

平成 26 年 11 月 28 日

朝日生命保険相互会社

平成 26 年度第 2 四半期（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
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. 有価証券の時価情報	
(ア) 有価証券の時価情報	・ ・ ・ ・ 14
(イ) デリバティブ取引の運用状況	・ ・ ・ ・ 16
(ウ) デリバティブ取引の時価情報	・ ・ ・ ・ 17

IV. 貸倒引当金残高の内訳	・ ・ ・ ・ 20
----------------	------------

V. 個人保険および個人年金保険の責任準備金の積立状況	・ ・ ・ ・ 20
-----------------------------	------------

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25年度末		平成26年度 第2四半期（上半期）末	
	金額	占率	金額	占率
国債	2,382,132	58.8	2,219,550	54.1
地方債	74,827	1.8	68,972	1.7
社債	617,932	15.2	656,154	16.0
うち公社・公団債	265,037	6.5	288,876	7.0
株式	233,652	5.8	253,127	6.2
外国証券	680,922	16.8	838,897	20.4
公社債	466,198	11.5	617,511	15.1
株式等	214,723	5.3	221,385	5.4
その他の証券	64,416	1.6	65,598	1.6
合計	4,053,883	100.0	4,102,300	100.0

(イ) 有価証券残存期間別残高(一般勘定)

<平成25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 (期間の定めのないものを含む)	合計
有価証券	236,324	233,097	138,994	167,907	472,487	2,805,071	4,053,883
国債	56,497	31,159	44,475	37,316	299,935	1,912,747	2,382,132
地方債	32,691	9,408	7,098	7,998	1,608	16,021	74,827
社債	43,756	128,214	80,631	42,381	66,843	256,105	617,932
株式						233,652	233,652
外国証券	103,073	60,943	6,427	80,211	101,915	328,350	680,922
公社債	101,394	50,857	6,427	80,211	101,915	125,391	466,198
株式等	1,678	10,085	-	-	-	202,959	214,723
その他の証券	304	3,371	361	-	2,183	58,194	64,416
買入金銭債権	-	-	10,000	-	-	53,945	63,945
譲渡性預金	-	-	-	-	-	-	-
その他	-	-	-	-	-	-	-
合計	236,324	233,097	148,994	167,907	472,487	2,859,017	4,117,829

<平成26年度第2四半期(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 (期間の定めのないものを含む)	合計
有価証券	213,078	261,729	157,412	195,079	440,504	2,834,496	4,102,300
国債	14,437	27,203	62,385	26,465	224,066	1,864,992	2,219,550
地方債	32,688	3,512	7,441	7,006	2,307	16,016	68,972
社債	113,356	73,933	78,910	37,621	81,297	271,035	656,154
株式						253,127	253,127
外国証券	52,570	153,707	8,333	123,985	130,635	369,664	838,897
公社債	50,613	142,561	8,333	123,985	130,635	161,382	617,511
株式等	1,957	11,146	-	-	-	208,281	221,385
その他の証券	26	3,371	341	-	2,198	59,660	65,598
買入金銭債権	-	-	10,000	-	-	49,448	59,448
譲渡性預金	-	-	-	-	-	-	-
その他	-	-	-	-	-	-	-
合計	213,078	261,729	167,412	195,079	440,504	2,883,945	4,161,749

(ウ) 地域別地方債保有内訳(一般勘定)

(単位:百万円)

区分	平成25年度末	平成26年度 第2四半期(上半期)末
北海道	3,000	3,000
東北	-	-
関東	68,283	61,930
中部	3,544	4,042
近畿	-	-
中国	-	-
四国	-	-
九州	-	-
合計	74,827	68,972

(エ)業種別株式明細表(一般勘定)

(単位:百万円、%)

