

有価証券関係情報

●有価証券関係

(注) 貸借対照表の「有価証券」のほか、「商品有価証券」を含めて記載しております。

●売買目的有価証券

(単位：百万円)

| | 平成28年3月31日 | 平成29年3月31日 |
|----------|-------------------|-------------------|
| | 当事業年度の損益に含まれた評価差額 | 当事業年度の損益に含まれた評価差額 |
| 売買目的有価証券 | 1 | 0 |

●満期保有目的の債券

該当ありません。

●子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

| | 平成28年3月31日 | | | 平成29年3月31日 | | |
|--------|------------|----|----|------------|----|----|
| | 貸借対照表計上額 | 時価 | 差額 | 貸借対照表計上額 | 時価 | 差額 |
| 子会社株式 | - | - | - | - | - | - |
| 関連会社株式 | - | - | - | - | - | - |

(注) 時価を把握することが極めて困難と認められる子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

| | 平成28年3月31日 | 平成29年3月31日 |
|--------|------------|------------|
| | 貸借対照表計上額 | 貸借対照表計上額 |
| 子会社株式 | 2,619 | 5,619 |
| 関連会社株式 | - | 103 |

これらについては、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「子会社株式及び関連会社株式」には含めておりません。

●その他有価証券

(単位：百万円)

| | 種類 | 平成28年3月31日 | | | 平成29年3月31日 | | | |
|--------------------------|-----------|------------|-----------|-----------|------------|-----------|-----------|---------|
| | | 貸借対照表計上額 | 取得原価 | 差額 | 貸借対照表計上額 | 取得原価 | 差額 | |
| 貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの | 株式 | 489,105 | 148,811 | 340,294 | 675,429 | 169,639 | 505,789 | |
| | 債券 | 国債 | 2,055,456 | 2,007,932 | 47,523 | 1,680,945 | 1,649,404 | 31,541 |
| | | 地方債 | 941,278 | 911,878 | 29,400 | 730,891 | 712,893 | 17,998 |
| | | 短期社債 | 345,632 | 335,773 | 9,858 | 329,540 | 321,705 | 7,834 |
| | | 社債 | - | - | - | - | - | - |
| | | 768,545 | 760,279 | 8,265 | 620,512 | 614,805 | 5,707 | |
| | その他 | | 152,080 | 144,023 | 8,056 | 78,152 | 76,007 | 2,145 |
| | | 外国債券 | 113,162 | 111,793 | 1,369 | 37,805 | 37,394 | 410 |
| | | その他 | 38,917 | 32,230 | 6,687 | 40,346 | 38,612 | 1,734 |
| | 小計 | 2,696,641 | 2,300,767 | 395,874 | 2,434,527 | 1,895,051 | 539,475 | |
| 貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの | 株式 | 24,388 | 26,978 | △ 2,590 | 5,780 | 6,621 | △ 840 | |
| | 債券 | 国債 | 44,910 | 44,977 | △ 67 | 239,006 | 241,972 | △ 2,965 |
| | | 地方債 | - | - | - | 38,594 | 40,087 | △ 1,492 |
| | | 短期社債 | 18,541 | 18,553 | △ 11 | 94,144 | 95,086 | △ 942 |
| | | 社債 | - | - | - | - | - | - |
| | | 26,368 | 26,424 | △ 56 | 106,267 | 106,798 | △ 531 | |
| | その他 | | 33,510 | 34,272 | △ 761 | 179,329 | 183,585 | △ 4,255 |
| | | 外国債券 | 14,692 | 14,752 | △ 59 | 123,641 | 126,859 | △ 3,218 |
| | | その他 | 18,817 | 19,519 | △ 701 | 55,688 | 56,725 | △ 1,036 |
| | 小計 | 102,809 | 106,228 | △ 3,418 | 424,117 | 432,178 | △ 8,061 | |
| 合計 | 2,799,451 | 2,406,995 | 392,455 | 2,858,644 | 2,327,230 | 531,413 | | |

