

4-5 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

2016年度末、2017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	2016年度末					2017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
			差益	差損			差益	差損		
満期保有目的の債券	40,441,881	46,518,693	6,076,812	6,149,942	73,129	38,490,055	44,608,732	6,118,677	6,160,256	41,579
責任準備金対応債券	12,517,334	13,697,410	1,180,075	1,204,445	24,370	10,676,330	11,769,615	1,093,285	1,103,904	10,618
子会社・関連会社株式	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
その他有価証券	12,522,618	12,966,282	443,664	657,830	214,165	13,667,194	14,225,628	558,433	758,562	200,129
公社債	4,758,489	4,796,899	38,409	71,613	33,204	4,474,163	4,508,040	33,877	55,126	21,248
株式	1,302,336	1,626,015	323,679	342,436	18,757	1,587,499	2,040,650	453,150	491,990	38,839
外国証券	4,658,641	4,748,683	90,041	237,280	147,238	4,835,101	4,923,090	87,989	202,126	114,137
公社債	4,219,602	4,248,732	29,130	175,028	145,898	4,129,047	4,137,485	8,437	122,573	114,136
株式等	439,038	499,950	60,911	62,252	1,340	706,053	785,604	79,551	79,552	0
その他の証券	1,428,000	1,417,122	△ 10,877	4,086	14,964	2,176,523	2,157,777	△ 18,745	7,158	25,903
買入金銭債権	25,149	27,561	2,411	2,411	—	173,907	176,069	2,161	2,161	—
譲渡性預金	350,000	350,000	—	—	—	420,000	420,000	—	—	—
その他	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
合 計	65,481,834	73,182,386	7,700,552	8,012,218	311,665	62,833,580	70,603,976	7,770,395	8,022,723	252,327
公社債	57,619,705	64,911,866	7,292,160	7,422,865	130,704	53,542,548	60,786,228	7,243,680	7,317,126	73,446
株式	1,302,336	1,626,015	323,679	342,436	18,757	1,587,499	2,040,650	453,150	491,990	38,839
外国証券	4,756,641	4,849,819	93,178	240,417	147,238	4,933,101	5,023,250	90,149	204,286	114,137
公社債	4,317,602	4,349,869	32,266	178,164	145,898	4,227,047	4,237,645	10,597	124,733	114,136
株式等	439,038	499,950	60,911	62,252	1,340	706,053	785,604	79,551	79,552	0
その他の証券	1,428,000	1,417,122	△ 10,877	4,086	14,964	2,176,523	2,157,777	△ 18,745	7,158	25,903
買入金銭債権	25,149	27,561	2,411	2,411	—	173,907	176,069	2,161	2,161	—
譲渡性預金	350,000	350,000	—	—	—	420,000	420,000	—	—	—
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、2016年度末が1,686,170百万円、380,716百万円、2017年度末が2,153,285百万円、516,484百万円です。

・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	2016年度末	2017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	1,479
その他有価証券	4,239	61,625
非上場国内株式(店頭売買株式を除く)	4,239	4,239
非上場外国株式(店頭売買株式を除く)	—	—
非上場外国債券	—	—
その他	—	57,385
合計	5,223	63,105

(注1) 金銭の信託のうち売買目的有価証券以外のものを含んでおります(2017年度末:57,385百万円)。

(注2) 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うち、外貨建資産の為替を評価した差損益は次のとおりです。(2017年度末:△867百万円)

(2) 金銭の信託の時価情報

(単位：百万円)

区分	2016年度末					2017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		差益	差損
			差益	差損			差益	差損		
金銭の信託	2,127,042	2,127,042	—	—	—	2,755,347	2,755,347	—	—	—

(注) 時価を把握することが極めて困難と認められる金銭の信託は含んでおりません(2017年度末:59,526百万円)。

1) 運用目的の金銭の信託

2016年度末、2017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	2016年度末					2017年度末				
	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	1,746,326	2,127,042	380,716	400,483	19,767	2,238,862	2,755,347	516,484	555,532	39,047
国内株式ファンド	1,306,142	1,625,946	319,804	338,231	18,426	1,456,654	1,899,530	442,876	478,188	35,312
外国株式ファンド	273,163	315,104	41,941	43,282	1,340	309,075	378,482	69,406	69,407	0
外国債券ファンド	167,020	185,990	18,970	18,970	—	473,131	477,334	4,202	7,936	3,734

(注) 時価を把握することが極めて困難と認められる金銭の信託は含んでおりません(2017年度末:59,526百万円)。

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
2016 年度末	国内株式						1,571,934	2,066,886
	外国証券						494,952	
	公社債						—	
	株式等						494,952	
	その他の証券						—	
2017 年度末	国内株式						1,849,990	2,726,288
	外国証券						696,751	
	公社債						—	
	株式等						696,751	
	その他の証券						179,546	

(注) 時価を把握することが極めて困難と認められる金銭の信託を含んでおります。

4) 金銭の信託の通貨別構成

(単位：百万円、%)

