

平成25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25年3月31日)		当中間会計期間末 (平成25年9月30日)	
	金額	占率	金額	占率
国債	2,171,383	52.2	2,284,347	53.9
地方債	249,885	6.0	238,396	5.6
社債	457,716	11.0	403,950	9.5
うち公社・公団債	281,476	6.8	270,986	6.4
株式	291,085	7.0	320,474	7.6
外国証券	970,883	23.4	963,420	22.8
公社債	678,944	16.4	705,094	16.7
株式等	291,939	7.0	258,325	6.1
その他の証券	18,023	0.4	26,414	0.6
合計	4,158,977	100.0	4,237,004	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25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	130,785	284,225	328,092	311,041	456,997	2,647,835	4,158,977
国債	57,718	89,899	113,837	145,997	271,707	1,492,222	2,171,383
地方債	5,745	22,247	16,629	5,280	-	199,983	249,885
社債	26,644	54,447	44,824	43,083	17,919	270,795	457,716
株式	-	-	-	-	-	291,085	291,085
外国証券	40,676	117,630	152,800	116,680	167,370	375,725	970,883
公社債	40,676	117,630	152,800	116,680	167,370	83,786	678,944
株式等	-	-	-	-	-	291,939	291,939
その他の証券	-	-	-	-	-	18,023	18,023
買入金銭債権	-	840	1,791	-	-	23,437	26,069
譲渡性預金	73,000	-	-	-	-	-	73,000
合計	203,785	285,065	329,884	311,041	456,997	2,671,273	4,258,047
当中間会計期間末(平成25年9月30日)							
有価証券	93,542	319,597	287,193	311,944	488,059	2,736,667	4,237,004
国債	27,633	145,997	107,718	160,383	242,700	1,599,915	2,284,347
地方債	13,281	11,311	7,220	3,624	5,512	197,445	238,396
社債	22,123	40,480	42,768	12,993	27,959	257,626	403,950
株式	-	-	-	-	-	320,474	320,474
外国証券	30,504	121,807	129,487	134,943	211,886	334,790	963,420
公社債	30,504	121,807	129,487	134,943	211,886	76,464	705,094
株式等	-	-	-	-	-	258,325	258,325
その他の証券	-	-	-	-	-	26,414	26,414
買入金銭債権	-	1,769	-	-	-	21,534	23,304
譲渡性預金	65,000	-	-	-	-	-	65,000
合計	158,542	321,366	287,193	311,944	488,059	2,758,201	4,325,308

(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25年3月31日)		当中間会計期間末 (平成25年9月30日)	
		金 額	占 率	金 額	占 率
水 産 ・ 農 林 業		-	-	-	-
鉱 業		418	0.1	500	0.1
建 設 業		9,208	3.2	10,260	3.2
製 造 業	食 料 品	11,180	3.8	12,759	4.0
	織 維 製 品	22,137	7.6	22,941	7.2
	パ ル プ ・ 紙	8,151	2.8	9,151	2.8
	化 学 品	19,221	6.6	20,871	6.5
	医 薬 品	13	0.0	13	0.0
	石 油 ・ 石 炭 製 品	5,186	1.8	5,111	1.6
	ゴ ム 製 品	388	0.1	30	0.0
	ガ ラ ス ・ 土 石 製 品	2,789	1.0	4,885	1.5
	鉄 鋼	1,212	0.4	1,546	0.5
	非 鉄 金 属	4,524	1.6	5,350	1.7
	金 属 製 品	1,420	0.5	1,541	0.5
	機 械	12,918	4.4	15,071	4.7
	電 気 機 器	25,184	8.7	26,031	8.1
	輸 送 用 機 器	38,336	13.2	47,876	14.9
	精 密 機 器	476	0.2	644	0.2
そ の 他 製 品	4,509	1.5	5,065	1.6	
電 気 ・ ガ ス 業		4,357	1.5	6,171	1.9
運 輸 ・ 情 報 通 信 業	陸 運 業	9,645	3.3	10,117	3.2
	海 運 業	3,224	1.1	4,437	1.4
	空 運 業	-	-	-	-
	倉 庫 ・ 運 輸 関 連 業	5,146	1.8	4,644	1.4
	情 報 ・ 通 信 業	96	0.0	107	0.0
商 業	卸 売 業	26,787	9.2	27,831	8.7
	小 売 業	10,408	3.6	11,807	3.7
金 融 ・ 保 険 業	銀 行 業	23,508	8.1	21,497	6.7
	証 券、商 品 先 物 取 引 業	4,529	1.6	5,333	1.7
	保 険 業	10,335	3.5	7,724	2.4
	そ の 他 金 融 業	2,769	0.9	2,757	0.9
不 動 産 業		18,568	6.4	23,948	7.5
サ ー ビ ス 業		4,429	1.5	4,441	1.4
合 計		291,085	100.0	320,474	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25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	263	—	—	—	—	263
ヘッジ会計非適用分	—	△ 54,696	3,365	—	—	△ 51,331
合計	263	△ 54,696	3,365	—	—	△ 51,067
当中間会計期間末(平成25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	188	—	—	—	—	188
ヘッジ会計非適用分	—	2,708	5,413	—	—	8,122
合計	188	2,708	5,413	—	—	8,311

