

平成19年度上半期報告 補足資料

【目次】

I. 一般勘定

| | |
|----------------------|--------|
| 1. 有価証券関係 | |
| (ア) 有価証券明細表 | ・・・1 |
| (イ) 有価証券残存期間別残高 | ・・・2 |
| (ウ) 地域別地方債保有内訳 | ・・・2 |
| (エ) 業種別株式明細表 | ・・・3 |
| (オ) デリバティブ取引の時価情報 | ・・・4～5 |
| 2. 貸付金関係 | |
| (ア) 貸付金明細表 | ・・・6 |
| (イ) 貸付金残存期間別残高 | ・・・6 |
| (ウ) 国内企業向け貸付金企業規模別内訳 | ・・・7 |
| (エ) 貸付金業種別内訳 | ・・・8 |
| (オ) 貸付金国内地域別内訳 | ・・・9 |
| (カ) 貸付金担保別内訳 | ・・・9 |
| 3. 海外投融資関係 | |
| (ア) 資産別明細 | ・・・10 |
| (イ) 海外投融資の地域別構成 | ・・・11 |
| (ウ) 外貨建資産の通貨別構成 | ・・・11 |

II. 特別勘定

| | |
|----------------------|-------|
| 1. 個人変額保険（特別勘定）の状況 | |
| (ア) 有価証券の時価情報 | ・・・12 |
| (イ) デリバティブ取引の時価情報 | ・・・12 |
| 2. 個人変額年金保険（特別勘定）の状況 | ・・・12 |

III. 全社計

| | |
|-------------------|----------|
| 1. 資産構成 | ・・・13 |
| 2. 有価証券等の時価情報 | |
| (ア) 有価証券の時価情報 | ・・・14～17 |
| (イ) デリバティブ取引の運用状況 | ・・・18 |
| (ウ) デリバティブ取引の時価情報 | ・・・19～20 |

| | |
|----------------|-------|
| IV. 貸倒引当金残高の内訳 | ・・・21 |
|----------------|-------|

| | |
|----------------------------|-------|
| V. 個人保険および個人年金保険の責任準備金積立状況 | ・・・21 |
|----------------------------|-------|

I. 一般勘定

1. 有価証券関係

(ア)有価証券明細表(一般勘定)

(単位:百万円、%)

| 区 分 | 平成18年度上半期末 | | 平成19年度上半期末 | | 平成18年度末 | |
|-------------|------------|-------|------------|-------|-----------|-------|
| | 金 額 | 占 率 | 金 額 | 占 率 | 金 額 | 占 率 |
| 国 債 | 1,662,964 | 41.7 | 1,540,095 | 39.0 | 1,823,289 | 44.3 |
| 地 方 債 | 94,251 | 2.4 | 91,565 | 2.3 | 91,655 | 2.2 |
| 社 債 | 359,727 | 9.0 | 453,274 | 11.5 | 374,383 | 9.1 |
| うち公社・公団債 | 55,716 | 1.4 | 69,162 | 1.7 | 60,086 | 1.5 |
| 株 式 | 745,085 | 18.7 | 675,887 | 17.1 | 750,506 | 18.3 |
| 外 国 証 券 | 872,208 | 21.9 | 951,235 | 24.1 | 912,034 | 22.2 |
| 公 社 債 | 748,415 | 18.8 | 824,885 | 20.9 | 790,022 | 19.2 |
| 株 式 等 | 123,793 | 3.1 | 126,349 | 3.2 | 122,011 | 3.0 |
| そ の 他 の 証 券 | 253,950 | 6.4 | 241,773 | 6.1 | 159,334 | 3.9 |
| 合計 | 3,988,189 | 100.0 | 3,953,830 | 100.0 | 4,111,204 | 100.0 |

(イ)有価証券残存期間別残高(一般勘定)

<平成18年度上半期末>

(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 | 合計 |
|--------|---------|-------------|-------------|-------------|--------------|-----------|-----------|
| 国債 | 20,069 | 102,468 | 123,654 | 270,286 | 645,992 | 500,493 | 1,662,964 |
| 地方債 | 2,590 | 8,184 | 4,405 | 7,961 | 66,679 | 4,430 | 94,251 |
| 社債 | 6,646 | 1,947 | 29,325 | 47,764 | 166,627 | 107,417 | 359,727 |
| 株式 | | | | | | 745,085 | 745,085 |
| 外国証券 | 91,622 | 212,459 | 174,732 | 32,507 | 150,138 | 210,748 | 872,208 |
| 公社債 | 61,122 | 212,410 | 171,657 | 27,618 | 150,138 | 125,467 | 748,415 |
| 株式等 | 30,499 | 49 | 3,075 | 4,889 | 0 | 85,280 | 123,793 |
| その他の証券 | 1,153 | 803 | 1,024 | - | 3,092 | 247,876 | 253,950 |
| 合計 | 122,081 | 325,863 | 333,142 | 358,519 | 1,032,530 | 1,816,052 | 3,988,189 |

<平成19年度上半期末>

(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 | 合計 |
|--------|---------|-------------|-------------|-------------|--------------|-----------|-----------|
| 国債 | 63,888 | 55,674 | 108,180 | 278,396 | 471,637 | 562,318 | 1,540,095 |
| 地方債 | 7,287 | 3,016 | 2,166 | 42,006 | 35,090 | 1,997 | 91,565 |
| 社債 | 932 | 6,787 | 28,805 | 59,576 | 201,269 | 155,902 | 453,274 |
| 株式 | | | | | | 675,887 | 675,887 |
| 外国証券 | 67,802 | 172,119 | 306,919 | 150,040 | 109,462 | 144,891 | 951,235 |
| 公社債 | 35,246 | 170,381 | 306,919 | 145,278 | 101,808 | 65,251 | 824,885 |
| 株式等 | 32,556 | 1,737 | - | 4,762 | 7,653 | 79,640 | 126,349 |
| その他の証券 | 681 | 690 | 212 | - | 6,097 | 234,091 | 241,773 |
| 合計 | 140,593 | 238,288 | 446,283 | 530,020 | 823,556 | 1,775,087 | 3,953,830 |

<平成18年度末>

(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 | 合計 |
|--------|---------|-------------|-------------|-------------|--------------|-----------|-----------|
| 国債 | 122,192 | 87,877 | 191,602 | 321,522 | 584,308 | 515,785 | 1,823,289 |
| 地方債 | 5,685 | 3,285 | 3,601 | 33,929 | 42,155 | 2,997 | 91,655 |
| 社債 | 2,340 | 1,102 | 30,093 | 62,559 | 156,673 | 121,614 | 374,383 |
| 株式 | | | | | | 750,506 | 750,506 |
| 外国証券 | 30,910 | 184,775 | 241,719 | 85,350 | 155,305 | 213,973 | 912,034 |
| 公社債 | - | 182,217 | 241,719 | 80,661 | 150,140 | 135,284 | 790,022 |
| 株式等 | 30,910 | 2,558 | - | 4,689 | 5,165 | 78,688 | 122,011 |
| その他の証券 | 758 | 877 | 266 | - | 5,398 | 152,033 | 159,334 |
| 合計 | 161,887 | 277,918 | 467,283 | 503,362 | 943,841 | 1,756,911 | 4,111,204 |

(注)10年超については、期間の定めのないものを含みます。

(ウ)地域別地方債保有内訳(一般勘定)

(単位:百万円)

| 区 分 | 平成18年度上半期末 | 平成19年度上半期末 | 平成18年度末 |
|-------|------------|------------|---------|
| 北 海 道 | 1,418 | 1,004 | 1,010 |
| 東 北 | - | - | - |
| 関 東 | 89,336 | 88,076 | 88,156 |
| 中 部 | 300 | 300 | 300 |
| 近 畿 | - | - | - |
| 中 国 | 2,100 | 1,098 | 1,098 |
| 四 国 | - | - | - |
| 九 州 | 1,096 | 1,086 | 1,090 |
| 合 計 | 94,251 | 91,565 | 91,655 |

(工)業種別株式明細表(一般勘定)

