

Ⅱ. 平成26年度決算（案） 補足資料

1. 一般勘定

(1) 商品有価証券関係	・ ・ ・ ・ 1
① 商品有価証券明細表	・ ・ ・ ・ 1
② 商品有価証券売買高	・ ・ ・ ・ 1
(2) 有価証券関係	・ ・ ・ ・ 1
① 有価証券明細表	・ ・ ・ ・ 1
② 有価証券残存期間別残高	・ ・ ・ ・ 2
③ 地域別地方債保有内訳	・ ・ ・ ・ 2
④ 公社債及び外国公社債格付別内訳	・ ・ ・ ・ 3
⑤ 株式業種別内訳	・ ・ ・ ・ 3
(3) 貸付金関係	・ ・ ・ ・ 4
① 貸付金明細表	・ ・ ・ ・ 4
② 貸付金企業規模別内訳	・ ・ ・ ・ 4
③ 貸付金業種別内訳	・ ・ ・ ・ 5
④ 貸付金担保別内訳	・ ・ ・ ・ 6
⑤ 貸付金地域別内訳	・ ・ ・ ・ 6
⑥ 一般貸付金残存期間別残高	・ ・ ・ ・ 6
(4) 海外投融資関係	・ ・ ・ ・ 7
① 資産別明細	・ ・ ・ ・ 7
② 外貨建資産の通貨別構成	・ ・ ・ ・ 8
③ 海外投融資の地域別構成	・ ・ ・ ・ 8
(5) デリバティブ取引の状況	・ ・ ・ ・ 9

2. 個人変額保険特別勘定

(1) 売買目的有価証券の評価損益	・ ・ ・ ・ 13
(2) デリバティブ取引の状況	・ ・ ・ ・ 13

3. 会社計

(1) 資産構成	・ ・ ・ ・ 14
(2) 売買目的有価証券の評価損益	・ ・ ・ ・ 14
(3) 有価証券の時価情報	・ ・ ・ ・ 15
(4) 金銭の信託の時価情報	・ ・ ・ ・ 16
(5) デリバティブ取引の状況	・ ・ ・ ・ 16

1. 一般勘定

(1) 商品有価証券関係

① 商品有価証券明細表

平成25年度末、平成26年度末に該当の残高はありません。

② 商品有価証券売買高

平成25年度、平成26年度に該当はありません。

(2) 有価証券関係

① 有価証券明細表

(単位:億円、%)

区分	平成25年度末		平成26年度末	
	金額	占率	金額	占率
公社債	216,668	50.1	226,544	46.4
国債	172,444	39.9	184,852	37.9
地方債	15,221	3.5	14,394	2.9
社債	29,002	6.7	27,297	5.6
(うち公社・公団債)	(14,839)	(3.4)	(13,491)	(2.8)
株式	71,456	16.5	90,752	18.6
外国証券	138,760	32.1	161,449	33.1
公社債	102,258	23.6	120,772	24.7
株式等	36,501	8.4	40,676	8.3
その他の証券	5,822	1.3	9,593	2.0
合計	432,707	100.0	488,339	100.0

②有価証券残存期間別残高

(単位:億円)

区分		1年以下	1年超 3年以下	3年超 5年以下	5年超 7年以下	7年超 10年以下	10年超 (期間の定めのないものを含む)	合計
平成 25 年度 末	国債	2,444	9,205	6,441	6,287	17,259	130,805	172,444
	地方債	1,186	5,013	2,102	1,540	67	5,311	15,221
	社債	2,128	5,637	4,746	1,168	2,124	13,197	29,002
	株式						71,456	71,456
	外国証券	2,337	7,137	7,997	12,906	14,862	93,518	138,760
	公社債	2,257	7,137	7,843	12,558	14,218	58,242	102,258
	株式等	80	0	153	347	644	35,275	36,501
	その他の証券	186	55	399	570	1,484	3,126	5,822
	買入金銭債権	353	100	40	91	488	4,632	5,706
	譲渡性預金	2,349	—	—	—	—	—	2,349
	合計	10,986	27,150	21,728	22,563	36,288	322,046	440,763
平成 26 年度 末	国債	3,475	7,747	5,670	8,423	22,426	137,109	184,852
	地方債	712	4,664	2,775	123	74	6,044	14,394
	社債	2,181	5,265	3,563	983	2,288	13,014	27,297
	株式						90,752	90,752
	外国証券	2,437	10,029	11,870	14,125	14,264	108,722	161,449
	公社債	2,409	10,027	11,546	13,604	13,722	69,464	120,772
	株式等	28	2	323	520	542	39,257	40,676
	その他の証券	215	423	1,144	1,205	2,321	4,282	9,593
	買入金銭債権	420	—	21	186	426	3,932	4,987
	譲渡性預金	3,029	—	—	—	—	—	3,029
	合計	12,473	28,130	25,044	25,047	41,802	363,859	496,357

