

平成23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	…… 20 頁
2. 貸倒引当金の明細	…… 21 頁
3. 土地の時価情報	…… 21 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23年3月31日)		当中間会計期間末 (平成23年9月30日)	
	金額	占率	金額	占率
国債	1,686,297	42.0	1,835,695	46.5
地方債	281,098	7.0	280,087	7.1
社債	773,933	19.3	717,634	18.2
うち公社・公団債	463,637	11.5	430,529	10.9
株式	348,968	8.7	243,697	6.2
外国証券	905,168	22.5	850,047	21.5
公社債	619,466	15.4	569,557	14.4
株式等	285,702	7.1	280,490	7.1
その他の証券	19,774	0.5	18,815	0.5
合計	4,015,240	100.0	3,945,978	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23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	138,523	299,712	357,409	403,326	494,056	2,322,211	4,015,240
国債	79,753	122,541	147,386	100,219	276,210	960,186	1,686,297
地方債	1,163	10,579	27,092	29,615	10,563	202,084	281,098
社債	23,955	74,809	82,719	136,198	59,403	396,847	773,933
株式	-	-	-	-	-	348,968	348,968
外国証券	33,650	91,781	100,211	137,294	147,879	394,350	905,168
公社債	33,650	91,781	100,211	137,294	147,879	108,648	619,466
株式等	-	-	-	-	-	285,702	285,702
その他の証券	-	-	-	-	-	19,774	19,774
買入金銭債権	-	848	-	1,856	-	27,961	30,666
譲渡性預金	49,000	-	-	-	-	-	49,000
合計	187,523	300,560	357,409	405,183	494,056	2,350,172	4,094,907
当中間会計期間末(平成23年9月30日)							
有価証券	94,340	333,838	381,802	362,766	433,918	2,339,311	3,945,978
国債	36,339	116,200	194,198	86,616	299,165	1,103,175	1,835,695
地方債	928	31,242	12,139	28,544	4,764	202,468	280,087
社債	19,623	84,632	65,692	138,499	25,634	383,551	717,634
株式	-	-	-	-	-	243,697	243,697
外国証券	37,449	101,763	109,771	109,106	104,354	387,603	850,047
公社債	37,449	101,763	109,771	109,106	104,354	107,112	569,557
株式等	-	-	-	-	-	280,490	280,490
その他の証券	-	-	-	-	-	18,815	18,815
買入金銭債権	847	-	1,861	-	-	27,292	30,001
譲渡性預金	46,000	-	-	-	-	-	46,000
合計	141,187	333,838	383,663	362,766	433,918	2,366,603	4,021,979

(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23年3月31日)		当中間会計期間末 (平成23年9月30日)	
		金 額	占 率	金 額	占 率
水 産 ・ 農 林 業		23	0.0	25	0.0
鉱 業		336	0.1	291	0.1
建 設 業		7,617	2.2	6,813	2.8
製 造 業	食 料 品	9,803	2.8	8,259	3.4
	織 維 製 品	28,601	8.2	21,034	8.6
	パ ル プ ・ 紙	9,507	2.7	9,897	4.1
	化 学	21,534	6.2	18,768	7.7
	医 薬 品	959	0.3	585	0.2
	石 油 ・ 石 炭 製 品	5,690	1.6	4,275	1.8
	ゴ ム 製 品	3,485	1.0	3,439	1.4
	ガ ラ ス ・ 土 石 製 品	1,613	0.5	1,643	0.7
	鉄 鋼	1,984	0.6	1,463	0.6
	非 鉄 金 属	5,613	1.6	4,175	1.7
	金 属 製 品	1,513	0.4	1,434	0.6
	機 械	11,517	3.3	8,099	3.3
	電 気 機 器	35,014	10.0	23,761	9.8
	輸 送 用 機 器	29,796	8.5	23,388	9.6
	精 密 機 器	1,602	0.5	1,047	0.4
そ の 他 製 品	5,048	1.4	4,287	1.8	
電 気 ・ ガ ス 業		8,153	2.3	5,964	2.5
運 輸 ・ 情 報 通 信 業	陸 運 業	9,163	2.6	8,578	3.5
	海 運 業	5,134	1.5	3,311	1.4
	空 運 業	-	-	-	-
	倉 庫 ・ 運 輸 関 連 業	3,431	1.0	3,019	1.2
	情 報 ・ 通 信 業	901	0.3	132	0.1
商 業	卸 売 業	28,032	8.0	23,919	9.8
	小 売 業	8,335	2.4	7,907	3.2
金 融 ・ 保 険 業	銀 行 業	73,358	21.0	20,204	8.3
	証 券 、 商 品 先 物 取 引 業	3,562	1.0	3,238	1.3
	保 険 業	9,987	2.9	9,324	3.8
	そ の 他 金 融 業	2,788	0.8	2,774	1.1
不 動 産 業		11,028	3.2	9,001	3.7
サ ー ビ ス 業		3,823	1.1	3,627	1.5
合 計		348,968	100.0	243,697	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23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	561	-	-	-	-	561
ヘッジ会計非適用分	-	▲ 14,058	15,758	-	-	1,700
合計	561	▲ 14,058	15,758	-	-	2,262
当中間会計期間末(平成23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	481	-	-	-	-	481
ヘッジ会計非適用分	-	20,280	20,780	-	-	41,061
合計	481	20,280	20,780	-	-	41,543

