平成 21 年度第 2 四半期 (上半期) 報告 補足資料

【目次】

Ι.	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
	(工) 業種別株式明細表	• • • • 3
	(オ) デリバティブ取引の時価情報	$\cdot \cdot \cdot 4 \sim 5$
	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
	(才) 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
Π.	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
ш.	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	• • • 14~16
	(イ) デリバティブ取引の運用状況	• • • • 17
TT 7	(ウ) デリバティブ取引の時価情報	• • • 18~19
	貸倒引当金残高の内訳	• • • 20
ν.	個人保険および個人年金保険の責任準備金積立状況	• • • 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)

	X	分			1年度 (上半期)末
				金 額	占 率
国			債	1,785,347	47.7
地	j	方	債	83,506	2.2
社			債	528,215	14.1
	うちな	公社•公园	fl債	80,099	2.1
株			式	352,259	9.4
外	玉	証	券	865,832	23.1
	公	社	債	617,730	16.5
	株	式	等	248,101	6.6
そ	の他	の証	券	125,736	3.4
	合	計		3,740,898	100.0

平成20年度末								
金額	占率							
1,691,400	47.0							
84,210	2.3							
528,828	14.7							
80,863	2.2							
298,052	8.3							
894,610	24.8							
644,481	17.9							
250,129	6.9							
105,283	2.9							
3,602,385	100.0							

(イ)有価証券残存期間別残高(一般勘定)

<平成21年度第2四半期(上半期)末>

(単位:百万円)

		74 - 1 //4// 1 - 1					, i	
	区 分	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		
国任	責	19,431	111,676	337,227	69,296	347,844	899,870	1,785,347
地	方債	2,202	2,164	42,050	32,667	4,421	-	83,506
社化	責	1,720	26,493	61,097	153,786	88,157	196,960	528,215
株式	式						352,259	352,259
外[国証券	29,779	217,598	215,620	88,136	26,161	288,536	865,832
	公社債	3,499	217,598	213,254	88,136	19,135	76,104	617,730
	株式等 26,279		-	2,365	ı	7,025	212,431	248,101
その他の証券		178	113		5,352	167	119,924	125,736
合	<u></u>	53,311	358,047	655,995	349,240	466,753	1,857,550	3,740,898

<平成20年度末> (単位:百万円)

< -	<平成20年度末>						(早	<u> </u>
	区 分	1年以下	1年超	3年超	5年超	7年超	10年超	合計
	区 分		3年以下	5年以下	7年以下	10年以下		
国信	責	16,579	124,151	369,481	91,034	228,412	861,741	1,691,400
地	方債	1,489	3,592	33,990	40,713	3,423	1,000	84,210
社債		-	23,279	64,764	149,836	84,587	206,360	528,828
株式							298,052	298,052
外	国証券	30,031	163,102	219,072	165,143	26,712	290,548	894,610
	公社債	4,500	163,102	216,169	165,143	18,100	77,464	644,481
	株式等	25,531	-	2,903	-	8,611	213,083	250,129
その他の証券		266	141	-	5,495	136	99,243	105,283
合計		48,366	314,266	687,309	452,223	343,272	1,756,946	3,602,385

⁽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)

]	区 分	平成21年度第2四半期 (上半期)末
北	海 道	_
東	北	_
関	東	81,826
中	部	300
近	畿	-
中	玉	1,099
四	玉	_
九	州	280
合	計	83,506

(単位:百万円)

(単位:白万円)
平成20年度末
1
1
82,530
300
1
1,099
1
280
84,210

(工)業種別株式明細表(一般勘定)