(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25年3月31日)				当中間会計期間末(平成25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	11,700	6,700	263	263	12,700	8,000	188	188
	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				263				188

(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25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	5,000	6,700	—	—	—	—	11,700
平均受取固定金利	1.64	1.69	—	—	—	—	1.67
平均支払変動金利	0.54	0.37	—	—	—	—	0.44
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	5,000	6,700	—	—	—	—	11,700
当中間会計期間末(平成25年9月30日)							
受取側固定スワップ想定元本	4,700	6,000	1,000	800	200	—	12,700
平均受取固定金利	1.68	1.68	0.62	0.98	1.43	—	1.55
平均支払変動金利	0.48	0.33	0.38	0.63	0.78	—	0.41
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	4,700	6,000	1,000	800	200	—	12,700

③通貨関連

(単位:百万円)

区分	種類	前事業年度末(平成25年3月31日)				当中間会計期間末(平成25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	559,617	—	614,314	△ 54,696	654,219	—	651,481	2,737
	アメリカドル	325,012	—	365,985	△ 40,972	329,569	—	324,537	5,032
	ユーロ	234,604	—	248,328	△ 13,723	324,649	—	326,944	△ 2,294
	買	—	—	—	—	3,002	—	2,974	△ 28
	アメリカドル	—	—	—	—	999	—	989	△ 10
ユーロ	—	—	—	—	2,002	—	1,984	△ 17	
	合計				△ 54,696				2,708

- (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25年3月31日)				当中間会計期間末(平成25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	33,907	—	35,460	△ 1,552	24,914	—	25,355	△ 440
	個別株先渡								
	売	—	—	—	—	59	—	61	△ 1
	買	—	—	—	—	127	—	134	△ 6
	株価指数オプション								
売	23,389 (0)	—	7,245	△ 7,245	26,983 (0)	—	2,647	△ 2,647	
店頭	プット								
	買	—	—	—	—	49,417 (1,014)	—	301	△ 713
	プット	90,727 (20,743)	67,337	32,958	12,215	94,321 (20,743)	67,337	29,952	9,209
	株券オプション								
売	306 (4)	—	56	△ 52	—	—	—	—	
	合計				3,365				5,413