(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23年3月31日)				当中間会計期間末(平成23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	29,350	16,960	561	561	27,150	12,500	481	481
	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				561				481

(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23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	12,390	10,260	6,700	-	-	-	29,350
平均受取固定金利	1.74	1.48	1.69	-	-	-	1.63
平均支払変動金利	0.77	0.54	0.44	-	-	-	0.61
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	12,390	10,260	6,700	-	-	-	29,350
当中間会計期間末(平成23年9月30日)							
受取側固定スワップ想定元本	14,650	6,500	6,000	-	-	-	27,150
平均受取固定金利	1.62	1.61	1.68	-	-	-	1.63
平均支払変動金利	0.43	0.34	0.29	-	-	-	0.38
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	14,650	6,500	6,000	-	-	-	27,150

③通貨関連

(単位:百万円)

区分	種類	前事業年度末(平成23年3月31日)				当中間会計期間末(平成23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	為替予約建売	498,412	—	512,470	▲ 14,058	496,950	—	476,684	20,265
	アメリカドル	233,886	—	235,626	▲ 1,740	273,115	—	262,899	10,216
	ユーロ	264,526	—	276,844	▲ 12,318	223,834	—	213,785	10,049
	買建	—	—	—	—	16,064	—	16,079	15
	アメリカドル	—	—	—	—	5,820	—	5,823	3
	ユーロ	—	—	—	—	10,243	—	10,255	12
合計				▲ 14,058				20,280	

(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23年3月31日)				当中間会計期間末(平成23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	株価指数先渡建売	38,854	—	36,060	2,793	50,457	—	50,420	36
	株価指数オプション								
	売建	20,584	—	4,554	▲ 1,730	—	—	—	—
	コール	(2,824)				(—)			
	買建	89,725	69,141	38,915	14,692	69,141	69,141	42,142	20,743
プット	(24,223)				(21,399)				
株券オプション									
売建	199	—	—	—	322	—	—	—	
コール	(4)		1	2	(5)		4	0	
合計				15,758				20,780	

(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
- ⑤ その他 クレジット・デフォルト・スワップ取引等

(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。

また、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、保有資産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も認識し、管理しております。

② 信用リスクについて

クレジット・デフォルト・スワップ取引では、取引相手先の信用リスクに加えて、原債務者の信用状態の変化によって保有するポジションの価値が変動するリスクを認識し、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（含む、総合証券事務サービス株式会社[注]）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。

[注] 当社では有価証券管理事務等を住友生命保険相互会社との共同出資会社「総合証券事務サービス株式会社」に業務委託しております。

(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責任者への報告
- ② 市場関連リスク管理分会、信用リスク管理分会への報告
- ③ リスク管理会議への報告
- ④ 経営会議、取締役会への報告
- ⑤ 内部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23年3月31日)		当中間会計期間末 (平成23年9月30日)	
	金 額	占 率	金 額	占 率
保 険 約 款 貸 付	97,520	5.6	94,639	5.5
保 険 料 振 替 貸 付	16,004	0.9	15,061	0.9
契 約 者 貸 付	81,516	4.7	79,577	4.6
一 般 貸 付	1,655,830	94.4	1,622,455	94.5
(うち非居住者貸付)	(9,015)	(0.5)	(8,775)	(0.5)
企 業 貸 付	1,454,930	83.0	1,417,284	82.5
(うち国内企業向け)	(1,447,638)	(82.6)	(1,410,416)	(82.1)
国・国際機関・政府関係機関貸付	801	0.0	697	0.1
公 共 団 体 ・ 公 企 業 貸 付	35,379	2.0	45,301	2.6
住 宅 ロ ー ン	69,624	4.0	68,008	4.0
消 費 者 ロ ー ン	93,501	5.3	89,633	5.2
そ の 他	1,592	0.1	1,529	0.1
合 計	1,753,350	100.0	1,717,094	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23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	18,443	20,386	12,334	6,589	74,807	55,296	187,857
固定金利	149,678	355,158	342,557	237,620	162,802	220,155	1,467,972
一般貸付計	168,121	375,544	354,891	244,210	237,609	275,452	1,655,830
当中間会計期間末(平成23年9月30日)							
変動金利	20,445	15,632	11,072	15,590	65,401	54,566	182,708
固定金利	142,357	337,945	358,307	221,763	133,054	246,317	1,439,746
一般貸付計	162,803	353,578	369,379	237,353	198,455	300,884	1,622,455