(単位:百万円、%)

| 区 分 | 平成18年度上半期末 | | 平成19年度上半期末 | | 平成18年度末 | | |
|-----------------|---------------------|---------|------------|---------|---------|---------|------|
| | 金 額 | 占 率 | 金 額 | 占 率 | 金 額 | 占 率 | |
| 水 産 ・ 農 林 業 | 88 | 0.0 | 61 | 0.0 | 80 | 0.0 | |
| 鉱 業 | 537 | 0.1 | 555 | 0.1 | 1,036 | 0.1 | |
| 建 設 業 | 8,414 | 1.1 | 5,588 | 0.8 | 6,339 | 0.8 | |
| 製 造 業 | 食 料 品 | 8,629 | 1.2 | 8,540 | 1.3 | 10,041 | 1.3 |
| | 織 維 製 品 | 3,952 | 0.5 | 3,491 | 0.5 | 2,856 | 0.4 |
| | パ ル プ ・ 紙 | 4,736 | 0.6 | 4,123 | 0.6 | 5,035 | 0.7 |
| | 化 学 | 80,686 | 10.8 | 77,148 | 11.4 | 80,785 | 10.8 |
| | 医 薬 品 | 14,235 | 1.9 | 9,983 | 1.5 | 12,689 | 1.7 |
| | 石 油 ・ 石 炭 製 品 | 1,924 | 0.3 | 1,773 | 0.3 | 1,261 | 0.2 |
| | ゴ ム 製 品 | 11,495 | 1.5 | 22,449 | 3.3 | 19,717 | 2.6 |
| | ガ ラ ス ・ 土 石 製 品 | 1,783 | 0.2 | 1,558 | 0.2 | 1,494 | 0.2 |
| | 鉄 鋼 | 23,232 | 3.1 | 37,163 | 5.5 | 36,998 | 4.9 |
| | 非 鉄 金 属 | 26,510 | 3.6 | 20,793 | 3.1 | 26,321 | 3.5 |
| | 金 属 製 品 | 2,139 | 0.3 | 1,860 | 0.3 | 2,233 | 0.3 |
| | 機 械 | 34,395 | 4.6 | 32,657 | 4.8 | 33,075 | 4.4 |
| | 電 気 機 器 | 158,034 | 21.2 | 122,668 | 18.1 | 137,495 | 18.3 |
| | 輸 送 用 機 器 | 15,053 | 2.0 | 18,614 | 2.8 | 17,343 | 2.3 |
| 精 密 機 器 | 8,900 | 1.2 | 9,446 | 1.4 | 10,641 | 1.4 | |
| そ の 他 製 品 | 10,173 | 1.4 | 9,423 | 1.4 | 10,578 | 1.4 | |
| 電 気 ・ ガ ス 業 | 6,139 | 0.8 | 5,968 | 0.9 | 9,183 | 1.2 | |
| 運 輸 ・ 情 報 通 信 業 | 陸 運 業 | 76,411 | 10.3 | 72,839 | 10.8 | 89,260 | 11.9 |
| | 海 運 業 | 1,647 | 0.2 | 3,904 | 0.6 | 4,910 | 0.7 |
| | 空 運 業 | 284 | 0.0 | 270 | 0.0 | 281 | 0.0 |
| | 倉 庫 ・ 運 輸 関 連 業 | 4,311 | 0.6 | 2,971 | 0.4 | 3,313 | 0.4 |
| | 情 報 ・ 通 信 業 | 13,860 | 1.9 | 12,654 | 1.9 | 14,342 | 1.9 |
| 商 業 | 卸 売 業 | 31,980 | 4.3 | 40,315 | 6.0 | 37,052 | 4.9 |
| | 小 売 業 | 13,159 | 1.8 | 11,858 | 1.8 | 12,842 | 1.7 |
| 金 融 ・ 保 険 業 | 銀 行 業 | 129,094 | 17.3 | 93,623 | 13.9 | 113,529 | 15.1 |
| | 証 券 ・ 商 品 先 物 取 引 業 | 9,538 | 1.3 | 6,732 | 1.0 | 8,243 | 1.1 |
| | 保 険 業 | 3,098 | 0.4 | 3,548 | 0.5 | 2,781 | 0.4 |
| | そ の 他 金 融 業 | 21,369 | 2.9 | 14,351 | 2.1 | 18,283 | 2.4 |
| 不 動 産 業 | 3,353 | 0.5 | 3,379 | 0.5 | 5,067 | 0.7 | |
| サ ー ビ ス 業 | 15,913 | 2.1 | 15,565 | 2.3 | 15,388 | 2.1 | |
| 合 計 | 745,085 | 100.0 | 675,887 | 100.0 | 750,506 | 100.0 | |

(オ)デリバティブ取引の時価情報(一般勘定)

①差損益の内訳(ヘッジ会計適用分・非適用分の内訳)(一般勘定)

(単位:百万円)

| 平成18年度上半期末 | | 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 | 58 | △1,117 | - | - | - | - | △1,058 |
| ヘッジ会計非適用分 | 225 | - | - | △221 | - | - | 3 |
| 合計 | 283 | △1,117 | - | △221 | - | - | △1,055 |

(注)平成18年度上半期について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△1,117百万円)および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。

(単位:百万円)

| 平成19年度上半期末 | | 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 | △2 | - | - | - | - | - | △2 |
| ヘッジ会計非適用分 | - | △2 | - | - | - | - | △2 |
| 合計 | △2 | △2 | - | - | - | - | △5 |

(注)平成19年度上半期について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。

(単位:百万円)

| 平成18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 | 19 | - | - | - | - | - | 19 |
| ヘッジ会計非適用分 | 36 | - | - | - | - | - | 36 |
| 合計 | 55 | - | - | - | - | - | 55 |

(注)平成18年度について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(一般勘定)

(単位:百万円)

| 区分 | 種類 | 平成18年度上半期末 | | | | 平成19年度上半期末 | | | | 平成18年度末 | | | |
|-----|-------------------|------------|--------|-----|-----|------------|--------|----|-----|---------|--------|----|-----|
| | | 契約額等 | | 時価 | 差損益 | 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 | | | | うち1年超 | | | |
| 店頭 | 金利先渡契約 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| | 売建 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| | 買建 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| | 金利オプション | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| | 売建 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| | コール | (-) | - | - | - | (-) | - | - | - | (-) | - | - | - |
| | プット | (-) | - | - | - | (-) | - | - | - | (-) | - | - | - |
| | 買建 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| | コール | (-) | - | - | - | (-) | - | - | - | (-) | - | - | - |
| | プット | (-) | - | - | - | (-) | - | - | - | (-) | - | - | - |
| | 金利スワップ | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| | 固定金利受取 /変動金利支払 | 66,315 | 42,045 | 269 | 269 | 43,645 | 37,560 | △2 | △2 | 57,145 | 38,145 | 52 | 52 |
| | 固定金利支払 /変動金利受取 | 5,000 | - | 14 | 14 | - | - | - | - | 5,000 | - | 3 | 3 |
| | 変動金利受取 /変動金利支払 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| その他 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | |
| 売建 | (-) | - | - | - | (-) | - | - | - | (-) | - | - | - | |
| 買建 | (-) | - | - | - | (-) | - | - | - | (-) | - | - | - | |
| 合計 | (-) | | | 283 | (-) | | | △2 | (-) | | | 55 | |

(注)・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。
・スワップ取引の差損益欄には時価を記載しています。

平成19年度上半期末 金利スワップ残存期間別残高

(単位:百万円、%)

| | 1年以下 | 1年超 | 3年超 | 5年超 | 7年超 | 10年超 | 合計 |
|---------------|-------|--------|--------|--------|-------|------|--------|
| | | 3年以下 | 5年以下 | 7年以下 | 10年以下 | | |
| 受取側固定スワップ想定元本 | 6,085 | 12,860 | 13,100 | 10,600 | 1,000 | - | 43,645 |
| 平均受取固定金利 | 0.49 | 0.78 | 1.51 | 1.63 | 1.30 | - | 1.17 |
| 平均支払変動金利 | 0.89 | 0.88 | 0.71 | 0.84 | 0.82 | - | 0.82 |
| 支払側固定スワップ想定元本 | - | - | - | - | - | - | - |
| 平均支払固定金利 | - | - | - | - | - | - | - |
| 平均受取変動金利 | - | - | - | - | - | - | - |
| 合計 | 6,085 | 12,860 | 13,100 | 10,600 | 1,000 | - | 43,645 |

