

## 平成25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）

平成24年度末、平成25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）商品有価証券売買高（一般勘定）

平成24年度第2四半期(上半期)、平成25年度第2四半期(上半期)ともに売買高がないため、記載していません。

### 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24年度末		平成25年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
国 債	14,044,285	53.9	14,077,173	53.4
地 方 債	290,122	1.1	254,944	1.0
社 債	2,092,989	8.0	2,036,916	7.7
うち公社・公団債	804,745	3.1	803,383	3.0
株 式	2,557,413	9.8	2,863,899	10.9
外 国 証 券	6,816,213	26.1	6,844,585	25.9
公 社 債	5,187,604	19.9	5,212,095	19.8
株 式 等	1,628,609	6.2	1,632,489	6.2
そ の 他 の 証 券	278,845	1.1	306,530	1.2
合 計	26,079,870	100.0	26,384,049	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24年度末	平成25年度 第2四半期(上半期)末
	金 額	金 額
北 海 道	4,262	3,728
東 北	-	-
関 東	103,310	93,648
中 部	35,379	41,676
近 畿	34,428	21,828
中 国	2,435	2,430
四 国	-	-
九 州	21,259	23,627
そ の 他	89,045	68,003
合 計	290,122	254,944

（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24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	736,436	1,845,940	2,108,859	1,263,390	1,603,794	18,521,448	26,079,870
国 債	383,554	325,713	315,566	432,510	713,075	11,873,865	14,044,285
地 方 債	74,602	127,393	20,947	7,204	26,421	33,552	290,122
社 債	161,477	602,704	610,501	220,845	124,088	373,372	2,092,989
株 式	-	-	-	-	-	2,557,413	2,557,413
外 国 証 券	112,149	748,008	1,147,189	589,116	726,129	3,493,621	6,816,213
公 社 債	110,307	739,444	1,136,140	584,458	724,470	1,892,782	5,187,604
株 式 等	1,841	8,564	11,049	4,657	1,659	1,600,838	1,628,609
その他の証券	4,653	42,120	14,654	13,714	14,080	189,622	278,845
買入金銭債権	-	1,215	12,623	-	-	269,265	283,103
譲渡性預金	34,999	-	-	-	-	-	34,999
そ の 他	-	-	-	-	-	24,071	24,071
区 分	平成25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	998,444	1,722,455	2,098,059	1,176,469	1,159,590	19,229,030	26,384,049
国 債	327,508	240,410	444,051	376,636	278,247	12,410,318	14,077,173
地 方 債	119,217	29,471	21,123	14,114	21,150	49,866	254,944
社 債	398,794	438,437	438,306	180,102	157,676	423,599	2,036,916
株 式	-	-	-	-	-	2,863,899	2,863,899
外 国 証 券	142,939	958,691	1,188,038	594,296	685,878	3,274,740	6,844,585
公 社 債	141,894	948,898	1,180,077	588,122	682,991	1,670,112	5,212,095
株 式 等	1,045	9,792	7,961	6,174	2,886	1,604,628	1,632,489
その他の証券	9,985	55,444	6,538	11,319	16,639	206,604	306,530
買入金銭債権	-	887	17,786	-	-	259,244	277,918
譲渡性預金	-	-	-	-	-	-	-
そ の 他	-	-	-	-	-	28,443	28,443

(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24年度末		平成25年度 第2四半期(上半期)末		
	金 額	占 率	金 額	占 率	
水産・農林業	142	0.0	134	0.0	
鉱業	200	0.0	200	0.0	
建設業	62,613	2.4	68,663	2.4	
製 造 業	食料品	130,185	5.1	139,997	4.9
	繊維製品	21,494	0.8	22,582	0.8
	パルプ・紙	2,450	0.1	2,510	0.1
	化学	113,488	4.4	127,125	4.4
	医薬品	38,999	1.5	43,797	1.5
	石油・石炭製品	4,504	0.2	4,535	0.2
	ゴム製品	19,844	0.8	24,718	0.9
	ガラス・土石製品	57,564	2.3	82,320	2.9
	鉄鋼	58,940	2.3	82,867	2.9
	非鉄金属	9,123	0.4	11,884	0.4
	金属製品	31,602	1.2	35,316	1.2
	機械	120,944	4.7	157,232	5.5
	電気機器	398,673	15.6	423,279	14.8
	輸送用機器	159,278	6.2	193,826	6.8
	精密機器	58,875	2.3	70,095	2.4
	その他製品	55,442	2.2	64,437	2.3
電気・ガス業	91,866	3.6	103,111	3.6	
運 輸 ・ 情 報 通 信 業	陸運業	243,019	9.5	252,034	8.8
	海運業	158	0.0	185	0.0
	空運業	1,081	0.0	4,744	0.2
	倉庫・運輸関連業	5,337	0.2	5,626	0.2
	情報・通信業	39,458	1.5	51,411	1.8
商 業	卸売業	104,535	4.1	113,407	4.0
	小売業	87,778	3.4	100,072	3.5
金 融 ・ 保 険 業	銀行業	343,376	13.4	363,437	12.7
	証券、商品先物取引業	10,761	0.4	12,176	0.4
	保険業	176,863	6.9	180,750	6.3
	その他金融業	19,288	0.8	19,344	0.7
不動産業	24,291	0.9	29,430	1.0	
サービス業	65,226	2.6	72,640	2.5	
合 計	2,557,413	100.0	2,863,899	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24年度末	平成25年度 第2四半期(上半期)末
保 険 約 款 貸 付	480,229	469,248
保 険 料 振 替 貸 付	54,293	52,486
契 約 者 貸 付	425,936	416,762
一 般 貸 付	2,659,441	2,612,475
(うち非居住者貸付)	(76,772)	(77,446)
企 業 貸 付	2,307,261	2,240,578
(うち国内企業向け)	(2,259,689)	(2,192,331)
国・国際機関・政府関係機関貸付	28,978	27,880
公 共 団 体 ・ 公 企 業 貸 付	320,822	341,999
住 宅 口 ー ン	2,277	1,938
(うち信託貸付金)	(-)	(-)
消 費 者 口 ー ン	45	32
そ の 他	55	45
合 計	3,139,671	3,081,724

