

2014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。

I. 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

II. 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

III. 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

IV. 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）

2013年度末、2014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）

2013年度第2四半期(上半期)、2014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	2013年度末		2014年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
国 債	13,924,344	51.8	13,997,809	49.8
地 方 債	235,000	0.9	138,337	0.5
社 債	1,960,965	7.3	1,644,146	5.9
うち公社・公団債	763,772	2.8	547,541	1.9
株 式	2,862,186	10.6	3,167,504	11.3
外 国 証 券	7,535,743	28.0	8,765,740	31.2
公 社 債	5,817,347	21.6	7,003,680	24.9
株 式 等	1,718,395	6.4	1,762,059	6.3
そ の 他 の 証 券	387,238	1.4	390,306	1.4
合 計	26,905,478	100.0	28,103,844	100.0

（2）地域別地方債保有内訳（一般勘定）

（単位：百万円）

区 分	2013年度末	2014年度 第2四半期(上半期)末
	金 額	金 額
北 海 道	3,725	3,315
東 北	-	-
関 東	75,074	53,167
中 部	41,461	28,075
近 畿	21,089	14,280
中 国	2,431	2,432
四 国	-	-
九 州	23,335	23,189
そ の 他	67,881	13,875
合 計	235,000	138,337

（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	2013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	849,458	1,780,555	1,733,902	1,239,317	1,439,671	19,862,571	26,905,478
国 債	184,354	255,753	296,555	382,078	412,021	12,393,581	13,924,344
地 方 債	108,508	35,446	9,154	25,461	7,132	49,296	235,000
社 債	391,605	445,909	377,380	162,313	155,611	428,145	1,960,965
株 式	-	-	-	-	-	2,862,186	2,862,186
外 国 証 券	158,068	989,537	1,033,241	658,098	812,654	3,884,143	7,535,743
公 社 債	154,220	984,195	1,025,738	656,465	806,731	2,189,996	5,817,347
株 式 等	3,847	5,342	7,502	1,632	5,923	1,694,147	1,718,395
その他の証券	6,922	53,909	17,572	11,366	52,250	245,218	387,238
買入金銭債権	-	13,081	5,410	-	-	257,326	275,818
譲渡性預金	15,000	-	-	-	-	-	15,000
そ の 他	-	2,835	-	-	-	31,863	34,699
区 分	2014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	750,519	2,060,131	1,837,854	1,362,243	1,482,143	20,610,952	28,103,844
国 債	83,383	209,629	338,995	348,898	446,766	12,570,135	13,997,809
地 方 債	14,216	32,198	7,122	27,636	4,372	52,791	138,337
社 債	134,615	491,717	299,668	150,145	168,194	399,804	1,644,146
株 式	-	-	-	-	-	3,167,504	3,167,504
外 国 証 券	511,961	1,263,312	1,177,801	819,210	826,321	4,167,133	8,765,740
公 社 債	509,412	1,254,075	1,172,166	819,210	817,363	2,431,452	7,003,680
株 式 等	2,548	9,237	5,634	-	8,957	1,735,681	1,762,059
その他の証券	6,341	63,273	14,266	16,353	36,488	253,583	390,306
買入金銭債権	268	12,482	5,392	-	-	250,845	268,988
譲渡性預金	19,999	-	-	-	-	-	19,999
そ の 他	-	2,779	-	-	-	29,226	32,006

(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		2013年度末		2014年度 第2四半期(上半期)末	
		金 額	占 率	金 額	占 率
水産・農林業		145	0.0	159	0.0
鉱業		200	0.0	200	0.0
建設業		69,244	2.4	80,478	2.5
製 造 業	食料品	147,840	5.2	171,868	5.4
	繊維製品	21,553	0.8	22,881	0.7
	パルプ・紙	4,260	0.1	2,647	0.1
	化学	123,365	4.3	137,483	4.3
	医薬品	43,251	1.5	48,759	1.5
	石油・石炭製品	4,236	0.1	4,388	0.1
	ゴム製品	23,237	0.8	22,283	0.7
	ガラス・土石製品	99,196	3.5	125,180	4.0
	鉄鋼	65,230	2.3	70,587	2.2
	非鉄金属	11,546	0.4	12,245	0.4
	金属製品	40,977	1.4	40,310	1.3
	機械	161,494	5.6	177,762	5.6
	電気機器	461,265	16.1	520,824	16.4
	輸送用機器	184,296	6.4	201,406	6.4
	精密機器	67,466	2.4	74,018	2.3
	その他製品	62,797	2.2	69,728	2.2
電気・ガス業		96,434	3.4	109,619	3.5
運 輸 ・ 情 報 通 信 業	陸運業	229,850	8.0	266,042	8.4
	海運業	54	0.0	66	0.0
	空運業	1,212	0.0	1,393	0.0
	倉庫・運輸関連業	5,292	0.2	5,415	0.2
	情報・通信業	51,657	1.8	60,641	1.9
商 業	卸売業	112,500	3.9	125,123	4.0
	小売業	102,499	3.6	104,472	3.3
金 融 ・ 保 険 業	銀行業	346,859	12.1	366,626	11.6
	証券・商品先物取引業	11,936	0.4	8,643	0.3
	保険業	198,278	6.9	204,406	6.5
	その他金融業	19,430	0.7	21,244	0.7
不動産業		24,139	0.8	23,216	0.7
サービス業		70,433	2.5	87,376	2.8
合 計		2,862,186	100.0	3,167,504	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	2013年度末	2014年度 第2四半期(上半期)末
保 険 約 款 貸 付	452,938	442,855
保 険 料 振 替 貸 付	49,177	47,308
契 約 者 貸 付	403,761	395,546
一 般 貸 付	2,570,235	2,609,149
(うち非居住者貸付)	(64,721)	(67,848)
企 業 貸 付	2,184,380	2,265,138
(うち国内企業向け)	(2,142,259)	(2,219,890)
国・国際機関・政府関係機関貸付	22,898	21,584
公 共 団 体 ・ 公 企 業 貸 付	361,189	320,910
住 宅 口 ー ン	1,698	1,454
消 費 者 口 ー ン	32	35
そ の 他	36	25
合 計	3,023,173	3,052,004

