

平成25年度第2四半期(上半期)報告 <補足資料>

<目次>

1. 会社計

(1) 有価証券(会社計)

- | | |
|-----------------|------|
| ① 売買目的有価証券の評価損益 | … 1頁 |
| ② 有価証券の時価情報 | … 1頁 |
| ③ 金銭の信託の時価情報 | … 3頁 |
| ④ デリバティブ取引の時価情報 | … 4頁 |

2. 一般勘定

(1) 有価証券関係

- | | |
|-----------------|------|
| ① 有価証券明細表 | … 5頁 |
| ② 有価証券残存期間別残高 | … 6頁 |
| ③ 業種別株式保有明細 | … 7頁 |
| ④ デリバティブ取引の時価情報 | … 8頁 |

(2) 貸付金関係

- | | |
|----------|------|
| ① 貸付金明細表 | … 9頁 |
|----------|------|

(3) 海外投融資関係

- | | |
|---------------|-------|
| ① 資産別明細表 | … 10頁 |
| ② 外貨建資産の通貨別構成 | … 10頁 |
| ③ 海外投融資の地域別構成 | … 11頁 |

3. 個人変額保険・個人変額年金保険特別勘定に関する時価情報

- | | |
|-------------------|-------|
| (1) 売買目的有価証券の評価損益 | … 12頁 |
| (2) 有価証券明細表 | … 12頁 |
| (3) 金銭の信託の時価情報 | … 12頁 |
| (4) デリバティブ取引の時価情報 | … 12頁 |

以 上

1. 会社計

(1) 有価証券(会社計)

① 売買目的有価証券の評価損益(会社計)

(単位:百万円)

区 分	平成24年度末		平成25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	527,787	70,801	580,114	30,986

② 有価証券の時価情報(会社計)

a. 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は以下のとおりです。

(単位:百万円)

区 分	平成24年度末					平成25年度第2四半期(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	
満期保有目的の債券	3,874,232	4,425,970	551,737	551,737	-	4,129,033	4,548,069	419,035	419,274	238
責任準備金対応債券	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
子会社・関連会社株式	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他の有価証券	955,999	1,079,296	123,296	123,344	47	1,009,034	1,119,633	110,598	111,281	682
公 社 債	925,308	1,036,956	111,648	111,648	-	974,981	1,072,448	97,467	97,886	419
株 式	14,760	20,994	6,233	6,281	47	16,248	24,997	8,748	8,941	192
外 国 証 券	14,454	18,681	4,226	4,226	-	16,329	19,741	3,412	3,483	70
公 社 債	14,454	18,681	4,226	4,226	-	16,313	19,726	3,412	3,483	70
株 式 等	-	-	-	-	-	15	15	△0	-	0
その他の証券	1,476	2,664	1,188	1,188	-	1,476	2,445	969	969	-
買入金銭債権	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
譲渡性預金	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
合 計	4,830,232	5,505,267	675,034	675,082	47	5,138,068	5,667,703	529,634	530,555	921
公 社 債	4,756,200	5,410,686	654,486	654,486	-	5,054,115	5,559,286	505,171	505,590	419
株 式	14,760	20,994	6,233	6,281	47	16,248	24,997	8,748	8,941	192
外 国 証 券	57,795	70,922	13,126	13,126	-	66,228	80,973	14,744	15,053	309
公 社 債	57,795	70,922	13,126	13,126	-	66,213	80,958	14,744	15,053	309
株 式 等	-	-	-	-	-	15	15	△0	-	0
その他の証券	1,476	2,664	1,188	1,188	-	1,476	2,445	969	969	-
買入金銭債権	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
譲渡性預金	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