③地域別地方債保有内訳

(単位:億円、%)

区分	平成25年度末		平成26年度末	
	金額	占率	金額	占率
北海道	18	0.1	22	0.2
東北	93	0.6	93	0.6
関東	7,587	49.8	7,263	50.5
中部	3,233	21.2	3,108	21.6
近畿	157	1.0	186	1.3
中国	314	2.1	94	0.7
四国	—	—	—	—
九州	1,118	7.3	1,034	7.2
その他	2,698	17.7	2,592	18.0
合計	15,221	100.0	14,394	100.0

(注)上記「その他」は共同発行市場公募地方債です。

④公社債及び外国公社債格付別内訳

(単位:億円、%)

区分	平成25年度末		平成26年度末	
	金額	占率	金額	占率
AAA	15,988	10.9	15,239	9.4
AA	100,790	68.8	112,625	69.3
A	16,109	11.0	19,905	12.3
BBB	7,346	5.0	8,898	5.5
BB以下	79	0.1	—	—
格付なし	6,168	4.2	5,794	3.6
合計	146,482	100.0	162,464	100.0

(注) 1. 上記公社債残高は日本国債の残高を除いています。(平成25年度末:17兆2,444億円、平成26年度末:18兆4,852億円)
2. 上記は外部の格付業者の格付に基づき作成しています。

⑤株式業種別内訳

(単位:億円、%)

区分	平成25年度末		平成26年度末		
	金額	占率	金額	占率	
水産・農林業	27	0.0	29	0.0	
鉱業	36	0.1	62	0.1	
建設業	1,107	1.5	1,312	1.4	
製造業	食料品	2,192	3.1	3,209	3.5
	繊維製品	916	1.3	1,277	1.4
	パルプ・紙	243	0.3	236	0.3
	化学	5,641	7.9	8,268	9.1
	医薬品	6,120	8.6	8,065	8.9
	石油・石炭製品	233	0.3	234	0.3
	ゴム製品	844	1.2	1,147	1.3
	ガラス・土石製品	734	1.0	829	0.9
	鉄鋼	1,653	2.3	1,960	2.2
	非鉄金属	764	1.1	881	1.0
	金属製品	409	0.6	425	0.5
	機械	4,301	6.0	5,309	5.9
	電気機器	8,516	11.9	10,486	11.6
	輸送用機器	11,999	16.8	16,125	17.8
精密機器	1,169	1.6	1,464	1.6	
その他製品	793	1.1	986	1.1	
電気・ガス業	3,828	5.4	4,213	4.6	
運輸・情報通信業	陸運業	4,237	5.9	5,855	6.5
	海運業	101	0.1	103	0.1
	空運業	81	0.1	106	0.1
	倉庫・運輸関連業	129	0.2	151	0.2
	情報・通信業	1,104	1.5	1,162	1.3
商業	卸売業	2,553	3.6	2,906	3.2
	小売業	1,827	2.6	2,355	2.6
金融・保険業	銀行業	6,174	8.6	6,749	7.4
	証券、商品先物取引業	668	0.9	679	0.7
	保険業	1,040	1.5	1,585	1.7
	その他金融業	451	0.6	524	0.6
不動産業	489	0.7	519	0.6	
サービス業	1,060	1.5	1,525	1.7	
合計	71,456	100.0	90,752	100.0	

(3) 貸付金関係

① 貸付金明細表

(単位:億円)

区分	平成25年度末	平成26年度末
保険約款貸付	7,822	7,365
保険料振替貸付	606	553
契約者貸付	7,216	6,812
一般貸付	77,466	76,210
企業貸付	56,772	56,087
国内	54,987	54,372
海外	1,784	1,715
国・国際機関・政府関係機関・ 公共団体・公企業貸付	5,738	5,486
国内	5,084	4,889
海外	654	596
住宅ローン	9,066	8,898
消費者ローン	5,237	4,987
その他	651	749
合 計	85,289	83,576
非居住者貸付	2,439	2,312

② 貸付金企業規模別内訳

(単位:件、億円、%)

