

3. 資産運用の実績(一般勘定)

(1) 資産の構成

(単位:百万円、%)

| 区 分 | 平成26年度末 | | 平成27年度 第2四半期(上半期)末 | |
|-------------|------------|-------|-----------------------|-------|
| | 金額 | 占率 | 金額 | 占率 |
| 現預金・コールローン | 507,313 | 1.4 | 576,645 | 1.6 |
| 買現先勘定 | — | — | — | — |
| 債券貸借取引支払保証金 | — | — | — | — |
| 買入金銭債権 | 229,523 | 0.6 | 225,118 | 0.6 |
| 商品有価証券 | — | — | — | — |
| 金銭の信託 | — | — | — | — |
| 有価証券 | 28,433,462 | 79.8 | 28,293,325 | 79.7 |
| 公 社 債 | 16,566,439 | 46.5 | 16,823,304 | 47.4 |
| 株 式 | 4,213,452 | 11.8 | 3,889,857 | 11.0 |
| 外 国 証 券 | 7,399,532 | 20.8 | 7,313,865 | 20.6 |
| 公 社 債 | 5,812,254 | 16.3 | 5,864,693 | 16.5 |
| 株 式 等 | 1,587,278 | 4.5 | 1,449,172 | 4.1 |
| その他の証券 | 254,037 | 0.7 | 266,297 | 0.8 |
| 貸付金 | 5,052,238 | 14.2 | 5,019,124 | 14.1 |
| 保険約款貸付 | 289,921 | 0.8 | 282,582 | 0.8 |
| 一般貸付 | 4,762,317 | 13.4 | 4,736,542 | 13.4 |
| 不動産 | 916,587 | 2.6 | 911,481 | 2.6 |
| 繰延税金資産 | — | — | — | — |
| その他 | 479,268 | 1.3 | 456,909 | 1.3 |
| 貸倒引当金 | △5,034 | △0.0 | △4,997 | △0.0 |
| 合 計 | 35,613,360 | 100.0 | 35,477,607 | 100.0 |
| うち外貨建資産 | 6,452,535 | 18.1 | 6,503,931 | 18.3 |

(注) 不動産については、土地・建物・建設仮勘定を合計した金額を計上しています。

(2) 資産の増減

(単位:百万円)

| 区 分 | 平成26年度 第2四半期(上半期) | 平成27年度 第2四半期(上半期) |
|-------------|----------------------|----------------------|
| 現預金・コールローン | △96,872 | 69,331 |
| 買現先勘定 | — | — |
| 債券貸借取引支払保証金 | — | — |
| 買入金銭債権 | △2,516 | △4,404 |
| 商品有価証券 | — | — |
| 金銭の信託 | — | — |
| 有価証券 | 746,085 | △140,136 |
| 公 社 債 | △219,055 | 256,865 |
| 株 式 | 251,740 | △323,595 |
| 外 国 証 券 | 706,026 | △85,667 |
| 公 社 債 | 618,341 | 52,438 |
| 株 式 等 | 87,685 | △138,106 |
| その他の証券 | 7,373 | 12,260 |
| 貸付金 | △2,096 | △33,114 |
| 保険約款貸付 | △8,143 | △7,338 |
| 一般貸付 | 6,047 | △25,775 |
| 不動産 | △5,796 | △5,105 |
| 繰延税金資産 | — | — |
| その他 | 55,228 | △22,359 |
| 貸倒引当金 | 311 | 36 |
| 合 計 | 694,342 | △135,753 |
| うち外貨建資産 | 718,224 | 51,395 |

