

## 平成24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23年度末、平成24年度第2四半期(上半期)末ともに残高がないため、記載していません。

#### （2）商品有価証券売買高（一般勘定）

平成23年度第2四半期(上半期)、平成24年度第2四半期(上半期)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23年度末		平成24年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
国 債	13,120,539	54.0	13,676,510	55.9
地 方 債	307,458	1.3	304,030	1.2
社 債	2,113,653	8.7	2,084,201	8.5
うち公社・公団債	784,279	3.2	795,702	3.3
株 式	2,284,861	9.4	2,024,783	8.3
外 国 証 券	6,298,234	25.9	6,168,967	25.2
公 社 債	4,786,438	19.7	4,697,142	19.2
株 式 等	1,511,795	6.2	1,471,824	6.0
そ の 他 の 証 券	189,951	0.8	187,311	0.8
合 計	24,314,699	100.0	24,445,805	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23年度末	平成24年度 第2四半期(上半期)末
	金 額	金 額
北 海 道	4,165	4,209
東 北	-	-
関 東	114,663	112,654
中 部	35,891	35,438
近 畿	42,145	42,239
中 国	2,822	2,431
四 国	-	-
九 州	18,703	17,984
そ の 他	89,067	89,073
合 計	307,458	304,030

（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23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 ないものを 含む)		
有 価 証 券	383,414	2,110,184	1,840,823	1,077,992	2,600,659	16,301,624	24,314,699	
国 債	95,772	544,624	310,294	297,294	1,785,733	10,086,819	13,120,539	
地 方 債	20,053	186,375	36,161	8,443	28,131	28,293	307,458	
社 債	99,590	670,909	522,791	329,986	162,239	328,135	2,113,653	
株 式	-	-	-	-	-	2,284,861	2,284,861	
外 国 証 券	128,246	695,954	958,901	434,079	613,882	3,467,170	6,298,234	
公 社 債	128,246	695,652	952,911	434,079	613,882	1,961,666	4,786,438	
株 式 等	-	302	5,989	-	-	1,505,504	1,511,795	
その他の証券	39,751	12,320	12,675	8,188	10,671	106,343	189,951	
買入金銭債権	922	621	10,926	904	-	280,949	294,324	
譲渡性預金	15,000	-	-	-	-	-	15,000	
そ の 他	483	-	-	-	-	20,189	20,672	
区 分	平成24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 ないものを 含む)		
有 価 証 券	655,882	1,776,079	2,010,276	1,127,873	2,202,296	16,673,398	24,445,805	
国 債	357,558	396,684	313,596	415,578	1,331,033	10,862,059	13,676,510	
地 方 債	70,623	135,282	33,433	7,404	28,707	28,579	304,030	
社 債	124,658	628,502	602,081	257,271	135,613	336,073	2,084,201	
株 式	-	-	-	-	-	2,024,783	2,024,783	
外 国 証 券	64,784	602,166	1,044,093	444,655	696,677	3,316,589	6,168,967	
公 社 債	64,784	601,982	1,038,412	444,655	696,677	1,850,630	4,697,142	
株 式 等	-	184	5,681	-	-	1,465,959	1,471,824	
その他の証券	38,257	13,442	17,071	2,964	10,264	105,311	187,311	
買入金銭債権	-	1,550	9,056	1,404	-	280,460	292,472	
譲渡性預金	40,000	-	-	-	-	-	40,000	
そ の 他	461	-	-	-	-	18,055	18,517	

