

5. 有価証券の時価情報等 【三井住友銀行単体】

[1] 有価証券

貸借対照表の「有価証券」のほか、「現金預け金」中の譲渡性預け金が含まれております。

(1) 満期保有目的の債券で時価のあるもの

(金額単位 百万円)

| | 16年3月末 | | | | |
|-----|--------------|---------|-------|-------|--------|
| | 貸借対照表 計上額 | 時 価 | 差 額 | うち | |
| | | | | 益 | 損 |
| 国 債 | 508,559 | 500,034 | 8,525 | 1,739 | 10,265 |
| その他 | 10,380 | 11,259 | 879 | 879 | - |
| 合 計 | 518,939 | 511,293 | 7,646 | 2,618 | 10,265 |

(2) 子会社株式及び関連会社株式で時価のあるもの

(金額単位 百万円)

| | 16年3月末 | | |
|-------|--------------|---------|--------|
| | 貸借対照表 計上額 | 時 価 | 差 額 |
| 子会社株式 | 81,184 | 122,881 | 41,696 |

(3) その他有価証券で時価のあるもの

(金額単位 百万円)

| | 16年3月末 | | | | |
|--------|------------|--------------|---------|---------|---------|
| | 取得原価 | 貸借対照表 計上額 | 評価差額 | うち | |
| | | | | 益 | 損 |
| 株 式 | 2,152,209 | 2,803,310 | 651,101 | 711,514 | 60,413 |
| 債 券 | 14,694,195 | 14,592,305 | 101,890 | 16,211 | 118,101 |
| 国 債 | 13,476,388 | 13,388,484 | 87,903 | 12,998 | 100,902 |
| 地方債 | 426,236 | 417,831 | 8,405 | 950 | 9,356 |
| 社 債 | 791,571 | 785,989 | 5,581 | 2,261 | 7,843 |
| その他 | 5,107,263 | 5,114,199 | 6,935 | 29,346 | 22,410 |
| 目的区分変更 | - | - | 36 | 36 | - |
| 合 計 | 21,953,668 | 22,509,815 | 556,183 | 757,109 | 200,925 |

(注)1. 上記の評価差額のうち、時価ヘッジの適用により損益に反映させた額は23,452百万円(収益)であります。

時価ヘッジの適用の結果、資本直入処理の対象となる額は532,730百万円であり、同対象額から繰延税金負債216,448百万円を差し引いた額316,282百万円が「その他有価証券評価差額金」に含まれております。

2. その他有価証券で時価のあるもののうち、当該有価証券の時価が取得原価に比べて著しく下落したものについては、原則として時価が取得原価まで回復する見込みがないものとみなして、当該時価をもって貸借対照表価額とし、評価差額を当期の損失として処理(以下、「減損処理」という。)しております。当期におけるこの減損処理額は215百万円であります。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ごとに次のとおり定めております。

| | |
|-----------------|--------------------|
| 破綻先、実質破綻先、破綻懸念先 | 時価が取得原価に比べて下落 |
| 要注意先 | 時価が取得原価に比べて30%以上下落 |
| 正常先 | 時価が取得原価に比べて50%以上下落 |

なお、破綻先とは破産、特別清算等、法的に経営破綻の事実が発生している発行会社、実質破綻先とは破綻先と同等の状況にある発行会社、破綻懸念先とは現在は経営破綻の状況にないが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。また、正常先とは破綻先、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。

(4) 時価のない有価証券のうち、主なものの内容及び貸借対照表計上額

(金額単位 百万円)

| | 16年3月末 |
|-------------------|-----------|
| 子会社株式及び関連会社株式 | |
| 子会社株式 | 1,113,717 |
| 関連会社株式 | 14,127 |
| その他 | 22,115 |
| その他有価証券 | |
| 非上場株式(店頭売買株式を除く。) | 497,426 |
| 非上場債券 | 1,585,770 |
| 非上場外国証券 | 168,541 |
| その他 | 126,934 |

(5) その他有価証券のうち、満期があるもの及び満期保有目的の債券の期間ごとの償還予定額

(金額単位 百万円)

| | 16年3月末 | | | |
|-----|-----------|-------------|--------------|-----------|
| | 1年以内 | 1年超 5年以内 | 5年超 10年以内 | 10年超 |
| 債券 | 2,709,996 | 8,966,350 | 3,904,980 | 1,105,308 |
| 国債 | 2,586,741 | 7,007,183 | 3,201,294 | 1,101,824 |
| 地方債 | 1,174 | 194,285 | 221,852 | 519 |
| 社債 | 122,080 | 1,764,880 | 481,834 | 2,964 |
| その他 | 301,404 | 4,119,550 | 426,442 | 386,108 |
| 合計 | 3,011,400 | 13,085,900 | 4,331,423 | 1,491,417 |

[2] 金銭の信託

その他の金銭の信託(運用目的および満期保有目的以外の金銭の信託)

(金額単位 百万円)

| | 16年3月末 | | | | |
|-----------|--------|--------------|------|-----|-----|
| | 取得原価 | 貸借対照表 計上額 | 評価差額 | うち益 | うち損 |
| その他の金銭の信託 | 3,628 | 3,749 | 121 | 222 | 100 |

(注)上記の評価差額から繰延税金負債49百万円を差し引いた額72百万円が「その他有価証券評価差額金」に含まれております。