区 分	2016年度末		2017年度末	
	金額	占率	金額	占率
日本円	1,571,934	76.1	2,180,256	80.0
米ドル	462,314	22.4	501,852	18.4
ユーロ	28,041	1.4	39,604	1.5
その他	4,596	0.2	4,574	0.2
合 計	2,066,886	100.0	2,726,288	100.0

(注) 時価を把握することが極めて困難と認められる金銭の信託を含んでおります。

なお、現預金等は除いております。

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	2016年度末		2017年度末	
		時価	構成比	時価	構成比
水産・農林業		1,318	0.1	1,398	0.1
鉱業		4,328	0.3	5,122	0.3
建設業		55,564	3.5	67,897	3.7
製造業	食料品	71,062	4.5	79,353	4.3
	繊維製品	8,565	0.5	13,521	0.7
	パルプ・紙	3,042	0.2	4,132	0.2
	化学	95,352	6.1	132,753	7.2
	医薬品	80,019	5.1	93,583	5.1
	石油・石炭製品	5,965	0.4	8,929	0.5
	ゴム製品	32,904	2.1	33,816	1.8
	ガラス・土石製品	12,751	0.8	14,612	0.8
	鉄鋼	16,483	1.0	17,845	1.0
	非鉄金属	12,170	0.8	13,850	0.7
	金属製品	8,145	0.5	9,464	0.5
	機械	90,035	5.7	105,321	5.7
	電気機器	196,919	12.5	241,462	13.1
	輸送用機器	197,316	12.6	197,203	10.7
	精密機器	21,402	1.4	26,542	1.4
	その他製品	20,538	1.3	31,716	1.7
運輸・情報通信業	電気・ガス業	21,451	1.4	23,567	1.3
	陸運業	53,224	3.4	62,185	3.4
	海運業	2,956	0.2	2,683	0.1
	空運業	11,315	0.7	14,332	0.8
	倉庫・運輸関連業	2,095	0.1	2,302	0.1
商業	情報・通信業	148,094	9.4	162,234	8.8
	卸売業	73,048	4.6	90,685	4.9
	小売業	60,623	3.9	76,444	4.1
金融・保険業	銀行業	108,138	6.9	112,729	6.1
	証券・商品先物取引業	16,443	1.0	15,857	0.9
	保険業	47,667	3.0	58,365	3.2
	その他金融業	16,061	1.0	27,829	1.5
不動産業		31,904	2.0	39,462	2.1
サービス業		45,021	2.9	62,781	3.4
合 計		1,571,934	100.0	1,849,990	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		②金利関連	③通貨関連	④株式関連	⑤債券関連	⑥その他	合計
2016年度末	ヘッジ会計適用分	1,364	△ 4,657	—	—	—	△ 3,292
	ヘッジ会計非適用分	—	—	—	—	—	—
	合 計	1,364	△ 4,657	—	—	—	△ 3,292
2017年度末	ヘッジ会計適用分	1,177	1,222	—	—	—	2,400
	ヘッジ会計非適用分	—	1	—	—	—	1
	合 計	1,177	1,223	—	—	—	2,401

(注1) 2016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△4,657百万円)は損益計算書に計上されています。

(注2) 2017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1,222百万円)、及びヘッジ会計非適用分の差損益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	2016年度末			2017年度末			
		契約額等		時価	差損益	契約額等		時価
		うち1年超	うち1年超			うち1年超	うち1年超	
店頭	金利スワップ	57,800	51,500	1,364	1,364	51,500	36,250	1,177
	固定金利受取／変動金利支払							
	合 計				1,364			1,177

(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
2016年度末	受取側固定スワップ想定元本	6,300	19,300	10,050	12,150	10,000	—	57,800
	平均受取固定金利	0.24	0.47	0.48	0.90	1.05	—	0.64
	平均支払変動金利	0.02	0.08	0.09	0.16	0.14	—	0.10
	合 計	6,300	19,300	10,050	12,150	10,000	—	57,800
2017年度末	受取側固定スワップ想定元本	15,250	8,400	8,600	14,250	5,000	—	51,500
	平均受取固定金利	0.46	0.52	0.61	0.92	1.12	—	0.69
	平均支払変動金利	0.03	0.07	0.12	0.11	0.10	—	0.08
	合 計	15,250	8,400	8,600	14,250	5,000	—	51,500

③通貨関連

(単位：百万円)

区分	種類	2016年度末			2017年度末			
		契約額等		時価	差損益	契約額等		時価
		うち1年超				うち1年超		
店頭	為替予約							
	売 建	2,438,390	—	△ 4,657	△ 4,657	2,704,699	—	1,223
	(うち米ドル)	1,603,918	—	△ 5,630	△ 5,630	1,696,562	—	△ 3,991
	(うちユーロ)	834,472	—	973	973	657,080	—	3,116
	(うち豪ドル)	—	—	—	—	224,994	—	1,794
	(うちその他)	—	—	—	—	126,062	—	304
	買 建	—	—	—	—	—	—	—
	合 計			△ 4,657				1,223

(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

2016年度末、2017年度末において、該当の残高はありません。

⑤債券関連

2016年度末、2017年度末において、該当の残高はありません。

⑥その他

2016年度末、2017年度末において、該当の残高はありません。

5 特別勘定に関する指標等

該当ありません。