(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23年度末		平成24年度 第2四半期(上半期)末	
		金 額	占 率	金 額	占 率
水産・農林業		371	0.0	225	0.0
鉱業		402	0.0	200	0.0
建設業		45,387	2.0	43,173	2.1
製 造 業	食料品	112,664	4.9	112,819	5.6
	繊維製品	20,040	0.9	17,837	0.9
	パルプ・紙	2,326	0.1	1,931	0.1
	化学	95,011	4.2	83,393	4.1
	医薬品	31,712	1.4	31,057	1.5
	石油・石炭製品	6,348	0.3	4,617	0.2
	ゴム製品	13,547	0.6	12,796	0.6
	ガラス・土石製品	53,339	2.3	43,959	2.2
	鉄鋼	55,555	2.4	49,535	2.4
	非鉄金属	11,540	0.5	7,893	0.4
	金属製品	27,302	1.2	26,487	1.3
	機械	102,560	4.5	84,975	4.2
	電気機器	441,873	19.3	339,151	16.7
	輸送用機器	123,453	5.4	110,118	5.4
	精密機器	53,513	2.3	48,036	2.4
	その他製品	50,545	2.2	40,139	2.0
電気・ガス業		92,921	4.1	79,810	3.9
運 輸 ・ 情 報 通 信 業	陸運業	171,695	7.5	166,537	8.2
	海運業	628	0.0	318	0.0
	空運業	1,345	0.1	943	0.0
	倉庫・運輸関連業	3,951	0.2	3,621	0.2
	情報・通信業	33,502	1.5	33,171	1.6
商 業	卸売業	95,617	4.2	83,358	4.1
	小売業	71,941	3.1	70,625	3.5
金 融 ・ 保 険 業	銀行業	305,889	13.4	273,731	13.5
	証券、商品先物取引業	6,730	0.3	5,950	0.3
	保険業	175,868	7.7	173,469	8.6
	その他金融業	11,570	0.5	11,774	0.6
不動産業		15,493	0.7	15,205	0.8
サービス業		50,205	2.2	47,918	2.4
合 計		2,284,861	100.0	2,024,783	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23年度末	平成24年度 第2四半期(上半期)末
保 険 約 款 貸 付	509,826	497,435
保 険 料 振 替 貸 付	60,193	57,991
契 約 者 貸 付	449,633	439,443
一 般 貸 付	2,902,702	2,753,448
(うち非居住者貸付)	(93,924)	(90,848)
企 業 貸 付	2,525,603	2,409,482
(うち国内企業向け)	(2,472,879)	(2,356,833)
国・国際機関・政府関係機関貸付	32,612	32,882
公 共 団 体 ・ 公 企 業 貸 付	316,890	308,334
住 宅 口 ー ン	27,471	2,638
(うち信託貸付金)	(24,321)	(-)
消 費 者 口 ー ン	51	45
そ の 他	73	64
合 計	3,412,529	3,250,883

#### (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 ないものを 含む)	合 計
平成23年度末	変 動 金 利	24,613	60,250	23,422	13,272	6,389	152,468
	固 定 金 利	296,339	497,203	582,416	449,924	348,293	2,750,234
	一 般 貸 付 計	320,952	557,454	605,838	463,196	354,682	2,902,702
平成24年度 第2四半期 (上半期)末	変 動 金 利	36,082	36,231	16,373	12,876	7,209	108,965
	固 定 金 利	245,061	516,918	502,375	444,063	331,804	2,644,483
	一 般 貸 付 計	281,144	553,150	518,748	456,940	339,013	2,753,448

#### (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23年度末		平成24年度 第2四半期(上半期)末	
		金額	占 率	金額	占 率
大 企 業	貸付先数	327	53.2	299	54.4
	金 額	2,102,320	85.0	2,039,446	86.5
中 堅 企 業	貸付先数	31	5.0	26	4.7
	金 額	6,226	0.3	4,810	0.2
中 小 企 業	貸付先数	257	41.8	225	40.9
	金 額	364,333	14.7	312,577	13.3
国内企業向け 貸付計	貸付先数	615	100.0	550	100.0
	金 額	2,472,879	100.0	2,356,833	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、を除外する全業種	小売業、飲食業	サービス業	卸売業
大 企 業	常用する従業員 資本金10億円以上	常用する従業員 資本金10億円以上	常用する従業員 資本金10億円以上	常用する従業員 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23年度末		平成24年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
製 造 業	440,139	15.2	415,487	15.1
食 料	30,287	1.0	30,038	1.1
織 維	5,253	0.2	5,193	0.2
木 材 ・ 木 製 品	562	0.0	523	0.0
パ ル プ ・ 紙	33,918	1.2	34,623	1.3
印 刷	20,092	0.7	19,460	0.7
化 学	34,780	1.2	26,940	1.0
石 油 ・ 石 炭	23,007	0.8	23,007	0.8
窯 業 ・ 土 石	23,248	0.8	23,071	0.8
鉄 鋼	69,968	2.4	77,712	2.8
非 鉄 金 属	14,146	0.5	13,714	0.5
金 属 製 品	1,874	0.1	659	0.0
はん用・生産用・業務用機械	62,894	2.2	60,797	2.2
電 気 機 械	65,234	2.2	55,525	2.0
輸 送 用 機 械	42,593	1.5	33,941	1.2
そ の 他 の 製 造 業	12,278	0.4	10,278	0.4
農 業 、 林 業	-	-	-	-
漁 業	-	-	-	-
鉱業、採石業、砂利採取業	-	-	-	-
建 設 業	14,984	0.5	15,450	0.6
電 気 ・ ガ ス ・ 熱 供 給 ・ 水 道 業	338,663	11.7	336,981	12.2
情 報 通 信 業	37,166	1.3	37,203	1.4
運 輸 業 、 郵 便 業	252,096	8.7	249,605	9.1
卸 売 業	545,674	18.8	516,663	18.8
小 売 業	20,129	0.7	15,777	0.6
金 融 業 、 保 険 業	735,124	25.3	750,831	27.3
不 動 産 業	197,673	6.8	144,531	5.2
物 品 賃 貸 業	154,177	5.3	134,413	4.9
学術研究、専門・技術サービス業	215	0.0	180	0.0
宿 泊 業	952	0.0	804	0.0
飲 食 業	188	0.0	136	0.0
生活関連サービス業・娯楽業	3,913	0.1	3,328	0.1
教 育 、 学 習 支 援 業	159	0.0	143	0.0
医 療 ・ 福 祉	56	0.0	8	0.0
そ の 他 の サ ー ビ ス	1,317	0.0	942	0.0
地 方 公 共 団 体	38,022	1.3	36,893	1.3
個人(住宅・消費・納税資金等)	27,522	0.9	2,684	0.1
そ の 他	600	0.0	533	0.0
合 計	2,808,778	96.8	2,662,600	96.7
海 外 向 け				
政 府 等	41,200	1.4	38,200	1.4
金 融 機 関	18,000	0.6	18,000	0.7
商 工 業 等	34,724	1.2	34,648	1.3
合 計	93,924	3.2	90,848	3.3
一 般 貸 付 計	2,902,702	100.0	2,753,448	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23年度末		平成24年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
北 海 道	40,736	1.5	38,150	1.4
東 北	30,350	1.1	30,146	1.1
関 東	2,148,256	77.2	2,083,460	78.3
中 部	189,981	6.8	185,268	7.0
近 畿	226,011	8.1	180,184	6.8
中 国	48,732	1.8	47,068	1.8
四 国	19,639	0.7	19,073	0.7
九 州	77,663	2.8	76,665	2.9
合 計	2,781,370	100.0	2,660,017	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23年度末		平成24年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
担 保 貸 付	17,835	0.6	15,867	0.6
有価証券担保貸付	2,867	0.1	2,337	0.1
不動産・動産・財団担保貸付	14,685	0.5	13,485	0.5
指名債権担保貸付	282	0.0	44	0.0
保 証 貸 付	112,831	3.9	74,083	2.7
信 用 貸 付	2,744,627	94.6	2,660,914	96.6
そ の 他	27,407	0.9	2,582	0.1
一 般 貸 付 計	2,902,702	100.0	2,753,448	100.0
うち劣後特約付貸付	401,063	13.8	427,063	15.5

