	267,133	6.0
イギリスポンド	247,498	4.6	200,192	4.5
カナダドル	64,061	1.2	32,177	0.7
中 国 元	36,516	0.7	28,426	0.6
ニユー台湾ドル	41,755	0.8	27,690	0.6
そ の 他 共 計	5,435,294	100.0	4,485,911	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	平成22年度末							
	外国証券		公社債		株式等		非居住者貸付	
	金額	占率	金額	占率	金額	占率	金額	占率
北 米	2,804,124	39.9	2,736,626	49.0	67,497	4.6	26,800	23.1
ヨ ー ロ ッ パ	2,451,678	34.8	2,396,215	42.9	55,463	3.8	35,500	30.6
オ セ ア ニ ア	148,610	2.1	125,954	2.3	22,656	1.6	15,000	12.9
ア ジ ア	110,304	1.6	6,137	0.1	104,167	7.2	230	0.2
中 南 米	1,408,495	20.0	204,466	3.7	1,204,029	82.8	2,575	2.2
中 東	-	-	-	-	-	-	-	-
ア フ リ カ	146	0.0	-	-	146	0.0	-	-
国 際 機 関	112,338	1.6	112,338	2.0	-	-	35,950	31.0
合 計	7,035,698	100.0	5,581,739	100.0	1,453,959	100.0	116,056	100.0
区 分	平成23年度第2四半期(上半期)末							
	外国証券		公社債		株式等		非居住者貸付	
	金額	占率	金額	占率	金額	占率	金額	占率
北 米	2,584,429	43.6	2,528,366	56.5	56,063	3.9	26,800	26.8
ヨ ー ロ ッ パ	1,545,502	26.1	1,500,521	33.5	44,981	3.1	35,500	35.4
オ セ ア ニ ア	277,626	4.7	146,449	3.3	131,177	9.0	15,000	15.0
ア ジ ア	94,841	1.6	14,175	0.3	80,666	5.5	115	0.1
中 南 米	1,356,480	22.9	215,730	4.8	1,140,749	78.5	2,499	2.5
中 東	-	-	-	-	-	-	-	-
ア フ リ カ	99	0.0	-	-	99	0.0	-	-
国 際 機 関	70,754	1.2	70,754	1.6	-	-	20,250	20.2
合 計	5,929,734	100.0	4,475,997	100.0	1,453,736	100.0	100,165	100.0

(注) 地域区分は発行会社及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）（ヘッジ会計適用分・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22年度末					平成23年度第2四半期(上半期)末				
	金利関連	通貨関連	株式関連	債券関連	合計	金利関連	通貨関連	株式関連	債券関連	合計
ヘッジ会計適用分	4,554	118,807	-	-	114,253	2,036	112,171	-	-	114,207
ヘッジ会計非適用分	37	316	2,882	952	4,113	93	3,405	1,349	2,737	1,923
合 計	4,591	119,124	2,882	952	118,367	1,942	115,576	1,349	2,737	116,131

（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22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 118,807百万円）及びヘッジ会計非適用分の差損益（ 4,113百万円）の合計 122,921百万円

平成23年度第2四半期(上半期)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112,171百万円）及びヘッジ会計非適用分の差損益（1,923百万円）の合計114,094百万円

時価情報

(a) 金利関連

（単位：百万円）

区 分	種 類	平成22年度末					平成23年度第2四半期(上半期)末				
		契約額等	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
取 引 所	金利先物 売建	24,901	-	8	8	-	49,811	-	30	30	-
	買建	24,911	-	4	4	-	-	-	-	-	-
店 頭	金利スワップ 固定金利受取 / 変動金利支払	110,340	92,340	2,668	2,668	2,627	101,795	74,895	2,456	2,456	2,414
	固定金利支払 / 変動金利受取	320,000	320,000	1,926	1,926	1,926	327,500	327,500	483	483	377
合 計					4,591	4,554				1,942	2,036

