

平成26年度第2四半期（上半期）報告 補足資料

1. 一般勘定

(1) 商品有価証券関係	・・・	1
① 商品有価証券明細表	・・・	1
② 商品有価証券売買高	・・・	1
(2) 有価証券関係	・・・	1
① 有価証券明細表	・・・	1
② 有価証券残存期間別残高	・・・	2
③ 地域別地方債保有内訳	・・・	2
④ 公社債及び外国公社債格付別内訳	・・・	3
⑤ 株式業種別内訳	・・・	3
(3) 貸付金関係	・・・	4
① 貸付金明細表	・・・	4
② 貸付金企業規模別内訳	・・・	4
③ 貸付金業種別内訳	・・・	5
④ 貸付金担保別内訳	・・・	6
⑤ 貸付金地域別内訳	・・・	6
⑥ 一般貸付金残存期間別残高	・・・	6
(4) 海外投融資関係	・・・	7
① 資産別明細	・・・	7
② 外貨建資産の通貨別構成	・・・	8
③ 海外投融資の地域別構成	・・・	8
(5) デリバティブ取引の状況	・・・	9

2. 個人変額保険特別勘定

(1) 売買目的有価証券の評価損益	・・・	13
(2) デリバティブ取引の状況	・・・	13

3. 会社計

(1) 資産構成	・・・	14
(2) 売買目的有価証券の評価損益	・・・	14
(3) 有価証券の時価情報	・・・	15
(4) 金銭の信託の時価情報	・・・	16
(5) デリバティブ取引の状況	・・・	16

1. 一般勘定

(1) 商品有価証券関係

① 商品有価証券明細表

平成25年度末、平成26年度上半期末に該当の残高はありません。

② 商品有価証券売買高

平成25年度上半期、平成26年度上半期に該当はありません。

(2) 有価証券関係

① 有価証券明細表

(単位:億円、%)

区分	平成25年度末		平成26年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
公社債	216,668	50.1	220,662	48.5
国債	172,444	39.9	177,865	39.1
地方債	15,221	3.5	14,926	3.3
社債	29,002	6.7	27,870	6.1
(うち公社・公団債)	(14,839)	(3.4)	(14,096)	(3.1)
株式	71,456	16.5	74,546	16.4
外国証券	138,760	32.1	151,574	33.3
公社債	102,258	23.6	113,396	24.9
株式等	36,501	8.4	38,178	8.4
その他の証券	5,822	1.3	7,809	1.7
合計	432,707	100.0	454,594	100.0
うち劣後債券	123	0.0	271	0.1

②有価証券残存期間別残高

(単位:億円)

区分		1年以下	1年超 3年以下	3年超 5年以下	5年超 7年以下	7年超 10年以下	10年超 (期間の定めのないものを含む)	合計
平成 25 年度 末	国債	2,444	9,205	6,441	6,287	17,259	130,805	172,444
	地方債	1,186	5,013	2,102	1,540	67	5,311	15,221
	社債	2,128	5,637	4,746	1,168	2,124	13,197	29,002
	株式						71,456	71,456
	外国証券	2,337	7,137	7,997	12,906	14,862	93,518	138,760
	公社債	2,257	7,137	7,843	12,558	14,218	58,242	102,258
	株式等	80	0	153	347	644	35,275	36,501
	その他の証券	186	55	399	570	1,484	3,126	5,822
	買入金銭債権	353	100	40	91	488	4,632	5,706
	譲渡性預金	2,349	—	—	—	—	—	2,349
	合計	10,986	27,150	21,728	22,563	36,288	322,046	440,763
平成 26 年度 上半 期末	国債	2,590	9,578	5,933	5,726	21,438	132,597	177,865
	地方債	898	5,031	2,516	627	44	5,807	14,926
	社債	2,278	5,122	4,006	1,076	2,132	13,252	27,870
	株式						74,546	74,546
	外国証券	2,641	8,412	10,866	13,883	13,668	102,102	151,574
	公社債	2,604	8,401	10,620	13,414	13,198	65,156	113,396
	株式等	37	11	246	469	469	36,945	38,178
	その他の証券	198	348	132	716	1,619	4,794	7,809
	買入金銭債権	259	71	29	163	374	4,347	5,246
	譲渡性預金	2,699	—	—	—	—	—	2,699
	合計	11,567	28,564	23,485	22,194	39,278	337,448	462,540

③地域別地方債保有内訳

(単位:億円、%)

区分	平成25年度末		平成26年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
北海道	18	0.1	—	—
東北	93	0.6	93	0.6
関東	7,587	49.8	7,585	50.8
中部	3,233	21.2	3,110	20.8
近畿	157	1.0	146	1.0
中国	314	2.1	303	2.0
四国	—	—	—	—
九州	1,118	7.3	1,021	6.8
その他	2,698	17.7	2,664	17.8
合計	15,221	100.0	14,926	100.0