(2) 貸付金残存期間別残高（一般勘定）

（単位：百万円）

区 分	1年以下	1年超 3年以下	3年超 5年以下	5年超 7年以下	7年超 10年以下	10年超 (期間の定めのないものを含む)	合 計
2013年度末	変 動 金 利	14,422	18,096	10,920	17,790	1,000	64,658
	固 定 金 利	189,796	527,265	441,722	258,762	503,732	2,505,576
	一 般 貸 付 計	204,219	545,361	452,643	276,552	504,732	2,570,235
2014年度 第2四半期 (上半期)末	変 動 金 利	11,248	14,304	10,704	22,605	1,000	96,938
	固 定 金 利	242,606	482,124	437,810	272,322	474,414	2,512,210
	一 般 貸 付 計	253,855	496,428	448,514	294,928	475,414	2,609,149

(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		2013年度末		2014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	245	62.8	243	63.6
	金 額	1,840,359	85.9	1,907,149	85.9
中 堅 企 業	貸付先数	15	3.8	13	3.4
	金 額	2,353	0.1	4,259	0.2
中 小 企 業	貸付先数	130	33.3	126	33.0
	金 額	299,545	14.0	308,481	13.9
国内企業向け 貸付計	貸付先数	390	100.0	382	100.0
	金 額	2,142,259	100.0	2,219,890	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	常用する従業員300名超かつ 資本金3億円超10億円未満	常用する従業員50名超かつ 資本金5千万円超10億円未満	常用する従業員100名超かつ 資本金5千万円超10億円未満	常用する従業員100名超かつ 資本金1億円超10億円未満
中 小 企 業	資本金3億円以下又は 常用する従業員300名以下	資本金5千万円以下又は 常用する従業員50名以下	資本金5千万円以下又は 常用する従業員100名以下	資本金1億円以下又は 常用する従業員100名以下

(4) 貸付金業種別内訳 (一般勘定)

(単位: 百万円、%)

区 分	2013年度末		2014年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
製 造 業	383,196	14.9	401,401	15.4
食 料	30,801	1.2	34,233	1.3
織 維	5,469	0.2	4,237	0.2
木 材 ・ 木 製 品	625	0.0	595	0.0
パ ル プ ・ 紙	30,272	1.2	30,058	1.2
印 刷	17,563	0.7	16,931	0.6
化 学	23,054	0.9	22,390	0.9
石 油 ・ 石 炭	27,699	1.1	27,482	1.1
窯 業 ・ 土 石	30,616	1.2	29,839	1.1
鉄 鋼	80,320	3.1	78,300	3.0
非 鉄 金 属	10,565	0.4	10,090	0.4
金 属 製 品	884	0.0	890	0.0
はん用・生産用・業務用機械	47,679	1.9	48,653	1.9
電 気 機 械	46,146	1.8	75,989	2.9
輸 送 用 機 械	26,295	1.0	18,268	0.7
そ の 他 の 製 造 業	5,202	0.2	3,441	0.1
農 業 、 林 業	-	-	-	-
漁 業	-	-	-	-
鉱業、採石業、砂利採取業	-	-	-	-
建 設 業	11,438	0.4	10,905	0.4
電 気 ・ ガ ス ・ 熱 供 給 ・ 水 道 業	425,319	16.5	428,038	16.4
情 報 通 信 業	46,137	1.8	51,119	2.0
運 輸 業 、 郵 便 業	271,146	10.5	265,240	10.2
卸 売 業	497,974	19.4	502,784	19.3
小 売 業	12,214	0.5	12,463	0.5
金 融 業 、 保 険 業	572,118	22.3	578,485	22.2
不 動 産 業	138,692	5.4	142,574	5.5
物 品 賃 貸 業	105,768	4.1	107,440	4.1
学術研究、専門・技術サービス業	159	0.0	534	0.0
宿 泊 業	371	0.0	309	0.0
飲 食 業	-	-	-	-
生活関連サービス業・娯楽業	3,201	0.1	2,947	0.1
教 育 、 学 習 支 援 業	36	0.0	25	0.0
医 療 ・ 福 祉	-	-	-	-
そ の 他 の サ ー ビ ス	2,049	0.1	2,913	0.1
地 方 公 共 団 体	33,491	1.3	32,226	1.2
個人(住宅・消費・納税資金等)	1,731	0.1	1,490	0.1
そ の 他	466	0.0	400	0.0
合 計	2,505,514	97.5	2,541,301	97.4
海 外 向 け				
政 府 等	22,600	0.9	22,600	0.9
金 融 機 関	13,000	0.5	13,000	0.5
商 工 業 等	29,121	1.1	32,248	1.2
合 計	64,721	2.5	67,848	2.6
一 般 貸 付 計	2,570,235	100.0	2,609,149	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	2013年度末		2014年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
北 海 道	37,682	1.5	37,729	1.5
東 北	44,005	1.8	44,498	1.8
関 東	1,924,712	76.9	1,952,756	76.9
中 部	191,059	7.6	192,647	7.6
近 畿	173,188	6.9	181,098	7.1
中 国	50,104	2.0	47,941	1.9
四 国	20,012	0.8	19,725	0.8
九 州	63,017	2.5	63,413	2.5
合 計	2,503,783	100.0	2,539,810	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	2013年度末		2014年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
担 保 貸 付	13,382	0.5	10,188	0.4
有価証券担保貸付	3,308	0.1	3,152	0.1
不動産・動産・財団担保貸付	10,061	0.4	7,034	0.3
指名債権担保貸付	12	0.0	0	0.0
保 証 貸 付	82,203	3.2	86,585	3.3
信 用 貸 付	2,472,917	96.2	2,510,885	96.2
そ の 他	1,731	0.1	1,490	0.1
一 般 貸 付 計	2,570,235	100.0	2,609,149	100.0
うち劣後特約付貸付	307,563	12.0	334,363	12.8