(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23年3月31日)		当中間会計期間末 (平成23年9月30日)	
			占 率		占 率
大 企 業	貸付先数	212	68.0	200	67.8
	金 額	1,292,206	89.3	1,267,067	89.8
中 堅 企 業	貸付先数	7	2.2	5	1.7
	金 額	4,292	0.3	4,564	0.3
中 小 企 業	貸付先数	93	29.8	90	30.5
	金 額	151,139	10.4	138,784	9.9
国内企業向け 貸 付 計	貸付先数	312	100.0	295	100.0
	金 額	1,447,638	100.0	1,410,416	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23年3月31日)		当中間会計期間末 (平成23年9月30日)		
	金 額	占 率	金 額	占 率	
国 内	製 造 業	312,611	18.9	297,458	18.3
	食 料	31,710	1.9	31,520	2.0
	織 維	7,860	0.5	7,860	0.5
	木 材 ・ 木 製 品	649	0.0	554	0.0
	パ ル プ ・ 紙	57,598	3.5	57,458	3.5
	印 刷	500	0.0	500	0.0
	化 学	30,653	1.9	27,182	1.7
	石 油 ・ 石 炭	33,000	2.0	30,000	1.9
	窯 業 ・ 土 石	3,335	0.2	3,585	0.2
	鉄 鋼	24,880	1.5	24,860	1.5
	非 鉄 金 属	14,466	0.9	14,199	0.9
	金 属 製 品	500	0.0	-	-
	はん用・生産用・業務用機械	15,811	1.0	12,686	0.8
	電 気 機 械	39,377	2.4	35,692	2.2
	輸 送 用 機 械	45,233	2.7	49,348	3.0
	そ の 他 の 製 造 業	7,038	0.4	2,012	0.1
向 け	農 業 、 林 業	-	-	-	-
	漁 業	-	-	-	-
	鉱 業 、 採 石 業 、 砂 利 採 取 業	2,092	0.1	2,080	0.1
	建 設 業	7,327	0.4	7,237	0.4
	電 気 ・ ガ ス ・ 熱 供 給 ・ 水 道 業	126,804	7.7	118,070	7.3
	情 報 通 信 業	28,007	1.7	38,000	2.3
	運 輸 業 、 郵 便 業	43,551	2.6	41,838	2.6
	卸 売 業	322,297	19.5	321,226	19.8
	小 売 業	7,374	0.4	7,371	0.5
	金 融 業 、 保 険 業	389,181	23.5	396,662	24.5
	不 動 産 業	160,176	9.7	152,033	9.4
	物 品 賃 貸 業	68,575	4.1	59,333	3.7
	学 術 研 究 、 専 門 ・ 技 術 サ ー ビ ス 業	-	-	-	-
	宿 泊 業	103	0.0	89	0.0
	飲 食 業	-	-	-	-
	生 活 関 連 サ ー ビ ス 業 、 娯 楽 業	1,450	0.1	1,450	0.1
	教 育 、 学 習 支 援 業	941	0.1	392	0.0
	医 療 ・ 福 祉	1,198	0.1	1,182	0.1
	そ の 他 の サ ー ビ ス	393	0.0	280	0.0
地 方 公 共 団 体	8,019	0.5	7,950	0.5	
個 人 (住 宅 ・ 消 費 ・ 納 税 資 金 等)	163,431	9.9	157,927	9.7	
そ の 他	3,279	0.2	3,094	0.2	
合 計	1,646,815	99.5	1,613,679	99.5	
海 外 向 け	政 府 等	-	-	-	-
	金 融 機 関	5,000	0.3	5,000	0.3
	商 工 業 等	4,015	0.2	3,775	0.2
合 計	9,015	0.5	8,775	0.5	
一 般 貸 付 計	1,655,830	100.0	1,622,455	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23年3月31日)		当中間会計期間末 (平成23年9月30日)	
	金 額	占 率	金 額	占 率
北 海 道	13,458	0.9	13,447	0.9
東 北	13,838	0.9	13,742	1.0
関 東	1,162,517	78.4	1,153,411	79.2
中 部	119,491	8.1	115,595	7.9
近 畿	128,298	8.7	117,096	8.1
中 国	19,329	1.3	19,880	1.4
四 国	4,972	0.3	4,783	0.3
九 州	21,474	1.4	17,792	1.2
合 計	1,483,381	100.0	1,455,750	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23年3月31日)		当中間会計期間末 (平成23年9月30日)	
	金 額	占 率	金 額	占 率
担 保 貸 付	10,359	0.6	7,398	0.5
有 価 証 券 担 保 貸 付	3,172	0.2	97	0.0
不 動 産 ・ 動 産 ・ 財 団 担 保 貸 付	6,742	0.4	7,097	0.5
指 名 債 権 担 保 貸 付	444	0.0	203	0.0
保 証 貸 付	49,939	3.0	47,897	2.9
信 用 貸 付	1,432,097	86.5	1,409,229	86.9
そ の 他	163,433	9.9	157,929	9.7
一 般 貸 付 計	1,655,830	100.0	1,622,455	100.0
う ち 劣 後 特 約 付 貸 付	218,900	13.2	237,900	14.7

