

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	2016年度末		2017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	380,822	1.0	460,641	1.2
買現先勘定	—	—	—	—
債券貸借取引支払保証金	—	—	—	—
買入金銭債権	220,118	0.6	223,207	0.6
商品有価証券	—	—	—	—
金銭の信託	—	—	2,607	0.0
有価証券	30,121,531	81.9	30,505,216	82.1
公 社 債 式	16,970,650	46.2	17,040,757	45.9
株 式	4,141,988	11.3	4,274,396	11.5
外 国 証 券	8,578,000	23.3	8,691,361	23.4
公 社 債 式	6,581,757	17.9	6,615,665	17.8
株 式 等	1,996,242	5.4	2,075,695	5.6
その他の証券	430,891	1.2	498,700	1.3
貸付金	4,681,981	12.7	4,607,305	12.4
保険約款貸付	260,726	0.7	254,020	0.7
一般貸付	4,421,255	12.0	4,353,284	11.7
不動産	878,498	2.4	874,085	2.4
繰延税金資産	—	—	—	—
その他	485,612	1.3	474,457	1.3
貸倒引当金	△5,848	△0.0	△5,105	△0.0
合 計	36,762,716	100.0	37,142,415	100.0
うち外貨建資産	8,041,467	21.9	8,276,499	22.3

(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	2016年度 第2四半期(上半期)	2017年度 第2四半期(上半期)
	現預金・コールローン	261,929
買現先勘定	—	—
債券貸借取引支払保証金	—	—
買入金銭債権	△5,354	3,088
商品有価証券	—	—
金銭の信託	—	2,607
有価証券	△348,707	383,684
公 社 債 式	56,233	70,107
株 式	△42,870	132,407
外 国 証 券	△539,544	113,360
公 社 債 式	△385,095	33,908
株 式 等	△154,448	79,452
その他の証券	177,472	67,808
貸付金	△98,854	△74,676
保険約款貸付	△7,436	△6,705
一般貸付	△91,418	△67,971
不動産	△4,196	△4,412
繰延税金資産	—	—
その他	△45,616	△11,154
貸倒引当金	361	743
合 計	△240,439	379,699
うち外貨建資産	△359,392	235,031

(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	2016年度 第2四半期(上半期)	2017年度 第2四半期(上半期)
利息及び配当金等収入	343,828	375,869
預貯金利息	11	7
有価証券利息・配当金	278,205	311,988
貸付金利息	42,881	40,494
不動産賃貸料	17,514	17,826
その他利息配当金	5,215	5,551
商品有価証券運用益	—	—
金銭の信託運用益	—	13
売買目的有価証券運用益	—	—
有価証券売却益	8,439	3,034
国債等債券売却益	410	428
株式等売却益	1,176	657
外国証券売却益	6,852	1,949
その他	—	—
有価証券償還益	28,934	26,105
金融派生商品収益	—	—
為替差益	—	1,358
貸倒引当金戻入額	340	403
その他運用収益	394	72
合 計	381,937	406,857

(4) 資産運用費用

(単位:百万円)

区 分	2016年度 第2四半期(上半期)	2017年度 第2四半期(上半期)
支払利息	6,921	4,940
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	26,705	10,316
国債等債券売却損	362	31
株式等売却損	539	3
外国証券売却損	25,804	10,281
その他	—	—
有価証券評価損	63,205	527
国債等債券評価損	—	—
株式等評価損	5,777	527
外国証券評価損	57,427	—
その他	—	—
有価証券償還損	1,952	1,858
金融派生商品費用	34,458	45,695
為替差損	234	—
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	4,802	4,791
その他運用費用	8,708	9,972
合 計	146,989	78,102

