

### 3-5 有価証券等の時価情報(一般勘定)

#### (1) 有価証券の時価情報

##### 1) 売買目的有価証券の評価損益

平成20年度末、平成21年度末、平成22年度末において、売買目的有価証券は保有していません。

##### 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        | 平成20年度末    |            |           |           |         | 平成21年度末    |            |           |           |         | 平成22年度末    |            |           |           |         |
|------------|------------|------------|-----------|-----------|---------|------------|------------|-----------|-----------|---------|------------|------------|-----------|-----------|---------|
|            | 帳簿価額       | 時価         | 差 損 益     |           |         | 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        |         |            |            | 差益        | 差損        |         |
| 満期保有目的の債券  | 35,360,140 | 36,358,633 | 998,492   | 1,005,083 | 6,590   | 37,632,823 | 38,636,651 | 1,003,827 | 1,050,855 | 47,027  | 41,032,112 | 42,237,648 | 1,205,535 | 1,302,555 | 97,019  |
| 責任準備金対応債券  | 40,821,219 | 41,536,025 | 714,805   | 802,520   | 87,715  | 36,268,618 | 37,164,458 | 895,839   | 987,984   | 92,144  | 30,152,441 | 31,154,718 | 1,002,276 | 1,030,415 | 28,138  |
| 子会社・関連会社株式 | -          | -          | -         | -         | -       | -          | -          | -         | -         | -       | -          | -          | -         | -         | -       |
| その他有価証券    | 7,436,145  | 7,446,393  | 10,248    | 44,178    | 33,930  | 7,205,321  | 7,272,102  | 66,781    | 85,854    | 19,072  | 6,941,093  | 6,974,295  | 33,201    | 76,789    | 43,587  |
| 公社債        | 6,244,676  | 6,262,002  | 17,325    | 32,129    | 14,804  | 5,712,323  | 5,781,865  | 69,542    | 71,395    | 1,853   | 5,302,257  | 5,362,806  | 60,549    | 70,417    | 9,868   |
| 株式         | 313,216    | 296,379    | ▲16,837   | 1,314     | 18,152  | 59,662     | 71,382     | 11,720    | 14,245    | 2,525   | 149,089    | 145,087    | ▲4,001    | 4,145     | 8,147   |
| 外国証券       | 873,652    | 883,483    | 9,831     | 10,733    | 901     | 532,635    | 518,195    | ▲14,439   | 209       | 14,649  | 509,346    | 485,702    | ▲23,644   | 1,920     | 25,564  |
| 公社債        | 873,652    | 883,483    | 9,831     | 10,733    | 901     | 532,635    | 518,195    | ▲14,439   | 209       | 14,649  | 509,346    | 485,702    | ▲23,644   | 1,920     | 25,564  |
| 株式等        | -          | -          | -         | -         | -       | -          | -          | -         | -         | -       | -          | -          | -         | -         | -       |
| その他の証券     | -          | -          | -         | -         | -       | -          | -          | -         | -         | -       | -          | -          | -         | -         | -       |
| 買入金銭債権     | 4,600      | 4,527      | ▲72       | -         | 72      | 8,100      | 8,058      | ▲41       | 3         | 44      | 40,400     | 40,698     | 298       | 306       | 8       |
| 譲渡性預金      | -          | -          | -         | -         | -       | 892,600    | 892,600    | -         | -         | -       | 940,000    | 940,000    | -         | -         | -       |
| その他        | -          | -          | -         | -         | -       | -          | -          | -         | -         | -       | -          | -          | -         | -         | -       |
| 合 計        | 83,617,505 | 85,341,052 | 1,723,546 | 1,851,782 | 128,236 | 81,106,763 | 83,073,212 | 1,966,448 | 2,124,694 | 158,245 | 78,125,647 | 80,366,661 | 2,241,013 | 2,409,760 | 168,746 |
| 公社債        | 82,426,037 | 84,156,660 | 1,730,623 | 1,839,733 | 109,109 | 79,613,765 | 81,582,975 | 1,969,209 | 2,110,235 | 141,025 | 76,388,811 | 78,656,955 | 2,268,143 | 2,402,999 | 134,855 |
| 株式         | 313,216    | 296,379    | ▲16,837   | 1,314     | 18,152  | 59,662     | 71,382     | 11,720    | 14,245    | 2,525   | 149,089    | 145,087    | ▲4,001    | 4,145     | 8,147   |
| 外国証券       | 873,652    | 883,483    | 9,831     | 10,733    | 901     | 532,635    | 518,195    | ▲14,439   | 209       | 14,649  | 607,346    | 583,920    | ▲23,426   | 2,309     | 25,735  |
| 公社債        | 873,652    | 883,483    | 9,831     | 10,733    | 901     | 532,635    | 518,195    | ▲14,439   | 209       | 14,649  | 607,346    | 583,920    | ▲23,426   | 2,309     | 25,735  |
| 株式等        | -          | -          | -         | -         | -       | -          | -          | -         | -         | -       | -          | -          | -         | -         | -       |
| その他の証券     | -          | -          | -         | -         | -       | -          | -          | -         | -         | -       | -          | -          | -         | -         | -       |
| 買入金銭債権     | 4,600      | 4,527      | ▲72       | -         | 72      | 8,100      | 8,058      | ▲41       | 3         | 44      | 40,400     | 40,698     | 298       | 306       | 8       |
| 譲渡性預金      | -          | -          | -         | -         | -       | 892,600    | 892,600    | -         | -         | -       | 940,000    | 940,000    | -         | -         | -       |
| その他        | -          | -          | -         | -         | -       | -          | -          | -         | -         | -       | -          | -          | -         | -         | -       |

