

## 平成27年度中間決算 補足資料

### < 目 次 >

#### I. 一般勘定

1. 有価証券関係	
(1) 有価証券明細表	…… 1 頁
(2) 有価証券残存期間別残高	…… 1 頁
(3) 業種別株式保有明細表	…… 2 頁
(4) デリバティブ取引の時価情報	…… 3 頁
2. 貸付金関係	
(1) 貸付金明細表	…… 6 頁
(2) 貸付金残存期間別残高	…… 6 頁
(3) 国内企業向け貸付金企業規模別内訳	…… 7 頁
(4) 貸付金業種別内訳	…… 8 頁
(5) 貸付金地域別内訳	…… 9 頁
(6) 貸付金担保別内訳	…… 9 頁
3. 海外投融資関係	
(1) 資産別明細	…… 10 頁
(2) 外貨建資産の通貨別構成	…… 11 頁
(3) 海外投融資の地域別構成	…… 11 頁

#### II. 個人変額保険・変額個人年金保険特別勘定

1. 売買目的有価証券の評価損益	…… 12 頁
2. 有価証券の時価情報	…… 12 頁
3. 金銭の信託の時価情報	…… 12 頁
4. デリバティブ取引の時価情報	…… 13 頁

#### III. 会社計

1. 売買目的有価証券の評価損益	…… 15 頁
2. 有価証券の時価情報	…… 15 頁
3. 金銭の信託の時価情報	…… 17 頁
4. デリバティブ取引の時価情報	…… 18 頁

#### IV. その他

1. 資産査定状況等	…… 21 頁
2. 貸倒引当金の明細	…… 22 頁
3. 土地の時価情報	…… 22 頁

# I. 一般勘定

## 1. 有価証券関係

### (1) 有価証券明細表

(単位:百万円、%)

区 分	前事業年度末 (平成27年3月31日)		当中間会計期間末 (平成27年9月30日)	
	金額	占率	金額	占率
国債	2,354,641	50.4	2,339,798	49.7
地方債	229,800	4.9	226,561	4.8
社債	430,285	9.2	443,805	9.4
うち公社・公団債	303,093	6.5	301,430	6.4
株式	397,918	8.5	374,064	8.0
外国証券	1,236,356	26.5	1,287,304	27.3
公社債	1,003,525	21.5	1,036,020	22.0
株式等	232,830	5.0	251,284	5.3
その他の証券	22,306	0.5	37,782	0.8
合計	4,671,309	100.0	4,709,318	100.0

### (2) 有価証券残存期間別残高

(単位:百万円)

前事業年度末(平成27年3月31日)							
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	60,390	242,699	235,199	307,362	801,930	3,023,727	4,671,309
国債	14,867	62,508	87,613	120,018	298,752	1,770,881	2,354,641
地方債	3,266	4,306	6,139	-	27,202	188,886	229,800
社債	13,489	25,702	26,543	13,311	105,364	245,874	430,285
株式	-	-	-	-	-	397,918	397,918
外国証券	28,766	150,182	114,903	174,033	370,611	397,860	1,236,356
公社債	28,766	150,182	114,903	174,033	370,611	165,029	1,003,525
株式等	-	-	-	-	-	232,830	232,830
その他の証券	-	-	-	-	-	22,306	22,306
買入金銭債権	-	1,749	-	-	-	17,389	19,138
譲渡性預金	45,000	-	-	-	-	-	45,000
合計	105,390	244,448	235,199	307,362	801,930	3,041,116	4,735,447
当中間会計期間末(平成27年9月30日)							
有価証券	120,272	207,349	200,100	370,281	680,607	3,130,706	4,709,318
国債	37,236	53,119	68,750	134,904	203,860	1,841,925	2,339,798
地方債	1,739	5,502	3,776	1,787	24,880	188,874	226,561
社債	10,807	33,009	13,616	16,492	105,222	264,657	443,805
株式	-	-	-	-	-	374,064	374,064
外国証券	70,488	115,718	113,956	217,097	346,643	423,400	1,287,304
公社債	70,488	115,718	113,956	217,097	346,643	172,116	1,036,020
株式等	-	-	-	-	-	251,284	251,284
その他の証券	-	-	-	-	-	37,782	37,782
買入金銭債権	1,735	-	-	-	-	15,601	17,336
譲渡性預金	45,000	-	-	-	-	-	45,000
合計	167,008	207,349	200,100	370,281	680,607	3,146,308	4,771,654

(注)「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号)に基づく有価証券として取り扱うものを含んでいます。

## (3)業種別株式保有明細表

(単位:百万円、%)

区 分		前事業年度末 (平成27年3月31日)		当中間会計期間末 (平成27年9月30日)	
		金 額	占 率	金 額	占 率
水 産 ・ 農 林 業		-	-	-	-
鉱 業		493	0.1	483	0.1
建 設 業		13,631	3.4	14,848	4.0
製 造 業	食 料 品	16,967	4.3	16,942	4.5
	織 維 製 品	36,928	9.3	37,323	10.0
	パ ル プ ・ 紙	11,179	2.8	11,936	3.2
	化 学	29,473	7.4	26,634	7.1
	医 薬 品	13	0.0	13	0.0
	石 油 ・ 石 炭 製 品	4,599	1.2	4,270	1.1
	ゴ ム 製 品	30	0.0	30	0.0
	ガ ラ ス ・ 土 石 製 品	4,637	1.2	4,653	1.2
	鉄 鋼	1,595	0.4	1,041	0.3
	非 鉄 金 属	7,032	1.8	7,193	1.9
	金 属 製 品	1,998	0.5	1,795	0.5
	機 械	16,551	4.2	12,080	3.2
	電 気 機 器	41,477	10.4	37,465	10.0
	輸 送 用 機 器	62,842	15.8	57,098	15.3
	精 密 機 器	1,117	0.3	1,029	0.3
そ の 他 製 品	6,124	1.5	5,822	1.6	
電 気 ・ ガ ス 業		5,930	1.5	7,650	2.1
運 輸 ・ 情 報 通 信 業	陸 運 業	15,531	3.9	14,977	4.0
	海 運 業	4,331	1.1	3,242	0.9
	空 運 業	-	-	-	-
	倉 庫 ・ 運 輸 関 連 業	3,517	0.9	3,065	0.8
	情 報 ・ 通 信 業	102	0.0	100	0.0
商 業	卸 売 業	32,788	8.2	29,291	7.8
	小 売 業	15,848	4.0	15,666	4.2
金 融 ・ 保 険 業	銀 行 業	20,417	5.1	19,490	5.2
	証 券 、 商 品 先 物 取 引 業	5,574	1.4	5,017	1.3
	保 険 業	3,552	0.9	3,609	1.0
	そ の 他 金 融 業	4,715	1.2	4,473	1.2
不 動 産 業		24,402	6.1	22,893	6.1
サ ー ビ ス 業		4,511	1.1	3,921	1.1
合 計		397,918	100.0	374,064	100.0

