

Ⅱ．平成23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	・・・ 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
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22年度末、平成23年度上半期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22年度上半期、平成23年度上半期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22年度末		平成23年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
公社債	178,393	51.7	185,012	53.8
国債	130,414	37.8	136,565	39.7
地方債	16,416	4.8	16,177	4.7
社債	31,563	9.2	32,269	9.4
(うち公社・公団債)	(15,664)	(4.5)	(16,438)	(4.8)
株式	62,108	18.0	53,426	15.5
外国証券	101,094	29.3	102,414	29.8
公社債	77,375	22.4	79,214	23.0
株式等	23,718	6.9	23,200	6.7
その他の証券	3,324	1.0	2,859	0.8
合計	344,920	100.0	343,712	100.0
うち劣後債券	159	0.0	159	0.0

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22年度末						
国債	5,887	3,248	7,107	14,663	9,745	89,760	130,414
地方債	1,347	1,934	2,377	4,945	3,345	2,465	16,416
社債	1,031	4,024	4,591	5,494	3,877	12,543	31,563
株式						62,108	62,108
外国証券	133	3,019	5,135	5,420	12,709	74,675	101,094
公社債	55	2,948	5,121	5,420	12,142	51,688	77,375
株式等	78	71	14	—	567	22,986	23,718
その他の証券	98	4	113	288	458	2,360	3,324
買入金銭債権	461	125	115	—	407	9,101	10,211
譲渡性預金	4,229	—	—	—	—	—	4,229
合計	13,190	12,357	19,441	30,813	30,543	253,015	359,362
平成23年度上半期末							
国債	4,693	3,816	12,281	7,139	7,587	101,047	136,565
地方債	1,321	1,960	4,475	2,364	3,173	2,881	16,177
社債	1,295	4,732	5,017	5,312	2,417	13,493	32,269
株式						53,426	53,426
外国証券	335	3,479	6,520	6,658	13,360	72,059	102,414
公社債	267	3,433	6,505	6,566	12,775	49,665	79,214
株式等	68	45	14	92	585	22,393	23,200
その他の証券	83	3	112	470	361	1,827	2,859
買入金銭債権	783	58	107	131	361	7,920	9,362
譲渡性預金	2,171	—	—	—	—	—	2,171
合計	10,684	14,050	28,516	22,076	27,262	252,656	355,246

③地域別地方債保有内訳

(単位：億円、%)

区分	平成22年度末		平成23年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
北海道	81	0.5	40	0.3
東北	169	1.0	150	0.9
関東	8,228	50.1	7,946	49.1
中部	3,443	21.0	3,551	22.0
近畿	182	1.1	171	1.1
中国	480	2.9	483	3.0
四国	—	—	—	—
九州	1,039	6.3	1,056	6.5
その他	2,790	17.0	2,776	17.2
合計	16,416	100.0	16,177	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22年度末		平成23年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
AAA	76,492	61.0	36,311	28.4
AA	27,973	22.3	67,621	53.0
A	12,808	10.2	15,687	12.3
BBB	753	0.6	859	0.7
BB以下	35	0.0	134	0.1
格付なし	7,291	5.8	7,048	5.5
合計	125,354	100.0	127,661	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22年度末：13兆414億円、平成23年度上半期末：13兆6,565億円)

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22年度末		平成23年度上半期末		
	金額	占率	金額	占率	
水産・農林業	27	0.0	28	0.1	
鉱業	27	0.0	23	0.0	
建設業	738	1.2	695	1.3	
製造業	食料品	1,688	2.7	1,640	3.1
	繊維製品	839	1.4	772	1.4
	パルプ・紙	227	0.4	230	0.4
	化学	4,989	8.0	4,448	8.3
	医薬品	5,020	8.1	4,842	9.1
	石油・石炭製品	277	0.4	224	0.4
	ゴム製品	478	0.8	467	0.9
	ガラス・土石製品	937	1.5	760	1.4
	鉄鋼	1,883	3.0	1,470	2.8
	非鉄金属	726	1.2	617	1.2
	金属製品	292	0.5	288	0.5
	機械	3,645	5.9	2,868	5.4
	電気機器	7,481	12.0	5,831	10.9
	輸送用機器	8,732	14.1	6,935	13.0
精密機器	1,222	2.0	1,109	2.1	
その他製品	746	1.2	633	1.2	
電気・ガス業	4,959	8.0	3,940	7.4	
運輸・情報通信業	陸運業	3,030	4.9	3,074	5.8
	海運業	157	0.3	115	0.2
	空運業	109	0.2	102	0.2
	倉庫・運輸関連業	87	0.1	82	0.2
	情報・通信業	827	1.3	824	1.5
商業	卸売業	2,288	3.7	2,035	3.8
	小売業	1,386	2.2	1,343	2.5
金融・保険業	銀行業	6,404	10.3	5,544	10.4
	証券、商品先物取引業	515	0.8	382	0.7
	保険業	911	1.5	797	1.5
	その他金融業	402	0.6	286	0.5
不動産業	307	0.5	285	0.5	
サービス業	739	1.2	720	1.3	
合計	62,108	100.0	53,426	100.0	