- (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23年度末		平成24年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
公 社 債	4,196,128	63.0	4,086,941	60.9
株 式	417,259	6.3	440,468	6.6
現 預 金 ・ そ の 他	56,263	0.8	148,026	2.2
小 計	4,669,650	70.1	4,675,436	69.7

###### 円貨額が確定した外貨建資産

（単位：百万円、％）

区 分	平成23年度末		平成24年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
公 社 債	-	-	-	-
現 預 金 ・ そ の 他	205,672	3.1	300,672	4.5
小 計	205,672	3.1	300,672	4.5

###### 円貨建資産

（単位：百万円、％）

区 分	平成23年度末		平成24年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
非 居 住 者 貸 付	93,924	1.4	90,848	1.4
公 社 債 ( 円 建 外 債 ) ・ そ の 他	1,687,601	25.4	1,644,409	24.5
小 計	1,781,525	26.8	1,735,257	25.9

###### 合 計

（単位：百万円、％）

海 外 投 融 資	6,656,848	100.0	6,711,366	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23年度末		平成24年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
米 ド ル	2,796,166	59.9	2,753,621	58.9
ユ ー ロ	1,194,966	25.6	1,013,503	21.7
オーストラリアドル	280,113	6.0	310,295	6.6
イギリスポンド	207,755	4.4	236,972	5.1
カナダドル	31,916	0.7	66,323	1.4
マレーシアリングgit	9,657	0.2	35,740	0.8
デンマーククローネ	13,050	0.3	34,569	0.7
そ の 他 共 計	4,669,650	100.0	4,675,436	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23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	2,810,675	44.6	2,728,996	57.0	81,678	5.4	26,800	28.5
ヨ ー ロ ッ パ	1,549,170	24.6	1,498,085	31.3	51,085	3.4	30,500	32.5
オ セ ア ニ ア	310,317	4.9	170,701	3.6	139,616	9.2	15,000	16.0
ア ジ ア	114,991	1.8	23,833	0.5	91,158	6.0	-	-
中 南 米	1,408,044	22.4	259,928	5.4	1,148,115	75.9	2,424	2.6
中 東	-	-	-	-	-	-	-	-
ア フ リ カ	141	0.0	-	-	141	0.0	-	-
国 際 機 関	104,893	1.7	104,893	2.2	-	-	19,200	20.4
合 計	6,298,234	100.0	4,786,438	100.0	1,511,795	100.0	93,924	100.0
区 分	平成24年度第2四半期(上半期)末							
	外国証券		公社債		株式等		非居住者貸付	
	金額	占率	金額	占率	金額	占率	金額	占率
北 米	2,693,285	43.7	2,584,902	55.0	108,382	7.4	26,800	29.5
ヨ ー ロ ッ パ	1,429,582	23.2	1,371,379	29.2	58,202	4.0	27,500	30.3
オ セ ア ニ ア	394,630	6.4	253,098	5.4	141,532	9.6	15,000	16.5
ア ジ ア	130,597	2.1	49,907	1.1	80,689	5.5	-	-
中 南 米	1,382,729	22.4	299,868	6.4	1,082,860	73.6	2,348	2.6
中 東	-	-	-	-	-	-	-	-
ア フ リ カ	16,699	0.3	16,542	0.4	156	0.0	-	-
国 際 機 関	121,442	2.0	121,442	2.6	-	-	19,200	21.1
合 計	6,168,967	100.0	4,697,142	100.0	1,471,824	100.0	90,848	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23年度末					平成24年度第2四半期(上半期)末				
	金利関連	通貨関連	株式関連	債券関連	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	860	138,182	-	-	137,321	508	40,457	-	-	39,949
ヘッジ会計非適用分	439	12,830	4,130	1,210	17,733	242	484	3,423	1,150	3,846
合 計	1,299	151,013	4,130	1,210	155,055	266	40,942	3,423	1,150	36,103