- (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	2013年度末		2014年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
公 社 債	5,170,550	62.2	6,264,123	64.6
株 式	689,780	8.3	733,343	7.6
現 預 金 ・ そ の 他	179,473	2.2	239,061	2.5
小 計	6,039,804	72.7	7,236,528	74.6

円貨額が確定した外貨建資産

（単位：百万円、％）

区 分	2013年度末		2014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	527,827	6.3	616,002	6.4
小 計	527,827	6.3	616,002	6.4

円貨建資産

（単位：百万円、％）

区 分	2013年度末		2014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	64,721	0.8	64,645	0.7
公 社 債 (円 建 外 債) ・ そ の 他	1,680,230	20.2	1,778,936	18.3
小 計	1,744,951	21.0	1,843,581	19.0

合 計

（単位：百万円、％）

区 分	2013年度末		2014年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
海 外 投 融 資	8,312,583	100.0	9,696,112	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	2013年度末		2014年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
米 ド ル	2,549,930	42.2	3,385,559	46.8
ユ ー ロ	1,918,320	31.8	2,122,855	29.3
オーストラリアドル	627,953	10.4	700,387	9.7
イギリスポンド	274,031	4.5	265,146	3.7
ポーランドズロチ	109,286	1.8	140,560	1.9
ニュージーランドドル	100,172	1.7	133,364	1.8
メキシコペソ	97,244	1.6	122,369	1.7
そ の 他 共 計	6,039,804	100.0	7,236,528	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	2013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	2,342,265	31.1	2,142,768	36.8	199,497	11.6	20,000	30.9
ヨ ー ロ ッ パ	2,505,937	33.3	2,326,343	40.0	179,594	10.5	23,500	36.3
オ セ ア ニ ア	772,339	10.2	606,970	10.4	165,368	9.6	5,000	7.7
ア ジ ア	184,573	2.4	55,390	1.0	129,182	7.5	1,500	2.3
中 南 米	1,536,934	20.4	492,360	8.5	1,044,574	60.8	2,121	3.3
中 東	-	-	-	-	-	-	-	-
ア フ リ カ	14,873	0.2	14,694	0.3	178	0.0	-	-
国 際 機 関	178,818	2.4	178,818	3.1	-	-	12,600	19.5
合 計	7,535,743	100.0	5,817,347	100.0	1,718,395	100.0	64,721	100.0
区 分	2014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	3,017,318	34.4	2,808,008	40.1	209,310	11.9	20,000	29.5
ヨ ー ロ ッ パ	2,745,968	31.3	2,565,331	36.6	180,637	10.3	26,702	39.4
オ セ ア ニ ア	867,807	9.9	693,798	9.9	174,009	9.9	5,000	7.4
ア ジ ア	271,558	3.1	113,524	1.6	158,033	9.0	1,500	2.2
中 南 米	1,634,060	18.6	594,225	8.5	1,039,835	59.0	2,045	3.0
中 東	-	-	-	-	-	-	-	-
ア フ リ カ	36,102	0.4	35,868	0.5	234	0.0	-	-
国 際 機 関	192,924	2.2	192,924	2.8	-	-	12,600	18.6
合 計	8,765,740	100.0	7,003,680	100.0	1,762,059	100.0	67,848	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	2013年度末						2014年度第2四半期(上半期)末					
	金利関連	通貨関連	株式関連	債券関連	その他	合計	金利関連	通貨関連	株式関連	債券関連	その他	合計
ヘッジ会計適用分	633	50,388	293	-	-	51,315	185	97,553	7,659	-	-	105,398
ヘッジ会計非適用分	6,085	7,004	221	1,529	-	14,841	8,900	4,738	32	5,120	70	9,179
合 計	6,718	57,393	515	1,529	-	66,157	9,086	92,814	7,627	5,120	70	114,578

