

3-4 資産運用に関する指標等(一般勘定)

(1) ポートフォリオの推移

・資産の構成と増減

(単位：百万円、%)

区 分	事業開始時		平成19年度末		
	金額	占率	金額	占率	増減
現預金・コールローン	1,130,604	1.0	2,868,825	2.5	1,738,220
買現先勘定	—	—	—	—	—
債券貸借取引支払保証金	—	—	1,454,885	1.3	1,454,885
買入金銭債権	—	—	59,981	0.1	59,981
商品有価証券	—	—	—	—	—
金銭の信託	5,932,964	5.2	1,861,542	1.7	▲4,071,421
有価証券	84,289,840	74.1	85,568,884	76.0	1,279,043
公社債	82,895,685	72.9	83,059,012	73.8	163,326
株式	—	—	—	—	—
外国証券	1,394,155	1.2	2,509,872	2.2	1,115,716
公社債	1,394,155	1.2	2,509,872	2.2	1,115,716
株式等	—	—	—	—	—
その他の証券	—	—	—	—	—
貸付金	21,413,175	18.8	19,921,240	17.7	▲1,491,935
保険約款貸付	—	—	17	0.0	17
一般貸付	—	—	12,278	0.0	12,278
機構貸付	21,413,175	18.8	19,908,944	17.7	▲1,504,231
不動産	79,018	0.1	78,002	0.1	▲1,016
うち投資用不動産	—	—	—	—	—
繰延税金資産	13	0.0	234,196	0.2	234,182
その他	892,436	0.8	477,820	0.4	▲414,616
貸倒引当金	▲745	▲0.0	▲707	▲0.0	37
一般勘定計	113,737,309	100.0	112,524,670	100.0	▲1,212,638
うち外貨建資産	1,205,622	1.1	2,354,081	2.1	1,148,458

(注1)「機構貸付」とは、管理機構(簡易生命保険勘定)への貸付です。

(注2)「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。

(注3)増減については、事業開始時との差額を計上しています。

(2) 運用利回り

(単位：%)

区 分	平成18年度末	平成19年度末
現預金・コールローン	—	0.45
買現先勘定	—	—
債券貸借取引支払保証金	—	—
買入金銭債権	—	0.68
商品有価証券	—	—
金銭の信託	—	▲18.33
有価証券	—	0.94
うち公社債	—	1.16
うち株式	—	—
うち外国証券	—	▲5.95
貸付金	—	2.77
うち一般貸付	—	1.30
不動産	—	—
一般勘定計	—	0.67
うち海外投融資	—	▲5.95

(注1) 利回り計算式の分母は帳簿価額ベースの日々平均残高、分子は経常損益中、資産運用収益－資産運用費用として算出した利回りです。

(注2) 一般勘定計の利回りは有価証券信託も含めて算出しています。

(3) 主要資産の平均残高

(単位：百万円)

区 分	平成18年度末	平成19年度末
現預金・コールローン	—	1,939,463
買現先勘定	—	—
債券貸借取引支払保証金	—	—
買入金銭債権	—	21,624
商品有価証券	—	—
金銭の信託	—	3,465,946
有価証券	—	85,884,509
うち公社債	—	83,219,847
うち株式	—	—
うち外国証券	—	2,664,661
貸付金	—	20,646,809
うち一般貸付	—	418
不動産	—	78,258
一般勘定計	—	112,985,334
うち海外投融資	—	2,664,661

(注1) 一般勘定計は有価証券信託に係る資産を含めています。

(注2) 「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。

(注3) 「海外投融資」とは外貨建資産と円建資産の合計です。

(4) 資産運用収益明細表

(単位：百万円)

区 分	平成18年度	平成19年度
利息及び配当金等収入	—	839,559
商品有価証券運用益	—	—
金銭の信託運用益	—	—
売買目的有価証券運用益	—	—
有価証券売却益	—	30,779
有価証券償還益	—	16
金融派生商品収益	—	—
為替差益	—	—
その他運用収益	—	997
合 計	—	871,353

(5) 資産運用費用明細表

(単位：百万円)

区 分	平成18年度	平成19年度
支払利息	—	1,788
商品有価証券運用損	—	—
金銭の信託運用損	—	318,576
売買目的有価証券運用損	—	—
有価証券売却損	—	62,449
有価証券評価損	—	105,568
有価証券償還損	—	44
金融派生商品費用	—	—
為替差損	—	6,231
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	—	—
その他運用費用	—	143
合 計	—	494,801