（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23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 138,182百万円）及びヘッジ会計非適用分の差損益（ 17,733百万円）の合計 155,915百万円

平成24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40,456百万円）及びヘッジ会計非適用分の差損益（ 3,846百万円）の合計36,610百万円

### 時価情報

#### （a）金利関連

（単位：百万円）

区 分	種 類	平成23年度末					平成24年度第2四半期(上半期)末				
		契約額等		時価	差損益	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	-	-	-	-	-	24,920	-	5	5	-
	買建	74,748	-	3	3	-	24,920	-	1	1	-
店 頭	金利スワップ 固定金利受取/変動金利支払	92,000	69,600	2,000	2,000	1,434	74,505	46,405	1,689	1,689	1,176
	固定金利支払/変動金利受取	327,500	327,500	703	703	573	329,500	329,500	1,952	1,952	1,684
合 計					1,299	860				266	508

（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23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	22,400	49,850	15,730	4,020	-	-	92,000
平均受取固定金利	1.24	1.34	1.50	1.52	-	-	1.35
平均支払変動金利	0.23	0.29	0.26	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	-	-	0.44	-	0.34	-	0.44
合 計	22,400	49,850	338,230	4,020	5,000	-	419,500
区 分	平成24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	28,100	29,800	12,670	3,935	-	-	74,505
平均受取固定金利	1.14	1.59	1.52	1.52	-	-	1.41
平均支払変動金利	0.28	0.27	0.28	0.33	-	-	0.28
支払側固定スワップ想定元本	-	2,500	320,000	-	7,000	-	329,500
平均支払固定金利	-	0.51	0.52	-	1.05	-	0.53
平均受取変動金利	-	0.34	0.44	-	0.33	-	0.44
合 計	28,100	32,300	332,670	3,935	7,000	-	404,005

## (b) 通貨関連

(単位: 百万円)

区分	種類	平成23年度末				平成24年度第2四半期(上半期)末			
		契約額等	時価	差損益	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	2,891,155	150,658	150,658	138,246	2,940,536	42,163	42,163	40,524
	(米ドル)	1,818,024	96,735	96,735	88,623	1,946,935	52,528	52,528	49,915
	(ユーロ)	743,207	40,770	40,770	37,535	633,377	6,009	6,009	5,590
	(イギリスポンド)	140,751	8,184	8,184	7,461	158,159	3,164	3,164	2,980
	(オーストラリアドル)	130,365	1,398	1,398	1,243	89,093	545	545	732
	(カナダドル)	28,728	781	781	763	17,493	77	77	59
	(その他)	30,077	2,787	2,787	2,618	95,477	1,658	1,658	1,492
	買建	218,698	1,304	1,304	64	315,403	1,222	1,222	68
	(米ドル)	101,650	549	549	16	143,095	665	665	84
	(ユーロ)	55,705	1,004	1,004	58	97,863	229	229	15
	(オーストラリアドル)	32,424	330	330	-	18,922	170	170	-
	(カナダドル)	16,770	0	0	-	10,899	127	127	-
	(イギリスポンド)	6,373	56	56	10	7,581	22	22	0
	(その他)	5,772	24	24	-	37,041	51	51	-
	通貨オプション								
	買建								
	ブット	110,876				-			
	(ユーロ)	(1,674)	14	1,659	-	(-)	-	-	-
	(ユーロ)	110,876				-			
(ユーロ)	(1,674)	14	1,659	-	(-)	-	-	-	
通貨スワップ									
(米ドル)	-	-	-	-	1,571	0	0	0	
(米ドル)	-	-	-	-	1,571	0	0	0	
合計			151,013	138,182			40,942	40,457	