(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を含んでおります。

2. 金銭の信託のうち売買目的有価証券以外のものを含み、その帳簿価額、差損益は、それぞれ、268,631百万円、34,577百万円です。

3. 帳簿価額は償却原価後、かつ減損処理後で時価評価前の価額です。

b. 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24年度末		平成25年度 第2四半期(上半期)末	
	帳簿価額	時価	帳簿価額	時価
満期保有目的の債券	-	-	-	-
非上場外国債券	-	-	-	-
その他の	-	-	-	-
責任準備金対応債券	-	-	-	-
子会社・関連会社株式	12,607	12,607	15,000	15,000
その他の有価証券	20,372	20,372	18,758	18,758
非上場国内株式(店頭売買株式を除く)	4	4	4	4
非上場外国株式(店頭売買株式を除く)	948	948	943	943
非上場外国債券	-	-	-	-
その他の	19,419	19,419	17,810	17,810
合 計	32,980	32,980	33,758	33,758

c. 前項bについて為替等を評価し、前項aと合算した有価証券の時価情報は以下のとおりです。

(単位:百万円)

区 分	平成24年度末					平成25年度第2四半期(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		
満期保有目的の債券	3,874,232	4,425,970	551,737	551,737	-	4,129,033	4,548,069	419,035	419,274	238
責任準備金対応債券	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
子会社・関連会社株式	12,607	12,607	-	-	-	15,000	15,000	-	-	-
その他の有価証券	976,372	1,103,708	127,335	128,555	1,219	1,027,793	1,143,786	115,993	117,576	1,583
公 社 債	925,308	1,036,956	111,648	111,648	-	974,981	1,072,448	97,467	97,886	419
株 式	14,765	20,998	6,233	6,281	47	16,252	25,001	8,748	8,941	192
外 国 証 券	15,403	20,083	4,679	4,679	-	17,272	21,296	4,023	4,094	70
公 社 債	14,454	18,681	4,226	4,226	-	16,313	19,726	3,412	3,483	70
株 式 等	948	1,401	452	452	-	958	1,569	610	611	0
その他の証券	20,895	25,669	4,774	5,946	1,171	19,286	25,039	5,753	6,654	900
買入金銭債権	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
譲渡性預金	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他の	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
合 計	4,863,212	5,542,285	679,073	680,292	1,219	5,171,826	5,706,855	535,029	536,850	1,821
公 社 債	4,756,200	5,410,686	654,486	654,486	-	5,054,115	5,559,286	505,171	505,590	419
株 式	24,872	31,106	6,233	6,281	47	27,252	36,001	8,748	8,941	192
外 国 証 券	61,244	74,823	13,578	13,578	-	71,172	86,528	15,355	15,665	309
公 社 債	57,795	70,922	13,126	13,126	-	66,213	80,958	14,744	15,053	309
株 式 等	3,448	3,901	452	452	-	4,958	5,569	610	611	0
その他の証券	20,895	25,669	4,774	5,946	1,171	19,286	25,039	5,753	6,654	900
買入金銭債権	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
譲渡性預金	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他の	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

③金銭の信託の時価情報(会社計)

(単位:百万円)

区 分	平成24年度末					平成25年度第2四半期(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	306,122	306,122	-	-	-	302,532	302,532	-	-	-

(注)本表には合同運用の金銭信託50百万円を含んでいます。

■ 運用目的の金銭の信託

(単位:百万円)

区 分	平成24年度末			平成25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	-	-	-	-	-	-

(注)金銭の信託には、金銭の信託内で有している現預金及びコールローン等を含んでいます。

■ 満期保有目的、責任準備金対応、その他の金銭の信託

(単位:百万円)

区 分	平成24年度末					平成25年度第2四半期(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	
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	267,865	306,071	38,206	38,206	-	267,904	302,481	34,577	34,577	-

(注)金銭の信託には、金銭の信託内で有している現預金及びコールローン等を含んでいます。

④デリバティブ取引の時価情報(会社計)(ヘッジ会計適用・非適用分の合算値)

■ 定性的情報

(1) 取引の内容

当社が利用対象としている主なデリバティブ取引は次の取引です。
通貨関連:為替予約取引

(2) 取組方針

保有資産及び負債のリスクを低減することを目的とし、投機的なデリバティブ取引は行わない方針です。

(3) 利用目的

保有資産及び負債のリスク低減を目的にデリバティブを利用しています。なお、ヘッジ会計は適用していません。

(4) リスクの内容

利用しているデリバティブ取引には市場価格の変動によるリスクがありますが、保有資産及び負債のリスクの低減を主目的として利用しているため、デリバティブ取引と対象となる資産及び負債のリスクの合計は限定的なものとなっております。
なお、デリバティブの取引行為自体に信用リスクがありますが、当該取引に係わる契約不履行の可能性が小さいと見込まれる相手先を選定して取引を行っています。

