

## 2. 資産運用の実績(一般勘定)

### (1) 資産の構成

(単位:百万円、%)

| 区 分               | 2023年度末    |       | 2024年度<br>第1四半期会計期間末 |       |
|-------------------|------------|-------|----------------------|-------|
|                   | 金 額        | 占率    | 金 額                  | 占率    |
| 現 預 金・コ ー ル ロ ー ン | 921,355    | 2.0   | 857,187              | 1.8   |
| 買 現 先 勘 定         | —          | —     | —                    | —     |
| 債券貸借取引支払保証金       | —          | —     | —                    | —     |
| 買 入 金 銭 債 権       | 160,302    | 0.3   | 157,976              | 0.3   |
| 商 品 有 価 証 券       | —          | —     | —                    | —     |
| 金 銭 の 信 託         | 114,117    | 0.2   | 111,193              | 0.2   |
| 有 価 証 券           | 40,019,186 | 85.5  | 40,563,438           | 85.8  |
| 公 社 債             | 18,512,671 | 39.5  | 18,394,014           | 38.9  |
| 株 式               | 6,649,853  | 14.2  | 6,557,978            | 13.9  |
| 外 国 証 券           | 13,682,996 | 29.2  | 14,369,582           | 30.4  |
| 公 社 債             | 10,456,698 | 22.3  | 10,946,092           | 23.2  |
| 株 式 等             | 3,226,298  | 6.9   | 3,423,490            | 7.2   |
| そ の 他 の 証 券       | 1,173,665  | 2.5   | 1,241,863            | 2.6   |
| 貸 付 金             | 3,881,450  | 8.3   | 3,846,903            | 8.1   |
| 保 険 約 款 貸 付       | 163,870    | 0.3   | 160,775              | 0.3   |
| 一 般 貸 付           | 3,717,579  | 7.9   | 3,686,128            | 7.8   |
| 不 動 産             | 883,780    | 1.9   | 884,340              | 1.9   |
| 繰 延 税 金 資 産       | —          | —     | —                    | —     |
| そ の 他             | 852,519    | 1.8   | 846,047              | 1.8   |
| 貸 倒 引 当 金         | △9,510     | △0.0  | △9,477               | △0.0  |
| 合 計               | 46,823,201 | 100.0 | 47,257,609           | 100.0 |
| うち外貨建資産           | 14,912,042 | 31.8  | 15,655,932           | 33.1  |

(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               | 2023年度<br>第1四半期累計期間 | 2024年度<br>第1四半期累計期間 |
|-------------------|---------------------|---------------------|
| 現 預 金・コ ー ル ロ ー ン | △166,695            | △64,168             |
| 買 現 先 勘 定         | —                   | —                   |
| 債券貸借取引支払保証金       | —                   | —                   |
| 買 入 金 銭 債 権       | △2,645              | △2,326              |
| 商 品 有 価 証 券       | —                   | —                   |
| 金 銭 の 信 託         | 2,310               | △2,924              |
| 有 価 証 券           | 1,347,642           | 544,251             |
| 公 社 債             | △111,707            | △118,657            |
| 株 式               | 728,990             | △91,874             |
| 外 国 証 券           | 656,564             | 686,586             |
| 公 社 債             | 654,272             | 489,394             |
| 株 式 等             | 2,291               | 197,192             |
| そ の 他 の 証 券       | 73,795              | 68,197              |
| 貸 付 金             | 43,823              | △34,547             |
| 保 険 約 款 貸 付       | △3,397              | △3,095              |
| 一 般 貸 付           | 47,221              | △31,451             |
| 不 動 産             | 2,955               | 560                 |
| 繰 延 税 金 資 産       | —                   | —                   |
| そ の 他             | 245,053             | △6,471              |
| 貸 倒 引 当 金         | 920                 | 33                  |
| 合 計               | 1,473,364           | 434,407             |
| うち外貨建資産           | 765,315             | 743,890             |