(注)上記「その他」は共同発行市場公募地方債です。

④公社債及び外国公社債格付別内訳

(単位:億円、%)

区分	平成25年度末		平成26年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
AAA	15,988	10.9	15,372	9.8
AA	100,790	68.8	109,370	70.0
A	16,109	11.0	17,568	11.2
BBB	7,346	5.0	7,824	5.0
BB以下	79	0.1	79	0.1
格付なし	6,168	4.2	5,977	3.8
合計	146,482	100.0	156,193	100.0

(注) 1. 上記公社債残高は日本国債の残高を除いています。(平成25年度末:17兆2,444億円、平成26年度上半期末:17兆7,865億円)
2. 上記は外部の格付業者の格付に基づき作成しています。

⑤株式業種別内訳

(単位:億円、%)

区分	平成25年度末		平成26年度上半期末		
	金額	占率	金額	占率	
水産・農林業	27	0.0	26	0.0	
鉱業	36	0.1	62	0.1	
建設業	1,107	1.5	1,187	1.6	
製造業	食料品	2,192	3.1	2,429	3.3
	繊維製品	916	1.3	944	1.3
	パルプ・紙	243	0.3	208	0.3
	化学	5,641	7.9	6,461	8.7
	医薬品	6,120	8.6	6,130	8.2
	石油・石炭製品	233	0.3	231	0.3
	ゴム製品	844	1.2	875	1.2
	ガラス・土石製品	734	1.0	715	1.0
	鉄鋼	1,653	2.3	1,716	2.3
	非鉄金属	764	1.1	832	1.1
	金属製品	409	0.6	391	0.5
	機械	4,301	6.0	4,755	6.4
	電気機器	8,516	11.9	9,261	12.4
	輸送用機器	11,999	16.8	12,631	16.9
精密機器	1,169	1.6	1,214	1.6	
その他製品	793	1.1	807	1.1	
電気・ガス業	3,828	5.4	3,770	5.1	
運輸・情報通信業	陸運業	4,237	5.9	4,602	6.2
	海運業	101	0.1	83	0.1
	空運業	81	0.1	83	0.1
	倉庫・運輸関連業	129	0.2	134	0.2
	情報・通信業	1,104	1.5	1,051	1.4
商業	卸売業	2,553	3.6	2,805	3.8
	小売業	1,827	2.6	1,888	2.5
金融・保険業	銀行業	6,174	8.6	5,495	7.4
	証券、商品先物取引業	668	0.9	619	0.8
	保険業	1,040	1.5	1,061	1.4
	その他金融業	451	0.6	466	0.6
不動産業	489	0.7	467	0.6	
サービス業	1,060	1.5	1,132	1.5	
合計	71,456	100.0	74,546	100.0	

(3) 貸付金関係

① 貸付金明細表

(単位:億円)

区分	平成25年度末	平成26年度上半期末
保険約款貸付	7,822	7,588
保険料振替貸付	606	579
契約者貸付	7,216	7,009
一般貸付	77,466	76,066
企業貸付	56,772	55,628
国内	54,987	54,004
海外	1,784	1,623
国・国際機関・政府関係機関・ 公共団体・公企業貸付	5,738	5,645
国内	5,084	4,992
海外	654	652
住宅ローン	9,066	8,973
消費者ローン	5,237	5,147
その他	651	672
合 計	85,289	83,655
非居住者貸付	2,439	2,276

② 貸付金企業規模別内訳

(単位:件、億円、%)

区分	平成25年度末		平成26年度上半期末		
		占率		占率	
大企業	貸付先数	969	42.3	951	40.8
	金額	49,592	90.2	48,341	89.5
中堅企業	貸付先数	322	14.0	317	13.6
	金額	728	1.3	732	1.4
中小企業	貸付先数	1,002	43.7	1,062	45.6
	金額	4,666	8.5	4,930	9.1
国内企業計	貸付先数	2,293	100.0	2,330	100.0
	金額	54,987	100.0	54,004	100.0

(注) 1. 業種の区分は以下のとおりです。

2. 貸付先数とは、各貸付先を名寄せした結果の債務者数をいい、貸付件数ではありません。

業種	①右の②～④を除く 全業種		②小売業、飲食業		③サービス業		④卸売業	
大企業	常用する 従業員 300名超	資本金 10億円以上	常用する 従業員 50名超	資本金 10億円以上	常用する 従業員 100名超	資本金 10億円以上	常用する 従業員 100名超	資本金 10億円以上
中堅企業		かつ 資本金 3億円超 10億円未満		かつ 資本金 5千万円超 10億円未満		かつ 資本金 5千万円超 10億円未満		かつ 資本金 1億円超 10億円未満
中小企業	資本金3億円以下又は 常用する従業員300名以下		資本金5千万円以下又は 常用する従業員50名以下		資本金5千万円以下又は 常用する従業員100名以下		資本金1億円以下又は 常用する従業員100名以下	