(5) リスク管理体制

デリバティブは、社内で決裁された限度額の範囲内で取引しております。
運用部門が行った取引の相手先からの報告書は、管理部門が直接受領して運用部門からの報告と照合し、管理部門は運用部門と独立してデリバティブのポジション及び損益を把握できる体制をとっています。また、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、全体のリスク状況については、リスク管理部門を通じ、取締役会及び経営会議において定期的に報告しております。

(6) 定量的情報に関する補足情報

為替予約取引については、保有する外貨建債権債務等の為替変動リスクを低減する目的で行っています。対象の保有資産とデリバティブの損益は通算して認識しており、為替変動がある程度減殺される効果を確認しています。

■ 定量的情報

(1) 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)

平成24年度末						
	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	-	△172	-	-	-	△172
合計	-	△172	-	-	-	△172
平成25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
ヘッジ会計適用分	-	-	-	-	-	-
ヘッジ会計非適用分	-	-	-	-	-	-
合計	-	-	-	-	-	-

(注)ヘッジ会計非適用分の差損益は、損益計算書に計上されています。

(2) 金利関連

該当ありません。

(3) 通貨関連

区分	種類	平成24年度末				平成25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	為替予約								
	売建米ドル	1,206	-	△172	△172	-	-	-	-
		1,206	-	△172	△172	-	-	-	-
合計					△172				

(注)為替予約の各期末の為替相場は、先物相場を使用しております。

(4) 株式関連

該当ありません。

(5) 債券関連

該当ありません。

(6) その他

該当ありません。

2. 一般勘定

(1) 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24年度末		平成25年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
国 債	4,527,332	96.7	4,814,753	96.6
地 方 債	3,490	0.1	3,466	0.1
社 債	30,224	0.6	30,153	0.6
うち 公 社 ・ 公 団 債	27,108	0.6	27,061	0.5
株 式	31,106	0.7	36,001	0.7
外 国 証 券	87,428	1.9	95,932	1.9
公 社 債	62,022	1.3	69,626	1.4
株 式 等	25,406	0.5	26,305	0.5
そ の 他 の 証 券	4,164	0.1	4,303	0.1
合 計	4,683,747	100.0	4,984,611	100.0

②有価証券残存期間別残高(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
平成24年度末	国債	3,631	23,197	15,528	-	16,115	4,468,860	4,527,332
	地方債	2,472	1,018	-	-	-	-	3,490
	社債	-	8,373	637	-	-	21,213	30,224
	株式	-	-	-	-	-	31,106	31,106
	外国証券	1,736	4,393	13,520	7,995	13,401	46,380	87,428
	公社債	-	-	4,338	2,318	12,024	43,341	62,022
	株式等	1,736	4,393	9,182	5,677	1,376	3,039	25,406
	その他の証券	-	89	-	1,397	13	2,664	4,164
	合計	7,840	37,071	29,686	9,392	29,531	4,570,224	4,683,747
平成25年度 第2四半期(上半期)末	国債	7,555	17,481	15,381	-	27,656	4,746,678	4,814,753
	地方債	3,466	-	-	-	-	-	3,466
	社債	6,153	2,261	527	-	-	21,210	30,153
	株式	-	-	-	-	-	36,001	36,001
	外国証券	2,019	5,205	11,071	9,431	13,718	54,485	95,932
	公社債	-	-	3,989	3,084	12,652	49,899	69,626
	株式等	2,019	5,205	7,082	6,346	1,066	4,586	26,305
	その他の証券	-	90	1,556	-	210	2,445	4,303
	合計	19,195	25,039	28,536	9,431	41,586	4,860,822	4,984,611

③業種別株式保有明細(一般勘定)

(単位:百万円、%)