区分	平成25年度末		平成26年度末		
		占率		占率	
大企業	貸付先数	969	42.3	950	39.9
	金額	49,592	90.2	48,453	89.1
中堅企業	貸付先数	322	14.0	320	13.4
	金額	728	1.3	744	1.4
中小企業	貸付先数	1,002	43.7	1,110	46.6
	金額	4,666	8.5	5,174	9.5
国内企業計	貸付先数	2,293	100.0	2,380	100.0
	金額	54,987	100.0	54,372	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	①右の②～④を除く 全業種		②小売業、飲食業		③サービス業		④卸売業	
大企業	常用する 従業員 300名超	資本金 10億円以上	常用する 従業員 50名超	資本金 10億円以上	常用する 従業員 100名超	資本金 10億円以上	常用する 従業員 100名超	資本金 10億円以上
中堅企業		かつ 資本金 3億円超 10億円未満		かつ 資本金 5千万円超 10億円未満		かつ 資本金 5千万円超 10億円未満		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	

③貸付金業種別内訳

(単位:億円、%)

区分		平成25年度末		平成26年度末	
		金額	占率	金額	占率
国内向け	製造業	15,218	19.6	14,095	18.5
	食料	1,040	1.3	1,012	1.3
	繊維	475	0.6	358	0.5
	木材・木製品	18	0.0	19	0.0
	パルプ・紙	954	1.2	768	1.0
	印刷	203	0.3	199	0.3
	化学	3,020	3.9	2,821	3.7
	石油・石炭	810	1.0	779	1.0
	窯業・土石	486	0.6	466	0.6
	鉄鋼	2,214	2.9	1,993	2.6
	非鉄金属	272	0.4	222	0.3
	金属製品	167	0.2	172	0.2
	はん用・生産用・業務用機械	1,455	1.9	1,355	1.8
	電気機械	1,436	1.9	1,413	1.9
	輸送用機械	2,200	2.8	2,067	2.7
	その他の製造業	462	0.6	446	0.6
	農業、林業	0	0.0	—	—
	漁業	20	0.0	20	0.0
	鉱業、採石業、砂利採取業	81	0.1	65	0.1
	建設業	445	0.6	432	0.6
	電気・ガス・熱供給・水道業	11,715	15.1	11,930	15.7
	情報通信業	1,830	2.4	1,746	2.3
	運輸業、郵便業	7,196	9.3	7,144	9.4
	卸売業	9,064	11.7	9,004	11.8
	小売業	531	0.7	531	0.7
	金融業、保険業	6,184	8.0	6,206	8.1
	不動産業	3,676	4.7	3,978	5.2
	物品賃貸業	2,429	3.1	2,632	3.5
	学術研究、専門・技術サービス業	19	0.0	18	0.0
	宿泊業	52	0.1	40	0.1
	飲食業	46	0.1	37	0.0
	生活関連サービス業、娯楽業	274	0.4	257	0.3
教育、学習支援業	23	0.0	18	0.0	
医療・福祉	18	0.0	11	0.0	
その他のサービス	38	0.0	40	0.1	
地方公共団体	1,852	2.4	1,799	2.4	
個人(住宅・消費・納税資金等)	14,308	18.5	13,889	18.2	
合 計	75,027	96.9	73,898	97.0	
海外向け	政府等	654	0.8	596	0.8
	金融機関	250	0.3	200	0.3
	商工業(等)	1,534	2.0	1,515	2.0
	合 計	2,439	3.1	2,312	3.0
総 合 計	77,466	100.0	76,210	100.0	

④貸付金担保別内訳

(単位:億円、%)

区分	平成25年度末		平成26年度末	
	金額	占率	金額	占率
担保貸付	397	0.5	348	0.5
有価証券担保貸付	109	0.1	94	0.1
不動産・動産・財団担保貸付	238	0.3	179	0.2
指名債権担保貸付	49	0.1	74	0.1
保証貸付	2,149	2.8	1,997	2.6
信用貸付	60,616	78.2	59,978	78.7
その他	14,304	18.5	13,886	18.2
一般貸付計	77,466	100.0	76,210	100.0
うち劣後特約付貸付	2,950	3.8	2,400	3.1

⑤貸付金地域別内訳

(単位:億円、%)

区分	平成25年度末		平成26年度末	
	金額	占率	金額	占率
北海道	696	1.3	663	1.2
東北	1,286	2.3	1,280	2.4
関東	35,283	64.2	35,212	64.8
中部	5,136	9.3	4,919	9.0
近畿	8,370	15.2	8,199	15.1
中国	1,515	2.8	1,384	2.5
四国	1,064	1.9	958	1.8
九州	1,633	3.0	1,752	3.2
合計	54,987	100.0	54,372	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。

⑥一般貸付金残存期間別残高

(単位:億円)