区 分		平成25年度末		平成26年度第2四半期(上半期)末	
		金 額	占 率	金 額	占 率
水 産 ・ 農 林 業		28	0.0	26	0.0
鉱 業		-	-	-	-
建 設 業		2,129	0.9	3,182	1.3
製 造 業	食 料 品	1,603	0.7	1,669	0.7
	織 維 製 品	10	0.0	10	0.0
	パ ル プ ・ 紙	85	0.0	79	0.0
	化 学	22,787	9.8	25,539	10.1
	医 薬 品	651	0.3	659	0.3
	石 油 ・ 石 炭 製 品	-	-	-	-
	ゴ ム 製 品	21,442	9.2	20,526	8.1
	ガ ラ ス ・ 土 石 製 品	141	0.1	144	0.1
	鉄 鋼	1,291	0.6	1,434	0.6
	非 鉄 金 属	9,640	4.1	10,842	4.3
	金 属 製 品	359	0.2	383	0.2
	機 械	4,906	2.1	5,832	2.3
	電 気 機 器	39,862	17.1	46,137	18.2
	輸 送 用 機 器	1,874	0.8	2,291	0.9
	精 密 機 器	5	0.0	4	0.0
そ の 他 製 品	3,047	1.3	4,549	1.8	
電 気 ・ ガ ス 業		338	0.1	338	0.1
運 輸 ・ 情 報 通 信 業	陸 運 業	35,517	15.2	36,254	14.3
	海 運 業	3	0.0	3	0.0
	空 運 業	-	-	-	-
	倉 庫 ・ 運 輸 関 連 業	1,979	0.8	2,086	0.8
	情 報 ・ 通 信 業	1,281	0.5	1,303	0.5
商 業	卸 売 業	30,326	13.0	33,320	13.2
	小 売 業	1,824	0.8	3,035	1.2
金 融 ・ 保 険 業	銀 行 業	38,079	16.3	38,767	15.3
	証 券 ・ 商 品 先 物 取 引 業	6,542	2.8	6,480	2.6
	保 険 業	197	0.1	197	0.1
	そ の 他 金 融 業	3,635	1.6	3,844	1.5
不 動 産 業		1,261	0.5	1,328	0.5
サ ー ビ ス 業		2,795	1.2	2,849	1.1
合 計		233,652	100.0	253,127	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25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	-	-	△3,535	-	-	-	△3,535
ヘッジ会計非適用分	-	-	△0	△15	-	-	△15
合計	-	-	△3,535	△15	-	-	△3,551

(注)平成25年度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△3,535百万円)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26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	-	-	△9,452	-	-	-	△9,452
ヘッジ会計非適用分	-	-	△677	△14	-	-	△692
合計	-	-	△10,129	△14	-	-	△10,144

(注)平成26年度第2四半期(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△9,452百万円)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。

②金利関連(一般勘定)

平成26年度第2四半期(上半期)末、平成25年度末とも保有していません。

③通貨関連(一般勘定)

(単位:百万円)

区分	種類	平成25年度末				平成26年度第2四半期(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	通貨先渡契約								
	売建	-	-	-	-	-	-	-	-
	買建	-	-	-	-	-	-	-	-
	為替予約								
	売建	254,882	-	△3,535	△3,535	488,734	-	△10,129	△10,129
	うち米ドル	157,284	-	△955	△955	296,344	-	△11,586	△11,586
	うち豪ドル	10,487	-	△280	△280	23,379	-	83	83
	うちユーロ	87,111	-	△2,299	△2,299	169,009	-	1,372	1,372
	買建	-	-	-	-	-	-	-	-
	うち米ドル	-	-	-	-	-	-	-	-
	うち豪ドル	-	-	-	-	-	-	-	-
	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	(-)	-	-	-	(-)	-	-	-	
					△3,535			△10,129	

(注)・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。
・為替予約の時価欄には差損益を記載しています。

④株式関連（一般勘定）

（単位：百万円）

区分	種類	平成25年度末				平成26年度第2四半期(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	先渡契約								
	売建	-	-	-	-	-	-	-	-
	買建	-	-	-	-	-	-	-	-
	オプション								
	売建								
	コール	-	-	-	-	-	-	-	-
	プット	(-)	-	-	-	(-)	-	-	-
	買建	-	-	-	-	-	-	-	-
	コール	-	-	-	-	-	-	-	-
	プット	50,000	-	-	-	50,000	-	0	△14
	(15)					(14)			
	その他								
売建	-	-	-	-	-	-	-	-	
買建	(-)	-	-	-	(-)	-	-	-	
買建	-	-	-	-	-	-	-	-	
買建	(-)	-	-	-	(-)	-	-	-	
合計									
					△15			△14	