区 分	平成24年度末		平成25年度 第2四半期(上半期)末		
	金額	占率	金額	占率	
水産・農林業	-	-	-	-	
鉱業	124	0.4	121	0.3	
建設業	1,388	4.5	1,888	5.2	
製 造 業	食料品	326	1.1	485	1.3
	繊維製品	-	-	-	-
	パルプ・紙	-	-	-	-
	化学	444	1.4	627	1.7
	医薬品	645	2.1	651	1.8
	石油・石炭製品	-	-	-	-
	ゴム製品	-	-	-	-
	ガラス・土石製品	-	-	-	-
	鉄鋼	-	-	-	-
	非鉄金属	270	0.9	330	0.9
	金属製品	-	-	-	-
	機械	1,114	3.6	1,190	3.3
	電気機器	3,416	11.0	3,730	10.4
輸送用機器	2,544	8.2	2,952	8.2	
精密機器	131	0.4	174	0.5	
その他製品	-	-	-	-	
電気・ガス業	631	2.0	654	1.8	
運 輸 ・ 情 報 通 信 業	陸運業	807	2.6	1,085	3.0
	海運業	-	-	-	-
	空運業	-	-	-	-
	倉庫・運輸関連業	-	-	-	-
	情報・通信業	1,786	5.7	2,658	7.4
商 業	卸売業	1,038	3.3	1,161	3.2
	小売業	4,613	14.8	4,597	12.8
金 融 ・ 保 険 業	銀行業	-	-	-	-
	証券、商品先物取引業	-	-	-	-
	保険業	10,107	32.5	11,000	30.6
	その他金融業	363	1.2	929	2.6
不動産業	-	-	-	-	
サービス業	1,349	4.3	1,761	4.9	
合計	31,106	100.0	36,001	100.0	

(注) 業種別区分は、証券コード協議会の業種別分類項目に準拠しております。

④デリバティブ取引の時価情報（一般勘定）（ヘッジ会計適用・非適用分の合算値）

■ 定性的情報

(1) 取引の内容

当社が利用対象としている主なデリバティブ取引は次の取引です。
通貨関連：為替予約取引

(2) 取組方針

保有資産及び負債のリスクを低減することを目的とし、投機的なデリバティブ取引は行わない方針です。

(3) 利用目的

保有資産及び負債のリスク低減を目的にデリバティブを利用しています。なお、ヘッジ会計は適用していません。

(4) リスクの内容

利用しているデリバティブ取引には市場価格の変動によるリスクがありますが、保有資産及び負債のリスクの低減を主目的として利用しているため、デリバティブ取引と対象となる資産及び負債のリスクの合計は限定的なものとなっております。

なお、デリバティブの取引行為自体に信用リスクがありますが、当該取引に係わる契約不履行の可能性が小さいと見込まれる相手先を選定して取引を行っています。

(5) リスク管理体制

デリバティブは、社内で決裁された限度額の範囲内で取引しております。

運用部門が行った取引の相手先からの報告書は、管理部門が直接受領して運用部門からの報告と照合し、管理部門は運用部門と独立してデリバティブのポジション及び損益を把握できる体制をとっています。また、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、全体のリスク状況については、リスク管理部門を通じ、取締役会及び経営会議において定期的に報告しております。

(6) 定量的情報に関する補足情報

為替予約取引については、保有する外貨建債権債務等の為替変動リスクを低減する目的で行っています。対象の保有資産とデリバティブの損益は通算して認識しており、為替変動がある程度減殺される効果を確認しています。

■ 定量的情報

(1) 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）

平成24年度末						
	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	-	△172	-	-	-	△172
合計	-	△172	-	-	-	△172
平成25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
ヘッジ会計適用分	-	-	-	-	-	-
ヘッジ会計非適用分	-	-	-	-	-	-
合計	-	-	-	-	-	-

（注）ヘッジ会計非適用分の差損益は、損益計算書に計上されています。

(2) 金利関連

該当ありません。

(3) 通貨関連

区分	種類	平成24年度末				平成25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	為替予約								
	売建米ドル	1,206	-	△172	△172	-	-	-	-
		1,206	-	△172	△172	-	-	-	-
合計					△172				