(3) 貸付金関係

①貸付金明細表

(単位：億円)

区分	平成22年度末	平成23年度上半期末
保険約款貸付	9,657	9,354
保険料振替貸付	782	753
契約者貸付	8,875	8,601
一般貸付	77,775	78,903
企業貸付	59,044	59,642
国内	57,046	57,803
海外	1,997	1,838
国・国際機関・政府関係機関・ 公共団体・公企業貸付	4,445	4,909
国内	3,319	3,939
海外	1,125	969
住宅ローン	9,798	9,689
消費者ローン	4,256	4,440
その他	231	221
合 計	87,433	88,258
非居住者貸付	3,122	2,808

②貸付金企業規模別内訳

(単位：件、億円、%)

区分	平成22年度末		平成23年度上半期末		
		占率		占率	
大 企 業	貸付先数	951	43.0	977	44.7
	金 額	50,845	89.1	52,004	90.0
中 堅 企 業	貸付先数	352	15.9	311	14.2
	金 額	1,145	2.0	857	1.5
中 小 企 業	貸付先数	908	41.1	898	41.1
	金 額	5,055	8.9	4,941	8.5
国内企業計	貸付先数	2,211	100.0	2,186	100.0
	金 額	57,046	100.0	57,803	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
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	

③貸付金業種別内訳

(単位:億円、%)

区分		平成22年度末		平成23年度上半期末	
		金額	占率	金額	占率
国内向け	製造業	16,043	20.6	15,967	20.2
	食料	1,106	1.4	1,073	1.4
	繊維	543	0.7	533	0.7
	木材・木製品	21	0.0	21	0.0
	パルプ・紙	835	1.1	829	1.1
	印刷	245	0.3	240	0.3
	化学	2,803	3.6	2,845	3.6
	石油・石炭	858	1.1	801	1.0
	窯業・土石	282	0.4	280	0.4
	鉄鋼	2,345	3.0	2,525	3.2
	非鉄金属	389	0.5	372	0.5
	金属製品	146	0.2	139	0.2
	はん用・生産用・業務用機械	1,226	1.6	1,177	1.5
	電気機械	2,234	2.9	1,974	2.5
	輸送用機械	2,484	3.2	2,645	3.4
	その他の製造業	520	0.7	506	0.6
	農業、林業	0	0.0	0	0.0
	漁業	10	0.0	10	0.0
	鉱業、採石業、砂利採取業	100	0.1	92	0.1
	建設業	424	0.5	407	0.5
	電気・ガス・熱供給・水道業	8,663	11.1	10,066	12.8
	情報通信業	1,532	2.0	2,010	2.5
	運輸業、郵便業	7,130	9.2	6,952	8.8
	卸売業	8,870	11.4	8,749	11.1
	小売業	605	0.8	532	0.7
	金融業、保険業	8,206	10.6	8,240	10.4
	不動産業	3,468	4.5	3,492	4.4
	物品賃貸業	3,232	4.2	3,018	3.8
	学術研究、専門・技術サービス業	114	0.1	111	0.1
	宿泊業	75	0.1	57	0.1
	飲食業	56	0.1	62	0.1
生活関連サービス業、娯楽業	111	0.1	115	0.1	
教育、学習支援業	36	0.0	34	0.0	
医療・福祉	31	0.0	27	0.0	
その他のサービス	54	0.1	43	0.1	
地方公共団体	1,818	2.3	1,962	2.5	
個人(住宅・消費・納税資金等)	14,067	18.1	14,141	17.9	
合 計	74,653	96.0	76,095	96.4	
海外向け	政府等	1,125	1.4	969	1.2
	金融機関	530	0.7	330	0.4
	商工業(等)	1,467	1.9	1,508	1.9
	合 計	3,122	4.0	2,808	3.6
総 合 計		77,775	100.0	78,903	100.0