(5) 売買目的有価証券の評価損益

2016年度末および2017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	2016年度末				
	帳簿価額	時価	差損益	差益	差損
満期保有目的の債券	4,715,320	5,537,852	822,531	823,812	△1,281
責任準備金対応債券	7,250,615	8,578,042	1,327,426	1,327,428	△1
子会社株式及び関連会社株式	—	—	—	—	—
その他の有価証券	13,550,699	17,067,658	3,516,959	3,602,161	△85,202
公 社 債	4,867,245	5,322,149	454,903	456,657	△1,753
株 式 等	1,670,383	4,018,610	2,348,227	2,353,377	△5,149
外 国 証 券	6,580,194	7,247,738	667,544	745,092	△77,548
公 社 債	5,934,260	6,461,472	527,211	597,262	△70,050
株 式 等	645,934	786,266	140,332	147,830	△7,497
その他の証券	361,309	406,195	44,885	45,633	△748
買入金銭債権	21,567	22,968	1,400	1,400	—
譲渡性預金	50,000	49,996	△3	0	△3
金銭の信託	—	—	—	—	—
合 計	25,516,636	31,183,553	5,666,917	5,753,402	△86,485
公 社 債	16,515,746	19,103,521	2,587,775	2,589,550	△1,774
株 式 等	1,670,383	4,018,610	2,348,227	2,353,377	△5,149
外 国 証 券	6,700,479	7,374,594	674,114	751,679	△77,565
公 社 債	6,054,545	6,588,327	533,781	603,849	△70,067
株 式 等	645,934	786,266	140,332	147,830	△7,497
その他の証券	361,309	406,195	44,885	45,633	△748
買入金銭債権	218,717	230,634	11,917	13,162	△1,245
譲渡性預金	50,000	49,996	△3	0	△3
金銭の信託	—	—	—	—	—

(単位:百万円)

区 分	2017年度第2四半期(上半期)末				
	帳簿価額	時価	差損益	差益	差損
満期保有目的の債券	4,649,932	5,454,225	804,292	806,018	△1,725
責任準備金対応債券	7,387,344	8,722,889	1,335,545	1,335,881	△336
子会社株式及び関連会社株式	—	—	—	—	—
その他の有価証券	13,601,257	17,366,917	3,765,660	3,820,272	△54,612
公 社 債	4,931,703	5,372,654	440,951	441,569	△617
株 式 等	1,669,660	4,151,018	2,481,357	2,490,336	△8,978
外 国 証 券	6,536,972	7,314,237	777,264	821,752	△44,487
公 社 債	5,865,218	6,448,475	583,256	626,048	△42,791
株 式 等	671,754	865,762	194,008	195,704	△1,695
その他の証券	408,397	473,176	64,778	65,307	△528
買入金銭債権	20,023	21,224	1,200	1,200	—
譲渡性預金	32,000	31,999	△0	0	△0
金銭の信託	2,499	2,607	107	107	—
合 計	25,638,533	31,544,032	5,905,498	5,962,173	△56,674
公 社 債	16,599,806	19,165,454	2,565,648	2,566,282	△633
株 式 等	1,669,660	4,151,018	2,481,357	2,490,336	△8,978
外 国 証 券	6,704,163	7,487,633	783,470	828,294	△44,824
公 社 債	6,032,409	6,621,871	589,462	632,590	△43,128
株 式 等	671,754	865,762	194,008	195,704	△1,695
その他の証券	408,397	473,176	64,778	65,307	△528
買入金銭債権	222,006	232,142	10,135	11,844	△1,709
譲渡性預金	32,000	31,999	△0	0	△0
金銭の信託	2,499	2,607	107	107	—

(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	2016年度末			2017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	4,664,197	5,488,010	823,812	4,595,067	5,401,085	806,018
公 社 債	4,395,085	5,200,549	805,464	4,325,314	5,114,164	788,850
外 国 証 券	108,062	114,649	6,587	117,869	124,393	6,523
買 入 金 銭 債 権	161,050	172,811	11,761	151,882	162,527	10,644
時価が貸借対照表計上額 を超えないもの	51,123	49,841	△1,281	54,865	53,139	△1,725
公 社 債	2,800	2,780	△19	2,800	2,784	△15
外 国 証 券	12,223	12,206	△17	1,965	1,964	△0
買 入 金 銭 債 権	36,100	34,854	△1,245	50,100	48,390	△1,709

イ. 責任準備金対応債券

(単位:百万円)

区 分	2016年度末			2017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	7,249,715	8,577,144	1,327,428	7,344,363	8,680,244	1,335,881
公 社 債	7,249,715	8,577,144	1,327,428	7,339,488	8,675,351	1,335,862
外 国 証 券	—	—	—	4,874	4,893	18
時価が貸借対照表計上額 を超えないもの	900	898	△1	42,981	42,644	△336
公 社 債	900	898	△1	500	499	△0
外 国 証 券	—	—	—	42,481	42,144	△336