(注)区分は証券コード協議会の業種別分類項目に準拠しています。

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

(単位:百万円)

前事業年度末(平成27年3月31日)						
	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	82	-	-	-	-	82
ヘッジ会計非適用分	-	11,096	△ 8,474	-	-	2,621
合計	82	11,096	△ 8,474	-	-	2,703
当中間会計期間末(平成27年9月30日)						
	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	50	-	-	-	-	50
ヘッジ会計非適用分	-	12,409	△ 1,677	-	-	10,732
合計	50	12,409	△ 1,677	-	-	10,783

(注) ヘッジ会計非適用分の差損益については、損益計算書に計上しています。

## ②金利関連

(単位:百万円)

区分	種類	前事業年度末(平成27年3月31日)				当中間会計期間末(平成27年9月30日)			
		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	金利スワップ								
	固定金利受取/変動金利支払	9,123	3,123	82	82	7,123	3,123	50	50
	固定金利支払/変動金利受取	-	-	-	-	-	-	-	-
	変動金利受取/変動金利支払	-	-	-	-	-	-	-	-
	合計				82				50

## (参考)金利スワップ残存期間別残高

(単位:百万円、%)

前事業年度末(平成27年3月31日)							
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
受取側固定スワップ想定元本	6,000	-	1,000	1,923	200	-	9,123
平均受取固定金利	1.68	-	0.62	0.89	1.43	-	1.39
平均支払変動金利	0.24	-	0.32	0.61	0.71	-	0.34
支払側固定スワップ想定元本	-	-	-	-	-	-	-
平均受取変動金利	-	-	-	-	-	-	-
平均支払固定金利	-	-	-	-	-	-	-
支払/受取共に変動スワップ想定元本	-	-	-	-	-	-	-
平均受取変動金利	-	-	-	-	-	-	-
平均支払変動金利	-	-	-	-	-	-	-
合計	6,000	-	1,000	1,923	200	-	9,123
当中間会計期間末(平成27年9月30日)							
受取側固定スワップ想定元本	4,000	1,000	1,063	860	200	-	7,123
平均受取固定金利	1.70	0.62	0.96	0.80	1.43	-	1.32
平均支払変動金利	0.24	0.32	0.61	0.61	0.71	-	0.36
支払側固定スワップ想定元本	-	-	-	-	-	-	-
平均受取変動金利	-	-	-	-	-	-	-
平均支払固定金利	-	-	-	-	-	-	-
支払/受取共に変動スワップ想定元本	-	-	-	-	-	-	-
平均受取変動金利	-	-	-	-	-	-	-
平均支払変動金利	-	-	-	-	-	-	-
合計	4,000	1,000	1,063	860	200	-	7,123

### ③通貨関連

(単位:百万円)

区分	種類	前事業年度末(平成27年3月31日)				当中間会計期間末(平成27年9月30日)			
		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	926,386	—	915,290	11,096	956,639	—	944,229	12,409
	アメリカドル	463,409	—	466,569	△ 3,159	505,502	—	496,542	8,960
	ユーロ	462,977	—	448,721	14,256	451,136	—	447,687	3,449
合計					11,096				12,409

(注) 1. 各期末の為替相場は先物相場を使用しています。

2. 外貨建金銭債権債務等に先物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、開示の対象から除いています。

### ④株式関連

(単位:百万円)

区分	種類	前事業年度末(平成27年3月31日)				当中間会計期間末(平成27年9月30日)			
		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	株価指数先渡 売 建	19,170	—	19,359	△ 188	13,071	—	12,830	241
	個別株先渡 買 建	—	—	—	—	601	—	598	△ 3
	株価指数オプション 売 建	22,708 (0)	—	3,813	△ 3,813	17,313 (0)	—	1,648	△ 1,648
店頭	コール 買 建	105,704 (634)	—	1,122	488	60,384 (723)	—	80	△ 642
	プット	105,906 (21,660)	35,901	16,698	△ 4,961	73,642 (16,088)	28,618	16,465	376
合計					△ 8,474				△ 1,677

(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

前事業年度末、当中間会計期間末ともに保有していません。

### ⑥その他

前事業年度末、当中間会計期間末ともに保有していません。

## デリバティブ取引のリスク管理等

### (1) 利用目的

当社では、主に資産または負債のリスクヘッジを目的にデリバティブ取引を行っております。

資産の安定的な運用のため現物資産に係る市場リスクなどのヘッジやコントロール、変額個人保険・変額個人年金に係る最低保証リスク（最低保証に関する責任準備金の変動による期間損益の変動リスク）の軽減を目的として利用しております。

### (2) 取引の内容

運用対象としているデリバティブ取引は以下の通りです。

- ① 株式関連 国内外株価指数先物取引・国内外株価指数オプション取引・個別株券オプション取引等
- ② 債券関連 国内債券先物取引・国内外債券オプション取引
- ③ 通貨関連 先物為替予約取引・通貨オプション取引
- ④ 金利関連 金利スワップ取引

### (3) リスクの内容

デリバティブ取引のリスクには、市場関連リスクと信用リスクならびに事務リスク・法務リスクがあります。

#### ① 市場関連リスクについて

市場リスクにはヘッジ対象である株式、債券、通貨の価格変動や金利変動によってもたらされるリスクに加えて、オプション取引に見られるような市場変動性（ボラティリティ）など、デリバティブ固有のリスクも含まれています。

従って、市場リスクについては現物資産と合わせたポジション管理を行うと同時にデリバティブ取引そのもののリスクのモニタリングも行っております。

#### ② 信用リスクについて

デリバティブ取引に付随する取引相手先のデフォルト（債務不履行）により、デリバティブ・ポジションから期待する経済効果を得られない信用リスクについて認識し、管理しております。