③通貨関連（一般勘定）

(単位:百万円)

| 区分 | 種類 | 平成18年度上半期末 | | | | 平成19年度上半期末 | | | | 平成18年度末 | | | |
|----|---------|------------|---|--------|--------|------------|---|-------|-----|---------|---|----|-----|
| | | 契約額等 | | 時価 | 差損益 | 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 | | | | うち1年超 | | | |
| 店頭 | 通貨先渡契約 | | | | | | | | | | | | |
| | 売建 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| | 買建 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| | 為替予約 | | | | | | | | | | | | |
| | 売建 | 31,732 | - | 32,850 | △1,117 | 1,159 | - | 1,162 | △2 | - | - | - | - |
| | うち米ドル | 31,732 | - | 32,850 | △1,117 | 1,159 | - | 1,162 | △2 | - | - | - | - |
| | うちユーロ | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| | 買建 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| | 通貨オプション | | | | | | | | | | | | |
| | 売建 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| | コール | (-) | - | - | - | (-) | - | - | - | (-) | - | - | - |
| | プット | (-) | - | - | - | (-) | - | - | - | (-) | - | - | - |
| | 買建 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| | コール | (-) | - | - | - | (-) | - | - | - | (-) | - | - | - |
| | プット | (-) | - | - | - | (-) | - | - | - | (-) | - | - | - |
| | 通貨スワップ | | | | | | | | | | | | |
| | その他 | | | | | | | | | | | | |
| | 売建 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| | 買建 | (-) | - | - | - | (-) | - | - | - | (-) | - | - | - |
| | 合計 | | | | △1,117 | | | | △2 | | | | - |

(注)・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。
 ・時価の算定には、期末日のTTM、WMロイターレート、割引レート等を基準として、当社で算出した理論価格を使用しています。
 ・外貨建金銭債権債務等が為替予約が付されていることにより、決済時における円貨額が確定している外貨建金銭債権債務等で、貸借対照表において当該円貨額で表示されているものについては、開示対象より除いています。

④株式関連（一般勘定）

平成18年度上半期末、平成19年度上半期末、平成18年度末とも保有していません。

⑤債券関連（一般勘定）

(単位:百万円)

| 区分 | 種類 | 平成18年度上半期末 | | | | 平成19年度上半期末 | | | | 平成18年度末 | | | |
|-----|-----------|------------|---|--------|------|------------|---|----|-----|---------|---|----|-----|
| | | 契約額等 | | 時価 | 差損益 | 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 | | | | うち1年超 | | | |
| 取引所 | 債券先物 | | | | | | | | | | | | |
| | 売建 | 40,218 | - | 40,440 | △221 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| | 買建 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| | 債券先物オプション | | | | | | | | | | | | |
| | 売建 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| | コール | (-) | - | - | - | (-) | - | - | - | (-) | - | - | - |
| | プット | (-) | - | - | - | (-) | - | - | - | (-) | - | - | - |
| | 買建 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| | コール | (-) | - | - | - | (-) | - | - | - | (-) | - | - | - |
| | プット | (-) | - | - | - | (-) | - | - | - | (-) | - | - | - |
| 合計 | | | | △221 | | | | - | | | | - | |

(注)・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. 貸付金関係

(ア) 貸付金明細表(一般勘定)

(単位:百万円)

| 区 分 | 平成18年度上半期末 | 平成19年度上半期末 | 平成18年度末 |
|-----------------|------------|------------|-----------|
| 保険約款貸付 | 193,201 | 175,794 | 183,836 |
| 契約者貸付 | 172,622 | 158,456 | 165,087 |
| 保険料振替貸付 | 20,578 | 17,337 | 18,749 |
| 一般貸付 | 1,008,202 | 1,014,813 | 1,009,933 |
| (うち非居住者貸付) | (77,000) | (68,000) | (77,000) |
| 企業貸付 | 880,544 | 912,197 | 890,073 |
| (うち国内企業向け貸付) | (803,544) | (844,197) | (813,073) |
| 国・国際機関・政府関係機関貸付 | 11,876 | 9,645 | 10,768 |
| 公共団体・公企業貸付 | 13,524 | 11,738 | 11,878 |
| 住宅ローン | 4,937 | 4,374 | 4,665 |
| 消費者ローン | 96,810 | 76,412 | 92,068 |
| その他 | 507 | 443 | 479 |
| 合 計 | 1,201,403 | 1,190,607 | 1,193,770 |
| うち劣後特約付貸付 | 90,000 | 120,500 | 75,000 |

(イ) 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 |
|------------|-------|------------|-------------|-------------|-------------|--------------|-------------------------|-----------|
| | | 平成18年度上半期末 | 25,103 | 34,111 | 17,273 | 53,502 | 18,828 | |
| 平成18年度上半期末 | 変動金利 | 25,103 | 34,111 | 17,273 | 53,502 | 18,828 | 31,555 | 180,375 |
| | 固定金利 | 120,525 | 242,946 | 205,534 | 102,064 | 134,216 | 22,540 | 827,826 |
| | 一般貸付計 | 145,628 | 277,057 | 222,807 | 155,567 | 153,044 | 54,096 | 1,008,202 |
| 平成19年度上半期末 | 変動金利 | 34,016 | 26,915 | 31,196 | 24,820 | 18,273 | 16,342 | 151,565 |
| | 固定金利 | 132,086 | 260,447 | 146,272 | 116,780 | 118,752 | 88,907 | 863,247 |
| | 一般貸付計 | 166,103 | 287,363 | 177,469 | 141,601 | 137,025 | 105,249 | 1,014,813 |
| 平成18年度末 | 変動金利 | 28,915 | 28,422 | 25,562 | 40,242 | 18,610 | 16,384 | 158,136 |
| | 固定金利 | 130,394 | 253,547 | 185,316 | 111,386 | 135,026 | 36,126 | 851,797 |
| | 一般貸付計 | 159,309 | 281,969 | 210,878 | 151,628 | 153,637 | 52,510 | 1,009,933 |

(ウ)国内企業向け貸付金企業規模別内訳(一般勘定)

(単位:件、百万円、%)

| 区分 | | 平成18年度上半期末 | | 平成19年度上半期末 | | 平成18年度末 | |
|--------|------|------------|-------|------------|-------|---------|-------|
| | | | 占率 | | 占率 | | 占率 |
| 大企業 | 貸付先数 | 165 | 61.8 | 167 | 69.6 | 165 | 65.5 |
| | 金額 | 731,651 | 91.1 | 780,922 | 92.5 | 740,068 | 91.0 |
| 中堅企業 | 貸付先数 | 9 | 3.4 | 7 | 2.9 | 8 | 3.2 |
| | 金額 | 3,753 | 0.5 | 3,171 | 0.4 | 3,539 | 0.4 |
| 中小企業 | 貸付先数 | 93 | 34.8 | 66 | 27.5 | 79 | 31.3 |
| | 金額 | 68,139 | 8.5 | 60,104 | 7.1 | 69,464 | 8.5 |
| 国内企業向け | 貸付先数 | 267 | 100.0 | 240 | 100.0 | 252 | 100.0 |
| 貸付計 | 金額 | 803,544 | 100.0 | 844,197 | 100.0 | 813,073 | 100.0 |

(注)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。

・業種の区分

| 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 | 従業員 300名超 かつ | 資本金 10億円以上 | 従業員 50名超 かつ | 資本金 10億円以上 | 従業員 100名超 かつ | 資本金 10億円以上 | 従業員 100名超 かつ | 資本金 10億円以上 |
| 中堅企業 | | 資本金 3億円超 10億円未満 | | 資本金 5千万円超 10億円未満 | | 資本金 5千万円超 10億円未満 | | 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 | |

(エ)貸付金業種別内訳(一般勘定)