(注) 不動産については、土地・建物・建設仮勘定を合計した金額を計上しています。

(3) 資産運用収益

(単位:百万円)

| 区 分 | 平成26年度 第2四半期(上半期) | 平成27年度 第2四半期(上半期) |
|-------------|----------------------|----------------------|
| 利息及び配当金等収入 | 336,955 | 346,928 |
| 預貯金利息 | 30 | 18 |
| 有価証券利息・配当金 | 266,903 | 278,387 |
| 貸付金利息 | 47,908 | 45,650 |
| 不動産賃貸料 | 16,620 | 17,397 |
| その他利息配当金 | 5,491 | 5,474 |
| 商品有価証券運用益 | — | — |
| 金銭の信託運用益 | 0 | 0 |
| 売買目的有価証券運用益 | — | — |
| 有価証券売却益 | 156,098 | 7,431 |
| 国債等債券売却益 | 151,595 | 1 |
| 株式等売却益 | 4,502 | 1,256 |
| 外国証券売却益 | 0 | 6,173 |
| その他 | — | — |
| 有価証券償還益 | 22,535 | 53,869 |
| 金融派生商品収益 | — | — |
| 為替差益 | 62 | 112 |
| 貸倒引当金戻入額 | 297 | 29 |
| その他運用収益 | 19 | 10 |
| 合 計 | 515,968 | 408,382 |

(4) 資産運用費用

(単位:百万円)

| 区 分 | 平成26年度 第2四半期(上半期) | 平成27年度 第2四半期(上半期) |
|--------------|----------------------|----------------------|
| 支払利息 | 1,616 | 1,588 |
| 商品有価証券運用損 | — | — |
| 金銭の信託運用損 | — | — |
| 売買目的有価証券運用損 | — | — |
| 有価証券売却損 | 13 | 1,806 |
| 国債等債券売却損 | 0 | 18 |
| 株式等売却損 | 4 | 323 |
| 外国証券売却損 | 8 | 1,465 |
| その他 | — | — |
| 有価証券評価損 | 17 | 7,751 |
| 国債等債券評価損 | — | — |
| 株式等評価損 | 17 | 6,475 |
| 外国証券評価損 | — | 1,275 |
| その他 | — | — |
| 有価証券償還損 | — | — |
| 金融派生商品費用 | 27,085 | 61,062 |
| 為替差損 | — | — |
| 貸倒引当金繰入額 | — | — |
| 貸付金償却 | — | — |
| 賃貸用不動産等減価償却費 | 4,860 | 4,818 |
| その他運用費用 | 8,270 | 8,661 |
| 合 計 | 41,864 | 85,689 |

(5) 売買目的有価証券の評価損益

平成26年度末および平成27年度第2四半期(上半期)末とも売買目的有価証券の保有はなく、評価損益は計上していません。

(6) 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26年度末 | | | | |
|---------------|------------|------------|-----------|-----------|---------|
| | 帳簿価額 | 時価 | 差損益 | 差損益 | |
| | | | | 差益 | 差損 |
| 満期保有目的の債券 | 5,249,888 | 5,896,950 | 647,061 | 647,860 | △798 |
| 責任準備金対応債券 | 6,820,691 | 7,471,758 | 651,066 | 651,066 | — |
| 子会社株式及び関連会社株式 | — | — | — | — | — |
| その他有価証券 | 11,642,072 | 15,620,689 | 3,978,616 | 3,995,764 | △17,147 |
| 公 社 債 | 4,431,621 | 4,823,786 | 392,165 | 392,909 | △743 |
| 株 式 | 1,653,260 | 4,070,475 | 2,417,214 | 2,424,331 | △7,117 |
| 外 国 証 券 | 5,328,260 | 6,460,968 | 1,132,708 | 1,141,981 | △9,273 |
| 公 社 債 | 4,757,793 | 5,684,550 | 926,756 | 935,936 | △9,179 |
| 株 式 等 | 570,466 | 776,417 | 205,951 | 206,045 | △93 |
| その他の証券 | 195,445 | 230,158 | 34,712 | 34,725 | △12 |
| 買入金銭債権 | 27,484 | 29,300 | 1,816 | 1,816 | — |
| 譲渡性預金 | 6,000 | 6,000 | 0 | 0 | △0 |
| その他 | — | — | — | — | — |
| 合 計 | 23,712,652 | 28,989,397 | 5,276,745 | 5,294,691 | △17,946 |
| 公 社 債 | 16,174,274 | 17,847,825 | 1,673,550 | 1,674,410 | △859 |
| 株 式 | 1,653,260 | 4,070,475 | 2,417,214 | 2,424,331 | △7,117 |
| 外 国 証 券 | 5,455,964 | 6,593,106 | 1,137,141 | 1,146,989 | △9,847 |
| 公 社 債 | 4,885,497 | 5,816,688 | 931,190 | 940,944 | △9,753 |
| 株 式 等 | 570,466 | 776,417 | 205,951 | 206,045 | △93 |
| その他の証券 | 195,445 | 230,158 | 34,712 | 34,725 | △12 |
| 買入金銭債権 | 227,707 | 241,833 | 14,125 | 14,233 | △108 |
| 譲渡性預金 | 6,000 | 6,000 | 0 | 0 | △0 |
| その他 | — | — | — | — | — |

