

### 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21年度末、平成22年度末、平成23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21年度末					平成22年度末					平成23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	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	44,444,928	46,533,803	2,088,875	2,098,978	10,103
責任準備金対応債券	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	24,812,291	25,990,069	1,177,778	1,177,933	155
子会社・関連会社株式	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他有価証券	7,205,321	7,272,102	66,781	85,854	19,072	6,941,093	6,974,295	33,201	76,789	43,587	6,196,880	6,279,629	82,748	119,730	36,981
公社債	5,712,323	5,781,865	69,542	71,395	1,853	5,302,257	5,362,806	60,549	70,417	9,868	4,739,555	4,808,351	68,796	91,738	22,942
株式	59,662	71,382	11,720	14,245	2,525	149,089	145,087	▲ 4,001	4,145	8,147	180,795	180,680	▲ 114	9,257	9,372
外国証券	532,635	518,195	▲ 14,439	209	14,649	509,346	485,702	▲ 23,644	1,920	25,564	367,229	380,605	13,375	18,042	4,667
公社債	532,635	518,195	▲ 14,439	209	14,649	509,346	485,702	▲ 23,644	1,920	25,564	367,229	380,605	13,375	18,042	4,667
株式等	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他の証券	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
買入金銭債権	8,100	8,058	▲ 41	3	44	40,400	40,698	298	306	8	13,900	14,591	691	691	-
譲渡性預金	892,600	892,600	-	-	-	940,000	940,000	-	-	-	895,400	895,400	-	-	-
その他	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
合 計	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	75,454,100	78,803,502	3,349,401	3,396,642	47,240
公社債	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	73,898,775	77,233,430	3,334,655	3,367,856	33,201
株式	59,662	71,382	11,720	14,245	2,525	149,089	145,087	▲ 4,001	4,145	8,147	180,795	180,680	▲ 114	9,257	9,372
外国証券	532,635	518,195	▲ 14,439	209	14,649	607,346	583,920	▲ 23,426	2,309	25,735	465,229	479,399	14,169	18,836	4,667
公社債	532,635	518,195	▲ 14,439	209	14,649	607,346	583,920	▲ 23,426	2,309	25,735	465,229	479,399	14,169	18,836	4,667
株式等	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他の証券	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
買入金銭債権	8,100	8,058	▲ 41	3	44	40,400	40,698	298	306	8	13,900	14,591	691	691	-
譲渡性預金	892,600	892,600	-	-	-	940,000	940,000	-	-	-	895,400	895,400	-	-	-
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、平成23年度末が180,795百万円、▲ 114百万円です。

・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21年度末	平成22年度末	平成23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
その他有価証券	140,000	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	140,000
非上場外国債券	—	—	—
その他	—	—	—
合 計	140,000	140,000	140,984

## (2) 金銭の信託の時価情報

(単位：百万円)

区 分	平成21年度末					平成22年度末					平成23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	175,038	175,038	—	—	—	225,365	225,365	—	—	—	242,747	242,747	—	—	—

### 1) 運用目的の金銭の信託

平成21年度末、平成22年度末、平成23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21年度末					平成22年度末					平成23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	163,318	175,038	11,720	14,245	2,525	229,367	225,365	▲ 4,001	4,145	8,147	242,861	242,747	▲ 114	9,257	9,372
国内株式 ファンド	86,498	98,219	11,720	14,245	2,525	151,245	147,243	▲ 4,001	4,145	8,147	188,989	188,875	▲ 114	9,257	9,372
不動産 ファンド	76,819	76,819	—	—	—	78,121	78,121	—	—	—	53,872	53,872	—	—	—

