

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22年度末、平成23年度末、平成24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22年度末						平成23年度末						平成24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	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	43,282,092	46,925,271	3,643,179	3,643,182	3			
責任準備金対応債券	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	23,508,816	24,927,941	1,419,124	1,419,124	—			
子会社・関連会社株式	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
その他有価証券	6,941,093	6,974,295	33,201	76,789	43,587	6,196,880	6,279,629	82,748	119,730	36,981	6,425,208	6,650,129	224,920	238,623	13,702			
公社債	5,302,257	5,362,806	60,549	70,417	9,868	4,739,555	4,808,351	68,796	91,738	22,942	4,853,462	4,962,038	108,576	116,985	8,408			
株式	149,089	145,087	△ 4,001	4,145	8,147	180,795	180,680	△ 114	9,257	9,372	182,009	225,429	43,419	48,265	4,845			
外国証券	509,346	485,702	△ 23,644	1,920	25,564	367,229	380,605	13,375	18,042	4,667	597,540	669,143	71,602	72,051	448			
公社債	509,346	485,702	△ 23,644	1,920	25,564	367,229	380,605	13,375	18,042	4,667	592,544	664,249	71,705	72,051	346			
株式等	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	4,996	4,893	△ 102	—	102			
その他の証券	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
買入金銭債権	40,400	40,698	298	306	8	13,900	14,591	691	691	—	426,096	427,417	1,321	1,321	—			
譲渡性預金	940,000	940,000	—	—	—	895,400	895,400	—	—	—	366,100	366,100	—	—	—			
その他	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
合 計	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	73,216,117	78,503,342	5,287,224	5,300,930	13,705			
公社債	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	71,546,370	76,713,056	5,166,685	5,175,097	8,411			
株式	149,089	145,087	△ 4,001	4,145	8,147	180,795	180,680	△ 114	9,257	9,372	182,009	225,429	43,419	48,265	4,845			
外国証券	607,346	583,920	△ 23,426	2,309	25,735	465,229	479,399	14,169	18,836	4,667	695,540	771,337	75,797	76,246	448			
公社債	607,346	583,920	△ 23,426	2,309	25,735	465,229	479,399	14,169	18,836	4,667	690,544	766,444	75,899	76,246	346			
株式等	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	4,996	4,893	△ 102	—	102			
その他の証券	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
買入金銭債権	40,400	40,698	298	306	8	13,900	14,591	691	691	—	426,096	427,417	1,321	1,321	—			
譲渡性預金	940,000	940,000	—	—	—	895,400	895,400	—	—	—	366,100	366,100	—	—	—			
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、平成24年度末が187,005百万円、43,317百万円です。

・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22年度末	平成23年度末	平成24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
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	140,984	140,984

(2) 金銭の信託の時価情報

(単位：百万円)

区 分	平成22年度末					平成23年度末					平成24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	225,365	225,365	—	—	—	242,747	242,747	—	—	—	256,832	256,832	—	—	—

1) 運用目的の金銭の信託

平成22年度末、平成23年度末、平成24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22年度末					平成23年度末					平成24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	229,367	225,365	△ 4,001	4,145	8,147	242,861	242,747	△ 114	9,257	9,372	213,515	256,832	43,317	48,265	4,947
国内株式 ファンド	151,245	147,243	△ 4,001	4,145	8,147	188,989	188,875	△ 114	9,257	9,372	189,553	232,973	43,419	48,265	4,845
外国株式 ファンド	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	10,028	9,926	△ 102	—	102
不動産 ファンド	78,121	78,121	—	—	—	53,872	53,872	—	—	—	13,933	13,933	—	—	—

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 22 年度 末	国内株式						145,087	145,087
	外国証券						—	
	公社債						—	
	株式等						—	
平成 23 年度 末	国内株式						180,680	180,680
	外国証券						—	
	公社債						—	
	株式等						—	
平成 24 年度 末	国内株式						225,429	230,323
	外国証券						4,893	
	公社債						—	
	株式等						4,893	

4) 金銭の信託の通貨別構成

(単位：百万円、%)