（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。

2013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 47,786百万円、株式関連 293百万円）及びヘッジ会計非適用分の差損益（14,841百万円）の合計 62,921百万円

2014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 124,357百万円、株式関連 7,659百万円）及びヘッジ会計非適用分の差損益（9,179百万円）の合計 141,196百万円

時価情報

（a）金利関連

（単位：百万円）

区 分	種 類	2013年度末					2014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			
店 頭	金利スワップ										
	固定金利受取 / 変動金利支払	46,320	32,570	894	894	509	37,125	26,425	831	831	468
	固定金利支払 / 変動金利受取	324,900	324,900	1,237	1,237	1,143	326,600	324,100	862	862	654
	金利スワップション										
	売建										
	固定金利支払 / 変動金利受取	-	-	-	-	-	200,000	200,000	1,587	1,146	-
買建											
固定金利支払 / 変動金利受取	480,000	480,000	5,220	6,374	-	762,000	590,000	5,528	10,202	-	
		(11,594)	(11,594)				(15,730)	(12,606)			
合 計				6,718	633				9,086	185	

（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、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	2013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	13,750	15,490	5,180	2,000	7,600	2,300	46,320	
平均受取固定金利	1.69	1.50	1.20	0.63	0.91	1.19	1.37	
平均支払変動金利	0.19	0.17	0.20	0.19	0.19	0.21	0.18	
支払側固定スワップ想定元本	-	322,500	-	-	-	2,400	324,900	
平均支払固定金利	-	0.52	-	-	-	1.73	0.53	
平均受取変動金利	-	0.32	-	-	-	0.21	0.32	
合 計	13,750	337,990	5,180	2,000	7,600	4,700	371,220	
区 分	2014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	10,700	12,430	5,095	2,000	4,600	2,300	37,125	
平均受取固定金利	1.48	1.51	1.20	0.63	0.98	1.19	1.33	
平均支払変動金利	0.16	0.15	0.17	0.18	0.17	0.21	0.17	
支払側固定スワップ想定元本	2,500	320,000	-	-	-	4,100	326,600	
平均支払固定金利	0.51	0.52	-	-	-	1.61	0.54	
平均受取変動金利	0.19	0.31	-	-	-	0.18	0.30	
合 計	13,200	332,430	5,095	2,000	4,600	6,400	363,725	

(b) 通貨関連

(単位: 百万円)

区分	種類	2013年度末				2014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	4,158,974	54,819	54,819	47,814	4,897,747	122,773	122,773	124,431	
	(米ドル)	1,819,275	24,196	24,196	22,338	2,111,385	131,022	131,022	118,642	
	(ユーロ)	1,288,459	13,397	13,397	12,887	1,703,149	5,749	5,749	2,512	
	(オーストラリアドル)	325,563	11,063	11,063	8,166	438,277	8,828	8,828	340	
	(イギリスポンド)	228,534	713	713	318	164,508	3,965	3,965	3,603	
	(カナダドル)	92,863	253	253	248	21,179	193	193	204	
	(その他)	404,277	5,195	5,195	3,854	459,247	2,170	2,170	4,151	
	買建	1,223,657	1,290	1,290	28	1,474,124	37,347	37,347	34,194	
	(米ドル)	583,945	67	67	19	1,110,765	38,728	38,728	34,193	
	(ユーロ)	142,162	225	225	0	105,788	40	40	0	
	(カナダドル)	78,661	0	0	-	85,852	6	6	0	
	(イギリスポンド)	84,397	19	19	8	54,084	69	69	0	
	(オーストラリアドル)	114,870	288	288	-	26,083	948	948	-	
	(その他)	219,619	689	689	-	91,549	456	456	-	
	通貨オプション									
	買建									
	プット	207,940				27,920				
	(米ドル)	(1,317)	55	1,261	-	(71)	-	71	-	
	(ユーロ)	207,940				27,920				
(米ドル)	(1,317)	55	1,261	-	(71)	-	71	-		
通貨スワップ	42,977	2,602	2,602	2,602	74,337	7,316	7,316	7,316		
(米ドル)	42,977	2,602	2,602	2,602	69,986	7,266	7,266	7,266		
(ユーロ)	-	-	-	-	4,351	50	50	50		
合計			57,393	50,388			92,814	97,553		

- (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. 年度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	2013年度末				2014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	29,936	83	83	-	-	-	-	-
	外貨建株価指数先物 売建	10,095	305	305	-	10,008	32	32	-
店頭	国内株式先渡契約 売建	53,072	293	293	293	53,284	7,659	7,659	7,659
合計				515	293			7,627	7,659