#### ③ 事務リスク・法務リスク

当社のデリバティブ取引実行に際しては取引実行部門と独立した事務管理部門が取引先の管理部門と照合を行うなど、相互牽制機能が働く体制となっております。また、取引開始に際しては契約書の内容精査など法務リスクに配慮し、状況に応じて弁護士など専門家の意見を聴取するなどの対応を行っております。

### (4) リスク管理体制

当社では取引実行部門とリスク管理担当部門を分離独立させ、相互牽制機能が発揮できる体制を確立しております。

具体的な管理・報告体制は以下の通りです。

- ① 価格変動リスクのモニタリングとリスク管理担当への報告
- ② 価格変動リスクのモニタリングとリスク管理責任者への報告
- ③ 市場関連リスク管理分会、信用リスク管理分会への報告
- ④ リスク管理会議への報告
- ⑤ 経営会議、取締役会への報告
- ⑥ 監査部門による規定遵守状況確認

## 2. 貸付金関係

### (1) 貸付金明細表

(単位:百万円、%)

区 分	前事業年度末 (平成27年3月31日)		当中間会計期間末 (平成27年9月30日)	
	金 額	占 率	金 額	占 率
保 険 約 款 貸 付	70,988	5.0	67,100	4.9
保 険 料 振 替 貸 付	10,194	0.7	9,426	0.7
契 約 者 貸 付	60,793	4.3	57,674	4.2
一 般 貸 付	1,351,659	95.0	1,307,222	95.1
(うち非居住者貸付)	(9,580)	(0.7)	(9,208)	(0.7)
企 業 貸 付	1,212,868	85.3	1,172,498	85.3
(うち国内企業向け)	(1,207,536)	(84.9)	(1,167,619)	(85.0)
国・国際機関・政府関係機関貸付	420	0.0	404	0.0
公 共 団 体 ・ 公 企 業 貸 付	35,399	2.5	35,183	2.6
住 宅 ロ ー ン	47,350	3.3	44,786	3.3
消 費 者 ロ ー ン	54,727	3.8	53,562	3.9
そ の 他	892	0.1	788	0.0
合 計	1,422,647	100.0	1,374,323	100.0

### (2) 貸付金残存期間別残高

(単位:百万円)

前事業年度末(平成27年3月31日)							
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
変動金利	7,721	2,051	27,878	11,973	2,966	42,098	94,690
固定金利	169,974	260,729	173,634	133,366	218,142	301,121	1,256,968
一般貸付計	177,696	262,780	201,513	145,339	221,108	343,220	1,351,659
当中間会計期間末(平成27年9月30日)							
変動金利	4,880	12,676	23,005	5,845	2,877	39,811	89,097
固定金利	164,722	255,014	135,155	161,426	201,008	300,797	1,218,125
一般貸付計	169,602	267,690	158,161	167,271	203,886	340,609	1,307,222

(3) 国内企業向け貸付金企業規模別内訳

(単位:件、百万円、%)

区 分		前事業年度末 (平成27年3月31日)		当中間会計期間末 (平成27年9月30日)	
			占 率		占 率
大 企 業	貸付先数	170	73.9	161	73.2
	金 額	1,094,007	90.6	1,047,785	89.7
中 堅 企 業	貸付先数	5	2.2	5	2.3
	金 額	2,745	0.2	2,637	0.2
中 小 企 業	貸付先数	55	23.9	54	24.5
	金 額	110,783	9.2	117,196	10.1
国内企業向け 貸 付 計	貸付先数	230	100.0	220	100.0
	金 額	1,207,536	100.0	1,167,619	100.0

(注) 1. 業種の区分は以下のとおりです。

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	

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。



## (4)貸付金業種別内訳

(単位:百万円、%)

区 分		前事業年度末 (平成27年3月31日)		当中間会計期間末 (平成27年9月30日)		
		金 額	占 率	金 額	占 率	
内 国	製 造 業	229,965	17.0	220,788	16.9	
	食 料	14,300	1.1	14,300	1.1	
	織 維	6,750	0.5	6,250	0.5	
	木 材 ・ 木 製 品	-	-	-	-	
	パ ル プ ・ 紙	45,500	3.4	42,500	3.3	
	印 刷	500	0.0	500	0.0	
	化 学	23,818	1.8	24,563	1.9	
	石 油 ・ 石 炭	28,837	2.1	28,823	2.2	
	窯 業 ・ 土 石	5,552	0.4	5,016	0.4	
	鉄 鋼	19,800	1.5	16,800	1.3	
	非 鉄 金 属	10,765	0.8	10,657	0.8	
	金 属 製 品	-	-	-	-	
	はん用・生産用・業務用機械	5,650	0.4	5,658	0.4	
	電 気 機 械	25,036	1.8	25,030	1.9	
	輸 送 用 機 械	43,397	3.2	40,647	3.1	
	そ の 他 の 製 造 業	58	0.0	41	0.0	
	向 け	農 業 、 林 業	-	-	-	-
		漁 業	-	-	-	-
		鉱 業 、 採 石 業 、 砂 利 採 取 業	70	0.0	60	0.0
		建 設 業	7,819	0.6	7,663	0.6
電 気 ・ ガ ス ・ 熱 供 給 ・ 水 道 業		112,149	8.3	104,885	8.0	
情 報 通 信 業		30,360	2.2	27,290	2.1	
運 輸 業 、 郵 便 業		42,786	3.2	42,790	3.3	
卸 売 業		304,883	22.6	304,802	23.3	
小 売 業		1,800	0.1	1,300	0.1	
金 融 業 、 保 険 業		332,067	24.6	315,684	24.1	
不 動 産 業		125,945	9.3	125,760	9.6	
物 品 賃 貸 業		43,205	3.2	40,308	3.1	
学 術 研 究 、 専 門 ・ 技 術 サービス業		200	0.0	-	-	
宿 泊 業		180	0.0	162	0.0	
飲 食 業		-	-	-	-	
生 活 関 連 サービス業、娯 楽 業		100	0.0	83	0.0	
教 育 、 学 習 支 援 業		49	0.0	-	-	
医 療 ・ 福 祉		831	0.1	788	0.1	
そ の 他 の サービス		139	0.0	137	0.0	
地 方 公 共 団 体		6,695	0.5	6,489	0.5	
個 人 (住 宅 ・ 消 費 ・ 納 税 資 金 等)	102,078	7.5	98,348	7.5		
そ の 他	751	0.1	669	0.1		
合 計	1,342,078	99.3	1,298,013	99.3		
海 外 向 け	政 府 等	-	-	-	-	
	金 融 機 関	5,000	0.4	5,000	0.4	
	商 工 業 等	4,580	0.3	4,208	0.3	
合 計	9,580	0.7	9,208	0.7		
一 般 貸 付 計		1,351,659	100.0	1,307,222	100.0	