（注）差損益欄には、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	平成22年度末							合計
	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		
受取側固定スワップ想定元本	18,000	58,300	25,850	8,190	-	-	110,340	
平均受取固定金利	1.26	1.22	1.55	1.67	-	-	1.34	
平均支払変動金利	0.32	0.27	0.28	0.35	-	-	0.29	
支払側固定スワップ想定元本	-	-	320,000	-	-	-	320,000	
平均支払固定金利	-	-	0.52	-	-	-	0.52	
平均受取変動金利	-	-	0.46	-	-	-	0.46	
合 計	18,000	58,300	345,850	8,190	-	-	430,340	
区 分	平成23年度第2四半期(上半期)末							合計
	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		
受取側固定スワップ想定元本	26,900	47,300	23,490	4,105	-	-	101,795	
平均受取固定金利	1.19	1.35	1.50	1.51	-	-	1.35	
平均支払変動金利	0.26	0.27	0.29	0.34	-	-	0.27	
支払側固定スワップ想定元本	-	-	322,500	-	5,000	-	327,500	
平均支払固定金利	-	-	0.52	-	1.18	-	0.53	
平均受取変動金利	-	-	0.45	-	0.31	-	0.45	
合 計	26,900	47,300	345,990	4,105	5,000	-	429,295	

(b) 通貨関連

(単位: 百万円)

区分	種類	平成22年度末				平成23年度第2四半期(上半期)末			
		契約額等	時価	差損益	うちハッジ会計 適用分	契約額等	時価	差損益	うちハッジ会計 適用分
店 頭	為替予約								
	売建	3,721,930	122,740	122,740	118,907	2,887,422	119,919	119,919	112,470
	(米ドル)	1,921,673	440	440	188	1,764,856	43,995	43,995	42,857
	(ユーロ)	1,431,460	112,654	112,654	110,345	807,209	61,097	61,097	56,336
	(イギリスポンド)	187,957	3,236	3,236	2,916	149,546	7,038	7,038	6,287
	(オーストラリアドル)	110,911	3,896	3,896	3,535	115,242	5,282	5,282	4,792
	(カナダドル)	45,996	899	899	788	22,919	871	871	761
	(スウェーデンクローナ)	12,178	835	835	802	13,438	859	859	752
	(デンマーククローネ)	6,601	438	438	386	8,432	426	426	357
	(ノルウェークローネ)	5,150	339	339	322	5,777	347	347	324
	買建	143,163	3,616	3,616	99	198,349	4,348	4,348	299
	(米ドル)	72,352	453	453	21	70,821	159	159	21
	(ユーロ)	42,672	2,138	2,138	77	55,886	3,134	3,134	277
	(オーストラリアドル)	16,921	803	803	-	45,722	787	787	-
	(イギリスポンド)	7,717	113	113	1	15,999	202	202	0
	(カナダドル)	2,869	86	86	-	7,572	35	35	-
	(スウェーデンクローナ)	253	7	7	-	1,158	21	21	-
	(デンマーククローネ)	114	5	5	-	921	-	-	-
	(ノルウェークローネ)	30	1	1	-	152	-	-	-
	(香港ドル)	228	6	6	-	114	6	6	-
(インドルピー)	3	0	0	-	-	-	-	-	
通貨オプション									
買建									
ブット	-				49,134				
(米ドル)	(-)	-	-	-	(1,047)	1,053	5	-	
(米ドル)	-				49,134				
(米ドル)	(-)	-	-	-	(1,047)	1,053	5	-	
合 計			119,124	118,807			115,576	112,171	

- (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. 各期末の為替相場は先物相場を使用しています。
3. 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。
4. 差損益欄には、先渡契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。
5. 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22年度末				平成23年度第2四半期(上半期)末			
		契約額等	時価	差損益	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 売建	14,902	2,421	2,421	-	-	-	-	-
	株価指数オプション 買建 プット	79,961 (5,162)	4,700	461	-	84,965 (4,149)	5,498	1,349	-
合計				2,882	-			1,349	-

- (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。
3. 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22年度末				平成23年度第2四半期(上半期)末				
		契約額等	時価	差損益	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	3,193	15	15	-	2,854	9	9	-	
	買建	11,932	68	68	-	-	-	-	-	
	外貨建債券先物 売建	-	-	-	-	65,153	1,007	1,007	-	
	買建	-	-	-	-	11,871	94	94	-	
	円建債券先物オプション 売建	-	-	-	-	21,100	-	-	-	
	プット	(-)	-	-	-	(10)	13	2	-	
店頭	外貨建債券先渡契約 売建	16,713	25	25	-	-	-	-	-	
	買建	16,701	17	17	-	-	-	-	-	
	債券店頭オプション 売建	-	-	-	-	-	-	-	-	
	コール	7,391 (25)	30	4	-	47,965 (125)	54	70	-	
	プット	27,173 (34)	3	31	-	115,096 (296)	323	27	-	
	買建	-	-	-	-	-	-	-	-	
	コール	27,173 (28)	24	4	-	112,596 (194)	84	110	-	
	プット	87,064 (1,026)	7	1,019	-	246,945 (2,445)	679	1,765	-	
	合計				952	-			2,737	-