（注）括弧内には、オプション料を記載しています。

⑤債券関連（一般勘定）

平成26年度第2四半期(上半期)末、平成25年度末とも保有していません。

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25年度末	平成26年度 第2四半期(上半期)末
保険約款貸付	90,151	85,154
契約者貸付	82,824	78,226
保険料振替貸付	7,326	6,928
一般貸付	625,236	649,518
(うち非居住者貸付)	(23,000)	(23,000)
企業貸付	617,112	642,406
(うち国内企業向け貸付)	(594,112)	(619,406)
国・国際機関・政府関係機関貸付	1,099	982
公共団体・公企業貸付	88	88
住宅ローン	970	884
消費者ローン	5,866	5,073
その他	98	82
合 計	715,387	734,673
うち劣後特約付貸付	86,228	66,249

(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 25 年度 末	変動金利	4,871	22,354	7,019	828	4	10,002	45,080
	固定金利	81,502	194,756	99,188	97,353	48,098	59,255	580,155
	一般貸付計	86,374	217,110	106,207	98,182	48,102	69,258	625,236
第 2 四 半 期 平 成 (26 年 上 半 期 末)	変動金利	20,957	4,988	8,905	1,055	3	10,001	45,912
	固定金利	103,264	177,838	110,608	72,224	72,090	67,578	603,605
	一般貸付計	124,222	182,826	119,513	73,280	72,094	77,580	649,518

(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25年度末		平成26年度 第2四半期（上半期）末	
			占 率		占 率
大 企 業	貸付先数	105	76.1	104	76.5
	金 額	533,474	89.8	555,064	89.6
中 堅 企 業	貸付先数	2	1.4	1	0.7
	金 額	2,850	0.5	675	0.1
中 小 企 業	貸付先数	31	22.5	31	22.8
	金 額	57,788	9.7	63,667	10.3
国内企業向け	貸付先数	138	100.0	136	100.0
貸 付 計	金 額	594,112	100.0	619,406	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25年度末		平成26年度 第2四半期(上半期)末		
		金額	占率	金額	占率	
国内向け	製造業	139,863	22.4	132,990	20.5	
	食料	2,620	0.4	2,590	0.4	
	繊維	6,000	1.0	6,000	0.9	
	木材・木製品	-	-	-	-	
	パルプ・紙	11,420	1.8	8,380	1.3	
	印刷	2,318	0.4	2,234	0.3	
	化学	15,401	2.5	12,893	2.0	
	石油・石炭	5,800	0.9	5,800	0.9	
	窯業・土石	306	0.0	391	0.1	
	鉄鋼	16,000	2.6	16,000	2.5	
	非鉄金属	40,884	6.5	39,734	6.1	
	金属製品	-	-	-	-	
	はん用・生産用・業務用機械	7,211	1.2	7,212	1.1	
	電気機械	20,520	3.3	20,513	3.2	
	輸送用機械	6,852	1.1	6,736	1.0	
	その他の製造業	4,530	0.7	4,505	0.7	
	農業、林業	-	-	-	-	
	漁業	-	-	-	-	
	鉱業、採石業、砂利採取業	-	-	-	-	
	建設業	5,454	0.9	4,752	0.7	
	電気・ガス・熱供給・水道業	25,678	4.1	25,386	3.9	
	情報通信業	8,950	1.4	10,950	1.7	
	運輸業、郵便業	63,647	10.2	64,000	9.9	
	卸売業	113,458	18.1	123,388	19.0	
	小売業	2,626	0.4	2,579	0.4	
	金融業、保険業	165,508	26.5	181,144	27.9	
	不動産業	21,707	3.5	21,126	3.3	
	物品賃貸業	37,793	6.0	44,512	6.9	
	学術研究、専門・技術サービス業	-	-	-	-	
	宿泊業	36	0.0	35	0.0	
	飲食業	-	-	-	-	
	生活関連サービス業、娯楽業	9,304	1.5	8,174	1.3	
	教育、学習支援業	-	-	-	-	
	医療・福祉	-	-	-	-	
	その他のサービス	1,370	0.2	1,521	0.2	
	地方公共団体	-	-	-	-	
	個人(住宅・消費・納税資金等)	6,837	1.1	5,957	0.9	
	合 計	602,236	96.3	626,518	96.5	
	海外向け	政府等	-	-	-	-
		金融機関	-	-	-	-
		商工業(等)	23,000	3.7	23,000	3.5
		合 計	23,000	3.7	23,000	3.5
	一般貸付計		625,236	100.0	649,518	100.0