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

(d) 債券関連

(単位: 百万円)

区分	種類	2013年度末				2014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 買建	10,859	13	13	-	12,238	11	11	-
	外貨建債券先物 売建	-	-	-	-	302,272	644	644	-
	買建	-	-	-	-	497,021	2,673	2,673	-
店頭	外貨建債券先渡契約 売建	-	-	-	-	79,819	17	17	-
	買建	-	-	-	-	87,784	162	162	-
	債券店頭オプション 売建								
	コール	431,678 (4,174)	2,100	2,074	-	531,477 (2,717)	5,470	2,752	-
	プット	17,731 (38)	40	1	-	20,507 (67)	46	20	-
	買建								
	コール	17,731 (33)	9	23	-	20,507 (41)	48	6	-
プット	431,678 (8,456)	4,891	3,565	-	531,477 (7,609)	1,738	5,871	-	
合計				1,529	-			5,120	-

- (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。

(e) その他

(単位: 百万円)

区分	種類	2013年度末				2014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	うちヘッジ会計適用分
店頭	クレジット・フォルト・スワップ オプション売建	-	-	-	-	8,000	8,000	116	116	-
	オプション買建	-	-	-	-	2,000	2,000	46	46	-
合計					-				70	-

- (注) 差損益欄には、時価を記載しています。

・特別勘定（個人変額保険・個人変額年金保険）

1. 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	2013年度末		2014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	49,898	156	53,429	1,638

(2) 金銭の信託の時価情報

2013年度末、2014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	2013年度末					2014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	-	2	-	-	2	-	3	-	-	3
合 計	-	2	-	-	2	-	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	2013年度末				2014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	754	6	6	-	590	10	10	-
	(イギリスポンド)	1	0	0	-	268	3	3	-
	(米ドル)	228	2	2	-	125	5	5	-
	(ユーロ)	462	2	2	-	54	0	0	-
	(カナダドル)	0	0	0	-	36	0	0	-
	(オーストラリアドル)	60	2	2	-	-	-	-	-
	(その他)	-	-	-	-	106	1	1	-
	買建	688	8	8	-	601	14	14	-
	(米ドル)	518	7	7	-	536	13	13	-
	(ユーロ)	127	1	1	-	23	0	0	-
	(その他)	42	0	0	-	41	0	0	-
	合 計			2	-			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2013年度末、2014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	2013年度末		2014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	109,852	4,434	100,200	2,800

(2) 金銭の信託の時価情報

2013年度末、2014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	2013年度末					2014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	2013年度末				2014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	0	0	0	-	5	0	0	-
	(カナダドル)	0	0	0	-	5	0	0	-
	(イギリスポンド)	0	0	0	-	0	0	0	-
	(米ドル)	0	0	0	-	0	0	0	-
	(ユーロ)	0	0	0	-	0	0	0	-
	(その他)	-	-	-	-	0	0	0	-
	買建	-	-	-	-	6	0	0	-
	(米ドル)	-	-	-	-	3	0	0	-
	(ユーロ)	-	-	-	-	3	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2013年度末、2014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	2013年度末		2014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	908,473	2.7	981,259	2.8
買 現 先 勘 定	-	-	-	-
債券貸借取引支払保証金	-	-	-	-
買 入 金 銭 債 権	275,818	0.8	268,988	0.8
商 品 有 価 証 券	-	-	-	-
金 銭 の 信 託	34,699	0.1	32,006	0.1
有 価 証 券	28,005,170	82.3	29,228,210	82.6
公 社 債	16,449,450	48.3	16,096,882	45.5
株 式	3,136,437	9.2	3,450,439	9.8
外 国 証 券	7,938,499	23.3	9,201,731	26.0
公 社 債	5,998,151	17.6	7,196,795	20.3
株 式 等	1,940,348	5.7	2,004,935	5.7
そ の 他 の 証 券	480,783	1.4	479,156	1.4
貸 付 金	3,023,173	8.9	3,052,004	8.6
保 険 約 款 貸 付	452,938	1.3	442,855	1.3
一 般 貸 付	2,570,235	7.6	2,609,149	7.4
不 動 産	1,206,176	3.5	1,196,018	3.4
繰 延 税 金 資 産	11,163	0.0	-	-
そ の 他	566,901	1.7	625,581	1.8
貸 倒 引 当 金	2,753	0.0	2,663	0.0
合 計	34,028,823	100.0	35,381,404	100.0
う ち 外 貨 建 資 産	6,442,552	18.9	7,666,732	21.7

(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	2013年度 第2四半期(上半期)	2014年度 第2四半期(上半期)
	現預金・コールローン	862
買 現 先 勘 定	-	-
債券貸借取引支払保証金	-	-
買 入 金 銭 債 権	5,185	6,830
商 品 有 価 証 券	-	-
金 銭 の 信 託	4,371	2,693
有 価 証 券	345,373	1,223,039
公 社 債	52,455	352,568
株 式	317,378	314,001
外 国 証 券	64,670	1,263,232
公 社 債	49,336	1,198,644
株 式 等	15,334	64,587
そ の 他 の 証 券	15,779	1,626
貸 付 金	57,947	28,831
保 険 約 款 貸 付	10,980	10,082
一 般 貸 付	46,966	38,913
不 動 産	15,939	10,157
繰 延 税 金 資 産	2,597	11,163
そ の 他	132,582	58,680
貸 倒 引 当 金	2,405	89
合 計	402,199	1,352,581
う ち 外 貨 建 資 産	149,504	1,224,180