(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
- 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25年3月31日)		当中間会計期間末 (平成25年9月30日)	
	金 額	占 率	金 額	占 率
保 険 約 款 貸 付	85,153	5.1	81,604	5.0
保 険 料 振 替 貸 付	12,998	0.8	12,012	0.7
契 約 者 貸 付	72,154	4.3	69,592	4.3
一 般 貸 付	1,590,002	94.9	1,550,125	95.0
(うち非居住者貸付)	(11,067)	(0.7)	(10,696)	(0.7)
企 業 貸 付	1,400,294	83.6	1,367,607	83.8
(うち国内企業向け)	(1,392,452)	(83.1)	(1,360,741)	(83.4)
国・国際機関・政府関係機関貸付	536	0.0	473	0.0
公 共 団 体 ・ 公 企 業 貸 付	44,756	2.7	39,538	2.4
住 宅 ロ ー ン	64,289	3.8	61,989	3.8
消 費 者 ロ ー ン	78,861	4.7	79,346	4.9
そ の 他	1,264	0.1	1,171	0.1
合 計	1,675,156	100.0	1,631,730	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25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	13,430	8,874	2,807	68,277	11,646	51,799	156,837
固定金利	203,302	327,822	270,204	179,123	207,421	245,291	1,433,165
一般貸付計	216,732	336,697	273,012	247,401	219,068	297,091	1,590,002
当中間会計期間末(平成25年9月30日)							
変動金利	12,321	9,001	13,475	63,923	6,750	50,167	155,639
固定金利	148,781	340,749	266,108	141,913	213,792	283,141	1,394,486
一般貸付計	161,102	349,750	279,583	205,837	220,542	333,308	1,550,125

(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25年3月31日)		当中間会計期間末 (平成25年9月30日)	
			占 率		占 率
大 企 業	貸付先数	183	73.8	179	74.0
	金 額	1,261,852	90.6	1,226,512	90.1
中 堅 企 業	貸付先数	4	1.6	4	1.6
	金 額	2,510	0.2	2,502	0.2
中 小 企 業	貸付先数	61	24.6	59	24.4
	金 額	128,090	9.2	131,727	9.7
国内企業向け 貸 付 計	貸付先数	248	100.0	242	100.0
	金 額	1,392,452	100.0	1,360,741	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25年3月31日)		当中間会計期間末 (平成25年9月30日)	
		金 額	占 率	金 額	占 率
内 国	製 造 業	287,224	18.1	271,278	17.5
	食 料	30,600	1.9	20,460	1.3
	織 維	6,750	0.4	6,750	0.4
	木 材 ・ 木 製 品	57	0.0	-	-
	パ ル プ ・ 紙	53,024	3.3	46,016	3.0
	印 刷	500	0.0	500	0.0
	化 学	28,221	1.8	24,781	1.6
	石 油 ・ 石 炭	32,082	2.0	32,818	2.1
	窯 業 ・ 土 石	6,204	0.4	5,808	0.4
	鉄 鋼	25,510	1.6	24,800	1.6