- (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。
3. 上表において、残存期間1年超の取引はありません。

・特別勘定（個人変額保険・個人変額年金保険）

1. 個人変額保険特別勘定に関する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22年度末		平成23年度第2四半期(上半期)末	
	貸借対照表計上額	当期の損益に 含まれた評価損益	貸借対照表計上額	当期の損益に 含まれた評価損益
売買目的有価証券	41,985	593	37,233	1,683

(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。

(2) 金銭の信託の時価情報

平成22年度末以降期末残高がないため、記載していません。

(3) デリバティブ取引の時価情報(ヘッジ会計適用分・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22年度末					平成23年度第2四半期(上半期)末				
	金利関連	通貨関連	株式関連	債券関連	合計	金利関連	通貨関連	株式関連	債券関連	合計
ヘッジ会計適用分	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ヘッジ会計非適用分	-	1	-	-	1	-	4	-	-	4
合 計	-	1	-	-	1	-	4	-	-	4

(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22年度末				平成23年度第2四半期(上半期)末			
		契約額等	時価	差損益	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	711	15	15	-	1,124	16	16	-
	(米ドル)	383	5	5	-	757	3	3	-
	(ユーロ)	236	9	9	-	360	12	12	-
	(メキシコペソ)	-	-	-	-	5	0	0	-
	(イギリスポンド)	91	0	0	-	-	-	-	-
	買建	611	16	16	-	706	21	21	-
	(米ドル)	405	11	11	-	284	0	0	-
	(ユーロ)	50	1	1	-	245	8	8	-
	(オーストラリアドル)	-	-	-	-	55	3	3	-
	(ポーランドズロチ)	45	1	1	-	34	2	2	-
	(スウェーデンクローナ)	-	-	-	-	29	1	1	-
	(スイスフラン)	25	0	0	-	21	2	2	-
	(シンガポールドル)	19	0	0	-	17	1	1	-
(ノルウェークローネ)	13	0	0	-	12	0	0	-	
(カナダドル)	2	0	0	-	6	0	0	-	
(イギリスポンド)	47	0	0	-	-	-	-	-	
合 計			1	-			4	-	

- (注) 1. 各期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、時価を記載しています。
 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22年度末以降期末残高がないため、記載していません。

2. 個人変額年金保険特別勘定に関する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22年度末		平成23年度第2四半期(上半期)末	
	貸借対照表計上額	当期の損益に含まれた評価損益	貸借対照表計上額	当期の損益に含まれた評価損益
売買目的有価証券	150,347	5,245	132,134	10,700

(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。

(2) 金銭の信託の時価情報

平成22年度末以降期末残高がないため、記載していません。

(3) デリバティブ取引の時価情報(ヘッジ会計適用分・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22年度末					平成23年度第2四半期(上半期)末				
	金利関連	通貨関連	株式関連	債券関連	合計	金利関連	通貨関連	株式関連	債券関連	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22年度末				平成23年度第2四半期(上半期)末			
		契約額等	時価	差損益	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 (米ドル)	-	-	-	-	2	0	0	-
	買建 (米ドル)	-	-	-	-	1	0	0	-
	(カナダドル)	-	-	-	-	0	0	0	-
	合 計			-	-			0	-

- (注) 1. 各期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、時価を記載しています。
 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22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22年度末		平成23年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
現預金・コールローン	467,149	1.5	496,740	1.6
買 現 先 勘 定	-	-	-	-
債券貸借取引支払保証金	-	-	-	-
買 入 金 銭 債 権	291,115	0.9	291,430	0.9
商 品 有 価 証 券	-	-	-	-
金 銭 の 信 託	21,178	0.1	18,495	0.1
有 価 証 券	24,294,557	78.7	24,362,478	78.8
公 社 債	13,750,568	44.5	15,350,763	49.7
株 式	2,838,617	9.2	2,522,934	8.2
外 国 証 券	7,370,161	23.9	6,196,814	20.1
公 社 債	5,723,585	18.5	4,597,097	14.9
株 式 等	1,646,575	5.3	1,599,717	5.2
そ の 他 の 証 券	335,210	1.1	291,967	0.9
貸 付 金	3,627,422	11.8	3,454,605	11.2
保 険 約 款 貸 付	539,497	1.7	530,600	1.7
一 般 貸 付	3,087,925	10.0	2,924,004	9.5
不 動 産	1,290,787	4.2	1,256,345	4.1
繰 延 税 金 資 産	475,198	1.5	485,116	1.6
そ の 他	415,152	1.3	547,254	1.8
貸 倒 引 当 金	12,900	0.0	11,409	0.0
合 計	30,869,661	100.0	30,901,058	100.0
う ち 外 貨 建 資 産	5,765,641	18.7	4,751,513	15.4