区分	1年以下	1年超 3年以下	3年超 5年以下	5年超 7年以下	7年超 10年以下	10年超 (期間の定めのないものを含む)	合計	
	平成25年度末	固定金利	8,811	15,424	13,406	9,709	10,000	16,579
変動金利		375	554	601	365	506	1,131	3,534
一般貸付計		9,186	15,979	14,008	10,075	10,507	17,710	77,466
平成26年度末	固定金利	8,631	16,624	11,411	9,529	9,169	17,263	72,629
	変動金利	307	630	793	465	410	973	3,580
	一般貸付計	8,939	17,255	12,204	9,994	9,579	18,237	76,210

(4)海外投融資関係

①資産別明細

・外貨建資産

(単位:億円、%)

区分	平成25年度末		平成26年度末	
	金額	占率	金額	占率
公社債	92,320	63.9	112,127	66.6
株式	4,499	3.1	5,958	3.5
現預金・その他	19,908	13.8	21,701	12.9
小計	116,728	80.8	139,787	83.0

・円貨額が確定した外貨建資産

(単位:億円、%)

区分	平成25年度末		平成26年度末	
	金額	占率	金額	占率
公社債	—	—	—	—
現預金・その他	2,051	1.4	2,317	1.4
小計	2,051	1.4	2,317	1.4

・円貨建資産

(単位:億円、%)

区分	平成25年度末		平成26年度末	
	金額	占率	金額	占率
非居住者貸付	1,211	0.8	1,094	0.7
公社債(円建外債)・その他	24,546	17.0	25,152	14.9
小計	25,757	17.8	26,247	15.6

・合計

(単位:億円、%)

区分	平成25年度末		平成26年度末	
	金額	占率	金額	占率
海外投融資	144,537	100.0	168,352	100.0

(注)「円貨額が確定した外貨建資産」とは、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計上額としているものです。

②外貨建資産の通貨別構成

(単位:億円、%)

区分	平成25年度末		平成26年度末	
	金額	占率	金額	占率
米ドル	63,694	54.6	81,305	58.2
ユーロ	25,678	22.0	28,095	20.1
イギリスポンド	14,692	12.6	17,511	12.5
オーストラリアドル	6,886	5.9	5,432	3.9
ポーランドズロチ	3,401	2.9	3,383	2.4
香港ドル	766	0.7	1,166	0.8
その他	1,607	1.4	2,892	2.1
合計	116,728	100.0	139,787	100.0

(注) 内訳は、平成26年度末における残高上位6通貨を表示しています。

③海外投融資の地域別構成

(単位:億円、%)

区分	外国証券						非居住者貸付		
			公社債		株式等				
	金額	占率	金額	占率	金額	占率	金額	占率	
平成25年度末	北米	53,051	38.2	49,587	48.5	3,463	9.5	1,228	50.3
	ヨーロッパ	47,943	34.6	42,267	41.3	5,676	15.6	580	23.8
	オセアニア	4,284	3.1	4,252	4.2	31	0.1	55	2.3
	アジア	3,556	2.6	1,786	1.7	1,770	4.8	10	0.4
	中南米	27,968	20.2	2,409	2.4	25,559	70.0	188	7.7
	中東	—	—	—	—	—	—	—	—
	アフリカ	—	—	—	—	—	—	57	2.3
	国際機関	1,955	1.4	1,955	1.9	—	—	320	13.1
	合計	138,760	100.0	102,258	100.0	36,501	100.0	2,439	100.0
平成26年度末	北米	67,036	41.5	62,708	51.9	4,327	10.6	1,267	54.8
	ヨーロッパ	52,772	32.7	45,913	38.0	6,858	16.9	530	22.9
	オセアニア	4,102	2.5	4,073	3.4	29	0.1	51	2.2
	アジア	5,352	3.3	2,570	2.1	2,782	6.8	10	0.4
	中南米	30,301	18.8	3,624	3.0	26,677	65.6	136	5.9
	中東	—	—	—	—	—	—	—	—
	アフリカ	—	—	—	—	—	—	51	2.2
	国際機関	1,882	1.2	1,882	1.6	—	—	265	11.5
	合計	161,449	100.0	120,772	100.0	40,676	100.0	2,312	100.0

(注) 海外投融資のうち、外国証券、非居住者貸付を対象としています。

(5) デリバティブ取引の状況

[定性的情報]

