

Ⅱ. 平成20年度第2四半期（上半期）報告 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	・・・ 2
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	・・・ 7
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
① 商品有価証券勘定	・・・ 9
② 一般勘定（商品有価証券勘定除く）	・・・ 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20年度上半期末、平成19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

(単位:億円)

区分	平成19年度上半期	平成20年度上半期
商品国債	19	—
商品地方債	—	—
商品政府保証債	—	—
その他の商品有価証券	—	—
合計	19	—

(2) 有価証券関係

① 有価証券明細表

(単位:億円、%)

区分	平成20年度上半期末		平成19年度末	
	金額	占率	金額	占率
公社債	162,632	50.3	162,317	50.2
国債	113,681	35.2	112,535	34.8
地方債	15,029	4.6	16,514	5.1
社債	33,922	10.5	33,268	10.3
(うち公社・公団債)	(18,219)	(5.6)	(17,412)	(5.4)
株式	79,132	24.5	82,657	25.6
外国証券	78,498	24.3	75,244	23.3
公社債	58,588	18.1	56,640	17.5
株式等	19,910	6.2	18,604	5.8
その他の証券	3,143	1.0	3,022	0.9
合計	323,406	100.0	323,242	100.0
うち劣後債券	155	0.0	157	0.0

②有価証券残存期間別残高(平成20年度上半期末)

(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 ないものも含む)	合 計
国債	7,366	11,352	7,887	5,897	23,453	57,723	113,681
地方債	501	1,665	3,596	2,523	5,932	809	15,029
社債	2,303	5,485	3,062	4,268	8,155	10,646	33,922
株式						79,132	79,132
外国証券	1,951	4,779	2,775	1,155	4,514	63,320	78,498
公社債	1,930	4,560	2,702	1,121	4,367	43,906	58,588
株式等	21	219	73	33	147	19,414	19,910
その他の証券	42	48	15	136	739	2,160	3,143
合 計	12,164	23,331	17,338	13,981	42,795	213,793	323,406

③地域別地方債保有内訳(平成20年度上半期末)

(単位:億円、%)

区分	金額	占率
北海道	97	0.7
東北	151	1.0
関東	6,738	44.8
中部	3,362	22.4
近畿	412	2.7
中国	537	3.6
四国	—	—
九州	864	5.7
その他	2,865	19.1
合 計	15,029	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(平成20年度上半期末)

(単位:億円、%)

区分	金額	占率
AAA	69,482	64.6
AA	27,546	25.6
A	10,184	9.5
BBB	228	0.2
BB以下	—	—
格付なし	97	0.1
合 計	107,539	100.0

(注) 1. 上記公社債残高は日本国債(残高11兆3,681億円)を除いています。
2. 上記は外部の格付機関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20年度上半期末		平成19年度末	
		金額	占率	金額	占率
水産・農林業		51	0.1	50	0.1
鉱業		43	0.1	49	0.1
建設業		912	1.2	844	1.0
製造業	食料品	2,108	2.7	2,036	2.5
	繊維製品	867	1.1	995	1.2
	パルプ・紙	335	0.4	256	0.3
	化学	5,576	7.0	5,989	7.2
	医薬品	7,529	9.5	6,935	8.4
	石油・石炭製品	238	0.3	249	0.3
	ゴム製品	492	0.6	422	0.5
	ガラス・土石製品	1,045	1.3	1,204	1.5
	鉄鋼	2,835	3.6	3,039	3.7
	非鉄金属	826	1.0	935	1.1
	金属製品	302	0.4	310	0.4
	機械	3,399	4.3	4,041	4.9
	電気機器	9,662	12.2	10,558	12.8
	輸送用機器	10,213	12.9	11,175	13.5
精密機器	1,475	1.9	1,415	1.7	
その他製品	913	1.2	1,060	1.3	
電気・ガス業		7,662	9.7	7,470	9.0
運輸・情報通信業	陸運業	4,060	5.1	3,990	4.8
	海運業	309	0.4	391	0.5
	空運業	223	0.3	255	0.3
	倉庫・運輸関連業	98	0.1	100	0.1
	情報・通信業	1,233	1.6	1,261	1.5
商業	卸売業	2,475	3.1	3,119	3.8
	小売業	1,927	2.4	1,771	2.1
金融・保険業	銀行業	8,554	10.8	8,747	10.6
	証券、商品先物取引業	807	1.0	871	1.1
	保険業	1,189	1.5	1,214	1.5
	その他金融業	588	0.7	650	0.8
不動産業		341	0.4	369	0.4
サービス業		829	1.0	874	1.1
合計		79,132	100.0	82,657	100.0