④貸付金担保別内訳

(単位：億円、%)

区分	平成22年度末		平成23年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
担保貸付	642	0.8	555	0.7
有価証券担保貸付	144	0.2	126	0.2
不動産・動産・財団担保貸付	423	0.5	363	0.5
指名債権担保貸付	75	0.1	64	0.1
保証貸付	2,738	3.5	2,637	3.3
信用貸付	60,338	77.6	61,580	78.0
その他	14,055	18.1	14,130	17.9
一般貸付計	77,775	100.0	78,903	100.0
うち劣後特約付貸付	3,850	5.0	3,965	5.0

⑤貸付金地域別内訳

(単位：億円、%)

区分	平成22年度末		平成23年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
北海道	336	0.6	380	0.7
東北	944	1.7	1,311	2.3
関東	38,755	67.9	38,340	66.3
中部	4,435	7.8	4,710	8.1
近畿	8,729	15.3	8,576	14.8
中国	1,280	2.2	1,544	2.7
四国	1,143	2.0	1,133	2.0
九州	1,421	2.5	1,806	3.1
合計	57,046	100.0	57,803	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

(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
	平成22年度末						
固定金利	10,269	17,290	13,003	10,952	10,529	10,681	72,727
変動金利	799	931	664	505	643	1,503	5,048
一般貸付計	11,069	18,222	13,668	11,457	11,172	12,185	77,775
平成23年度上半期末							
固定金利	10,098	17,701	12,259	11,046	10,804	12,124	74,035
変動金利	681	890	638	485	613	1,560	4,868
一般貸付計	10,779	18,592	12,897	11,531	11,417	13,685	78,903

(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22年度末		平成23年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
公社債	67,103	63.0	68,237	63.5
株式	2,402	2.3	2,216	2.1
現預金・その他	15,042	14.1	14,132	13.1
小計	84,549	79.4	84,586	78.7

・円貨額が確定した外貨建資産

区分	平成22年度末		平成23年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
公社債	—	—	—	—
現預金・その他	1,570	1.5	1,559	1.5
小計	1,570	1.5	1,559	1.5

・円貨建資産

区分	平成22年度末		平成23年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
非居住者貸付	1,952	1.8	1,650	1.5
公社債(円建外債)・その他	18,431	17.3	19,673	18.3
小計	20,384	19.1	21,324	19.8

・合計

区分	平成22年度末		平成23年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
海外投融資	106,503	100.0	107,471	100.0
(うち海外不動産)	(2,221)	(2.1)	(2,260)	(2.1)

(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22年度末		平成23年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
米ドル	49,794	58.9	52,605	62.2
ユーロ	14,193	16.8	12,474	14.7
イギリスポンド	11,063	13.1	10,905	12.9
オーストラリアドル	7,841	9.3	5,999	7.1
ポーランドズロチ	1,281	1.5	1,744	2.1
インドルピー	—	—	483	0.6
その他	374	0.4	373	0.4
合計	84,549	100.0	84,586	100.0

(注) 内訳は、平成23年度上半期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		
	金額		占率		金額		占率		
平成22年度末	北米	42,636	42.2	40,366	52.2	2,269	9.6	1,270	40.7
	ヨーロッパ	31,243	30.9	28,454	36.8	2,788	11.8	994	31.8
	オセアニア	5,337	5.3	5,337	6.9	—	—	—	—
	アジア	948	0.9	722	0.9	226	1.0	6	0.2
	中南米	20,422	20.2	1,989	2.6	18,433	77.7	182	5.8
	中東	—	—	—	—	—	—	0	0.0
	アフリカ	—	—	—	—	—	—	75	2.4
	国際機関	506	0.5	506	0.7	—	—	592	19.0
	合計	101,094	100.0	77,375	100.0	23,718	100.0	3,122	100.0
平成23年度上半期末	北米	46,301	45.2	43,903	55.4	2,398	10.3	1,257	44.8
	ヨーロッパ	31,207	30.5	28,713	36.2	2,494	10.8	794	28.3
	オセアニア	3,274	3.2	3,274	4.1	—	—	63	2.3
	アジア	1,174	1.1	922	1.2	251	1.1	5	0.2
	中南米	20,090	19.6	2,034	2.6	18,056	77.8	173	6.2
	中東	—	—	—	—	—	—	0	0.0
	アフリカ	—	—	—	—	—	—	72	2.6
	国際機関	366	0.4	366	0.5	—	—	442	15.7
	合計	102,414	100.0	79,214	100.0	23,200	100.0	2,808	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22年度末、平成23年度上半期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。