(注) 時価を把握することが極めて困難と認められるその他有価証券

(単位：百万円)

| | 平成28年3月31日 | 平成29年3月31日 |
|-----|------------|------------|
| | 貸借対照表計上額 | 貸借対照表計上額 |
| 株式 | 2,829 | 2,858 |
| その他 | 1,638 | 2,026 |
| 合計 | 4,467 | 4,885 |

これらについては、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

●当事業年度中に売却した満期保有目的の債券

該当ありません。

●当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

| | 平成28年3月期 | | | 平成29年3月期 | | |
|------|----------|---------|---------|----------|---------|---------|
| | 売却額 | 売却益の合計額 | 売却損の合計額 | 売却額 | 売却益の合計額 | 売却損の合計額 |
| 株式 | 36,807 | 1,987 | 1,924 | 33,590 | 3,663 | 191 |
| 債券 | 477,785 | 3,022 | 23 | 565,184 | 5,345 | 759 |
| 国債 | 311,234 | 2,809 | 21 | 399,809 | 4,599 | 759 |
| 地方債 | 51,230 | 99 | 1 | 139,339 | 697 | - |
| 短期社債 | - | - | - | - | - | - |
| 社債 | 115,320 | 113 | 0 | 26,035 | 48 | 0 |
| その他 | 139,788 | 3,371 | 348 | 181,743 | 3,911 | 2,289 |
| 外国債券 | 124,097 | 814 | 161 | 166,665 | 1,497 | 2,287 |
| その他 | 15,690 | 2,556 | 186 | 15,078 | 2,414 | 1 |
| 合計 | 654,380 | 8,382 | 2,296 | 780,518 | 12,920 | 3,240 |

●保有目的を変更した有価証券

該当ありません。

●減損処理を行った有価証券
(平成28年3月期)

売買目的有価証券以外の有価証券(時価を把握することが極めて困難なものを除く)のうち、当該有価証券の時価が取得原価に比べて著しく下落しており、時価が取得原価まで回復する見込みがあると認められないものについては、当該時価をもって貸借対照表計上額とするとともに、評価差額を当事業年度の損失として処理(以下「減損処理」という。)しております。

当事業年度における減損処理額は、153百万円(すべて株式)であります。

また、時価が「著しく下落した」と判断するための基準は、資産の自己査定基準において、有価証券の発行会社の区分毎に以下のとおり定められております。

| | |
|-----------------|--|
| 破綻先、実質破綻先、破綻懸念先 | 時価が取得原価に比べ下落 |
| 要注意先 | 時価が取得原価に比べ30%以上下落 |
| 正常先 | 時価が取得原価に比べ50%以上下落又は、時価が取得原価に比べ30%以上50%未満下落したもので市場価格が一定水準以下で推移している場合等 |

なお、破綻先とは、破産、特別清算、会社更生、民事再生、手形交換所における取引停止処分等、法的・形式的に経営破綻の事実が発生している発行会社、実質破綻先とは、実質的に経営破綻に陥っている発行会社であります。破綻懸念先とは、今後、経営破綻に陥る可能性が大きいと認められる発行会社、要注意先とは、今後の管理に注意を要する発行会社であります。正常先とは、上記破綻先、実質破綻先、破綻懸念先、及び要注意先以外の発行会社であります。

(平成29年3月期)

売買目的有価証券以外の有価証券(時価を把握することが極めて困難なものを除く)のうち、当該有価証券の時価が取得原価に比べて著しく下落しており、時価が取得原価まで回復する見込みがあると認められないものについては、当該時価をもって貸借対照表計上額とするとともに、評価差額を当事業年度の損失として処理(以下「減損処理」という。)しております。

当事業年度における減損処理額は、1百万円(すべて社債)であります。

また、時価が「著しく下落した」と判断するための基準は、資産の自己査定基準において、有価証券の発行会社の区分毎に以下のとおり定められております。

| | |
|-----------------|--|
| 破綻先、実質破綻先、破綻懸念先 | 時価が取得原価に比べ下落 |
| 要注意先 | 時価が取得原価に比べ30%以上下落 |
| 正常先 | 時価が取得原価に比べ50%以上下落又は、時価が取得原価に比べ30%以上50%未満下落したもので市場価格が一定水準以下で推移している場合等 |