(3)貸付金関係

①貸付金明細表

(単位:億円)

区分	平成20年度上半期末	平成19年度末
保険約款貸付	11,174	11,392
保険料振替貸付	1,010	1,029
契約者貸付	10,164	10,363
一般貸付	82,422	84,141
企業貸付	63,340	64,453
国内	61,270	62,503
海外	2,070	1,950
国・国際機関・政府関係機関・ 公共団体・公企業貸付	5,072	5,617
国内	2,975	3,199
海外	2,097	2,418
住宅ローン	9,510	9,573
消費者ローン	4,157	4,133
その他	340	363
合 計	93,597	95,533
非居住者貸付	4,167	4,368

②貸付金企業規模別内訳

(単位:件、億円、%)

区分	平成20年度上半期末		平成19年度末	
		占率		占率
大企業	貸付先数	989	996	40.1
	金額	51,791	52,509	84.0
中堅企業	貸付先数	387	398	16.0
	金額	1,860	1,972	3.2
中小企業	貸付先数	1,050	1,091	43.9
	金額	7,618	8,020	12.8
国内企業計	貸付先数	2,426	2,485	100.0
	金額	61,270	62,503	100.0

(注) 1. 業種の区分は以下の通りです。

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	
	常用する 従業員 300人超	資本金 10億円以上	常用する 従業員 50人超	資本金 10億円以上	常用する 従業員 100人超	資本金 10億円以上	常用する 従業員 100人超	資本金 10億円以上
大企業	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
中堅企業		資本金3億円以下又は 常用する従業員300人以下		資本金5千万円以下又は 常用する従業員50人以下		資本金5千万円以下又は 常用する従業員100人以下		資本金1億円以下又は 常用する従業員100人以下
中小企業								

③貸付金業種別内訳

(単位:億円、%)

区分		平成20年度上半期末		平成19年度末	
		金額	占率	金額	占率
国内向け	製造業	14,308	17.4	14,574	17.3
	食料	759	0.9	797	0.9
	繊維	495	0.6	468	0.6
	木材・木製品	34	0.0	37	0.0
	パルプ・紙	931	1.1	953	1.1
	印刷	164	0.2	218	0.3
	化学	2,002	2.4	2,049	2.4
	石油・石炭	777	0.9	745	0.9
	窯業・土石	353	0.4	312	0.4
	鉄鋼	2,197	2.7	2,214	2.6
	非鉄金属	426	0.5	465	0.6
	金属製品	190	0.2	206	0.2
	一般機械	835	1.0	922	1.1
	電気機械	2,055	2.5	2,136	2.5
	輸送用機械	2,130	2.6	2,294	2.7
	精密機械	417	0.5	192	0.2
	その他の製造業	536	0.7	560	0.7
	農業	0	0.0	0	0.0
	林業	—	—	—	—
	漁業	10	0.0	10	0.0
	鉱業	193	0.2	188	0.2
	建設業	438	0.5	458	0.5
	電気・ガス・熱供給・水道業	9,910	12.0	9,803	11.7
	情報通信業	1,530	1.9	1,684	2.0
	運輸業	5,889	7.1	5,919	7.0
	卸売業	8,392	10.2	8,354	9.9
	小売業	776	0.9	839	1.0
金融・保険業	11,324	13.7	11,818	14.0	
不動産業	3,497	4.2	3,531	4.2	
各種サービス	7,132	8.7	7,591	9.0	
地方公共団体	1,159	1.4	1,263	1.5	
個人(住宅・消費・納税資金等)	13,689	16.6	13,734	16.3	
合 計	78,254	94.9	79,772	94.8	
海外向け	政府等	2,097	2.5	2,418	2.9
	金融機関	530	0.6	580	0.7
	商工業(等)	1,540	1.9	1,370	1.6
	合 計	4,167	5.1	4,368	5.2
総 合 計	82,422	100.0	84,141	100.0	