ウ. その他有価証券

(単位:百万円)

区 分	2016年度末			2017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	10,622,245	14,224,406	3,602,161	11,528,011	15,348,284	3,820,272
公 社 債	4,662,842	5,119,499	456,657	4,814,938	5,256,507	441,569
株 式	1,573,628	3,927,005	2,353,377	1,562,768	4,053,104	2,490,336
外 国 証 券	4,023,370	4,768,463	745,092	4,737,518	5,559,270	821,752
そ の 他 の 証 券	334,836	380,470	45,633	384,262	449,570	65,307
買 入 金 銭 債 権	21,567	22,968	1,400	20,023	21,224	1,200
譲 渡 性 預 金	6,000	6,000	0	6,000	6,000	0
金 銭 の 信 託	—	—	—	2,499	2,607	107
貸借対照表計上額が帳簿価額 を超えないもの	2,928,453	2,843,251	△85,202	2,073,246	2,018,633	△54,612
公 社 債	204,402	202,649	△1,753	116,764	116,147	△617
株 式	96,754	91,605	△5,149	106,892	97,913	△8,978
外 国 証 券	2,556,823	2,479,275	△77,548	1,799,454	1,754,967	△44,487
そ の 他 の 証 券	26,473	25,724	△748	24,134	23,605	△528
買 入 金 銭 債 権	—	—	—	—	—	—
譲 渡 性 預 金	44,000	43,996	△3	26,000	25,999	△0
金 銭 の 信 託	—	—	—	—	—	—

・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	891,559	891,641
その他の有価証券	466,167	466,426
非上場国内株式	28,456	28,376
非上場外国株式	427,126	427,126
その他の外国証券	1,168	609
その他の	9,416	10,314
合 計	1,357,727	1,358,067

【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	2016年度末				
	帳簿価額	時価	差損益	差益	差損
公 社 債	16,515,746	19,103,521	2,587,775	2,589,550	△1,774
株 式	1,670,383	4,018,610	2,348,227	2,353,377	△5,149
外 国 証 券	7,487,203	8,116,945	629,741	765,590	△135,848
公 社 債	6,054,545	6,588,327	533,781	603,849	△70,067
株 式 等	1,432,657	1,528,617	95,960	161,740	△65,780
その他の証券	362,367	407,324	44,956	45,726	△770
そ の 他	268,717	280,631	11,914	13,162	△1,248
合 計	26,304,417	31,927,033	5,622,615	5,767,406	△144,790

(単位:百万円)

区 分	2017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	16,599,806	19,165,454	2,565,648	2,566,282	△633
株 式	1,669,660	4,151,018	2,481,357	2,490,336	△8,978
外 国 証 券	7,490,328	8,240,118	749,790	849,528	△99,738
公 社 債	6,032,409	6,621,871	589,462	632,590	△43,128
株 式 等	1,457,919	1,618,247	160,328	216,937	△56,609
その他の証券	410,188	474,968	64,779	65,460	△680
そ の 他	256,506	266,749	10,242	11,952	△1,709
合 計	26,426,490	32,298,309	5,871,818	5,983,559	△111,740

(注) 1. 本表に記載されていない2016年度末の有価証券の帳簿価額は569,946百万円(非上場国内有価証券146,945百万円、非上場外国有価証券423,000百万円)です。

2. 本表に記載されていない2017年度第2四半期(上半期)末の有価証券の帳簿価額は570,110百万円(非上場国内有価証券147,110百万円、非上場外国有価証券423,000百万円)です。

3. この結果、開示率は2016年度末97.8%、2017年度第2四半期(上半期)末97.9%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当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

(単位:百万円)

区 分	2016年度末				
	貸借対照表計上額	時価	差損益	差益	差損
金 銭 の 信 託	—	—	—	—	—

(単位:百万円)

区 分	2017年度第2四半期(上半期)末				
	貸借対照表計上額	時価	差損益	差益	差損
金 銭 の 信 託	2,607	2,607	—	—	—

・運用目的の金銭の信託

2016年度末および2017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

(単位:百万円)

区 分	2016年度末				
	帳簿価額	時価	差損益	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	—	—	—	—	—

(単位:百万円)

区 分	2017年度第2四半期(上半期)末				
	帳簿価額	時価	差損益	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	2,499	2,607	107	107	—