(注)「不動産」については土地・建物・建設仮勘定を合計した金額を計上しています。

(2) 資産の増減

(単位：百万円)

区 分	平成22年度 第2四半期(上半期)	平成23年度 第2四半期(上半期)
現預金・コールローン	36,246	29,591
買 現 先 勘 定	-	-
債券貸借取引支払保証金	-	-
買 入 金 銭 債 権	19,408	314
商 品 有 価 証 券	-	-
金 銭 の 信 託	2,287	2,682
有 価 証 券	136,335	67,921
公 社 債	184,141	1,600,194
株 式	456,285	315,683
外 国 証 券	434,609	1,173,347
公 社 債	497,757	1,126,488
株 式 等	63,147	46,858
そ の 他 の 証 券	26,129	43,242
貸 付 金	69,738	172,816
保 険 約 款 貸 付	14,843	8,896
一 般 貸 付	54,894	163,920
不 動 産	42,374	34,441
繰 延 税 金 資 産	11,038	9,918
そ の 他	255,894	132,101
貸 倒 引 当 金	109	1,490
合 計	154,901	31,397
う ち 外 貨 建 資 産	161,601	1,014,128

(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. 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22年度末		平成23年度第2四半期(上半期)末	
	貸借対照表計上額	当期の損益に 含まれた評価損益	貸借対照表計上額	当期の損益に 含まれた評価損益
売 買 目 的 有 価 証 券	1,114,369	21,228	989,090	73,411
一 般 勘 定	21,178	1,049	18,495	1,722
特 別 勘 定	1,093,190	20,179	970,594	71,689

- (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	差 益	
				差 益	差 損
平成22年度末	満期保有目的の債券	145,823	150,247	4,424	-
	公 社 債	103,924	105,161	1,237	-
	外 国 公 社 債	41,899	45,085	3,186	-
	責任準備金対応債券	6,870,639	7,092,066	221,426	13,486
	公 社 債	6,870,639	7,092,066	221,426	13,486
	子会社・関連会社株式	20,785	42,999	22,213	10
	そ の 他 有 価 証 券	14,706,987	15,078,568	371,580	422,567
	公 社 債	6,299,209	6,460,407	161,198	12,902
	株 式	1,915,677	2,221,350	305,672	190,104
	外 国 証 券	6,088,114	5,987,731	100,383	207,259
	公 社 債	5,608,527	5,539,839	68,687	153,892
	株 式 等	479,587	447,891	31,695	53,367
	そ の 他 の 証 券	106,978	101,963	5,015	11,929
	買 入 金 銭 債 権	281,006	291,115	10,108	371
	譲 渡 性 預 金	16,000	16,000	0	-
	そ の 他	-	-	-	-
	合 計	21,744,236	22,363,881	619,644	436,065
	公 社 債	13,273,773	13,657,635	383,862	26,388
	株 式	1,915,677	2,221,350	305,672	190,104
	外 国 証 券	6,149,107	6,074,134	74,972	207,259
公 社 債	5,650,426	5,584,925	65,501	153,892	
株 式 等	498,680	489,209	9,471	53,367	
そ の 他 の 証 券	108,671	103,645	5,025	11,940	
買 入 金 銭 債 権	281,006	291,115	10,108	371	
譲 渡 性 預 金	16,000	16,000	0	-	
そ の 他	-	-	-	-	
平成23年度第2四半期(上半期)末	満期保有目的の債券	132,793	138,154	5,361	-
	公 社 債	94,221	96,419	2,197	-
	外 国 公 社 債	38,571	41,735	3,163	-
	責任準備金対応債券	7,649,141	8,194,571	545,430	358
	公 社 債	7,649,141	8,194,571	545,430	358
	子会社・関連会社株式	1,564	1,552	12	12
	そ の 他 有 価 証 券	14,151,500	14,457,037	305,536	482,575
	公 社 債	7,025,691	7,292,383	266,692	11,897
	株 式	1,831,865	1,939,077	107,212	246,858
	外 国 証 券	4,899,677	4,827,489	72,188	205,393
	公 社 債	4,445,630	4,437,425	8,204	134,182
	株 式 等	454,047	390,064	63,983	71,210
	そ の 他 の 証 券	97,764	81,655	16,109	18,398
	買 入 金 銭 債 権	271,501	291,430	19,928	27
	譲 渡 性 預 金	25,000	25,000	0	-
	そ の 他	-	-	-	-
	合 計	21,935,000	22,791,315	856,315	482,946
	公 社 債	14,769,053	15,583,374	814,320	12,255
	株 式	1,831,865	1,939,077	107,212	246,858
	外 国 証 券	4,938,249	4,869,225	69,024	205,393
公 社 債	4,484,202	4,479,161	5,041	134,182	
株 式 等	454,047	390,064	63,983	71,210	
そ の 他 の 証 券	99,329	83,207	16,121	18,411	
買 入 金 銭 債 権	271,501	291,430	19,928	27	
譲 渡 性 預 金	25,000	25,000	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年度末	平成23年度第2四半期(上半期)末
満期保有目的の債券	-	-
非上場外国公社債	-	-
その他	-	-
責任準備金対応債券	-	-
子会社・関連会社株式	202,187	329,480
非上場国内株式(店頭売買株式を除く)	182,680	182,680
非上場外国株式(店頭売買株式を除く)	12,192	139,524
その他	7,313	7,275
その他有価証券	1,190,373	1,138,707
非上場国内株式(店頭売買株式を除く)	133,982	132,012
非上場外国株式(店頭売買株式を除く)	968,050	917,929
非上場外国公社債	0	0
その他	88,340	88,764
合 計	1,392,560	1,468,188