#### (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24年度末	変 動 金 利	43,605	31,425	10,769	4,052	6,329	183	96,366
	固 定 金 利	224,948	512,181	514,960	402,274	341,178	567,531	2,563,075
	一般貸付計	268,553	543,607	525,730	406,327	347,507	567,715	2,659,441
平成25年度 第2四半期 (上半期)末	変 動 金 利	19,652	25,457	11,656	8,194	1,000	-	65,961
	固 定 金 利	193,495	471,583	484,770	340,754	441,925	613,982	2,546,513
	一般貸付計	213,148	497,041	496,427	348,949	442,925	613,982	2,612,475

#### (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24年度末		平成25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	275	55.7	254	63.0
	金 額	1,960,924	86.8	1,909,459	87.1
中 堅 企 業	貸付先数	16	3.2	13	3.2
	金 額	4,452	0.2	1,794	0.1
中 小 企 業	貸付先数	203	41.1	136	33.7
	金 額	294,311	13.0	281,076	12.8
国内企業向け 貸付計	貸付先数	494	100.0	403	100.0
	金 額	2,259,689	100.0	2,192,331	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		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 かつ 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24年度末		平成25年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
製 造 業	381,556	14.3	358,336	13.7
食 料	28,165	1.1	23,597	0.9
織 維	5,647	0.2	5,642	0.2
木 材 ・ 木 製 品	492	0.0	455	0.0
パ ル プ ・ 紙	34,362	1.3	29,136	1.1
印 刷	18,828	0.7	18,196	0.7
化 学	25,850	1.0	23,348	0.9
石 油 ・ 石 炭	21,199	0.8	21,199	0.8
窯 業 ・ 土 石	22,962	0.9	30,757	1.2
鉄 鋼	67,476	2.5	62,338	2.4
非 鉄 金 属	13,943	0.5	12,844	0.5
金 属 製 品	599	0.0	1,004	0.0
はん用・生産用・業務用機械	44,690	1.7	46,408	1.8
電 気 機 械	52,789	2.0	44,960	1.7
輸 送 用 機 械	34,247	1.3	34,370	1.3
そ の 他 の 製 造 業	10,301	0.4	4,078	0.2
農 業 、 林 業	-	-	-	-
漁 業	-	-	-	-
鉱業、採石業、砂利採取業	-	-	-	-
建 設 業	12,730	0.5	11,589	0.4
電 気 ・ ガ ス ・ 熱 供 給 ・ 水 道 業	352,184	13.2	410,571	15.7
情 報 通 信 業	37,031	1.4	34,146	1.3
運 輸 業 、 郵 便 業	241,553	9.1	237,258	9.1
卸 売 業	525,587	19.8	504,692	19.3
小 売 業	13,651	0.5	11,675	0.4
金 融 業 、 保 険 業	703,426	26.5	665,890	25.5
不 動 産 業	145,227	5.5	147,160	5.6
物 品 賃 貸 業	126,126	4.7	112,614	4.3
学術研究、専門・技術サービス業	216	0.0	173	0.0
宿 泊 業	626	0.0	428	0.0
飲 食 業	91	0.0	57	0.0
生活関連サービス業・娯楽業	3,442	0.1	3,069	0.1
教 育 、 学 習 支 援 業	55	0.0	45	0.0
医 療 ・ 福 祉	8	0.0	-	-
そ の 他 の サ ー ビ ス	500	0.0	248	0.0
地 方 公 共 団 体	35,795	1.3	34,632	1.3
個人(住宅・消費・納税資金等)	2,323	0.1	1,971	0.1
そ の 他	533	0.0	466	0.0
合 計	2,582,669	97.1	2,535,028	97.0
海 外 向 け				
政 府 等	29,200	1.1	29,200	1.1
金 融 機 関	13,000	0.5	13,000	0.5
商 工 業 等	34,572	1.3	35,246	1.3
合 計	76,772	2.9	77,446	3.0
一 般 貸 付 計	2,659,441	100.0	2,612,475	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24年度末		平成25年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
北 海 道	33,283	1.3	37,174	1.5
東 北	34,524	1.3	34,333	1.4
関 東	2,026,369	78.5	1,933,815	76.3
中 部	176,201	6.8	191,107	7.5
近 畿	163,883	6.4	181,526	7.2
中 国	47,144	1.8	43,686	1.7
四 国	18,584	0.7	18,322	0.7
九 州	80,444	3.1	93,090	3.7
合 計	2,580,434	100.0	2,533,057	100.0