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23年3月31日)		当中間会計期間末(平成23年9月30日)	
	金 額	占 率	金 額	占 率
公 社 債	459,417	45.1	416,257	42.5
株 式	7,860	0.8	7,245	0.8
現 預 金 ・ そ の 他	126,737	12.4	132,194	13.5
小 計	594,014	58.3	555,697	56.8

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23年3月31日)		当中間会計期間末(平成23年9月30日)	
	金 額	占 率	金 額	占 率
公 社 債	-	-	-	-
現 預 金 ・ そ の 他	94,007	9.2	94,000	9.6
小 計	94,007	9.2	94,000	9.6

③ 円貨建資産

(単位:百万円、%)

区 分	前事業年度末(平成23年3月31日)		当中間会計期間末(平成23年9月30日)	
	金 額	占 率	金 額	占 率
非 居 住 者 貸 付	9,015	0.9	8,775	0.9
公 社 債 (円 建 外 債) ・ そ の 他	322,125	31.6	320,063	32.7
小 計	331,140	32.5	328,839	33.6

④ 合 計

(単位:百万円、%)

区 分	前事業年度末(平成23年3月31日)		当中間会計期間末(平成23年9月30日)	
	金 額	占 率	金 額	占 率
海 外 投 融 資	1,019,162	100.0	978,536	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。

(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23年3月31日)		当中間会計期間末 (平成23年9月30日)	
	金 額	占 率	金 額	占 率
米 ド ル	332,150	55.9	343,546	61.8
カ ナ ダ ド ル	-	-	-	-
豪 ド ル	28	0.0	1	0.0
ユ ー ロ	261,833	44.1	212,147	38.2
英 ボ ン ド	-	-	-	-
ス イ ス フ ラ ン	-	-	-	-
そ の 他	1	0.0	1	0.0
合 計	594,014	100.0	555,697	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23年3月31日)									
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						
北 米	239,438	26.5	228,883	36.9	10,554	3.7	-	-	
ヨ ー ロ ッ パ	623,148	68.8	358,103	57.8	265,044	92.8	6,700	74.3	
オ セ ア ニ ア	-	-	-	-	-	-	-	-	
ア ジ ア	13,142	1.4	3,039	0.5	10,103	3.5	-	-	
中 南 米	-	-	-	-	-	-	2,315	25.7	
中 東	-	-	-	-	-	-	-	-	
ア フ リ カ	-	-	-	-	-	-	-	-	
国 際 機 関	29,439	3.3	29,439	4.8	-	-	-	-	
合 計	905,168	100.0	619,466	100.0	285,702	100.0	9,015	100.0	
当中間会計期間末(平成23年9月30日)									
北 米	249,098	29.3	240,517	42.2	8,581	3.1	-	-	
ヨ ー ロ ッ パ	557,672	65.6	295,133	51.8	262,538	93.6	6,700	76.3	
オ セ ア ニ ア	-	-	-	-	-	-	-	-	
ア ジ ア	12,396	1.5	3,025	0.6	9,370	3.3	-	-	
中 南 米	-	-	-	-	-	-	2,075	23.7	
中 東	-	-	-	-	-	-	-	-	
ア フ リ カ	-	-	-	-	-	-	-	-	
国 際 機 関	30,880	3.6	30,880	5.4	-	-	-	-	
合 計	850,047	100.0	569,557	100.0	280,490	100.0	8,775	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23年3月31日)		当中間会計期間末(平成23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	65,908	▲ 377	58,780	▲ 4,316
公 社 債	21,448	▲ 168	18,689	211
株 式	20,475	▲ 429	19,680	▲ 1,469
外 国 証 券	18,802	284	15,717	▲ 2,686
公 社 債	6,714	▲ 106	6,900	▲ 195
株 式 等	12,087	391	8,816	▲ 2,490
そ の 他 の 証 券	5,182	▲ 64	4,693	▲ 372