④貸付金担保別内訳

(単位:億円、%)

区分	平成20年度上半期末		平成19年度末	
	金額	占率	金額	占率
担保貸付	990	1.2	1,119	1.3
有価証券担保貸付	255	0.3	281	0.3
不動産・動産・財団担保貸付	638	0.8	728	0.9
指名債権担保貸付	96	0.1	109	0.1
保証貸付	3,421	4.2	3,586	4.3
信用貸付	64,342	78.1	65,728	78.1
その他	13,668	16.6	13,707	16.3
一般貸付計	82,422	100.0	84,141	100.0
うち劣後特約付貸付	5,040	6.1	4,970	5.9

⑤貸付金地域別内訳

(単位:億円、%)

区分	平成20年度上半期末		平成19年度末	
	金額	占率	金額	占率
北海道	345	0.6	379	0.6
東北	948	1.5	978	1.6
関東	42,632	69.6	43,393	69.4
中部	4,889	8.0	5,095	8.2
近畿	8,432	13.8	8,546	13.7
中国	1,362	2.2	1,467	2.3
四国	1,093	1.8	1,121	1.8
九州	1,566	2.6	1,522	2.4
合 計	61,270	100.0	62,503	100.0

(注) 1. 個人ローン、非居住者貸付、保険約款貸付等は含みません。
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(平成20年度上半期末)

(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 ないものを含む)	合 計
固定金利	11,257	18,354	13,916	10,070	12,842	9,435	75,875
変動金利	1,058	1,419	984	798	853	1,432	6,546
一般貸付計	12,315	19,774	14,900	10,868	13,696	10,867	82,422

(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20年度上半期末		平成19年度末	
	金額	占率	金額	占率
公社債	51,698	59.3	51,602	60.8
株式	6,275	7.2	7,110	8.4
現預金・その他	9,944	11.4	8,892	10.5
小計	67,918	77.9	67,606	79.7

・円貨額が確定した外貨建資産

区分	平成20年度上半期末		平成19年度末	
	金額	占率	金額	占率
公社債	—	—	—	—
現預金・その他	1,781	2.0	1,734	2.0
小計	1,781	2.0	1,734	2.0

・円貨建資産

区分	平成20年度上半期末		平成19年度末	
	金額	占率	金額	占率
非居住者貸付	2,798	3.2	3,135	3.7
公社債(円建外債)・その他	14,667	16.8	12,363	14.6
小計	17,465	20.0	15,498	18.3

・合計

区分	平成20年度上半期末		平成19年度末	
	金額	占率	金額	占率
海外投融資	87,164	100.0	84,839	100.0
(うち海外不動産)	(3,165)	(3.6)	(3,371)	(4.0)

(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20年度上半期末		平成19年度末	
	金額	占率	金額	占率
米ドル	47,601	70.1	43,099	63.7
ユーロ	17,185	25.3	21,586	31.9
オーストラリアドル	1,048	1.5	768	1.1
イギリスポンド	453	0.7	555	0.8
ニュージーランドドル	364	0.5	—	—
香港ドル	351	0.5	324	0.5
その他	914	1.3	1,273	1.9
合計	67,918	100.0	67,606	100.0