株 産 ・ 農 林 葉		区 分		平成21年度第2四	日半期(上半期)末
飲 業 63 0.0 建 設 業 2,984 0.8 食 料 品 5,833 1.7 機 維 製 品 836 0.2 パ ル プ・ 47,931 13.6 医 薬 品 3,542 1.0 店 基 製 品 12,776 3.6 石油・石炭製品 品 12,776 3.6 3.6 方 工具 銀 15,912 4.5 非 鉄 金 属 12,067 3.4 大 無 銀 11,802 3.4 大 無 銀 61,712 17.5 株 器 8,094 2.3 株 器 8,094 2.3 株 器 8,094 1.1 大 の 他 製 1.727 0.5 電 運 業 46,747 13.3 3.3 本 運 運 2,059 0.6 <t< th=""><th></th><th></th><th></th><th>金 額</th><th>占 率</th></t<>				金 額	占 率
建 設 業 2,984 0.8 食 料 品 5,833 1.7 繊維 製 品 836 0.2 パ ル プ・・ 47,931 13.6 医 薬 品 3,542 1.0 石油・石炭製品 865 0.2 ガラス・土石製品 823 0.2 非 鉄 金属 15,912 4.5 毒 無 金属 12,067 3.4 金属 財 15,912 4.5 非 鉄 金属 12,067 3.4 金属 財 大 展 展 61,712 1.5 非 鉄 金 展 8,094 2.3 株 器 8,094 2.3 株 器 8,094 2.3 株 器 8,094 2.3 株 器 8,094 2.3 大 変 業 1,727 0.5 電 運 運 2,059 0.6 の </th <th>水</th> <th>産・農林</th> <th>業</th> <th>39</th> <th>0.0</th>	水	産・農林	業	39	0.0
食 料 品 5,833 1.7 繊維製品 836 0.2 パルプ・紙 2,274 0.6 化 学 47,931 13.6 医薬品 3,542 1.0 石油・石炭製品 865 0.2 ガラス・土石製品 823 0.2 業 鉄 金属 12,067 3.4 金属製品 1,398 0.4 機機 機 11,802 3.4 電気機 器 61,712 17.5 輸送用機器 8,094 2.3 精密機器 3,994 1.1 その他製品 2,282 0.6 電気・ガス薬 1,727 0.5 運輸管要産業 46,747 13.3 佐藤運業 908 0.3 佐藤連業 2,059 0.6 企産庫 運輸開選業 2,059 0.6 企産庫 運輸開選業 19,873 5.6 業 7,845 2.2 金融・所売売業 7,845 2.2 金融・所売品 先物取引業 4,094 1.2 保険業 2,036 0.6 その他金融業 5,195 1.5 不助産業 2,029 0.6 <	鉱		業	63	0.0
機 維 製 品 836 0.2 パルプ・紙 2,274 0.6 化 学 47,931 13.6 医 薬 品 3,542 1.0 石油・石炭製品 865 0.2 ガラス・土石製品 823 0.2 鉄 鋼 15,912 4.5 鉄 銀 品 12,067 3.4 金 属 製 品 13,98 0.4 機 器 61,712 17.5 輸 送 用 機 器 8,094 2.3 精 密 機 器 3,994 1.1 を の 他 製 品 2,282 0.6 電 気・ガス業 1,727 0.5 運輸・情報通信業 908 0.3 産 薬 運輸関連業 2,059 0.6 素 切 売 業 19,873 5.6 産 銀 行 業 45,503 12.9	建	設	業	2,984	0.8
パルプ・紙 2,274 0.6 化 学 47,931 13.6 医薬品 3,542 1.0 石油・石炭製品 865 0.2 ゴム製品 12,776 3.6 ガラス・土石製品 823 0.2 鉄 銀 15,912 4.5 非鉄金属 12,067 3.4 金属製品 1,398 0.4 機機 械 11,802 3.4 電気機 機器 61,712 17.5 輸送用機 器 8,094 2.3 精密機 器 3,994 1.1 その他製品 2,282 0.6 電気・ガス業 1,727 0.5 運輸・情報 運業 46,747 13.3 海海運業 908 0.3 空運輸・情報 連業 2,059 0.6 産産車・運輸開連業 2,059 0.6 産業 7,845 2.2 金融・所属 45,503 12.9 企会 銀行業 2,059 0.6 産業 7,845 2.2 金融・所属 7,845 2.2 <th></th> <th>食 料</th> <th>品</th> <th>5,833</th> <th>1.7</th>		食 料	品	5,833	1.7
世 に 学 は 47,931 に 13.6 医 薬 品 3,542 に 1.0 石油・石炭製品 865 に 2.2 対ラス・土石製品 823 に 3.5 42 は 3.6 数		繊 維 製	品	836	0.2
要 医 薬 品 3,542 1.0 石油・石炭製品 865 0.2 ゴム製品 12,776 3.6 鉄 調 15,912 4.5 鉄 銀 品 12,067 3.4 金 属 製 品 1,398 0.4 機 材 11,802 3.4 電 気 機 器 61,712 17.5 輸 送 用 機 器 8,094 2.3 精 密 機 器 3,994 1.1 そ の 他 製 品 2,282 0.6 電 気 ・ガ ス 業 1,727 0.5 運輸・情報通信業 908 0.3 空 運 業 160 0.0 倉庫・運輸関連業 2,059 0.6 業 7,845 2.2 産 銀 行 業 9,501 2.7 商 素 7,845 2.2 金融・保 険 業 7,845 2.2 本融・保 険 業 2,036 0.6 産 そ の 他 金 融 業 5,195 1.5 不 動 産 業 2,029 0.6		パルプ・	紙	2,274	0.6
 医 薬 品 3,542 1.0 石油・石炭製品 865 0.2 ゴム製品 12,776 3.6 ガラス・土石製品 823 0.2 鉄 鋼 15,912 4.5 非 鉄 金属 12,067 3.4 金属製品 1,398 0.4 機 器 61,712 17.5 輸 送 用 機 器 8,094 2.3 精 密 機 器 3,994 1.1 そ の 他 製品 2,282 0.6 電 気・ガス業 1,727 0.5 運輸・・ 運業 908 0.3 空 運業 160 0.0 倉庫・運輸関連業 2,059 0.6 業 19,873 5.6 薬 の 他 金融 業 7,845 2.2 不 動 産業 2,036 0.6 産 そ の 他 金融業 5,195 1.5 不 動 産業 2,029 0.6 不 動 産業 2,029 0.6 不 動 産業 2,029 0.6 ボール ス 業 9,340 2.7 	製	化	学	47,931	13.6
造 ゴ ム 製 品 12,776 3.6 ガラス・土石製品 鉄 鋼 15,912 4.5 非 鉄 金 属 12,067 3.4 金 属 製 品 1,398 0.4 機 被 11,802 3.4 電 気 機 器 61,712 17.5 輸 送 用 機 器 8,094 2.3 精 密 機 器 3,994 1.1 そ の 他 製 品 2,282 0.6 電 気 ・ ガ ス 業 1,727 0.5 運輸・管 運 業 46,747 13.3 海 運 業 908 0.3 ウ 運 業 160 0.0 自庫・運輸 関連業 2,059 0.6 常 車・運輸 関連業 2,059 0.6 業 19,873 5.6 素 小 売 業 7,845 2.2 金融・・商品 先物取引業 4,094 1.2 保険業 2,036 0.6 産 の 他 金融業 5,195 1.5 不 動 産 業 2,029 0.6 サ ー ビ ス 業 9,340 2.7	1	医 薬	묘	3,542	1.0
造 ガラス・土石製品 823 0.2 鉄 鋼 15,912 4.5 非 鉄 金属 12,067 3.4 金属製品 1,398 0.4 機機 機器 11,802 3.4 電気機器 61,712 17.5 輸送用機器 8,094 2.3 精密機器 3,994 1.1 その他製品 2,282 0.6 電極等 第 46,747 13.3 海運輸売運業 908 0.3 空運業 160 0.0 倉庫・運輸関連業 2,059 0.6 業内 19,873 5.6 業内、売業 7,845 2.2 金融 行業 45,503 12.9 証券・商品先物取引業 4,094 1.2 保険業 2,036 0.6 その他金融業 5,195 1.5 不動産業 2,029 0.6 サービス業 9,340 2.7		石油・石炭製	묘	865	0.2
造 鉄 鋼 15,912 4.5 非 鉄 金 属 12,067 3.4 金 属 製 品 1,398 0.4 機 域 11,802 3.4 電 気 機 器 61,712 17.5 輸送 用 機 器 3,994 1.1 その 他 製 品 2,282 0.6 電 気 ガ ス 1,727 0.5 運輸 運 業 46,747 13.3 海 運 業 908 0.3 空 運 業 160 0.0 倉庫 運 業 2,059 0.6 青報 ・通 第 19,873 5.6 業 19,873 5.6 2.7 商 売 業 7,845 2.2 金 銀 行 業 7,845 2.2 金 銀 行 業 4,094 1.2 保 そ		ゴ ム 製	묘	12,776	3.6