## (5)貸付金地域別内訳

国内

(単位:百万円、%)

区 分	前事業年度末 (平成27年3月31日)		当中間会計期間末 (平成27年9月30日)	
	金 額	占 率	金 額	占 率
北 海 道	6,310	0.5	6,309	0.5
東 北	12,621	1.0	10,604	0.9
関 東	1,007,851	81.3	981,387	81.8
中 部	124,988	10.1	122,218	10.2
近 畿	58,209	4.7	55,457	4.6
中 国	11,132	0.9	5,012	0.4
四 国	4,845	0.4	4,785	0.4
九 州	14,040	1.1	13,891	1.2
合 計	1,240,000	100.0	1,199,665	100.0

(注) 1. 住宅ローン、消費者ローン、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) 貸付金担保別内訳

(単位:百万円、%)

区 分	前事業年度末 (平成27年3月31日)		当中間会計期間末 (平成27年9月30日)	
	金 額	占 率	金 額	占 率
担 保 貸 付	2,014	0.1	1,767	0.1
有 価 証 券 担 保 貸 付	28	0.0	12	0.0
不 動 産 ・ 動 産 ・ 財 団 担 保 貸 付	1,986	0.1	1,755	0.1
指 名 債 権 担 保 貸 付	-	-	-	-
保 証 貸 付	25,746	1.9	22,820	1.8
信 用 貸 付	1,221,820	90.4	1,184,285	90.6
そ の 他	102,078	7.6	98,348	7.5
一 般 貸 付 計	1,351,659	100.0	1,307,222	100.0
う ち 劣 後 特 約 付 貸 付	189,900	14.0	184,900	14.1

### 3. 海外投融資関係

#### (1) 資産別明細

##### ① 外貨建資産

(単位:百万円、%)

区 分	前事業年度末(平成27年3月31日)		当中間会計期間末(平成27年9月30日)	
	金 額	占 率	金 額	占 率
公 社 債	941,619	70.5	975,936	70.1
株 式	11,359	0.9	11,339	0.8
現 預 金 ・ そ の 他	128,282	9.6	154,657	11.1
小 計	1,081,261	81.0	1,141,934	82.0

##### ② 円貨額が確定した外貨建資産

(単位:百万円、%)

区 分	前事業年度末(平成27年3月31日)		当中間会計期間末(平成27年9月30日)	
	金 額	占 率	金 額	占 率
公 社 債	-	-	-	-
現 預 金 ・ そ の 他	78,994	5.9	77,983	5.6
小 計	78,994	5.9	77,983	5.6

##### ③ 円貨建資産

(単位:百万円、%)

区 分	前事業年度末(平成27年3月31日)		当中間会計期間末(平成27年9月30日)	
	金 額	占 率	金 額	占 率
非 居 住 者 貸 付	9,580	0.7	9,208	0.7
公 社 債 ( 円 建 外 債 ) ・ そ の 他	165,612	12.4	163,348	11.7
小 計	175,192	13.1	172,557	12.4

##### ④ 合 計

(単位:百万円、%)

区 分	前事業年度末(平成27年3月31日)		当中間会計期間末(平成27年9月30日)	
	金 額	占 率	金 額	占 率
海 外 投 融 資	1,335,448	100.0	1,392,475	100.0
うち 海 外 不 動 産	-	-	-	-

※ 「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。

## (2)外貨建資産の通貨別構成

(単位:百万円、%)

区 分	前事業年度末 (平成27年3月31日)		当中間会計期間末 (平成27年9月30日)	
	金 額	占 率	金 額	占 率
米 ド ル	594,817	55.0	652,387	57.1
カ ナ ダ ド ル	-	-	-	-
豪 ド ル	24,451	2.3	33,972	3.0
ユ ー ロ	461,990	42.7	450,810	39.5
英 ポ ン ド	-	-	4,762	0.4
ス イ ス フ ラ ン	-	-	-	-
そ の 他	0	0.0	0	0.0
合 計	1,081,261	100.0	1,141,934	100.0

## (3)海外投融資の地域別構成

(単位:百万円、%)

前事業年度末(平成27年3月31日)										
区 分	外 国 証 券						非 居 住 者 貸 付			
	金 額		占 率		公 社 債		株 式 等		金 額	
	金 額	占 率	金 額	占 率	金 額	占 率	金 額	占 率	金 額	占 率
北 米	498,100	40.3	474,459	47.3	23,640	10.2	-	-	-	-
ヨ ー ロ ッ パ	688,373	55.7	485,091	48.3	203,282	87.3	5,000	52.2	5,000	52.2
オ セ ア ニ ア	16,422	1.3	16,422	1.6	-	-	-	-	-	-
ア ジ ア	5,907	0.5	-	-	5,907	2.5	-	-	-	-
中 南 米	-	-	-	-	-	-	4,580	47.8	4,580	47.8
中 東	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ア フ リ カ	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国 際 機 関	27,552	2.2	27,552	2.8	-	-	-	-	-	-
合 計	1,236,356	100.0	1,003,525	100.0	232,830	100.0	9,580	100.0	9,580	100.0
当中間会計期間末(平成27年9月30日)										
北 米	550,253	42.7	505,085	48.7	45,167	18.0	-	-	-	-
ヨ ー ロ ッ パ	684,771	53.2	484,365	46.8	200,405	79.7	5,000	54.3	5,000	54.3
オ セ ア ニ ア	19,972	1.6	19,972	1.9	-	-	-	-	-	-
ア ジ ア	5,711	0.4	-	-	5,711	2.3	-	-	-	-
中 南 米	-	-	-	-	-	-	4,208	45.7	4,208	45.7
中 東	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ア フ リ カ	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国 際 機 関	26,595	2.1	26,595	2.6	-	-	-	-	-	-
合 計	1,287,304	100.0	1,036,020	100.0	251,284	100.0	9,208	100.0	9,208	100.0

## II. 個人変額保険・変額個人年金保険特別勘定

### 1. 売買目的有価証券の評価損益

(個人変額保険)

(単位:百万円)