	非 鉄 金 属	15,208	1.0	15,694	1.0
	金 属 製 品	-	-	-	-
	はん用・生産用・業務用機械	6,435	0.4	15,692	1.0
	電 気 機 械	32,900	2.1	29,000	1.9
	輸 送 用 機 械	48,693	3.1	48,945	3.2
	そ の 他 の 製 造 業	1,037	0.1	12	0.0
向 外	農 業 、 林 業	-	-	-	-
	漁 業	-	-	-	-
	鉱 業 、 採 石 業 、 砂 利 採 取 業	77	0.0	68	0.0
	建 設 業	6,343	0.4	6,154	0.4
	電 気 ・ ガ ス ・ 熱 供 給 ・ 水 道 業	133,397	8.4	131,566	8.5
	情 報 通 信 業	37,790	2.4	37,720	2.4
	運 輸 業 、 郵 便 業	44,794	2.8	45,420	2.9
	卸 売 業	319,219	20.1	306,836	19.8
	小 売 業	3,843	0.2	3,843	0.2
	金 融 業 、 保 険 業	391,070	24.6	386,596	24.9
	不 動 産 業	157,509	9.9	154,357	10.0
	物 品 賃 貸 業	42,931	2.7	44,332	2.9
	学 術 研 究 、 専 門 ・ 技 術 サ ー ビ ス 業	-	-	-	-
	宿 泊 業	8	0.0	6	0.0
	飲 食 業	-	-	-	-
	生 活 関 連 サ ー ビ ス 業 、 娯 楽 業	-	-	-	-
	教 育 、 学 習 支 援 業	245	0.0	196	0.0
	医 療 ・ 福 祉	1,003	0.1	960	0.1
	そ の 他 の サ ー ビ ス	857	0.0	117	0.0
地 方 公 共 団 体	7,523	0.5	7,316	0.5	
個 人 (住 宅 ・ 消 費 ・ 納 税 資 金 等)	143,319	9.0	141,486	9.1	
そ の 他	1,775	0.1	1,170	0.1	
合 計	1,578,934	99.3	1,539,429	99.3	
海 外 向 け	政 府 等	-	-	-	-
	金 融 機 関	5,000	0.3	5,000	0.3
	商 工 業 等	6,067	0.4	5,696	0.4
合 計	11,067	0.7	10,696	0.7	
一 般 貸 付 計	1,590,002	100.0	1,550,125	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25年3月31日)		当中間会計期間末 (平成25年9月30日)	
	金 額	占 率	金 額	占 率
北 海 道	15,375	1.1	15,315	1.1
東 北	12,848	0.9	12,802	0.9
関 東	1,155,853	80.5	1,121,581	80.2
中 部	126,292	8.8	137,575	9.8
近 畿	84,544	5.9	74,542	5.3
中 国	14,492	1.0	12,147	0.9
四 国	6,993	0.5	4,926	0.4
九 州	19,214	1.3	19,052	1.4
合 計	1,435,614	100.0	1,397,942	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25年3月31日)		当中間会計期間末 (平成25年9月30日)	
	金 額	占 率	金 額	占 率
担 保 貸 付	4,504	0.3	3,436	0.2
有 価 証 券 担 保 貸 付	92	0.0	76	0.0
不 動 産・動 産・財 団 担 保 貸 付	4,412	0.3	3,360	0.2
指 名 債 権 担 保 貸 付	-	-	-	-
保 証 貸 付	32,123	2.0	31,567	2.1
信 用 貸 付	1,410,054	88.7	1,373,634	88.6
そ の 他	143,319	9.0	141,487	9.1
一 般 貸 付 計	1,590,002	100.0	1,550,125	100.0
う ち 劣 後 特 約 付 貸 付	235,900	14.8	231,900	15.0