(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・為替・株式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22年度末		平成23年度上半期末	
	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	1,559	225	2,430	346
為替予約	66,095	844	51,235	1,813
金利オプション(買)	----	----	----	----
通貨オプション(買)	1,247	12	1,440	38
その他の金融派生商品	1	0	1	0
合計	68,903	1,082	55,107	2,199

(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

[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、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。

(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、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23年度上半期末）

（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	—	1,352	—	—	—	1,352
ヘッジ会計非適用分	—	107	▲ 0	—	—	107
合計	—	1,460	▲ 0	—	—	1,459

（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

平成22年度末、平成23年度上半期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22年度末				平成23年度上半期末			
		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	為替予約								
	売建	56,363	—	57,454	▲ 1,091	50,728	—	49,439	1,289
	米ドル	34,712	—	35,012	▲ 299	32,830	—	32,645	185
	ユーロ	7,058	—	7,410	▲ 351	5,417	—	5,124	293
	買建	8,457	—	8,640	182	1,801	—	1,796	▲ 5
	米ドル	5,292	—	5,378	86	749	—	750	1
	ユーロ	2,045	—	2,102	56	215	—	217	1
	通貨オプション								
	売建								
	コール	1,247	—	1	0	—	—	—	—
	(1)	(1)	(1)	(1)	(1)	(1)	(1)	(1)	(1)
	米ドル	1,247	—	1	0	—	—	—	—
	(1)	(1)	(1)	(1)	(1)	(1)	(1)	(1)	(1)
	ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—
	(1)	(1)	(1)	(1)	(1)	(1)	(1)	(1)	(1)
	プット	—	—	—	—	618	—	34	▲ 9
	(1)	(1)	(1)	(1)	(1)	(25)	(1)	(1)	(1)
	米ドル	—	—	—	—	306	—	10	▲ 0
	(1)	(1)	(1)	(1)	(1)	(9)	(1)	(1)	(1)
	ユーロ	—	—	—	—	312	—	24	▲ 9
	(1)	(1)	(1)	(1)	(1)	(15)	(1)	(1)	(1)
	買建								
	コール	—	—	—	—	—	—	—	—
(1)	(1)	(1)	(1)	(1)	(1)	(1)	(1)	(1)	
米ドル	—	—	—	—	—	—	—	—	
(1)	(1)	(1)	(1)	(1)	(1)	(1)	(1)	(1)	
ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—	
(1)	(1)	(1)	(1)	(1)	(1)	(1)	(1)	(1)	
プット	1,247	—	0	▲ 1	1,440	—	64	22	
(1)	(1)	(1)	(1)	(1)	(42)	(1)	(1)	(1)	
米ドル	1,247	—	0	▲ 1	919	—	24	2	
(1)	(1)	(1)	(1)	(1)	(21)	(1)	(1)	(1)	
ユーロ	—	—	—	—	520	—	40	19	
(1)	(1)	(1)	(1)	(1)	(20)	(1)	(1)	(1)	
通貨スワップ	1,559	1,559	106	106	2,430	2,430	163	163	
米ドル	644	644	34	34	1,318	1,318	46	46	
ユーロ	888	888	72	72	1,085	1,085	115	115	
合計				▲ 802				1,460	

（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んでいます。

3.「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22年度末				平成23年度上半期末			
		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		
店頭	株式オプション								
	売建								
	コール	—	—	—	—	—	—	—	—
	プット	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	買建								
	コール	1	1	0	▲ 0	1	1	0	▲ 0
プット	(0)	(0)	—	—	(0)	(0)	—	—	
		(—)	(—)			(—)	(—)		
合 計					▲ 0				▲ 0

(注) 1. () 内には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22年度末、平成23年度上半期末に該当の残高はありません。

6. その他

平成22年度末、平成23年度上半期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22年度末		平成23年度上半期末	
	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	974	▲ 15	842	▲ 86

(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23年度上半期末）

(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

平成22年度末、平成23年度上半期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22年度末				平成23年度上半期末			
		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		
店頭	為替予約								
	売建	2	—	2	▲ 0	6	—	6	0
	米ドル	0	—	0	▲ 0	0	—	0	▲ 0
	ユーロ	1	—	1	▲ 0	2	—	2	0
	買建	2	—	2	0	5	—	5	▲ 0
	米ドル	0	—	0	0	4	—	4	0
ユーロ	0	—	0	0	0	—	0	0	
合計					▲ 0				0