- (注) 1. 個人ローン、非居住者貸付、保険約款貸付等は含んでいません。  
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24年度末		平成25年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
担 保 貸 付	14,467	0.5	13,443	0.5
有価証券担保貸付	2,526	0.1	2,989	0.1
不動産・動産・財団担保貸付	11,915	0.4	10,441	0.4
指名債権担保貸付	25	0.0	11	0.0
保 証 貸 付	75,428	2.8	79,646	3.0
信 用 貸 付	2,567,310	96.5	2,517,414	96.4
そ の 他	2,234	0.1	1,971	0.1
一 般 貸 付 計	2,659,441	100.0	2,612,475	100.0
うち劣後特約付貸付	394,063	14.8	385,563	14.8

- (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24年度末		平成25年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
公 社 債	4,599,711	63.5	4,609,120	61.2
株 式	578,443	8.0	595,515	7.9
現 預 金 ・ そ の 他	84,537	1.2	179,637	2.4
小 計	5,262,693	72.6	5,384,274	71.5

###### 円貨額が確定した外貨建資産

（単位：百万円、％）

区 分	平成24年度末		平成25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	265,747	3.7	422,746	5.6
小 計	265,747	3.7	422,746	5.6

###### 円貨建資産

（単位：百万円、％）

区 分	平成24年度末		平成25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	76,772	1.1	77,446	1.0
公 社 債 ( 円 建 外 債 ) ・ そ の 他	1,640,811	22.6	1,643,427	21.8
小 計	1,717,584	23.7	1,720,874	22.9

###### 合 計

（単位：百万円、％）

海 外 投 融 資	7,246,024	100.0	7,527,895	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24年度末		平成25年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
米 ド ル	2,917,558	55.4	2,721,993	50.6
ユ ー ロ	1,192,874	22.7	1,465,124	27.2
オーストラリアドル	360,853	6.9	460,740	8.6
イギリスポンド	308,824	5.9	295,892	5.5
ポーランドズロチ	33,324	0.6	64,611	1.2
カナダドル	80,632	1.5	45,099	0.8
中 国 元	42,286	0.8	43,451	0.8
そ の 他 共 計	5,262,693	100.0	5,384,274	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24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	2,766,648	40.6	2,600,067	50.1	166,581	10.2	26,800	34.9
ヨ ー ロ ッ パ	1,769,424	26.0	1,675,765	32.3	93,658	5.8	18,500	24.1
オ セ ア ニ ア	439,243	6.4	284,205	5.5	155,038	9.5	10,000	13.0
ア ジ ア	174,190	2.6	64,562	1.2	109,628	6.7	-	-
中 南 米	1,470,837	21.6	367,362	7.1	1,103,475	67.8	2,272	3.0
中 東	-	-	-	-	-	-	-	-
ア フ リ カ	18,087	0.3	17,860	0.3	227	0.0	-	-
国 際 機 関	177,781	2.6	177,781	3.4	-	-	19,200	25.0
合 計	6,816,213	100.0	5,187,604	100.0	1,628,609	100.0	76,772	100.0
区 分	平成25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	2,510,537	36.7	2,336,563	44.8	173,973	10.7	26,800	34.6
ヨ ー ロ ッ パ	1,990,858	29.1	1,863,121	35.7	127,737	7.8	23,500	30.3
オ セ ア ニ ア	527,916	7.7	370,472	7.1	157,444	9.6	5,000	6.5
ア ジ ア	145,130	2.1	46,204	0.9	98,925	6.1	750	1.0
中 南 米	1,473,991	21.5	399,756	7.7	1,074,235	65.8	2,196	2.8
中 東	-	-	-	-	-	-	-	-
ア フ リ カ	29,283	0.4	29,110	0.6	173	0.0	-	-
国 際 機 関	166,865	2.4	166,865	3.2	-	-	19,200	24.8
合 計	6,844,585	100.0	5,212,095	100.0	1,632,489	100.0	77,446	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24年度末					平成25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	857	145,879	13,541	-	160,279	486	6,223	17,280	-	23,989
ヘッジ会計非適用分	420	15,335	-	189	14,726	1,567	6,311	5	2,675	10,559
合 計	437	161,215	13,541	189	175,005	2,053	12,534	17,285	2,675	34,549

（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24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 144,739百万円、株式関連 13,541百万円）及びヘッジ会計非適用分の差損益（14,726百万円）の合計 173,007百万円  
 平成25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 4,898百万円、株式関連 17,280百万円）及びヘッジ会計非適用分の差損益（10,559百万円）の合計 32,738百万円

### 時価情報

（a）金利関連

（単位：百万円）

区 分	種 類	平成24年度末					平成25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
			うち1年超					うち1年超			
取 引 所	金利先物 売建	23,451	-	3	3	-	-	-	-	-	-
	買建	-	-	-	-	-	64,839	-	10	10	-
店 頭	金利スワップ 固定金利受取 / 変動金利支払	70,110	34,210	1,426	1,426	928	53,515	34,515	1,100	1,100	648
	固定金利支払 / 変動金利受取	323,700	323,700	1,860	1,860	1,786	326,100	326,100	1,240	1,240	1,134
	金利スワップション 買建	-	-	-	-	-	281,000	280,000	5,280	1,924	-
	固定金利支払 / 変動金利受取	(-)	(-)	-	-	-	(7,204)	(7,203)			
合 計					437	857				2,053	486