なお、破綻先とは、破産、特別清算、会社更生、民事再生、手形交換所における取引停止処分等、法的・形式的に経営破綻の事実が発生している発行会社、実質破綻先とは、実質的に経営破綻に陥っている発行会社であります。破綻懸念先とは、今後、経営破綻に陥る可能性が大きいと認められる発行会社、要注意先とは、今後の管理に注意を要する発行会社であります。正常先とは、上記破綻先、実質破綻先、破綻懸念先、及び要注意先以外の発行会社であります。

●金銭の信託関係

●運用目的の金銭の信託

(単位：百万円)

| | 平成28年3月31日 | | 平成29年3月31日 | |
|------------|------------|-------------------|------------|-------------------|
| | 貸借対照表計上額 | 当事業年度の損益に含まれた評価差額 | 貸借対照表計上額 | 当事業年度の損益に含まれた評価差額 |
| 運用目的の金銭の信託 | 2,878 | - | 48,151 | - |

●満期保有目的の金銭の信託

該当ありません。

●その他の金銭の信託（運用目的及び満期保有目的以外）

該当ありません。

●その他有価証券評価差額金

貸借対照表に計上されているその他有価証券評価差額金の内訳は、次のとおりであります。

(単位：百万円)

| | 平成28年3月31日 | | 平成29年3月31日 | |
|--------------|------------|--|------------|--|
| | 評価差額 | | 評価差額 | |
| 評価差額 | 392,455 | | 531,413 | |
| その他有価証券 | 392,455 | | 531,413 | |
| その他の金銭の信託 | - | | - | |
| (△)繰延税金負債 | △ 118,173 | | △ 160,589 | |
| その他有価証券評価差額金 | 274,282 | | 370,823 | |

デリバティブ取引情報

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引について、取引の対象物の種類ごとの連結決算日における契約額又は契約において定められた元本相当額、時価及び評価損益並びに当該時価の算定方法は、次のとおりであります。なお、契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

●金利関連取引

(単位：百万円)

| 区分 | 種類 | | 平成28年3月31日 | | | 平成29年3月31日 | | | | |
|---------|---------|-----------|------------|--------|---------|------------|--------|--------|-------|-------|
| | | | 契約額等 | 時価 | 評価損益 | 契約額等 | 時価 | 評価損益 | | |
| | | | | | | | | | うち1年超 | うち1年超 |
| 金融商品取引所 | 金利先物 | 売建 | - | - | - | - | - | - | | |
| | | 買建 | - | - | - | - | - | - | | |
| | 金利オプション | 売建 | - | - | - | - | - | - | | |
| | | 買建 | - | - | - | - | - | - | | |
| | 金利先渡契約 | 売建 | - | - | - | - | - | - | | |
| | | 買建 | - | - | - | - | - | - | | |
| 店頭 | 金利スワップ | 受取固定・支払変動 | 91,348 | 86,432 | 2,037 | 2,037 | 72,013 | 64,962 | 1,374 | 1,374 |
| | | 受取変動・支払固定 | 91,348 | 86,432 | △ 1,027 | △ 1,027 | 72,013 | 64,962 | △ 661 | △ 661 |
| | | 受取変動・支払変動 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| | 金利オプション | 売建 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| | | 買建 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| | その他 | 売建 | 58 | 58 | - | 11 | 35 | 35 | - | 11 |
| 買建 | | 58 | 58 | - | △ 7 | 35 | 35 | - | △ 7 | |
| 合計 | | | | 1,010 | 1,014 | | 712 | 716 | | |

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益を連結損益計算書に計上しております。

2. 時価の算定

取引所取引については、東京金融取引所等における最終の価格によっております。店頭取引については、割引現在価値やオプション価格計算モデル等により算定しております。