(単位:百万円)

| 区 分 | 平成27年度第2四半期(上半期)末 | | | | |
|---------------|-------------------|------------|-----------|-----------|---------|
| | 帳簿価額 | 時価 | 差損益 | 差損益 | |
| | | | | 差益 | 差損 |
| 満期保有目的の債券 | 4,987,303 | 5,625,820 | 638,517 | 639,893 | △1,376 |
| 責任準備金対応債券 | 7,159,460 | 7,821,488 | 662,028 | 662,035 | △7 |
| 子会社株式及び関連会社株式 | — | — | — | — | — |
| その他有価証券 | 11,979,171 | 15,525,405 | 3,546,233 | 3,574,263 | △28,030 |
| 公 社 債 | 4,600,841 | 4,994,158 | 393,316 | 394,120 | △803 |
| 株 式 | 1,642,908 | 3,746,612 | 2,103,704 | 2,106,095 | △2,391 |
| 外 国 証 券 | 5,461,148 | 6,484,886 | 1,023,737 | 1,044,694 | △20,956 |
| 公 社 債 | 4,882,347 | 5,743,641 | 861,293 | 879,687 | △18,393 |
| 株 式 等 | 578,800 | 741,244 | 162,443 | 165,006 | △2,562 |
| その他の証券 | 218,518 | 242,194 | 23,676 | 27,554 | △3,878 |
| 買入金銭債権 | 26,754 | 28,553 | 1,798 | 1,798 | — |
| 譲渡性預金 | 29,000 | 28,999 | △0 | 0 | △0 |
| その他 | — | — | — | — | — |
| 合 計 | 24,125,935 | 28,972,714 | 4,846,779 | 4,876,192 | △29,413 |
| 公 社 債 | 16,429,988 | 18,107,841 | 1,677,853 | 1,678,756 | △902 |
| 株 式 | 1,642,908 | 3,746,612 | 2,103,704 | 2,106,095 | △2,391 |
| 外 国 証 券 | 5,582,199 | 6,610,000 | 1,027,800 | 1,049,943 | △22,142 |
| 公 社 債 | 5,003,399 | 5,868,755 | 865,356 | 884,936 | △19,579 |
| 株 式 等 | 578,800 | 741,244 | 162,443 | 165,006 | △2,562 |
| その他の証券 | 218,518 | 242,194 | 23,676 | 27,554 | △3,878 |
| 買入金銭債権 | 223,319 | 237,065 | 13,745 | 13,843 | △98 |
| 譲渡性預金 | 29,000 | 28,999 | △0 | 0 | △0 |
| その他 | — | — | — | — | — |