③貸付金業種別内訳

(単位:億円、%)

区分		平成25年度末		平成26年度上半期末	
		金額	占率	金額	占率
国内向け	製造業	15,218	19.6	14,651	19.3
	食料	1,040	1.3	1,041	1.4
	繊維	475	0.6	469	0.6
	木材・木製品	18	0.0	20	0.0
	パルプ・紙	954	1.2	956	1.3
	印刷	203	0.3	198	0.3
	化学	3,020	3.9	2,862	3.8
	石油・石炭	810	1.0	853	1.1
	窯業・土石	486	0.6	461	0.6
	鉄鋼	2,214	2.9	2,030	2.7
	非鉄金属	272	0.4	210	0.3
	金属製品	167	0.2	169	0.2
	はん用・生産用・業務用機械	1,455	1.9	1,419	1.9
	電気機械	1,436	1.9	1,399	1.8
	輸送用機械	2,200	2.8	2,118	2.8
	その他の製造業	462	0.6	440	0.6
	農業、林業	0	0.0	0	0.0
	漁業	20	0.0	20	0.0
	鉱業、採石業、砂利採取業	81	0.1	87	0.1
	建設業	445	0.6	381	0.5
	電気・ガス・熱供給・水道業	11,715	15.1	11,920	15.7
	情報通信業	1,830	2.4	1,748	2.3
	運輸業、郵便業	7,196	9.3	6,984	9.2
	卸売業	9,064	11.7	8,978	11.8
	小売業	531	0.7	546	0.7
	金融業、保険業	6,184	8.0	5,749	7.6
	不動産業	3,676	4.7	3,798	5.0
物品賃貸業	2,429	3.1	2,460	3.2	
学術研究、専門・技術サービス業	19	0.0	18	0.0	
宿泊業	52	0.1	45	0.1	
飲食業	46	0.1	40	0.1	
生活関連サービス業、娯楽業	274	0.4	270	0.4	
教育、学習支援業	23	0.0	20	0.0	
医療・福祉	18	0.0	13	0.0	
その他のサービス	38	0.0	53	0.1	
地方公共団体	1,852	2.4	1,877	2.5	
個人(住宅・消費・納税資金等)	14,308	18.5	14,123	18.6	
合 計	75,027	96.9	73,790	97.0	
海外向け	政府等	654	0.8	652	0.9
	金融機関	250	0.3	200	0.3
	商工業(等)	1,534	2.0	1,423	1.9
	合 計	2,439	3.1	2,276	3.0
総 合 計	77,466	100.0	76,066	100.0	

④貸付金担保別内訳

(単位:億円、%)

区分	平成25年度末		平成26年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
担保貸付	397	0.5	383	0.5
有価証券担保貸付	109	0.1	96	0.1
不動産・動産・財団担保貸付	238	0.3	227	0.3
指名債権担保貸付	49	0.1	59	0.1
保証貸付	2,149	2.8	2,009	2.6
信用貸付	60,616	78.2	59,552	78.3
その他	14,304	18.5	14,121	18.6
一般貸付計	77,466	100.0	76,066	100.0
うち劣後特約付貸付	2,950	3.8	2,550	3.4

⑤貸付金地域別内訳

(単位:億円、%)

区分	平成25年度末		平成26年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
北海道	696	1.3	651	1.2
東北	1,286	2.3	1,242	2.3
関東	35,283	64.2	34,616	64.1
中部	5,136	9.3	5,124	9.5
近畿	8,370	15.2	8,279	15.3
中国	1,515	2.8	1,496	2.8
四国	1,064	1.9	956	1.8
九州	1,633	3.0	1,636	3.0
合計	54,987	100.0	54,004	100.0

(注) 1. 個人ローン、非居住者貸付、保険約款貸付等は含んでいません。
2. 地域区分は、貸付先の本社所在地によります。

⑥一般貸付金残存期間別残高

(単位:億円)

区分	1年以下	1年超 3年以下	3年超 5年以下	5年超 7年以下	7年超 10年以下	10年超 (期間の定めのないものを含む)	合計
	平成25年度末						
固定金利	8,811	15,424	13,406	9,709	10,000	16,579	73,932
変動金利	375	554	601	365	506	1,131	3,534
一般貸付計	9,186	15,979	14,008	10,075	10,507	17,710	77,466
平成26年度上半期末							
固定金利	8,236	16,307	12,301	9,582	9,365	16,839	72,631
変動金利	366	558	624	347	501	1,036	3,434
一般貸付計	8,602	16,865	12,925	9,930	9,867	17,875	76,066