区 分	前事業年度末(平成27年3月31日)		当中間会計期間末(平成27年9月30日)	
	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	78,880	6,135	72,821	△ 5,405
公 社 債	23,614	215	21,407	20
株 式	26,759	4,032	24,597	△ 2,822
外 国 証 券	22,156	1,100	21,160	△ 2,240
公 社 債	8,787	△ 91	8,258	△ 251
株 式 等	13,368	1,192	12,902	△ 1,989
そ の 他 の 証 券	6,350	786	5,656	△ 362

(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。

(変額個人年金保険)

(単位:百万円)

区 分	前事業年度末(平成27年3月31日)		当中間会計期間末(平成27年9月30日)	
	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	376,086	16,794	261,810	△ 29,079
公 社 債	32,263	392	24,571	△ 208
株 式	12,591	1,035	9,015	△ 1,853
外 国 証 券	9,361	△ 401	7,840	△ 992
公 社 債	3,531	△ 185	2,713	△ 199
株 式 等	5,829	△ 215	5,127	△ 792
そ の 他 の 証 券	321,870	15,768	220,382	△ 26,025

(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. 有価証券の時価情報(売買目的有価証券以外の有価証券)

(個人変額保険)

前事業年度末、当中間会計期間末ともに売買目的有価証券以外の有価証券は保有していません。

(変額個人年金保険)

前事業年度末、当中間会計期間末ともに売買目的有価証券以外の有価証券は保有していません。

### 3. 金銭の信託の時価情報

(個人変額保険)

前事業年度末、当中間会計期間末ともに保有していません。

(変額個人年金保険)

前事業年度末、当中間会計期間末ともに保有していません。

#### 4. デリバティブ取引の時価情報

(ヘッジ会計適用・非適用分の合算値:個人変額保険・変額個人年金保険特別勘定)

##### 【個人変額保険】

##### (1) 差損益の内訳(ヘッジ会計適用分・非適用分の内訳)

(単位:百万円)

前事業年度末(平成27年3月31日)						
	金利関連	通貨関連	株式関連	債券関連	その他	合計
ヘッジ会計適用分	—	—	—	—	—	—
ヘッジ会計非適用分	—	—	—	—	—	—
合計	—	—	—	—	—	—
当中間会計期間末(平成27年9月30日)						
	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	△3	—	—	△3
合計	—	△0	△3	—	—	△3

(注) ヘッジ会計非適用分の差損益については、損益計算書に計上しています。

##### (2) 金利関連

前事業年度末、当中間会計期間末ともに保有していません。

##### (3) 通貨関連

(単位:百万円)

区分	種類	前事業年度末(平成27年3月31日)				当中間会計期間末(平成27年9月30日)			
		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	—	—	—	—	1	—	1	△0
	売建	—	—	—	—	1	—	1	△0
	合計	—	—	—	—	—	—	—	△0

(注) 各期末の為替相場は先物相場を使用しています。

##### (4) 株式関連

(単位:百万円)

区分	種類	前事業年度末(平成27年3月31日)				当中間会計期間末(平成27年9月30日)			
		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	—	—	—	—	186	—	183	△3
	買建	—	—	—	—	—	—	—	—
	合計	—	—	—	—	—	—	—	△3

##### (5) 債券関連

前事業年度末、当中間会計期間末ともに保有していません。

##### (6) その他

前事業年度末、当中間会計期間末ともに保有していません。

【変額個人年金保険】

(1) 差損益の内訳(ヘッジ会計適用分・非適用分の内訳)

(単位:百万円)

前事業年度末(平成27年3月31日)						
	金利関連	通貨関連	株式関連	債券関連	その他	合計
ヘッジ会計適用分	-	-	-	-	-	-
ヘッジ会計非適用分	-	-	-	-	-	-
合計	-	-	-	-	-	-
当中間会計期間末(平成27年9月30日)						
	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
合計	-	△0	-	-	-	△0

(注) ヘッジ会計非適用分の差損益については、損益計算書に計上しています。

(2) 金利関連

前事業年度末、当中間会計期間末ともに保有していません。

(3) 通貨関連

(単位:百万円)

区分	種類	前事業年度末(平成27年3月31日)				当中間会計期間末(平成27年9月30日)			
		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	-	1	△0
	ユーロ	-	-	-	-	1	-	1	△0
	合計				-				△0

(注) 各期末の為替相場は先物相場を使用しています。

(4) 株式関連

前事業年度末、当中間会計期間末ともに保有していません。

(5) 債券関連

前事業年度末、当中間会計期間末ともに保有していません。

(6) その他

前事業年度末、当中間会計期間末ともに保有していません。

### Ⅲ. 会社計

#### 1. 売買目的有価証券の評価損益

(単位:百万円)

区 分	前事業年度末(平成27年3月31日)		当中間会計期間末(平成27年9月30日)	
	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	537,448	27,102	414,007	△ 39,008
公 社 債	94,252	1,113	84,324	△ 147
株 式	62,114	7,327	54,007	△ 7,257
外 国 証 券	52,859	2,107	49,635	△ 5,216
公 社 債	19,071	△ 308	17,469	△ 740
株 式 等	33,787	2,416	32,166	△ 4,476
その他の証券	328,221	16,554	226,039	△ 26,387

(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)

(単位:百万円)

