

### 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

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18年度末					平成19年度末				
	帳簿価額	時価	差 損 益		帳簿価額	時価	差 損 益			
			うち差益	うち差損			うち差益	うち差損		
満期保有目的の債券	—	—	—	—	31,366,941	32,187,510	820,569	823,269	2,700	
責任準備金対応債券	—	—	—	—	44,037,157	44,742,056	704,899	851,310	146,410	
子会社・関連会社株式	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
その他有価証券	—	—	—	—	11,816,976	11,623,135	▲193,841	57,216	251,057	
公社債	—	—	—	—	7,610,356	7,654,912	44,556	50,335	5,778	
株式	—	—	—	—	1,675,142	1,458,350	▲216,792	6,784	223,577	
外国証券	—	—	—	—	2,531,477	2,509,872	▲21,605	96	21,701	
公社債	—	—	—	—	2,531,477	2,509,872	▲21,605	96	21,701	
株式等	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
その他の証券	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
買入金銭債権	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
譲渡性預金	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
その他	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
合 計	—	—	—	—	87,221,076	88,552,702	1,331,626	1,731,796	400,169	
公社債	—	—	—	—	83,014,455	84,584,480	1,570,024	1,724,915	154,890	
株式	—	—	—	—	1,675,142	1,458,350	▲216,792	6,784	223,577	
外国証券	—	—	—	—	2,531,477	2,509,872	▲21,605	96	21,701	
公社債	—	—	—	—	2,531,477	2,509,872	▲21,605	96	21,701	
株式等	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
その他の証券	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
買入金銭債権	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
譲渡性預金	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
その他	—	—	—	—	—	—	—	—	—	

(注1) 本表には、CD(譲渡性預金)等、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、1,675,142百万円、▲216,792百万円です。

・時価のない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18年度末	平成19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	—	1,014,581
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）	—	—
非上場外国債券	—	—
その他	—	1,014,581
合 計	—	1,014,581

(注) 本表には、CD（譲渡性預金）等、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を含んでいます。

## (2) 金銭の信託の時価情報

(単位：百万円)

区 分	平成18年度末					平成19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			
			うち差益	うち差損			うち差益	うち差損		
金銭の信託	—	—	—	—	—	1,861,542	1,861,542	—	—	—

### 1) 運用目的の金銭の信託

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18年度末					平成19年度末				
	帳簿価額	時価	差 損 益		帳簿価額	時価	差 損 益			
			うち差益	うち差損			うち差益	うち差損		
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	—	—	—	—	—	2,078,335	1,861,542	▲216,792	6,784	223,577
国内株式ファンド	—	—	—	—	—	1,997,592	1,780,799	▲216,792	6,784	223,577
不動産ファンド	—	—	—	—	—	80,743	80,743	—	—	—

### 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 (期間の定めのない ものを含む)	
平成18年度末	国内株式						—	—
平成19年度末	国内株式						1,458,350	1,458,350

### 4) 外国証券の地域別、発行国別、通貨別構成

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18年度末			平成19年度末		
		時価	構成比	TOPIX 構成比	時価	構成比	TOPIX 構成比
水産・農林業		—	—	—	1,037	0.1	0.1
鉱業		—	—	—	6,089	0.4	0.4
建設業		—	—	—	24,562	1.7	1.7
製造業	食料品	—	—	—	44,896	3.1	3.3
	繊維製品	—	—	—	10,798	0.7	0.9
	パルプ・紙	—	—	—	3,785	0.3	0.3
	化学	—	—	—	80,883	5.5	5.5
	医薬品	—	—	—	61,242	4.2	4.1
	石油・石炭製品	—	—	—	10,834	0.7	0.7
	ゴム製品	—	—	—	6,620	0.5	0.5
	ガラス・土石製品	—	—	—	17,286	1.2	1.2
	鉄鋼	—	—	—	45,299	3.1	3.1
	非鉄金属	—	—	—	20,219	1.4	1.2
	金属製品	—	—	—	7,073	0.5	0.5
	機械	—	—	—	64,717	4.4	4.5
	電気機器	—	—	—	209,833	14.4	14.0
	輸送用機器	—	—	—	142,458	9.8	9.5
	精密機器	—	—	—	18,447	1.3	1.4
その他製品	—	—	—	42,880	2.9	3.0	
電気・ガス業		—	—	—	63,515	4.4	4.6
運輸・情報通信業	陸運業	—	—	—	53,288	3.7	3.7
	海運業	—	—	—	14,323	1.0	1.0
	空運業	—	—	—	6,128	0.4	0.5
	倉庫・運輸関連業	—	—	—	3,057	0.2	0.2
	情報・通信業	—	—	—	80,010	5.5	5.3
商業	卸売業	—	—	—	83,751	5.7	5.2
	小売業	—	—	—	43,382	3.0	3.3
金融・保険業	銀行業	—	—	—	156,350	10.7	10.6
	証券、商品先物取引業	—	—	—	24,351	1.7	1.6
	保険業	—	—	—	38,029	2.6	2.6
	その他金融業	—	—	—	18,459	1.3	1.3
不動産業		—	—	—	33,393	2.3	2.5
サービス業		—	—	—	21,340	1.5	1.5
合計		—	—	—	1,458,350	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19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 時間加重収益率	超過収益率
バークレイズ・グローバル・インベスターズ	57,815	▲25.75	▲1.57
住友信託銀行	56,824	▲29.20	▲5.02
中央三井アセット信託銀行	55,416	▲27.88	▲3.70
大和住銀投信投資顧問	38,289	▲27.51	▲3.33
ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント	29,100	▲25.41	▲1.23
ステート・ストリート投信投資顧問	18,426	▲26.44	▲2.26
合 計	255,872	▲27.72	▲3.54