(4)海外投融資関係

①資産別明細

・外貨建資産

(単位:億円、%)

区分	平成25年度末		平成26年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
公社債	92,320	63.9	103,783	65.9
株式	4,499	3.1	5,455	3.5
現預金・その他	19,908	13.8	20,552	13.0
小計	116,728	80.8	129,791	82.4

・円貨額が確定した外貨建資産

(単位:億円、%)

区分	平成25年度末		平成26年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
公社債	—	—	—	—
現預金・その他	2,051	1.4	1,860	1.2
小計	2,051	1.4	1,860	1.2

・円貨建資産

(単位:億円、%)

区分	平成25年度末		平成26年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
非居住者貸付	1,211	0.8	1,139	0.7
公社債(円建外債)・その他	24,546	17.0	24,794	15.7
小計	25,757	17.8	25,934	16.5

・合計

(単位:億円、%)

区分	平成25年度末		平成26年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
海外投融資	144,537	100.0	157,587	100.0
(うち海外不動産)	(1,992)	(1.4)	(1,887)	(1.2)

(注)「円貨額が確定した外貨建資産」とは、為替予約等が付されていることにより決済時の円貨額が確定し、当該円貨額を資産の貸借対照表計上額としているものです。

②外貨建資産の通貨別構成

(単位:億円、%)

区分	平成25年度末		平成26年度上半期末	
	金額	占率	金額	占率
米ドル	63,694	54.6	73,429	56.6
ユーロ	25,678	22.0	27,212	21.0
イギリスポンド	14,692	12.6	15,786	12.2
オーストラリアドル	6,886	5.9	6,224	4.8
ポーランドズロチ	3,401	2.9	3,442	2.7
香港ドル	766	0.7	936	0.7
その他	1,607	1.4	2,760	2.1
合計	116,728	100.0	129,791	100.0

(注) 内訳は、平成26年度上半期末における残高上位6通貨を表示しています。

③海外投融資の地域別構成

(単位:億円、%)

区分	外国証券						非居住者貸付		
			公社債		株式等				
	金額	占率	金額	占率	金額	占率	金額	占率	
平成25年度末	北米	53,051	38.2	49,587	48.5	3,463	9.5	1,228	50.3
	ヨーロッパ	47,943	34.6	42,267	41.3	5,676	15.6	580	23.8
	オセアニア	4,284	3.1	4,252	4.2	31	0.1	55	2.3
	アジア	3,556	2.6	1,786	1.7	1,770	4.8	10	0.4
	中南米	27,968	20.2	2,409	2.4	25,559	70.0	188	7.7
	中東	—	—	—	—	—	—	—	—
	アフリカ	—	—	—	—	—	—	57	2.3
	国際機関	1,955	1.4	1,955	1.9	—	—	320	13.1
	合計	138,760	100.0	102,258	100.0	36,501	100.0	2,439	100.0
平成26年度上半期末	北米	61,416	40.5	57,367	50.6	4,048	10.6	1,136	49.9
	ヨーロッパ	50,345	33.2	44,287	39.1	6,058	15.9	530	23.3
	オセアニア	4,374	2.9	4,342	3.8	32	0.1	53	2.3
	アジア	4,648	3.1	2,224	2.0	2,423	6.3	10	0.4
	中南米	28,997	19.1	3,382	3.0	25,615	67.1	172	7.6
	中東	—	—	—	—	—	—	—	—
	アフリカ	—	—	—	—	—	—	54	2.4
	国際機関	1,792	1.2	1,792	1.6	—	—	320	14.1
	合計	151,574	100.0	113,396	100.0	38,178	100.0	2,276	100.0

(注) 海外投融資のうち、外国証券、非居住者貸付を対象としています。

(5) デリバティブ取引の状況

[定性的情報]

(a) 取引の内容

当社が利用対象としているデリバティブ取引は次の取引です。

金利関連：金利先物取引、金利スワップ取引、スワップション取引等

通貨関連：為替予約取引、通貨オプション取引、通貨スワップ取引等

株式関連：株価指数先物取引、株価指数オプション取引、株券オプション取引等

債券関連：債券先物取引、債券先物オプション取引、選択権付債券売買取引等

(b) 取組方針

効率的な資産運用を図る観点から、主として現物資産運用のリスクをコントロールする目的でデリバティブを活用しています。

(c) 利用目的

ご契約者よりお預かりした資産の安定運用のため、主として保有資産に係る市場リスクのヘッジを目的として利用しています。

(d) リスクの内容

当社が行っているデリバティブ取引については、市場リスク（金利・為替・株式等の変動によるリスク）及び信用リスク（取引相手が倒産等により契約不履行に陥るリスク）があります。市場リスクについては、デリバティブ取引は主として現物資産運用のリスクをコントロールすることを目的としていることから、限定的であると認識しています。また、信用リスクについても、国内外の金融商品取引所を通じた取引か、信用度の高い取引先を相手としており、契約が履行されないリスクは小さいものと認識しています。