(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23年3月31日)		当中間会計期間末(平成23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	534,384	▲ 4,275	497,186	▲ 19,869
公 社 債	101,380	▲ 1,527	91,804	1,024
株 式	30,552	▲ 323	30,806	▲ 2,330
外 国 証 券	25,397	446	21,548	▲ 3,727
公 社 債	7,578	▲ 64	8,799	▲ 208
株 式 等	17,819	511	12,748	▲ 3,518
そ の 他 の 証 券	377,053	▲ 2,870	353,027	▲ 14,836

(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23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	—	—	▲7	—	—	▲7
合計	—	—	▲7	—	—	▲7
当中間会計期間末(平成23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	—	—	—	—	—	—
合計	—	—	—	—	—	—

(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

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) 株式関連

(単位:百万円)

区分	種類	前事業年度末(平成23年3月31日)				当中間会計期間末(平成23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	324	—	331	▲7	—	—	—	—
	合計				▲7				—

(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)

前事業年度末、当中間会計期間末ともに保有していないため記載していません。

(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

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) 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23年3月31日)		当中間会計期間末(平成23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	658,403	▲ 5,446	609,221	▲ 27,681
公 社 債	143,795	▲ 1,939	131,209	1,473
株 式	71,911	▲ 1,368	69,133	▲ 4,926
外 国 証 券	60,460	796	51,156	▲ 9,019
公 社 債	19,360	▲ 305	21,261	▲ 522
株 式 等	41,099	1,102	29,894	▲ 8,497
その 他 の 証 券	382,236	▲ 2,935	357,721	▲ 15,208

(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23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	74,348	76,257	1,909	1,986	77	74,348	1,909	1,986	77
公 社 債	36,648	37,687	1,039	1,114	74	36,648	1,039	1,114	74
外 国 公 社 債	32,100	32,641	541	544	3	32,100	541	544	3
買入金銭債権	5,600	5,927	327	327	-	5,600	327	327	-
責任準備金対応債券	1,211,135	1,247,635	36,500	40,138	3,637	1,211,135	36,500	40,138	3,637
公 社 債	1,204,135	1,240,656	36,520	40,088	3,567	1,204,135	36,520	40,088	3,567
外 国 公 社 債	7,000	6,979	▲ 20	49	70	7,000	▲ 20	49	70
子会社・関連会社株式	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その 他 有 価 証 券	2,590,679	2,566,097	▲ 24,581	93,140	117,722	2,540,478	25,619	101,342	75,723
公 社 債	1,465,033	1,500,545	35,512	40,120	4,607	1,465,033	35,512	40,120	4,607
株 式	251,175	275,944	24,768	48,640	23,871	251,175	24,768	48,640	23,871
外 国 証 券	784,514	700,268	▲ 84,246	3,577	87,824	734,313	▲ 34,045	11,780	45,825
公 社 債	629,419	580,366	▲ 49,053	2,714	51,767	579,218	1,147	10,916	9,769
株 式 等	155,095	119,901	▲ 35,193	863	36,056	155,095	▲ 35,193	863	36,056
その 他 の 証 券	16,345	15,273	▲ 1,072	256	1,328	16,345	▲ 1,072	256	1,328
買入金銭債権	24,610	25,066	455	546	90	24,610	455	546	90
譲渡性預金	49,000	49,000	-	-	-	49,000	-	-	-
合 計	3,876,163	3,889,991	13,827	135,265	121,438	3,825,962	64,028	143,467	79,439
公 社 債	2,705,817	2,778,890	73,072	81,323	8,250	2,705,817	73,072	81,323	8,250
株 式	251,175	275,944	24,768	48,640	23,871	251,175	24,768	48,640	23,871
外 国 証 券	823,614	739,888	▲ 83,725	4,171	87,897	773,413	▲ 33,524	12,374	45,898
公 社 債	668,519	619,987	▲ 48,532	3,308	51,841	618,318	1,668	11,510	9,842
株 式 等	155,095	119,901	▲ 35,193	863	36,056	155,095	▲ 35,193	863	36,056
その 他 の 証 券	16,345	15,273	▲ 1,072	256	1,328	16,345	▲ 1,072	256	1,328
有 価 証 券 合 計	3,796,953	3,809,996	13,043	134,391	121,347	3,746,751	63,245	142,593	79,348
買入金銭債権	30,210	30,994	783	874	90	30,210	783	874	90
譲渡性預金	49,000	49,000	-	-	-	49,000	-	-	-