(注) 国内向けの区分は日本銀行の貸出先別貸付金(業種別、設備資金新規貸出)の業種分類に準拠しております。

(オ)貸付金地域別内訳（一般勘定）

（単位：百万円、％）

区分	平成25年度末		平成26年度 第2四半期（上半期）末	
	金額	占率	金額	占率
北海道	1,052	0.2	1,031	0.2
東北	9,434	1.6	9,417	1.5
関東	480,559	80.7	501,240	80.8
中部	20,619	3.5	19,913	3.2
近畿	70,861	11.9	76,380	12.3
中国	2,319	0.4	2,313	0.4
四国	1,320	0.2	1,260	0.2
九州	9,230	1.6	9,003	1.5
合計	595,398	100.0	620,560	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）

（単位：百万円、％）

区分	平成25年度末		平成26年度 第2四半期（上半期）末	
	金額	占率	金額	占率
担保貸付	4,835	0.8	4,798	0.7
有価証券担保貸付	3,382	0.5	3,724	0.6
不動産・動産・財団担保貸付	1,452	0.2	1,073	0.2
指名債権担保貸付	-	-	-	-
保証貸付	12,940	2.1	14,436	2.2
信用貸付	600,622	96.1	624,325	96.1
その他	6,837	1.1	5,957	0.9
一般貸付計	625,236	100.0	649,518	100.0
うち劣後特約付貸付	86,228	13.8	66,249	10.2

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25年度末		平成26年度 第2四半期(上半期)末	
	金額	占率	金額	占率
公 社 債	211,387	29.9	403,771	46.6
株 式	20	0.0	27	0.0
現預金・その他	36,987	5.2	41,453	4.8
小 計	248,394	35.1	445,252	51.3

(b) 円貨額が確定した外貨建資産

(単位:百万円、%)

区 分	平成25年度末		平成26年度 第2四半期(上半期)末	
	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25年度末		平成26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	23,000	3.2	23,000	2.7
公社債(円建外債)・その他	436,405	61.7	399,135	46.0
小 計	459,405	64.9	422,135	48.7

(d) 合計

(単位:百万円、%)

区 分	平成25年度末		平成26年度 第2四半期(上半期)末	
	金額	占率	金額	占率
海外投融資	707,800	100.0	867,388	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25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	125,259	18.4	125,251	18.4	8	0.0	-	-
ヨーロッパ	229,623	33.7	228,756	33.6	866	0.1	9,000	39.1
オセアニア	6,181	0.9	6,181	0.9	-	-	-	-
アジア	3,521	0.5	3,501	0.5	20	0.0	-	-
中南米	291,220	42.8	77,391	11.4	213,828	31.4	14,000	60.9
中東	-	-	-	-	-	-	-	-
アフリカ	-	-	-	-	-	-	-	-
国際機関	25,115	3.7	25,115	3.7	-	-	-	-
合計	680,922	100.0	466,198	68.5	214,723	31.5	23,000	100.0

(単位:百万円、%)

区分	平成26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	175,403	20.9	175,394	20.9	8	0.0	-	-
ヨーロッパ	285,363	34.0	284,496	33.9	867	0.1	9,000	39.1
オセアニア	6,397	0.8	6,397	0.8	-	-	-	-
アジア	3,529	0.4	3,501	0.4	27	0.0	-	-
中南米	312,808	37.3	92,326	11.0	220,482	26.3	14,000	60.9
中東	-	-	-	-	-	-	-	-
アフリカ	-	-	-	-	-	-	-	-
国際機関	55,394	6.6	55,394	6.6	-	-	-	-
合計	838,897	100.0	617,511	73.6	221,385	26.4	23,000	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25年度末		平成26年度第2四半期(上半期)末	
	金額	占率	金額	占率
米ドル	144,136	58.0	248,567	55.8
ユーロ	93,041	37.5	172,792	38.8
その他	11,216	4.5	23,892	5.4
合計	248,394	100.0	445,252	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

(単位：百万円)

区 分	平成25年度末		平成26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	28,049	264	29,583	650

(注) 「当期の損益に含まれた評価損益」には振戻損益を含んでいます。

② 有価証券の明細

(単位：百万円)

区 分	平成25年度末	平成26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	8,922	8,979
株式	9,727	10,371
外国証券	9,399	10,232
公社債	3,217	3,609
株式等	6,181	6,623
その他の証券	-	-
合計	28,049	29,583