- (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23年度末				平成24年度第2四半期(上半期)末			
		契約額等	時価	差損益	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	株価指数オプション								
	買建								
ブット	109,913				99,968				
(ユーロ)	(4,202)	71	4,130	-	(3,473)	49	3,423	-	
合計			4,130	-			3,423	-	

- (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、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23年度末				平成24年度第2四半期(上半期)末			
		契約額等	時価	差損益	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	3,560	10	10	-	17,406	40	40	-
	外貨建債券先物 売建	-	-	-	-	77,271	591	591	-
	買建	-	-	-	-	13,236	63	63	-
店頭	債券店頭オプション 売建								
	コール	3,010 (3)	4	0	-	251,174 (1,857)	933	923	-
	プット	20,007 (41)	62	20	-	47,281 (94)	9	85	-
	買建								
	コール	20,007 (21)	8	12	-	47,281 (78)	76	2	-
	プット	102,993 (1,192)	5	1,187	-	351,098 (3,762)	2,174	1,588	-
合計				1,210	-			1,150	-

- (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。

・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23年度末		平成24年度第2四半期(上半期)末	
	貸借対照表計上額	当期の損益に 含まれた評価損益	貸借対照表計上額	当期の損益に 含まれた評価損益
売 買 目 的 有 価 証 券	39,885	2,491	38,144	1,959

(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23年度末、平成24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23年度末					平成24年度第2四半期(上半期)末				
	金利関連	通貨関連	株式関連	債券関連	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	-	3	-	-	3
合 計	-	0	-	-	0	-	3	-	-	3

(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23年度末				平成24年度第2四半期(上半期)末			
		契約額等	時価	差損益	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	301	1	1	-	527	3	3	-
	(米ドル)	220	0	0	-	398	3	3	-
	(ユーロ)	19	0	0	-	77	0	0	-
	(イギリスポンド)	56	1	1	-	49	0	0	-
	(その他)	5	0	0	-	1	0	0	-
	買建	301	2	2	-	288	0	0	-
	(米ドル)	111	0	0	-	190	1	1	-
	(イギリスポンド)	9	0	0	-	9	0	0	-
	(ユーロ)	90	1	1	-	-	-	-	-
	(その他)	90	1	1	-	87	1	1	-
	合 計			0	-			3	-

- (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23年度末、平成24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23年度末		平成24年度第2四半期(上半期)末	
	貸借対照表計上額	当期の損益に含まれた評価損益	貸借対照表計上額	当期の損益に含まれた評価損益
売買目的有価証券	139,446	4,548	123,914	6,994

(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23年度末、平成24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23年度末					平成24年度第2四半期(上半期)末				
	金利関連	通貨関連	株式関連	債券関連	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23年度末				平成24年度第2四半期(上半期)末			
		契約額等	時価	差損益	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	14	0	0	-	9	0	0	-
	(イギリスポンド)	-	-	-	-	9	0	0	-
	(米ドル)	14	0	0	-	-	-	-	-
店 頭	買建	15	0	0	-	8	0	0	-
	(米ドル)	15	0	0	-	8	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23年度末、平成24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23年度末		平成24年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
現預金・コールローン	499,298	1.6	571,375	1.8
買 現 先 勘 定	-	-	-	-
債券貸借取引支払保証金	-	-	-	-
買 入 金 銭 債 権	294,324	0.9	292,472	0.9
商 品 有 価 証 券	-	-	-	-
金 銭 の 信 託	20,672	0.1	18,517	0.1
有 価 証 券	25,333,423	80.5	25,390,606	80.4
公 社 債	15,853,161	50.4	16,367,411	51.8
株 式	2,549,923	8.1	2,262,157	7.2
外 国 証 券	6,614,982	21.0	6,462,970	20.5
公 社 債	4,922,982	15.6	4,826,420	15.3
株 式 等	1,692,000	5.4	1,636,550	5.2
そ の 他 の 証 券	315,355	1.0	298,066	0.9
貸 付 金	3,412,529	10.8	3,250,883	10.3
保 険 約 款 貸 付	509,826	1.6	497,435	1.6
一 般 貸 付	2,902,702	9.2	2,753,448	8.7
不 動 産	1,249,101	4.0	1,223,036	3.9
繰 延 税 金 資 産	282,638	0.9	341,849	1.1
そ の 他	380,621	1.2	482,326	1.5
貸 倒 引 当 金	10,670	0.0	2,552	0.0
合 計	31,461,940	100.0	31,568,514	100.0
うち外貨建資産	4,984,071	15.8	4,964,672	15.7

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

#### (2) 資産の増減

(単位：百万円)

