

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24年度末、平成25年度末、平成26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24年度末					平成25年度末					平成26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	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	43,695,559	48,232,675	4,537,116	4,537,655	539
責任準備金対応債券	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	15,493,208	16,668,447	1,175,238	1,175,453	214
子会社・関連会社株式	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
その他有価証券	6,425,208	6,650,129	224,920	238,623	13,702	7,148,598	7,414,127	265,529	278,007	12,478	9,411,484	10,193,205	781,721	784,470	2,748
公社債	4,853,462	4,962,038	108,576	116,985	8,408	4,927,726	5,025,535	97,809	100,097	2,287	5,105,394	5,203,999	98,605	99,163	558
株式	182,009	225,429	43,419	48,265	4,845	337,777	412,261	74,484	78,011	3,527	713,204	996,906	283,701	285,545	1,844
外国証券	597,540	669,143	71,602	72,051	448	1,072,516	1,164,581	92,065	98,718	6,652	1,850,911	2,248,231	397,319	397,666	346
公社債	592,544	664,249	71,705	72,051	346	917,500	1,001,464	83,964	90,616	6,652	1,537,712	1,863,492	325,779	326,126	346
株式等	4,996	4,893	△ 102	—	102	155,016	163,117	8,101	8,101	—	313,198	384,738	71,539	71,539	—
その他の証券	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
買入金銭債権	426,096	427,417	1,321	1,321	—	106,278	107,448	1,170	1,181	11	446,973	449,068	2,095	2,095	—
譲渡性預金	366,100	366,100	—	—	—	704,300	704,300	—	—	—	1,295,000	1,295,000	—	—	—
その他	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
合 計	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	68,600,251	75,094,328	6,494,077	6,497,580	3,502
公社債	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	64,196,162	70,003,228	5,807,066	5,808,378	1,312
株式	182,009	225,429	43,419	48,265	4,845	337,777	412,261	74,484	78,011	3,527	713,204	996,906	283,701	285,545	1,844
外国証券	695,540	771,337	75,797	76,246	448	1,170,516	1,266,362	95,846	102,499	6,652	1,948,911	2,350,125	401,213	401,560	346
公社債	690,544	766,444	75,899	76,246	346	1,015,500	1,103,245	87,745	94,397	6,652	1,635,712	1,965,386	329,673	330,020	346
株式等	4,996	4,893	△ 102	—	102	155,016	163,117	8,101	8,101	—	313,198	384,738	71,539	71,539	—
その他の証券	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
買入金銭債権	426,096	427,417	1,321	1,321	—	106,278	107,448	1,170	1,181	11	446,973	449,068	2,095	2,095	—
譲渡性預金	366,100	366,100	—	—	—	704,300	704,300	—	—	—	1,295,000	1,295,000	—	—	—
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、平成26年度末が1,026,403百万円、355,241百万円です。

・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24年度末	平成25年度末	平成26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	20,000
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	20,000
非上場外国債券	—	—	—
その他	—	—	—
合 計	140,984	140,984	20,984

(2) 金銭の信託の時価情報

(単位：百万円)

区 分	平成24年度末					平成25年度末					平成26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	256,832	256,832	—	—	—	581,627	581,627	—	—	—	1,434,943	1,434,943	—	—	—

1) 運用目的の金銭の信託

平成24年度末、平成25年度末、平成26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24年度末					平成25年度末					平成26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	213,515	256,832	43,317	48,265	4,947	499,042	581,627	82,585	86,112	3,527	1,079,701	1,434,943	355,241	357,085	1,844
国内株式 ファンド	189,553	232,973	43,419	48,265	4,845	342,583	417,067	74,484	78,011	3,527	765,237	1,048,938	283,701	285,545	1,844
外国株式 ファンド	10,028	9,926	△ 102	—	102	55,742	60,755	5,013	5,013	—	158,944	195,510	36,565	36,565	—
外国債券 ファンド	—	—	—	—	—	100,716	103,804	3,087	3,087	—	155,519	190,493	34,974	34,974	—
不動産 ファンド	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 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	
平成 26 年度 末	国内株式						996,906	1,381,644
	外国証券						384,738	
	公社債						—	
	株式等						384,738	

4) 金銭の信託の通貨別構成

(単位：百万円、%)