（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、先物取引及びスワップ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。

（参考）金利スワップ残存期間別残高

（単位：百万円、%）

区 分	平成24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	35,900	25,460	7,850	-	-	900	70,110	
平均受取固定金利	1.20	1.55	1.69	-	-	2.01	1.40	
平均支払変動金利	0.24	0.23	0.28	-	-	0.26	0.24	
支払側固定スワップ想定元本	-	322,500	-	-	-	1,200	323,700	
平均支払固定金利	-	0.52	-	-	-	1.71	0.53	
平均受取変動金利	-	0.43	-	-	-	0.23	0.43	
合 計	35,900	347,960	7,850	-	-	2,100	393,810	
区 分	平成25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	19,000	23,250	3,765	2,000	4,600	900	53,515	
平均受取固定金利	1.65	1.50	1.54	0.63	0.98	2.01	1.49	
平均支払変動金利	0.18	0.20	0.23	0.22	0.22	0.22	0.20	
支払側固定スワップ想定元本	-	322,500	-	-	-	3,600	326,100	
平均支払固定金利	-	0.52	-	-	-	1.73	0.54	
平均受取変動金利	-	0.35	-	-	-	0.23	0.35	
合 計	19,000	345,750	3,765	2,000	4,600	4,500	379,615	

## (b) 通貨関連

(単位：百万円)

区分	種類	平成24年度末				平成25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	3,665,450	160,004	160,004	145,161	3,479,565	7,414	7,414	4,941
	(米ドル)	2,130,913	150,058	150,058	138,325	1,804,817	6,716	6,716	5,967
	(ユーロ)	871,332	7,041	7,041	4,347	1,063,802	3,376	3,376	1,688
	(オーストラリアドル)	121,945	1,747	1,747	1,348	194,140	2,096	2,096	1,251
	(イギリスポンド)	205,491	530	530	188	168,163	8,130	8,130	7,543
	(カナダドル)	35,834	13	13	17	21,745	48	48	49
	(その他)	299,933	640	640	968	226,894	478	478	376
	買建	1,087,801	70	70	421	1,128,975	3,990	3,990	42
	(米ドル)	544,056	1,576	1,576	462	565,113	3,825	3,825	37
	(ユーロ)	171,238	1,698	1,698	25	209,212	232	232	73
	(カナダドル)	21,258	0	0	-	80,757	199	199	2
	(オーストラリアドル)	58,264	6	6	1	59,972	29	29	4
	(イギリスポンド)	29,272	260	260	7	45,334	738	738	0
	(その他)	263,710	214	214	6	168,584	500	500	0
	通貨オプション								
	売建								
	コール	-	-	-	-	187,980			
	(米ドル)	(-)	-	-	-	(1,682)	480	1,201	-
	買建								
コール	-	-	-	-	96,782				
(米ドル)	(-)	-	-	-	(1,755)	747	1,008	-	
通貨スワップ									
(米ドル)	9,877	1,139	1,139	1,139	22,295	1,324	1,324	1,324	
合計			161,215	145,879			12,534	6,223	

(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、先渡契約及びスワップ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。

5. 上表において、残存期間1年超の取引はありません(通貨スワップ取引除く)。

## (c) 株式関連

(単位：百万円)

区分	種類	平成24年度末				平成25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	-	-	-	-	29,964	3	3	-
	株価指数オプション 売建	-	-	-	-	39,974	618	224	-
	コール	(-)	-	-	-	(843)			
	買建 コール	- (-)	- -	- -	- -	19,981 (1,073)	840	233	-
店頭	国内株式先渡契約 売建	34,949	13,541	13,541	13,541	48,408	17,280	17,280	17,280
合計				13,541	13,541			17,285	17,280

- (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。

## (d) 債券関連

(単位：百万円)

区分	種類	平成24年度末				平成25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	12,759	40	40	-	-	-	-	-
	買建	-	-	-	-	34,434	298	298	-
	外貨建債券先物 売建	-	-	-	-	110,894	851	851	-
	買建	-	-	-	-	495,470	4,381	4,381	-
店頭	円建債券先物オプション 売建 プット	42,850 (17)	24	6	-	- (-)	-	-	-
	外貨建債券先渡契約 売建	-	-	-	-	11,113	486	486	-
	買建	-	-	-	-	130,738	2,494	2,494	-
	債券店頭オプション 売建 コール	6,175 (22)	81	59	-	336,183 (7,432)	6,974	458	-
店頭	プット	65,258 (80)	46	34	-	9,391 (20)	3	16	-
	買建 コール	65,258 (58)	319	260	-	9,391 (14)	29	14	-
	プット	6,175 (27)	29	1	-	336,183 (10,713)	1,711	9,001	-
	合計			189	-			2,675	-

- (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24年度末		平成25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	46,187	5,083	49,346	804