区 分	前事業年度末(平成27年3月31日)								
	帳簿価額	時 価	差 損 益 (時価-帳簿価額)			損益計算書 計上後価額	差 損 益 (時価-損益計算書計上後価額)		
			差 益	差 損	差 益		差 損		
満期保有目的の債券	10,398	11,620	1,221	1,221	-	10,398	1,221	1,221	-
公 社 債	6,075	6,545	469	469	-	6,075	469	469	-
買入金銭債権	4,323	5,075	751	751	-	4,323	751	751	-
責任準備金対応債券	1,945,469	2,230,667	285,197	285,246	49	1,945,469	285,197	285,246	49
公 社 債	1,945,469	2,230,667	285,197	285,246	49	1,945,469	285,197	285,246	49
子会社・関連会社株式	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他の有価証券	2,264,776	2,653,913	389,137	397,685	8,548	2,351,518	302,395	308,192	5,797
公 社 債	1,000,966	1,063,182	62,215	62,262	46	1,000,966	62,215	62,262	46
株 式	206,725	388,284	181,559	186,480	4,921	206,725	181,559	186,480	4,921
外 国 証 券	983,701	1,121,085	137,383	140,963	3,579	1,070,442	50,642	51,471	828
公 社 債	875,602	1,003,525	127,923	131,098	3,175	962,343	41,181	41,606	424
株 式 等	108,098	117,559	9,460	9,864	404	108,098	9,460	9,864	404
その他の証券	14,752	21,546	6,794	6,794	-	14,752	6,794	6,794	-
買入金銭債権	13,631	14,814	1,183	1,183	-	13,631	1,183	1,183	-
譲渡性預金	45,000	45,000	-	-	-	45,000	-	-	-
合 計	4,220,645	4,896,201	675,556	684,153	8,597	4,307,386	588,814	594,661	5,846
公 社 債	2,952,511	3,300,395	347,883	347,979	95	2,952,511	347,883	347,979	95
株 式	206,725	388,284	181,559	186,480	4,921	206,725	181,559	186,480	4,921
外 国 証 券	983,701	1,121,085	137,383	140,963	3,579	1,070,442	50,642	51,471	828
公 社 債	875,602	1,003,525	127,923	131,098	3,175	962,343	41,181	41,606	424
株 式 等	108,098	117,559	9,460	9,864	404	108,098	9,460	9,864	404
その他の証券	14,752	21,546	6,794	6,794	-	14,752	6,794	6,794	-
有価証券合計	4,157,690	4,831,311	673,621	682,218	8,597	4,244,431	586,880	592,726	5,846
買入金銭債権	17,954	19,889	1,934	1,934	-	17,954	1,934	1,934	-
譲渡性預金	45,000	45,000	-	-	-	45,000	-	-	-

(注) 1. 本表には、金融商品取引法上の有価証券として取り扱いを行うことが適当と認められるもの等を含んでいます。

2. 外貨建その他有価証券の為替換算差額の一部等については、損益計算書に計上しています。上表では、決算処理後の差損益を適切に開示するため、帳簿価額ベースに加えて、同為替換算差額等86,741百万円を損益計算書に計上した後のベースでの差損益についても記載しています。



(単位:百万円)

区 分	当中間会計期間末(平成27年9月30日)									
	帳簿価額	時 価	差 損 益	(時価-帳簿価額)		損益計算書 計上後価額	差 損 益	(時価-損益計算書計上後価額)		
				差益	差損			差益	差損	
満期保有目的の債券	9,845	11,001	1,155	1,155	-	9,845	1,155	1,155	-	
公 社 債	5,739	6,166	427	427	-	5,739	427	427	-	
買入金銭債権	4,106	4,834	728	728	-	4,106	728	728	-	
責任準備金対応債券	1,952,021	2,230,888	278,867	278,867	-	1,952,021	278,867	278,867	-	
公 社 債	1,952,021	2,230,888	278,867	278,867	-	1,952,021	278,867	278,867	-	
子会社・関連会社株式	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
その他の有価証券	2,339,813	2,683,540	343,726	358,246	14,519	2,427,302	256,237	267,633	11,396	
公 社 債	990,663	1,052,405	61,742	61,968	226	990,494	61,911	61,968	57	
株 式	206,205	362,014	155,808	162,630	6,821	206,205	155,808	162,630	6,821	
外 国 証 券	1,050,156	1,174,259	124,102	129,217	5,114	1,137,814	36,444	38,604	2,160	
公 社 債	917,754	1,036,020	118,265	122,487	4,222	1,005,412	30,607	31,874	1,267	
株 式 等	132,401	138,239	5,837	6,729	892	132,401	5,837	6,729	892	
その他の証券	35,679	36,630	950	3,307	2,356	35,679	950	3,307	2,356	
買入金銭債権	12,107	13,230	1,122	1,122	-	12,107	1,122	1,122	-	
譲渡性預金	45,000	45,000	-	-	-	45,000	-	-	-	
合 計	4,301,679	4,925,430	623,750	638,270	14,519	4,389,168	536,261	547,657	11,396	
公 社 債	2,948,423	3,289,461	341,037	341,263	226	2,948,254	341,206	341,263	57	
株 式	206,205	362,014	155,808	162,630	6,821	206,205	155,808	162,630	6,821	
外 国 証 券	1,050,156	1,174,259	124,102	129,217	5,114	1,137,814	36,444	38,604	2,160	
公 社 債	917,754	1,036,020	118,265	122,487	4,222	1,005,412	30,607	31,874	1,267	
株 式 等	132,401	138,239	5,837	6,729	892	132,401	5,837	6,729	892	
その他の証券	35,679	36,630	950	3,307	2,356	35,679	950	3,307	2,356	
有価証券合計	4,240,465	4,862,365	621,899	636,419	14,519	4,327,954	534,410	545,806	11,396	
買入金銭債権	16,213	18,064	1,850	1,850	-	16,213	1,850	1,850	-	
譲渡性預金	45,000	45,000	-	-	-	45,000	-	-	-	

(注) 1. 本表には、金融商品取引法上の有価証券として取り扱いを行うことが適当と認められるもの等を含んでいます。

2. 外貨建その他有価証券の為替換算差額の一部等については、損益計算書に計上しています。上表では、決算処理後の差損益を適切に開示するため、帳簿価額ベースに加えて、同為替換算差額等87,489百万円を損益計算書に計上した後のベースでの差損益についても記載しています。

## ○満期保有目的の債券

(単位:百万円)

区 分	前事業年度末(平成27年3月31日)			当中間会計期間末(平成27年9月30日)		
	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 超えるものの	10,398	11,620	1,221	9,845	11,001	1,155
公 社 債	6,075	6,545	469	5,739	6,166	427
買入金銭債権	4,323	5,075	751	4,106	4,834	728
時価が貸借対照表計上額を 超えないものの	-	-	-	-	-	-

## ○責任準備金対応債券

(単位:百万円)

区 分	前事業年度末(平成27年3月31日)			当中間会計期間末(平成27年9月30日)		
	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 超えるものの	1,930,356	2,215,603	285,246	1,952,021	2,230,888	278,867
公 社 債	1,930,356	2,215,603	285,246	1,952,021	2,230,888	278,867
時価が貸借対照表計上額を 超えないものの	15,113	15,063	△ 49	-	-	-
公 社 債	15,113	15,063	△ 49	-	-	-

○その他有価証券

(単位:百万円)