(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         | 2023年度<br>第1四半期累計期間 | 2024年度<br>第1四半期累計期間 |
|-------------|---------------------|---------------------|
| 利息及び配当金等収入  | 239,873             | 262,507             |
| 預貯金利息       | 3,449               | 4,525               |
| 有価証券利息・配当金  | 201,582             | 223,285             |
| 貸付金利息       | 15,755              | 16,602              |
| 不動産賃貸料      | 12,298              | 11,451              |
| その他利息配当金    | 6,786               | 6,642               |
| 商品有価証券運用益   | —                   | —                   |
| 金銭の信託運用益    | 462                 | 64                  |
| 売買目的有価証券運用益 | 23                  | —                   |
| 有価証券売却益     | 57,675              | 81,175              |
| 国債等債券売却益    | 15,353              | 0                   |
| 株式等売却益      | 8,597               | 47,494              |
| 外国証券売却益     | 33,724              | 33,211              |
| その他         | —                   | 469                 |
| 有価証券償還益     | 11,504              | 15,944              |
| 金融派生商品収益    | —                   | —                   |
| 為替差益        | 200,906             | 175,259             |
| 貸倒引当金戻入額    | 918                 | 28                  |
| その他運用収益     | 86                  | 70                  |
| 合 計         | 511,449             | 535,050             |

## (4) 資産運用費用

(単位:百万円)

| 区 分          | 2023年度<br>第1四半期累計期間 | 2024年度<br>第1四半期累計期間 |
|--------------|---------------------|---------------------|
| 支払利息         | 8,330               | 9,743               |
| 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      | 15,689              | 25,729              |
| 国債等債券売却損     | 4                   | 24,058              |
| 株式等売却損       | 30                  | 0                   |
| 外国証券売却損      | 15,655              | 1,671               |
| その他          | —                   | —                   |
| 有価証券評価損      | —                   | 1,007               |
| 国債等債券評価損     | —                   | —                   |
| 株式等評価損       | —                   | 14                  |
| 外国証券評価損      | —                   | 992                 |
| その他          | —                   | —                   |
| 有価証券償還損      | 206                 | 0                   |
| 金融派生商品費用     | 164,266             | 157,125             |
| 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 | 2,253               | 2,383               |
| その他運用費用      | 12,520              | 11,599              |
| 合 計          | 203,267             | 207,588             |

## (5) 売買目的有価証券の評価損益

(単位:百万円)

| 区 分      | 2023年度末  |                    | 2024年度第1四半期会計期間末 |                    |
|----------|----------|--------------------|------------------|--------------------|
|          | 貸借対照表計上額 | 当期の損益に<br>含まれた評価損益 | 貸借対照表計上額         | 当期の損益に<br>含まれた評価損益 |
| 売買目的有価証券 | —        | △278               | —                | —                  |

(注) 1. 本表には、金銭の信託等の売買目的有価証券を含んでいます。

2. 貸借対照表計上額及び当期の損益に含まれた評価損益には、デリバティブ取引に係る差損益を含んでいます。

(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           | 2023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     | 3,241,743  | 3,511,216  | 269,473   | 276,169   | △6,696     |
| 責任準備金対応債券     | 14,751,534 | 14,067,870 | △683,663  | 439,208   | △1,122,871 |
| 子会社株式及び関連会社株式 | 98,991     | 72,876     | △26,114   | —         | △26,114    |
| その他の有価証券      | 15,205,937 | 21,150,182 | 5,944,244 | 6,325,124 | △380,880   |
| 公 社 債         | 3,339,283  | 3,392,866  | 53,582    | 128,887   | △75,304    |
| 株 式           | 1,548,276  | 6,555,831  | 5,007,554 | 5,009,046 | △1,491     |
| 外 国 証 券       | 9,235,145  | 9,997,409  | 762,263   | 1,026,243 | △263,980   |
| 公 社 債         | 7,502,211  | 7,738,611  | 236,400   | 490,065   | △253,665   |
| 株 式 等         | 1,732,934  | 2,258,797  | 525,863   | 536,178   | △10,314    |
| その他の証券        | 937,811    | 1,068,044  | 130,233   | 158,759   | △28,526    |
| 買入金銭債権        | 4,717      | 4,916      | 199       | 199       | —          |
| 譲渡性預金         | 17,000     | 16,995     | △4        | —         | △4         |
| 金銭の信託         | 123,702    | 114,117    | △9,585    | 1,988     | △11,573    |
| 合 計           | 33,298,206 | 38,802,146 | 5,503,940 | 7,040,502 | △1,536,562 |
| 公 社 債         | 18,459,088 | 18,297,686 | △161,402  | 831,931   | △993,334   |
| 株 式           | 1,548,276  | 6,555,831  | 5,007,554 | 5,009,046 | △1,491     |
| 外 国 証 券       | 12,052,223 | 12,593,634 | 541,411   | 1,036,613 | △495,202   |
| 公 社 債         | 10,220,297 | 10,261,959 | 41,661    | 500,435   | △458,773   |
| 株 式 等         | 1,831,925  | 2,331,674  | 499,749   | 536,178   | △36,428    |
| その他の証券        | 937,811    | 1,068,044  | 130,233   | 158,759   | △28,526    |
| 買入金銭債権        | 160,103    | 155,836    | △4,266    | 2,163     | △6,429     |
| 譲渡性預金         | 17,000     | 16,995     | △4        | —         | △4         |
| 金銭の信託         | 123,702    | 114,117    | △9,585    | 1,988     | △11,573    |