(注) 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。

ア. 満期保有目的の債券

(単位:百万円)

| 区 分 | 平成26年度末 | | | 平成27年度第2四半期(上半期)末 | | |
|------------------------|-----------|-----------|---------|-------------------|-----------|---------|
| | 貸借対照表計上額 | 時価 | 差額 | 貸借対照表計上額 | 時価 | 差額 |
| 時価が貸借対照表計上額を 超えるもの | 5,197,034 | 5,844,894 | 647,860 | 4,946,630 | 5,586,524 | 639,893 |
| 公 社 債 | 4,909,008 | 5,539,443 | 630,434 | 4,662,081 | 5,284,681 | 622,600 |
| 外 国 証 券 | 101,111 | 106,119 | 5,007 | 101,535 | 106,783 | 5,248 |
| そ の 他 | 186,913 | 199,331 | 12,417 | 183,014 | 195,058 | 12,044 |
| 時価が貸借対照表計上額を 超えないもの | 52,854 | 52,055 | △798 | 40,672 | 39,296 | △1,376 |
| 公 社 債 | 12,952 | 12,836 | △116 | 7,605 | 7,513 | △92 |
| 外 国 証 券 | 26,592 | 26,018 | △573 | 19,516 | 18,330 | △1,185 |
| そ の 他 | 13,309 | 13,201 | △108 | 13,550 | 13,452 | △98 |

イ. 責任準備金対応債券

(単位:百万円)

| 区 分 | 平成26年度末 | | | 平成27年度第2四半期(上半期)末 | | |
|------------------------|-----------|-----------|---------|-------------------|-----------|---------|
| | 貸借対照表計上額 | 時価 | 差額 | 貸借対照表計上額 | 時価 | 差額 |
| 時価が貸借対照表計上額を 超えるもの | 6,820,691 | 7,471,758 | 651,066 | 7,155,959 | 7,817,994 | 662,035 |
| 公 社 債 | 6,820,691 | 7,471,758 | 651,066 | 7,155,959 | 7,817,994 | 662,035 |
| そ の 他 | — | — | — | — | — | — |
| 時価が貸借対照表計上額を 超えないもの | — | — | — | 3,501 | 3,494 | △7 |
| 公 社 債 | — | — | — | 3,501 | 3,494 | △7 |
| そ の 他 | — | — | — | — | — | — |

ウ. その他有価証券

(単位:百万円)

| 区 分 | 平成26年度末 | | | 平成27年度第2四半期(上半期)末 | | |
|--------------------------|------------|------------|-----------|-------------------|------------|-----------|
| | 帳簿価額 | 貸借対照表計上額 | 差額 | 帳簿価額 | 貸借対照表計上額 | 差額 |
| 貸借対照表計上額が帳簿価額を 超えるもの | 10,678,152 | 14,673,917 | 3,995,764 | 10,720,181 | 14,294,445 | 3,574,263 |
| 公 社 債 | 4,371,423 | 4,764,333 | 392,909 | 4,504,975 | 4,899,096 | 394,120 |
| 株 式 | 1,568,675 | 3,993,007 | 2,424,331 | 1,595,582 | 3,701,677 | 2,106,095 |
| 外 国 証 券 | 4,512,668 | 5,654,650 | 1,141,981 | 4,443,718 | 5,488,413 | 1,044,694 |
| そ の 他 の 証 券 | 194,900 | 229,626 | 34,725 | 146,149 | 173,704 | 27,554 |
| 買 入 金 銭 債 権 | 27,484 | 29,300 | 1,816 | 26,754 | 28,553 | 1,798 |
| 譲 渡 性 預 金 | 3,000 | 3,000 | 0 | 3,000 | 3,000 | 0 |
| そ の 他 | — | — | — | — | — | — |
| 貸借対照表計上額が帳簿価額を 超えないもの | 963,919 | 946,771 | △17,147 | 1,258,990 | 1,230,960 | △28,030 |
| 公 社 債 | 60,197 | 59,453 | △743 | 95,865 | 95,062 | △803 |
| 株 式 | 84,585 | 77,468 | △7,117 | 47,325 | 44,934 | △2,391 |
| 外 国 証 券 | 815,591 | 806,317 | △9,273 | 1,017,429 | 996,472 | △20,956 |
| そ の 他 の 証 券 | 545 | 532 | △12 | 72,369 | 68,490 | △3,878 |
| 買 入 金 銭 債 権 | — | — | — | — | — | — |
| 譲 渡 性 預 金 | 3,000 | 2,999 | △0 | 26,000 | 25,999 | △0 |
| そ の 他 | — | — | — | — | — | — |

