

4-5 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26年度末、平成27年度末、平成28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26年度末					平成27年度末					平成28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	43,695,559	48,232,675	4,537,116	4,537,655	539	42,239,821	49,752,914	7,513,092	7,513,093	0	40,441,881	46,518,693	6,076,812	6,149,942	73,129
責任準備金対応債券	15,493,208	16,668,447	1,175,238	1,175,453	214	13,563,423	15,062,160	1,498,737	1,498,737	-	12,517,334	13,697,410	1,180,075	1,204,445	24,370
子会社・関連会社株式	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他有価証券	9,411,484	10,193,205	781,721	784,470	2,748	9,918,112	10,479,639	561,527	658,164	96,636	12,522,618	12,966,282	443,664	657,830	214,165
公社債	5,105,394	5,203,999	98,605	99,163	558	4,012,950	4,115,794	102,844	103,597	752	4,758,489	4,796,899	38,409	71,613	33,204
株式	713,204	996,906	283,701	285,545	1,844	1,065,422	1,202,513	137,091	195,326	58,235	1,302,336	1,626,015	323,679	342,436	18,757
外国証券	1,850,911	2,248,231	397,319	397,666	346	3,682,785	4,001,136	318,351	355,894	37,542	4,658,641	4,748,683	90,041	237,280	147,238
公社債	1,537,712	1,863,492	325,779	326,126	346	3,299,371	3,590,822	291,450	319,363	27,912	4,219,602	4,248,732	29,130	175,028	145,898
株式等	313,198	384,738	71,539	71,539	-	383,413	410,314	26,901	36,531	9,630	439,038	499,950	60,911	62,252	1,340
その他の証券	-	-	-	-	-	100,000	100,044	44	150	105	1,428,000	1,417,122	△ 10,877	4,086	14,964
買入金銭債権	446,973	449,068	2,095	2,095	-	426,954	430,150	3,195	3,195	-	25,149	27,561	2,411	2,411	-
譲渡性預金	1,295,000	1,295,000	-	-	-	630,000	630,000	-	-	-	350,000	350,000	-	-	-
その他	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
合 計	68,600,251	75,094,328	6,494,077	6,497,580	3,502	65,721,357	75,294,714	9,573,357	9,669,994	96,637	65,481,834	73,182,386	7,700,552	8,012,218	311,665
公社債	64,196,162	70,003,228	5,807,066	5,808,378	1,312	59,718,195	68,828,482	9,110,287	9,111,040	753	57,619,705	64,911,866	7,292,160	7,422,865	130,704
株式	713,204	996,906	283,701	285,545	1,844	1,065,422	1,202,513	137,091	195,326	58,235	1,302,336	1,626,015	323,679	342,436	18,757
外国証券	1,948,911	2,350,125	401,213	401,560	346	3,780,785	4,103,523	322,738	360,281	37,542	4,756,641	4,849,819	93,178	240,417	147,238
公社債	1,635,712	1,965,386	329,673	330,020	346	3,397,371	3,693,209	295,837	323,750	27,912	4,317,602	4,349,869	32,266	178,164	145,898
株式等	313,198	384,738	71,539	71,539	-	383,413	410,314	26,901	36,531	9,630	439,038	499,950	60,911	62,252	1,340
その他の証券	-	-	-	-	-	100,000	100,044	44	150	105	1,428,000	1,417,122	△ 10,877	4,086	14,964
買入金銭債権	446,973	449,068	2,095	2,095	-	426,954	430,150	3,195	3,195	-	25,149	27,561	2,411	2,411	-
譲渡性預金	1,295,000	1,295,000	-	-	-	630,000	630,000	-	-	-	350,000	350,000	-	-	-
その他	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

(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26年度末が1,026,403百万円、355,241百万円、平成27年度末が1,448,835百万円、163,992百万円、平成28年度末が1,686,170百万円、380,716百万円です。

・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26年度末	平成27年度末	平成28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	984	984	984
その他有価証券	20,000	—	4,239
非上場国内株式(店頭売買株式を除く)	—	—	4,239
非上場外国株式(店頭売買株式を除く)	20,000	—	—
非上場外国債券	—	—	—
その他	—	—	—
合 計	20,984	984	5,223