(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。

(イ) デリバティブ取引の時価情報

① 金利関連

平成26年度第2四半期(上半期)末、平成25年度末とも保有していません。

② 通貨関連

平成26年度第2四半期(上半期)末、平成25年度末とも保有していません。

③ 株式関連

平成26年度第2四半期(上半期)末、平成25年度末とも保有していません。

④ 債券関連

平成26年度第2四半期(上半期)末、平成25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26年度第2四半期(上半期)末		
	一般勘定	特別勘定	計
現預金・コールローン	240,444	851	241,295
金銭の信託	-	-	-
公社債	2,944,677	8,979	2,953,656
株式	253,127	10,371	263,498
外国証券	838,897	10,232	849,130
貸付金	734,673	-	734,673
不動産	419,908	-	419,908
資産計	5,652,106	30,936	5,682,706
うち外貨建資産	534,449	10,298	544,748

2.有価証券の時価情報(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25年度末		平成26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	28,049	264	29,583	650

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25年度末					平成26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	487,299	512,623	25,323	25,855	△531	424,691	455,474	30,783	31,076	△293
責任準備金対応債券	2,672,373	2,812,284	139,911	142,311	△2,400	2,546,819	2,727,469	180,649	180,688	△38
子会社・関連会社株式	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他有価証券	748,515	804,218	55,702	77,695	△21,993	951,813	1,036,302	84,489	104,155	△19,665
公社債	215,680	219,971	4,291	4,615	△324	227,816	233,354	5,538	5,708	△170
株式	161,811	216,269	54,458	67,101	△12,642	162,279	235,746	73,467	86,596	△13,128
外国証券	299,578	293,560	△6,018	2,869	△8,887	488,723	491,602	2,879	9,228	△6,349
公社債	217,202	215,391	△1,810	2,099	△3,910	400,438	406,773	6,334	8,263	△1,928
株式等	82,376	78,168	△4,207	770	△4,977	88,285	84,829	△3,455	965	△4,420
その他の証券	61,445	64,416	2,971	3,109	△138	62,994	65,598	2,604	2,620	△16
買入金銭債権	10,000	10,000	-	-	-	10,000	10,000	-	-	-
譲渡性預金	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
合 計	3,908,188	4,129,126	220,937	245,862	△24,924	3,923,323	4,219,246	295,922	315,920	△19,998
公社債	3,070,601	3,225,033	154,432	157,159	△2,727	2,939,139	3,137,129	197,990	198,199	△209
株式	161,811	216,269	54,458	67,101	△12,642	162,279	235,746	73,467	86,596	△13,128
外国証券	550,385	555,850	5,464	14,875	△9,410	699,462	717,276	17,813	24,457	△6,643
公社債	468,009	477,681	9,672	14,105	△4,432	611,176	632,446	21,269	23,491	△2,222
株式等	82,376	78,168	△4,207	770	△4,977	88,285	84,829	△3,455	965	△4,420
その他の証券	61,445	64,416	2,971	3,109	△138	62,994	65,598	2,604	2,620	△16
買入金銭債権	63,945	67,556	3,611	3,616	△5	59,448	63,495	4,046	4,046	-
譲渡性預金	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

(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:百万円)

区 分	平成25年度末	平成26年度 第2四半期(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	5,093	5,093
その他有価証券	148,846	148,844
非上場国内株式(店頭売買株式を除く)	12,289	12,287
非上場外国株式(店頭売買株式を除く)	136,557	136,557
非上場外国債券	-	-
その他	-	-
合 計	153,939	153,937

○満期保有目的の債券

(単位:百万円)

区分	平成25年度末			平成26年度 第2四半期(上半期)末		
	貸借対照表 計上額	時 価	差 額	貸借対照表 計上額	時 価	差 額
時価が貸借対照表計上額 を超えるもの	415,284	441,139	25,855	402,179	433,256	31,076
公 社 債	187,647	198,421	10,774	203,603	215,786	12,183
外 国 証 券	176,391	187,854	11,463	149,127	163,974	14,847
買 入 金 銭 債 権	51,245	54,862	3,616	49,448	53,495	4,046
そ の 他	-	-	-	-	-	-
時価が貸借対照表計上額 を超えないもの	72,014	71,483	△ 531	22,511	22,218	△ 293
公 社 債	33,999	33,997	△ 2	-	-	-
外 国 証 券	35,315	34,792	△ 522	22,511	22,218	△ 293
買 入 金 銭 債 権	2,700	2,694	△ 5	-	-	-
そ の 他	-	-	-	-	-	-

○責任準備金対応債券

(単位:百万円)