(注1) 本表中、平成21年度末、平成22年度末には、「金融商品に関する会計基準」(平成20年3月10日 企業会計基準第10号)により、金融商品取引法上の有価証券(時価のある有価証券)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。

(注2) 金銭の信託のうち売買目的有価証券以外のものを含み、その帳簿価額、差損益は、それぞれ、平成20年度末が313,216百万円、▲16,837百万円、平成21年度末が59,662百万円、11,720百万円、平成22年度末が149,089百万円、▲4,001百万円です。

・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：百万円)

| 区 分                | 平成20年度末   | 平成21年度末 | 平成22年度末 |
|--------------------|-----------|---------|---------|
| 満期保有目的の債券          | —         | —       | —       |
| 非上場外国債券            | —         | —       | —       |
| その他                | —         | —       | —       |
| 責任準備金対応債券          | —         | —       | —       |
| 子会社・関連会社株式         | —         | —       | —       |
| その他有価証券            | 1,149,100 | 140,000 | 140,000 |
| 非上場国内株式(店頭売買株式を除く) | —         | —       | —       |
| 非上場外国株式(店頭売買株式を除く) | —         | 140,000 | 140,000 |
| 非上場外国債券            | —         | —       | —       |
| その他                | 1,149,100 | —       | —       |
| 合 計                | 1,149,100 | 140,000 | 140,000 |

(注)本表中、平成20年度末には、CD(譲渡性預金)等、金融商品取引法上の有価証券(時価のない有価証券)として取り扱うことが適当と認められるものを含んでいます。

また、平成21年度末、平成22年度末には、「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号)により、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を記載しています。

## (2) 金銭の信託の時価情報

(単位：百万円)

| 区 分   | 平成20年度末  |         |       |    |   | 平成21年度末  |         |       |    |   | 平成22年度末  |         |       |    |   |
|-------|----------|---------|-------|----|---|----------|---------|-------|----|---|----------|---------|-------|----|---|
|       | 貸借対照表計上額 | 時価      | 差 損 益 |    |   | 貸借対照表計上額 | 時価      | 差 損 益 |    |   | 貸借対照表計上額 | 時価      | 差 損 益 |    |   |
|       |          |         | 差益    | 差損 |   |          |         | 差益    | 差損 |   |          |         | 差益    | 差損 |   |
| 金銭の信託 | 409,123  | 409,123 | —     | —  | — | 175,038  | 175,038 | —     | —  | — | 225,365  | 225,365 | —     | —  | — |