(単位:百万円)

| 区 分           | 2024年度第1四半期会計期間末 |            |            |           |            |
|---------------|------------------|------------|------------|-----------|------------|
|               | 帳簿価額             | 時価         | 差損益        | 差益        | 差損         |
| 満期保有目的の債券     | 3,103,056        | 3,283,673  | 180,616    | 189,426   | △8,809     |
| 責任準備金対応債券     | 15,099,233       | 13,813,394 | △1,285,838 | 225,239   | △1,511,078 |
| 子会社株式及び関連会社株式 | 65,347           | 65,347     | —          | —         | —          |
| その他の有価証券      | 15,311,696       | 21,496,269 | 6,184,572  | 6,621,549 | △436,977   |
| 公 社 債         | 3,289,788        | 3,293,507  | 3,718      | 118,706   | △114,987   |
| 株 式           | 1,538,458        | 6,463,967  | 4,925,508  | 4,927,315 | △1,806     |
| 外 国 証 券       | 9,365,172        | 10,467,606 | 1,102,434  | 1,375,603 | △273,168   |
| 公 社 債         | 7,575,497        | 7,997,604  | 422,106    | 686,598   | △264,491   |
| 株 式 等         | 1,789,675        | 2,470,002  | 680,327    | 689,004   | △8,676     |
| その他の証券        | 971,141          | 1,136,317  | 165,176    | 196,613   | △31,437    |
| 買入金銭債権        | 4,513            | 4,681      | 168        | 168       | —          |
| 譲渡性預金         | 19,000           | 18,995     | △4         | —         | △4         |
| 金銭の信託         | 123,622          | 111,193    | △12,429    | 3,143     | △15,573    |
| 合 計           | 33,579,334       | 38,658,685 | 5,079,350  | 7,036,215 | △1,956,865 |
| 公 社 債         | 18,390,295       | 17,522,502 | △867,793   | 527,317   | △1,395,111 |
| 株 式           | 1,538,458        | 6,463,967  | 4,925,508  | 4,927,315 | △1,806     |
| 外 国 証 券       | 12,379,008       | 13,254,021 | 875,013    | 1,380,162 | △505,149   |
| 公 社 債         | 10,523,985       | 10,718,671 | 194,685    | 691,158   | △496,472   |
| 株 式 等         | 1,855,023        | 2,535,350  | 680,327    | 689,004   | △8,676     |
| その他の証券        | 971,141          | 1,136,317  | 165,176    | 196,613   | △31,437    |
| 買入金銭債権        | 157,808          | 151,687    | △6,120     | 1,662     | △7,783     |
| 譲渡性預金         | 19,000           | 18,995     | △4         | —         | △4         |
| 金銭の信託         | 123,622          | 111,193    | △12,429    | 3,143     | △15,573    |

(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。

- ・ 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           | 2023年度末   | 2024年度<br>第1四半期会計期間末 |
|---------------|-----------|----------------------|
| 子会社株式及び関連会社株式 | 1,005,971 | 1,023,479            |
| そ の 他 有 価 証 券 | 62,045    | 63,600               |
| 国 内 株 式       | 29,953    | 29,948               |
| 外 国 株 式       | 494       | 494                  |
| そ の 他         | 31,596    | 33,156               |
| 合 計           | 1,068,016 | 1,087,080            |

【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         | 2023年度末    |            |           |           |            |
|-------------|------------|------------|-----------|-----------|------------|
|             | 帳簿価額       | 時価         | 差損益       | 差益        | 差損         |
| 公 社 債       | 18,459,088 | 18,297,686 | △161,402  | 831,931   | △993,334   |
| 株 式         | 1,548,276  | 6,555,831  | 5,007,554 | 5,009,046 | △1,491     |
| 外 国 証 券     | 12,920,859 | 13,635,285 | 714,425   | 1,219,110 | △504,684   |
| 公 社 債       | 10,220,297 | 10,261,959 | 41,661    | 500,435   | △458,773   |
| 株 式 等       | 2,700,561  | 3,373,325  | 672,764   | 718,675   | △45,911    |
| そ の 他 の 証 券 | 941,116    | 1,071,611  | 130,494   | 159,021   | △28,526    |
| そ の 他       | 300,806    | 286,949    | △13,856   | 4,151     | △18,007    |
| 合 計         | 34,170,147 | 39,847,364 | 5,677,216 | 7,223,261 | △1,546,044 |