（注）為替予約の各期末の為替相場は、先物相場を使用しております。

(4) 株式関連

該当ありません。

(5) 債券関連

該当ありません。

(6) その他

該当ありません。

(2) 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24年度末	平成25年度 第2四半期(上半期)末
保 險 約 款 貸 付	145,019	149,753
契 約 者 貸 付	129,523	133,956
保 險 料 振 替 貸 付	15,495	15,796
一 般 貸 付	85	60
そ の 他	85	60
合 計	145,104	149,813

(注) 一般貸付の「その他」の内容は従業員貸付です。

(3)海外投融資関係(一般勘定)

①資産別明細表(一般勘定)

■ 外貨建資産

(単位:百万円、%)

区 分	平成24年度末		平成25年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
公 社 債	18,681	21.0	26,045	27.1
株 式	1,401	1.6	1,569	1.6
現 預 金 ・ そ の 他	21,673	24.4	19,766	20.5
外 貨 建 資 産 計	41,756	47.0	47,382	49.3

■ 円貨額が確定した外貨建資産

該当ありません。

■ 円貨建資産

(単位:百万円、%)

区 分	平成24年度末		平成25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	-	-	-	-
公社債(円建外債)・その他	47,169	53.0	48,813	50.7
円 貨 建 資 産 計	47,169	53.0	48,813	50.7

■ 合 計

(単位:百万円、%)

区 分	平成24年度末		平成25年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
海 外 投 融 資	88,926	100.0	96,196	100.0

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24年度末		平成25年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
米 ド ル	27,360	65.5	33,716	71.2
ユ ー ロ	5,992	14.4	5,924	12.5
オーストラリアドル	7,782	18.6	7,137	15.1
イギリスポンド	617	1.5	599	1.3
中 国 元	2	0.0	2	0.0
新 台 湾 ド ル	1	0.0	1	0.0
シンガポールドル	-	-	0	0.0
外 貨 建 資 産 計	41,756	100.0	47,382	100.0

③海外投融资の地域別構成(一般勘定)

(単位:百万円、%)

区分	平成24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	18,757	21.5	10,967	17.7	7,790	30.7	-	-
ヨーロッパ	50,441	57.7	43,341	69.9	7,100	27.9	-	-
オセアニア	7,714	8.8	7,714	12.4	-	-	-	-
アジア	-	-	-	-	-	-	-	-
中南米	10,515	12.0	-	-	10,515	41.4	-	-
中東	-	-	-	-	-	-	-	-
アフリカ	-	-	-	-	-	-	-	-
国際機関	-	-	-	-	-	-	-	-
合計	87,428	100.0	62,022	100.0	25,406	100.0	-	-

区分	平成25年度 第2四半期(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	26,092	27.2	18,971	27.2	7,120	27.1	-	-
ヨーロッパ	50,779	52.9	43,580	62.6	7,198	27.4	-	-
オセアニア	7,073	7.4	7,073	10.2	-	-	-	-
アジア	-	-	-	-	-	-	-	-
中南米	11,986	12.5	-	-	11,986	45.6	-	-
中東	-	-	-	-	-	-	-	-
アフリカ	-	-	-	-	-	-	-	-
国際機関	-	-	-	-	-	-	-	-
合計	95,932	100.0	69,626	100.0	26,305	100.0	-	-

3. 個人変額保険・個人変額年金保険特別勘定に関する時価情報(特別勘定)

(1) 売買目的有価証券の評価損益(特別勘定)

(単位:百万円)

区 分	平成24年度末		平成25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	527,787	70,801	580,114	30,986

(2) 有価証券明細表(特別勘定)

(単位:百万円)

区 分	平成24年度末	平成25年度 第2四半期(上半期)末
	貸借対照表計上額	貸借対照表計上額
公 社 債	159,256	168,650
株 式	30,778	35,960
外 国 証 券	188,010	203,830
公 社 債	44,775	46,405
株 式 等	143,235	157,425
そ の 他 証 券	149,741	171,673
合 計	527,787	580,114

(3) 金銭の信託の時価情報(特別勘定)

該当ありません。

(4) デリバティブ取引の時価情報(特別勘定)

該当ありません。