(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	2013年度末		2014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	1,131,556	30,309	1,153,592	30,330
一 般 勘 定	31,863	788	29,226	1,584
特 別 勘 定	1,099,692	29,520	1,124,365	28,746

(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	差損益		
				差益	差損	
2013年度末	満期保有目的の債券	45,109	48,862	3,753	-	
	公 社 債	45,109	48,862	3,753	-	
	外 国 公 社 債	-	-	-	-	
	責任準備金対応債券	11,726,939	12,799,665	1,072,726	142	
	公 社 債	11,721,834	12,794,528	1,072,693	142	
	外 国 公 社 債	5,104	5,137	33	-	
	子会社・関連会社株式	28,434	44,116	15,682	-	
	そ の 他 の 有 価 証 券	12,115,568	14,013,790	1,898,222	81,864	
	公 社 債	4,048,489	4,353,365	304,875	1,222	
	株 式	1,605,896	2,537,699	931,802	53,892	
	外 国 証 券	5,928,966	6,540,243	611,277	25,508	
	公 社 債	5,327,360	5,812,243	484,882	19,592	
	株 式 等	601,605	728,000	126,394	5,916	
	そ の 他 の 証 券	252,517	288,828	36,311	1,066	
	買 入 金 銭 債 権	262,110	275,818	13,708	173	
	譲 渡 性 預 金	15,000	15,000	0	-	
	金 銭 の 信 託	2,587	2,835	247	-	
	合 計	23,916,050	26,906,435	2,990,384	82,007	
	2014年度第2四半期(上半期)末	公 社 債	15,815,433	17,196,756	1,381,322	1,365
		株 式	1,605,896	2,537,699	931,802	53,892
外 国 証 券		5,960,087	6,587,059	626,971	25,508	
公 社 債		5,332,465	5,817,380	484,915	19,592	
株 式 等		627,622	769,678	142,055	5,916	
そ の 他 の 証 券		254,934	291,266	36,332	1,066	
買 入 金 銭 債 権		262,110	275,818	13,708	173	
譲 渡 性 預 金		15,000	15,000	0	-	
金 銭 の 信 託		2,587	2,835	247	-	
満期保有目的の債券		45,260	49,471	4,210	-	
公 社 債		45,260	49,471	4,210	-	
外 国 公 社 債		-	-	-	-	
責任準備金対応債券		11,615,618	12,965,262	1,349,644	17	
公 社 債		11,603,514	12,952,934	1,349,420	17	
外 国 公 社 債		12,104	12,328	223	-	
子会社・関連会社株式		26,878	60,154	33,275	-	
そ の 他 の 有 価 証 券		12,847,689	15,301,022	2,453,332	53,201	
公 社 債		3,794,955	4,130,668	335,713	295	
株 式		1,588,299	2,838,537	1,250,238	37,623	
外 国 証 券		6,935,052	7,753,642	818,589	15,185	
公 社 債	6,323,819	6,991,576	667,757	11,368		
株 式 等	611,233	762,065	150,832	3,817		
そ の 他 の 証 券	251,799	286,406	34,606	93		
買 入 金 銭 債 権	254,995	268,988	13,992	2		
譲 渡 性 預 金	20,000	19,999	0	0		
金 銭 の 信 託	2,587	2,779	191	-		
合 計	24,535,446	28,375,910	3,840,463	53,219		
公 社 債	15,443,729	17,133,073	1,689,344	313		
株 式	1,588,299	2,838,537	1,250,238	37,623		
外 国 証 券	6,973,173	7,825,257	852,083	15,185		
公 社 債	6,335,923	7,003,904	667,981	11,368		
株 式 等	637,250	821,352	184,102	3,817		
そ の 他 の 証 券	252,660	287,273	34,612	93		
買 入 金 銭 債 権	254,995	268,988	13,992	2		
譲 渡 性 預 金	20,000	19,999	0	0		
金 銭 の 信 託	2,587	2,779	191	-		

(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	2013年度末	2014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	-	-
その他の	-	-
責任準備金対応債券	-	-
子会社・関連会社株式	418,119	451,013
非上場国内株式(店頭売買株式を除く)	201,171	206,964
非上場外国株式(店頭売買株式を除く)	172,743	192,479
その他の	44,204	51,569
その他の有価証券	966,677	955,813
非上場国内株式(店頭売買株式を除く)	123,314	122,002
非上場外国株式(店頭売買株式を除く)	775,099	765,001
非上場外国公社債	0	0
その他の	68,263	68,809
合 計	1,384,797	1,406,826

- (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。
 (2013年度末：15,280百万円、2014年度第2四半期(上半期)末：15,570百万円)

(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
2013年度末	34,699	34,699	1,036	6,681	5,645
2014年度第2四半期(上半期)末	32,006	32,006	1,776	6,916	5,139