(e) リスク管理体制

デリバティブ取引の目的や種類ごとに必要となる取引限度枠等を規定するとともに、その取引については、事務部門（バックオフィス）が外部証票との照合により内容を確認する等、投融資執行部門（フロントオフィス）に対しての牽制が働く体制としています。また、現物資産も併せた市場リスクを定量的に把握・分析し、そのリスク量とともにポジション、損益状況を定期的に「運用リスク管理専門委員会」に報告する体制になっています。

(f) 定量的情報に関する補足説明

ア) 想定元本（契約金額）に関する補足説明

スワップ取引に係る想定元本やオプション取引の契約金額は、金利交換等に係る名目的なものであり、信用リスク量を示すものではありません。

デリバティブ取引の信用リスクとは、取引相手先がデフォルトした際に、市場で同じポジションを再構築するための潜在的なコストを意味しており、当社ではカレントエクスポージャー方式により算出しています。

○信用リスク相当額

(単位：億円)

	平成25年度末		平成26年度上半期末	
	想定元本 (契約金額)	信用リスク 相当額	想定元本 (契約金額)	信用リスク 相当額
金利スワップ等	—	—	—	—
通貨スワップ	7,751	543	11,013	773
為替予約	59,948	684	63,841	677
金利オプション(買)	—	—	—	—
通貨オプション(買)	—	—	—	—
株価指数先物	—	—	1,058	63
その他の金融派生商品	2	0	2	0
合計	67,702	1,228	75,915	1,515

(注)「外貨建債権債務等」に充当された通貨関連デリバティブを除く。

イ) 時価算定に係る補足説明

[先物取引等の市場取引]

期末日の清算値または終値

[株式オプション取引]

外部情報ベンダー等より入手したボラティリティ等を基準として、当社で算出した理論価格

[為替予約取引、通貨オプション取引]

取引相手の金融機関等より入手したTTM、割引レート等を基準として、当社で算出した理論価格

[金利スワップ取引、通貨スワップ取引]

公表されている市場金利等を基準として、将来のキャッシュフロー差額を現在価値に割り引いた理論価格

ウ) 差損益に関する補足説明

当社では、デリバティブ取引を主として現物資産のかかえる市場リスクのコントロールを行うための補完手段として活用しています。

例えば、為替予約、通貨オプション取引については、主として為替リスクをヘッジするために活用しており、外国債券・外国株式等の外貨建資産全体の損益と合計で見する必要があります。

(g) ヘッジ会計の方法

ヘッジの手法については、時価ヘッジ、繰延ヘッジ、金利スワップの特例処理、為替予約及び通貨スワップの振当処理を行っています。ヘッジの有効性の判定は、リスク管理方針に基づき、主にヘッジ対象とヘッジ手段の時価変動を比較する比率分析によっております。

[定量的情報(一般勘定)](ヘッジ会計適用・非適用分合算値)

1. 差損益の内訳(ヘッジ会計適用分・非適用分の内訳)(平成26年度上半期末)

(単位:億円)

区分	金利関連	通貨関連	株式関連	債券関連	その他	合計
ヘッジ会計適用分	—	△3,765	—	—	—	△3,765
ヘッジ会計非適用分	—	△31	△22	—	—	△53
合計	—	△3,796	△22	—	—	△3,818

(注) ヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ適用分の差損益、及びヘッジ会計非適用分のうちヘッジ会計の中止に伴う繰延ヘッジ損益の未償却額を除いた差損益は、損益計算書に計上しています。

2. 金利関連

平成25年度末、平成26年度上半期末に該当の残高はありません。

3. 通貨関連

(単位:億円)

区分	種類	平成25年度末			平成26年度上半期末				
		契約額等	うち1年超	時価	差損益	契約額等	うち1年超	時価	差損益
店頭	為替予約								
	売建	59,091	—	59,940	△848	61,760	—	63,116	△1,356
	米ドル	33,644	—	33,820	△176	36,919	—	37,947	△1,028
	ユーロ	11,672	—	11,789	△117	11,631	—	11,731	△100
	買建	7	—	7	0	758	—	724	△33
	米ドル	7	—	7	0	121	—	121	0
	ユーロ	0	—	0	0	30	—	30	△0
	通貨オプション								
	売建								
	コール	—	—	—	—	—	—	—	—
	米ドル	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—
	プット	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	米ドル	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	ユーロ	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	買建								
	コール	—	—	—	—	—	—	—	—
	米ドル	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—
	プット	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
米ドル	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	
ユーロ	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	
通貨スワップ									
米ドル	7,751	7,751	△1,935	△1,935	11,013	10,916	△2,407	△2,407	
ユーロ	3,606	3,606	△695	△695	6,375	6,375	△1,009	△1,009	
合計	3,656	3,656	△1,166	△1,166	3,847	3,750	△1,273	△1,273	
				△2,784				△3,796	