### 1) 運用目的の金銭の信託

平成20年度末、平成21年度末、平成22年度末において、運用目的の金銭の信託は保有していません。

### 2) 満期保有目的・責任準備金対応・その他の金銭の信託

(単位：百万円)

| 区 分           | 平成20年度末 |         |          |       |        | 平成21年度末 |         |        |        |       | 平成22年度末 |         |         |       |       |
|---------------|---------|---------|----------|-------|--------|---------|---------|--------|--------|-------|---------|---------|---------|-------|-------|
|               | 帳簿価額    | 時価      | 差 損 益    |       |        | 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     |       |         |         | 差益      | 差損    |       |
| 満期保有目的の金銭の信託  | —       | —       | —        | —     | —      | —       | —       | —      | —      | —     | —       | —       | —       | —     | —     |
| 責任準備金対応の金銭の信託 | —       | —       | —        | —     | —      | —       | —       | —      | —      | —     | —       | —       | —       | —     | —     |
| その他の金銭の信託     | 425,960 | 409,123 | ▲ 16,837 | 1,314 | 18,152 | 163,318 | 175,038 | 11,720 | 14,245 | 2,525 | 229,367 | 225,365 | ▲ 4,001 | 4,145 | 8,147 |
| 国内株式ファンド      | 342,622 | 325,785 | ▲ 16,837 | 1,314 | 18,152 | 86,498  | 98,219  | 11,720 | 14,245 | 2,525 | 151,245 | 147,243 | ▲ 4,001 | 4,145 | 8,147 |
| 不動産ファンド       | 83,338  | 83,338  | —        | —     | —      | 76,819  | 76,819  | —      | —      | —     | 78,121  | 78,121  | —       | —     | —     |

### 3) 金銭の信託の有価証券の残存期間別残高

(単位：百万円)

| 運用種目                |      | 残存期間別 |         |         |         |          |                         | 合計      |
|---------------------|------|-------|---------|---------|---------|----------|-------------------------|---------|
|                     |      | 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<br>(期間の定めのないものを含む) |         |
| 平成<br>20<br>年度<br>末 | 国内株式 |       |         |         |         |          | 296,379                 | 296,379 |
| 平成<br>21<br>年度<br>末 | 国内株式 |       |         |         |         |          | 71,382                  | 71,382  |
| 平成<br>22<br>年度<br>末 | 国内株式 |       |         |         |         |          | 145,087                 | 145,087 |

### 4) 外国証券の地域別、発行国別、通貨別構成

平成20年度末、平成21年度末、平成22年度末において、該当ありません。

## 5) 金銭の信託の国内株式の業種別構成

(単位：百万円、%)