(注) 1. 「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。

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. 株式関連

(単位：億円)

区分	種類	平成22年度末				平成23年度上半期末			
		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	株価指数先物								
	売建	—	—	—	—	—	—	—	—
	買建	19	—	18	▲ 1	20	—	20	0
合計				▲ 1					0

(注) 1. 「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。

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。

5. 債券関連

平成22年度末、平成23年度上半期末に該当の残高はありません。

6. その他

平成22年度末、平成23年度上半期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23年度上半期末	
		うち一般勘定
現預金・コールローン	5,347	5,046
買現先勘定	—	—
買入金銭債権	9,362	9,362
商品有価証券	—	—
金銭の信託	—	—
公社債	188,612	185,012
株式	55,720	53,426
外国証券	105,547	102,414
貸付金	88,258	88,258
不動産	17,349	17,349
資産計	494,845	483,694
うち外貨建資産	87,884	84,586

(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22年度末		平成23年度上半期末	
	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	11,826	▲ 198	10,211	▲ 776

(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22年度末					平成23年度上半期末				
	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	174,154	181,064	6,909	7,197	▲ 287	178,000	189,689	11,689	11,940	▲ 251
満期保有目的の債券	165	166	1	1	▲ 0	165	164	▲ 0	1	▲ 1
子会社・関連会社株式	77	340	263	263	—	77	218	141	141	—
その他有価証券	159,472	171,443	11,971	18,276	▲ 6,305	158,251	164,677	6,425	15,123	▲ 8,698
公社債	14,471	14,815	344	380	▲ 35	15,790	16,268	477	543	▲ 66
株式	47,184	59,059	11,875	15,398	▲ 3,522	47,227	51,012	3,785	9,591	▲ 5,806
外国証券	89,998	89,913	▲ 85	2,423	▲ 2,508	89,438	91,864	2,425	4,956	▲ 2,530
公社債	76,899	75,998	▲ 901	1,388	▲ 2,289	75,428	78,309	2,881	4,035	▲ 1,154
株式等	13,099	13,914	815	1,034	▲ 218	14,010	13,554	▲ 455	920	▲ 1,376
その他の証券	3,247	3,078	▲ 168	69	▲ 238	2,857	2,594	▲ 262	31	▲ 294
買入金銭債権	341	345	4	4	▲ 0	765	765	▲ 0	0	▲ 0
譲渡性預金	4,230	4,229	▲ 0	0	▲ 0	2,172	2,171	▲ 0	0	▲ 0
合 計	333,869	353,015	19,145	25,739	▲ 6,593	336,494	354,750	18,256	27,207	▲ 8,951
公社債	178,048	184,931	6,883	7,194	▲ 311	184,535	196,228	11,693	12,002	▲ 308
株式	47,184	59,059	11,875	15,398	▲ 3,522	47,227	51,012	3,785	9,591	▲ 5,806
外国証券	90,952	91,157	204	2,713	▲ 2,508	90,340	92,932	2,591	5,128	▲ 2,536
公社債	77,776	76,902	▲ 874	1,415	▲ 2,290	76,252	79,158	2,905	4,066	▲ 1,160
株式等	13,176	14,255	1,079	1,297	▲ 218	14,087	13,773	▲ 313	1,062	▲ 1,376
その他の証券	3,247	3,078	▲ 168	69	▲ 238	2,857	2,594	▲ 262	31	▲ 294
買入金銭債権	10,206	10,557	350	363	▲ 12	9,362	9,810	448	453	▲ 4
譲渡性預金	4,230	4,229	▲ 0	0	▲ 0	2,172	2,171	▲ 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22年度末	平成23年度上半期末
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	1,840	1,907
その他有価証券	11,801	10,473
非上場国内株式 (店頭売買株式を除く)	2,670	2,036
非上場外国株式 (店頭売買株式を除く)	6,975	6,977
非上場外国債券	539	80
そ の 他	1,616	1,379
合 計	13,642	12,380

(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22年度末: ▲509億円、平成23年度上半期末: ▲521億円)

(4) 金銭の信託の時価情報 (会社計)

(単位：億円)

区分	平成22年度末					平成23年度上半期末				
	貸借対照表 計上額	時価	差損益			貸借対照表 計上額	時価	差損益		
			差益	差損				差益	差損	
金銭の信託	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