区 分	前事業年度末(平成27年3月31日)			当中間会計期間末(平成27年9月30日)		
	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	1,986,490	2,384,175	397,685	1,995,204	2,353,451	358,246
公 社 債	976,250	1,038,513	62,262	953,594	1,015,563	61,968
株 式	174,759	361,240	186,480	172,513	335,143	162,630
外 国 証 券	807,096	948,060	140,963	846,513	975,730	129,217
そ の 他 の 証 券	14,752	21,546	6,794	10,475	13,783	3,307
買 入 金 銭 債 権	13,631	14,814	1,183	12,107	13,230	1,122
貸借対照表計上額が帳簿価額を超えないもの	278,286	269,738	△ 8,548	344,608	330,088	△ 14,519
公 社 債	24,715	24,668	△ 46	37,068	36,842	△ 226
株 式	31,966	27,044	△ 4,921	33,692	26,870	△ 6,821
外 国 証 券	176,604	173,024	△ 3,579	203,642	198,528	△ 5,114
そ の 他 の 証 券	-	-	-	25,204	22,847	△ 2,356
譲 渡 性 預 金	45,000	45,000	-	45,000	45,000	-

・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次のとおりです。

(単位:百万円)

区 分	前事業年度末 (平成27年3月31日)	当中間会計期間末 (平成27年9月30日)
満期保有目的の債券	-	-
責任準備金対応債券	-	-
子会社・関連会社株式	1,427	1,819
そ の 他 有 価 証 券	122,697	123,019
非 上 場 国 内 株 式	8,930	11,347
非上場外国株式等(店頭売買株式を除く)	113,731	111,636
そ の 他 の 証 券	35	35
合 計	124,125	124,839

(注) 本表の非上場外国株式等(店頭売買株式を除く)には外貨建てのものが含まれており、その為替換算差額には損益計算書に計上せず貸借対照表価額に含めて計上しているものがあります。当該為替換算差額の金額は、前事業年度末は1,430百万円、当中間会計期間末は1,411百万円です。

3. 金銭の信託の時価情報

(単位:百万円)

区 分	前事業年度末(平成27年3月31日)					当中間会計期間末(平成27年9月30日)				
	貸借対照表計上額	時 価	差 損 益	差 益	差 損	貸借対照表計上額	時 価	差 損 益	差 益	差 損
金 銭 の 信 託	200	200	-	-	-	200	200	-	-	-

(注) 本表記載の金銭の信託は全て「取得原価をもって貸借対照表に計上している預金と同様の性格の合同運用の指定金銭信託」です。なお運用目的、満期保有目的、責任準備金対応の金銭の信託は保有していません。

#### 4. デリバティブ取引の時価情報(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)

(単位:百万円)

前事業年度末(平成27年3月31日)						
	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	82	-	-	-	-	82
ヘッジ会計非適用分	-	11,095	△ 8,482	-	-	2,613
合計	82	11,095	△ 8,482	-	-	2,695
当中間会計期間末(平成27年9月30日)						
	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	50	-	-	-	-	50
ヘッジ会計非適用分	-	12,409	△ 1,680	-	-	10,729
合計	50	12,409	△ 1,680	-	-	10,780

(注) ヘッジ会計非適用分の差損益については、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

###### ① 金利関連

前事業年度末、当中間会計期間末ともに保有していません。

###### ② 通貨関連

(単位:百万円)

区分	種類	前事業年度末(平成27年3月31日)				当中間会計期間末(平成27年9月30日)			
		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	926,644	-	915,548	11,095	956,660	-	944,250	12,409
	アメリカドル	463,570	-	466,730	△ 3,160	505,502	-	496,542	8,960
	ユーロ	463,044	-	448,788	14,256	451,158	-	447,708	3,449
	その他の通貨	29	-	29	△ 0	-	-	-	-
店頭	買建	17	-	17	△ 0	14	-	14	△ 0
	アメリカドル	17	-	17	△ 0	14	-	14	△ 0
	合計				11,095				12,409

(注) 各期末の為替相場は先物相場を使用しています。

###### ③ 株式関連

(単位:百万円)

区分	種類	前事業年度末(平成27年3月31日)				当中間会計期間末(平成27年9月30日)			
		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	331	-	339	△ 7	-	-	-	-
	買建	-	-	-	-	186	-	183	△ 3
店頭	株価指数先物								
	個別株先物	19,170	-	19,359	△ 188	13,071	-	12,830	241
	買建	-	-	-	-	601	-	598	△ 3
	株価指数オプション	22,708	-			17,313	-		
	売建	(0)		3,813	△ 3,813	(0)		1,648	△ 1,648
店頭	買建	105,704	-	1,122	488	60,384	-	80	△ 642
	オプション	(634)				(723)			
	プット	105,906	35,901			73,642	28,618		
	合計	(21,660)		16,698	△ 4,961	(16,088)		16,465	△ 1,680

(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

前事業年度末、当中間会計期間末ともに保有していません。

⑤その他

前事業年度末、当中間会計期間末ともに保有していません。

(3)ヘッジ会計が適用されているもの

①金利関連

(単位:百万円)

ヘッジ会計の方法	種類	主なヘッジ対象	前事業年度末(平成27年3月31日)			当中間会計期間末(平成27年9月30日)		
			契約額等	うち1年超	時価	契約額等	うち1年超	時価
原則的処理方法	金利スワップ 固定金利受取/ 変動金利支払	貸付金	263	263	0	263	263	1
金利スワップの特例処理	金利スワップ 固定金利受取/ 変動金利支払	貸付金	8,860	2,860	81	6,860	2,860	49
合計					82			50

(参考)金利スワップ残存期間別残高

(単位:百万円、%)

前事業年度末(平成27年3月31日)							
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
受取側固定スワップ想定元本	6,000	—	1,000	1,923	200	—	9,123
平均受取固定金利	1.68	—	0.62	0.89	1.43	—	1.39
平均支払変動金利	0.24	—	0.32	0.61	0.71	—	0.34
支払側固定スワップ想定元本	—	—	—	—	—	—	—
平均受取変動金利	—	—	—	—	—	—	—
平均支払固定金利	—	—	—	—	—	—	—
支払/受取共に変動スワップ想定元本	—	—	—	—	—	—	—
平均受取変動金利	—	—	—	—	—	—	—
平均支払変動金利	—	—	—	—	—	—	—
合計	6,000	—	1,000	1,923	200	—	9,123
当中間会計期間末(平成27年9月30日)							
受取側固定スワップ想定元本	4,000	1,000	1,063	860	200	—	7,123
平均受取固定金利	1.70	0.62	0.96	0.80	1.43	—	1.32
平均支払変動金利	0.24	0.32	0.61	0.61	0.71	—	0.36
支払側固定スワップ想定元本	—	—	—	—	—	—	—
平均受取変動金利	—	—	—	—	—	—	—
平均支払固定金利	—	—	—	—	—	—	—
支払/受取共に変動スワップ想定元本	—	—	—	—	—	—	—
平均受取変動金利	—	—	—	—	—	—	—
平均支払変動金利	—	—	—	—	—	—	—
合計	4,000	1,000	1,063	860	200	—	7,123