区 分	平成23年度 第2四半期(上半期)	平成24年度 第2四半期(上半期)
	現預金・コールローン	29,591
買 現 先 勘 定	-	-
債券貸借取引支払保証金	-	-
買 入 金 銭 債 権	314	1,851
商 品 有 価 証 券	-	-
金 銭 の 信 託	2,682	2,155
有 価 証 券	67,921	57,182
公 社 債	1,600,194	514,250
株 式	315,683	287,766
外 国 証 券	1,173,347	152,012
公 社 債	1,126,488	96,562
株 式 等	46,858	55,450
そ の 他 の 証 券	43,242	17,289
貸 付 金	172,816	161,645
保 険 約 款 貸 付	8,896	12,391
一 般 貸 付	163,920	149,253
不 動 産	34,441	26,064
繰 延 税 金 資 産	9,918	59,210
そ の 他	132,101	101,704
貸 倒 引 当 金	1,490	8,117
合 計	31,397	106,574
うち外貨建資産	1,014,128	19,399

(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23年度末		平成24年度第2四半期(上半期)末	
	貸借対照表計上額	当期の損益に 含まれた評価損益	貸借対照表計上額	当期の損益に 含まれた評価損益
売 買 目 的 有 価 証 券	1,039,397	41,247	963,317	42,463
一 般 勘 定	20,672	358	18,517	275
特 別 勘 定	1,018,724	40,889	944,800	42,739

(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		
				差益	差損	
平成23年度末	満期保有目的の債券	135,828	141,079	5,250	-	
	公 社 債	94,524	96,999	2,474	-	
	外 国 公 社 債	41,303	44,079	2,775	-	
	責任準備金対応債券	8,271,349	8,793,208	521,858	1,041	
	公 社 債	8,271,349	8,793,208	521,858	1,041	
	子会社・関連会社株式	1,763	1,932	168	-	
	そ の 他 有 価 証 券	14,051,792	14,743,299	691,506	286,548	
	公 社 債	6,909,503	7,175,777	266,273	12,757	
	株 式	1,674,737	1,972,561	297,824	167,709	
	外 国 証 券	5,071,333	5,186,119	114,785	94,684	
	公 社 債	4,608,914	4,745,134	136,220	52,926	
	株 式 等	462,419	440,984	21,434	41,758	
	そ の 他 の 証 券	105,325	99,516	5,808	11,349	
	買入金銭債権	275,893	294,324	18,431	47	
	譲渡性預金	15,000	15,000	0	-	
	そ の 他	-	-	-	-	
	合 計	22,460,734	23,679,519	1,218,784	287,590	
	平成24年度第2四半期(上半期)末	公 社 債	15,275,377	16,065,984	790,607	13,799
		株 式	1,674,737	1,972,561	297,824	167,709
外 国 証 券		5,112,637	5,230,198	117,561	94,684	
公 社 債		4,650,217	4,789,214	138,996	52,926	
株 式 等		462,419	440,984	21,434	41,758	
そ の 他 の 証 券		107,088	101,448	5,639	11,349	
買入金銭債権		275,893	294,324	18,431	47	
譲渡性預金		15,000	15,000	0	-	
そ の 他		-	-	-	-	
満期保有目的の債券		133,772	139,083	5,311	-	
公 社 債		94,828	98,206	3,378	-	
外 国 公 社 債		38,944	40,877	1,932	-	
責任準備金対応債券		9,451,315	10,075,753	624,437	1,259	
公 社 債		9,451,315	10,075,753	624,437	1,259	
子会社・関連会社株式		2,078	2,094	16	-	
そ の 他 有 価 証 券		13,245,679	13,793,422	547,743	341,206	
公 社 債		6,205,219	6,518,598	313,379	6,805	
株 式		1,608,737	1,714,173	105,436	212,375	
外 国 証 券		5,014,880	5,132,145	117,264	108,011	
公 社 債	4,510,047	4,658,197	148,149	58,716		
株 式 等	504,832	473,947	30,885	49,294		
そ の 他 の 証 券	104,964	96,031	8,933	13,928		
買入金銭債権	271,876	292,472	20,596	85		
譲渡性預金	40,000	40,000	0	-		
そ の 他	-	-	-	-		
合 計	22,832,846	24,010,354	1,177,508	342,465		
公 社 債	15,751,363	16,692,559	941,195	8,065		
株 式	1,608,737	1,714,173	105,436	212,375		
外 国 証 券	5,053,824	5,173,022	119,197	108,011		
公 社 債	4,548,992	4,699,075	150,082	58,716		
株 式 等	504,832	473,947	30,885	49,294		
そ の 他 の 証 券	107,042	98,125	8,917	13,928		
買入金銭債権	271,876	292,472	20,596	85		
譲渡性預金	40,000	40,000	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23年度末	平成24年度第2四半期(上半期)末
満期保有目的の債券	-	-
非上場外国公社債	-	-
その他	-	-
責任準備金対応債券	-	-
子会社・関連会社株式	338,206	338,415
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	147,618
その他	6,809	8,115
その他の有価証券	1,133,357	1,059,428
非上場国内株式(店頭売買株式を除く)	129,619	127,929
非上場外国株式(店頭売買株式を除く)	905,550	833,933
非上場外国公社債	0	0
その他	98,188	97,565
合 計	1,471,564	1,397,843