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25年3月31日)		当中間会計期間末(平成25年9月30日)	
	金 額	占 率	金 額	占 率
公 社 債	597,165	56.3	635,554	60.5
株 式	8,890	0.8	9,240	0.8
現 預 金 ・ そ の 他	130,934	12.3	127,116	12.1
小 計	736,990	69.4	771,911	73.4

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25年3月31日)		当中間会計期間末(平成25年9月30日)	
	金 額	占 率	金 額	占 率
公 社 債	-	-	-	-
現 預 金 ・ そ の 他	71,000	6.7	68,003	6.5
小 計	71,000	6.7	68,003	6.5

③ 円貨建資産

(単位:百万円、%)

区 分	前事業年度末(平成25年3月31日)		当中間会計期間末(平成25年9月30日)	
	金 額	占 率	金 額	占 率
非 居 住 者 貸 付	11,067	1.1	10,696	1.0
公 社 債(円建外債)・その他	242,393	22.8	200,221	19.1
小 計	253,461	23.9	210,917	20.1

④ 合 計

(単位:百万円、%)

区 分	前事業年度末(平成25年3月31日)		当中間会計期間末(平成25年9月30日)	
	金 額	占 率	金 額	占 率
海 外 投 融 資	1,061,452	100.0	1,050,832	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25年3月31日)		当中間会計期間末 (平成25年9月30日)	
	金 額	占 率	金 額	占 率
米 ド ル	477,167	64.7	429,899	55.7
カ ナ ダ ド ル	-	-	-	-
豪 ド ル	32	0.0	2,727	0.4
ユ ー ロ	259,785	35.3	339,277	43.9
英 ポ ン ド	-	-	-	-
ス イ ス フ ラ ン	-	-	-	-
そ の 他	5	0.0	7	0.0
合 計	736,990	100.0	771,911	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25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	金 額	占 率	金 額	占 率	
北 米	362,989	37.4	349,967	51.6	13,022	4.5	-	-	
ヨ ー ロ ッ パ	550,158	56.7	283,084	41.7	267,073	91.5	5,000	45.2	
オ セ ア ニ ア	-	-	-	-	-	-	-	-	
ア ジ ア	14,854	1.5	3,010	0.4	11,843	4.0	-	-	
中 南 米	-	-	-	-	-	-	6,067	54.8	
中 東	-	-	-	-	-	-	-	-	
ア フ リ カ	-	-	-	-	-	-	-	-	
国 際 機 関	42,881	4.4	42,881	6.3	-	-	-	-	
合 計	970,883	100.0	678,944	100.0	291,939	100.0	11,067	100.0	
当中間会計期間末(平成25年9月30日)									
北 米	316,941	32.9	312,361	44.3	4,579	1.8	-	-	
ヨ ー ロ ッ パ	596,514	61.9	354,586	50.3	241,927	93.6	5,000	46.7	
オ セ ア ニ ア	2,228	0.3	2,228	0.3	-	-	-	-	
ア ジ ア	11,818	1.2	-	-	11,818	4.6	-	-	
中 南 米	-	-	-	-	-	-	5,696	53.3	
中 東	-	-	-	-	-	-	-	-	
ア フ リ カ	-	-	-	-	-	-	-	-	
国 際 機 関	35,917	3.7	35,917	5.1	-	-	-	-	
合 計	963,420	100.0	705,094	100.0	258,325	100.0	10,696	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25年3月31日)		当中間会計期間末(平成25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	68,293	9,501	71,854	2,662
公 社 債	20,502	367	22,136	△ 196
株 式	22,471	4,788	23,460	1,752
外 国 証 券	19,669	3,550	20,272	654
公 社 債	7,562	960	8,316	△ 151
株 式 等	12,106	2,589	11,955	806
そ の 他 の 証 券	5,650	795	5,984	451

(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25年3月31日)		当中間会計期間末(平成25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	501,413	40,686	474,398	13,714
公 社 債	75,208	1,194	56,711	△ 1,133
株 式	27,244	6,228	20,206	357
外 国 証 券	23,163	4,513	17,088	△ 185
公 社 債	7,653	958	6,156	△ 277
株 式 等	15,510	3,555	10,932	91
そ の 他 の 証 券	375,797	28,749	380,391	14,676

(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)

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。

【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25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	—	0	—	—	—	0
合計	—	0	—	—	—	0
当中間会計期間末(平成25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

(単位:百万円)

区分	種類	前事業年度末(平成25年3月31日)				当中間会計期間末(平成25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	15	—	15	0	—	—	—	—
	デンマーククローネ	8	—	8	0	—	—	—	—
	ノルウェークローネ	6	—	6	0	—	—	—	—
	合計				0				—

(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

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25年3月31日)		当中間会計期間末(平成25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	636,193	57,829	616,743	16,265
公 社 債	123,234	2,000	111,642	△ 1,646
株 式	71,706	15,269	65,482	2,423
外 国 証 券	59,804	11,014	53,242	359
公 社 債	21,182	2,633	20,365	△ 660
株 式 等	38,621	8,380	32,876	1,020
その他の証券	381,448	29,545	386,376	15,128