鉄 銀 15,912 4.5 非 鉄 金 属 12,067 3.4 金 属 製 品 1,398 0.4 機	进	ガラス・土石製	品	823	0.2
金属製品 1,398 0.4 機機 械 11,802 3.4 電気機器 8,094 2.3 精密機器 8,094 2.3 精密機器 3,994 1.1 その他製品 2,282 0.6 電気・ガス業 1,727 0.5 運輸・ 運業 46,747 13.3 海運業 908 0.3 空運業 160 0.0 倉庫・運輸関連業 2,059 0.6 業 9,501 2.7 商却売業 19,873 5.6 業 7,845 2.2 金融・・売業 7,845 2.2 金融・・商品先物取引業 4,094 1.2 保険業 2,036 0.6 その他金融業 5,195 1.5 不動産業 2,029 0.6 サービス業 9,340 2.7	垣	鉄	鋼	15,912	4.5
機 機 器 61,712 17.5 17.5 17.5 輪 送 用 機 器 8,094 2.3 1.1 在 の 他 製 品 2,282 0.6 電 気 ・ ガ ス 業 1,727 0.5 連輪 で 運 業 46,747 13.3 海 運 業 908 0.3 1.1 在 2,059 1.6 音 報・運 輪 関連業 2,059 1.6 音 報・通 信 業 9,501 2.7 高 卸 売 業 7,845 2.2 金融・ 保 険 業 7,845 2.2 在 融・ 保 険 業 2,036 0.6 2.7 不 動 産 業 2,029 0.6 2.7 1.5 不 動 産 業 2,029 0.6 2.7		非 鉄 金	属	12,067	3.4
業 電 気 機 器 8,094 2.3 輸 送 用 機 器 8,094 2.3 精 密 機 器 3,994 1.1 そ の 他 製 品 2,282 0.6 電 気 ・ ガ ス 業 1,727 0.5 運輸 達 業 908 0.3 空 運 業 908 0.3 倉庫・運輸 関連業 2,059 0.6 業 情報・通 信 業 9,501 2.7 商 卸 売 業 19,873 5.6 業 小 売 業 7,845 2.2 金融・保険業 2,036 0.6 そ の 他 金 融 業 5,195 1.5 不 動 産 業 2,029 0.6 サ ー ビ ス 業 9,340 2.7		金 属 製	品	1,398	0.4
電気機器 61,712 17.5 17.5 輸送用機器 8,094 2.3 精密機器 3,994 1.1 その他製品 2,282 0.6 電気・ガス業 1,727 0.5 連輸 選業 46,747 13.3 海運業 160 0.0 倉庫・運輸関連業 2,059 0.6 業 19,873 5.6 業 19,873 5.6 業 45,503 12.9 融・・ 売業 7,845 2.2 金融・・ 売業 45,503 12.9 証券・商品先物取引業 4,094 1.2 保険業 その他金融業 5,195 1.5 不動産業 2,029 0.6 サービス業 9,340 2.7		機	械	11,802	3.4
精密機器 3,994 1.1 その他製品 2,282 0.6 電気・ガス業 1,727 0.5 運輸・情報選 業 908 0.3 空運輸関連業 160 0.0 倉庫・運輸関連業 2,059 0.6 業 19,873 5.6 業 小売業 7,845 2.2 金融・保険業 45,503 12.9 証券・商品先物取引業 4,094 1.2 保険業 その他金融業 5,195 1.5 不動産業 2,029 0.6 サービス業 9,340 2.7	業	電 気 機	器	61,712	17.5
その他製品 2,282 0.6 電気・ガス業 1,727 0.5 運輸・運業 第 46,747 13.3 海運業 第 160 0.0 倉庫・運輸関連業 第 160 0.0 倉庫・運輸関連業 第 19,873 0.6 業 19,873 5.6 業 小売業 7,845 2.2 金融・・原産業 45,503 12.9 証券・商品先物取引業 4,094 1.2 保険業 7,036 0.6 その他金融業 5,195 1.5 不動産業 2,029 0.6 サービス業 9,340 2.7		輸送用機	器	8,094	2.3
電 気 ・ ガ ス 業 1,727 0.5 正		精 密 機	器	3,994	1.1
運輸 陸 運業 46,747 13.3 店標 運業 908 0.3 空運業 160 0.0 倉庫・運輸関連業 2,059 0.6 業情報・通信業 9,501 2.7 商即売業 19,873 5.6 業小売業 7,845 2.2 金融・・売業 45,503 12.9 証券・商品先物取引業 4,094 1.2 保険業 2,036 0.6 その他金融業 5,195 1.5 不動産業 2,029 0.6 サービス業 9,340 2.7		その他製	品	2,282	0.6
輪 達 乗 10.0 海 運 業 160 0.0 倉庫・運輸関連業 2,059 0.6 業 情報・通信業 9,501 2.7 商卸売業 19,873 5.6 業小売業 7,845 2.2 金融・・ 業 45,503 12.9 証券・商品先物取引業 4,094 1.2 保険業 2,036 0.6 その他金融業 5,195 1.5 不動産業 2,029 0.6 サービス業 9,340 2.7	電	気・ガス	業	1,727	0.5
情報 運業 908 0.3 空運業 160 0.0 倉庫・運輸関連業 2,059 0.6 業情報・通信業 9,501 2.7 商卸売業 19,873 5.6 業小売業 7,845 2.2 金融・銀行業 45,503 12.9 証券・商品先物取引業 4,094 1.2 保険業 2,036 0.6 その他金融業 5,195 1.5 不動産業 2,029 0.6 サービス業 9,340 2.7	運輸	陸運	業	46,747	13.3
報通信 運業 160 0.0 倉庫・運輸関連業 2,059 0.6 業情報・通信業 9,501 2.7 商卸売業 19,873 5.6 業小売業 7,845 2.2 金融・銀行業 45,503 12.9 証券・商品先物取引業 4,094 1.2 保険業 2,036 0.6 その他金融業 5,195 1.5 不動産業 2,029 0.6 サービス業 9,340 2.7	•	海運	業	908	0.3
業情報・通信業 9,501 2.7 商卸売業 19,873 5.6 業小売業 7,845 2.2 金銀行業 45,503 12.9 証券・商品先物取引業保険業 4,094 1.2 保険業 2,036 0.6 その他金融業 5,195 1.5 不動産業 2,029 0.6 サービス業 9,340 2.7	報	空運	業	160	0.0
業情報・通信業 9,501 2.7 商卸売業 19,873 5.6 業小売業 7,845 2.2 金銀行業 45,503 12.9 証券・商品先物取引業保険業 4,094 1.2 保険業 2,036 0.6 その他金融業 5,195 1.5 不動産業 2,029 0.6 サービス業 9,340 2.7	通信	倉庫・運輸関連	業	2,059	0.6
業 小 売 業 7,845 2.2 金 銀 行 業 45,503 12.9 証券・商品先物取引業 4,094 1.2 保険 業 2,036 0.6 その他金融業 5,195 1.5 不動産業 2,029 0.6 サービス業 9,340 2.7	業	情 報・通信	業	9,501	2.7
金融・ 銀 行 業 45,503 12.9 証券・商品先物取引業 4,094 1.2 保険業 2,036 0.6 その他金融業 5,195 1.5 不動産業 2,029 0.6 サービス業 9,340 2.7	商	卸 売	業	19,873	5.6
融 : 4,094 1.2 保険 業 2,036 0.6 その他金融業 5,195 1.5 不動産業 2,029 0.6 サービス業 9,340 2.7	業	小 売	業	7,845	2.2
融・ 証券・商品先物取引業 4,094 1.2 保険業 2,036 0.6 その他金融業 5,195 1.5 不動産業 2,029 0.6 サービス業 9,340 2.7	金	銀行	業	45,503	12.9
保険業 2,036 0.6 その他金融業 5,195 1.5 不動産業 2,029 0.6 サービス業 9,340 2.7	融 •	証券•商品先物取引	業	4,094	1.2
不動産業 2,029 サービス業 9,340 2.7	保险	保険	業	2,036	0.6
不動産業 2,029 0.6 サービス業 9,340 2.7	業	その他金融	業	5,195	1.5
サービス業 9,340 2.7	不				
		ービス	業		
п п 352,259 100.0	合		計	352,259	100.0

