

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	2020年度末		2021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	1,217,742	2.9	1,004,668	2.4
買現先勘定	—	—	—	—
債券貸借取引支払保証金	—	—	—	—
買入金銭債権	264,184	0.6	248,100	0.6
商品有価証券	—	—	—	—
金銭の信託	154,622	0.4	157,065	0.4
有価証券	34,704,247	82.7	35,394,510	83.8
公 社 債	18,153,867	43.2	18,317,655	43.4
株 式	4,641,731	11.1	4,834,681	11.5
外 国 証 券	10,656,853	25.4	11,100,369	26.3
公 社 債	8,351,872	19.9	8,612,163	20.4
株 式 等	2,304,980	5.5	2,488,206	5.9
その他の証券	1,251,796	3.0	1,141,804	2.7
貸付金	4,095,722	9.8	4,000,158	9.5
保険約款貸付	207,776	0.5	199,547	0.5
一般貸付	3,887,946	9.3	3,800,611	9.0
不動産	865,732	2.1	866,855	2.1
繰延税金資産	—	—	—	—
その他	685,663	1.6	550,416	1.3
貸倒引当金	△6,837	△0.0	△6,690	△0.0
合 計	41,981,079	100.0	42,215,082	100.0
うち外貨建資産	11,263,147	26.8	11,763,881	27.9

(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	2020年度 第2四半期(上半期)	2021年度 第2四半期(上半期)
現預金・コールローン	△80,148	△213,074
買現先勘定	—	—
債券貸借取引支払保証金	—	—
買入金銭債権	15,123	△16,084
商品有価証券	—	—
金銭の信託	128,411	2,442
有価証券	911,151	690,262
公 社 債	132,847	163,788
株 式	500,310	192,949
外 国 証 券	143,572	443,516
公 社 債	△267,888	260,290
株 式 等	411,461	183,226
その他の証券	134,421	△109,991
貸付金	14,050	△95,564
保険約款貸付	△11,438	△8,228
一般貸付	25,488	△87,335
不動産	△2,051	1,122
繰延税金資産	—	—
その他	△63,249	△135,247
貸倒引当金	△382	146
合 計	922,903	234,003
うち外貨建資産	261,656	500,734

(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	2020年度 第2四半期(上半期)	2021年度 第2四半期(上半期)
利息及び配当金等収入	418,071	418,569
預貯金利息	431	216
有価証券利息・配当金	357,932	358,452
貸付金利息	31,351	30,301
不動産賃貸料	18,939	19,976
その他利息配当金	9,416	9,621
商品有価証券運用益	—	—
金銭の信託運用益	—	2,318
売買目的有価証券運用益	—	—
有価証券売却益	38,746	29,257
国債等債券売却益	1,950	556
株式等売却益	17,289	22,847
外国証券売却益	19,249	4,191
その他	257	1,663
有価証券償還益	66,058	31,584
金融派生商品収益	—	—
為替差益	—	12,855
貸倒引当金戻入額	—	263
その他運用収益	206	50
合 計	523,082	494,900

(4) 資産運用費用

(単位:百万円)

区 分	2020年度 第2四半期(上半期)	2021年度 第2四半期(上半期)
支払利息	6,650	8,314
商品有価証券運用損	—	—
金銭の信託運用損	765	—
売買目的有価証券運用損	—	—
有価証券売却損	7,934	6,426
国債等債券売却損	300	4
株式等売却損	5,459	6,093
外国証券売却損	2,175	328
その他	—	—
有価証券評価損	21,560	3,550
国債等債券評価損	—	—
株式等評価損	21,560	3,550
外国証券評価損	—	—
その他	—	—
有価証券償還損	33,071	8,456
金融派生商品費用	22,013	45,275
為替差損	17,187	—
貸倒引当金繰入額	459	—
貸付金償却	—	—
賃貸用不動産等減価償却費	4,788	4,638
その他運用費用	11,198	13,030
合 計	125,630	89,694

(5) 売買目的有価証券の評価損益

2020年度末および2021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)

(単位:百万円)