(6) 利息及び配当金等収入明細表

(単位：百万円)

区 分	平成18年度	平成19年度
預貯金利息	—	2,549
有価証券利息・配当金	—	546,885
公社債利息	—	494,498
株式配当金	—	—
外国証券利息配当金	—	52,386
貸付金利息	—	2
機構貸付金利息	—	285,570
その他共計	—	839,559

(7) 有価証券売却益明細表

(単位：百万円)

区 分	平成18年度	平成19年度
国債等債券	—	—
株 式 等	—	—
外国証券	—	30,779
その他共計	—	30,779

(8) 有価証券売却損明細表

(単位：百万円)

区 分	平成18年度	平成19年度
国債等債券	—	11,237
株 式 等	—	—
外国証券	—	51,212
その他共計	—	62,449

(9) 有価証券評価損明細表

(単位：百万円)

区 分	平成18年度	平成19年度
国債等債券	—	—
株 式 等	—	—
外国証券	—	105,568
その他共計	—	105,568

(10) 商品有価証券明細表

該当ありません。

(11) 商品有価証券売買高

該当ありません。

(12) 有価証券明細表

(単位：百万円、%)

区 分	平成18年度末		平成19年度末	
	金額	占率	金額	占率
公社債	—	—	83,059,012	97.1
国債	—	—	68,959,931	80.6
地方債	—	—	3,711,596	4.3
社債	—	—	10,387,483	12.1
うち公社・公団債等	—	—	8,061,887	9.4
株式	—	—	—	—
外国証券	—	—	2,509,872	2.9
公社債	—	—	2,509,872	2.9
株式等	—	—	—	—
その他の証券	—	—	—	—
合 計	—	—	85,568,884	100.0

(13) 有価証券残存期間別残高

(単位：百万円)

区 分	1年以下	1年超 3年以下	3年超 5年以下	5年超 7年以下	7年超 10年以下	10年超 (期間の定めのないものを含む)	合 計
	平成18年度末	—	—	—	—	—	
国債	—	—	—	—	—	—	—
地方債	—	—	—	—	—	—	—
社債	—	—	—	—	—	—	—
株式	—	—	—	—	—	—	—
外国証券	—	—	—	—	—	—	—
公社債	—	—	—	—	—	—	—
株式等	—	—	—	—	—	—	—
その他の証券	—	—	—	—	—	—	—
合 計	—	—	—	—	—	—	—
平成19年度末	6,887,620	11,291,053	12,802,344	13,370,444	16,455,901	8,152,568	68,959,931
国債	6,887,620	11,291,053	12,802,344	13,370,444	16,455,901	8,152,568	68,959,931
地方債	210,006	830,240	117,147	836,672	1,671,646	45,883	3,711,596
社債	2,614,199	3,695,044	1,053,367	889,193	1,740,338	395,340	10,387,483
株式	—	—	—	—	—	—	—
外国証券	135,683	481,727	361,650	374,213	498,664	657,932	2,509,872
公社債	135,683	481,727	361,650	374,213	498,664	657,932	2,509,872
株式等	—	—	—	—	—	—	—
その他の証券	—	—	—	—	—	—	—
合 計	9,847,509	16,298,065	14,334,509	15,470,524	20,366,551	9,251,724	85,568,884

(14) 保有公社債の期末残高利回り

(単位：%)

区 分	平成18年度末	平成19年度末
公 社 債	—	1.20
外国公社債	—	3.58

(15) 地方債地域別内訳

(単位：百万円)

区 分	平成18年度末	平成19年度末
北海道	—	89,022
東 北	—	44,508
関 東	—	1,520,939
中 部	—	373,549
近 畿	—	195,659
中 国	—	77,805
四 国	—	—
九 州	—	164,642
その他	—	1,245,470
合 計	—	3,711,596

(注)「その他」は共同発行市場公募地方債の残高です。

(16) 業種別株式保有明細表

該当ありません。

(17) 貸付金明細表

(単位：百万円)

区 分	平成18年度末	平成19年度末
保険約款貸付	—	17
契約者貸付	—	17
保険料振替貸付	—	—
一般貸付	—	19,921,223
(うち非居住者貸付)	(—)	(—)
企業貸付	—	19,908,944
(うち国内企業向け)	(—)	(19,908,944)
国・国際機関・政府関係機関貸付	—	—
公共団体・公企業貸付	—	12,278
住宅ローン	—	—
消費者ローン	—	—
その他	—	—
合 計	—	19,921,240