	(単位:百万円、%)
平成20 金 額	年度末 占 率
39	0.0
54	0.0
2,686	0.9
4,956	1.7
930	0.3
1,949	0.7
36,499	12.2
4,180	1.4
751	0.3
10,805	3.6
662	0.2
10,830	3.6
7,936	2.7
1,012	0.3
8,033	2.7
52,497	17.6
7,024	2.4
2,870	1.0
5,098	1.7
1,799	0.6
39,210	13.2
745	0.3
228	0.1
2,111	0.7
8,883	3.0
14,443	4.8
6,870	2.3
45,008	15.1
3,371	1.1
2,191	0.7
3,736	1.3
1,851	0.6
8,779	2.9
298,052	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	平成21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	7	9,417	-	-	-	9,425
		ヘッジ会計非適用分	-	-	△354	-	-	△354
l		合計	7	9,417	△354	-	-	9,071

(注)平成21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、417百万円)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20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	△52	4,949	-	-	-	4,896
	ヘッジ会計非適用分	-	-	△8,208	-	-	△8,208
	合計	△52	4,949	△8,208	-	-	△3,312

(注)平成20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4,949百万円)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)

	Т					1				立:百万円)
- A	## WT		21年度第2四	□半期(上	半期)末			平成20	年度末	
区 分	種 類	契約	うち1年超	n+: /m*	共相共		契約	額等 うち1年超	n+: /m*	关相头
	金利先渡契約		961年超	時価	差損益	ł		961年超	時価	差損益
	売建	_	_	_	_		_	_	-	_
	買建	_	_	-	_		_	_	_	_
	金利オプション									
	売建									
	コール	-					-	-		
		(-)		-	-		(-)		-	-
	プット	-					-	-		
		(-)		-	-		(-)		-	-
	買建									
	コール	-					-	-		
		(-)		-			(-)		-	-
店	プット	-	-				-	-		
店頭		(-)		-	_		(-)		_	_
	金利スワップ									
	固定金利受取	3,500	3,500	7	7		3,500	3,500	△52	△52
	/変動金利支払									
	固定金利支払	_	_	_	_		_	_	_	_
	/変動金利受取									
	変動金利受取	_	_	_	_		_	_	_	_
	/変動金利支払									
	その他									
	売建	_	_	_	_		_	_	_	_
	JUAE .	(-)					(-)			
	買建	_		_	_		_	_	_	_
	只走	(-)					(-)			
	合 計	(-)			7	ł	(-)			△5:
(3) \ -\	在訓中2274 代出	ᇓᇭᆂᇎ			<u> </u>	I				△0,

(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21年度第2四半期(上半期)末 金利スワップ残存期間別残高

1 724	21 20,7300 7,770	2 /////		- /2(1)///	14333334143		(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		-	2,500	-	1,000	-	-	3,500
	平均受取固定金利	-	1.14	-	1.30	-	-	1.18
	平均支払変動金利	-	0.01	-	0.59	-	-	0.18
支払側	側固定スワップ想定元本	-	-	-	-	-	-	-
	平均支払固定金利	ı	-	-	-	-	1	-
	平均受取変動金利	-	-	-	-	-	1	-
合計		-	2,500	-	1,000	-	-	3,500

③通貨関連 (一般勘定)

(単位:百万円)

		平成	21年度第2四	四半期(上半期	引)末
区分	種 類	契約	額等		
			うち1年超	時価	差損益
	通貨先渡契約				
	売建	-	-	-	-
	買建	-	-	-	-
	為替予約				
	売建	289,720	-	280,302	
	うち米ドル	238,999	-	230,176	
	うちユーロ	50,721	-	50,125	595
	買建	-	-	-	-
	うち米ドル	-	-	_	-
	うちユーロ	-	-	_	-
	通貨オプション				
	売建				
店	コール	_	-		
頭	0. 3	(-)		_	_
.,,	プット	_	_		
	DD 7-b.	(-)		_	_
	買建				
	コール	_	_		
	⊸ ₽ 1	(-)		_	_
	プット	(-)	-		
	マルコローデ	(-)		_	_
	通貨スワップ その他	_	-	_	_
	元建				
l	ル建	(-)	_	_	_
	買建	(-)	_	_	_
	具定	(-)			_
	合 計	()			9,417

(平位,日次11)							
	平成20年度末						
契約	額等						
	うち1年超	時価	差損益				
-	-	-	-				
-	_	-	-				
294,733	_	289,783	4,949				
246,049	-	243,259	2,790				
48,683	-	46,524	2,158				
_ ′	_	_ ′	_ ´				
_	_	_	_				
_	-	_	_				
_	_						
(-)		_	_				
_	_						
(-) - (-)		_	_				
()							
_	_						
(-)		_	_				
_	_						
(-) - (-)		_	_				
_	_	_	_				
_	_	_	_				
(-)							
	_	_	_				
(-)							
. /			4,949				
	<u> </u>		1,010				

合計 9,417 (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に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)

(単位:百万円)