区 分	平成22年度末		平成23年度末		平成24年度末	
	金額	占率	金額	占率	金額	占率
日本円	217,760	100.0	203,563	100.0	225,429	97.9
米ドル	—	—	—	—	4,341	1.9
ユーロ	—	—	—	—	—	—
その他	—	—	—	—	552	0.2
合 計	217,760	100.0	203,563	100.0	230,323	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22年度末			平成23年度末			平成24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		136	0.1	0.1	183	0.1	0.1	182	0.1	0.1
鉱業		946	0.7	0.7	1,356	0.8	0.7	1,275	0.6	0.6
建設業		3,058	2.1	2.2	4,319	2.4	2.4	5,401	2.4	2.3
製造業	食料品	4,277	2.9	2.9	6,386	3.5	3.6	9,343	4.1	4.2
	繊維製品	1,350	0.9	1.0	1,631	0.9	0.9	1,797	0.8	0.8
	パルプ・紙	517	0.4	0.4	685	0.4	0.4	625	0.3	0.3
	化学	8,458	5.8	6.0	10,555	5.8	5.8	12,672	5.6	5.6
	医薬品	6,448	4.4	4.5	8,590	4.8	4.7	11,639	5.2	5.2
	石油・石炭製品	1,342	0.9	1.0	1,518	0.8	0.8	1,647	0.7	0.7
	ゴム製品	943	0.7	0.7	1,421	0.8	0.8	2,194	1.0	1.0
	ガラス・土石製品	1,965	1.4	1.4	2,014	1.1	1.1	1,991	0.9	0.9
	鉄鋼	3,299	2.3	2.3	3,461	1.9	1.9	3,731	1.7	1.6
	非鉄金属	1,985	1.4	1.4	2,203	1.2	1.2	2,312	1.0	1.0
	金属製品	1,022	0.7	0.8	1,269	0.7	0.7	1,474	0.7	0.7
	機械	7,523	5.2	5.4	9,240	5.1	5.1	11,430	5.1	5.1
	電気機器	21,057	14.5	14.8	24,576	13.6	13.8	25,986	11.5	11.4
	輸送用機器	14,743	10.2	10.1	19,232	10.6	10.8	25,632	11.4	11.1
	精密機器	2,034	1.4	1.4	2,541	1.4	1.4	2,850	1.3	1.3
	その他製品	3,026	2.1	2.1	2,863	1.6	1.6	3,080	1.4	1.4
電気・ガス業		6,376	4.4	3.7	5,521	3.1	3.0	4,765	2.1	2.3
運輸・情報通信業	陸運業	5,063	3.5	3.5	7,038	3.9	3.8	9,834	4.4	4.4
	海運業	826	0.6	0.6	758	0.4	0.4	786	0.3	0.3
	空運業	443	0.3	0.3	533	0.3	0.3	1,231	0.5	0.5
	倉庫・運輸関連業	334	0.2	0.2	426	0.2	0.2	630	0.3	0.3
	情報・通信業	8,360	5.8	5.8	10,983	6.1	6.0	13,440	6.0	6.1
商業	卸売業	7,857	5.4	5.7	10,202	5.6	5.6	11,343	5.0	4.9
	小売業	5,021	3.5	3.5	7,411	4.1	4.3	9,432	4.2	4.4
金融・保険業	銀行業	13,715	9.5	9.1	17,765	9.8	9.6	24,476	10.9	10.8
	証券・商品先物取引業	2,153	1.5	1.4	2,240	1.2	1.2	3,681	1.6	1.6
	保険業	3,705	2.6	2.5	4,403	2.4	2.4	5,233	2.3	2.3
	その他金融業	1,136	0.8	0.8	1,480	0.8	0.8	2,482	1.1	1.2
不動産業		3,529	2.4	2.3	4,512	2.5	2.5	8,006	3.6	3.6
サービス業		2,426	1.7	1.7	3,350	1.9	1.9	4,815	2.1	2.2
合 計		145,087	100.0	100.0	180,680	100.0	100.0	225,429	100.0	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
平成24年度末	ヘッジ会計適用分	509	△ 5,179	—	—	—	△ 4,670
	ヘッジ会計非適用分	—	—	—	—	—	—
	合 計	509	△ 5,179	—	—	—	△ 4,670

(注1) 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2) 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。

(注3) 平成24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△ 5,179百万円)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22年度末				平成23年度末				平成24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	42,600	42,600	187	187	76,080	76,080	314	314	92,980	78,380	509	509
合 計					187				314				509

(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 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
平成 24 年度 末	受取側固定 スワップ想定元本	14,600	40,080	25,750	4,650	2,900	5,000	92,980
	平均受取固定金利	1.00	0.67	0.44	0.64	0.96	0.99	0.68
	平均支払変動金利	0.60	0.34	0.28	0.40	0.50	0.36	0.37
	合 計	14,600	40,080	25,750	4,650	2,900	5,000	92,980

③通貨関連

(単位：百万円)

区分	種類	平成22年度末				平成23年度末				平成24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	77,114	－	△ 1,379	△ 1,379	46,682	－	△ 658	△ 658	263,203	－	△ 5,179	△ 5,179
	(うち米ドル)	77,114	－	△ 1,379	△ 1,379	46,682	－	△ 658	△ 658	263,203	－	△ 5,179	△ 5,179
	買 建	－	－	－	－	－	－	－	－	－	－	－	－
合 計					△ 1,379				△ 658				△ 5,179

(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22年度末、平成23年度末、平成24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22年度末、平成23年度末、平成24年度末において、該当の残高はありません。

⑥その他

平成22年度末、平成23年度末、平成24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。