(注)内訳は、平成20年度上半期末における残高上位6通貨を表示しております。

③海外投融資の地域別構成

(単位:億円、%)

区分	平成20年度上半期末							
	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
北米	41,911	53.4	37,492	64.0	4,419	22.2	1,436	34.5
ヨーロッパ	20,155	25.7	17,408	29.7	2,746	13.8	1,635	39.2
オセアニア	952	1.2	859	1.5	92	0.5	—	—
アジア	440	0.6	302	0.5	138	0.7	154	3.7
中南米	14,554	18.5	2,041	3.5	12,513	62.8	217	5.2
中東	—	—	—	—	—	—	3	0.1
国際機関	483	0.6	483	0.8	—	—	720	17.3
合計	78,498	100.0	58,588	100.0	19,910	100.0	4,167	100.0

区分	平成19年度末							
	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
北米	37,430	49.7	32,532	57.4	4,897	26.3	1,302	29.8
ヨーロッパ	24,111	32.0	20,873	36.9	3,238	17.4	1,936	44.3
オセアニア	796	1.1	678	1.2	117	0.6	—	—
アジア	397	0.5	264	0.5	133	0.7	160	3.7
中南米	11,995	15.9	1,778	3.1	10,217	54.9	181	4.2
中東	—	—	—	—	—	—	3	0.1
国際機関	513	0.7	513	0.9	—	—	782	17.9
合計	75,244	100.0	56,640	100.0	18,604	100.0	4,368	100.0

(5) デリバティブ取引の状況

①商品有価証券勘定

平成20年度上半期末、平成19年度末に該当の残高はありません。

②一般勘定（商品有価証券勘定除く）

[定性的情報]

(1)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

(2)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。

(3)利用目的

ご契約者様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やコントロールを目的として利用しています。

(4)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・株価・為替など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。

(5)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額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など、投資執行部門（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。

(6) 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20年度上半期末	
	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	78	6
為替予約	40,016	1,495
金利オプション(買)	----	----
通貨オプション(買)	7,940	310
その他の金融派生商品	----	----
合計	48,036	1,811

(注) 「外貨建債権債務等」に充当された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

[為替予約取引、通貨オプション取引]

ブローカーより入手したTTM、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]

公表されている市場金利を基準として、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、円金利スワップ取引は、債券・融資・短資等の円金利資産のもつ金利変動リスクを調整するために活用しています。また、金利変動リスクの調整に際しては、単に金利予測に基づくものだけでなく、ALMの観点から保険という負債特性を意識したコントロールを行っています。

このため、金利スワップ単体で損益を見るのではなく、対象である円金利資産全体の損益とトータルで見る必要があります。

また、同様に為替予約、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る必要があります。

(7) ヘッジ会計の方法

ヘッジの手法については、時価ヘッジ、為替の振当処理、金利スワップの特例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り評価しています。

[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20年度上半期末)

(単位:億円)

		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	ヘッジ会計適用分	—	882	—	—	—	882
	ヘッジ会計非適用分	—	80	—	—	▲ 151	▲ 70
合計		—	963	—	—	▲ 151	812

(注) ヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ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

(単位:億円)

区分	種類	平成20年度上半期末				平成19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	金利スワップ								
	固定金利受取/変動金利支払	—	—	—	—	551	51	1	1
	固定金利支払/変動金利受取	—	—	—	—	500	—	0	0
合計									2

(注) 「差損益」欄には、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。

3. 通貨関連

(単位:億円)