(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 ▲50、201百万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23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	72,476	74,320	1,844	1,946	102	72,476	1,844	1,946	102
公 社 債	35,995	37,123	1,127	1,195	67	35,995	1,127	1,195	67
外 国 公 社 債	31,000	31,188	188	224	35	31,000	188	224	35
買 入 金 銭 債 権	5,480	6,008	527	527	-	5,480	527	527	-
責任準備金対応債券	1,286,996	1,377,771	90,775	93,365	2,590	1,286,996	90,775	93,365	2,590
公 社 債	1,279,996	1,371,369	91,373	93,365	1,992	1,279,996	91,373	93,365	1,992
外 国 公 社 債	7,000	6,402	▲ 597	-	597	7,000	▲ 597	-	597
子会社・関連会社株式	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他の有価証券	2,532,100	2,464,869	▲ 67,231	85,206	152,437	2,454,233	10,635	107,972	97,336
公 社 債	1,462,847	1,517,425	54,578	58,782	4,203	1,462,847	54,578	58,782	4,203
株 式	233,632	220,712	▲ 12,919	22,776	35,696	233,632	▲ 12,919	22,776	35,696
外 国 証 券	748,762	641,733	▲ 107,028	2,528	109,557	670,895	▲ 29,161	25,294	54,456
公 社 債	592,737	531,557	▲ 61,180	2,528	63,709	514,870	16,686	25,294	8,607
株 式 等	156,024	110,176	▲ 45,848	-	45,848	156,024	▲ 45,848	-	45,848
その他の証券	17,345	14,476	▲ 2,868	93	2,962	17,345	▲ 2,868	93	2,962
買 入 金 銭 債 権	23,513	24,520	1,007	1,025	17	23,513	1,007	1,025	17
譲 渡 性 預 金	46,000	46,000	-	-	-	46,000	-	-	-
合 計	3,891,573	3,916,961	25,387	180,518	155,130	3,813,706	103,254	203,284	100,029
公 社 債	2,778,838	2,925,918	147,079	153,342	6,263	2,778,838	147,079	153,342	6,263
株 式	233,632	220,712	▲ 12,919	22,776	35,696	233,632	▲ 12,919	22,776	35,696
外 国 証 券	786,762	679,324	▲ 107,437	2,752	110,190	708,895	▲ 29,570	25,518	55,089
公 社 債	630,737	569,148	▲ 61,589	2,752	64,342	552,870	16,277	25,518	9,240
株 式 等	156,024	110,176	▲ 45,848	-	45,848	156,024	▲ 45,848	-	45,848
その他の証券	17,345	14,476	▲ 2,868	93	2,962	17,345	▲ 2,868	93	2,962
有 価 証 券 合 計	3,816,579	3,840,432	23,852	178,966	155,113	3,738,712	101,719	201,731	100,012
買 入 金 銭 債 権	28,994	30,529	1,535	1,552	17	28,994	1,535	1,552	17
譲 渡 性 預 金	46,000	46,000	-	-	-	46,000	-	-	-

- (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. 外貨建の他の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▲77,866百万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。
3. 投資事業組合及び外国投資事業組合は「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」に含めて開示していますが、投資事業組合が保有する「その他有価証券」の評価差額については持分相当額▲2百万円を投資事業組合の貸借対照表価額に含めて計上しています。なお、前事業年度末については該当金額がないため、注記はしておりません。