(単位:百万円、%)

| 区 分 | | 平成18年度上半期末 | | 平成19年度上半期末 | | 平成18年度末 | |
|-----------------|---------------|------------|---------|------------|---------|-----------|-------|
| | | 金額 | 占率 | 金額 | 占率 | 金額 | 占率 |
| 国内向け | 製 造 業 | 163,013 | 16.2 | 158,381 | 15.6 | 163,881 | 16.2 |
| | 食料 | 1,880 | 0.2 | 1,950 | 0.2 | 1,990 | 0.2 |
| | 繊維 | 1,005 | 0.1 | 1,860 | 0.2 | 1,000 | 0.1 |
| | 木材・木製品 | - | - | - | - | - | - |
| | パルプ・紙 | 13,280 | 1.3 | 17,570 | 1.7 | 16,204 | 1.6 |
| | 印刷 | 166 | 0.0 | 200 | 0.0 | 221 | 0.0 |
| | 化学 | 19,282 | 1.9 | 22,030 | 2.2 | 21,153 | 2.1 |
| | 石油・石炭 | 15,502 | 1.5 | 9,800 | 1.0 | 10,330 | 1.0 |
| | 窯業・土石 | 1,016 | 0.1 | 940 | 0.1 | 974 | 0.1 |
| | 鉄鋼 | 21,015 | 2.1 | 19,000 | 1.9 | 24,005 | 2.4 |
| | 非鉄金属 | 55,082 | 5.5 | 48,652 | 4.8 | 51,636 | 5.1 |
| | 金属製品 | 205 | 0.0 | 206 | 0.0 | 180 | 0.0 |
| | 一般機械 | 3,314 | 0.3 | 3,075 | 0.3 | 2,594 | 0.3 |
| | 電気機械 | 10,432 | 1.0 | 10,699 | 1.1 | 10,695 | 1.1 |
| | 輸送用機械 | 19,004 | 1.9 | 17,325 | 1.7 | 17,679 | 1.8 |
| | 精密機械 | 250 | 0.0 | 250 | 0.0 | 250 | 0.0 |
| | その他の製造業 | 1,576 | 0.2 | 4,820 | 0.5 | 4,966 | 0.5 |
| | 農業 | - | - | - | - | - | - |
| | 林業 | - | - | - | - | - | - |
| | 漁業 | - | - | - | - | - | - |
| | 鉱業 | 104 | 0.0 | 69 | 0.0 | 86 | 0.0 |
| | 建設業 | 10,704 | 1.1 | 10,179 | 1.0 | 10,224 | 1.0 |
| | 電気・ガス・熱供給・水道業 | 50,686 | 5.0 | 49,740 | 4.9 | 53,435 | 5.3 |
| | 情報通信業 | 42,617 | 4.2 | 38,073 | 3.8 | 42,595 | 4.2 |
| | 運輸業 | 74,081 | 7.3 | 71,827 | 7.1 | 74,641 | 7.4 |
| | 卸売業 | 124,360 | 12.3 | 143,268 | 14.1 | 134,179 | 13.3 |
| | 小売業 | 4,719 | 0.5 | 4,533 | 0.4 | 4,746 | 0.5 |
| | 金融・保険業 | 206,307 | 20.5 | 239,046 | 23.6 | 198,376 | 19.6 |
| | 不動産業 | 26,215 | 2.6 | 28,411 | 2.8 | 26,252 | 2.6 |
| | 各種サービス | 125,822 | 12.5 | 121,922 | 12.0 | 127,079 | 12.6 |
| | 地方公共団体 | 312 | 0.0 | 128 | 0.0 | 220 | 0.0 |
| 個人(住宅・消費・納税資金等) | 102,256 | 10.1 | 81,231 | 8.0 | 97,213 | 9.6 | |
| 合 計 | 931,202 | 92.4 | 946,813 | 93.3 | 932,933 | 92.4 | |
| 海外向け | 政府等 | - | - | - | - | - | - |
| | 金融機関 | - | - | - | - | - | - |
| | 商工業(等) | 77,000 | 7.6 | 68,000 | 6.7 | 77,000 | 7.6 |
| | 合 計 | 77,000 | 7.6 | 68,000 | 6.7 | 77,000 | 7.6 |
| 総 合 計 | | 1,008,202 | 100.0 | 1,014,813 | 100.0 | 1,009,933 | 100.0 |

(オ)貸付金国内地域別内訳(一般勘定)

| 区 分 | 平成18年度上半期末 | | 平成19年度上半期末 | | (単位:百万円、%) 平成18年度末 | |
|-------|------------|-------|------------|-------|-----------------------|-------|
| | 金 額 | 占 率 | 金 額 | 占 率 | 金 額 | 占 率 |
| 北 海 道 | 5,138 | 0.6 | 5,633 | 0.7 | 5,743 | 0.7 |
| 東 北 | 11,935 | 1.4 | 12,183 | 1.4 | 12,271 | 1.5 |
| 関 東 | 592,151 | 71.4 | 646,363 | 74.6 | 601,392 | 71.9 |
| 中 部 | 32,955 | 4.0 | 28,397 | 3.3 | 32,524 | 3.9 |
| 近 畿 | 164,805 | 19.9 | 152,557 | 17.6 | 160,446 | 19.2 |
| 中 国 | 6,377 | 0.8 | 6,015 | 0.7 | 6,195 | 0.7 |
| 四 国 | 4,081 | 0.5 | 2,805 | 0.3 | 3,928 | 0.5 |
| 九 州 | 12,008 | 1.4 | 12,068 | 1.4 | 13,698 | 1.6 |
| 合 計 | 829,453 | 100.0 | 866,025 | 100.0 | 836,199 | 100.0 |

(注) 1. 個人ローン、非居住者貸付、保険約款貸付等を含みません。

2. 地域区分は、貸付先の本社所在地によります。

(カ)貸付金担保別内訳(一般勘定)

| 区 分 | 平成18年度上半期末 | | 平成19年度上半期末 | | (単位:百万円、%) 平成18年度末 | |
|---------------|------------|-------|------------|-------|-----------------------|-------|
| | 金 額 | 占 率 | 金 額 | 占 率 | 金 額 | 占 率 |
| 担保貸付 | 45,979 | 4.6 | 37,232 | 3.7 | 40,813 | 4.0 |
| 有価証券担保貸付 | 7,062 | 0.7 | 6,900 | 0.7 | 7,090 | 0.7 |
| 不動産・動産・財団担保貸付 | 31,467 | 3.1 | 24,966 | 2.5 | 28,294 | 2.8 |
| 指名債権担保貸付 | 7,449 | 0.7 | 5,366 | 0.5 | 5,428 | 0.5 |
| 保証貸付 | 12,869 | 1.3 | 12,610 | 1.2 | 12,679 | 1.3 |
| 信用貸付 | 847,605 | 84.1 | 884,182 | 87.1 | 859,706 | 85.1 |
| その他 | 101,748 | 10.1 | 80,787 | 8.0 | 96,734 | 9.6 |
| 一般貸付計 | 1,008,202 | 100.0 | 1,014,813 | 100.0 | 1,009,933 | 100.0 |
| うち劣後特約付貸付 | 90,000 | 8.9 | 120,500 | 11.9 | 75,000 | 7.4 |

3. 海外投融資関係

(ア) 資産別明細(一般勘定)

(a) 外貨建資産

(単位:百万円、%)

| 区 分 | 平成18年度上半期末 | | 平成19年度上半期末 | | 平成18年度末 | |
|---------|------------|------|------------|------|---------|------|
| | 金額 | 占率 | 金額 | 占率 | 金額 | 占率 |
| 公社債 | 423,609 | 44.4 | 535,376 | 52.1 | 441,658 | 44.4 |
| 株式 | 56 | 0.0 | 38 | 0.0 | 36 | 0.0 |
| 現預金・その他 | 47,766 | 5.0 | 33,770 | 3.3 | 30,883 | 3.1 |
| 小 計 | 471,433 | 49.4 | 569,186 | 55.4 | 472,578 | 47.5 |

(b) 円貨額が確定した外貨建資産

(単位:百万円、%)

| 区 分 | 平成18年度上半期末 | | 平成19年度上半期末 | | 平成18年度末 | |
|---------|------------|----|------------|----|---------|----|
| | 金額 | 占率 | 金額 | 占率 | 金額 | 占率 |
| 公社債 | - | - | - | - | - | - |
| 現預金・その他 | - | - | - | - | - | - |
| 小 計 | - | - | - | - | - | - |