(2) 金銭の信託の時価情報

(単位：百万円)

区 分	平成26年度末					平成27年度末					平成28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	1,434,943	1,434,943	—	—	—	1,644,547	1,644,547	—	—	—	2,127,042	2,127,042	—	—	—

1) 運用目的の金銭の信託

平成26年度末、平成27年度末、平成28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26年度末					平成27年度末					平成28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	1,079,701	1,434,943	355,241	357,085	1,844	1,480,555	1,644,547	163,992	231,857	67,865	1,746,326	2,127,042	380,716	400,483	19,767
国内株式 ファンド	765,237	1,048,938	283,701	285,545	1,844	1,090,727	1,227,819	137,091	195,326	58,235	1,306,142	1,625,946	319,804	338,231	18,426
外国株式 ファンド	158,944	195,510	36,565	36,565	—	228,532	235,713	7,180	16,811	9,630	273,163	315,104	41,941	43,282	1,340
外国債券 ファンド	155,519	190,493	34,974	34,974	—	161,295	181,015	19,720	19,720	—	167,020	185,990	18,970	18,970	—

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	1年以下	1年超3年以下	3年超5年以下	5年超7年以下	7年超10年以下	10年超 (期間の定めのないものを含む)	合計
		平成26年度末						
国内株式							996,906	1,381,644
外国証券							384,738	
公社債							—	
株式等							384,738	
平成27年度末								
国内株式							1,202,513	1,612,827
外国証券							410,314	
公社債							—	
株式等							410,314	
平成28年度末								
国内株式							1,571,934	2,066,886
外国証券							494,952	
公社債							—	
株式等							494,952	

4) 金銭の信託の通貨別構成

(単位：百万円、%)

区 分	平成26年度末		平成27年度末		平成28年度末	
	金額	占率	金額	占率	金額	占率
日本円	996,906	72.2	1,202,513	74.6	1,571,934	76.1
米ドル	364,823	26.4	387,285	24.0	462,314	22.4
ユーロ	—	—	—	—	28,041	1.4
その他	19,915	1.4	23,029	1.4	4,596	0.2
合計	1,381,644	100.0	1,612,827	100.0	2,066,886	100.0

(注) 現預金等は除いています。

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26年度末		平成27年度末		平成28年度末	
		時価	構成比	時価	構成比	時価	構成比
水産・農林業		559	0.1	801	0.1	1,318	0.1
鉱業		3,022	0.3	3,003	0.2	4,328	0.3
建設業		29,857	3.0	41,353	3.4	55,564	3.5
製造業	食料品	41,889	4.2	62,603	5.2	71,062	4.5
	繊維製品	5,604	0.6	6,517	0.5	8,565	0.5
	パルプ・紙	1,706	0.2	2,328	0.2	3,042	0.2
	化学	50,087	5.0	67,118	5.6	95,352	6.1
	医薬品	57,218	5.7	74,337	6.2	80,019	5.1
	石油・石炭製品	9,614	1.0	4,046	0.3	5,965	0.4
	ゴム製品	10,529	1.1	25,414	2.1	32,904	2.1
	ガラス・土石製品	6,766	0.7	8,050	0.7	12,751	0.8
	鉄鋼	12,032	1.2	12,174	1.0	16,483	1.0
	非鉄金属	12,243	1.2	13,116	1.1	12,170	0.8
	金属製品	4,884	0.5	5,650	0.5	8,145	0.5
	機械	47,724	4.8	57,642	4.8	90,035	5.7
	電気機器	109,326	11.0	144,451	12.0	196,919	12.5
	輸送用機器	125,236	12.6	136,059	11.3	197,316	12.6
	精密機器	23,188	2.3	15,440	1.3	21,402	1.4
	その他製品	10,460	1.0	13,261	1.1	20,538	1.3
電気・ガス業		14,463	1.5	18,050	1.5	21,451	1.4
運輸・情報・通信業	陸運業	40,836	4.1	45,044	3.7	53,224	3.4
	海運業	2,446	0.2	1,992	0.2	2,956	0.2
	空運業	7,150	0.7	8,575	0.7	11,315	0.7
	倉庫・運輸関連業	1,670	0.2	1,704	0.1	2,095	0.1
	情報・通信業	92,457	9.3	124,335	10.3	148,094	9.4
商業	卸売業	69,127	6.9	70,010	5.8	73,048	4.6
	小売業	36,775	3.7	51,225	4.3	60,623	3.9
金融・保険業	銀行業	81,461	8.2	75,608	6.3	108,138	6.9
	証券・商品先物取引業	10,079	1.0	10,842	0.9	16,443	1.0
	保険業	18,380	1.8	24,695	2.1	47,667	3.0
	その他金融業	9,349	0.9	13,446	1.1	16,061	1.0
不動産業		23,379	2.3	29,266	2.4	31,904	2.0
サービス業		27,373	2.7	34,344	2.9	45,021	2.9
合計		996,906	100.0	1,202,513	100.0	1,571,934	100.0

