

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25年度末、平成26年度末、平成27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25年度末					平成26年度末					平成27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	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	42,239,821	49,752,914	7,513,092	7,513,093	0
責任準備金対応債券	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	13,563,423	15,062,160	1,498,737	1,498,737	-
子会社・関連会社株式	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他有価証券	7,148,598	7,414,127	265,529	278,007	12,478	9,411,484	10,193,205	781,721	784,470	2,748	9,918,112	10,479,639	561,527	658,164	96,636
公社債	4,927,726	5,025,535	97,809	100,097	2,287	5,105,394	5,203,999	98,605	99,163	558	4,012,950	4,115,794	102,844	103,597	752
株式	337,777	412,261	74,484	78,011	3,527	713,204	996,906	283,701	285,545	1,844	1,065,422	1,202,513	137,091	195,326	58,235
外国証券	1,072,516	1,164,581	92,065	98,718	6,652	1,850,911	2,248,231	397,319	397,666	346	3,682,785	4,001,136	318,351	355,894	37,542
公社債	917,500	1,001,464	83,964	90,616	6,652	1,537,712	1,863,492	325,779	326,126	346	3,299,371	3,590,822	291,450	319,363	27,912
株式等	155,016	163,117	8,101	8,101	-	313,198	384,738	71,539	71,539	-	383,413	410,314	26,901	36,531	9,630
その他の証券	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	100,000	100,044	44	150	105
買入金銭債権	106,278	107,448	1,170	1,181	11	446,973	449,068	2,095	2,095	-	426,954	430,150	3,195	3,195	-
譲渡性預金	704,300	704,300	-	-	-	1,295,000	1,295,000	-	-	-	630,000	630,000	-	-	-
その他	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
合 計	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	65,721,357	75,294,714	9,573,357	9,669,994	96,637
公社債	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	59,718,195	68,828,482	9,110,287	9,111,040	753
株式	337,777	412,261	74,484	78,011	3,527	713,204	996,906	283,701	285,545	1,844	1,065,422	1,202,513	137,091	195,326	58,235
外国証券	1,170,516	1,266,362	95,846	102,499	6,652	1,948,911	2,350,125	401,213	401,560	346	3,780,785	4,103,523	322,738	360,281	37,542
公社債	1,015,500	1,103,245	87,745	94,397	6,652	1,635,712	1,965,386	329,673	330,020	346	3,397,371	3,693,209	295,837	323,750	27,912
株式等	155,016	163,117	8,101	8,101	-	313,198	384,738	71,539	71,539	-	383,413	410,314	26,901	36,531	9,630
その他の証券	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	100,000	100,044	44	150	105
買入金銭債権	106,278	107,448	1,170	1,181	11	446,973	449,068	2,095	2,095	-	426,954	430,150	3,195	3,195	-
譲渡性預金	704,300	704,300	-	-	-	1,295,000	1,295,000	-	-	-	630,000	630,000	-	-	-
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、平成27年度末が1,448,835百万円、163,992百万円です。

・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25年度末	平成26年度末	平成27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	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	20,000	—
非上場外国債券	—	—	—
その他	—	—	—
合 計	140,984	20,984	984

(2) 金銭の信託の時価情報

(単位：百万円)

区 分	平成25年度末					平成26年度末					平成27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	581,627	581,627	—	—	—	1,434,943	1,434,943	—	—	—	1,644,547	1,644,547	—	—	—

1) 運用目的の金銭の信託

平成25年度末、平成26年度末、平成27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25年度末					平成26年度末					平成27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	499,042	581,627	82,585	86,112	3,527	1,079,701	1,434,943	355,241	357,085	1,844	1,480,555	1,644,547	163,992	231,857	67,865
国内株式 ファンド	342,583	417,067	74,484	78,011	3,527	765,237	1,048,938	283,701	285,545	1,844	1,090,727	1,227,819	137,091	195,326	58,235
外国株式 ファンド	55,742	60,755	5,013	5,013	—	158,944	195,510	36,565	36,565	—	228,532	235,713	7,180	16,811	9,630
外国債券 ファンド	100,716	103,804	3,087	3,087	—	155,519	190,493	34,974	34,974	—	161,295	181,015	19,720	19,720	—

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	
平成27年度末	国内株式						1,202,513	1,612,827
	外国証券						410,314	
	公社債						—	
	株式等						410,314	

4) 金銭の信託の通貨別構成

(単位：百万円、%)