| 業種別       | 年度末        | 平成20年度末 |       |              | 平成21年度末 |       |              | 平成22年度末 |       |              |
|-----------|------------|---------|-------|--------------|---------|-------|--------------|---------|-------|--------------|
|           |            | 時価      | 構成比   | TOPIX<br>構成比 | 時価      | 構成比   | TOPIX<br>構成比 | 時価      | 構成比   | TOPIX<br>構成比 |
| 水産・農林業    |            | 234     | 0.1   | 0.1          | 67      | 0.1   | 0.1          | 136     | 0.1   | 0.1          |
| 鉱業        |            | 945     | 0.3   | 0.4          | 259     | 0.4   | 0.4          | 946     | 0.7   | 0.7          |
| 建設業       |            | 6,030   | 2.0   | 2.2          | 1,384   | 1.9   | 2.0          | 3,058   | 2.1   | 2.2          |
| 製造業       | 食料品        | 9,546   | 3.2   | 3.3          | 2,377   | 3.3   | 3.2          | 4,277   | 2.9   | 2.9          |
|           | 繊維製品       | 2,157   | 0.7   | 0.9          | 592     | 0.8   | 0.8          | 1,350   | 0.9   | 1.0          |
|           | パルプ・紙      | 1,168   | 0.4   | 0.5          | 270     | 0.4   | 0.4          | 517     | 0.4   | 0.4          |
|           | 化学         | 17,237  | 5.8   | 5.7          | 4,330   | 6.1   | 5.9          | 8,458   | 5.8   | 6.0          |
|           | 医薬品        | 14,897  | 5.0   | 4.7          | 3,068   | 4.3   | 4.0          | 6,448   | 4.4   | 4.5          |
|           | 石油・石炭製品    | 3,301   | 1.1   | 1.0          | 497     | 0.7   | 0.6          | 1,342   | 0.9   | 1.0          |
|           | ゴム製品       | 1,736   | 0.6   | 0.7          | 415     | 0.6   | 0.6          | 943     | 0.7   | 0.7          |
|           | ガラス・土石製品   | 2,825   | 1.0   | 1.1          | 898     | 1.3   | 1.3          | 1,965   | 1.4   | 1.4          |
|           | 鉄鋼         | 7,652   | 2.6   | 2.4          | 1,959   | 2.7   | 2.7          | 3,299   | 2.3   | 2.3          |
|           | 非鉄金属       | 3,640   | 1.2   | 1.1          | 898     | 1.3   | 1.2          | 1,985   | 1.4   | 1.4          |
|           | 金属製品       | 1,547   | 0.5   | 0.7          | 510     | 0.7   | 0.7          | 1,022   | 0.7   | 0.8          |
|           | 機械         | 11,771  | 4.0   | 4.1          | 3,375   | 4.7   | 4.7          | 7,523   | 5.2   | 5.4          |
|           | 電気機器       | 38,008  | 12.8  | 12.6         | 10,684  | 15.0  | 15.3         | 21,057  | 14.5  | 14.8         |
|           | 輸送用機器      | 27,702  | 9.3   | 9.2          | 7,057   | 9.9   | 9.9          | 14,743  | 10.2  | 10.1         |
|           | 精密機器       | 3,044   | 1.0   | 1.3          | 1,141   | 1.6   | 1.6          | 2,034   | 1.4   | 1.4          |
| その他製品     | 8,222      | 2.8     | 2.7   | 1,699        | 2.4     | 2.5   | 3,026        | 2.1     | 2.1   |              |
| 電気・ガス業    |            | 18,782  | 6.3   | 6.5          | 3,735   | 5.2   | 4.9          | 6,376   | 4.4   | 3.7          |
| 運輸・情報・通信業 | 陸運業        | 12,945  | 4.4   | 4.4          | 2,738   | 3.8   | 3.8          | 5,063   | 3.5   | 3.5          |
|           | 海運業        | 2,137   | 0.7   | 0.6          | 397     | 0.6   | 0.6          | 826     | 0.6   | 0.6          |
|           | 空運業        | 1,523   | 0.5   | 0.7          | 237     | 0.3   | 0.3          | 443     | 0.3   | 0.3          |
|           | 倉庫・運輸関連業   | 708     | 0.2   | 0.3          | 171     | 0.2   | 0.2          | 334     | 0.2   | 0.2          |
|           | 情報・通信業     | 20,668  | 7.0   | 6.1          | 4,021   | 5.6   | 5.3          | 8,360   | 5.8   | 5.8          |
| 商業        | 卸売業        | 14,170  | 4.8   | 4.4          | 3,737   | 5.2   | 5.2          | 7,857   | 5.4   | 5.7          |
|           | 小売業        | 11,085  | 3.7   | 3.8          | 2,574   | 3.6   | 3.5          | 5,021   | 3.5   | 3.5          |
| 金融・保険業    | 銀行業        | 29,678  | 10.0  | 10.2         | 6,238   | 8.7   | 9.7          | 13,715  | 9.5   | 9.1          |
|           | 証券・商品先物取引業 | 3,522   | 1.2   | 1.3          | 1,169   | 1.6   | 1.8          | 2,153   | 1.5   | 1.4          |
|           | 保険業        | 7,329   | 2.5   | 2.6          | 1,571   | 2.2   | 2.2          | 3,705   | 2.6   | 2.5          |
|           | その他金融業     | 1,812   | 0.6   | 0.7          | 544     | 0.8   | 0.8          | 1,136   | 0.8   | 0.8          |
| 不動産業      |            | 5,194   | 1.8   | 2.0          | 1,591   | 2.2   | 2.2          | 3,529   | 2.4   | 2.3          |
| サービス業     |            | 5,149   | 1.7   | 1.7          | 1,163   | 1.6   | 1.5          | 2,426   | 1.7   | 1.7          |
| 合計        |            | 296,379 | 100.0 | 100.0        | 71,382  | 100.0 | 100.0        | 145,087 | 100.0 | 100.0        |

