

## ■有価証券

### 保有有価証券の残高

(単位：百万円、%)

種 類	令和2年3月末		令和3年3月末		増 減
	金 額	構成比	金 額	構成比	
国債 (うち運用信託額)	418,226 ( - )	46.28	374,170 ( - )	40.92	△ 44,055 ( - )
地方債	8,668	0.96	8,633	0.95	△ 35
金融債	-	-	-	-	-
社債	11,904	1.32	8,406	0.92	△ 3,498
株式	22	0.00	22	0.00	0
外国証券	57,639	6.38	57,545	6.29	△ 93
その他の証券	407,261	45.06	465,546	50.92	58,284
合 計	903,722	100.00	914,324	100.00	10,602

### 保有有価証券の平均残高

(単位：百万円、%)

種 類	令和元年度		令和2年度		増 減
	金 額	構成比	金 額	構成比	
国債	410,940	49.57	375,040	43.69	△ 35,900
地方債	8,453	1.02	8,444	0.99	△ 8
金融債	-	-	-	-	-
社債	12,675	1.53	10,247	1.19	△ 2,428
株式	22	0.00	22	0.00	0
外国証券	63,762	7.69	53,760	6.26	△ 10,001
その他の証券	333,103	40.19	410,908	47.87	77,805
合 計	828,956	100.00	858,423	100.00	29,466

### 商品有価証券の平均残高

該当ありません。

## 保有有価証券の残存期間別残高

(単位:百万円)

種 類	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	合 計
〔令和2年3月末〕								
国債	75,000	124,300	72,500	33,000	－	102,000	－	406,800
地方債	－	－	4,000	4,450	－	－	－	8,450
金融債	－	－	－	－	－	－	－	－
社債	3,500	4,400	1,000	－	－	3,000	－	11,900
株式	－	－	－	－	－	－	22	22
外国証券	－	4,829	10,066	20,514	9,441	10,000	－	54,852
その他の証券	2,077	8,571	33,662	46,438	245,933	26,951	43,626	407,261
〔令和3年3月末〕								
国債	67,500	117,800	44,500	－	2,000	135,000	－	366,800
地方債	－	－	8,450	－	－	－	－	8,450
金融債	－	－	－	－	－	－	－	－
社債	1,400	3,000	1,000	－	－	3,000	－	8,400
株式	－	－	－	－	－	－	22	22
外国証券	2,000	11,901	12,178	13,122	6,321	10,000	－	55,523
その他の証券	2,837	12,219	43,230	48,764	221,214	81,019	56,260	465,546

- (注) 1. 本表記載の有価証券の残高は、期末日における元本(額面)ベースでの償還予定額を記載したものです。
2. 株式、その他の証券については、期末日における時価としています。
3. 外国証券のうち外貨建のものについては、外貨額面に期末為替レートを乗じた額としています。

## ■有価証券の時価情報

### 売買目的有価証券

該当する事項はありません。

### 満期保有目的の債券

該当する事項はありません。

### その他有価証券

(単位：百万円)

	種 類	令和元年度			令和2年度		
		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	-	-	-	-	-	-
	債券						
	国債	418,226	406,428	11,797	356,132	347,965	8,167
	地方債	8,668	8,444	223	8,633	8,445	187
	短期社債	-	-	-	-	-	-
	社債	6,043	5,903	140	6,492	6,402	90
	その他						
	外国証券	44,420	39,760	4,659	51,811	47,704	4,106
	その他の証券	273,867	241,556	32,311	245,993	213,015	32,978
	小 計	751,226	702,093	49,133	669,062	623,532	45,529
貸借対照表計上 額が取得原価を 超えないもの	株式	-	-	-	-	-	-
	債券						
	国債	-	-	-	18,038	18,204	△ 166
	地方債	-	-	-	-	-	-
	短期社債	-	-	-	-	-	-
	社債	5,861	6,000	△ 139	1,914	2,000	△ 86
	その他						
	外国証券	13,219	14,000	△ 780	5,734	6,000	△ 265
	その他の証券	133,393	138,701	△ 5,308	219,552	232,643	△ 13,090
	小 計	152,473	158,701	△ 6,227	245,239	258,848	△ 13,609
合 計	903,700	860,795	42,905	914,302	882,381	31,920	

## ■金銭の信託の時価情報

### 運用目的の金銭の信託

該当する事項はありません。

### 満期保有目的の金銭の信託

該当する事項はありません。

### その他の金銭の信託

(単位：百万円)

	令和元年度					令和2年度				
	貸借 対照表 計上額	取得 原価	差額	うち貸借対照 表計上額が取 得原価を超え るもの	うち貸借対照 表計上額が取 得原価を超え ないもの	貸借 対照表 計上額	取得 原価	差額	うち貸借対照 表計上額が取 得原価を超え るもの	うち貸借対照 表計上額が取 得原価を超え ないもの
その 他の 金銭 の信託	62,820	59,346	3,474	5,443	△ 1,969	63,956	59,578	4,377	4,971	△ 594

(注) 「うち貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの」「うち貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの」は、それぞれ「差額」の内訳です。

## ■デリバティブ取引等

(デリバティブ取引、金融等デリバティブ取引、有価証券店頭デリバティブ取引)

### 金利関連取引

(単位：百万円)

区 分			令和2年3月末			令和3年3月末		
			契約額等	時 価	評価損益	契約額等	時 価	評価損益
取引所	金利先物	売 建	-	-	-	-	-	-
		買 建	-	-	-	-	-	-
	金利オプション	売 建	-	-	-	-	-	-
		買 建	-	-	-	-	-	-
店頭	金利スワップ	受取固定 支払変動	-	-	-	-	-	-
		受取変動 支払固定	101,000	△ 6,341	△ 6,341	101,000	△ 3,933	△ 3,933
	金利オプション	売 建	-	-	-	-	-	-
		買 建	-	-	-	-	-	-
合 計			101,000	△ 6,341	△ 6,341	101,000	△ 3,933	△ 3,933

### 通貨関連取引

該当する取引はありません。

### 株式関連取引

該当する取引はありません。

### 債券関連取引

該当する取引はありません。