(a) 取引の内容

当社が利用対象としているデリバティブ取引は次の取引です。

金利関連：金利先物取引、金利スワップ取引、スワップション取引等

通貨関連：為替予約取引、通貨オプション取引、通貨スワップ取引等

株式関連：株価指数先物取引、株価指数オプション取引、株券オプション取引等

債券関連：債券先物取引、債券先物オプション取引、選択権付債券売買取引等

(b) 取組方針

効率的な資産運用を図る観点から、主として現物資産運用のリスクをコントロールする目的でデリバティブを活用しています。

(c) 利用目的

ご契約者よりお預かりした資産の安定運用のため、主として保有資産に係る市場リスクのヘッジを目的として利用しています。

(d) リスクの内容

当社が行っているデリバティブ取引については、市場リスク（金利・為替・株式等の変動によるリスク）及び信用リスク（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。市場リスクについては、デリバティブ取引は主として現物資産運用のリスクをコントロールすることを目的としていることから、限定的であると認識しています。また、信用リスクについても、国内外の金融商品取引所を通じた取引か、信用度の高い取引先を相手としており、契約が履行されないリスクは小さいものと認識しています。

(e) リスク管理体制

デリバティブ取引の目的や種類ごとに必要となる取引限度枠等を規定するとともに、その取引については、事務部門（バックオフィス）が外部証票との照合により内容を確認する等、投融資執行部門（フロントオフィス）に対しての牽制が働く体制としています。また、現物資産も併せた市場リスクを定量的に把握・分析し、そのリスク量とともにポジション、損益状況を定期的に「運用リスク管理専門委員会」に報告する体制になっています。

(f) 定量的情報に関する補足説明

ア) 想定元本（契約金額）に関する補足説明

スワップ取引に係る想定元本やオプション取引の契約金額は、金利交換等に係る名目的なものであり、信用リスク量を示すものではありません。

デリバティブ取引の信用リスクとは、取引相手先がデフォルトした際に、市場で同じポジションを再構築するための潜在的なコストを意味しており、当社ではカレントエクスポージャー方式により算出しています。

○信用リスク相当額

(単位：億円)

	平成25年度末		平成26年度末	
	想定元本 (契約金額)	信用リスク 相当額	想定元本 (契約金額)	信用リスク 相当額
金利スワップ等	—	—	—	—
通貨スワップ	7,751	543	9,564	649
為替予約	59,948	684	62,579	1,998
金利オプション(買)	—	—	—	—
通貨オプション(買)	—	—	—	—
その他の金融派生商品	2	0	408	29
合計	67,702	1,228	72,552	2,678

(注)「外貨建債権債務等」に充当された通貨関連デリバティブを除く。

イ) 時価算定に係る補足説明

[先物取引等の市場取引]

期末日の清算値または終値

[株式オプション取引]

外部情報ベンダー等より入手したボラティリティ等を基準として、当社で算出した理論価格

[為替予約取引、通貨オプション取引]

取引相手の金融機関等より入手したT T M、割引レート等を基準として、当社で算出した理論価格

[金利スワップ取引、通貨スワップ取引]

公表されている市場金利等を基準として、将来のキャッシュフロー差額を現在価値に割り引いた理論価格

ウ) 差損益に関する補足説明

当社では、デリバティブ取引を主として現物資産のかかえる市場リスクのコントロールを行うための補完手段として活用しています。

例えば、為替予約、通貨オプション取引については、主として為替リスクをヘッジするために活用しており、外国債券・外国株式等の外貨建資産全体の損益と合計で見する必要があります。

(g) ヘッジ会計の方法

ヘッジの手法については、時価ヘッジ、繰延ヘッジ、金利スワップの特例処理、為替予約及び通貨スワップの振当処理を行っています。ヘッジの有効性の判定は、リスク管理方針に基づき、主にヘッジ対象とヘッジ手段の時価変動を比較する比率分析によっております。

[定量的情報(一般勘定)](ヘッジ会計適用・非適用分合算値)

1. 差損益の内訳(ヘッジ会計適用分・非適用分の内訳)(平成26年度末)

(単位:億円)

区分	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	—	△2,156	△1	—	—	△2,157
ヘッジ会計非適用分	—	0	0	—	—	0
合計	—	△2,156	△0	—	—	△2,157

(注) ヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ適用分の差損益、及びヘッジ会計非適用分のうちヘッジ会計の中止に伴う繰延ヘッジ損益の未償却額を除いた差損益は、損益計算書に計上しています。

2. 金利関連

平成25年度末、平成26年度末に該当の残高はありません。

3. 通貨関連

(単位:億円)

区分	種類	平成25年度末				平成26年度末			
		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		
店頭	為替予約								
	売建	59,091	—	59,940	△848	63,636	—	62,547	1,088
	米ドル	33,644	—	33,820	△176	39,267	—	39,277	△10
	ユーロ	11,672	—	11,789	△117	11,776	—	10,969	806
	買建	7	—	7	0	32	—	32	0
	米ドル	7	—	7	0	31	—	32	0
	ユーロ	0	—	0	0	0	—	0	0
	通貨オプション								
	売建								
	コール	—	—	—	—	—	—	—	—
	米ドル	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—
	プット	—	—	—	—	—	—	—	—
	米ドル	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—
	買建								
	コール	—	—	—	—	—	—	—	—
	米ドル	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—
	プット	—	—	—	—	—	—	—	—
	米ドル	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—
	通貨スワップ								
	米ドル	7,751	7,751	△1,935	△1,935	9,564	9,376	△3,245	△3,245
	ユーロ	3,606	3,606	△695	△695	4,552	4,462	△1,685	△1,685
	合計	3,656	3,656	△1,166	△1,166	3,982	3,885	△1,310	△1,310
	合計				△2,784				△2,156

