

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23年度末、平成24年度末、平成25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23年度末 | | | | | 平成24年度末 | | | | | 平成25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 | 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 | 45,257,324 | 48,427,090 | 3,169,765 | 3,174,107 | 4,342 |
| 責任準備金対応債券 | 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 | - | 17,953,667 | 19,052,820 | 1,099,152 | 1,100,453 | 1,300 |
| 子会社・関連会社株式 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| その他有価証券 | 6,196,880 | 6,279,629 | 82,748 | 119,730 | 36,981 | 6,425,208 | 6,650,129 | 224,920 | 238,623 | 13,702 | 7,148,598 | 7,414,127 | 265,529 | 278,007 | 12,478 |
| 公社債 | 4,739,555 | 4,808,351 | 68,796 | 91,738 | 22,942 | 4,853,462 | 4,962,038 | 108,576 | 116,985 | 8,408 | 4,927,726 | 5,025,535 | 97,809 | 100,097 | 2,287 |
| 株式 | 180,795 | 180,680 | △ 114 | 9,257 | 9,372 | 182,009 | 225,429 | 43,419 | 48,265 | 4,845 | 337,777 | 412,261 | 74,484 | 78,011 | 3,527 |
| 外国証券 | 367,229 | 380,605 | 13,375 | 18,042 | 4,667 | 597,540 | 669,143 | 71,602 | 72,051 | 448 | 1,072,516 | 1,164,581 | 92,065 | 98,718 | 6,652 |
| 公社債 | 367,229 | 380,605 | 13,375 | 18,042 | 4,667 | 592,544 | 664,249 | 71,705 | 72,051 | 346 | 917,500 | 1,001,464 | 83,964 | 90,616 | 6,652 |
| 株式等 | - | - | - | - | - | 4,996 | 4,893 | △ 102 | - | 102 | 155,016 | 163,117 | 8,101 | 8,101 | - |
| その他の証券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 買入金銭債権 | 13,900 | 14,591 | 691 | 691 | - | 426,096 | 427,417 | 1,321 | 1,321 | - | 106,278 | 107,448 | 1,170 | 1,181 | 11 |
| 譲渡性預金 | 895,400 | 895,400 | - | - | - | 366,100 | 366,100 | - | - | - | 704,300 | 704,300 | - | - | - |
| その他 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 合 計 | 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 | 70,359,590 | 74,894,037 | 4,534,446 | 4,552,568 | 18,121 |
| 公社債 | 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 | 68,040,718 | 72,403,664 | 4,362,946 | 4,370,876 | 7,930 |
| 株式 | 180,795 | 180,680 | △ 114 | 9,257 | 9,372 | 182,009 | 225,429 | 43,419 | 48,265 | 4,845 | 337,777 | 412,261 | 74,484 | 78,011 | 3,527 |
| 外国証券 | 465,229 | 479,399 | 14,169 | 18,836 | 4,667 | 695,540 | 771,337 | 75,797 | 76,246 | 448 | 1,170,516 | 1,266,362 | 95,846 | 102,499 | 6,652 |
| 公社債 | 465,229 | 479,399 | 14,169 | 18,836 | 4,667 | 690,544 | 766,444 | 75,899 | 76,246 | 346 | 1,015,500 | 1,103,245 | 87,745 | 94,397 | 6,652 |
| 株式等 | - | - | - | - | - | 4,996 | 4,893 | △ 102 | - | 102 | 155,016 | 163,117 | 8,101 | 8,101 | - |
| その他の証券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 買入金銭債権 | 13,900 | 14,591 | 691 | 691 | - | 426,096 | 427,417 | 1,321 | 1,321 | - | 106,278 | 107,448 | 1,170 | 1,181 | 11 |
| 譲渡性預金 | 895,400 | 895,400 | - | - | - | 366,100 | 366,100 | - | - | - | 704,300 | 704,300 | - | - | - |
| 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、平成25年度末が492,793百万円、82,585百万円です。

・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23年度末 | 平成24年度末 | 平成25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 | 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 | 140,984 | 140,984 | 140,984 |

(2) 金銭の信託の時価情報

(単位：百万円)

| 区 分 | 平成23年度末 | | | | | 平成24年度末 | | | | | 平成25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 | 242,747 | 242,747 | — | — | — | 256,832 | 256,832 | — | — | — | 581,627 | 581,627 | — | — | — |