区 分	2020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	3,915,712	4,560,313	644,601	644,694	△93
責任準備金対応債券	10,648,522	11,967,965	1,319,442	1,370,809	△51,367
子会社株式及び関連会社株式	—	—	—	—	—
その他の有価証券	15,697,103	19,686,717	3,989,614	4,104,837	△115,222
公 社 債	4,600,341	4,931,654	331,312	332,752	△1,439
株 式	1,569,925	4,549,352	2,979,426	3,001,258	△21,831
外 国 証 券	8,148,691	8,727,414	578,723	650,714	△71,991
公 社 債	6,797,217	7,195,323	398,105	464,301	△66,195
株 式 等	1,351,474	1,532,091	180,617	186,413	△5,796
その他の証券	1,096,142	1,191,967	95,824	114,551	△18,726
買入金銭債権	78,122	78,711	589	595	△5
譲渡性預金	53,000	52,995	△4	—	△4
金銭の信託	150,879	154,622	3,742	4,965	△1,223
合 計	30,261,338	36,214,997	5,953,658	6,120,341	△166,683
公 社 債	17,822,554	20,082,669	2,260,114	2,282,046	△21,931
株 式	1,569,925	4,549,352	2,979,426	3,001,258	△21,831
外 国 証 券	9,305,241	9,909,832	604,591	707,457	△102,866
公 社 債	7,953,767	8,377,741	423,974	521,044	△97,070
株 式 等	1,351,474	1,532,091	180,617	186,413	△5,796
その他の証券	1,096,142	1,191,967	95,824	114,551	△18,726
買入金銭債権	263,595	273,558	9,963	10,062	△99
譲渡性預金	53,000	52,995	△4	—	△4
金銭の信託	150,879	154,622	3,742	4,965	△1,223

(単位:百万円)

区 分	2021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	3,814,548	4,445,309	630,760	630,793	△32
責任準備金対応債券	11,623,236	12,982,933	1,359,696	1,394,980	△35,283
子会社株式及び関連会社株式	—	—	—	—	—
その他の有価証券	15,258,671	19,478,420	4,219,749	4,310,571	△90,822
公 社 債	4,021,875	4,344,180	322,305	322,959	△654
株 式	1,594,209	4,738,337	3,144,127	3,170,336	△26,209
外 国 証 券	8,427,964	9,043,365	615,400	666,665	△51,264
公 社 債	6,944,674	7,328,078	383,403	432,560	△49,157
株 式 等	1,483,289	1,715,287	231,997	234,104	△2,107
その他の証券	944,087	1,077,601	133,513	146,200	△12,686
買入金銭債権	67,379	67,875	496	500	△3
譲渡性預金	50,000	49,995	△4	—	△4
金銭の信託	153,155	157,065	3,909	3,909	—
合 計	30,696,456	36,906,662	6,210,206	6,336,345	△126,138
公 社 債	17,995,350	20,249,447	2,254,097	2,271,318	△17,220
株 式	1,594,209	4,738,337	3,144,127	3,170,336	△26,209
外 国 証 券	9,712,049	10,373,642	661,593	731,584	△69,991
公 社 債	8,228,759	8,658,355	429,596	497,480	△67,884
株 式 等	1,483,289	1,715,287	231,997	234,104	△2,107
その他の証券	944,087	1,077,601	133,513	146,200	△12,686
買入金銭債権	247,603	260,573	12,969	12,995	△26
譲渡性預金	50,000	49,995	△4	—	△4
金銭の信託	153,155	157,065	3,909	3,909	—

(注) 1. 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。
2. 市場価格のない株式等および組合等は本表から除いています。

ア. 満期保有目的の債券

(単位:百万円)

区 分	2020年度末			2021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	3,904,720	4,549,415	644,694	3,802,548	4,433,341	630,793
公 社 債	3,637,897	4,268,299	630,402	3,544,973	4,159,148	614,174
外 国 証 券	89,349	94,174	4,824	81,349	85,473	4,123
買 入 金 銭 債 権	177,473	186,940	9,467	176,224	188,720	12,495
時価が貸借対照表計上額を 超えないもの	10,991	10,898	△93	12,000	11,967	△32
公 社 債	2,991	2,991	△0	—	—	—
外 国 証 券	—	—	—	8,000	7,989	△10
買 入 金 銭 債 権	8,000	7,906	△93	4,000	3,977	△22

イ. 責任準備金対応債券

(単位:百万円)

区 分	2020年度末			2021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	8,286,040	9,656,850	1,370,809	9,182,539	10,577,520	1,394,980
公 社 債	7,654,986	8,973,878	1,318,891	8,404,268	9,738,452	1,334,184
外 国 証 券	631,053	682,972	51,918	778,271	839,067	60,796
時価が貸借対照表計上額を 超えないもの	2,362,482	2,311,115	△51,367	2,440,696	2,405,413	△35,283
公 社 債	1,926,336	1,905,844	△20,492	2,024,233	2,007,666	△16,566
外 国 証 券	436,146	405,271	△30,874	416,463	397,746	△18,716

