

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當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
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
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)

残存期間別 運用種目		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 20 年度末	国 内 株 式						296,379	296,379
平成 21 年度末	国 内 株 式						71,382	71,382
平成 22 年度末	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構成比	時価	構成比	TOPIX構成比	時価	構成比	TOPIX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・インベスタートーズ	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收益率
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收益率
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	ベンチマーク收益率	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) 時間加重收益率は、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) ベンチマーク收益率及び時間加重收益率は、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收益率
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) 時間加重收益率は、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))の同期間の收益率は、0.90%です。

(注4) 国内株式パッシブファンドの時間加重收益率については、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收益率
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) 時間加重收益率は、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 うち1年超	時価	差損益	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	11,300	11,300	▲ 55	22,200	22,200	190	42,600	42,600	187
	固定金利受取／ 変動金利支払									
	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 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20年度末	受取側固定 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 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 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	—	—	—	—	89,354	—	▲ 2,510	▲ 2,510	77,114	—					
	売 建	—	—	—	—	89,354	—	▲ 2,510	▲ 2,510	77,114	—					
	(うち米ドル)	—	—	—	—	—	—	—	—	—	▲ 1,379					
	買 建	—	—	—	—	—	—	—	—	—	▲ 1,379					
合 計		/			—	/			▲ 2,510	/						
(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。