(c) 円貨建資産

(単位:百万円、%)

| 区 分 | 平成18年度上半期末 | | 平成19年度上半期末 | | 平成18年度末 | |
|---------------|------------|------|------------|------|---------|------|
| | 金額 | 占率 | 金額 | 占率 | 金額 | 占率 |
| 非居住者貸付 | 77,000 | 8.1 | 68,000 | 6.6 | 77,000 | 7.7 |
| 公社債(円建外債)・その他 | 406,561 | 42.6 | 390,990 | 38.0 | 446,092 | 44.8 |
| 小 計 | 483,561 | 50.6 | 458,990 | 44.6 | 523,092 | 52.5 |

(d) 合計

(単位:百万円、%)

| 区 分 | 平成18年度上半期末 | | 平成19年度上半期末 | | 平成18年度末 | |
|---------|------------|-------|------------|-------|---------|-------|
| | 金額 | 占率 | 金額 | 占率 | 金額 | 占率 |
| 海外投融資 | 954,995 | 100.0 | 1,028,176 | 100.0 | 995,670 | 100.0 |
| うち海外不動産 | - | - | - | - | - | - |

(注) 「円貨額が確定した外貨建資産」は、為替予約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。

(イ)海外投融資の地域別構成(一般勘定)

(単位:百万円、%)

| 区分 | 平成18年度上半期末 | | | | | | | | | |
|-------|------------|-------|---------|------|---------|------|--------|-------|--------|--|
| | 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 | 430,923 | 49.4 | 430,889 | 49.4 | 33 | 0.0 | - | - | | |
| ヨーロッパ | 136,955 | 15.7 | 136,511 | 15.7 | 444 | 0.1 | 25,000 | 32.5 | | |
| オセアニア | - | - | - | - | - | - | - | - | | |
| アジア | 3,405 | 0.4 | 3,000 | 0.3 | 405 | 0.0 | - | - | | |
| 中南米 | 294,631 | 33.8 | 171,721 | 19.7 | 122,910 | 14.1 | 52,000 | 67.5 | | |
| 中東 | - | - | - | - | - | - | - | - | | |
| アフリカ | - | - | - | - | - | - | - | - | | |
| 国際機関 | 6,292 | 0.7 | 6,292 | 0.7 | - | - | - | - | | |
| 合計 | 872,208 | 100.0 | 748,415 | 85.8 | 123,793 | 14.2 | 77,000 | 100.0 | | |

(単位:百万円、%)

| 区分 | 平成19年度上半期末 | | | | | | | | | |
|-------|------------|-------|---------|------|---------|------|--------|-------|--------|--|
| | 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 | 543,981 | 57.2 | 543,947 | 57.2 | 33 | 0.0 | - | - | | |
| ヨーロッパ | 182,516 | 19.2 | 181,714 | 19.1 | 801 | 0.1 | 25,000 | 36.8 | | |
| オセアニア | - | - | - | - | - | - | - | - | | |
| アジア | 3,384 | 0.4 | 3,000 | 0.3 | 384 | 0.0 | - | - | | |
| 中南米 | 221,353 | 23.3 | 96,223 | 10.1 | 125,130 | 13.2 | 43,000 | 63.2 | | |
| 中東 | - | - | - | - | - | - | - | - | | |
| アフリカ | - | - | - | - | - | - | - | - | | |
| 国際機関 | - | - | - | - | - | - | - | - | | |
| 合計 | 951,235 | 100.0 | 824,885 | 86.7 | 126,349 | 13.3 | 68,000 | 100.0 | | |

(単位:百万円、%)

| 区分 | 平成18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 | 460,034 | 50.4 | 460,005 | 50.4 | 28 | 0.0 | - | - | | |
| ヨーロッパ | 158,493 | 17.4 | 158,041 | 17.3 | 452 | 0.0 | 25,000 | 32.5 | | |
| オセアニア | - | - | - | - | - | - | - | - | | |
| アジア | 3,292 | 0.4 | 3,000 | 0.3 | 292 | 0.0 | - | - | | |
| 中南米 | 290,213 | 31.8 | 168,975 | 18.5 | 121,238 | 13.3 | 52,000 | 67.5 | | |
| 中東 | - | - | - | - | - | - | - | - | | |
| アフリカ | - | - | - | - | - | - | - | - | | |
| 国際機関 | - | - | - | - | - | - | - | - | | |
| 合計 | 912,034 | 100.0 | 790,022 | 86.6 | 122,011 | 13.4 | 77,000 | 100.0 | | |

(注)外国証券は発行国、非居住者貸付は債務者の居住地により区分しています。

(ウ)外貨建資産の通貨別構成(一般勘定)

(単位:百万円、%)

| 区分 | 平成18年度上半期末 | | 平成19年度上半期末 | | 平成18年度末 | |
|-----|------------|-------|------------|-------|---------|-------|
| | 金額 | 占率 | 金額 | 占率 | 金額 | 占率 |
| 米ドル | 413,305 | 87.7 | 491,893 | 86.4 | 420,469 | 89.0 |
| ユーロ | 58,105 | 12.3 | 77,267 | 13.6 | 52,085 | 11.0 |
| その他 | 22 | 0.0 | 25 | 0.0 | 23 | 0.0 |
| 合計 | 471,433 | 100.0 | 569,186 | 100.0 | 472,578 | 100.0 |

Ⅱ. 特別勘定

1. 個人変額保険(特別勘定)の状況

(ア) 有価証券の時価情報

① 売買目的有価証券の評価損益

| 区 分 | 平成18年度上半期末 | | 平成19年度上半期末 | | 平成18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 | 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 | 42,519 | △1,768 | 42,182 | △2,327 | 43,377 | △927 |

(単位:百万円)

(注) 「当期の損益に含まれた評価損益」には振戻損益を含めております。

② 有価証券の明細

| 区 分 | 平成18年度上半期末 | 平成19年度上半期末 | 平成18年度末 |
|--------|------------|------------|----------|
| | 貸借対照表計上額 | 貸借対照表計上額 | 貸借対照表計上額 |
| 公社債 | 11,130 | 11,130 | 9,839 |
| 株式 | 16,188 | 17,170 | 18,965 |
| 外国証券 | 15,201 | 13,881 | 14,572 |
| 公社債 | 6,847 | 4,407 | 5,023 |
| 株式等 | 8,353 | 9,474 | 9,548 |
| その他の証券 | - | - | - |
| 合計 | 42,519 | 42,182 | 43,377 |

(単位:百万円)

(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うことが適当と認められるものを含んでいます。

(イ) デリバティブ取引の時価情報

① 金利関連

平成18年度上半期末、平成19年度上半期末、平成18年度末とも保有していません。

② 通貨関連

平成18年度上半期末、平成19年度上半期末、平成18年度末とも保有していません。

③ 株式関連

平成18年度上半期末、平成19年度上半期末、平成18年度末とも保有していません。

④ 債券関連

平成18年度上半期末、平成19年度上半期末、平成18年度末とも保有していません。

2. 個人変額年金保険(特別勘定)の状況

個人変額年金保険については、実績はありません。

Ⅲ. 全社計

1. 資産構成

(一般勘定・特別勘定の資産構成)

(単位:百万円)

| 区 分 | 平成19年度上半期末 | | |
|------------|------------|--------|-----------|
| | 一般勘定 | 特別勘定 | 計 |
| 現預金・コールローン | 222,098 | 1,562 | 223,661 |
| 金銭の信託 | 10 | - | 10 |
| 公社債 | 2,084,935 | 11,815 | 2,096,750 |
| 株式 | 675,887 | 18,129 | 694,016 |
| 外国証券 | 951,235 | 14,340 | 965,576 |
| 貸付金 | 1,190,607 | - | 1,190,607 |
| 不動産 | 548,680 | - | 548,680 |
| 資産計 | 6,160,068 | 47,123 | 6,206,137 |
| うち外貨建資産 | 568,024 | 14,446 | 582,470 |

2.有価証券等の時価情報(全社計)

(ア)有価証券の時価情報(全社計)

①売買目的有価証券の評価損益(全社計)