### ■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①	629,995	▲23.98
中央三井アセット信託銀行①	547,377	▲24.09
三菱UFJ信託銀行①	225,151	▲24.10
中央三井アセット信託銀行②	105,900	▲24.09
三菱UFJ信託銀行②	10,560	▲21.68
住友信託銀行②	5,942	▲22.62
合 計	1,524,926	▲24.22

### ■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	40,463	1.85
中央三井アセット信託銀行	40,279	2.06
合 計	80,743	1.96

(注) 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。

### ◆計測期間、ベンチマーク等

(単位：%)

	計測期間	ベンチマーク収益率	ベンチマーク名称
国内株式	平成19年10月～平成20年3月	▲24.18	TOPIX配当込み

## 7) 金銭の信託の報酬額

(単位：百万円)

区 分	平成18年度	平成19年度
運用受託機関分	—	569
資産管理機関分	—	287
合 計	—	856

(注) 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) 定性的情報

##### ① 取引の内容

当社が利用しているデリバティブ取引は、通貨関連の為替予約取引です。

##### ② 取組方針

当社が利用しているデリバティブ取引は、原則として為替予約取引に限定しています。デリバティブ取引を行う際は、ヘッジ目的に限り実施することとし、投機的な取引は行わない方針です。

ヘッジ会計の有効性の判定については、為替予約を実施する場合に、ヘッジ対象とヘッジ手段が同一通貨、同一期日でかつ外貨の想定元本が一致するように実施していることから、その後の為替相場変動による相関関係は完全に確保されているため、その判定をもって有効性の判定に代えています。

##### ③ 利用目的

当社が行っている為替予約取引は、外貨債の償還金や利子などの外貨キャッシュ・フローの円貨額を確定させ、為替レートの変動によるリスクを軽減させるためのものです。

##### ④ リスクの内容

為替予約取引は為替レートの変動によるリスクを有しています。また、為替予約取引の契約先は信用度の高い取引機関であるため、相手方の契約不履行による信用リスクはほとんどないと認識しています。

##### ⑤ リスク管理体制

当社のリスク管理基本方針において、金融派生商品の利用についてはヘッジ目的に限るものとし、投機目的には利用しないこととしています。

為替予約取引については、同基本方針を遵守して策定した資産運用方針に従い約定を実施しており、約定結果は、バック事務を委託している資産管理銀行及びミドル事務担当部署において確認し、また、ヘッジ対象及びヘッジ手段のポジションについては、毎月、リスク管理関連部署において確認を行っております。なお、信用リスクについては、取引先ごとに取引の与信限度額を設定することなどにより管理しています。

##### ⑥ 定量的情報に関する補足説明

特にありません。

## 2) 定量的情報

### 【平成19年度末】

- ① 差損益の内訳（ヘッジ会計適用分・非適用分の内訳）  
該当ありません。
- ② 金利関連  
該当ありません。
- ③ 通貨関連  
該当ありません。
- ④ 株式関連  
該当ありません。
- ⑤ 債券関連  
該当ありません。
- ⑥ その他  
該当ありません。