(注) 1.()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. 「差損益」欄には、先渡取引については契約額等と時価との差額を記載し、オプション取引についてはオプション料と時価との差額を記載し、スワップ取引については時価(現在価値)を記載しています。

4. 株式関連

(単位:億円)

区分	種類	平成25年度末				平成26年度上半期末			
		契約額等		時価	差損益	契約額等		時価	差損益
			うち1年超				うち1年超		
取引所	株価指数先物								
	売建	—	—	—	—	1,036	—	1,058	△22
	買建	—	—	—	—	—	—	—	—
店頭	株式先渡契約								
	売建	—	—	—	—	—	—	—	—
	買建	—	—	—	—	—	—	—	—
	株式オプション								
	売建								
	コール	—	—	—	—	—	—	—	—
		(—)	(—)			(—)	(—)		
	プット	—	—	—	—	—	—	—	—
		(—)	(—)			(—)	(—)		
	買建								
コール	2	2	0	0	2	2	0	0	
	(0)	(0)			(0)	(0)			
プット	—	—	—	—	—	—	—	—	
	(—)	(—)			(—)	(—)			
合計				0				△22	

(注) 1. ()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. 「差損益」欄には、先物取引及び先渡取引については契約額等と時価との差額を記載し、オプション取引についてはオプション料と時価との差額を記載しています。

5. 債券関連

平成25年度末、平成26年度上半期末に該当の残高はありません。

6. その他

平成25年度末、平成26年度上半期末に該当の残高はありません。

2. 個人変額保険特別勘定

(1) 売買目的有価証券の評価損益

(単位:億円)

区分	平成25年度末		平成26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	1,049	29	1,077	25

(2) デリバティブ取引の状況(個人変額保険特別勘定)

1. 差損益の内訳(ヘッジ会計適用分・非適用分の内訳)(平成26年度上半期末)

(単位:億円)

区分	金利関連	通貨関連	株式関連	債券関連	その他	合計
ヘッジ会計適用分	—	—	—	—	—	—
ヘッジ会計非適用分	—	0	△0	—	—	0
合計	—	0	△0	—	—	0

(注) ヘッジ会計非適用分の差損益は、損益計算書に計上しています。

2. 金利関連

平成25年度末、平成26年度上半期末に該当の残高はありません。

3. 通貨関連

(単位:億円)

区分	種類	平成25年度末				平成26年度上半期末			
		契約額等		時価	差損益	契約額等		時価	差損益
			うち1年超				うち1年超		
店頭	為替予約								
	売建	32	—	32	0	52	—	52	△0
	米ドル	9	—	9	△0	13	—	13	△0
	ユーロ	18	—	18	0	31	—	32	△0
	買建	32	—	32	0	74	—	75	1
	米ドル	23	—	23	0	45	—	46	0
	ユーロ	4	—	4	△0	11	—	11	△0
合計				0				0	

(注) 「差損益」欄には、先渡取引については、契約額等と時価との差額を記載しています。

4. 株式関連

(単位:億円)

区分	種類	平成25年度末				平成26年度上半期末			
		契約額等		時価	差損益	契約額等		時価	差損益
			うち1年超				うち1年超		
取引所	株価指数先物								
	売建	0	—	0	△0	—	—	—	—
	買建	18	—	19	0	36	—	36	△0
合計				0				△0	

(注) 「差損益」欄には、先物取引については、契約額等と時価との差額を記載しています。

5. 債券関連

平成25年度末、平成26年度上半期末に該当の残高はありません。

6. その他

平成25年度末、平成26年度上半期末に該当の残高はありません。

3. 会社計

(1) 資産構成(会社計)

(単位:億円)

区分	平成26年度上半期末	
		うち一般勘定
現預金・コールローン	8,200	7,719
買現先勘定	—	—
買入金銭債権	5,246	5,246
商品有価証券	—	—
金銭の信託	—	—
公社債	224,591	220,662
株式	76,643	74,546
外国証券	155,457	151,574
貸付金	83,655	83,655
不動産	17,117	17,117
資産計	587,541	575,118
うち外貨建資産	133,873	129,791

(2) 売買目的有価証券の評価損益(会社計)

(単位:億円)