- (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23年度末： 3,153百万円、平成24年度第2四半期(上半期)末： 10,618百万円)

### (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	差益	
				差益	差損
平成23年度末	20,672	20,672	358	6,288	5,929
平成24年度第2四半期(上半期)末	18,517	18,517	275	6,128	5,852

- (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23年度末		平成24年度第2四半期(上半期)末	
	貸借対照表計上額	当期の損益に含まれた評価損益	貸借対照表計上額	当期の損益に含まれた評価損益
運用目的の金銭の信託	20,672	358	18,517	275

- (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

平成23年度末、平成24年度第2四半期(上半期)末ともに残高がないため、記載していません。

#### (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 24 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、株式オプション取引
- ・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 24 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
- ・外貨建債券・外貨建社債（負債）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24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 23 年度末		平成 24 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	4,195	40	4,040	36
為 替 予 約	33,595	365	35,943	722
通 貨 オ ブ シ ョ ン	1,108	10	-	-
通 貨 ス ワ ッ プ	1,075	164	1,091	32
債 券 先 渡 契 約	-	-	-	-
債 券 オ ブ シ ョ ン	1,460	0	6,968	31
合 計	41,434	581	48,042	823

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23年度末					平成24年度第2四半期(上半期)末				
	金利関連	通貨関連	株式関連	債券関連	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	860	138,182	-	-	137,321	508	40,457	-	-	39,949
ヘッジ会計非適用分	439	12,917	4,065	1,210	17,754	242	494	3,463	1,150	3,877
合 計	1,299	151,100	4,065	1,210	155,076	266	40,951	3,463	1,150	36,071

(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23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 138,182百万円)及びヘッジ会計非適用分の差損益( 17,754百万円)の合計 155,937百万円

平成24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40,456百万円)及びヘッジ会計非適用分の差損益( 3,877百万円)の合計36,579百万円

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23年度末				平成24年度第2四半期(上半期)末			
		契約額等	時価		差損益	契約額等	時価		差損益
			うち1年超				うち1年超		
取 引 所	金利先物 売建	-	-	-	-	24,920	-	5	5
	買建	74,748	-	3	3	24,920	-	1	1
店 頭	金利スワップ 固定金利受取 / 変動金利支払	21,800	17,500	566	566	19,805	15,805	513	513
	固定金利支払 / 変動金利受取	7,500	7,500	129	129	9,500	9,500	267	267
合 計					439				242

(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23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	4,300	6,750	9,730	1,020	-	-	21,800	
平均受取固定金利	1.29	1.36	1.38	1.23	-	-	1.35	
平均支払変動金利	0.25	0.29	0.25	0.34	-	-	0.27	
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	-	-	0.33	-	0.34	-	0.34	
合 計	4,300	6,750	12,230	1,020	5,000	-	29,300	
区 分	平成24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	4,000	6,200	8,670	935	-	-	19,805	
平均受取固定金利	1.33	1.42	1.36	1.23	-	-	1.37	
平均支払変動金利	0.25	0.27	0.25	0.33	-	-	0.26	
支払側固定スワップ想定元本	-	2,500	-	-	7,000	-	9,500	
平均支払固定金利	-	0.51	-	-	1.05	-	0.91	
平均受取変動金利	-	0.34	-	-	0.33	-	0.33	
合 計	4,000	8,700	8,670	935	7,000	-	29,305	

## (b) 通貨関連

(単位：百万円)

区分	種類	平成23年度末			平成24年度第2四半期(上半期)末		
		契約額等	時価	差損益	契約額等	時価	差損益
店頭	為替予約						
	売建	378,581	12,625	12,625	499,638	1,656	1,656
	(米ドル)	229,090	8,177	8,177	307,212	2,718	2,718
	(ユーロ)	79,507	3,325	3,325	80,795	499	499
	(オーストラリアドル)	33,555	151	151	30,944	187	187
	(イギリスポンド)	12,241	778	778	17,212	187	187
	(カナダドル)	17,452	20	20	5,562	16	16
	(その他)	6,733	172	172	57,910	170	170
	買建	228,857	1,367	1,367	321,198	1,162	1,162
	(米ドル)	107,814	545	545	146,535	637	637
	(ユーロ)	57,744	1,017	1,017	97,678	234	234
	(オーストラリアドル)	32,481	331	331	18,935	170	170
	(カナダドル)	16,823	0	0	10,919	127	127
	(イギリスポンド)	5,902	84	84	8,112	25	25
	(その他)	8,090	50	50	39,016	19	19
	通貨オプション						
買建							
ブット	110,876			-			
(ユーロ)	(1,674)	14	1,659	(-)	-	-	
(ユーロ)	110,876			-			
(ユーロ)	(1,674)	14	1,659	(-)	-	-	
合計			12,917			494	