(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26年度末	ヘッジ会計適用分	971	493	—	—	—	1,465
	ヘッジ会計非適用分	—	—	—	—	—	—
	合 計	971	493	—	—	—	1,465
平成27年度末	ヘッジ会計適用分	2,060	4,644	—	—	—	6,704
	ヘッジ会計非適用分	—	—	—	—	—	—
	合 計	2,060	4,644	—	—	—	6,704
平成28年度末	ヘッジ会計適用分	1,364	△ 4,657	—	—	—	△ 3,292
	ヘッジ会計非適用分	—	—	—	—	—	—
	合 計	1,364	△ 4,657	—	—	—	△ 3,292

(注1) 平成26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493百万円)は損益計算書に計上されています。

(注2) 平成27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4,644百万円)は損益計算書に計上されています。

(注3) 平成28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△4,657百万円)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26年度末				平成27年度末				平成28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/ 変動金利支払	101,950	79,250	971	971	79,250	59,800	2,060	2,060	57,800	51,500	1,364	1,364
	合 計				971				2,060				1,364

(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 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
平成26年度末	受取側固定 スワップ想定元本	22,700	25,750	22,300	10,050	16,150	5,000	101,950
	平均受取固定金利	0.55	0.44	0.45	0.48	0.94	1.12	0.58
	平均支払変動金利	0.17	0.16	0.18	0.20	0.24	0.24	0.19
	合 計	22,700	25,750	22,300	10,050	16,150	5,000	101,950
平成27年度末	受取側固定 スワップ想定元本	19,450	24,550	8,400	8,600	13,250	5,000	79,250
	平均受取固定金利	0.50	0.39	0.52	0.61	0.94	1.12	0.59
	平均支払変動金利	0.09	0.05	0.11	0.15	0.10	0.13	0.09
	合 計	19,450	24,550	8,400	8,600	13,250	5,000	79,250
平成28年度末	受取側固定 スワップ想定元本	6,300	19,300	10,050	12,150	10,000	—	57,800
	平均受取固定金利	0.24	0.47	0.48	0.90	1.05	—	0.64
	平均支払変動金利	0.02	0.08	0.09	0.16	0.14	—	0.10
	合 計	6,300	19,300	10,050	12,150	10,000	—	57,800

③通貨関連

(単位：百万円)

区分	種類	平成26年度末			平成27年度末			平成28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	363,120	-	493	493	1,693,683	-	4,644	4,644	2,438,390	-	△ 4,657	△ 4,657
	(うち米ドル)	172,008	-	△ 12,843	△ 12,843	392,081	-	5,408	5,408	1,603,918	-	△ 5,630	△ 5,630
	(うちユーロ)	191,112	-	13,337	13,337	1,301,602	-	△ 764	△ 764	834,472	-	973	973
	買 建	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	合 計				493				4,644				△ 4,657

(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

平成26年度末、平成27年度末、平成28年度末において、該当の残高はありません。

⑤債券関連

平成26年度末、平成27年度末、平成28年度末において、該当の残高はありません。

⑥その他

平成26年度末、平成27年度末、平成28年度末において、該当の残高はありません。

5. 特別勘定に関する指標等

該当ありません。