区分	平成25年度末		平成26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	10,982	72	11,245	149

(注) 1. 売買目的有価証券に含まれる金銭の信託の貸借対照表計上額及び当期の損益に含まれた評価損益には、デリバティブ取引に係る差損益を含んでいます。
2. 売買目的有価証券に含まれる金銭の信託内で有している現預金及びコールローンは含んでいません。

(3) 有価証券の時価情報(会社計) (売買目的有価証券以外の有価証券のうち時価のあるもの)

(単位:億円)

区分	平成25年度末					平成26年度上半期末				
	帳簿価額	時価	差損益			帳簿価額	時価	差損益		
			差益	差損	差益			差損		
責任準備金対応債券	201,363	219,363	18,000	18,087	△87	203,539	224,502	20,963	20,975	△12
満期保有目的の債券	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
子会社・関連会社株式	77	617	540	540	—	77	681	604	604	—
その他有価証券	180,158	226,772	46,614	47,791	△1,177	187,744	246,757	59,012	59,624	△611
公社債	20,563	21,550	987	998	△10	21,670	22,909	1,238	1,238	△0
株式	40,819	69,112	28,293	29,232	△939	38,983	73,208	34,224	34,753	△528
外国証券	111,097	127,931	16,834	17,049	△215	117,500	140,134	22,634	22,717	△82
公社債	90,312	101,438	11,126	11,315	△189	96,920	112,577	15,656	15,702	△45
株式等	20,785	26,493	5,708	5,733	△25	20,579	27,557	6,977	7,014	△36
その他の証券	5,048	5,547	499	511	△12	6,611	7,526	914	915	△0
買入金銭債権	280	280	△0	—	△0	279	279	0	0	△0
譲渡性預金	2,350	2,349	△0	0	△0	2,700	2,699	△0	0	△0
合 計	381,599	446,754	65,154	66,419	△1,265	391,361	471,941	80,580	81,204	△624
公社債	215,680	234,215	18,534	18,632	△97	219,424	241,188	21,764	21,776	△11
株式	40,819	69,112	28,293	29,232	△939	38,983	73,208	34,224	34,753	△528
外国証券	111,994	129,408	17,414	17,629	△215	118,396	141,676	23,280	23,363	△82
公社債	91,132	102,297	11,165	11,354	△189	97,739	113,438	15,698	15,744	△45
株式等	20,862	27,111	6,248	6,274	△25	20,656	28,238	7,581	7,618	△36
その他の証券	5,048	5,547	499	511	△12	6,611	7,526	914	915	△0
買入金銭債権	5,706	6,119	413	414	△0	5,246	5,641	395	396	△0
譲渡性預金	2,350	2,349	△0	0	△0	2,700	2,699	△0	0	△0

(注) 本表には、金融商品取引法上の有価証券として取り扱うことが適当と認められるもの等を含んでいます。

○時価を把握することが極めて困難と認められる有価証券の帳簿価額は以下のとおりです。

(単位:億円)

区分	平成25年度末	平成26年度上半期末
責任準備金対応債券	—	—
満期保有目的の債券	—	—
非上場外国債券	—	—
その他	—	—
子会社・関連会社株式	2,319	2,788
その他有価証券	9,942	9,024
非上場国内株式(店頭売買株式を除く)	1,965	960
非上場外国株式(店頭売買株式を除く)	6,224	6,204
非上場外国債券	—	—
その他	1,751	1,859
合 計	12,261	11,813

(注) 時価を把握することが極めて困難と認められる有価証券のうち、外貨建資産について為替を評価した差損益は次のとおりです。(平成25年度末:428億円、平成26年度上半期末:592億円)

(4) 金銭の信託の時価情報(会社計)

・運用目的の金銭の信託

平成25年度末、平成26年度上半期末に該当の残高はありません。

・責任準備金対応、満期保有目的、その他の金銭の信託

平成25年度末、平成26年度上半期末に該当の残高はありません。

(5) デリバティブ取引の状況(会社計)

1. 差損益の内訳(ヘッジ会計適用分・非適用分の内訳)(平成26年度上半期末)

(単位:億円)

区分	金利関連	通貨関連	株式関連	債券関連	その他	合計
ヘッジ会計適用分	—	△3,765	—	—	—	△3,765
ヘッジ会計非適用分	—	△30	△20	—	—	△51
合計	—	△3,796	△20	—	—	△3,817

(注) ヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ適用分の差損益、及びヘッジ会計非適用分のうちヘッジ会計の中止に伴う繰延ヘッジ損益の未償却額を除いた差損益は、損益計算書に計上しています。

2. ヘッジ会計が適用されていないもの

(a) 金利関連

平成25年度末、平成26年度上半期末に該当の残高はありません。

(b) 通貨関連

(単位:億円)