(2) 金銭の信託の時価情報

平成24年度末、平成25年度第2四半期(上半期)末ともに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24年度末					平成25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	-	8	-	-	8
合 計	-	1	-	-	1	-	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24年度末				平成25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	504	4	4	-	1,087	9	9	-
	(米ドル)	313	1	1	-	771	12	12	-
	(ユーロ)	33	0	0	-	171	0	0	-
	(イギリスポンド)	156	2	2	-	144	2	2	-
	(オーストラリアドル)	-	-	-	-	0	0	0	-
	(カナダドル)	-	-	-	-	0	0	0	-
	(その他)	1	0	0	-	0	0	0	-
	買建	920	3	3	-	1,012	1	1	-
	(ユーロ)	297	0	0	-	561	0	0	-
	(米ドル)	291	0	0	-	176	2	2	-
	(カナダドル)	159	3	3	-	151	0	0	-
	(イギリスポンド)	56	0	0	-	-	-	-	-
	(オーストラリアドル)	4	0	0	-	-	-	-	-
	(その他)	110	0	0	-	123	1	1	-
	合 計			1	-			8	-

(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24年度末、平成25年度第2四半期(上半期)末ともに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24年度末		平成25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	139,125	24,716	127,807	6,729

### (2) 金銭の信託の時価情報

平成24年度末、平成25年度第2四半期(上半期)末ともに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24年度末					平成25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	-	0	-	-	0
合 計	-	0	-	-	0	-	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24年度末				平成25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	10	0	0	-	19	0	0	-
	(米ドル)	6	0	0	-	12	0	0	-
	(ユーロ)	4	0	0	-	6	0	0	-
	(イギリスポンド)	-	-	-	-	0	0	0	-
	(オーストラリアドル)	-	-	-	-	0	-	-	-
	(カナダドル)	-	-	-	-	0	0	0	-
	(その他)	0	0	0	-	0	0	0	-
	買建	129	0	0	-	18	0	0	-
	(ユーロ)	32	0	0	-	12	0	0	-
	(米ドル)	74	0	0	-	6	0	0	-
	(イギリスポンド)	11	0	0	-	-	-	-	-
	(カナダドル)	3	0	0	-	-	-	-	-
	(オーストラリアドル)	2	0	0	-	-	-	-	-
	(その他)	5	0	0	-	-	-	-	-
	合 計			0	-			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24年度末、平成25年度第2四半期(上半期)末ともに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24年度末		平成25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	729,401	2.2	728,539	2.2
買 現 先 勘 定	-	-	-	-
債券貸借取引支払保証金	-	-	-	-
買 入 金 銭 債 権	283,103	0.9	277,918	0.8
商 品 有 価 証 券	-	-	-	-
金 銭 の 信 託	24,071	0.1	28,443	0.1
有 価 証 券	27,161,984	82.1	27,507,357	82.2
公 社 債	16,751,267	50.7	16,698,812	49.9
株 式	2,842,790	8.6	3,160,169	9.4
外 国 証 券	7,165,487	21.7	7,230,158	21.6
公 社 債	5,340,201	16.1	5,389,537	16.1
株 式 等	1,825,286	5.5	1,840,621	5.5
そ の 他 の 証 券	402,437	1.2	418,217	1.2
貸 付 金	3,139,671	9.5	3,081,724	9.2
保 険 約 款 貸 付	480,229	1.5	469,248	1.4
一 般 貸 付	2,659,441	8.0	2,612,475	7.8
不 動 産	1,224,473	3.7	1,208,534	3.6
繰 延 税 金 資 産	65,570	0.2	62,972	0.2
そ の 他	448,323	1.4	580,905	1.7
貸 倒 引 当 金	4,109	0.0	1,704	0.0
合 計	33,072,490	100.0	33,474,690	100.0
う ち 外 貨 建 資 産	5,615,234	17.0	5,764,738	17.2

(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24年度 第2四半期(上半期)	平成25年度 第2四半期(上半期)
	現預金・コールローン	72,076
買 現 先 勘 定	-	-
債券貸借取引支払保証金	-	-
買 入 金 銭 債 権	1,851	5,185
商 品 有 価 証 券	-	-
金 銭 の 信 託	2,155	4,371
有 価 証 券	57,182	345,373
公 社 債	514,250	52,455
株 式	287,766	317,378
外 国 証 券	152,012	64,670
公 社 債	96,562	49,336
株 式 等	55,450	15,334
そ の 他 の 証 券	17,289	15,779
貸 付 金	161,645	57,947
保 険 約 款 貸 付	12,391	10,980
一 般 貸 付	149,253	46,966
不 動 産	26,064	15,939
繰 延 税 金 資 産	59,210	2,597
そ の 他	101,704	132,582
貸 倒 引 当 金	8,117	2,405
合 計	106,574	402,199
う ち 外 貨 建 資 産	19,399	149,504

(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24年度末		平成25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	1,106,185	143,261	1,151,751	35,249
一 般 勘 定	24,071	6,783	28,443	1,764
特 別 勘 定	1,082,113	136,477	1,123,307	33,485