(単位:百万円)

| 区 分 | 平成18年度上半期末 | | 平成19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 | 44,584 | △2,029 | 44,285 | △2,404 |

| 区 分 | 平成18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 |
| 売買目的有価証券 | 45,484 | △1,164 |

(注) 1.本表には、「金銭の信託」等の売買目的有価証券を含みます。

2.「当期の損益に含まれた評価損益」には振戻損益を含みます。

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)(全社計)

(単位:百万円)

| 区 分 | 平成18年度上半期末 | | | | | 平成19年度上半期末 | | | | |
|------------|------------|-----------|---------|---------|---------|------------|-----------|---------|---------|---------|
| | 帳簿価額 | 時価 | 差 損 益 | | | 帳簿価額 | 時価 | 差 損 益 | | |
| | | | うち差益 | うち差損 | | | | うち差益 | うち差損 | |
| 満期保有目的の債券 | 437,738 | 442,314 | 4,575 | 7,328 | △2,753 | 438,518 | 442,040 | 3,522 | 6,208 | △2,686 |
| 責任準備金対応債券 | 1,645,331 | 1,626,133 | △19,198 | 3,341 | △22,539 | 1,620,004 | 1,610,432 | △9,571 | 6,211 | △15,783 |
| 子会社・関連会社株式 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| その他有価証券 | 1,739,052 | 1,923,541 | 184,489 | 231,740 | △47,251 | 1,791,626 | 1,933,305 | 141,679 | 205,410 | △63,731 |
| 公社債 | 407,055 | 409,770 | 2,715 | 4,393 | △1,677 | 365,901 | 372,330 | 6,429 | 6,580 | △150 |
| 株式 | 540,149 | 720,026 | 179,877 | 209,143 | △29,265 | 516,912 | 651,512 | 134,599 | 175,790 | △41,190 |
| 外国証券 | 524,278 | 529,494 | 5,216 | 12,479 | △7,263 | 643,382 | 657,405 | 14,022 | 18,320 | △4,298 |
| 公社債 | 426,954 | 431,856 | 4,901 | 9,471 | △4,569 | 563,232 | 572,044 | 8,812 | 12,699 | △3,886 |
| 株式等 | 97,323 | 97,637 | 314 | 3,007 | △2,693 | 80,150 | 85,360 | 5,210 | 5,621 | △411 |
| その他の証券 | 257,518 | 253,950 | △3,568 | 5,475 | △9,044 | 255,378 | 241,773 | △13,605 | 4,486 | △18,092 |
| 買入金銭債権 | 10,050 | 10,299 | 248 | 249 | △0 | 10,050 | 10,283 | 233 | 233 | - |
| 譲渡性預金 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| その他 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 合 計 | 3,822,122 | 3,991,989 | 169,866 | 242,410 | △72,544 | 3,850,148 | 3,985,778 | 135,629 | 217,830 | △82,201 |
| 公社債 | 2,114,229 | 2,098,155 | △16,073 | 8,032 | △24,105 | 2,078,505 | 2,077,439 | △1,065 | 13,085 | △14,151 |
| 株式 | 540,149 | 720,026 | 179,877 | 209,143 | △29,265 | 516,912 | 651,512 | 134,599 | 175,790 | △41,190 |
| 外国証券 | 840,836 | 851,119 | 10,282 | 19,330 | △9,047 | 896,223 | 911,890 | 15,666 | 23,585 | △7,918 |
| 公社債 | 743,513 | 753,481 | 9,967 | 16,322 | △6,354 | 816,072 | 826,529 | 10,456 | 17,963 | △7,507 |
| 株式等 | 97,323 | 97,637 | 314 | 3,007 | △2,693 | 80,150 | 85,360 | 5,210 | 5,621 | △411 |
| その他の証券 | 257,518 | 253,950 | △3,568 | 5,475 | △9,044 | 255,378 | 241,773 | △13,605 | 4,486 | △18,092 |
| 買入金銭債権 | 69,388 | 68,737 | △651 | 429 | △1,080 | 103,128 | 103,162 | 34 | 883 | △848 |
| 譲渡性預金 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| その他 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |

(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うことが適当と認められるものを含んでいます。

(単位:百万円)

| 区 分 | 平成18年度末 | | | | |
|------------|-----------|-----------|---------|---------|---------|
| | 帳簿価額 | 時価 | 差 損 益 | | |
| | | | うち差益 | うち差損 | |
| 満期保有目的の債券 | 559,415 | 565,018 | 5,603 | 7,651 | △2,047 |
| 責任準備金対応債券 | 1,687,418 | 1,679,524 | △7,894 | 7,236 | △15,130 |
| 子会社・関連会社株式 | - | - | - | - | - |
| その他有価証券 | 1,673,168 | 1,889,772 | 216,604 | 238,348 | △21,744 |
| 公社債 | 437,035 | 440,842 | 3,807 | 4,939 | △1,132 |
| 株式 | 531,208 | 725,937 | 194,729 | 212,705 | △17,975 |
| 外国証券 | 540,102 | 553,186 | 13,084 | 15,512 | △2,428 |
| 公社債 | 456,524 | 467,148 | 10,624 | 12,359 | △1,735 |
| 株式等 | 83,577 | 86,038 | 2,460 | 3,152 | △692 |
| その他の証券 | 154,771 | 159,334 | 4,562 | 4,770 | △207 |
| 買入金銭債権 | 10,050 | 10,471 | 420 | 421 | △0 |
| 譲渡性預金 | - | - | - | - | - |
| その他 | - | - | - | - | - |
| 合 計 | 3,920,001 | 4,134,315 | 214,313 | 253,236 | △38,922 |
| 公社債 | 2,285,521 | 2,282,368 | △3,153 | 12,569 | △15,722 |
| 株式 | 531,208 | 725,937 | 194,729 | 212,705 | △17,975 |
| 外国証券 | 862,976 | 881,200 | 18,223 | 22,327 | △4,104 |
| 公社債 | 779,398 | 795,162 | 15,763 | 19,175 | △3,411 |
| 株式等 | 83,577 | 86,038 | 2,460 | 3,152 | △692 |
| その他の証券 | 154,771 | 159,334 | 4,562 | 4,770 | △207 |
| 買入金銭債権 | 85,523 | 85,474 | △48 | 863 | △911 |
| 譲渡性預金 | - | - | - | - | - |
| その他 | - | - | - | - | - |

(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う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とおりです。

| 区 分 | 平成18年度上半期末 | 平成19年度上半期末 |
|--------------------|------------|------------|
| 満期保有目的の債券 | - | - |
| 非上場外国債券 | - | - |
| その他 | - | - |
| 責任準備金対応債券 | - | - |
| 子会社・関連会社株式 | 5,461 | 5,461 |
| その他有価証券 | 45,756 | 59,903 |
| 非上場国内株式(店頭売買株式を除く) | 19,597 | 18,913 |
| 非上場外国株式(店頭売買株式を除く) | 16,659 | 31,490 |
| 非上場外国債券 | - | - |
| その他 | 9,500 | 9,500 |
| 合 計 | 51,217 | 65,365 |

(単位:百万円)

| 平成18年度末 |
|---------|
| - |
| - |
| - |
| - |
| 5,461 |
| 55,081 |
| 19,107 |
| 26,474 |
| - |
| 9,500 |
| 60,543 |

<参考> 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)から除いた時価のない有価証券のうち、理論価格等により時価相当額の算出が可能な有価証券を加えた時価情報は次の通りです。