区分	種類	平成25年度末				平成26年度上半期末			
		契約額等	うち1年超	時価	差損益	契約額等	うち1年超	時価	差損益
店頭	為替予約								
	売建	1,915	—	1,928	△12	1,566	—	1,582	△15
	米ドル	726	—	730	△4	516	—	526	△9
	ユーロ	793	—	797	△4	532	—	535	△2
	買建	1,383	—	1,391	7	1,699	—	1,680	△19
	米ドル	740	—	743	3	642	—	653	11
	ユーロ	410	—	411	1	175	—	175	△0
	通貨オプション								
	売建								
	コール	—	—	—	—	—	—	—	—
	米ドル	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	ユーロ	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	プット	—	—	—	—	—	—	—	—
	米ドル	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	ユーロ	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	買建								
	コール	—	—	—	—	—	—	—	—
	米ドル	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	ユーロ	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	プット	—	—	—	—	—	—	—	—
	米ドル	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	ユーロ	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	通貨スワップ								
	米ドル	—	—	—	—	2,183	2,183	4	4
	ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—
	合計				△4				△30

(注) 1. ()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. 「差損益」欄には、先渡取引については契約額等と時価との差額を記載し、オプション取引についてはオプション料と時価との差額を記載し、スワップ取引については時価(現在価値)を記載しています。

(c) 株式関連

(単位:億円)

区分	種類	平成25年度末				平成26年度上半期末			
		契約額等	うち1年超	時価	差損益	契約額等	うち1年超	時価	差損益
取引所	株価指数先物								
	売建	124	—	125	△1	1,218	—	1,239	△20
	買建	98	—	100	2	93	—	93	△0
店頭	株式先渡契約								
	売建	—	—	—	—	—	—	—	—
	買建	—	—	—	—	—	—	—	—
	株式オプション								
	売建								
	コール	—	—	—	—	—	—	—	—
	プット	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
買建									
コール	2	2	0	0	2	2	0	0	
	(0)	(0)	—	—	(0)	(0)	—	—	
プット	—	—	—	—	—	—	—	—	
	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	
合計				1				△20	

(注) 1. ()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. 「差損益」欄には、先物取引及び先渡取引については契約額等と時価との差額を記載し、オプション取引についてはオプション料と時価との差額を記載しています。

(d) 債券関連

平成25年度末、平成26年度上半期末に該当の残高はありません。

(e) その他

平成25年度末、平成26年度上半期末に該当の残高はありません。

3. ヘッジ会計が適用されているもの

(a) 金利関連

平成25年度末、平成26年度上半期末に該当の残高はありません。

(b) 通貨関連

(単位:億円)

区分	ヘッジ会計の方法	種類	主なヘッジ対象	平成25年度末				平成26年度上半期末				
				契約額等	うち1年超	時価	差損益	契約額等	うち1年超	時価	差損益	
店頭	時価ヘッジ	為替予約	外貨建債券									
		売建		59,079	—	59,928	△848	61,362	—	62,716	△1,353	
		米ドル		33,635	—	33,812	△176	36,776	—	37,802	△1,026	
		ユーロ		11,672	—	11,789	△117	11,600	—	11,701	△100	
		買建		—	—	—	—	—	—	—	—	
		米ドル		—	—	—	—	—	—	—	—	
		ユーロ		—	—	—	—	—	—	—	—	
		通貨オプション										
		売建										
		コール		—	—	—	—	—	—	—	—	—
		米ドル		(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	—
		ユーロ		(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	—
		プット		—	—	—	—	—	—	—	—	—
		米ドル		(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	—
		ユーロ		(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	—
		買建		—	—	—	—	—	—	—	—	—
		コール		(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	—
		米ドル		(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	—
		ユーロ		(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	—
		プット		—	—	—	—	—	—	—	—	—
米ドル	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	—			
ユーロ	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	—			
繰延ヘッジ	通貨スワップ	外貨建債券	7,751	7,751	△1,935	△1,935	8,830	8,732	△2,411	△2,411		
	米ドル		3,606	3,606	△695	△695	4,191	4,191	△1,013	△1,013		
	ユーロ		3,656	3,656	△1,166	△1,166	3,847	3,750	△1,273	△1,273		
合計						△2,784				△3,765		

(注) 1. ()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. 「差損益」欄には、先渡取引については契約額等と時価との差額を記載し、オプション取引についてはオプション料と時価との差額を記載し、スワップ取引については時価(現在価値)を記載しています。

(c) 株式関連

平成25年度末、平成26年度上半期末に該当の残高はありません。

(d) 債券関連

平成25年度末、平成26年度上半期末に該当の残高はありません。

(e) その他

平成25年度末、平成26年度上半期末に該当の残高はありません。