- (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23年度末			平成24年度第2四半期(上半期)末		
		契約額等	時価	差損益	契約額等	時価	差損益
取引所	円建株価指数先物						
	買建	4,100	56	56	10,567	60	60
	外貨建株価指数先物						
買建	3,896	9	9	4,844	100	100	
株価指数オプション							
買建							
ブット	109,913			99,968			
(ユーロ)	(4,202)	71	4,130	(3,473)	49	3,423	
合計			4,065			3,463	

- (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23年度末			平成24年度第2四半期(上半期)末		
		契約額等	時価	差損益	契約額等	時価	差損益
取引所	円建債券先物 売建	3,560	10	10	17,406	40	40
	外貨建債券先物 売建	-	-	-	77,271	591	591
	買建	-	-	-	13,236	63	63
店頭	債券店頭オプション 売建						
	コール	3,010 (3)	4	0	251,174 (1,857)	933	923
	プット	20,007 (41)	62	20	47,281 (94)	9	85
	買建						
	コール	20,007 (21)	8	12	47,281 (78)	76	2
	プット	102,993 (1,192)	5	1,187	351,098 (3,762)	2,174	1,588
合計				1,210			1,150

(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。

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23年度末				平成24年度第2四半期(上半期)末			
			契約額等		時価	差損益	契約額等		時価	差損益
				うち1年超				うち1年超		
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	573	573	320,000	320,000	1,684	1,684
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	70,200	52,100	1,434	1,434	54,700	30,600	1,176	1,176
合計						860				508

(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23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	18,100	43,100	6,000	3,000	-	-	70,200	
平均受取固定金利	1.23	1.34	1.70	1.62	-	-	1.35	
平均支払変動金利	0.22	0.28	0.29	0.34	-	-	0.27	
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	-	-	0.44	-	-	-	0.44	
合計	18,100	43,100	326,000	3,000	-	-	390,200	

  

区分	平成24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	24,100	23,600	4,000	3,000	-	-	54,700	
平均受取固定金利	1.11	1.64	1.85	1.62	-	-	1.42	
平均支払変動金利	0.28	0.26	0.33	0.33	-	-	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	-	-	0.44	-	-	-	0.44	
合計	24,100	23,600	324,000	3,000	-	-	374,700	

## (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23年度末				平成24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	-	-	-	-	1,571	1,571	0	0
			-	-	-	-	1,571	1,571	0	0
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		2,539,107	-	138,246	138,246	2,467,697	-	40,524	40,524
	(米ドル)		1,604,010	-	88,623	88,623	1,655,726	-	49,915	49,915
	(ユーロ)		671,205	-	37,535	37,535	559,899	-	5,590	5,590
	(イギリスポンド)		131,637	-	7,461	7,461	143,356	-	2,980	2,980
	(オーストラリアドル)		96,993	-	1,243	1,243	58,389	-	732	732
	(カナダドル)		11,649	-	763	763	12,358	-	59	59
	(その他)		23,610	-	2,618	2,618	37,966	-	1,492	1,492
	買建		7,761	-	64	64	5,689	-	68	68
	(米ドル)		3,134	-	16	16	4,433	-	84	84
(ユーロ)	3,058	-	58	58	1,231	-	15	15		
(イギリスポンド)	1,568	-	10	10	25	-	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		205,203	-	-	-	300,095	-	-	-
	(オーストラリアドル)		135,212	-	-	-	210,122	-	-	-
	(米ドル)		69,990	-	-	-	89,972	-	-	-
	通貨スワップ		107,562	107,562	-	-	107,562	107,562	-	-
(米ドル)	107,562	107,562	-	-	107,562	107,562	-	-		
合計					138,182				40,457	

(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、(d) 債券関連は平成23年度末、平成24年度第2四半期(上半期)末ともに残高がないため、記載していません。

・貸倒引当金の明細

(単位：百万円)

摘 要	平成23年度末	平成24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	2,411	1,372	1,038
(イ)個別貸倒引当金	8,258	1,180	7,078
(ウ)特定海外債権引当勘定	-	-	-
(2)個別貸倒引当金			
(ア)繰入額	8,269	1,190	7,078
(イ)取崩額	8,360	2,650	5,709
[償却に伴う取崩額を除く]			
(ウ)純繰入額	90	1,459	1,369
(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	58	6	51

(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23年度末 : 119百万円
- ・平成24年度第2四半期(上半期)末 : 110百万円