○満期保有目的の債券

(単位:百万円)

区 分	前事業年度末(平成23年3月31日)			当中間会計期間末(平成23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	71,248	73,234	1,986	59,476	61,423	1,946
公 社 債	34,648	35,762	1,114	33,995	35,190	1,195
外 国 証 券	31,000	31,544	544	20,000	20,224	224
買 入 金 銭 債 権	5,600	5,927	327	5,480	6,008	527
時価が貸借対照表計上額を 超えないものの	3,100	3,022	▲ 77	13,000	12,897	▲ 102
公 社 債	2,000	1,925	▲ 74	2,000	1,932	▲ 67
外 国 証 券	1,100	1,096	▲ 3	11,000	10,964	▲ 35
買 入 金 銭 債 権	-	-	-	-	-	-

○責任準備金対応債券

(単位:百万円)

区 分	前事業年度末(平成23年3月31日)			当中間会計期間末(平成23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	1,062,901	1,103,039	40,138	1,264,925	1,358,290	93,365
公 社 債	1,059,901	1,099,989	40,088	1,264,925	1,358,290	93,365
外 国 証 券	3,000	3,049	49	-	-	-
時価が貸借対照表計上額を 超えないものの	148,234	144,596	▲ 3,637	22,070	19,480	▲ 2,590
公 社 債	144,234	140,666	▲ 3,567	15,070	13,078	▲ 1,992
外 国 証 券	4,000	3,930	▲ 70	7,000	6,402	▲ 597

○その他有価証券

(単位:百万円)

区 分	前事業年度末(平成23年3月31日)			当中間会計期間末(平成23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	1,580,941	1,674,082	93,140	1,626,404	1,711,611	85,206
公 社 債	1,302,166	1,342,286	40,120	1,389,695	1,448,478	58,782
株 式	124,226	172,866	48,640	90,524	113,301	22,776
外 国 証 券	132,792	136,369	3,577	123,542	126,070	2,528
そ の 他 の 証 券	3,432	3,688	256	632	725	93
買 入 金 銭 債 権	18,323	18,870	546	22,010	23,035	1,025
譲 渡 性 預 金	-	-	-	-	-	-
貸借対照表計上額が帳簿価額を超えないもの	1,009,738	892,015	▲ 117,722	905,696	753,258	▲ 152,437
公 社 債	162,867	158,259	▲ 4,607	73,151	68,947	▲ 4,203
株 式	126,948	103,077	▲ 23,871	143,107	107,411	▲ 35,696
外 国 証 券	651,722	563,898	▲ 87,824	625,220	515,662	▲ 109,557
そ の 他 の 証 券	12,913	11,584	▲ 1,328	16,713	13,751	▲ 2,962
買 入 金 銭 債 権	6,286	6,196	▲ 90	1,503	1,485	▲ 17
譲 渡 性 預 金	49,000	49,000	-	46,000	46,000	-

・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23年3月31日)	当中間会計期間末 (平成23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	7,639	7,465
そ の 他 の 有 価 証 券	238,391	193,510
非 上 場 国 内 株 式	67,126	17,103
非上場外国株式等(店頭売買株式を除く)	168,506	173,650
そ の 他 の 証 券	2,757	2,756
合 計	246,031	200,975

(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、当中間会計期間末は▲2,683百万円、前事業年度末は▲2,068百万円です。

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23年3月31日)					当中間会計期間末(平成23年9月30日)				
	貸借対照表計上額	時 価	差 損 益	差 損 益		貸借対照表計上額	時 価	差 損 益	差 損 益	
				差 益	差 損				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23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	561	—	—	—	—	561
ヘッジ会計非適用分	—	▲ 14,057	15,746	—	—	1,688
合計	561	▲ 14,057	15,746	—	—	2,250
当中間会計期間末(平成23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	481	—	—	—	—	481
ヘッジ会計非適用分	—	20,280	20,794	—	—	41,075
合計	481	20,280	20,794	—	—	41,557

(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23年3月31日)				当中間会計期間末(平成23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	為替予約建売	498,417	—	512,475	▲ 14,058	496,950	—	476,684	20,265
	アメリカドル	233,886	—	235,626	▲ 1,740	273,115	—	262,899	10,216
	ユーロ	264,526	—	276,844	▲ 12,318	223,834	—	213,785	10,049
	その他の通貨	5	—	5	▲ 0	—	—	—	—
	買建	24	—	25	0	16,077	—	16,093	15
	アメリカドル	—	—	—	—	5,828	—	5,832	3
	ユーロ	17	—	17	0	10,248	—	10,261	12
	スイスフラン	4	—	4	0	—	—	—	—
シンガポールドル	3	—	3	0	—	—	—	—	
合計				▲ 14,057				20,280	