区 分	平成24年度末		平成25年度末		平成26年度末	
	金額	占率	金額	占率	金額	占率
日本円	225,429	97.9	412,261	71.7	996,906	72.2
米ドル	4,341	1.9	156,187	27.1	364,823	26.4
ユーロ	—	—	—	—	—	—
その他	552	0.2	6,930	1.2	19,915	1.4
合 計	230,323	100.0	575,379	100.0	1,381,644	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		平成24年度末		平成25年度末		平成26年度末	
		時価	構成比	時価	構成比	時価	構成比
水産・農林業		182	0.1	308	0.1	559	0.1
鉱業		1,275	0.6	1,973	0.5	3,022	0.3
建設業		5,401	2.4	10,616	2.6	29,857	3.0
製造業	食料品	9,343	4.1	15,978	3.9	41,889	4.2
	繊維製品	1,797	0.8	2,979	0.7	5,604	0.6
	パルプ・紙	625	0.3	1,236	0.3	1,706	0.2
	化学	12,672	5.6	22,226	5.4	50,087	5.0
	医薬品	11,639	5.2	19,132	4.6	57,218	5.7
	石油・石炭製品	1,647	0.7	2,502	0.6	9,614	1.0
	ゴム製品	2,194	1.0	3,837	0.9	10,529	1.1
	ガラス・土石製品	1,991	0.9	4,196	1.0	6,766	0.7
	鉄鋼	3,731	1.7	6,612	1.6	12,032	1.2
	非鉄金属	2,312	1.0	4,170	1.0	12,243	1.2
	金属製品	1,474	0.7	2,874	0.7	4,884	0.5
	機械	11,430	5.1	21,365	5.2	47,724	4.8
	電気機器	25,986	11.5	52,032	12.6	109,326	11.0
	輸送用機器	25,632	11.4	48,147	11.7	125,236	12.6
	精密機器	2,850	1.3	5,903	1.4	23,188	2.3
	その他製品	3,080	1.4	5,974	1.4	10,460	1.0
電気・ガス業		4,765	2.1	9,206	2.2	14,463	1.5
運輸・情報・通信業	陸運業	9,834	4.4	15,514	3.8	40,836	4.1
	海運業	786	0.3	1,528	0.4	2,446	0.2
	空運業	1,231	0.5	2,124	0.5	7,150	0.7
	倉庫・運輸関連業	630	0.3	932	0.2	1,670	0.2
	情報・通信業	13,440	6.0	30,676	7.4	92,457	9.3
商業	卸売業	11,343	5.0	19,273	4.7	69,127	6.9
	小売業	9,432	4.2	17,244	4.2	36,775	3.7
金融・保険業	銀行業	24,476	10.9	38,556	9.4	81,461	8.2
	証券・商品先物取引業	3,681	1.6	6,951	1.7	10,079	1.0
	保険業	5,233	2.3	9,045	2.2	18,380	1.8
	その他金融業	2,482	1.1	5,343	1.3	9,349	0.9
不動産業		8,006	3.6	13,723	3.3	23,379	2.3
サービス業		4,815	2.1	10,070	2.4	27,373	2.7
合 計		225,429	100.0	412,261	100.0	996,906	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
平成26年度末	ヘッジ会計適用分	971	493	—	—	—	1,465
	ヘッジ会計非適用分	—	—	—	—	—	—
	合 計	971	493	—	—	—	1,465

(注1) 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2) 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。

(注3) 平成26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493百万円)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24年度末				平成25年度末				平成26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	92,980	78,380	509	509	112,730	95,350	326	326	101,950	79,250	971	971
合 計					509				326				971

(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 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
平成 26 年度 末	受取側固定 スワップ想定元本	22,700	25,750	22,300	10,050	16,150	5,000	101,950
	平均受取固定金利	0.55	0.44	0.45	0.48	0.94	1.12	0.58
	平均支払変動金利	0.17	0.16	0.18	0.20	0.24	0.24	0.19
	合 計	22,700	25,750	22,300	10,050	16,150	5,000	101,950

③通貨関連

(単位：百万円)

区分	種類	平成24年度末				平成25年度末				平成26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	263,203	-	△ 5,179	△ 5,179	404,257	-	△ 15,655	△ 15,655	363,120	-	493	493
	(うち米ドル)	263,203	-	△ 5,179	△ 5,179	270,312	-	△ 6,817	△ 6,817	172,008	-	△ 12,843	△ 12,843
	(うちユーロ)	-	-	-	-	133,944	-	△ 8,837	△ 8,837	191,112	-	13,337	13,337
	買 建	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
合 計					△ 5,179				△ 15,655				493

(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24年度末、平成25年度末、平成26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24年度末、平成25年度末、平成26年度末において、該当の残高はありません。

⑥その他

平成24年度末、平成25年度末、平成26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。