## 6) 金銭の信託の委託先別時価残高及び運用実績

### 【平成20年度】

#### ■国内株式アクティブファンド

(単位：百万円、%)

| 投資一任契約先                  | 時価総額   | 計測期間の<br>時間加重収益率 | 超過収益率  |
|--------------------------|--------|------------------|--------|
| パークレイズ・グローバル・インベスターズ     | 32,431 | ▲ 40.47          | ▲ 3.00 |
| 大和住銀投信投資顧問               | 23,518 | ▲ 40.50          | ▲ 3.03 |
| ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント  | 18,006 | ▲ 39.04          | ▲ 1.57 |
| ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ | 11,406 | ▲ 40.02          | ▲ 2.55 |
| 合 計                      | 85,363 | ▲ 41.18          | ▲ 3.71 |

#### ■国内株式パッシブファンド

(単位：百万円、%)

| 投資一任契約先      | 時価総額    | 計測期間の時間加重収益率 |
|--------------|---------|--------------|
| 住友信託銀行       | 131,340 | ▲ 37.84      |
| 中央三井アセット信託銀行 | 88,039  | ▲ 37.04      |
| 三菱UFJ信託銀行    | 21,041  | ▲ 38.94      |
| 合 計          | 240,421 | ▲ 37.94      |

#### ■不動産ファンド

(単位：百万円、%)

| 単独運用指定金銭信託契約先 | 時価総額   | 計測期間の時間加重収益率 |
|---------------|--------|--------------|
| 三菱UFJ信託銀行     | 41,697 | 3.72         |
| 中央三井アセット信託銀行  | 41,641 | 4.08         |
| 合 計           | 83,338 | 3.90         |

#### ◆計測期間、ベンチマーク等

(単位：%)

| 国内株式 | 計測期間             | ベンチマーク収益率 | ベンチマーク名称  |
|------|------------------|-----------|-----------|
|      | 平成19年10月～平成21年3月 | ▲ 37.47   | TOPIX配当込み |

(注1) 時間加重収益率は、ファンドの資産のうち、短期資産を除いた部分で計測しています。

(注2) ベンチマーク収益率及び時間加重収益率は、年率換算しています。

## 【平成21年度】

## ■国内株式パッシブファンド

(単位：百万円、%)

| 投資一任契約先      | 時価総額   | 計測期間の時間加重収益率 |
|--------------|--------|--------------|
| 住友信託銀行       | 37,862 | ▲ 15.64      |
| 中央三井アセット信託銀行 | 34,984 | ▲ 16.14      |
| 三菱UFJ信託銀行    | 25,371 | ▲ 17.77      |
| 合 計          | 98,219 | ▲ 16.41      |

## ■不動産ファンド

(単位：百万円、%)

| 単独運用指定金銭信託契約先 | 時価総額   | 計測期間の時間加重収益率 |
|---------------|--------|--------------|
| 三菱UFJ信託銀行     | 38,213 | 3.60         |
| 中央三井アセット信託銀行  | 38,605 | 3.63         |
| 合 計           | 76,819 | 3.62         |

## ◆計測期間、ベンチマーク等

(単位：%)

| 国内株式 | 計測期間             | ベンチマーク収益率 | ベンチマーク名称  |
|------|------------------|-----------|-----------|
|      | 平成19年10月～平成22年3月 | ▲ 16.60   | TOPIX配当込み |