		平成	平成21年度第2四半期(上半期)				
区分	種 類	契約	額等				
			うち1年超	時価	差損益		
	先渡契約						
	売建	-	-	-	-		
	買建	-	-	-	-		
	オプション						
	売建						
	コール	-	-				
		(-)		_	-		
	プット	-	-				
rt:		(-)		-	-		
店	買建	` ′					
頭	コール	_	-				
	·	(-)		_	_		
	プット	99,988	_				
		(354)		0	△354		
	その他	(001)					
	売建	_	_				
	70,72	(-)		_	_		
	買建		_				
	X^L	(-)		_	_		
	合 計	` '			△354		

(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。

⑤債券関連(一般勘定)

平成21年度第2四半期(上半期)末、平成20年度末とも保有していません。

	平成20年度末							
契約	額等 うち1年超	時価	差損益					
		3 //	7-17 3-111					
_	-	_	_					
-	-							
(-)		-	-					
(-)	_	-	-					
(-)	_	-	-					
400,005 (21,631)	_	13,422	△8,208					
(21,031)		15,422	∠0,200					
_ (-)	-	_	_					
(-)	-							
(-)		_	_ △8,208					

2. 貸付金関係 (ア)貸付金明細表(一般勘定)

	区 分	平成21年度 第2四半期(上半期)末
保険約	款貸付	149,880
	契約者貸付	136,676
	保険料振替貸付	13,203
一般負	 付	905,735
	(うち非居住者貸付)	(59,000)
	企業貸付	857,456
	(うち国内企業向け貸付)	(798,456)
	国·国際機関·政府関係機関貸付	5,397
	公共団体·公企業貸付	9,413
	住宅ローン	2,923
	消費者ローン	30,249
	その他	293
合	計	1,055,615
	うち劣後特約付貸付	78,500

(単位:百万円)

(十四:日271)
平成20年度末
155,447
141,468
13,978
925,800
(68,000)
868,242
(800,242)
6,435
9,471
3,249
38,095
306
1,081,248
78,500

(イ)貸付金残存期間別残高(一般勘定)

(単位:百万円)

		4 たいて	→ 1-77	o 보 +게	- F +77	7 FT +77		単位:日ガ門
	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 21 年	変動金利	12,191	31,269	28,505	19,578	5,260	124	96,929
(上半期)末年度第2四半期	固定金利	151,852	185,396	123,695	140,781	142,692	64,385	808,805
大学	一般貸付計	164,044	216,666	152,200	160,360	147,953	64,510	905,735
平成	変動金利	11,577	25,451	35,589	21,893	5,385	230	100,127
成 20 年度末	固定金利	106,192	212,939	148,437	153,016	134,883	70,204	825,673
末	一般貸付計	117,770	238,391	184,026	174,909	140,268	70,434	925,800

(ウ)国内企業向け貸付金企業規模別内訳(一般勘定)

		X	分	平成21年度第2四	日半期(上半期)末 占率
大	企	業	貸付先数	148	72.2
			金額	711,209	89.1
中	堅 企	業	貸付先数	4	2.0
			金 額	2,512	0.3
中	小 企	業	貸付先数	53	25.9
			金 額	84,734	10.6
国	内企業向	可け	貸付先数	205	100.0
貸	付	計	金 額	798,456	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。

(単位:件、百万円、%)

	L. 件、自刀 门、/0/
半成20	年度末
	占率
157	72.7
714,448	89.3
4	1.9
2,667	0.3
55	25.5
83,126	10.4
216	100.0
800,242	100.0

・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	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	資本金 10億円以上
中堅企業		資本金 3億円超 10億円未満	50名超 かつ	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	

※「物品賃貸業」、「学術研究、専門・技術サービス業」、「宿泊業」、「生活関連サービス業、娯楽業」、「教育、学習支援業」、「医療、福祉」、「その他のサービス」

(工)貸付金業種別内訳(一般勘定)

(単位:百万円、%)

	区分	平成21年度第2四半期(上半期)末			
	<u> </u>	金額	占率		
	製造業	203,786	22.5		
	食料	3,360	0.4		
	繊維	9,660	1.1		
	木材•木製品		-		
	パルプ・紙	17,614	1.9		
	[1] 届月	2,568	0.3		
	化学	30,641	3.4		
	石油·石炭	9,000	1.0		
	窯業•土石	657	0.1		
	鉄鋼	23,000	2.5		
	非鉄金属	53,579	5.9		
	金属製品	77	0.0		
	はん用・生産用・業務用機械	3,820	0.4		
	電気機械	19,409	2.1		
	輸送用機械	20,190	2.2		
	その他の製造業	10,210	1.1		
	農業、林業	_	_		
玉	漁業	-	_		
内	鉱業、採石業、砂利採取業	6	0.0		
向 け	建設業	7,341	0.8		
()	電気・ガス・熱供給・水道業	43,533	4.8		
	情報通信業	17,525	1.9		
	運輸業、郵便業	74,652	8.2		
	卸売業	144,924	16.0		
	小売業	4,825	0.5		
	金融業•保険業	176,095	19.4		
	不動産業	26,675	2.9		
	物品賃貸業	109,280	12.1		
	学術研究、専門・技術サービス業	-	-		
	宿泊業	66	0.0		
	飲食業	_	-		
	生活関連サービス業、娯楽業	4,115	0.5		
	教育、学習支援業	11	0.0		
	医療•福祉	-	_		
	その他のサービス	723	0.1		
	地方公共団体	-	_		
	個人(住宅・消費・納税資金等)	33,172	3.7		
	合 計	846,735	93.5		
海	政府等	-	_		
外	金融機関	-	_		
向 け	商工業(等)	59,000	6.5		
()	合 計	59,000	6.5		
	総 合 計	905,735	100.0		

II. Noo	(単位:百万円、%)
平成20	
金額	占率
195,926	21.2
3,410	0.4
9,660	1.0
_	_
17,832	1.9
2,307	0.2
29,369	3.2
9,000	1.0
674	0.1
21,000	2.3
50,638	5.5
112	0.0
3,733	0.4
17,402 20,302	1.9
10,484	2.2
10,464	1.1
_	_
17	0.0
8,137	0.9
44,484	4.8
17,535	1.9
77,530	8.4
140,173	15.1
5,031	0.5
183,498	19.8
27,144	2.9
111,195	12.0
_	-
127	0.0
_	-
4,498	0.5
12	0.0
-	_
820	0.1
15	0.0
41,651	4.5
857,800	92.7
-	_
-	-
68,000	7.3
68,000	7.3
925,800	100.0

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

(才)貸付金国内地域別内訳(一般勘定)

区 分	平成21年度第2四	日半期(上半期)末
- 3	金 額	占率
北 海 道	1,889	0.2
東 北	13,215	1.6
関 東	631,608	77.6
中 部	27,162	3.3
近 畿	118,771	14.6
中 国	6,225	0.8
四国	3,119	0.4
九 州	11,569	1.4
合 計	813,562	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。