(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23年3月31日)				当中間会計期間末(平成23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	株価指数先物建売	553	—	566	▲ 12	—	—	—	—
	買建	—	—	—	—	1,395	—	1,408	13
店頭	株価指数先物建売	38,854	—	36,060	2,793	50,457	—	50,420	36
	株価指数オプション建売	20,584	—	—	—	—	—	—	—
	コール	(2,824)	—	4,554	▲ 1,730	(—)	—	—	—
	買建	89,725	69,141	—	—	69,141	69,141	—	—
	プット	(24,223)	—	38,915	14,692	(21,399)	—	42,142	20,743
株券オプション建売	199	—	—	—	322	—	—	—	
コール	(4)	—	1	2	(5)	—	4	0	
合計				15,746				20,794	

(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23年3月31日)			当中間会計期間末(平成23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	4,990	700	65	4,990	700	42
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	24,360	16,260	496	22,160	11,800	439
合計					561			481

(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23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	12,390	10,260	6,700	-	-	-	29,350
平均受取固定金利	1.74	1.48	1.69	-	-	-	1.63
平均支払変動金利	0.77	0.54	0.44	-	-	-	0.61
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	12,390	10,260	6,700	-	-	-	29,350
当中間会計期間末(平成23年9月30日)							
受取側固定スワップ想定元本	14,650	6,500	6,000	-	-	-	27,150
平均受取固定金利	1.62	1.61	1.68	-	-	-	1.63
平均支払変動金利	0.43	0.34	0.29	-	-	-	0.38
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	14,650	6,500	6,000	-	-	-	27,150

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23年3月31日)			当中間会計期間末(平成23年9月30日)		
			契約額等((注)1)	時価	契約額等((注)1)	時価		
							うち1年超	うち1年超
為替予約の振当処理	為替予約	外貨建定期預金	93,983	-	((注)2)	93,964	-	((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23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	169	169	-	141	28	169	100.0%
危険債権	9,867	9,867	-	9,787	55	9,843	99.8%
要管理債権	462	462	0	460	1	461	99.6%
小計 (A)	10,500	10,500	0	10,389	85	10,474	99.8%
正常債権 (B)	1,858,565	1,706,594	151,971				
合計 (A+B)	1,869,065	1,717,094	151,971				
						(A)/(A+B)	0.56%

区 分	前事業年度末(平成23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	102	102	100.0%
危険債権	12,329	12,106	98.2%
要管理債権	485	482	99.4%
小計 (A)	12,916	12,691	98.3%
正常債権 (B)	1,903,836		
合計 (A+B)	1,916,753		
	(A)/(A+B)		0.67%

- (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ができない可能性の高い債権です。
3. 要管理債権とは、3か月以上延滞貸付金及び条件緩和貸付金です。なお、3か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か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か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・引当基準に基づき、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23年3月31日)			当中間会計期間末(平成23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	12,916	12,691	98.3%	10,500	10,389	85	10,474	99.8%

(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23年3月31日)	当中間会計期間末 (平成23年9月30日)
第Ⅱ分類	6,025	4,235
第Ⅲ分類	222	24
第Ⅳ分類	-	-
合計額	6,247	4,259

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22年4月 1日 至 平成23年3月31日)	(自 平成23年4月 1日 至 平成23年9月30日)
(1) 貸倒引当金残高の内訳		
(イ) 一般貸倒引当金	198	183
(ロ) 個別貸倒引当金	1,861	758
(ハ) 特定海外債権引当勘定	—	—
(2) 個別貸倒引当金		
(イ) 繰入額	1,390	34
(ロ) 取崩額 [償却等に伴う取崩額を除く]	118	17
(ハ) 繰入額	1,272	17
(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	6	4

(注) 当中間会計期間の個別貸倒引当金の取崩額には、不良債権の譲渡に伴う取崩額 1,110 百万円を除いた額を記載しております。

3. 土地の時価情報

(単位:百万円)

	前事業年度末 (平成23年3月31日)	当中間会計期間末 (平成23年9月30日)
時 価	147,412	145,645
貸借対照表価額	192,836	192,651
差 損 益	▲ 45,424	▲ 47,005

(注) 1. 時価は、公示価格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。