ウ. その他有価証券

(単位:百万円)

区 分	2020年度末			2021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	12,913,377	17,018,214	4,104,837	12,897,567	17,208,138	4,310,571
公 社 債	4,495,430	4,828,182	332,752	3,921,555	4,244,514	322,959
株 式	1,408,942	4,410,200	3,001,258	1,351,609	4,521,946	3,170,336
外 国 証 券	6,272,606	6,923,320	650,714	6,654,186	7,320,851	666,665
そ の 他 の 証 券	687,471	802,022	114,551	809,678	955,878	146,200
買 入 金 銭 債 権	8,126	8,721	595	7,382	7,882	500
譲 渡 性 預 金	—	—	—	—	—	—
金 銭 の 信 託	40,800	45,766	4,965	153,155	157,065	3,909
貸借対照表計上額が帳簿価額を 超えないもの	2,783,725	2,668,502	△115,222	2,361,103	2,270,281	△90,822
公 社 債	104,911	103,472	△1,439	100,319	99,665	△654
株 式	160,982	139,151	△21,831	242,600	216,390	△26,209
外 国 証 券	1,876,085	1,804,093	△71,991	1,773,778	1,722,513	△51,264
そ の 他 の 証 券	408,671	389,944	△18,726	134,408	121,722	△12,686
買 入 金 銭 債 権	69,996	69,990	△5	59,996	59,992	△3
譲 渡 性 預 金	53,000	52,995	△4	50,000	49,995	△4
金 銭 の 信 託	110,079	108,855	△1,223	—	—	—

・市場価格のない株式等および組合等の帳簿価額は以下のとおりです。

(単位:百万円)

区 分	2020年度末	2021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	876,895	879,114
その他の有価証券	47,475	53,655
非上場国内株式	27,698	31,663
非上場外国株式	4,126	4,126
その他の外国証券	98	88
その他の	15,552	17,776
合 計	924,371	932,770

【ご参考】前表に、市場価格のない株式等および組合等(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	2020年度末				
	帳簿価額	時価	差損益	差益	差損
公 社 債	17,822,554	20,082,669	2,260,114	2,282,046	△21,931
株 式	1,569,925	4,549,352	2,979,426	3,001,258	△21,831
外 国 証 券	10,077,430	10,636,110	558,679	727,383	△168,703
公 社 債	7,953,767	8,377,741	423,974	521,044	△97,070
株 式 等	2,123,663	2,258,369	134,705	206,338	△71,633
その他の証券	1,097,625	1,193,477	95,851	114,577	△18,726
そ の 他	467,475	481,176	13,700	15,028	△1,327
合 計	31,035,011	36,942,785	5,907,773	6,140,294	△232,520

(単位:百万円)

区 分	2021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	17,995,350	20,249,447	2,254,097	2,271,318	△17,220
株 式	1,594,209	4,738,337	3,144,127	3,170,336	△26,209
外 国 証 券	10,484,374	11,101,328	616,953	746,327	△129,373
公 社 債	8,228,759	8,658,355	429,596	497,480	△67,884
株 式 等	2,255,615	2,442,972	187,357	248,847	△61,489
その他の証券	945,901	1,079,518	133,616	146,302	△12,686
そ の 他	450,759	467,634	16,874	16,905	△30
合 計	31,470,595	37,636,265	6,165,669	6,351,190	△185,520

(注) 1. 本表に記載されていない2020年度末の有価証券の帳簿価額は150,697百万円(非上場国内有価証券150,697百万円)です。

2. 本表に記載されていない2021年度第2四半期(上半期)末の有価証券の帳簿価額は158,630百万円(非上場国内有価証券158,630百万円)です。

3. この結果、開示率は2020年度末99.5%、2021年度第2四半期(上半期)末99.5%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	2020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	154,622	154,622	—	—	—

(単位:百万円)

区 分	2021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	157,065	157,065	—	—	—

・運用目的の金銭の信託

2020年度末および2021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	2020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	150,879	154,622	3,742	4,965	△1,223

(単位:百万円)

区 分	2021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	153,155	157,065	3,909	3,909	—