	(単位:百万円、%)
平成20	年度末
金 額	占 率
2,385	0.3
13,479	1.7
633,455	77.6
28,018	3.4
117,998	14.5
6,268	0.8
3,054	0.4
11,795	1.4
816,455	100.0

(カ)貸付金担保別内訳(一般勘定)

区 分	平成21年度第2四半期(上半期)末		
	- ~	金 額	占率
担保	貸付	16,875	1.9
	有 価 証 券 担 保 貸 付	3,607	0.4
	不動産・動産・財団担保貸付	13,268	1.5
	指名債権担保貸付	-	-
保証	E貸付	19,528	2.2
信用]貸付	836,157	92.3
その	他	33,172	3.7
一般	党 貸付計	905,735	100.0
	うち劣後特約付貸付	78,500	8.7

	(単位:日ガロ、%)
平成20年度末	
金 額	占 率
19,703	2.1
3,143	0.3
16,560	1.8
_	
19,789	2.1
844,962	91.3
41,345	4.5
925,800	100.0
78,500	8.5

3. 海外投融資関係

(ア)資産別明細(一般勘定)

(a)外貨建資産

平成21年度 第2四半期(上半期)末 区 分 金額 占率 公社債 283,391 30.5 株 式 16 0.0 現預金・その他 23,150 2.5 小 計 306,558 33.0

(単位:百万円、%)

平成20年度末	
金 額	占率
310,948	32.1
16	0.0
25,009	2.6
335,974	34.7

(b)円貨額が確定した外貨建資産

F ()	平成21年度 第2日	四半期(上半期)末
区分	金額	占率
公社債	-	-
現預金・その他	-	-
小 計	-	-

(単位:百万円、%)

		(平匹・日刀17, /0)
平成	₹204	年度末
金額		占率
	-	-
	-	-
	-	_

(c)円貨建資産

区分	平成21年度 第2日	四半期(上半期)末
	金額	占率
非居住者貸付	59,000	6.3
公社債(円建外債)・その他	563,756	60.7
小 計	622,756	67.0

(単位:百万円、%)

平成20年度末	
金 額	占率
68,000	7.0
563,503	58.2
631,503	65.3

(d)合計

区分	平成21年度 第2四半期(上半期)末		
	E 77	金額	占率
海外投融	資	929,315	100.0
	うち海外不動産	_	-

(単位:百万円、%)

平成20年度末	
金額	占率
967,477	100.0
	ı

(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、%)

								д. П / 3 1(/0/
	平成21年度第2四半期(上半期)末							
区 分	外国	証券					非居住者貸付	
			公社	土債	株式	株式等		
	金額	占率	金額	占率	金額	占率	金額	占率
北 米	349,375	40.4	349,366	40.4	9	0.0	_	_
ヨーロッパ	184,275	21.3	183,778	21.2	497	0.1	22,000	37.3
オセアニア	_	_	_	-	-	-	_	_
アジア	3,017	0.3	3,000	0.3	17	0.0	-	_
中 南 米	329,164	38.0	81,585	9.4	247,578	28.6	37,000	62.7
中東	-	_	_	-	-	-	_	_
アフリカ	_	_	_	-	-	-	_	_
国 際 機 関	_	_	_	_	-	-	_	_
合 計	865,832	100.0	617,730	71.3	248,101	28.7	59,000	100.0

(単位:百万円、%)

	平成20年度末					V I I	匹.日沙门(70)	
区 分	外国	証券					非居住者貸付	
			公社	土債	株式等			
	金額	占率	金額	占率	金額	占率	金額	占率
北 米	372,182	41.6	372,172	41.6	10	0.0	-	_
ヨーロッパ	182,116	20.4	181,636	20.3	479	0.1	25,000	36.8
オセアニア	=	=	=	=	=	-	=	_
アジア	3,016	0.3	3,000	0.3	16	0.0	=	_
中 南 米	337,294	37.7	87,672	9.8	249,622	27.9	43,000	63.2
中東	=	=	=	=	=	-	=	_
アフリカ	=	=	=	=	=	_	=	_
国際機関	=	=	=	=	=	_	=	_
合 計	894,610	100.0	644,481	72.0	250,129	28.0	68,000	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)

平成21年度第2四半期(上半期)末 区 分 金額 米 K ル 254,498 83.0 52,051 17.0 \mathcal{O} 他 0.0 計 306,558 100.0

平成20年度末				
金額	占率			
285,194	84.9			
50,771	15.1			
8	0.0			
335,974	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21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		
売買目的有価証券	27,140	3,042		

平成20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				
25,087	△1,901				

⁽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

(単位:百万円)

	区分	平成21年度 第2四半期(上半期)末	
		貸借対照表計上額	
公社(責	13,139	
株式		7,06	
外国語	证券	6,937	
	公社債	2,992	
	株式等	3,945	
その作	也の証券	-	
合計		27,140	

平成20年度末	
貸借対照表計上額	
13,110	
5,976	
6,001	
3,020	
2,980	
25,087	
5.引注 トの右体証券	

⁽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

平成21年度第2四半期(上半期)末、平成20年度末とも保有していません。

②通貨関連

(単位:百万円)

区		平成21年度第2四半期(上半期)末					
	種 類	契約	額等				
分			うち1年超	時価	差損益		
	通貨先渡契約						
	売建	-	-	-	-		
	買建	-	-	-	-		
	為替予約						
	売建						
	うち米ドル						
	うちユーロ	-	-	-	-		
	買建	115	-	116	0		
	うち米ドル	28	-	28	0		
	うちユーロ	87	-	87	0		
	通貨オプション						
	売建						
店	コール	-	-				
頭		(-)		-	-		
~	プット	-	-				
		(-)		-	-		
	買建						
	コール	-	-				
		(-)		-	_		
	プット	-	-				
		(-)		-	_		
	通貨スワップ	-	-	-	_		
	その他						
	売建	-	-	-	-		
1		(-)					
	買建	-	-	-	-		
<u></u>		(-)					
	合 計				0		
(注)	括弧内には、貸借対照。	表に計 上したオ	プション料を記	記載しています	·_		

平成20年度末					
契約	額等				
	うち1年超	時価	差損益		
-	-	-	-		
-	-	-	-		
_	_	_	_		
_	_	_	_		
_	_	_	_		
_	-	-	-		
-	-				
(-)		-	-		
(-) - (-)	-				
(-)		-	-		
-	-				
(-)		-	-		
- (-) - (-)	_				
(-)	_	_	_		
_	-	-	-		
(-) - (-)					
-	-	-	-		
(-)					
			-		