(注) 本表には、金銭の信託等の売買目的有価証券を含んでいます。

### (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		差損
				差益	差損	
平成24年度末	満期保有目的の債券	142,267	147,965	5,698	5,698	-
	公 社 債	95,131	99,341	4,210	4,210	-
	外 国 公 社 債	47,135	48,623	1,487	1,487	-
	責任準備金対応債券	10,499,119	11,705,797	1,206,678	1,206,821	143
	公 社 債	10,499,119	11,705,797	1,206,678	1,206,821	143
	外 国 公 社 債	-	-	-	-	-
	子会社・関連会社株式	27,669	34,541	6,872	6,918	46
	そ の 他 有 価 証 券	12,759,745	14,335,428	1,575,683	1,715,242	139,559
	公 社 債	5,416,478	5,833,147	416,669	420,548	3,878
	株 式	1,606,888	2,250,276	643,387	733,948	90,560
	外 国 証 券	5,266,542	5,743,653	477,111	519,232	42,121
	公 社 債	4,725,795	5,140,468	414,672	440,625	25,952
	株 式 等	540,746	603,185	62,438	78,607	16,168
	そ の 他 の 証 券	168,842	190,247	21,404	24,394	2,989
	買入金銭債権	265,993	283,103	17,110	17,118	7
	譲渡性預金	35,000	34,999	0	0	0
	そ の 他	-	-	-	-	-
	合 計	23,428,801	26,223,733	2,794,931	2,934,681	139,749
	公 社 債	16,010,728	17,638,286	1,627,557	1,631,580	4,022
	株 式	1,606,888	2,250,276	643,387	733,948	90,560
外 国 証 券	5,339,695	5,825,213	485,517	527,639	42,121	
公 社 債	4,772,931	5,189,092	416,160	442,113	25,952	
株 式 等	566,763	636,121	69,357	85,526	16,168	
そ の 他 の 証 券	170,495	191,853	21,358	24,394	3,036	
買入金銭債権	265,993	283,103	17,110	17,118	7	
譲渡性預金	35,000	34,999	0	0	0	
そ の 他	-	-	-	-	-	
平成25年度第2四半期(上半期)末	満期保有目的の債券	93,882	98,032	4,149	4,149	-
	公 社 債	44,958	48,489	3,530	3,530	-
	外 国 公 社 債	48,923	49,543	619	619	-
	責任準備金対応債券	11,624,659	12,568,615	943,956	944,231	275
	公 社 債	11,623,359	12,567,296	943,937	944,212	275
	外 国 公 社 債	1,300	1,318	18	18	-
	子会社・関連会社株式	27,223	32,209	4,985	4,985	-
	そ の 他 有 価 証 券	11,894,654	13,548,440	1,653,786	1,766,289	112,503
	公 社 債	4,408,699	4,700,716	292,016	296,366	4,349
	株 式	1,650,687	2,558,184	907,497	960,645	53,147
	外 国 証 券	5,375,248	5,791,129	415,880	469,496	53,615
	公 社 債	4,837,073	5,161,871	324,798	367,398	42,599
	株 式 等	538,175	629,257	91,081	102,098	11,016
	そ の 他 の 証 券	196,032	220,492	24,460	25,679	1,219
	買入金銭債権	263,986	277,918	13,931	14,101	170
	譲渡性預金	-	-	-	-	-
	そ の 他	-	-	-	-	-
	合 計	23,640,420	26,247,298	2,606,877	2,719,655	112,778
	公 社 債	16,077,017	17,316,501	1,239,484	1,244,109	4,625
	株 式	1,650,687	2,558,184	907,497	960,645	53,147
外 国 証 券	5,451,489	5,872,982	421,492	475,108	53,615	
公 社 債	4,887,296	5,212,734	325,437	368,036	42,599	
株 式 等	564,192	660,247	96,055	107,071	11,016	
そ の 他 の 証 券	197,239	221,711	24,472	25,691	1,219	
買入金銭債権	263,986	277,918	13,931	14,101	170	
譲渡性預金	-	-	-	-	-	
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24年度末	平成25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	340,397	369,878
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)	148,716	151,742
その他	9,000	35,455
その他の有価証券	1,052,494	996,944
非上場国内株式(店頭売買株式を除く)	124,456	123,034
非上場外国株式(店頭売買株式を除く)	833,550	808,050
非上場外国公社債	0	0
その他	94,487	65,859
合 計	1,392,891	1,366,823

- (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24年度末：19,556百万円、平成25年度第2四半期(上半期)末：8,390百万円)

### (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24年度末	24,071	24,071	6,783	9,666	2,883
平成25年度第2四半期(上半期)末	28,443	28,443	1,764	6,958	5,194

- (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24年度末		平成25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	24,071	6,783	28,443	1,764

- ・満期保有目的、責任準備金対応、その他の金銭の信託  
 ・平成24年度末、平成25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。

#### (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、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25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、金利スワップション取引
- ・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、株式先渡取引
- ・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25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
- ・国内株式をヘッジ対象、株式先渡をヘッジ手段とする取引
- ・外貨建債券・外貨建定期預金・外貨建株式をヘッジ対象、為替予約をヘッジ手段とする取引
- ・外貨建債券・外貨建社債(負債)・外貨建貸付金をヘッジ対象、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25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24年度末		平成25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	3,938	31	3,796	28
金利スワップション	-	-	2,810	66
為替予約	51,382	485	51,063	437
通貨オプション	-	-	2,847	28
通貨スワップ	1,174	328	1,397	113
債券先渡契約	-	-	1,418	24
債券オプション	1,428	4	6,911	87
株式先渡契約	349	20	484	29
合 計	58,273	870	70,729	815