- (注) 1. 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。
 2. 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	2013年度末		2014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	31,863	788	29,226	1,584

・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	2013年度末					2014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	2,587	2,835	247	247	-	2,587	2,779	191	191	-

(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

2014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、2014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、2014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	2013 年度末		2014 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	3,712	24	3,637	24
金利スワップション	4,800	76	9,620	110
為 替 予 約	60,041	477	70,534	899
通貨オプション	2,079	14	279	2
通貨スワップ	1,604	57	2,052	239
債券先渡契約	-	-	1,676	3
債券オプション	8,988	70	11,039	73
株式先渡契約	530	36	532	33
クレジット・デリバティブ	-	-	100	1
合 計	81,756	757	99,472	1,388

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	2013年度末						2014年度第2四半期(上半期)末					
	金利関連	通貨関連	株式関連	債券関連	その他	合計	金利関連	通貨関連	株式関連	債券関連	その他	合計
ヘッジ会計適用分	633	50,388	293	-	-	51,315	185	97,553	7,659	-	-	105,398
ヘッジ会計非適用分	6,085	7,489	206	1,529	-	14,897	8,900	3,648	69	5,146	70	10,259
合 計	6,718	57,877	86	1,529	-	66,212	9,086	93,905	7,590	5,146	70	115,658

(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。

2013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 47,786百万円、株式関連 293百万円) 及びヘッジ会計非適用分の差損益 (14,897百万円) の合計 62,977百万円

2014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 124,357百万円、株式関連 7,659百万円) 及びヘッジ会計非適用分の差損益 (10,259百万円) の合計 142,276百万円

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	2013年度末				2014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
店 頭	金利スワップ								
	固定金利受取 / 変動金利支払	20,820	17,770	384	384	17,625	13,625	362	362
	固定金利支払 / 変動金利受取	4,900	4,900	94	94	6,600	4,100	207	207
	金利スワップション								
	売建								
	固定金利支払 / 変動金利受取	-	-	-	-	200,000	200,000	1,587	1,146
買建									
固定金利支払 / 変動金利受取	480,000	480,000	5,220	6,374	762,000	590,000	5,528	10,202	
		(11,594)	(11,594)		(15,730)	(12,606)			
合 計				6,085				8,900	

(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、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	2013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	3,050	9,490	680	-	7,600	-	20,820	
平均受取固定金利	1.35	1.37	1.23	-	0.91	-	1.19	
平均支払変動金利	0.20	0.16	0.19	-	0.19	-	0.18	
支払側固定スワップ想定元本	-	2,500	-	-	-	2,400	4,900	
平均支払固定金利	-	0.51	-	-	-	1.73	1.11	
平均受取変動金利	-	0.21	-	-	-	0.21	0.21	
合 計	3,050	11,990	680	-	7,600	2,400	25,720	
区 分	2014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	8,430	595	-	4,600	-	17,625	
平均受取固定金利	1.37	1.35	1.23	-	0.98	-	1.25	
平均支払変動金利	0.17	0.14	0.17	-	0.17	-	0.16	
支払側固定スワップ想定元本	2,500	-	-	-	-	4,100	6,600	
平均支払固定金利	0.51	-	-	-	-	1.61	1.19	
平均受取変動金利	0.19	-	-	-	-	0.18	0.18	
合 計	6,500	8,430	595	-	4,600	4,100	24,225	

(b) 通貨関連

(単位:百万円)

区分	種類	2013年度末			2014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	1,494,559	7,871	7,871	1,297,501	58	58
	(ユーロ)	257,558	867	867	459,115	3,088	3,088
	(米ドル)	731,036	2,181	2,181	454,867	13,451	13,451
	(オーストラリアドル)	120,501	2,980	2,980	170,856	9,187	9,187
	(イギリスポンド)	91,712	443	443	44,072	641	641
	(カナダドル)	79,598	22	22	18,885	23	23
	(その他)	214,152	1,375	1,375	149,704	1,898	1,898
	買建	1,254,065	1,643	1,643	922,194	3,661	3,661
	(米ドル)	606,409	346	346	555,003	5,010	5,010
	(ユーロ)	148,217	281	281	107,666	28	28
	(カナダドル)	78,684	0	0	86,285	6	6
	(イギリスポンド)	85,218	23	23	54,500	82	82
	(オーストラリアドル)	114,883	288	288	26,091	948	948
	(その他)	220,652	702	702	92,647	448	448
	通貨オプション						
	買建						
	ブット	207,940			27,920		
	(米ドル)	(1,317)	55	1,261	(71)	-	71
(米ドル)	207,940			27,920			
(米ドル)	(1,317)	55	1,261	(71)	-	71	
合 計			7,489			3,648	

(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	2013年度末			2014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	31,961	75	75	-	-	-
	買建	10,153	288	288	7,748	104	104
	外貨建株価指数先物						
売建	10,095	305	305	11,412	36	36	
買建	11,016	148	148	5,209	71	71	
合計				206			69

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

(d) 債券関連

(単位:百万円)