区分	種類	平成20年度上半期末				平成19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	37,292	2,488	36,289	1,002	26,584	2,773	26,446	137
	米ドル	34,502	2,488	33,618	883	26,061	2,773	25,932	129
	ユーロ	1,490	—	1,458	32	414	—	408	6
	買建	3,823	—	3,727	▲ 96	2,031	—	2,042	11
	米ドル	2,305	—	2,248	▲ 57	2,004	—	2,016	11
	ユーロ	1,074	—	1,055	▲ 19	20	—	20	0
	通貨オプション								
	売建								
	コール	—	—	—	—	1,102	—	1	▲ 0
	米ドル	(—)	(—)	—	—	(1)	(—)	—	▲ 0
	ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—
	プット	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	米ドル	521	—	7	▲ 0	—	—	—	—
	ユーロ	(7)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	買建	—	—	—	—	—	—	—	—
	コール	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	米ドル	—	—	—	—	—	—	—	—
	ユーロ	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	プット	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	米ドル	7,940	3,910	341	59	8,241	1,550	380	212
	ユーロ	(282)	(185)	—	—	(167)	(53)	—	—
	米ドル	6,524	3,314	292	46	5,510	601	335	222
	ユーロ	(246)	(165)	—	—	(112)	(24)	—	—
	通貨スワップ	1,415	596	49	13	2,531	949	38	▲ 13
	米ドル	(35)	(20)	—	—	(52)	(28)	—	—
	ユーロ	78	78	▲ 0	▲ 0	5	5	▲ 0	▲ 0
米ドル	78	78	▲ 0	▲ 0	5	5	▲ 0	▲ 0	
ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—	
合計				963				361	

(注) 1. ()内にはオプション料を記載しています。
 2. ヘッジ会計を適用したものを含みます。
 3. 「差損益」欄には、先渡取引については、契約額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

平成20年度上半期末、平成19年度末に該当の残高はありません。

5. 債券関連

平成20年度上半期末、平成19年度末に該当の残高はありません。

6. その他

(単位:億円)

区分	種類	平成20年度上半期末				平成19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	クレジット・デフォルト・スワップ プロテクション売建	240	240	▲ 151	▲ 151	—	—	—	—
合計				▲ 151	▲ 151				—

(注) 1. 上表は、複合金融商品に組み込まれたデリバティブについて、従来現物の金融資産と一体処理していたものうち区分処理に移行したものを記載しています。
 2. 「契約額等」欄には、当該デリバティブが組み込まれている複合金融商品の額面金額を記載しています。

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20年度上半期末		平成19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	1,171	▲ 54	1,299	▲ 323

(2) デリバティブ取引の状況(個人変額保険特別勘定)

1. 金利関連

平成20年度上半期末、平成19年度末に該当の残高はありません。

2. 通貨関連

(単位:億円)

区分	種類	平成20年度上半期末			平成19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	—	—	—	—	—	—	—	
	米ドル	—	—	—	—	—	—	—	
	ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	
	買建	0	—	0	▲ 0	33	—	33	0
	米ドル	—	—	—	—	—	—	—	—
	ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—
合 計				▲ 0				▲ 0	

(注) 1. 「差損益」欄には、先渡取引については、契約額と時価との差額を記載しています。
2. 「差損益」は、特別勘定資産運用損益として損益計算書に計上しています。

3. 株式関連

(単位:億円)

区分	種類	平成20年度上半期末			平成19年度末			
		契約額等		時価	差損益	契約額等		時価
			うち1年超			うち1年超		
取引所	株価指数先物							
	売建	—	—	—	—	—	—	—
	買建	58	—	53	▲ 4	66	—	65
合 計				▲ 4				▲ 0

(注) 1. 「差損益」欄には、先物取引については、契約額と時価との差額を記載しています。
2. 「差損益」は、特別勘定資産運用損益として損益計算書に計上しています。

4. 債券関連

平成20年度上半期末、平成19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20年度上半期末	
		うち一般勘定
現預金・コールローン	6,984	6,143
買現先勘定	—	—
買入金銭債権	13,194	13,194
商品有価証券	—	—
金銭の信託	1,529	1,529
公社債	167,813	162,632
株式	83,139	79,132
外国証券	82,660	78,498
貸付金	93,597	93,597
不動産	16,479	16,479
資産計	479,801	463,417
うち外貨建資産	72,089	67,918