1) 運用目的の金銭の信託

平成23年度末、平成24年度末、平成25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23年度末 | | | | | 平成24年度末 | | | | | 平成25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 | 242,861 | 242,747 | △ 114 | 9,257 | 9,372 | 213,515 | 256,832 | 43,317 | 48,265 | 4,947 | 499,042 | 581,627 | 82,585 | 86,112 | 3,527 |
| 国内株式 ファンド | 188,989 | 188,875 | △ 114 | 9,257 | 9,372 | 189,553 | 232,973 | 43,419 | 48,265 | 4,845 | 342,583 | 417,067 | 74,484 | 78,011 | 3,527 |
| 外国株式 ファンド | — | — | — | — | — | 10,028 | 9,926 | △ 102 | — | 102 | 55,742 | 60,755 | 5,013 | 5,013 | — |
| 外国債券 ファンド | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | 100,716 | 103,804 | 3,087 | 3,087 | — |
| 不動産 ファンド | 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)

| 運用種目 | | 残存期間別 | | | | | 10年超 (期間の定めのないものを含む) | 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 | | |
| 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 | |
| 平成25年度末 | 国内株式 | | | | | | 412,261 | 575,379 |
| | 外国証券 | | | | | | 163,117 | |
| | 公社債 | | | | | | — | |
| | 株式等 | | | | | | 163,117 | |

4) 金銭の信託の通貨別構成

(単位：百万円、%)

| 区 分 | 平成23年度末 | | 平成24年度末 | | 平成25年度末 | |
|-----|---------|-------|---------|-------|---------|-------|
| | 金額 | 占率 | 金額 | 占率 | 金額 | 占率 |
| 日本円 | 203,563 | 100.0 | 225,429 | 97.9 | 412,261 | 71.7 |
| 米ドル | — | — | 4,341 | 1.9 | 156,187 | 27.1 |
| ユーロ | — | — | — | — | — | — |
| その他 | — | — | 552 | 0.2 | 6,930 | 1.2 |
| 合計 | 203,563 | 100.0 | 230,323 | 100.0 | 575,379 | 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23年度末 | | | 平成24年度末 | | | 平成25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 | | 183 | 0.1 | 0.1 | 182 | 0.1 | 0.1 | 308 | 0.1 | 0.1 |
| 鉱業 | | 1,356 | 0.8 | 0.7 | 1,275 | 0.6 | 0.6 | 1,973 | 0.5 | 0.5 |
| 建設業 | | 4,319 | 2.4 | 2.4 | 5,401 | 2.4 | 2.3 | 10,616 | 2.6 | 2.5 |
| 製造業 | 食料品 | 6,386 | 3.5 | 3.6 | 9,343 | 4.1 | 4.2 | 15,978 | 3.9 | 3.9 |
| | 繊維製品 | 1,631 | 0.9 | 0.9 | 1,797 | 0.8 | 0.8 | 2,979 | 0.7 | 0.7 |
| | パルプ・紙 | 685 | 0.4 | 0.4 | 625 | 0.3 | 0.3 | 1,236 | 0.3 | 0.3 |
| | 化学 | 10,555 | 5.8 | 5.8 | 12,672 | 5.6 | 5.6 | 22,226 | 5.4 | 5.4 |
| | 医薬品 | 8,590 | 4.8 | 4.7 | 11,639 | 5.2 | 5.2 | 19,132 | 4.6 | 4.6 |
| | 石油・石炭製品 | 1,518 | 0.8 | 0.8 | 1,647 | 0.7 | 0.7 | 2,502 | 0.6 | 0.6 |
| | ゴム製品 | 1,421 | 0.8 | 0.8 | 2,194 | 1.0 | 1.0 | 3,837 | 0.9 | 0.9 |
| | ガラス・土石製品 | 2,014 | 1.1 | 1.1 | 1,991 | 0.9 | 0.9 | 4,196 | 1.0 | 1.0 |
| | 鉄鋼 | 3,461 | 1.9 | 1.9 | 3,731 | 1.7 | 1.6 | 6,612 | 1.6 | 1.6 |
| | 非鉄金属 | 2,203 | 1.2 | 1.2 | 2,312 | 1.0 | 1.0 | 4,170 | 1.0 | 1.0 |
| | 金属製品 | 1,269 | 0.7 | 0.7 | 1,474 | 0.7 | 0.7 | 2,874 | 0.7 | 0.7 |
| | 機械 | 9,240 | 5.1 | 5.1 | 11,430 | 5.1 | 5.1 | 21,365 | 5.2 | 5.2 |
| | 電気機器 | 24,576 | 13.6 | 13.8 | 25,986 | 11.5 | 11.4 | 52,032 | 12.6 | 12.7 |
| | 輸送用機器 | 19,232 | 10.6 | 10.8 | 25,632 | 11.4 | 11.1 | 48,147 | 11.7 | 11.8 |
| | 精密機器 | 2,541 | 1.4 | 1.4 | 2,850 | 1.3 | 1.3 | 5,903 | 1.4 | 1.4 |
| その他製品 | 2,863 | 1.6 | 1.6 | 3,080 | 1.4 | 1.4 | 5,974 | 1.4 | 1.5 | |
| 電気・ガス業 | | 5,521 | 3.1 | 3.0 | 4,765 | 2.1 | 2.3 | 9,206 | 2.2 | 2.2 |
| 運輸・情報・通信業 | 陸運業 | 7,038 | 3.9 | 3.8 | 9,834 | 4.4 | 4.4 | 15,514 | 3.8 | 3.8 |
| | 海運業 | 758 | 0.4 | 0.4 | 786 | 0.3 | 0.3 | 1,528 | 0.4 | 0.4 |
| | 空運業 | 533 | 0.3 | 0.3 | 1,231 | 0.5 | 0.5 | 2,124 | 0.5 | 0.5 |
| | 倉庫・運輸関連業 | 426 | 0.2 | 0.2 | 630 | 0.3 | 0.3 | 932 | 0.2 | 0.2 |
| | 情報・通信業 | 10,983 | 6.1 | 6.0 | 13,440 | 6.0 | 6.1 | 30,676 | 7.4 | 7.3 |
| 商業 | 卸売業 | 10,202 | 5.6 | 5.6 | 11,343 | 5.0 | 4.9 | 19,273 | 4.7 | 4.6 |
| | 小売業 | 7,411 | 4.1 | 4.3 | 9,432 | 4.2 | 4.4 | 17,244 | 4.2 | 4.3 |
| 金融・保険業 | 銀行業 | 17,765 | 9.8 | 9.6 | 24,476 | 10.9 | 10.8 | 38,556 | 9.4 | 9.4 |
| | 証券・商品先物取引業 | 2,240 | 1.2 | 1.2 | 3,681 | 1.6 | 1.6 | 6,951 | 1.7 | 1.7 |
| | 保険業 | 4,403 | 2.4 | 2.4 | 5,233 | 2.3 | 2.3 | 9,045 | 2.2 | 2.2 |
| | その他金融業 | 1,480 | 0.8 | 0.8 | 2,482 | 1.1 | 1.2 | 5,343 | 1.3 | 1.3 |
| 不動産業 | | 4,512 | 2.5 | 2.5 | 8,006 | 3.6 | 3.6 | 13,723 | 3.3 | 3.3 |
| サービス業 | | 3,350 | 1.9 | 1.9 | 4,815 | 2.1 | 2.2 | 10,070 | 2.4 | 2.4 |
| 合計 | | 180,680 | 100.0 | 100.0 | 225,429 | 100.0 | 100.0 | 412,261 | 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 |
| 平成25年度末 | ヘッジ会計適用分 | 326 | △ 15,655 | — | — | — | △ 15,328 |
| | ヘッジ会計非適用分 | — | — | — | — | — | — |
| | 合 計 | 326 | △ 15,655 | — | — | — | △ 15,328 |