(注) 1. 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。

2. 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うち、外国証券の為替を評価した差損益は以下のとおりです。

(平成22年度末： 5,524百万円、平成23年度第2四半期(上半期)末： 19,558百万円)

(3) 金銭の信託の時価情報

(単位：百万円)

区 分	貸借対照表計上額	時価	差損益	差損益	
				差益	差損
平成22年度末	21,178	21,178	1,049	4,705	5,755
平成23年度第2四半期(上半期)末	18,495	18,495	1,722	5,817	7,540

(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22年度末		平成23年度第2四半期(上半期)末	
	貸借対照表計上額	当期の損益に含まれた評価損益	貸借対照表計上額	当期の損益に含まれた評価損益
運用目的の金銭の信託	21,178	1,049	18,495	1,722

(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22年度末					平成23年度第2四半期(上半期)末				
	帳簿価額	時価	差損益	差損益		帳簿価額	時価	差損益	差損益	
				差益	差損				差益	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	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

(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、外貨建資産等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、貸付金の収益及び借入金の費用の安定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、現物資産等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等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 23 年度第 2 四半期(上半期)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、通貨スワップ取引
- ・株式関連：株価指数先物取引、株価指数オプション取引
- ・債券関連：債券先物取引、債券先物オプション取引、債券オプション取引、債券先渡契約取引

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等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 23 年度第 2 四半期(上半期)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・借入金をヘッジ対象、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
- ・外貨建社債をヘッジ対象、通貨スワップをヘッジ手段とする取引
- ・外貨建株式をヘッジ対象、通貨スワップ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及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等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、バリュエーション・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23年度第2四半期(上半期)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 22 年度末		平成 23 年度第 2 四半期(上半期)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	4,303	67	4,292	45
為替予約	40,983	488	33,108	1,447
通貨オプション	-	-	491	15
通貨スワップ	1,075	153	1,075	80
債券先渡し契約	334	0	-	-
債券オプション	1,488	0	5,226	11
合 計	48,184	710	44,194	1,600

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等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等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等の残高と合わせて見ることによって、現物資産等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等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

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22年度末					平成23年度第2四半期(上半期)末				
	金利関連	通貨関連	株式関連	債券関連	合計	金利関連	通貨関連	株式関連	債券関連	合計
ヘッジ会計適用分	4,554	118,807	-	-	114,253	2,036	112,171	-	-	114,207
ヘッジ会計非適用分	37	541	3,021	952	4,477	93	3,387	1,449	2,737	2,005
合 計	4,591	119,349	3,021	952	118,731	1,942	115,558	1,449	2,737	116,213