-12-

③株式関連

平成21年度第2四半期(上半期)末、平成20年度末とも保有していません。

④債券関連

平成21年度第2四半期(上半期)末、平成20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。

[・]時価の算定には、期末日のTTM、WMロイターリントで記しています。 ・・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に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。

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21年度第2四半期(上半期)末			
	一般勘定	特別勘定	∄	
現預金・コールローン	150,562	113	150,676	
金銭の信託	10	-	10	
公社債	2,397,069	13,644	2,410,714	
株式	352,259	7,390	359,649	
外国証券	865,832	6,937	872,770	
貸付金	1,055,615	-	1,055,615	
不動産	461,827	-	461,827	
資産計	5,650,642	29,926	5,678,873	
うち外貨建資産	306,558	6,992	313,551	

-13-

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)

平成20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		
26,313	△1,987		

	平成21年度第2四半期(上半期)末				
区 分	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	27,972	3,209			

(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)

			平成21年度	第2四半期(.	上半期)末	
	区 分	帳簿価額	時価	差	色 損 益	益
					うち差益	うち差担
満其	開保有目的の債券	407,885	411,234	3,349	9,024	△5,6
責任	£準備金対応債券	1,917,830	1,963,711	45,881	52,404	△6,5
子会	会社·関連会社株式	-	-	-	-	
その	つ他有価証券	1,309,673	1,303,168	△6,505	64,258	△70,7
	公社債	384,182	391,527	7,344	7,428	Δ
	株式	326,902	333,116	6,213	37,660	△31,4
	外国証券	477,321	443,707	△33,614	849	△34,4
	公社債	406,301	383,583	△22,718	786	△23,5
	株式等	71,019	60,123	△10,895	63	△10,9
	その他の証券	111,216	125,736	14,520	18,320	△3,7
	買入金銭債権	10,050	9,081	△969	-	\triangle 9
	譲渡性預金	-	1	-	1	
	その他	-	-	-	-	
	合 計	3,635,389	3,678,114	42,725	125,687	△82,9
公社	注債	2,389,725	2,448,743	59,018	61,689	△2,6
株式	ŧ	326,902	333,116	6,213	37,660	△31,4
外	国証券	711,468	674,456	△37,011	6,747	△43,7
	公社債	640,449	614,332	△26,116	6,683	△32,8
	株式等	71,019	60,123	△10,895	63	△10,9
その	り他の証券	111,216	125,736	14,520	18,320	△3,7
買	入金銭債権	96,076	96,062	△14	1,270	△1,2
譲	度性預金	-	-	-	-	
その	り他	-	-	-	-	

	(単位:百万円)							
	2	平成20年度末	₹					
帳簿価額	時価	Ź	差 損 善	益				
			うち差益	うち差損				
419,235	419,734	498	9,568	△9,069				
1,926,098	1,951,822	25,724	44,369	△18,645				
-	ı	ı	ı	-				
1,251,500	1,145,604	△105,895	10,237	△116,133				
283,985	288,726	4,741	4,795	△53				
340,280	278,602	△61,677	4,796	△66,474				
505,670	466,333	△39,337	645	△39,982				
432,179	404,182	△27,997	368	△28,365				
73,490	62,150	△11,339	277	△11,617				
111,513	105,283	△6,229	0	△6,229				
10,050	6,658	△3,392	1	△3,392				
1	1	1	1	1				
-	ı	ı	ı	-				
3,596,833	3,517,161	△79,672	64,175	△143,848				
2,299,697	2,344,189	44,492	50,097	△5,605				
340,280	278,602	△61,677	4,796	△66,474				
745,969	692,217	△53,751	8,008	△61,759				
672,478	630,066	△42,411	7,731	△50,142				
73,490	62,150	△11,339	277	△11,617				
111,513	105,283	△6,229	0	△6,229				
99,373	96,867	△2,506	1,273	△3,780				
_	-	-	-	-				
-	-	-	-	-				
かなりのた合りでいます								

(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21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	5,443
その	他有価証券	201,680
	非上場国内株式(店頭売買株式を除く)	13,700
	非上場外国株式(店頭売買株式を除く)	178,480
	非上場外国債券	_
	その他	9,500
	合 計	207,124

(単位・百万円)

(単位:百万円)
平成20年度末
-
-
-
-
5,434
201,995
14,014
178,480
-
9,500
207,430

<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)

	平成21年度第2四半期(上半期)末					
区 分	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	407,885	411,234	3,349	9,024	△5,67	
責任準備金対応債券	1,917,830	1,963,711	45,881	52,404	△6,52	
子会社•関連会社株式	-	-	1	-	ı	
その他有価証券	1,497,654	1,491,146	△6,507	64,258	△70,76	
公社債	384,182	391,527	7,344	7,428	△8	
株式	326,902	333,116	6,213	37,660	△31,44	
外国証券	665,302	631,685	△33,616	849	△34,46	
公社債	406,301	383,583	△22,718	786	△23,50	
株式等	259,000	248,101	△10,898	63	△10,96	
その他の証券	111,216	125,736	14,520	18,320	△3,79	
買入金銭債権	10,050	9,081	△969	=	△96	
譲渡性預金	-	=	-	=	=	
その他	-	=	-	=	-	
合 計	3,823,370	3,866,092	42,722	125,687	△82,96	
公社債	2,389,725	2,448,743	59,018	61,689	△2,67	
株式	326,902	333,116	6,213	37,660	△31,44	
外国証券	899,449	862,434	△37,014	6,747	△43,76	
公社債	640,449	614,332	△26,116	6,683	△32,80	
株式等	259,000	248,101	△10,898	63	△10,96	
その他の証券	111,216	125,736	14,520	18,320	△3,79	
買入金銭債権	96,076	96,062	△14	1,270	△1,28	
譲渡性預金	-	-	-	-	-	
その他	-	-	-	-	-	