②通貨関連

(単位:百万円)

ヘッジ会計の方法	種類	主なヘッジ対象	前事業年度末(平成27年3月31日)			当中間会計期間末(平成27年9月30日)		
			契約額等((注)1)	うち1年超	時価	契約額等((注)1)	うち1年超	時価
為替予約の振当処理	為替予約	外貨建定期預金	78,973	—	((注)2)	77,961	—	((注)2)

(注)1. 為替予約の振当処理の契約額等は、ヘッジ対象としている外貨建定期預金と一体で処理しているため、当該外貨建定期預金の貸借対照表計上額(時価)と同額となります。

当該外貨建定期預金は短期間で決済されるため、金利変動を考慮する重要性が乏しいことから時価は帳簿価額と同額としています。

2. 為替予約の振当処理の時価は上記の契約額等を含めております。

③株式関連

前事業年度末、当中間会計期間末ともに保有していません。

④債券関連

前事業年度末、当中間会計期間末ともに保有していません。

⑤その他

前事業年度末、当中間会計期間末ともに保有していません。

## IV. その他

### 1. 資産査定状況等

当社は、資産の健全性確保のため、毎決算期末において資産の自己査定を実施し、その結果を反映した適正な償却・引当処理を行っています。

#### ○債務者区分による債権の状況

(単位:百万円)

区 分	当中間会計期間末(平成27年9月30日)						
	債権額 (C)	貸付金	その他	担保・保証 等	引当金	保全額 (D)	保全率 (D)/(C)
破産更生債権及びこれらに準ずる債権	-	-	-	-	-	-	-
危険債権	160	160	-	159	0	159	99.6%
要管理債権	44	44	-	44	12	56	128.0%
小計 (A)	204	204	-	203	12	216	105.8%
正常債権 (B)	1,832,501	1,374,119	458,382				
合計 (A+B)	1,832,706	1,374,323	458,382				
						(A)/(A+B)	0.01%

区 分	前事業年度末(平成27年3月31日)		
	債権額	保全額	保全率
破産更生債権及びこれらに準ずる債権	-	-	-
危険債権	168	168	99.8%
要管理債権	56	71	128.0%
小計 (A)	224	240	106.8%
正常債権 (B)	1,870,451		
合計 (A+B)	1,870,676		
	(A)/(A+B)		0.01%

- (注)1. 破産更生債権及びこれらに準ずる債権とは、破産手続開始、更生手続開始又は再生手続開始の申立て等の事由により経営破綻に陥っている債務者に対する債権及びこれらに準ずる債権です。
2. 危険債権とは、債務者が経営破綻の状態には至っていないが、財政状態及び経営成績が悪化し、契約に従った債権の元本の回収及び利息の受取りができない可能性の高い債権です。
3. 要管理債権とは、3カ月以上延滞貸付金及び条件緩和貸付金です。なお、3カ月以上延滞貸付金とは、元本又は利息の支払が、約定支払日の翌日から3カ月以上遅延している貸付金(注1及び2に掲げる債権を除く)、条件緩和貸付金とは、債務者の経営再建又は支援を図ることを目的として、金利の減免、利息の支払猶予、元本の返済猶予、債権放棄その他の債務者に有利となる取決めを行った貸付金(注1及び2に掲げる債権並びに3カ月以上延滞貸付金を除く)です。
4. 正常債権とは、債務者の財政状態及び経営成績に特に問題がないものとして、注1から3までに掲げる債権以外のものに区分される債権です。
5. 償却・引当規程に基づき、破産更生債権及びこれらに準ずる債権のⅢ・Ⅳ分類については、全額を個別貸倒引当金に計上するか又は直接減額し、危険債権のⅢ分類については、必要額を個別貸倒引当金に計上しています。なお、正常債権及び要管理債権については、貸倒実績率に基づき一般貸倒引当金を計上しています。
6. 「保全率」とは担保・保証等による保全額及び引当金によるカバー率であり、(担保・保証等による保全額+引当金)/債権額で算出しています。「担保・保証等による保全額」とは担保・保証等により回収が見込まれる金額であり、担保については評価額に所定の掛目を乗じて算出しています。

#### (参考)リスク管理債権の保全率

(単位:百万円)

	前事業年度末(平成27年3月31日)			当中間会計期間末(平成27年9月30日)				
	債権額	保全額計	保全率	債権額	担保・保証 等	引当金	保全額計	保全率
リスク管理債権	224	240	106.8%	204	203	12	216	105.8%

#### (参考)貸付金に関わる自己査定分類金額

(単位:百万円)

	前事業年度末 (平成27年3月31日)	当中間会計期間末 (平成27年9月30日)
第Ⅱ分類	284	317
第Ⅲ分類	0	0
第Ⅳ分類	-	-
合計額	284	318

## 2. 貸倒引当金の明細

(単位:百万円)

摘 要	前事業年度	当中間会計期間
	(自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)	(自平成27年4月1日 至平成27年9月30日)
(1) 貸倒引当金残高の内訳		
(イ) 一般貸倒引当金	195	188
(ロ) 個別貸倒引当金	389	384
(ハ) 特定海外債権引当勘定	—	—
(2) 個別貸倒引当金		
(イ) 繰入額	7	5
(ロ) 取崩額 [償却等に伴う取崩額を除く]	20	7
(ハ) 繰入額	△ 13	△ 1
(3) 特定海外債権引当勘定		
(イ) 対象国数	—	—
(ロ) 債権額	—	—
(ハ) 繰入額	—	—
(ニ) 取崩額	—	—
(4) 貸付金償却	—	—

## 3. 土地の時価情報

(単位:百万円)

	前事業年度末 (平成27年3月31日)	当中間会計期間末 (平成27年9月30日)
時 価	150,200	151,630
貸借対照表価額	176,997	175,570
差 損 益	△ 26,796	△ 23,939

(注) 1. 時価は、公示価格等を基準に算定しています。  
2. 上記には、借地権を含んでいます。