(単位:百万円)

| 区 分 | 平成18年度上半期末 | | | | | 平成19年度上半期末 | | | | |
|------------|------------|-----------|---------|---------|---------|------------|-----------|---------|---------|---------|
| | 帳簿価額 | 時価 | 差 損 益 | | | 帳簿価額 | 時価 | 差 損 益 | | |
| | | | うち差益 | うち差損 | うち差益 | | | うち差損 | | |
| 満期保有目的の債券 | 437,738 | 442,314 | 4,575 | 7,328 | △2,753 | 438,518 | 442,040 | 3,522 | 6,208 | △2,686 |
| 責任準備金対応債券 | 1,645,331 | 1,626,133 | △19,198 | 3,341 | △22,539 | 1,620,004 | 1,610,432 | △9,571 | 6,211 | △15,783 |
| 子会社・関連会社株式 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| その他有価証券 | 1,765,211 | 1,949,697 | 184,485 | 231,740 | △47,254 | 1,832,616 | 1,974,295 | 141,678 | 205,410 | △63,732 |
| 公社債 | 407,055 | 409,770 | 2,715 | 4,393 | △1,677 | 365,901 | 372,330 | 6,429 | 6,580 | △150 |
| 株式 | 540,149 | 720,026 | 179,877 | 209,143 | △29,265 | 516,912 | 651,512 | 134,599 | 175,790 | △41,190 |
| 外国証券 | 550,437 | 555,650 | 5,212 | 12,479 | △7,266 | 684,372 | 698,394 | 14,021 | 18,320 | △4,299 |
| 公社債 | 426,954 | 431,856 | 4,901 | 9,471 | △4,569 | 563,232 | 572,044 | 8,812 | 12,699 | △3,886 |
| 株式等 | 123,482 | 123,793 | 311 | 3,007 | △2,696 | 121,140 | 126,349 | 5,209 | 5,621 | △412 |
| その他の証券 | 257,518 | 253,950 | △3,568 | 5,475 | △9,044 | 255,378 | 241,773 | △13,605 | 4,486 | △18,092 |
| 買入金銭債権 | 10,050 | 10,299 | 248 | 249 | △0 | 10,050 | 10,283 | 233 | 233 | - |
| 譲渡性預金 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| その他 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 合 計 | 3,848,281 | 4,018,145 | 169,863 | 242,410 | △72,547 | 3,891,139 | 4,026,768 | 135,628 | 217,830 | △82,201 |
| 公社債 | 2,114,229 | 2,098,155 | △16,073 | 8,032 | △24,105 | 2,078,505 | 2,077,439 | △1,065 | 13,085 | △14,151 |
| 株式 | 540,149 | 720,026 | 179,877 | 209,143 | △29,265 | 516,912 | 651,512 | 134,599 | 175,790 | △41,190 |
| 外国証券 | 866,996 | 877,275 | 10,278 | 19,330 | △9,051 | 937,213 | 952,879 | 15,666 | 23,585 | △7,919 |
| 公社債 | 743,513 | 753,481 | 9,967 | 16,322 | △6,354 | 816,072 | 826,529 | 10,456 | 17,963 | △7,507 |
| 株式等 | 123,482 | 123,793 | 311 | 3,007 | △2,696 | 121,140 | 126,349 | 5,209 | 5,621 | △412 |
| その他の証券 | 257,518 | 253,950 | △3,568 | 5,475 | △9,044 | 255,378 | 241,773 | △13,605 | 4,486 | △18,092 |
| 買入金銭債権 | 69,388 | 68,737 | △651 | 429 | △1,080 | 103,128 | 103,162 | 34 | 883 | △848 |
| 譲渡性預金 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| その他 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |

(単位:百万円)

| 区 分 | 平成18年度末 | | | | |
|------------|-----------|-----------|---------|---------|---------|
| | 帳簿価額 | 時価 | 差 損 益 | | |
| | | | うち差益 | うち差損 | うち差損 |
| 満期保有目的の債券 | 559,415 | 565,018 | 5,603 | 7,651 | △2,047 |
| 責任準備金対応債券 | 1,687,418 | 1,679,524 | △7,894 | 7,236 | △15,130 |
| 子会社・関連会社株式 | - | - | - | - | - |
| その他有価証券 | 1,709,142 | 1,925,746 | 216,603 | 238,348 | △21,744 |
| 公社債 | 437,035 | 440,842 | 3,807 | 4,939 | △1,132 |
| 株式 | 531,208 | 725,937 | 194,729 | 212,705 | △17,975 |
| 外国証券 | 576,076 | 589,159 | 13,083 | 15,512 | △2,428 |
| 公社債 | 456,524 | 467,148 | 10,624 | 12,359 | △1,735 |
| 株式等 | 119,552 | 122,011 | 2,459 | 3,152 | △693 |
| その他の証券 | 154,771 | 159,334 | 4,562 | 4,770 | △207 |
| 買入金銭債権 | 10,050 | 10,471 | 420 | 421 | △0 |
| 譲渡性預金 | - | - | - | - | - |
| その他 | - | - | - | - | - |
| 合 計 | 3,955,975 | 4,170,288 | 214,313 | 253,236 | △38,923 |
| 公社債 | 2,285,521 | 2,282,368 | △3,153 | 12,569 | △15,722 |
| 株式 | 531,208 | 725,937 | 194,729 | 212,705 | △17,975 |
| 外国証券 | 898,950 | 917,173 | 18,222 | 22,327 | △4,105 |
| 公社債 | 779,398 | 795,162 | 15,763 | 19,175 | △3,411 |
| 株式等 | 119,552 | 122,011 | 2,459 | 3,152 | △693 |
| その他の証券 | 154,771 | 159,334 | 4,562 | 4,770 | △207 |
| 買入金銭債権 | 85,523 | 85,474 | △48 | 863 | △911 |
| 譲渡性預金 | - | - | - | - | - |
| その他 | - | - | - | - | - |

(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うことが適当と認められるものを含んでいます。

<参考>金銭の信託の時価情報(全社計)

(単位:百万円)

| 区 分 | 平成18年度上半期末 | | | | | 平成19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 | | |
| | | | | うち差益 | うち差損 | | | | うち差益 | うち差損 |
| 金銭の信託 | 15 | 15 | - | - | - | 10 | 10 | - | - | - |

| 区 分 | 平成18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 | 10 | 10 | - | - | - |

(イ) デリバティブ取引の運用状況

(1) 取引の内容

当社が利用している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
- ・通貨関連:為替先物予約取引、通貨オプション取引
- ・株式関連:株価指数先物取引、株価指数オプション取引、個別株オプション取引
- ・債券関連:債券先物取引、債券オプション取引

(2) 取組方針

当社では、保有している有価証券、貸付等の資産について、これらの資産が持つ価格変動リスク、金利変動リスク等を回避(ヘッジ)することを主目的に、現物資産の運用を補完するものと位置づけてデリバティブ取引を活用しています。なお、ヘッジ会計適用の要件を満たすデリバティブ取引はヘッジ会計を適用しています。

(3) 利用目的

「金利スワップ取引」は、貸付金の金利変動リスクを回避する目的で行っています。

「為替先物予約取引」「通貨オプション取引」は、外国証券の買入等に備える目的で行っているほか、外国証券の償還・売却・利息、配当金の受取等、今後発生が見込まれる外国通貨の受取に際し、為替リスクを回避することを主目的として行っています。

株式関連および債券関連のデリバティブ取引は、現物資産購入の際の補完的手段、および保有資産の価格変動リスク回避を主目的として行っています。

(4) リスクの内容

金利スワップ取引には、金利が変動した場合に受取、支払額が変動することに伴う金利リスクがあります。為替先物予約取引、通貨オプション取引、株価指数先物取引、株価指数オプション取引、個別株オプション取引、債券先物取引、債券オプション取引については、為替、株価、債券価格の変動に伴い損益が発生するリスク(為替リスク、価格変動リスク)があります。当社は、主に現物資産の運用を補完するものと位置づけ、これらの取引を活用していることから、金利リスク、為替リスク、価格変動リスクは相当程度減殺されています。なお、デリバティブ取引には信用リスク(契約が履行されないリスク)がありますが、当社は取引所もしくは信用度の高い契約先を通じた取引を行うことで、信用リスクの抑制に努めています。

(5) リスク管理体制

当社では、デリバティブ取引の目的や種類毎に取引限度額等を規定するとともに、独立したリスク管理部門のチェックを通じて投融資執行部門への牽制が働く体制をとっています。デリバティブ取引に係るリスクにつきましては、現物資産に係るリスクと併せて管理の徹底を図っています。リスク管理部門においては、全てのデリバティブ取引についてのポジションおよび損益を管理しているほか、運用ルールの遵守についてのチェック、把握・分析したリスク量の経営層への報告等を通して、厳正なリスク管理を行っています。

(ウ)デリバティブ取引の時価情報(全社計)