(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25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	41,523	43,102	1,578	1,579	0	41,523	1,578	1,579	0
公 社 債	26,410	27,251	841	841	0	26,410	841	841	0
外 国 公 社 債	10,000	10,089	89	89	0	10,000	89	89	0
買入金銭債権	5,113	5,761	648	648	-	5,113	648	648	-
責任準備金対応債券	1,660,577	1,861,768	201,191	202,049	858	1,660,577	201,191	202,049	858
公 社 債	1,660,577	1,861,768	201,191	202,049	858	1,660,577	201,191	202,049	858
外 国 公 社 債	-	-	-	-	-	-	-	-	-
子会社・関連会社株式	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他の有価証券	2,185,138	2,363,387	178,249	218,622	40,372	2,222,094	141,293	175,438	34,145
公 社 債	1,126,858	1,191,998	65,140	66,091	951	1,126,858	65,140	66,091	951
株 式	213,326	268,543	55,216	70,199	14,983	213,326	55,216	70,199	14,983
外 国 証 券	737,924	792,886	54,961	79,362	24,400	774,881	18,005	36,178	18,173
公 社 債	599,174	668,944	69,769	76,359	6,589	636,130	32,813	33,175	361
株 式 等	138,750	123,941	△ 14,808	3,003	17,811	138,750	△ 14,808	3,003	17,811
その他の証券	14,228	16,003	1,774	1,795	20	14,228	1,774	1,795	20
買入金銭債権	19,799	20,956	1,156	1,173	16	19,799	1,156	1,173	16
譲渡性預金	73,000	73,000	-	-	-	73,000	-	-	-
合 計	3,887,238	4,268,258	381,019	422,251	41,232	3,924,195	344,062	379,067	35,004
公 社 債	2,813,845	3,081,017	267,172	268,982	1,809	2,813,845	267,172	268,982	1,809
株 式	213,326	268,543	55,216	70,199	14,983	213,326	55,216	70,199	14,983
外 国 証 券	747,924	802,976	55,051	79,452	24,401	784,881	18,094	36,268	18,173
公 社 債	609,174	679,034	69,859	76,449	6,589	646,130	32,903	33,265	362
株 式 等	138,750	123,941	△ 14,808	3,003	17,811	138,750	△ 14,808	3,003	17,811
その他の証券	14,228	16,003	1,774	1,795	20	14,228	1,774	1,795	20
有価証券合計	3,789,325	4,168,540	379,214	420,429	41,215	3,826,282	342,258	377,245	34,987
買入金銭債権	24,912	26,717	1,804	1,821	16	24,912	1,804	1,821	16
譲渡性預金	73,000	73,000	-	-	-	73,000	-	-	-

(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36,956百万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343百万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。

(単位:百万円)

区 分	当中間会計期間末(平成25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	28,962	30,228	1,265	1,265	-	28,962	1,265	1,265	-	
公 社 債	19,987	20,644	656	656	-	19,987	656	656	-	
外 国 公 社 債	4,000	4,044	44	44	-	4,000	44	44	-	
買 入 金 銭 債 権	4,974	5,539	564	564	-	4,974	564	564	-	
責任準備金対応債券	1,729,138	1,892,206	163,067	163,714	646	1,729,138	163,067	163,714	646	
公 社 債	1,729,138	1,892,206	163,067	163,714	646	1,729,138	163,067	163,714	646	
外 国 公 社 債	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
子会社・関連会社株式	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
その他の有価証券	2,197,336	2,407,674	210,337	237,784	27,447	2,259,436	148,237	179,171	30,933	
公 社 債	1,130,169	1,177,567	47,398	48,977	1,579	1,130,169	47,398	48,977	1,579	
株 式	206,453	300,763	94,310	103,142	8,832	206,453	94,310	103,142	8,832	
外 国 証 券	757,007	821,067	64,060	81,073	17,012	819,106	1,961	22,460	20,498	
公 社 債	624,414	701,094	76,680	80,304	3,624	686,513	14,581	21,691	7,110	
株 式 等	132,592	119,973	△ 12,619	768	13,388	132,592	△ 12,619	768	13,388	
その他の証券	21,310	24,945	3,635	3,635	-	21,310	3,635	3,635	-	
買 入 金 銭 債 権	17,396	18,329	933	955	22	17,396	933	955	22	
譲 渡 性 預 金	65,000	65,000	-	-	-	65,000	-	-	-	
合 計	3,955,438	4,330,108	374,670	402,764	28,094	4,017,537	312,571	344,151	31,580	
公 社 債	2,879,295	3,090,418	211,122	213,348	2,226	2,879,295	211,122	213,348	2,226	
株 式	206,453	300,763	94,310	103,142	8,832	206,453	94,310	103,142	8,832	
外 国 証 券	761,007	825,112	64,105	81,118	17,012	823,106	2,006	22,505	20,498	
公 社 債	628,414	705,139	76,725	80,349	3,624	690,513	14,626	21,736	7,110	
株 式 等	132,592	119,973	△ 12,619	768	13,388	132,592	△ 12,619	768	13,388	
その他の証券	21,310	24,945	3,635	3,635	-	21,310	3,635	3,635	-	
有価証券合計	3,868,066	4,241,239	373,172	401,243	28,071	3,930,166	311,073	342,630	31,557	
買 入 金 銭 債 権	22,371	23,868	1,497	1,520	22	22,371	1,497	1,520	22	
譲 渡 性 預 金	65,000	65,000	-	-	-	65,000	-	-	-	