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、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24年度末					平成25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	857	145,879	13,541	-	160,279	486	6,223	17,280	-	23,989
ヘッジ会計非適用分	420	15,575	254	189	14,711	1,567	6,637	59	2,675	10,820
合 計	437	161,454	13,287	189	174,990	2,053	12,860	17,220	2,675	34,810

(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24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 144,739百万円、株式関連 13,541百万円) 及びヘッジ会計非適用分の差損益 (14,711百万円) の合計 172,993百万円  
 平成25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 4,898百万円、株式関連 17,280百万円) 及びヘッジ会計非適用分の差損益 (10,820百万円) の合計 32,999百万円

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24年度末				平成25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	契約額等	うち1年超	時価	差損益
取 引 所	金利先物 売建	23,451	-	3	3	-	-	-	-
	買建	-	-	-	-	64,839	-	10	10
店 頭	金利スワップ 固定金利受取 / 変動金利支払	18,010	14,510	498	498	20,915	18,815	451	451
	固定金利支払 / 変動金利受取	3,700	3,700	74	74	6,100	6,100	105	105
	金利スワップション 買建	-	-	-	-	281,000	280,000	5,280	1,924
	固定金利支払 / 変動金利受取	(-)	(-)	-	-	(7,204)	(7,203)		
合 計					420				1,567

(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、先物取引及びスワップ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。

(参考) 金利スワップ残存期間別残高

(単位: 百万円、%)

区 分	平成24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	3,500	12,760	850	-	-	900	18,010	
平均受取固定金利	1.34	1.37	1.23	-	-	2.01	1.39	
平均支払変動金利	0.21	0.22	0.26	-	-	0.26	0.22	
支払側固定スワップ想定元本	-	2,500	-	-	-	1,200	3,700	
平均支払固定金利	-	0.51	-	-	-	1.71	0.90	
平均受取変動金利	-	0.31	-	-	-	0.23	0.28	
合 計	3,500	15,260	850	-	-	2,100	21,710	
区 分	平成25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	2,100	12,550	765	-	4,600	900	20,915	
平均受取固定金利	1.49	1.36	1.23	-	0.98	2.01	1.31	
平均支払変動金利	0.16	0.19	0.22	-	0.22	0.22	0.20	
支払側固定スワップ想定元本	-	2,500	-	-	-	3,600	6,100	
平均支払固定金利	-	0.51	-	-	-	1.73	1.23	
平均受取変動金利	-	0.25	-	-	-	0.23	0.24	
合 計	2,100	15,050	765	-	4,600	4,500	27,015	

## (b) 通貨関連

(単位:百万円)

区分	種類	平成24年度末			平成25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	1,309,397	15,201	15,201	1,222,458	2,853	2,853
	(米ドル)	682,380	11,944	11,944	647,182	976	976
	(ユーロ)	235,691	2,721	2,721	230,837	2,052	2,052
	(オーストラリアドル)	60,195	409	409	121,878	864	864
	(イギリスポンド)	47,737	444	444	23,929	801	801
	(カナダドル)	21,826	4	4	8,747	0	0
	(その他)	261,565	322	322	189,883	111	111
	買建	1,127,057	374	374	1,142,525	3,978	3,978
	(米ドル)	556,633	1,127	1,127	566,405	3,891	3,891
	(ユーロ)	188,074	1,646	1,646	215,457	207	207
	(カナダドル)	24,582	70	70	83,990	185	185
	(オーストラリアドル)	58,661	9	9	59,802	25	25
	(イギリスポンド)	32,790	276	276	45,689	743	743
	(その他)	266,315	212	212	171,180	462	462
	通貨オプション						
	売建						
	コール	-	-	-	187,980		
	(米ドル)	(-)	-	-	(1,682)	480	1,201
		-	-	-	187,980		
	(-)	-	-	(1,682)	480	1,201	
買建							
コール	-	-	-	96,782			
(米ドル)	(-)	-	-	(1,755)	747	1,008	
	-	-	-	96,782			
	(-)	-	-	(1,755)	747	1,008	
合計			15,575			6,637	

(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24年度末			平成25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	-	-	-	33,421	14	14
	買建	8,779	255	255	7,844	76	76
	外貨建株価指数先物						
	買建	5,740	1	1	4,029	22	22
	株価指数オプション						
	売建						
	コール	-	-	-	39,974		
	コール	(-)	-	-	(843)	618	224
	買建						
コール	-	-	-	19,981			
コール	(-)	-	-	(1,073)	840	233	
合計				254			59