(注) 1.()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、先渡取引については契約額等と時価との差額を記載し、オプション取引についてはオプション料と時価との差額を記載し、スワップ取引については時価(現在価値)を記載しています。

4. 株式関連

(単位:億円)

区分	種類	平成25年度末				平成26年度末			
		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		
店頭	株式先渡契約								
	売建	—	—	—	—	407	—	409	△1
	買建	—	—	—	—	—	—	—	—
	株式オプション								
	売建								
	コール	—	—	—	—	—	—	—	—
	プット	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	買建	—	—	—	—	—	—	—	—
	コール	2	2	0	0	2	2	1	0
	プット	(0)	(0)	—	—	(0)	(0)	—	—
		(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
合 計				0					△0

(注) 1. ()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、先渡取引については契約額等と時価との差額を記載し、オプション取引についてはオプション料と時価との差額を記載しています。

5. 債券関連

平成25年度末、平成26年度末に該当の残高はありません。

6. その他

平成25年度末、平成26年度末に該当の残高はありません。

2. 個人変額保険特別勘定

(1) 売買目的有価証券の評価損益

(単位:億円)

区分	平成25年度末		平成26年度末	
	貸借対照表計上額	当期の損益に含まれた評価損益	貸借対照表計上額	当期の損益に含まれた評価損益
売買目的有価証券	1,049	29	1,194	96

(2) デリバティブ取引の状況(個人変額保険特別勘定)

1. 差損益の内訳(ヘッジ会計適用分・非適用分の内訳)(平成26年度末)

(単位:億円)

区分	金利関連	通貨関連	株式関連	債券関連	その他	合計
ヘッジ会計適用分	—	—	—	—	—	—
ヘッジ会計非適用分	—	△0	0	—	—	△0
合計	—	△0	0	—	—	△0

(注) ヘッジ会計非適用分の差損益は、損益計算書に計上しています。

2. 金利関連

平成25年度末、平成26年度末に該当の残高はありません。

3. 通貨関連

(単位:億円)

区分	種類	平成25年度末				平成26年度末			
		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		
店頭	為替予約								
	売建	32	—	32	0	53	—	53	△0
	米ドル	9	—	9	△0	12	—	12	△0
	ユーロ	18	—	18	0	30	—	30	△0
	買建	32	—	32	0	75	—	74	△0
	米ドル	23	—	23	0	46	—	46	△0
	ユーロ	4	—	4	△0	20	—	20	0
合計					0				△0

(注) 「差損益」欄には、先渡取引については、契約額等と時価との差額を記載しています。

4. 株式関連

(単位:億円)

区分	種類	平成25年度末				平成26年度末			
		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	株価指数先物								
	売建	0	—	0	△0	22	—	22	△0
	買建	18	—	19	0	21	—	21	0
合計					0				0

(注) 「差損益」欄には、先物取引については、契約額等と時価との差額を記載しています。

5. 債券関連

平成25年度末、平成26年度末に該当の残高はありません。

6. その他

平成25年度末、平成26年度末に該当の残高はありません。

3. 会社計

(1) 資産構成(会社計)

(単位:億円)

区分	平成26年度末	
		うち一般勘定
現預金・コールローン	10,647	10,047
買現先勘定	—	—
買入金銭債権	4,987	4,987
商品有価証券	—	—
金銭の信託	—	—
公社債	229,857	226,544
株式	93,111	90,752
外国証券	164,506	161,449
貸付金	83,576	83,576
不動産	16,965	16,965
資産計	622,830	611,694
うち外貨建資産	142,959	139,787

(2) 売買目的有価証券の評価損益(会社計)

(単位:億円)

区分	平成25年度末		平成26年度末	
	貸借対照表計上額	当期の損益に含まれた評価損益	貸借対照表計上額	当期の損益に含まれた評価損益
売買目的有価証券	10,982	72	10,052	443

(注) 1. 売買目的有価証券に含まれる金銭の信託の貸借対照表計上額及び当期の損益に含まれた評価損益には、デリバティブ取引に係る差損益を含んでいます。
 2. 売買目的有価証券に含まれる金銭の信託内で有している現預金及びコールローンは含んでいません。