- (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62,099百万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、当中間会計期間末は該当金額がありません。

○満期保有目的の債券

(単位:百万円)

区 分	前事業年度末(平成25年3月31日)			当中間会計期間末(平成25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	36,523	38,103	1,579	28,962	30,228	1,265
公 社 債	24,410	25,251	841	19,987	20,644	656
外 国 証 券	7,000	7,089	89	4,000	4,044	44
買 入 金 銭 債 権	5,113	5,761	648	4,974	5,539	564
時価が貸借対照表計上額を 超えないもの	5,000	4,999	△ 0	-	-	-
公 社 債	2,000	1,999	△ 0	-	-	-
外 国 証 券	3,000	2,999	△ 0	-	-	-
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25年3月31日)			当中間会計期間末(平成25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	1,651,875	1,853,925	202,049	1,724,437	1,888,152	163,714
公 社 債	1,651,875	1,853,925	202,049	1,724,437	1,888,152	163,714
外 国 証 券	-	-	-	-	-	-
時価が貸借対照表計上額を 超えないもの	8,701	7,843	△ 858	4,701	4,054	△ 646
公 社 債	8,701	7,843	△ 858	4,701	4,054	△ 646
外 国 証 券	-	-	-	-	-	-

○その他有価証券

(単位:百万円)

区 分	前事業年度末(平成25年3月31日)			当中間会計期間末(平成25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	1,814,878	2,033,501	218,622	1,798,759	2,036,543	237,784
公 社 債	1,112,406	1,178,497	66,091	1,040,553	1,089,531	48,977
株 式	146,852	217,051	70,199	166,779	269,921	103,142
外 国 証 券	524,843	604,205	79,362	554,511	635,584	81,073
そ の 他 の 証 券	13,625	15,421	1,795	21,310	24,945	3,635
買 入 金 銭 債 権	17,150	18,324	1,173	15,603	16,559	955
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	370,259	329,886	△ 40,372	398,577	371,130	△ 27,447
公 社 債	14,451	13,500	△ 951	89,615	88,036	△ 1,579
株 式	66,474	51,491	△ 14,983	39,673	30,841	△ 8,832
外 国 証 券	213,081	188,680	△ 24,400	202,495	185,483	△ 17,012
そ の 他 の 証 券	602	581	△ 20	-	-	-
買 入 金 銭 債 権	2,648	2,632	△ 16	1,792	1,769	△ 22
譲 渡 性 預 金	73,000	73,000	-	65,000	65,000	-

・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25年3月31日)	当中間会計期間末 (平成25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	6,548	1,347
そ の 他 有 価 証 券	186,799	158,918
非 上 場 国 内 株 式	16,838	19,007
非上場外国株式等(店頭売買株式を除く)	169,129	139,084
そ の 他 の 証 券	830	826
合 計	193,347	160,265

(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△1,038百万円、当中間会計期間末は△688百万円です。

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25年3月31日)					当中間会計期間末(平成25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25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	263	—	—	—	—	263
ヘッジ会計非適用分	—	△ 54,696	3,365	—	—	△ 51,331
合計	263	△ 54,696	3,365	—	—	△ 51,067
当中間会計期間末(平成25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	188	—	—	—	—	188
ヘッジ会計非適用分	—	2,708	5,413	—	—	8,122
合計	188	2,708	5,413	—	—	8,311

(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25年3月31日)				当中間会計期間末(平成25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	559,636	—	614,333	△ 54,696	654,219	—	651,481	2,737
	売建	325,012	—	365,985	△ 40,972	329,569	—	324,537	5,032
	アメリカドル	234,604	—	248,328	△ 13,723	324,649	—	326,944	△ 2,294
	その他の通貨	18	—	18	0	—	—	—	—
	買建	—	—	—	—	3,002	—	2,974	△ 28
	アメリカドル	—	—	—	—	999	—	989	△ 10
合計	—	—	—	—	2,002	—	1,984	△ 17	
合計				△ 54,696				2,708	