(注) 管理機構 (簡易生命保険勘定) への貸付金は、日本銀行調査統計局が定める「金融統計調査表の記入要領」の業種別貸出金調査表の業種分類一覧表において、「金融・保険業」に区分されているため、「企業貸付」に計上しています。

(18) 貸付金残存期間別残高

(単位：百万円)

区 分	1年以下	1年超 3年以下	3年超 5年以下	5年超 7年以下	7年超 10年以下	10年超	合 計
平成18年度末	変動金利	—	—	—	—	—	—
	固定金利	—	—	—	—	—	—
	一般貸付計	—	—	—	—	—	—
平成19年度末	変動金利	—	—	—	—	—	—
	固定金利	1,666,015	4,894,898	2,417,221	2,179,818	2,797,206	19,921,223
	一般貸付計	1,666,015	4,894,898	2,417,221	2,179,818	2,797,206	19,921,223

(注)「固定金利」には、管理機構（簡易生命保険勘定）への貸付金を含んでいます。

(19) 国内企業向け貸付金企業規模別内訳

(単位：件、百万円、%)

区 分		平成18年度末		平成19年度末	
			占率		占率
大企業	貸付先数	—	—	—	—
	金額	—	—	—	—
中堅企業	貸付先数	—	—	—	—
	金額	—	—	—	—
中小企業	貸付先数	—	—	1	100.0
	金額	—	—	19,908,944	100.0
国内企業向け貸付計	貸付先数	—	—	1	100.0
	金額	—	—	19,908,944	100.0

(注1) 管理機構（簡易生命保険勘定）への貸付金は、日本銀行調査統計局が定める「金融統計調査表の記入要領」の企業規模別区分に基づき「中小企業」に区分しています。

(注2) 業種の区分は以下のとおりです。

(注3) 貸付先数とは、各貸付先を名寄せした結果の債務者数をいい、貸付件数ではありません。

業種	①右の②～④を除く全業種		②小売業、飲食業		③サービス業		④卸売業	
	従業員	資本金	従業員	資本金	従業員	資本金	従業員	資本金
大企業	300名超	10億円以上	50名超	10億円以上	100名超	10億円以上	100名超	10億円以上
中堅企業	かつ	3億円超 10億円未満	かつ	5千万円超 10億円未満	かつ	5千万円超 10億円未満	かつ	1億円超 10億円未満
中小企業	資本金3億円以下又は 常用する従業員300人以下		資本金5千万円以下又は 常用する従業員50人以下		資本金5千万円以下又は 常用する従業員100人以下		資本金1億円以下又は 常用する従業員100人以下	

(20) 貸付金業種別内訳

(単位：百万円、%)

区分	平成18年度末		平成19年度末		
	金額	占率	金額	占率	
国内向け	製造業	—	—	—	—
	食料	—	—	—	—
	繊維	—	—	—	—
	木材・木製品	—	—	—	—
	パルプ・紙	—	—	—	—
	印刷	—	—	—	—
	化学	—	—	—	—
	石油・石炭	—	—	—	—
	窯業・土石	—	—	—	—
	鉄鋼	—	—	—	—
	非鉄金属	—	—	—	—
	金属製品	—	—	—	—
	一般機械	—	—	—	—
	電気機械	—	—	—	—
	輸送用機械	—	—	—	—
	精密機械	—	—	—	—
	その他の製造業	—	—	—	—
農業	—	—	—	—	
林業	—	—	—	—	
漁業	—	—	—	—	
鉱業	—	—	—	—	
建設業	—	—	—	—	
電気・ガス・熱供給・水道業	—	—	—	—	
情報通信業	—	—	—	—	
運輸業	—	—	—	—	
卸売業	—	—	—	—	
小売業	—	—	—	—	
金融・保険業	—	—	19,908,944	99.9	
不動産業	—	—	—	—	
各種サービス	—	—	—	—	
地方公共団体	—	—	12,278	0.1	
個人（住宅・消費・納税資金等）	—	—	—	—	
合計	—	—	19,921,223	100.0	
海外向け	政府等	—	—	—	—
	金融機関	—	—	—	—
	商工業（等）	—	—	—	—
合計	—	—	—	—	
総合計	—	—	19,921,223	100.0	

(注) 管理機構（簡易生命保険勘定）への貸付金は、日本銀行調査統計局が定める「金融統計調査表の記入要領」の業種別貸出金調査表の業種分類一覧表に基づき、「金融・保険業」に区分しています。

(21) 貸付金使途別内訳

(単位：百万円、%)