区分	平成25年度末			平成26年度 第2四半期(上半期)末		
	貸借対照表 計上額	時 価	差 額	貸借対照表 計上額	時 価	差 額
時価が貸借対照表計上額 を超えるもの	2,454,712	2,597,023	142,311	2,534,005	2,714,694	180,688
公 社 債	2,415,612	2,557,381	141,769	2,494,905	2,675,213	180,307
外 国 証 券	39,100	39,642	542	39,100	39,480	380
そ の 他	-	-	-	-	-	-
時価が貸借対照表計上額 を超えないもの	217,661	215,261	△ 2,400	12,813	12,774	△ 38
公 社 債	217,661	215,261	△ 2,400	12,813	12,774	△ 38
外 国 証 券	-	-	-	-	-	-
そ の 他	-	-	-	-	-	-

○その他有価証券

(単位:百万円)

区分	平成25年度末			平成26年度 第2四半期(上半期)末		
	帳簿価額	貸借対照表 計上額	差 額	帳簿価額	貸借対照表 計上額	差 額
貸借対照表計上額が 帳簿価額を超えるもの	487,198	564,894	77,695	689,383	793,538	104,155
公 社 債	189,724	194,340	4,615	201,890	207,598	5,708
株 式	107,027	174,128	67,101	110,331	196,928	86,596
外 国 証 券	137,350	140,219	2,869	317,527	326,756	9,228
そ の 他 の 証 券	53,095	56,205	3,109	59,634	62,255	2,620
買 入 金 銭 債 権	-	-	-	-	-	-
譲 渡 性 預 金	-	-	-	-	-	-
そ の 他	-	-	-	-	-	-
貸借対照表計上額が 帳簿価額を超えないもの	261,317	239,323	△ 21,993	262,430	242,764	△ 19,665
公 社 債	25,955	25,631	△ 324	25,926	25,755	△ 170
株 式	54,783	42,141	△ 12,642	51,947	38,818	△ 13,128
外 国 証 券	162,228	153,340	△ 8,887	171,196	164,846	△ 6,349
そ の 他 の 証 券	8,349	8,210	△ 138	3,360	3,343	△ 16
買 入 金 銭 債 権	10,000	10,000	-	10,000	10,000	-
譲 渡 性 預 金	-	-	-	-	-	-
そ の 他	-	-	-	-	-	-

(イ) デリバティブ取引の運用状況

(1) 取引の内容

当社が利用対象としている主なデリバティブ取引は以下の通りです。

- ・金利関連：金利スワップ取引等
- ・通貨関連：為替予約取引、通貨オプション取引等
- ・株式関連：株価指数先物取引、株価指数オプション取引、個別株オプション取引等
- ・債券関連：債券先物取引、債券オプション取引等

(2) 取組方針

当社では、保有する現物資産が持つ市場リスク（金利・為替・株価等の変動によるリスク）を回避（ヘッジ）することを主目的に、デリバティブ取引を活用しています。なお、ヘッジ会計の適用要件を満たすデリバティブ取引については、ヘッジ会計を適用しています。

(3) 利用目的

当社がデリバティブ取引を利用する主な目的は以下の通りです。

- ・金利関連のデリバティブ取引：現物資産の金利変動リスクを回避すること。
- ・通貨関連のデリバティブ取引：現物資産の為替変動リスクを回避すること。
- ・株式関連および債券関連のデリバティブ取引：現物資産の価格変動リスクを回避すること。

(4) リスクの内容

当社が利用対象としているデリバティブ取引には、市場リスクと信用リスク（契約が履行されないリスク）があります。市場リスクについては、当社は、保有する現物資産の市場リスクを回避することを主目的にデリバティブ取引を活用していることから、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、取引所を通じた取引もしくは信用度が高いと判断される取引先を相手とした店頭取引を行っており、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

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じて、厳正なリスク管理を行っています。

(6) 定量的情報に関する補足説明

①差損益に関する補足説明

当社では、保有する現物資産の市場リスクを回避することを主目的としてデリバティブ取引を行っており、その差損益の認識にあたっては、ヘッジ対象の現物資産の損益と合算して行う必要があります。

②時価算定に関する補足説明

- ・株価指数オプション取引等

取引先金融機関から提示された価格等を使用しています。

- ・為替予約取引

期末日の TTM 等に基づき当社で算出した理論価格を使用しています。

(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25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	-	△3,535	-	-	-	△3,535
ヘッジ会計非適用分	-	△0	△15	-	-	△15
合計	-	△3,535	△15	-	-	△3,551