(注1) 時間加重収益率は、ファンドの資産のうち、短期資産を除いた部分で計測しています。

(注2) ベンチマーク収益率及び時間加重収益率は、年率換算しています。

## 【平成22年度】

### ■国内株式パッシブファンド

(単位：百万円、%)

| 投資一任契約先      | 時価総額    | 計測期間の時間加重収益率 |
|--------------|---------|--------------|
| 住友信託銀行       | 50,145  | 0.64         |
| 中央三井アセット信託銀行 | 48,873  | 0.51         |
| 三菱UFJ信託銀行    | 48,225  | 0.72         |
| 合 計          | 147,243 | 0.60         |

(注1) 時間加重収益率は、ファンドの資産のうち、短期資産を除いた部分で計測しています。

(注2) 計測期間は平成22年6月～平成23年3月としています。

(注3) ベンチマーク(TOPIX(配当込み))の同期間の収益率は、0.90%です。

(注4) 国内株式パッシブファンドの時間加重収益率については、平成22年度分より日次厳密法で計測しています。

### ■不動産ファンド

(単位：百万円、%)

| 単独運用指定金銭信託契約先 | 時価総額   | 計測期間の時間加重収益率 |
|---------------|--------|--------------|
| 三菱UFJ信託銀行     | 39,051 | 3.25         |
| 中央三井アセット信託銀行  | 39,069 | 2.85         |
| 合 計           | 78,121 | 3.05         |

(注1) 時間加重収益率は、ファンド資産のうち、短期資産を除いた部分で計測しています。

(注2) 計測期間は平成20年4月～平成23年3月とし、年率換算しています。

## 7) 金銭の信託の報酬額

(単位：百万円)

| 区 分     | 平成20年度 | 平成21年度 | 平成22年度 |
|---------|--------|--------|--------|
| 運用受託機関分 | 550    | 233    | 67     |
| 資産管理機関分 | 357    | 261    | 226    |
| 合 計     | 908    | 495    | 293    |

(注) 資産管理機関分には、不動産ファンドの信託報酬が含まれています。

## (3) デリバティブ取引の時価情報(ヘッジ会計適用・非適用の合算値)

## ①差損益の内訳(ヘッジ会計適用分・非適用分の内訳)

(単位:百万円)

| 区 分     |           | 金利関連 | 通貨関連    | 株式関連 | 債券関連 | その他 | 合計      |
|---------|-----------|------|---------|------|------|-----|---------|
| 平成20年度末 | ヘッジ会計適用分  | ▲ 55 | —       | —    | —    | —   | ▲ 55    |
|         | ヘッジ会計非適用分 | —    | —       | —    | —    | —   | —       |
|         | 合 計       | ▲ 55 | —       | —    | —    | —   | ▲ 55    |
| 平成21年度末 | ヘッジ会計適用分  | 190  | ▲ 2,510 | —    | —    | —   | ▲ 2,320 |
|         | ヘッジ会計非適用分 | —    | —       | —    | —    | —   | —       |
|         | 合 計       | 190  | ▲ 2,510 | —    | —    | —   | ▲ 2,320 |
| 平成22年度末 | ヘッジ会計適用分  | 187  | ▲ 1,379 | —    | —    | —   | ▲ 1,192 |
|         | ヘッジ会計非適用分 | —    | —       | —    | —    | —   | —       |
|         | 合 計       | 187  | ▲ 1,379 | —    | —    | —   | ▲ 1,192 |

(注1) 平成21年度末のヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ適用分の差損益(通貨関連▲2,510百万円)は損益計算書に計上されています。

(注2) 平成22年度末のヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ適用分の差損益(通貨関連▲1,379百万円)は損益計算書に計上されています。