(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22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 118,807百万円)及びヘッジ会計非適用分の差損益(4,477百万円)の合計 123,285百万円

平成23年度第2四半期(上半期)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112,171百万円)及びヘッジ会計非適用分の差損益(2,005百万円)の合計114,176百万円

ヘッジ会計が適用されていないもの

(a) 金利関連

(単位:百万円)

区 分	種 類	平成22年度末				平成23年度第2四半期(上半期)末			
		契約額等	時価		差損益	契約額等	時価		差損益
			うち1年超				うち1年超		
取 引 所	金利先物 売建	24,901	-	8	8	49,811	-	30	30
	買建	24,911	-	4	4	-	-	-	-
店 頭	金利スワップ 固定金利受取/変動金利支払	1,000	1,000	40	40	1,000	1,000	42	42
	固定金利支払/変動金利受取	-	-	-	-	7,500	7,500	105	105
合 計					37				93

(注) 差損益欄には、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	平成22年度末						
	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	合計
受取側固定スワップ想定元本	-	-	1,000	-	-	-	1,000
平均受取固定金利	-	-	1.47	-	-	-	1.47
平均支払変動金利	-	-	0.19	-	-	-	0.19
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	-	-	1,000	-	-	-	1,000
区 分	平成23年度第2四半期(上半期)末						
	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	合計
受取側固定スワップ想定元本	-	-	1,000	-	-	-	1,000
平均受取固定金利	-	-	1.47	-	-	-	1.47
平均支払変動金利	-	-	0.20	-	-	-	0.20
支払側固定スワップ想定元本	-	-	2,500	-	5,000	-	7,500
平均支払固定金利	-	-	0.51	-	1.18	-	0.96
平均受取変動金利	-	-	0.35	-	0.31	-	0.32
合 計	-	-	3,500	-	5,000	-	8,500

(b) 通貨関連

(単位: 百万円)

区分	種類	平成22年度末			平成23年度第2四半期(上半期)末		
		契約額等	時価	差損益	契約額等	時価	差損益
店頭	為替予約						
	売建	228,693	4,500	4,500	365,275	8,052	8,052
	(米ドル)	141,347	815	815	231,221	1,120	1,120
	(ユーロ)	50,418	2,789	2,789	82,282	5,344	5,344
	(イギリスポンド)	14,334	306	306	17,646	767	767
	(オーストラリアドル)	17,343	366	366	16,974	490	490
	(カナダドル)	3,561	113	113	11,639	118	118
	(デンマーククローネ)	641	52	52	2,449	69	69
	(スウェーデンクローナ)	533	34	34	2,052	107	107
	(ノルウェークローネ)	253	16	16	874	22	22
	(メキシコペソ)	243	6	6	114	10	10
	(スイスフラン)	-	-	-	11	0	0
	(シンガポールドル)	3	0	0	4	0	0
	(ポーランドズロチ)	13	0	0	4	0	0
	買建	158,375	3,959	3,959	212,407	4,671	4,671
	(米ドル)	82,040	718	718	79,091	84	84
	(ユーロ)	44,275	2,151	2,151	56,476	3,161	3,161
	(オーストラリアドル)	16,925	803	803	47,241	898	898
	(イギリスポンド)	9,043	115	115	16,414	209	209
	(カナダドル)	2,922	87	87	7,670	36	36
	(スウェーデンクローナ)	253	7	7	1,963	65	65
	(ポーランドズロチ)	1,109	29	29	931	74	74
	(デンマーククローネ)	114	5	5	921	-	-
	(スイスフラン)	620	15	15	603	79	79
	(ノルウェークローネ)	357	9	9	503	23	23
	(シンガポールドル)	480	9	9	477	33	33
(香港ドル)	228	6	6	114	6	6	
(メキシコペソ)	0	0	0	0	0	0	
(インドルピー)	3	0	0	-	-	-	
通貨オプション							
買建							
ブット	-	-	-	49,134	-	-	
(米ドル)	(-)	-	-	(1,047)	1,053	5	
	-	-	-	49,134	-	-	
	(-)	-	-	(1,047)	1,053	5	
合計			541			3,387	