区分	種類	2013年度末			2014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						
	買建	10,859	13	13	17,633	13	13
	外貨建債券先物						
	売建	-	-	-	302,272	644	644
買建	-	-	-	508,686	2,646	2,646	
店頭	外貨建債券先渡契約						
	売建	-	-	-	79,819	17	17
	買建	-	-	-	87,784	162	162
	債券店頭オプション						
	売建						
	コール	431,678			531,477		
	(4,174)		2,100	2,074	(2,717)	5,470	2,752
	プット	17,731			20,507		
	(38)		40	1	(67)	46	20
	買建						
コール	17,731			20,507			
(33)		9	23	(41)	48	6	
プット	431,678			531,477			
(8,456)		4,891	3,565	(7,609)	1,738	5,871	
合計				1,529			5,146

- (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。

(e) その他

(単位:百万円)

区分	種類	2013年度末			2014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	
店頭	クレジット・フォルト・スワップ								
	オプション売建	-	-	-	-	8,000	8,000	116	116
	オプション買建	-	-	-	-	2,000	2,000	46	46
合計					-				70

- (注) 差損益欄には、時価を記載しています。

ヘッジ会計が適用されているもの

(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	2013年度末				2014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	1,143	1,143	320,000	320,000	654	654
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	25,500	14,800	509	509	19,500	12,800	468	468
合計						633				185

(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	2013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	10,700	6,000	4,500	2,000	-	2,300	25,500	
平均受取固定金利	1.79	1.70	1.20	0.63	-	1.19	1.52	
平均支払変動金利	0.18	0.18	0.20	0.19	-	0.21	0.19	
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	-	0.32	-	-	-	-	0.32	
合計	10,700	326,000	4,500	2,000	-	2,300	345,500	

区分	2014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	6,700	4,000	4,500	2,000	-	2,300	19,500	
平均受取固定金利	1.55	1.85	1.20	0.63	-	1.19	1.39	
平均支払変動金利	0.16	0.18	0.18	0.18	-	0.21	0.18	
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	-	0.31	-	-	-	-	0.31	
合計	6,700	324,000	4,500	2,000	-	2,300	339,500	

(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	2013年度末				2014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	為替予約 買建 (米ドル)	外国株式 予約取引	-	-	-	-	570,043	-	34,120	34,120									
			-	-	-	-	570,043	-	34,120	34,120									
	通貨スワップ (米ドル)	外貨建 債券	42,977	42,977	2,602	2,602	74,337	74,337	7,316	7,316									
			42,977	42,977	2,602	2,602	69,986	69,986	7,266	7,266									
			-	-	-	-	4,351	50	50										
ヘッジ対象に係る損益を認識する方法	為替予約 売建 (米ドル) (ユーロ) (オーストラリアドル) (イギリスポンド) (カナダドル) (その他)	外貨建 債券	2,734,183	-	47,814	47,814	3,670,952	-	124,431	124,431									
			1,116,047	-	22,338	22,338	1,682,850	-	118,642	118,642									
			1,063,706	-	12,887	12,887	1,267,691	-	2,512	2,512									
			207,160	-	8,166	8,166	268,393	-	340	340									
			141,008	-	318	318	133,252	-	3,603	3,603									
			14,462	-	248	248	4,552	-	204	204									
			191,798	-	3,854	3,854	314,213	-	4,151	4,151									
	買建 (米ドル) (イギリスポンド) (カナダドル) (ユーロ)		4,323	-	28	28	1,343	-	73	73									
			3,247	-	19	19	1,288	-	72	72									
			641	-	8	8	24	-	0	0									
			-	-	-	-	18	-	0	0									
			-	-	-	-	12	-	0	0									
			434	-	0	0		-	0	0									
為替予約等の振当処理	為替予約 売建 (オーストラリアドル) (米ドル) (その他)	外貨建 定期預金	516,987	-	-	-	591,394	-	-	-									
			329,055	-	-	-	378,797	-	-	-									
			187,932	-	-	-	182,890	-	-	-									
			-	-	-	-	29,707	-	-	-									
	通貨スワップ (米ドル)	外貨建社債 (負債)	107,562	107,562	-	-	107,562	107,562	-	-									
			107,562	107,562	-	-	107,562	107,562	-	-									
通貨スワップ (米ドル)	外貨建 貸付金	9,920	9,920	-	-	23,382	23,382	-	-										
		9,920	9,920	-	-	23,382	23,382	-	-										
合 計									50,388										97,553

- (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。(注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	2013年度末				2014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	53,072	-	293	293	53,284	-	7,659	7,659
合 計						293				7,659

(注) 差損益欄には、時価を記載しています。

(d) 債券関連は2013年度末、2014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	2013年度末	2014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	1,394	1,403	9
(イ)個別貸倒引当金	1,358	1,259	99
(ウ)特定海外債権引当勘定	-	-	-
(2)個別貸倒引当金			
(ア)繰入額	1,361	1,262	98
(イ)取崩額	2,339	1,361	977
[償却に伴う取崩額を除く]			
(ウ)純繰入額	977	98	878
(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	31	3	27

(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。

- ・2013年度末 : 67百万円
- ・2014年度第2四半期(上半期)末 : 63百万円