(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20年度上半期末		平成19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	16,549	▲ 614	18,490	▲ 4,034

(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みません。

(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20年度上半期末					平成19年度末				
	帳簿価額	時価	差損益	うち差益		帳簿価額	時価	差損益	うち差益	
				うち差益	うち差損				うち差益	うち差損
責任準備金対応債券	163,801	167,844	4,043	4,340	▲ 296	171,474	177,527	6,053	6,255	▲ 202
満期保有目的の債券	380	379	▲ 0	0	▲ 0	400	401	1	1	▲ 0
子会社・関連会社株式	544	789	244	244	—	544	705	160	160	—
その他有価証券	133,975	163,339	29,363	32,947	▲ 3,583	121,689	157,452	35,763	38,663	▲ 2,899
公社債	10,804	10,905	101	111	▲ 10	3,350	3,385	34	35	▲ 0
株式	47,983	76,465	28,482	29,975	▲ 1,493	47,962	80,008	32,046	33,634	▲ 1,587
外国証券	66,924	67,913	988	2,851	▲ 1,863	61,373	65,167	3,794	4,976	▲ 1,181
公社債	55,702	57,128	1,425	1,780	▲ 355	51,436	54,467	3,030	3,282	▲ 251
株式等	11,222	10,784	▲ 437	1,071	▲ 1,508	9,936	10,700	763	1,693	▲ 930
その他の証券	3,063	2,854	▲ 208	6	▲ 215	2,881	2,768	▲ 112	16	▲ 129
買入金銭債権	2,199	2,200	0	1	▲ 0	3,041	3,041	0	0	▲ 0
譲渡性預金	3,000	2,999	▲ 0	0	▲ 0	3,080	3,080	0	0	▲ 0
合 計	298,701	332,353	33,651	37,532	▲ 3,880	294,108	336,087	41,979	45,081	▲ 3,102
公社債	162,531	166,555	4,023	4,197	▲ 173	162,283	168,023	5,740	5,886	▲ 146
株式	48,527	77,254	28,726	30,220	▲ 1,493	48,506	80,714	32,207	33,794	▲ 1,587
外国証券	68,384	69,274	889	2,854	▲ 1,964	63,563	67,320	3,756	4,987	▲ 1,231
公社債	57,162	58,489	1,327	1,783	▲ 456	53,627	56,619	2,992	3,293	▲ 301
株式等	11,222	10,784	▲ 437	1,071	▲ 1,508	9,936	10,700	763	1,693	▲ 930
その他の証券	3,063	2,854	▲ 208	6	▲ 215	2,881	2,768	▲ 112	16	▲ 129
買入金銭債権	13,193	13,413	220	252	▲ 32	13,792	14,180	387	395	▲ 7
譲渡性預金	3,000	2,999	▲ 0	0	▲ 0	3,080	3,080	0	0	▲ 0

(注) 本表には、CD(譲渡性預金)等、金融商品取引法上の有価証券として取り扱ふことが適当と認められるものを含んでいます。

○時価のない有価証券の帳簿価額は次の通りです。

(単位:億円)

区分	平成20年度上半期末	平成19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	2,602	2,941
その他有価証券	8,997	7,388
非上場国内株式(店頭売買株式を除く)	1,737	1,718
非上場外国株式(店頭売買株式を除く)	5,557	4,106
非上場外国債券	—	—
その他	1,703	1,564
合 計	11,599	10,329

(注) 時価のない有価証券のうち、外貨建資産について為替を評価した差損益は以下の通りです。

(平成20年度上半期末:▲379億円、平成19年度末:▲532億円)

(4) 金銭の信託の時価情報(会社計)

(単位:億円)