- (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. 各期末の為替相場は先物相場を使用しています。
3. 差損益欄には、先渡契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。
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22年度末			平成23年度第2四半期(上半期)末		
		契約額等	時価	差損益	契約額等	時価	差損益
取引所	円建株価指数先物						
	売建	14,902	2,421	2,421	-	-	-
	買建	13,798	184	184	9,023	164	164
	外貨建株価指数先物						
	買建	1,960	45	45	3,666	65	65
所	株価指数オプション						
	買建 プット	79,961 (5,162)	4,700	461	84,965 (4,149)	5,498	1,349
合計				3,021			1,449

- (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。
3. 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22年度末			平成23年度第2四半期(上半期)末		
		契約額等	時価	差損益	契約額等	時価	差損益
取引所	円建債券先物						
	売建	3,193	15	15	2,854	9	9
	買建	11,932	68	68	-	-	-
	外貨建債券先物						
	売建 買建	- -	- -	- -	65,153 11,871	1,007 94	1,007 94
所	円建債券先物オプション						
	売建 プット	- (-)	-	-	21,100 (10)	13	2
店頭	外貨建債券先渡契約						
	売建	16,713	25	25	-	-	-
	買建	16,701	17	17	-	-	-
	債券店頭オプション						
	売建						
	コール	7,391 (25)	30	4	47,965 (125)	54	70
	プット	27,173 (34)	3	31	115,096 (296)	323	27
	買建						
	コール	27,173 (28)	24	4	112,596 (194)	84	110
	プット	87,064 (1,026)	7	1,019	246,945 (2,445)	679	1,765
合計				952			2,737

- (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。
3. 上表において、残存期間1年超の取引はありません。

ヘッジ会計が適用されているもの

(a) 金利関連 (平成22年度末)

(単位:百万円)

ヘッジ会計の方法	種類	主なヘッジ対象	契約額等		時価	差損益
				うち1年超		
原則的処理方法	金利スワップ 固定金利受取 / 変動金利支払	貸付金	5,000	-	18	18
	固定金利支払 / 変動金利受取	借入金	320,000	320,000	1,926	1,926
金利スワップの特例処理	金利スワップ 固定金利受取 / 変動金利支払	貸付金	104,340	91,340	2,609	2,609
合 計						4,554

(注) 差損益欄には、時価を記載しています。

(a) 金利関連 (平成23年度第2四半期(上半期)末)

(単位:百万円)

ヘッジ会計の方法	種類	主なヘッジ対象	契約額等		時価	差損益
				うち1年超		
原則的処理方法	金利スワップ 固定金利受取 / 変動金利支払	貸付金	-	-	-	-
	固定金利支払 / 変動金利受取	借入金	320,000	320,000	377	377
金利スワップの特例処理	金利スワップ 固定金利受取 / 変動金利支払	貸付金	100,795	73,895	2,414	2,414
合 計						2,036

(注) 差損益欄には、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	平成22年度末						
	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	合計
受取側固定スワップ想定元本	18,000	58,300	24,850	8,190	-	-	109,340
平均受取固定金利	1.26	1.22	1.56	1.67	-	-	1.34
平均支払変動金利	0.32	0.27	0.28	0.35	-	-	0.29
支払側固定スワップ想定元本	-	-	320,000	-	-	-	320,000
平均支払固定金利	-	-	0.52	-	-	-	0.52
平均受取変動金利	-	-	0.46	-	-	-	0.46
合 計	18,000	58,300	344,850	8,190	-	-	429,340
区 分	平成23年度第2四半期(上半期)末						
	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	合計
受取側固定スワップ想定元本	26,900	47,300	22,490	4,105	-	-	100,795
平均受取固定金利	1.19	1.35	1.51	1.51	-	-	1.35
平均支払変動金利	0.26	0.27	0.29	0.34	-	-	0.28
支払側固定スワップ想定元本	-	-	320,000	-	-	-	320,000
平均支払固定金利	-	-	0.52	-	-	-	0.52
平均受取変動金利	-	-	0.45	-	-	-	0.45
合 計	26,900	47,300	342,490	4,105	-	-	420,795

(b) 通貨関連 (平成22年度末)

(単位:百万円)