### 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
平成23年度末	国内株式						180,680	180,680

### 4) 外国証券の地域別、発行国別、通貨別構成

平成21年度末、平成22年度末、平成23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21年度末			平成22年度末			平成23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		67	0.1	0.1	136	0.1	0.1	183	0.1	0.1
鉱業		259	0.4	0.4	946	0.7	0.7	1,356	0.8	0.7
建設業		1,384	1.9	2.0	3,058	2.1	2.2	4,319	2.4	2.4
製造業	食料品	2,377	3.3	3.2	4,277	2.9	2.9	6,386	3.5	3.6
	繊維製品	592	0.8	0.8	1,350	0.9	1.0	1,631	0.9	0.9
	パルプ・紙	270	0.4	0.4	517	0.4	0.4	685	0.4	0.4
	化学	4,330	6.1	5.9	8,458	5.8	6.0	10,555	5.8	5.8
	医薬品	3,068	4.3	4.0	6,448	4.4	4.5	8,590	4.8	4.7
	石油・石炭製品	497	0.7	0.6	1,342	0.9	1.0	1,518	0.8	0.8
	ゴム製品	415	0.6	0.6	943	0.7	0.7	1,421	0.8	0.8
	ガラス・土石製品	898	1.3	1.3	1,965	1.4	1.4	2,014	1.1	1.1
	鉄鋼	1,959	2.7	2.7	3,299	2.3	2.3	3,461	1.9	1.9
	非鉄金属	898	1.3	1.2	1,985	1.4	1.4	2,203	1.2	1.2
	金属製品	510	0.7	0.7	1,022	0.7	0.8	1,269	0.7	0.7
	機械	3,375	4.7	4.7	7,523	5.2	5.4	9,240	5.1	5.1
	電気機器	10,684	15.0	15.3	21,057	14.5	14.8	24,576	13.6	13.8
	輸送用機器	7,057	9.9	9.9	14,743	10.2	10.1	19,232	10.6	10.8
	精密機器	1,141	1.6	1.6	2,034	1.4	1.4	2,541	1.4	1.4
その他製品	1,699	2.4	2.5	3,026	2.1	2.1	2,863	1.6	1.6	
電気・ガス業		3,735	5.2	4.9	6,376	4.4	3.7	5,521	3.1	3.0
運輸・情報・通信業	陸運業	2,738	3.8	3.8	5,063	3.5	3.5	7,038	3.9	3.8
	海運業	397	0.6	0.6	826	0.6	0.6	758	0.4	0.4
	空運業	237	0.3	0.3	443	0.3	0.3	533	0.3	0.3
	倉庫・運輸関連業	171	0.2	0.2	334	0.2	0.2	426	0.2	0.2
	情報・通信業	4,021	5.6	5.3	8,360	5.8	5.8	10,983	6.1	6.0
商業	卸売業	3,737	5.2	5.2	7,857	5.4	5.7	10,202	5.6	5.6
	小売業	2,574	3.6	3.5	5,021	3.5	3.5	7,411	4.1	4.3
金融・保険業	銀行業	6,238	8.7	9.7	13,715	9.5	9.1	17,765	9.8	9.6
	証券・商品先物取引業	1,169	1.6	1.8	2,153	1.5	1.4	2,240	1.2	1.2
	保険業	1,571	2.2	2.2	3,705	2.6	2.5	4,403	2.4	2.4
	その他金融業	544	0.8	0.8	1,136	0.8	0.8	1,480	0.8	0.8
不動産業		1,591	2.2	2.2	3,529	2.4	2.3	4,512	2.5	2.5
サービス業		1,163	1.6	1.5	2,426	1.7	1.7	3,350	1.9	1.9
合計		71,382	100.0	100.0	145,087	100.0	100.0	180,680	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。

## 【平成23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	60,866	0.63
中央三井アセット信託銀行	59,430	0.67
三菱UFJ信託銀行	68,578	0.58
合 計	188,875	0.61

(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24年3月とし、年率換算しています。

(注3) ベンチマーク(TOPIX(配当込み))の同期間の収益率は、0.81%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	30,412	▲ 6.52
中央三井アセット信託銀行	23,459	▲ 15.78
合 計	53,872	▲ 11.39

(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21年4月～平成24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21年度	平成22年度	平成23年度
運用受託機関分	233	67	67
資産管理機関分	261	226	228
合 計	495	293	295

(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
平成23年度末	ヘッジ会計適用分	314	▲ 658	—	—	—	▲ 343
	ヘッジ会計非適用分	—	—	—	—	—	—
	合 計	314	▲ 658	—	—	—	▲ 343

(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。

(注3) 平成23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▲ 658百万円)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21年度末				平成22年度末				平成23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	22,200	22,200	190	190	42,600	42,600	187	187	76,080	76,080	314	314
	合計				190				187				314

(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
平成23年度末	受取側固定スワップ想定元本	—	31,380	43,050	1,650	—	—	76,080
	平均受取固定金利	—	0.91	0.53	0.99	—	—	0.70
	平均支払変動金利	—	0.57	0.35	0.64	—	—	0.45
	合計	—	31,380	43,050	1,650	—	—	76,080

③通貨関連

(単位：百万円)

区分	種類	平成21年度末				平成22年度末				平成23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	為替予約												
	売 建	89,354	—	▲ 2,510	▲ 2,510	77,114	—	▲ 1,379	▲ 1,379	46,682	—	▲ 658	▲ 658
	(うち米ドル)	89,354	—	▲ 2,510	▲ 2,510	77,114	—	▲ 1,379	▲ 1,379	46,682	—	▲ 658	▲ 658
	買 建	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
	合計				▲ 2,510				▲ 1,379				▲ 658

(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21年度末、平成22年度末、平成23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21年度末、平成22年度末、平成23年度末において、該当の残高はありません。

⑥その他

平成21年度末、平成22年度末、平成23年度末において、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。