(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22年度末		平成23年度上半期末	
	貸借対照表計上額	当期の損益に含まれた 評価損益	貸借対照表計上額	当期の損益に含まれた 評価損益
運用目的の金銭の信託	—	24	—	—

(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22年度末、平成23年度上半期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23年度上半期末)

(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	—	1,352	—	—	—	1,352
ヘッジ会計非適用分	—	122	0	—	—	122
合計	—	1,474	0	—	—	1,474

(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. ヘッジ会計が適用されていないもの

(a) 金利関連

平成22年度末、平成23年度上半期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22年度末				平成23年度上半期末					
		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	為替予約										
	売建	8,304	—	8,478	▲ 174	7,390	—	7,275	114		
	米ドル	5,162	—	5,218	▲ 56	4,312	—	4,259	53		
	ユーロ	2,296	—	2,389	▲ 92	1,724	—	1,685	39		
	買建	8,804	—	8,988	184	2,289	—	2,284	▲ 4		
	米ドル	5,443	—	5,530	86	955	—	958	2		
	ユーロ	2,186	—	2,244	57	417	—	417	0		
	通貨オプション										
	売建										
	コール	1,247	—	1	0	—	—	—	—		
	(1)	(1)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—		
	米ドル	1,247	—	1	0	—	—	—	—		
	(1)	(1)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—		
	ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—		
	(—)	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—		
	プット	—	—	—	—	618	—	34	▲ 9		
	(—)	(—)	(—)	—	—	(25)	(—)	—	—		
	米ドル	—	—	—	—	306	—	10	▲ 0		
	(—)	(—)	(—)	—	—	(9)	(—)	—	—		
	ユーロ	—	—	—	—	312	—	24	▲ 9		
	(—)	(—)	(—)	—	—	(15)	(—)	—	—		
	買建	—	—	—	—	—	—	—	—		
	コール	—	—	—	—	—	—	—	—		
	(—)	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—		
	米ドル	—	—	—	—	—	—	—	—		
	(—)	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—		
	ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—		
(—)	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—			
プット	1,247	—	0	▲ 1	1,440	—	64	22			
(1)	(1)	(—)	—	—	(42)	(—)	—	—			
米ドル	1,247	—	0	▲ 1	919	—	24	2			
(1)	(1)	(—)	—	—	(21)	(—)	—	—			
ユーロ	—	—	—	—	520	—	40	19			
(—)	(—)	(—)	—	—	(20)	(—)	—	—			
通貨スワップ	—	—	—	—	—	—	—	—			
米ドル	—	—	—	—	—	—	—	—			
ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—			
合計				9				122			

(注) 1. () 内には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22年度末				平成23年度上半期末					
		契約額等	うち1年超		時価	差損益	契約額等	うち1年超		時価	差損益
取引所	株価指数先物										
	売建	—	—	—	—	—	—	—	—		
	買建	153	—	144	▲ 8	115	—	115	0		
店頭	株式オプション										
	売建										
	コール	—	—	—	—	—	—	—	—		
	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—			
	プット	—	—	—	—	—	—	—	—		
	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—			
買建	—	—	—	—	—	—	—	—			
コール	1	1	0	▲ 0	1	1	0	▲ 0			
(0)	(0)	—	—	(0)	(0)	—	—	—			
プット	—	—	—	—	—	—	—	—			
(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	—			
合計				▲ 8				0			

(注) 1. () 内には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、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22年度末、平成23年度上半期末に該当の残高はありません。

(e) その他

平成22年度末、平成23年度上半期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22年度末、平成23年度上半期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22年度末				平成23年度上半期末					
				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				
店頭	時価ヘッジ	為替予約											
		売建	48,175	—	49,094	▲ 918	44,176	—	42,988	1,188			
		米ドル	29,592	—	29,837	▲ 244	28,813	—	28,682	130			
		ユーロ	4,818	—	5,079	▲ 260	4,078	—	3,812	265			
		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	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	—		
		合 計						▲ 812				1,352	
			繰延ヘッジ	通貨スワップ	外貨建債券	1,559	1,559	106	106	2,430	2,430	163	163
				米ドル		644	644	34	34	1,318	1,318	46	46
		ユーロ		888	888	72	72	1,085	1,085	115	115		

(注) 1. () 内には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

平成22年度末、平成23年度上半期末に該当の残高はありません。

(d) 債券関連

平成22年度末、平成23年度上半期末に該当の残高はありません。

(e) その他

平成22年度末、平成23年度上半期末に該当の残高はありません。