				(:日刀円)		
平成20年度末						
帳簿価額	時価	差		益		
			うち差益	うち差損		
419,235	419,734	498	9,568	△9,069		
1,926,098	1,951,822	25,724	44,369	△18,645		
-	-	-	-	-		
1,439,481	1,333,583	△105,898	10,237	△116,135		
283,985	288,726	4,741	4,795	△53		
340,280	278,602	△61,677	4,796	△66,474		
693,651	654,311	△39,339	645	△39,984		
432,179	404,182	△27,997	368	△28,365		
261,471	250,129	△11,342	277	△11,619		
111,513	105,283	△6,229	0	△6,229		
10,050	6,658	△3,392	-	△3,392		
-	-	-	-	_		
-	-	-	-	_		
3,784,814	3,705,139	△79,674	64,175	△143,850		
2,299,697	2,344,189	44,492	50,097	△5,605		
340,280	278,602	△61,677	4,796	△66,474		
933,949	880,196	△53,753	8,008	△61,761		
672,478	630,066	△42,411	7,731	△50,142		
261,471	250,129	△11,342	277	△11,619		
111,513	105,283	△6,229	0	△6,229		
99,373	96,867	△2,506	1,273	△3,780		
_	-	_	_	_		
-	-	-	-	-		

⁽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)

	平	成21年度	第2四半期	(上半期)ラ	ŧ
区 分	貸借対照	時価	差	損	益
	表計上額			うち差益	うち差損
金銭の信託	10	10	-	-	_

			(半世	<u>. 日刀口</u>		
平成20年度末						
貸借対照	時価	差	損	益		
表計上額			うち差益	うち差損		
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、外貨建資産の買入・売却等に備える目的、および保有外貨建資産の為替リスクを回避する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21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	7	9,417	-	-	-	9,425
ヘッジ会計非適用分	-	0	△354	-	-	△353
合計	7	9,418	△354	ı	-	9,072

(注)平成21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9,418百万円) 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20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	$\triangle 52$	4,949	-	-	-	4,896
ヘッジ会計非適用分	-	-	△8,208	-	-	△8,208
合計	△52	4,949	△8,208	_	_	△3,312

(注) 平成20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4,949百万円) 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(全社計)

(単位:百万円)

区		平成21年度第2四半期(上半期)末				
	種 類		額等	n-l- /m²	74 TO 74	
分	金利先渡契約		うち1年超	時価	差損益	
	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	-	-			
店頭		(-)		-	-	
<u> </u>	金利スワップ					
	固定金利受取	3,500	3,500	7	7	
	/変動金利支払					
	固定金利支払	_	_	_	_	
	/変動金利受取					
	変動金利受取	_	_	_	_	
	/変動金利支払					
	その他					
	売建					
	元建	-	_	-	_	
	DE 7-h.	(-)				
	買建	-	_	_	_	
		(-)				
	合 計				7	

	(単位:日万円)							
	平成20	年度末						
契約		nda /m²	24 IB V					
	うち1年超	時価	差損益					
_	_	_						
_	_	_	_					
_	_							
()								
(-)		_	_					
-	-							
(-)		_	_					
(/								
-	-							
(-)		_	_					
` /								
_	_							
(-)		-	-					
3,500	3,500	△52	△52					
3,300	3,300	△52	△32					
-	-	-	-					
_	_	_	_					
_	_	_	_					
(-)								
-	-	-	_					
(-)								
(-)								
			$\triangle 52$					

平成21年度第2四半期(上半期)末 金利スワップ残存期間別残高

		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		1	2,500	_	1,000	_	-	3,500
	平均受取固定金利	-	1.14	-	1.30	-	-	1.18
	平均支払変動金利	ı	0.01	_	0.59	_	-	0.18
支払側固定	スワップ想定元本	1	_	_	_	_	_	-
	平均支払固定金利	-	-	-	-	-	-	-
	平均受取変動金利	1	-	-	-	-	-	-
合計		-	2,500	_	1,000	-	_	3,500

⁽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。

③通貨関連(全社計)

(単位:百万円)

		平成21年度第2四半期(上半期)末				
区 分	種 類	契約額等				
		Ī	うち1年超	時価	差損益	
	通貨先渡契約					
	売建	-	-	-	-	
	買建	-	-	-	-	
	為替予約					
	売建	289,720	-	280,302	9,417	
	うち米ドル	238,999	-	230,176	8,822	
	うちユーロ	50,721	-	50,125	595	
	買建	115	-	116	(
	うち米ドル	28	-	28	(
	うちユーロ	87	-	87	(
	通貨オプション					
	売建					
	コール	-	-			
店頭		(-)		-	-	
珙	プット	_	-			
		(-)		-	-	
	買建					
	コール	_	_			
		(-)		_	-	
	プット	_	_			
		(-)		-	_	
	通貨スワップ	_	_	_	_	
	その他					
	売建	_	_	_	_	
	2 = 1 =	(-)				
	買建	_	_	_	-	
		(-)				
4	· 計				9,418	

平成20年度末						
契約額等						
	うち1年超	時価	差損益			
-	-	-	-			
-	-	-	-			
294,733	-	289,783	4,949			
246,049	-	243,259	2,790			
48,683	-	46,524	2,158			
-	-	-	-			
-	-	-	-			
-	-	-	-			
-	-					
(-)		-	-			
-	-					
(-) - (-)		-	-			
-	-					
(-)		-	-			
-	-					
(-) - (-)		-	_			
-	-	-	-			
-	-	-	-			
(-)						
-	-	-	-			
(-)						
			4,949			

- (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、制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に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)

(単位:百万円)

		平成21年度第2四半期(上半期)末				
区 分	種 類	契約	額等			
			うち1年超	時価	差損益	
	先渡契約					
	売建	-	-	-	-	
	買建	-	-	-	-	
	オプション					
	売建					
	コール	-	-			
		(-)		-	-	
	プット	-	-			
rt-		(-)		-	-	
店頭	買建					
政	コール	-	-			
		(-)		-	-	
	プット	99,988	-			
		(354)		0	△354	
	その他					
	売建	-	-			
		(-)		-	-	
	買建	-	-			
		(-)		-	-	
É	合 計 △354					
(注)	(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。					

(注)括弧内には、	貸借対照表に計し	上したオプション料	を記載しています。

平成20年度末					
契約	額等				
うち1年超		時価	差損益		
-	-	-	-		
-	-	-	-		
-	-				
(-)		-	-		
-	-				
(-)		-	-		
-	-				
(-)		-	-		
400,005	-				
(21,631)		13,422	△8,208		
-	-				
(-)		-	-		
-	-				
(-)		-	-		
			△8,208		

⑤債券関連(全社計) 平成21年度第2四半期(上半期)末、平成20年度末とも保有していません。

IV. 貸倒引当金残高の内訳

区 分	平成21年度 第2四半期(上半期)末	平成20年度末	比 較	
貸倒引当金	6,213	955	5,257	
一般貸倒引当金	204	167	37	
個別貸倒引当金	6,009	788	5,220	
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20年度 第2四半期(上半期)末	平成21年度 第2四半期(上半期)末	平成20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。