(3) 有価証券の時価情報(会社計)(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:億円)

区分	平成25年度末					平成26年度末				
	帳簿価額	時価	差損益			帳簿価額	時価	差損益		
			差益	差損	差益			差損		
責任準備金対応債券	201,363	219,363	18,000	18,087	△87	206,738	232,924	26,185	26,189	△4
満期保有目的の債券	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
子会社・関連会社株式	77	617	540	540	—	77	374	297	297	—
その他有価証券	180,158	226,772	46,614	47,791	△1,177	193,376	277,227	83,850	84,192	△342
公社債	20,563	21,550	987	998	△10	23,553	25,123	1,569	1,577	△8
株式	40,819	69,112	28,293	29,232	△939	39,445	89,364	49,919	50,152	△233
外国証券	111,097	127,931	16,834	17,049	△215	118,896	150,095	31,198	31,295	△96
公社債	90,312	101,438	11,126	11,315	△189	97,520	120,054	22,534	22,550	△16
株式等	20,785	26,493	5,708	5,733	△25	21,376	30,041	8,664	8,744	△79
その他の証券	5,048	5,547	499	511	△12	8,062	9,224	1,162	1,167	△4
買入金銭債権	280	280	△0	—	△0	388	388	0	0	△0
譲渡性預金	2,350	2,349	△0	0	△0	3,030	3,029	△0	0	△0
合 計	381,599	446,754	65,154	66,419	△1,265	400,192	510,526	110,333	110,680	△347
公社債	215,680	234,215	18,534	18,632	△97	224,975	252,330	27,354	27,366	△11
株式	40,819	69,112	28,293	29,232	△939	39,445	89,364	49,919	50,152	△233
外国証券	111,994	129,408	17,414	17,629	△215	119,692	151,229	31,537	31,633	△96
公社債	91,132	102,297	11,165	11,354	△189	98,238	120,813	22,574	22,591	△16
株式等	20,862	27,111	6,248	6,274	△25	21,453	30,415	8,962	9,041	△79
その他の証券	5,048	5,547	499	511	△12	8,062	9,224	1,162	1,167	△4
買入金銭債権	5,706	6,119	413	414	△0	4,987	5,347	359	360	△0
譲渡性預金	2,350	2,349	△0	0	△0	3,030	3,029	△0	0	△0

(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:億円)

区分	平成25年度末	平成26年度末
責任準備金対応債券	—	—
満期保有目的の債券	—	—
非上場外国債券	—	—
その他	—	—
子会社・関連会社株式	2,319	2,928
その他有価証券	9,942	8,997
非上場国内株式(店頭売買株式を除く)	1,965	1,010
非上場外国株式(店頭売買株式を除く)	6,224	5,874
非上場外国債券	—	—
その他	1,751	2,113
合 計	12,261	11,926

(注) 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、外貨建資産について為替を評価した差損益は次のとおりです。
(平成25年度末:428億円、平成26年度末:821億円)

(4) 金銭の信託の時価情報(会社計)

平成25年度末、平成26年度末に該当の残高はありません。

・運用目的の金銭の信託

平成25年度末、平成26年度末に該当の残高はありません。

・責任準備金対応、満期保有目的、その他の金銭の信託

平成25年度末、平成26年度末に該当の残高はありません。

(5) デリバティブ取引の状況(会社計)

1. 差損益の内訳(ヘッジ会計適用分・非適用分の内訳)(平成26年度末)

(単位:億円)

区分	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	—	△2,156	△1	—	—	△2,157
ヘッジ会計非適用分	—	5	△0	—	—	4
合計	—	△2,150	△2	—	—	△2,153

(注) ヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ適用分の差損益、及びヘッジ会計非適用分のうちヘッジ会計の中止に伴う繰延ヘッジ損益の未償却額を除いた差損益は、損益計算書に計上しています。

2. ヘッジ会計が適用されていないもの

(a) 金利関連

平成25年度末、平成26年度末に該当の残高はありません。

(b)通貨関連

(単位:億円)