(注1) 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2) 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。

(注3) 平成25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△ 15,655百万円)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23年度末 | | | 平成24年度末 | | | 平成25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 | 76,080 | 76,080 | 314 | 314 | 92,980 | 78,380 | 509 | 509 | 112,730 | 95,350 | 326 | 326 |
| 合計 | | | | | 314 | | | | 509 | | | | 326 |

(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 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 |
| 平成 25 年度末 | 受取側固定 スワップ想定元本 | 17,380 | 42,150 | 24,550 | 7,500 | 11,150 | 10,000 | 112,730 |
| | 平均受取固定金利 | 0.82 | 0.53 | 0.39 | 0.55 | 0.93 | 1.05 | 0.63 |
| | 平均支払変動金利 | 0.36 | 0.23 | 0.20 | 0.26 | 0.28 | 0.28 | 0.25 |
| | 合計 | 17,380 | 42,150 | 24,550 | 7,500 | 11,150 | 10,000 | 112,730 |

③通貨関連

(単位：百万円)

| 区分 | 種類 | 平成23年度末 | | | 平成24年度末 | | | 平成25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 | 46,682 | — | △ 658 | △ 658 | 263,203 | — | △ 5,179 | △ 5,179 | 404,257 | — | △ 15,655 | △ 15,655 |
| | (うち米ドル) | 46,682 | — | △ 658 | △ 658 | 263,203 | — | △ 5,179 | △ 5,179 | 270,312 | — | △ 6,817 | △ 6,817 |
| | (うちユーロ) | — | — | — | — | — | — | — | — | 133,944 | — | △ 8,837 | △ 8,837 |
| | 買 建 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |
| 合計 | | | | | △ 658 | | | | △ 5,179 | | | | △ 15,655 |

(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23年度末、平成24年度末、平成25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23年度末、平成24年度末、平成25年度末において、該当の残高はありません。

⑥その他

平成23年度末、平成24年度末、平成25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。