ヘッジ会計の方法	種類	主なヘッジ対象	契約額等		時価	差損益
				うち1年超		
ヘッジ対象に係る損益を認識する方法	為替予約	外貨建債券				
	売建		3,526,926	-	118,907	118,907
	(米ドル)		1,796,391	-	188	188
	(ユーロ)		1,394,184	-	110,345	110,345
	(イギリスポンド)		177,162	-	2,916	2,916
	(オーストラリアドル)		93,764	-	3,535	3,535
	(カナダドル)		42,809	-	788	788
	(スウェーデンクローナ)		11,745	-	802	802
	(デンマーククローネ)		5,968	-	386	386
	(ノルウェークローネ)		4,899	-	322	322
	買建		3,999	-	99	99
	(米ドル)		2,519	-	21	21
	(ユーロ)		1,432	-	77	77
(イギリスポンド)	48	-	1	1		
為替予約等の振当処理	為替予約	外貨建定期預金				
	売建		180,356	-	-	-
	(オーストラリアドル)		140,354	-	-	-
	(米ドル)		40,001	-	-	-
通貨スワップ	外貨建社債 (負債)	107,562	107,562	-	-	
(米ドル)		107,562	107,562	-	-	
合 計						118,807

- (注) 1. 年度末の為替相場は先物相場を使用しています。
2. 為替予約及び通貨スワップの振当処理によるものは、ヘッジ対象とされている外貨建定期預金及び外貨建社債(負債)と一体処理されているため、その時価は、当該外貨建定期預金及び外貨建社債(負債)の時価に含めて記載しています。
3. 差損益欄には、為替予約の時価を記載しています(上記2.を除く)。

(b) 通貨関連 (平成23年度第2四半期(上半期)末)

(単位:百万円)

ヘッジ会計の方法	種類	主なヘッジ対象	契約額等		時価	差損益
				うち1年超		
ヘッジ対象に係る損益を認識する方法	為替予約	外貨建債券				
	売建		2,559,598	-	112,470	112,470
	(米ドル)		1,557,242	-	42,857	42,857
	(ユーロ)		737,899	-	56,336	56,336
	(イギリスポンド)		132,432	-	6,287	6,287
	(オーストラリアドル)		98,281	-	4,792	4,792
	(カナダドル)		11,460	-	761	761
	(スウェーデンクローナ)		11,391	-	752	752
	(デンマーククローネ)		5,983	-	357	357
	(ノルウェークローネ)		4,906	-	324	324
	買建		8,341	-	299	299
	(ユーロ)		6,779	-	277	277
	(米ドル)		1,539	-	21	21
(イギリスポンド)	23	-	0	0		
為替予約等の振当処理	為替予約	外貨建定期預金				
	売建		165,256	-	-	-
	(オーストラリアドル)		115,257	-	-	-
	(米ドル)		49,998	-	-	-
通貨スワップ	外貨建社債 (負債)	107,562	107,562	-	-	
(米ドル)		107,562	107,562	-	-	
合 計						112,171

- (注) 1. 期末の為替相場は先物相場を使用しています。
2. 為替予約及び通貨スワップの振当処理によるものは、ヘッジ対象とされている外貨建定期預金及び外貨建社債(負債)と一体処理されているため、その時価は、当該外貨建定期預金及び外貨建社債(負債)の時価に含めて記載しています。
3. 差損益欄には、為替予約の時価を記載しています(上記2.を除く)。

(c) 株式関連、(d) 債券関連は平成22年度末以降期末残高がないため、記載していません。

・貸倒引当金の明細

(単位：百万円)

摘 要	平成22年度末	平成23年度 第2四半期(上半期)末	増 減
(1)貸倒引当金残高			
(ア)一般貸倒引当金	4,480	3,063	1,416
(イ)個別貸倒引当金	8,419	8,345	74
(ウ)特定海外債権引当勘定	-	-	-
(2)個別貸倒引当金			
(ア)繰入額	8,435	8,361	73
(イ)取崩額	9,127	8,409	717
[償却に伴う取崩額を除く]			
(ウ)純繰入額	691	47	644
(3)特定海外債権引当勘定			
(ア)対象国数	-	-	-
(イ)債権額	-	-	-
(ウ)繰入額	-	-	-
(イ)取崩額	-	-	-
[償却に伴う取崩額を除く]			
(4)貸付金償却	410	116	294

(注) 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について、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)を債権額から直接減額した金額は、以下のとおりです。

- ・平成22年度末 : 3,832百万円
- ・平成23年度第2四半期(上半期)末 : 1,737百万円