区分	平成20年度上半期末			
	貸借対照表 計上額	時価	差損益	うち差益
				うち差損
金銭の信託	1,529	1,529	—	—

区分	平成19年度末			
	貸借対照表 計上額	時価	差損益	うち差益
				うち差損
金銭の信託	1,705	1,705	—	—

(注) 1. 時価の算定は、金銭の信託の受託者が合理的に算出した価格によっています。

2. 貸借対照表計上額には、金銭の信託内で有しているデリバティブ取引に係る差損益を含んでいます。

・運用目的の金銭の信託

(単位:億円)

区分	平成20年度上半期末		平成19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
運用目的の金銭の信託	1,529	▲ 142	1,705	▲ 447

(注) 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。

・満期保有目的、責任準備金対応、その他の金銭の信託

平成20年度上半期末、平成19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20年度上半期末)

(単位:億円)

	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	—	882	—	—	—	882
ヘッジ会計非適用分	—	81	▲ 32	—	▲ 151	▲ 102
合計	—	963	▲ 32	—	▲ 151	779

(注) ヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ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

(単位:億円)

区分	種類	平成20年度上半期末			平成19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	金利スワップ								
	固定金利受取/変動金利支払	—	—	—	—	—	—	—	
	固定金利支払/変動金利受取	—	—	—	—	—	—	—	
合計									

(注) 「差損益」欄には、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。

3. 通貨関連

(単位:億円)

区分	種類	平成20年度上半期末				平成19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	37,325	2,488	36,321	1,003	26,986	2,773	26,851	135
	米ドル	34,509	2,488	33,625	884	26,157	2,773	26,027	129
	ユーロ	1,513	—	1,480	33	558	—	554	4
	買建	3,876	—	3,778	▲ 97	2,431	—	2,445	14
	米ドル	2,328	—	2,271	▲ 56	2,149	—	2,160	11
	ユーロ	1,094	—	1,073	▲ 20	267	—	270	2
	通貨オプション								
	売建								
	コール	—	—	—	—	1,102	—	1	▲ 0
	米ドル	(—)	(—)	—	—	(1)	(—)	1	▲ 0
	ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—
	プット	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	米ドル	521	—	7	▲ 0	—	—	—	—
	ユーロ	(7)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	買建	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	コール	—	—	—	—	—	—	—	—
	米ドル	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	ユーロ	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	プット	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	米ドル	7,940	3,910	341	59	8,241	1,550	380	212
	ユーロ	(282)	(185)	—	—	(167)	(53)	—	—
	米ドル	6,524	3,314	292	46	5,510	601	335	222
ユーロ	(246)	(165)	—	—	(112)	(24)	—	—	
通貨スワップ	1,415	596	49	13	2,531	949	38	▲ 13	
米ドル	(35)	(20)	—	—	(52)	(28)	—	—	
ユーロ	78	78	▲ 0	▲ 0	5	5	▲ 0	▲ 0	
米ドル	78	78	▲ 0	▲ 0	5	5	▲ 0	▲ 0	
ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—	
合計				963				362	

(注) 1. ()内にはオプション料を記載しています。
 2. ヘッジ会計を適用したものを含まず。
 3. 「差損益」欄には、先渡取引については、契約額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20年度上半期末				平成19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	—	—	—	—	—	—	—	—
	買建	437	—	404	▲ 32	247	—	246	▲ 1
合計					▲ 32				▲ 1

(注) 「差損益」欄には、契約額と時価との差額を記載しています。

5. 債券関連

平成20年度上半期末、平成19年度末に該当の残高はありません。

6. その他

(単位:億円)

区分	種類	平成20年度上半期末				平成19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	クレジット・デフォルト・スワップ								
	プロテクション売建	240	240	▲ 151	▲ 151	—	—	—	—
合計					▲ 151				—

(注) 1. 上表は、複合金融商品に組み込まれたデリバティブについて、従来現物の金融資産と一体処理していたもののうち区分処理に移行したものを記載しています。
 2. 「契約額等」欄には、当該デリバティブが組み込まれている複合金融商品の額面金額を記載しています。