(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24年度末			平成25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	12,759	40	40	-	-	-
	買建	-	-	-	34,434	298	298
	外貨建債券先物						
	売建	-	-	-	110,894	851	851
	買建	-	-	-	495,470	4,381	4,381
	円建債券先物オプション						
	売建						
	プット	42,850			-		
	プット	(17)	24	6	(-)	-	-
店頭	外貨建債券先渡契約						
	売建	-	-	-	11,113	486	486
	買建	-	-	-	130,738	2,494	2,494
	債券店頭オプション						
	売建						
	コール	6,175			336,183		
	コール	(22)	81	59	(7,432)	6,974	458
	プット	65,258			9,391		
	プット	(80)	46	34	(20)	3	16
	買建						
コール	65,258			9,391			
コール	(58)	319	260	(14)	29	14	
プット	6,175			336,183			
プット	(27)	29	1	(10,713)	1,711	9,001	
合計				189			2,675

(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

(単位：百万円)

ヘッジ会計の方法	種類	主なヘッジ対象	平成24年度末				平成25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		
原則的処理方法	金利スワップ 固定金利支払 / 変動金利受取	借入金	320,000	320,000	1,786	1,786	320,000	320,000	1,134	1,134
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	52,100	19,700	928	928	32,600	15,700	648	648
合計						857				486

(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24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	32,400	12,700	7,000	-	-	-	
平均受取固定金利	1.19	1.73	1.75	-	-	-	1.40	
平均支払変動金利	0.24	0.23	0.29	-	-	-	0.24	
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	-	0.43	-	-	-	-	0.43	
合計	32,400	332,700	7,000	-	-	-	372,100	

  

区分	平成25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	16,900	10,700	3,000	2,000	-	-	
平均受取固定金利	1.67	1.66	1.62	0.63	-	-	1.60	
平均支払変動金利	0.19	0.22	0.23	0.22	-	-	0.20	
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	-	0.35	-	-	-	-	0.35	
合計	16,900	330,700	3,000	2,000	-	-	352,600	

## (b) 通貨関連

(単位:百万円)

ヘッジ会計の方法	種類	主なヘッジ対象	平成24年度末				平成25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	契約額等	うち1年超	時価	差損益
原則的処理方法	通貨スワップ (米ドル)	外貨建債券	9,877	9,877	1,139	1,139	22,295	22,295	1,324	1,324
			9,877	9,877	1,139	1,139	22,295	22,295	1,324	1,324
ヘッジ対象に係る損益を認識する方法	為替予約									
	売建	外貨建債券	2,427,927	-	145,161	145,161	2,316,673	-	4,941	4,941
	(米ドル)		1,481,780	-	138,325	138,325	1,190,433	-	5,967	5,967
	(ユーロ)		660,985	-	4,347	4,347	851,471	-	1,688	1,688
	(イギリスポンド)		167,377	-	188	188	151,231	-	7,543	7,543
	(オーストラリアドル)		62,762	-	1,348	1,348	72,860	-	1,251	1,251
	(カナダドル)		14,290	-	17	17	13,003	-	49	49
	(その他)		40,731	-	968	968	37,672	-	376	376
	買建		8,601	-	421	421	12,709	-	42	42
	(米ドル)		7,012	-	462	462	6,197	-	37	37
	(ユーロ)		710	-	25	25	6,014	-	73	73
	(オーストラリアドル)		131	-	1	1	252	-	4	4
	(カナダドル)		-	-	-	-	90	-	2	2
	(イギリスポンド)		440	-	7	7	46	-	0	0
(その他)		306	-	6	6	108	-	0	0	
為替予約等の振当処理	為替予約									
	売建	外貨建定期預金	265,260	-	-	-	411,986	-	-	-
	(オーストラリアドル)		180,277	-	-	-	255,042	-	-	-
	(米ドル)		84,982	-	-	-	156,943	-	-	-
	通貨スワップ	外貨建社債(負債)	107,562	107,562	-	-	107,562	107,562	-	-
	(米ドル)		107,562	107,562	-	-	107,562	107,562	-	-
通貨スワップ	外貨建貸付金	-	-	-	-	9,920	9,920	-	-	
(米ドル)		-	-	-	-	9,920	9,920	-	-	
合計					145,879				6,223	

- (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、外貨建社債(負債)及び外貨建貸付金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、外貨建社債(負債)及び外貨建貸付金の時価を含めて記載しています。  
3. 差損益欄には、為替予約及び通貨スワップ取引については時価を記載しています。(上記2.を除く)

## (c) 株式関連

(単位:百万円)

ヘッジ会計の方法	種類	主なヘッジ対象	平成24年度末				平成25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	契約額等	うち1年超	時価	差損益
ヘッジ対象に係る損益を認識する方法	国内株式先渡契約 売建	国内株式	34,949	-	13,541	13,541	48,408	-	17,280	17,280
合計						13,541			17,280	

(注) 差損益欄には、時価を記載しています。

(d) 債券関連は平成24年度末、平成25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。



・貸倒引当金の明細

(単位：百万円)

摘 要	平成24年度末	平成25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	1,751	717	1,033
(イ)個別貸倒引当金	2,358	987	1,371
(ウ)特定海外債権引当勘定	-	-	-
(2)個別貸倒引当金			
(ア)繰入額	2,364	993	1,371
(イ)取崩額	2,603	2,363	239
[償却に伴う取崩額を除く]			
(ウ)純繰入額	238	1,370	1,131
(3)特定海外債権引当勘定			
(ア)対象国数	-	-	-
(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	429	3	426

(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24年度末 : 472百万円
- ・平成25年度第2四半期(上半期)末 : 72百万円