- ・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26年度末 | 平成27年度 第2四半期(上半期)末 |
|---------------|---------|-----------------------|
| 満期保有目的の債券 | — | — |
| 責任準備金対応債券 | — | — |
| 子会社株式及び関連会社株式 | 285,948 | 288,575 |
| その他の有価証券 | 690,289 | 585,839 |
| 非上場国内株式 | 48,294 | 48,561 |
| 非上場外国株式 | 632,126 | 527,126 |
| その他の外国証券 | 1,721 | 1,854 |
| その他の | 8,147 | 8,297 |
| 合 計 | 976,238 | 874,415 |

- 【ご参考】前表に、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(外貨建の子会社株式及び関連会社株式等)の為替評価等を加えた時価情報は以下のとおりです。

(単位:百万円)

| 区 分 | 平成26年度末 | | | | |
|---------|------------|------------|-----------|-----------|---------|
| | 帳簿価額 | 時価 | 差損益 | 差益 | 差損 |
| 公 社 債 | 16,174,274 | 17,847,825 | 1,673,550 | 1,674,410 | △859 |
| 株 式 | 1,653,260 | 4,070,475 | 2,417,214 | 2,424,331 | △7,117 |
| 外 国 証 券 | 5,637,867 | 6,797,583 | 1,159,716 | 1,180,619 | △20,903 |
| 公 社 債 | 4,885,497 | 5,816,688 | 931,190 | 940,944 | △9,753 |
| 株 式 等 | 752,369 | 980,895 | 228,525 | 239,675 | △11,149 |
| その他の証券 | 198,430 | 233,664 | 35,233 | 35,246 | △12 |
| そ の 他 | 233,707 | 247,833 | 14,125 | 14,233 | △108 |
| 合 計 | 23,897,540 | 29,197,381 | 5,299,841 | 5,328,842 | △29,001 |

(単位:百万円)

| 区 分 | 平成27年度第2四半期(上半期)末 | | | | |
|---------|-------------------|------------|-----------|-----------|---------|
| | 帳簿価額 | 時価 | 差損益 | 差益 | 差損 |
| 公 社 債 | 16,429,988 | 18,107,841 | 1,677,853 | 1,678,756 | △902 |
| 株 式 | 1,642,908 | 3,746,612 | 2,103,704 | 2,106,095 | △2,391 |
| 外 国 証 券 | 5,766,862 | 6,804,568 | 1,037,705 | 1,072,409 | △34,704 |
| 公 社 債 | 5,003,399 | 5,868,755 | 865,356 | 884,936 | △19,579 |
| 株 式 等 | 763,463 | 935,812 | 172,349 | 187,473 | △15,124 |
| その他の証券 | 221,353 | 245,625 | 24,271 | 28,150 | △3,878 |
| そ の 他 | 252,319 | 266,065 | 13,745 | 13,843 | △98 |
| 合 計 | 24,313,433 | 29,170,713 | 4,857,280 | 4,899,254 | △41,974 |

- (注) 1. 本表に記載されていない平成26年度末の有価証券の帳簿価額は791,350百万円(非上場国内有価証券163,350百万円、非上場外国有価証券628,000百万円)です。
2. 本表に記載されていない平成27年度第2四半期(上半期)末の有価証券の帳簿価額は686,917百万円(非上場国内有価証券163,917百万円、非上場外国有価証券523,000百万円)です。
3. この結果、開示率は平成26年度末96.8%、平成27年度第2四半期(上半期)末97.3%となります。
4. 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切と認められるもの等を含んでいます。

(7) 金銭の信託の時価情報

- ・運用目的の金銭の信託

平成26年度末および平成27年度第2四半期(上半期)末とも保有していません。

- ・満期保有目的、責任準備金対応、その他の金銭の信託

平成26年度末および平成27年度第2四半期(上半期)末とも保有していません。