区分	種類	平成25年度末				平成26年度末			
		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	為替予約								
	売建	1,915	—	1,928	△12	1,287	—	1,271	15
	米ドル	726	—	730	△4	319	—	319	0
	ユーロ	793	—	797	△4	528	—	520	8
	買建	1,383	—	1,391	7	1,015	—	1,004	△10
	米ドル	740	—	743	3	387	—	384	△2
	ユーロ	410	—	411	1	310	—	307	△3
	通貨オプション								
	売建								
	コール	—	—	—	—	—	—	—	—
		(—)	(—)			(—)	(—)		
	米ドル	—	—	—	—	—	—	—	—
		(—)	(—)			(—)	(—)		
	ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—
		(—)	(—)			(—)	(—)		
	プット	—	—	—	—	—	—	—	—
		(—)	(—)			(—)	(—)		
	米ドル	—	—	—	—	—	—	—	—
		(—)	(—)			(—)	(—)		
	ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—
		(—)	(—)			(—)	(—)		
	買建								
	コール	—	—	—	—	—	—	—	—
	(—)	(—)			(—)	(—)			
米ドル	—	—	—	—	—	—	—	—	
	(—)	(—)			(—)	(—)			
ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—	
	(—)	(—)			(—)	(—)			
プット	—	—	—	—	—	—	—	—	
	(—)	(—)			(—)	(—)			
米ドル	—	—	—	—	—	—	—	—	
	(—)	(—)			(—)	(—)			
ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—	
	(—)	(—)			(—)	(—)			
通貨スワップ									
米ドル	—	—	—	—	—	—	—	—	
ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—	
合計				△4				5	

(注) 1. ()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、先渡取引については契約額等と時価との差額を記載し、オプション取引についてはオプション料と時価との差額を記載し、スワップ取引については時価(現在価値)を記載しています。

(c) 株式関連

(単位:億円)

区分	種類	平成25年度末				平成26年度末			
		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	株価指数先物								
	売建	124	—	125	△1	226	—	228	△2
	買建	98	—	100	2	71	—	71	0
店頭	株式先渡契約								
	売建	—	—	—	—	—	—	—	—
	買建	—	—	—	—	—	—	—	—
	株式オプション								
	売建								
	コール	—	—	—	—	—	—	—	—
	プット	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	買建								
	コール	2	2	0	0	2	2	1	0
	プット	(0)	(0)	—	—	(0)	(0)	—	—
合計				1				△0	

(注) 1. ()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、先物取引及び先渡取引については契約額等と時価との差額を記載し、オプション取引についてはオプション料と時価との差額を記載しています。

(d) 債券関連

平成25年度末、平成26年度末に該当の残高はありません。

(e) その他

平成25年度末、平成26年度末に該当の残高はありません。

3. ヘッジ会計が適用されているもの

(a) 金利関連

平成25年度末、平成26年度末に該当の残高はありません。

(b) 通貨関連

(単位:億円)

区分	ヘッジ会計の方法	種類	主なヘッジ対象	平成25年度末				平成26年度末				
				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	時価ヘッジ	為替予約	外貨建債券									
		売建		59,079	—	59,928	△848	63,597	—	62,508	1,089	
		米ドル		33,635	—	33,812	△176	39,232	—	39,242	△9	
		ユーロ		11,672	—	11,789	△117	11,776	—	10,969	806	
		買建		—	—	—	—	—	—	—	—	—
		米ドル		—	—	—	—	—	—	—	—	—
		ユーロ		—	—	—	—	—	—	—	—	—
		通貨オプション										
		売建										
		コール		—	—	—	—	—	—	—	—	—
		米ドル		(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	—
		ユーロ		(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	—
		プット		—	—	—	—	—	—	—	—	—
		米ドル		(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	—
		ユーロ		(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	—
		買建		—	—	—	—	—	—	—	—	—
		コール		(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	—
		米ドル		—	—	—	—	—	—	—	—	—
		ユーロ		(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	—
		プット		—	—	—	—	—	—	—	—	—
		米ドル		(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	—
		ユーロ		(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	—
		繰延ヘッジ		通貨スワップ	外貨建債券	7,751	7,751	△1,935	△1,935	9,564	9,376	△3,245
	米ドル		3,606	3,606	△695	△695	4,552	4,462	△1,685	△1,685		
	ユーロ		3,656	3,656	△1,166	△1,166	3,982	3,885	△1,310	△1,310		
合計						△2,784				△2,156		

(注) 1. ()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、先渡取引については契約額等と時価との差額を記載し、オプション取引についてはオプション料と時価との差額を記載し、スワップ取引については時価(現在価値)を記載しています。

(c) 株式関連

(単位:億円)

区分	ヘッジ会計の方法	種類	主なヘッジ対象	平成25年度末				平成26年度末						
				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					
店頭	時価ヘッジ	株式先渡契約	株式等											
		売建		—	—	—	—	407	—	409	△1			
		買建		—	—	—	—	—	—	—	—			
合計														△1

(注) 「差損益」欄には、先渡取引については、契約額等と時価との差額を記載しています。

(d) 債券関連

平成25年度末、平成26年度末に該当の残高はありません。

(e) その他

平成25年度末、平成26年度末に該当の残高はありません。