①差損益の内訳(ヘッジ会計適用分・非適用分の内訳)(全社計)

(単位:百万円)

| 平成18年度上半期末 | 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 | 58 | △1,117 | - | - | - | △1,058 |
| ヘッジ会計非適用分 | 225 | - | - | △221 | - | 3 |
| 合計 | 283 | △1,117 | - | △221 | - | △1,055 |

(注)平成18年度上半期について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△1,117百万円)および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。

(単位:百万円)

| 平成19年度上半期末 | 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 | △2 | - | - | - | - | △2 |
| ヘッジ会計非適用分 | - | △2 | - | - | - | △2 |
| 合計 | △2 | △2 | - | - | - | △5 |

(注)平成19年度上半期について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。

(単位:百万円)

| 平成18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 | 19 | - | - | - | - | 19 |
| ヘッジ会計非適用分 | 36 | - | - | - | - | 36 |
| 合計 | 55 | - | - | - | - | 55 |

(注)平成18年度について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(全社計)

(単位:百万円)

| 区分 | 種類 | 平成18年度上半期末 | | | | 平成19年度上半期末 | | | | 平成18年度末 | | | |
|-------|-------------------|------------|--------|-----|-----|------------|--------|----|-----|---------|--------|----|-----|
| | | 契約額等 | | 時価 | 差損益 | 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 | | | | うち1年超 | | | | うち1年超 | | | |
| 店頭 | 金利先渡契約 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| | 売建 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| | 買建 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| | 金利オプション | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| | 売建 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| | コール | (-) | - | - | - | (-) | - | - | - | (-) | - | - | - |
| | プット | (-) | - | - | - | (-) | - | - | - | (-) | - | - | - |
| | 買建 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| | コール | (-) | - | - | - | (-) | - | - | - | (-) | - | - | - |
| | プット | (-) | - | - | - | (-) | - | - | - | (-) | - | - | - |
| | 金利スワップ | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| | 固定金利受取 /変動金利支払 | 66,315 | 42,045 | 269 | 269 | 43,645 | 37,560 | △2 | △2 | 57,145 | 38,145 | 52 | 52 |
| | 固定金利支払 /変動金利受取 | 5,000 | - | 14 | 14 | - | - | - | - | 5,000 | - | 3 | 3 |
| | 変動金利受取 /変動金利支払 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| | その他 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 売建 | (-) | - | - | - | (-) | - | - | - | (-) | - | - | - | |
| 買建 | (-) | - | - | - | (-) | - | - | - | (-) | - | - | - | |
| 合計 | (-) | - | - | 283 | (-) | - | - | △2 | (-) | - | - | 55 | |

(注)・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。
・スワップ取引の差損益欄には時価を記載しています。

平成19年度上半期末 金利スワップ残存期間別残高

(単位:百万円、%)

| | 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 | 合計 |
|---------------|-------|-------------|-------------|-------------|--------------|------|--------|
| 受取側固定スワップ想定元本 | 6,085 | 12,860 | 13,100 | 10,600 | 1,000 | - | 43,645 |
| 平均受取固定金利 | 0.49 | 0.78 | 1.51 | 1.63 | 1.30 | - | 1.17 |
| 平均支払変動金利 | 0.89 | 0.88 | 0.71 | 0.84 | 0.82 | - | 0.82 |
| 支払側固定スワップ想定元本 | - | - | - | - | - | - | - |
| 平均支払固定金利 | - | - | - | - | - | - | - |
| 平均受取変動金利 | - | - | - | - | - | - | - |
| 合計 | 6,085 | 12,860 | 13,100 | 10,600 | 1,000 | - | 43,645 |

③通貨関連（全社計）

（単位：百万円）

| 区分 | 種類 | 平成18年度上半期末 | | | 平成19年度上半期末 | | | 平成18年度末 | | | | | |
|----|------------------|------------|---|--------|------------|-------|---|---------|-----|-------|---|----|-----|
| | | 契約額等 | | 時価 | 差損益 | 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 | | | | うち1年超 | | | |
| 店頭 | 通貨先渡契約 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | |
| | 売建 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | |
| | 買建 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | |
| | 為替予約 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | |
| | 売建 | 31,732 | - | 32,850 | △1,117 | 1,159 | - | 1,162 | △2 | - | - | - | |
| | うち米 ^F | 31,732 | - | 32,850 | △1,117 | 1,159 | - | 1,162 | △2 | - | - | - | |
| | うちユーロ | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | |
| | 買建 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | |
| | うち米 ^F | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | |
| | うちユーロ | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | |
| | 通貨オプション | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | |
| | 売建 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | |
| | コール | (-) | - | - | - | (-) | - | - | - | (-) | - | - | |
| | プット | (-) | - | - | - | (-) | - | - | - | (-) | - | - | |
| | 買建 | (-) | - | - | - | (-) | - | - | - | (-) | - | - | |
| | コール | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | |
| | プット | (-) | - | - | - | (-) | - | - | - | (-) | - | - | |
| | 通貨スワップ | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | |
| | その他 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | |
| | 売建 | (-) | - | - | - | (-) | - | - | - | (-) | - | - | |
| | 買建 | (-) | - | - | - | (-) | - | - | - | (-) | - | - | |
| | 合計 | | | | △1,117 | | | | △2 | | | | - |

（注）・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。

・時価の算定には、期末日のTTM、WMロイターレート、割引レート等を基準として、当社で算出した理論価格を使用しています。

・外貨建金銭債権債務等が為替予約が付されていることにより、決済時における円貨額が確定している外貨建金銭債権債務等で、貸借対照表において当該円貨額で表示されているものについては、開示対象より除いています。

④株式関連（全社計）

平成18年度上半期末、平成19年度上半期末、平成18年度末とも保有していません。

⑤債券関連（全社計）

（単位：百万円）

| 区分 | 種類 | 平成18年度上半期末 | | | 平成19年度上半期末 | | | 平成18年度末 | | | | | |
|-----|-----------|------------|---|--------|------------|-------|---|---------|-----|-------|---|----|-----|
| | | 契約額等 | | 時価 | 差損益 | 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 | | | | うち1年超 | | | |
| 取引所 | 債券先物 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | |
| | 売建 | 40,218 | - | 40,440 | △221 | - | - | - | - | - | - | - | |
| | 買建 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | |
| | 債券先物オプション | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | |
| | 売建 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | |
| | コール | (-) | - | - | - | (-) | - | - | - | (-) | - | - | |
| | プット | (-) | - | - | - | (-) | - | - | - | (-) | - | - | |
| | 買建 | (-) | - | - | - | (-) | - | - | - | (-) | - | - | |
| | コール | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | |
| | プット | (-) | - | - | - | (-) | - | - | - | (-) | - | - | |
| 合計 | | | | △221 | | | | - | | | | - | |

（注）・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。

IV. 貸倒引当金残高の内訳

(単位:百万円)

| 区分 | 平成19年度上半期末 | 平成18年度末 | 比較 |
|------------|------------|---------|------|
| 貸倒引当金 | 1,029 | 1,129 | △ 99 |
| 一般貸倒引当金 | 175 | 216 | △ 40 |
| 個別貸倒引当金 | 853 | 912 | △ 59 |
| 特定海外債権引当勘定 | - | - | - |

V. 個人保険および個人年金保険の責任準備金積立状況

| | | 平成18年度上半期末 | 平成19年度上半期末 | 平成18年度末 |
|---------------|------------------|-------------------------|------------|---------|
| 積立方式 | 標準責任準備金 対象契約 | 平成8年大蔵省告示 第48号の定める方式 | 同 左 | 同 左 |
| | 標準責任準備金 対象外契約 | 平準純保険料式 | 同 左 | 同 左 |
| 積立率(危険準備金を除く) | | 100.0% | 100.0% | 100.0% |

(注) 1. 積立方式および積立率は、個人保険および個人年金保険を対象としております。

なお、団体保険および団体年金保険の責任準備金は積立方式という概念がないため、上記には含んでおりません。

2. 積立率については、標準責任準備金対象契約に関しては、平成8年大蔵省告示第48号の定める方式により、また、標準責任準備金対象外契約に関しては、平準純保険料式により計算した保険料積立金、および未経過保険料に対する積立率を記載しております。