(単位:百万円)

| 区 分         | 2024年度第1四半期会計期間末 |            |           |           |            |
|-------------|------------------|------------|-----------|-----------|------------|
|             | 帳簿価額             | 時価         | 差損益       | 差益        | 差損         |
| 公 社 債       | 18,390,295       | 17,522,502 | △867,793  | 527,317   | △1,395,111 |
| 株 式         | 1,538,458        | 6,463,967  | 4,925,508 | 4,927,315 | △1,806     |
| 外 国 証 券     | 13,266,648       | 14,380,970 | 1,114,322 | 1,628,320 | △513,998   |
| 公 社 債       | 10,523,985       | 10,718,671 | 194,685   | 691,158   | △496,472   |
| 株 式 等       | 2,742,662        | 3,662,299  | 919,636   | 937,161   | △17,525    |
| そ の 他 の 証 券 | 974,351          | 1,139,789  | 165,438   | 196,875   | △31,437    |
| そ の 他       | 300,431          | 281,876    | △18,554   | 4,805     | △23,360    |
| 合 計         | 34,470,184       | 39,789,106 | 5,318,921 | 7,284,635 | △1,965,713 |

- (注) 1. 本表に記載されていない2023年度末の有価証券の帳簿価額は196,075百万円(非上場国内有価証券196,075百万円)です。
2. 本表に記載されていない2024年度第1四半期会計期間末の有価証券の帳簿価額は196,230百万円(非上場国内有価証券196,084百万円、非上場外国有価証券145百万円)です。
3. この結果、開示率は2023年度末99.4%、2024年度第1四半期会計期間末99.4%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       | 2023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 | 114,117  | 114,117 | —   | —  | —  |

(単位:百万円)

| 区 分       | 2024年度第1四半期会計期間末 |         |     |    |    |
|-----------|------------------|---------|-----|----|----|
|           | 貸借対照表計上額         | 時価      | 差損益 | 差益 | 差損 |
| 金 銭 の 信 託 | 111,193          | 111,193 | —   | —  | —  |

(注) 貸借対照表計上額には、金銭の信託内で設定しているデリバティブ取引に係る差損益を含んでいます。

## ・運用目的の金銭の信託

(単位:百万円)

| 区 分        | 2023年度末  |                    | 2024年度第1四半期会計期間末 |                    |
|------------|----------|--------------------|------------------|--------------------|
|            | 貸借対照表計上額 | 当期の損益に<br>含まれた評価損益 | 貸借対照表計上額         | 当期の損益に<br>含まれた評価損益 |
| 運用目的の金銭の信託 | —        | △312               | —                | —                  |

(注) 貸借対照表計上額及び当期の損益に含まれた評価損益には、デリバティブ取引に係る差損益を含んでいます。

## ・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                   | 2023年度末 |         |        |       |         |
|-----------------------|---------|---------|--------|-------|---------|
|                       | 帳簿価額    | 時価      | 差損益    | 差益    | 差損      |
| 満期保有目的の<br>金 銭 の 信 託  | —       | —       | —      | —     | —       |
| 責任準備金対応の<br>金 銭 の 信 託 | —       | —       | —      | —     | —       |
| そ の 他 の<br>金 銭 の 信 託  | 123,702 | 114,117 | △9,585 | 1,988 | △11,573 |

(単位:百万円)

| 区 分                   | 2024年度第1四半期会計期間末 |         |         |       |         |
|-----------------------|------------------|---------|---------|-------|---------|
|                       | 帳簿価額             | 時価      | 差損益     | 差益    | 差損      |
| 満期保有目的の<br>金 銭 の 信 託  | —                | —       | —       | —     | —       |
| 責任準備金対応の<br>金 銭 の 信 託 | —                | —       | —       | —     | —       |
| そ の 他 の<br>金 銭 の 信 託  | 123,622          | 111,193 | △12,429 | 3,143 | △15,573 |