(注)平成25年度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△3,535百万円)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26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	-	△9,452	-	-	-	△9,452
ヘッジ会計非適用分	-	△677	△14	-	-	△692
合計	-	△10,129	△14	-	-	△10,144

(注)平成26年度第2四半期(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△9,452百万円)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。

(2)ヘッジ会計が適用されていないもの

①金利関連(全社計)

平成26年度第2四半期(上半期)末、平成25年度末とも保有していません。

②通貨関連(全社計)

(単位:百万円)

区分	種類	平成25年度末				平成26年度第2四半期(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	通貨先渡契約	-	-	-	-	-	-	-	-
	売建	-	-	-	-	-	-	-	-
	買建	-	-	-	-	-	-	-	-
	為替予約								
	売建	52	-	△0	△0	32,324	-	△677	△677
	うち米ドル	36	-	△0	△0	32,307	-	△677	△677
	うち豪ドル	16	-	△0	△0	16	-	0	0
	うちユーロ	-	-	-	-	-	-	-	-
	買建	-	-	-	-	-	-	-	-
	うち米ドル	-	-	-	-	-	-	-	-
	うち豪ドル	-	-	-	-	-	-	-	-
	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	(-)	-	-	△0	(-)	-	-	△677	

(注)・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。

・為替予約の時価欄には差損益を記載しています。

③株式関連（全社計）

（単位：百万円）

区分	種類	平成25年度末				平成26年度第2四半期(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	先渡契約	-	-	-	-	-	-	-	-
	売建	-	-	-	-	-	-	-	-
	買建	-	-	-	-	-	-	-	-
	オプション								
	売建	-	-	-	-	-	-	-	-
	コール	(-)	-	-	-	(-)	-	-	-
	プット	-	-	-	-	-	-	-	-
	買建	(-)	-	-	-	(-)	-	-	-
	コール	-	-	-	-	-	-	-	-
	プット	50,000	-	-	-	50,000	-	0	△14
	(15)				△15	(14)			
	その他								
売建	-	-	-	-	-	-	-	-	
買建	(-)	-	-	-	(-)	-	-	-	
買建	-	-	-	-	-	-	-	-	
買建	(-)	-	-	-	(-)	-	-	-	
合計				△15				△14	

(注) 括弧内には、オプション料を記載しています。

④債券関連（全社計）

平成26年度第2四半期(上半期)末、平成25年度末とも保有していません。

(3) ヘッジ会計が適用されているもの

① 金利関連 (全社計)

平成26年度第2四半期(上半期)末、平成25年度末とも保有していません。

② 通貨関連 (全社計)

(単位:百万円)

ヘッジ会計の方法	種類	平成25年度末				平成26年度第2四半期(上半期)末			
		主なヘッジ対象	契約額等		時価	主なヘッジ対象	契約額等		時価
				うち1年超				うち1年超	
時価ヘッジ	通貨先渡契約								
	売建		-	-	-		-	-	-
	買建		-	-	-		-	-	-
	為替予約								
	売建	外貨建債券	254,830	-	△3,535	外貨建債券	456,410	-	△9,452
	うち米ドル		157,247	-	△954		264,037	-	△10,908
	うち豪ドル		10,470	-	△280		23,363	-	83
	うちユーロ		87,111	-	△2,299		169,009	-	1,372
	買建		-	-	-		-	-	-
	うち米ドル		-	-	-		-	-	-
	うち豪ドル		-	-	-		-	-	-
	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				△3,535				△9,452	

(注)・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。

・為替予約の時価欄には差損益を記載しています。

③ 株式関連 (全社計)

平成26年度第2四半期(上半期)末、平成25年度末とも保有していません。

④ 債券関連 (全社計)

平成26年度第2四半期(上半期)末、平成25年度末とも保有していません。

IV. 貸倒引当金残高の内訳

(単位:百万円)

区 分	平成25年度末	平成26年度 第2四半期(上半期)末	比 較
貸 倒 引 当 金	3,258	3,195	△ 63
一 般 貸 倒 引 当 金	1,131	1,088	△ 43
個 別 貸 倒 引 当 金	2,126	2,106	△ 19
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の積立状況

区 分		平成25年度 第2四半期(上半期)末	平成26年度 第2四半期(上半期)末	平成25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号に定める方式	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号に定める
 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。