区 分	平成25年度末		平成26年度末		平成27年度末	
	金額	占率	金額	占率	金額	占率
日本円	412,261	71.7	996,906	72.2	1,202,513	74.6
米ドル	156,187	27.1	364,823	26.4	387,285	24.0
ユーロ	—	—	—	—	—	—
その他	6,930	1.2	19,915	1.4	23,029	1.4
合 計	575,379	100.0	1,381,644	100.0	1,612,827	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25年度末		平成26年度末		平成27年度末	
		時価	構成比	時価	構成比	時価	構成比
水産・農林業		308	0.1	559	0.1	801	0.1
鉱業		1,973	0.5	3,022	0.3	3,003	0.2
建設業		10,616	2.6	29,857	3.0	41,353	3.4
製造業	食料品	15,978	3.9	41,889	4.2	62,603	5.2
	繊維製品	2,979	0.7	5,604	0.6	6,517	0.5
	パルプ・紙	1,236	0.3	1,706	0.2	2,328	0.2
	化学	22,226	5.4	50,087	5.0	67,118	5.6
	医薬品	19,132	4.6	57,218	5.7	74,337	6.2
	石油・石炭製品	2,502	0.6	9,614	1.0	4,046	0.3
	ゴム製品	3,837	0.9	10,529	1.1	25,414	2.1
	ガラス・土石製品	4,196	1.0	6,766	0.7	8,050	0.7
	鉄鋼	6,612	1.6	12,032	1.2	12,174	1.0
	非鉄金属	4,170	1.0	12,243	1.2	13,116	1.1
	金属製品	2,874	0.7	4,884	0.5	5,650	0.5
	機械	21,365	5.2	47,724	4.8	57,642	4.8
	電気機器	52,032	12.6	109,326	11.0	144,451	12.0
	輸送用機器	48,147	11.7	125,236	12.6	136,059	11.3
	精密機器	5,903	1.4	23,188	2.3	15,440	1.3
その他製品	5,974	1.4	10,460	1.0	13,261	1.1	
電気・ガス業		9,206	2.2	14,463	1.5	18,050	1.5
運輸・情報・通信業	陸運業	15,514	3.8	40,836	4.1	45,044	3.7
	海運業	1,528	0.4	2,446	0.2	1,992	0.2
	空運業	2,124	0.5	7,150	0.7	8,575	0.7
	倉庫・運輸関連業	932	0.2	1,670	0.2	1,704	0.1
	情報・通信業	30,676	7.4	92,457	9.3	124,335	10.3
商業	卸売業	19,273	4.7	69,127	6.9	70,010	5.8
	小売業	17,244	4.2	36,775	3.7	51,225	4.3
金融・保険業	銀行業	38,556	9.4	81,461	8.2	75,608	6.3
	証券・商品先物取引業	6,951	1.7	10,079	1.0	10,842	0.9
	保険業	9,045	2.2	18,380	1.8	24,695	2.1
	その他金融業	5,343	1.3	9,349	0.9	13,446	1.1
不動産業		13,723	3.3	23,379	2.3	29,266	2.4
サービス業		10,070	2.4	27,373	2.7	34,344	2.9
合計		412,261	100.0	996,906	100.0	1,202,513	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 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
平成 27 年度 末	ヘッジ会計適用分	2,060	4,644	—	—	—	6,704
	ヘッジ会計非適用分	—	—	—	—	—	—
	合 計	2,060	4,644	—	—	—	6,704

(注1) 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2) 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。

(注3) 平成27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4,644百万円)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25年度末				平成26年度末				平成27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	112,730	95,350	326	326	101,950	79,250	971	971	79,250	59,800	2,060	2,060
合計					326				971				2,060

(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 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
平成 27 年度 末	受取側固定 スワップ想定元本	19,450	24,550	8,400	8,600	13,250	5,000	79,250
	平均受取固定金利	0.50	0.39	0.52	0.61	0.94	1.12	0.59
	平均支払変動金利	0.09	0.05	0.11	0.15	0.10	0.13	0.09
	合計	19,450	24,550	8,400	8,600	13,250	5,000	79,250

③通貨関連

(単位：百万円)

区分	種類	平成25年度末				平成26年度末				平成27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	404,257	-	△ 15,655	△ 15,655	363,120	-	493	493	1,693,683	-	4,644	4,644
	(うち米ドル)	270,312	-	△ 6,817	△ 6,817	172,008	-	△ 12,843	△ 12,843	392,081	-	5,408	5,408
	(うちユーロ)	133,944	-	△ 8,837	△ 8,837	191,112	-	13,337	13,337	1,301,602	-	△ 764	△ 764
	買 建	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
合計					△ 15,655				493				4,644

(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25年度末、平成26年度末、平成27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25年度末、平成26年度末、平成27年度末において、該当の残高はありません。

⑥その他

平成25年度末、平成26年度末、平成27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。