## ②金利関連

(単位:百万円)

| 区分 | 種類                | 平成20年度末 |        |      | 平成21年度末 |        |        | 平成22年度末 |     |        |        |     |     |
|----|-------------------|---------|--------|------|---------|--------|--------|---------|-----|--------|--------|-----|-----|
|    |                   | 契約額等    |        | 時価   | 差損益     | 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  |        |         |     | うち1年超  |        |     |     |
| 店頭 | 金利スワップ            |         |        |      |         |        |        |         |     |        |        |     |     |
|    | 固定金利受取/<br>変動金利支払 | 11,300  | 11,300 | ▲ 55 | ▲ 55    | 22,200 | 22,200 | 190     | 190 | 42,600 | 42,600 | 187 | 187 |
|    | 合 計               |         |        |      | ▲ 55    |        |        | 190     |     |        |        |     | 187 |

(注)「差損益」欄には、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。

## (参考)金利スワップ残存期間別残高

(単位:百万円、%)

| 区 分     |                   | 1年以下 | 1年超<br>3年以下 | 3年超<br>5年以下 | 5年超<br>7年以下 | 7年超<br>10年以下 | 10年超 | 合計     |
|---------|-------------------|------|-------------|-------------|-------------|--------------|------|--------|
| 平成20年度末 | 受取側固定<br>スワップ想定元本 | —    | —           | 9,300       | 2,000       | —            | —    | 11,300 |
|         | 平均受取固定金利          | —    | —           | 1.25        | 1.25        | —            | —    | 1.25   |
|         | 平均支払変動金利          | —    | —           | 1.13        | 1.20        | —            | —    | 1.14   |
|         | 合 計               | —    | —           | 9,300       | 2,000       | —            | —    | 11,300 |
| 平成21年度末 | 受取側固定<br>スワップ想定元本 | —    | —           | 20,200      | 2,000       | —            | —    | 22,200 |
|         | 平均受取固定金利          | —    | —           | 1.14        | 1.25        | —            | —    | 1.15   |
|         | 平均支払変動金利          | —    | —           | 0.78        | 0.68        | —            | —    | 0.77   |
|         | 合 計               | —    | —           | 20,200      | 2,000       | —            | —    | 22,200 |
| 平成22年度末 | 受取側固定<br>スワップ想定元本 | —    | 9,300       | 33,300      | —           | —            | —    | 42,600 |
|         | 平均受取固定金利          | —    | 1.25        | 0.71        | —           | —            | —    | 0.83   |
|         | 平均支払変動金利          | —    | 0.78        | 0.40        | —           | —            | —    | 0.49   |
|         | 合 計               | —    | 9,300       | 33,300      | —           | —            | —    | 42,600 |



### ③通貨関連

(単位：百万円)

| 区分 | 種類      | 平成20年度末 |   |    | 平成21年度末 |       |         | 平成22年度末 |        |       |         |         |
|----|---------|---------|---|----|---------|-------|---------|---------|--------|-------|---------|---------|
|    |         | 契約額等    |   | 時価 | 差損益     | 契約額等  |         | 時価      | 差損益    | 契約額等  |         |         |
|    |         | うち1年超   |   |    |         | うち1年超 |         |         |        | うち1年超 |         |         |
| 店頭 | 為替予約    |         |   |    |         |       |         |         |        |       |         |         |
|    | 売 建     | —       | — | —  | —       | —     | ▲ 2,510 | ▲ 2,510 | 77,114 | —     | ▲ 1,379 | ▲ 1,379 |
|    | (うち米ドル) | —       | — | —  | —       | —     | ▲ 2,510 | ▲ 2,510 | 77,114 | —     | ▲ 1,379 | ▲ 1,379 |
|    | 買 建     | —       | — | —  | —       | —     | —       | —       | —      | —     | —       | —       |
|    | 合 計     |         |   |    |         |       | ▲ 2,510 |         |        |       |         | ▲ 1,379 |

(注1) 年度末の為替相場は先物相場を使用しています。

(注2) 為替予約の時価は差損益を記載しています。

### ④株式関連

該当の残高はありません。

### ⑤債券関連

該当の残高はありません。

### ⑥その他

該当の残高はありません。

## 4.特別勘定に関する指標等

該当ありません。

## 5.保険会社及びその子会社等の状況

該当ありません。