(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25年3月31日)				当中間会計期間末(平成25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	446	—	446	0	—	—	—	—
店頭	売建	33,907	—	35,460	△ 1,552	24,914	—	25,355	△ 440
	個別株先	—	—	—	—	59	—	61	△ 1
	買建	—	—	—	—	127	—	134	6
	株価指数オプション	—	—	—	—	—	—	—	—
	売建	23,389	—	7,245	△ 7,245	26,983	—	2,647	△ 2,647
	コ	(0)	—	—	—	(0)	—	—	—
	買建	—	—	—	—	49,417	—	301	△ 713
	コ	—	—	—	—	(1,014)	—	—	—
ブット	90,727	67,337	32,958	12,215	94,321	67,337	29,952	9,209	
株券オプション	(20,743)	—	—	—	(20,743)	—	—	—	
売建	306	—	56	△ 52	—	—	—	—	
コ	(4)	—	—	—	—	—	—	—	
合計				3,365				5,413	

(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25年3月31日)			当中間会計期間末(平成25年9月30日)		
			契約額等		時価	契約額等		時価
				うち1年超			うち1年超	
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	700	700	13	700	-	9
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	11,000	6,000	250	12,000	8,000	179
合計					263			188

(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25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	5,000	6,700	-	-	-	-	11,700
平均受取固定金利	1.64	1.69	-	-	-	-	1.67
平均支払変動金利	0.54	0.37	-	-	-	-	0.44
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	5,000	6,700	-	-	-	-	11,700
当中間会計期間末(平成25年9月30日)							
受取側固定スワップ想定元本	4,700	6,000	1,000	800	200	-	12,700
平均受取固定金利	1.68	1.68	0.62	0.98	1.43	-	1.55
平均支払変動金利	0.48	0.33	0.38	0.63	0.78	-	0.41
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	4,700	6,000	1,000	800	200	-	12,700

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25年3月31日)			当中間会計期間末(平成25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	70,990	-	((注)2)	67,994	-	((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25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	41	41	-	41	-	41	100.0%
危険債権	635	635	-	589	31	621	97.7%
要管理債権	190	190	0	190	26	217	114.0%
小計 (A)	868	868	0	822	58	880	101.4%
正常債権 (B)	1,947,987	1,630,862	317,124				
合計 (A+B)	1,948,855	1,631,730	317,124				
						(A)/(A+B)	0.04%

区 分	前事業年度末(平成25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	34	34	100.0%
危険債権	846	817	96.6%
要管理債権	237	273	115.2%
小計 (A)	1,117	1,124	100.6%
正常債権 (B)	1,949,666		
合計 (A+B)	1,950,784		
			(A)/(A+B)
			0.06%

- (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25年3月31日)			当中間会計期間末(平成25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	1,117	1,124	100.6%	868	822	58	880	101.4%

(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25年3月31日)	当中間会計期間末 (平成25年9月30日)
第Ⅱ分類	5,647	2,159
第Ⅲ分類	28	14
第Ⅳ分類	-	-
合計額	5,676	2,173

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24年4月1日 至平成25年3月31日)	(自平成25年4月1日 至平成25年9月30日)
(1) 貸倒引当金残高の内訳		
(イ) 一般貸倒引当金	632	309
(ロ) 個別貸倒引当金	544	482
(ハ) 特定海外債権引当勘定	—	—
(2) 個別貸倒引当金		
(イ) 繰入額	72	14
(ロ) 取崩額 [償却等に伴う取崩額を除く]	13	63
(ハ) 繰入額	59	△ 49
(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	28	1

3. 土地の時価情報

(単位:百万円)

	前事業年度末 (平成25年3月31日)	当中間会計期間末 (平成25年9月30日)
時 価	142,256	141,574
貸借対照表価額	190,211	190,197
差 損 益	△ 47,954	△ 48,623

(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。