区 分	平成18年度末		平成19年度末	
	金額	占率	金額	占率
設備資金	—	—	12,278	0.1
運転資金	—	—	19,908,944	99.9
合 計	—	—	19,921,223	100.0

(注) 管理機構（簡易生命保険勘定）への貸付金は、「運転資金」に区分しています。

(22) 貸付金地域別内訳

(単位：百万円、%)

区 分	平成18年度末		平成19年度末	
	金額	占率	金額	占率
北海道	—	—	—	—
東 北	—	—	—	—
関 東	—	—	19,913,210	99.9
中 部	—	—	6,465	0.0
近 畿	—	—	—	—
中 国	—	—	1,547	0.0
四 国	—	—	—	—
九 州	—	—	—	—
合 計	—	—	19,921,223	100.0

(注) 管理機構（簡易生命保険勘定）への貸付金は、同機構の所在地が東京都であることから、「関東」に区分しています。

(23) 貸付金担保別内訳

(単位：百万円、%)

区 分	平成18年度末		平成19年度末	
	金額	占率	金額	占率
担保貸付	—	—	—	—
有価証券担保貸付	—	—	—	—
不動産・動産・財団担保貸付	—	—	—	—
指名債権担保貸付	—	—	—	—
保証貸付	—	—	—	—
信用貸付	—	—	12,278	0.1
その他	—	—	19,908,944	99.9
合 計	—	—	19,921,223	100.0
うち劣後特約付貸付	—	—	—	—

(注) 管理機構（簡易生命保険勘定）への貸付金は、「その他」に区分しています。

(24) 有形固定資産明細表

1) 有形固定資産の明細

(単位：百万円、%)

区 分		前期末 残 高	当 期 増加額	当 期 減少額	当 期 償却額	当期末 残 高	減価償却 累計額	償 却 累計率
平成 18 年度	土 地	—	—	—	—	—	—	—
	建 物	—	—	—	—	—	—	—
	建設仮勘定	—	—	—	—	—	—	—
	その他の有形固定資産	—	—	—	—	—	—	—
	合 計	—	—	—	—	—	—	—
平成 19 年度	土 地	—	40,726	—	—	40,726	—	—
	建 物	—	38,893	76	1,551	37,266	1,542	4.0
	建設仮勘定	—	906	896	—	9	—	—
	その他の有形固定資産	—	21,883	374 (6)	1,618	19,890	1,606	7.5
	合 計	—	102,409	1,347 (6)	3,170	97,892	3,148	—

(注) 「当期減少額」欄の括弧内には、減損損失の計上額を再掲しています。

2) 不動産残高及び賃貸用ビル保有数

(単位：百万円、棟)

区 分	平成18年度末	平成19年度末
不動産残高	—	78,002
営業用	—	78,002
賃貸用	—	—
賃貸用ビル保有数	—	—

(注) 「不動産」(営業用)については、土地、建物(建物付属設備及び構築物を含む)、建設仮勘定を合計した金額を計上しています。

(25) 固定資産等処分益明細表

該当ありません。

(26) 固定資産等処分損明細表

(単位：百万円)

区 分	平成18年度	平成19年度
有形固定資産	—	162
土地	—	—
建物	—	109
その他	—	52
無形固定資産	—	—
その他	—	—
合 計	—	162

(注) 「建物」については、建物、建物付属設備、構築物を合計した金額を計上しています。

(27) 賃貸用不動産等減価償却費明細表

該当ありません。

(28) 海外投融資の状況

1) 資産別内訳

(単位：百万円、%)

区 分		平成18年度末		平成19年度末	
		金額	占率	金額	占率
外貨建資産	公社債	—	—	2,354,081	93.8
	株式	—	—	—	—
	現預金・その他	—	—	—	—
	小 計	—	—	2,354,081	93.8
円貨額が確定した 外貨建資産	公社債	—	—	—	—
	現預金・その他	—	—	—	—
	小 計	—	—	—	—
円貨建資産	非居住者貸付	—	—	—	—
	公社債(円建外債)・その他	—	—	155,790	6.2
	小 計	—	—	155,790	6.2
海外投融資合計		—	—	2,509,872	100.0

(注)「円貨額が確定した外貨建資産」とは、為替予約が付されていることにより決済時の円貨額が確定し、当該円貨額を資産の貸借対照表計上額としているものです。

2) 地域別構成

(単位：百万円、%)

区 分	外国証券						非居住者貸付	
	金額		占率		金額		占率	
平成18年度末	北米	—	—	—	—	—	—	—
	ヨーロッパ	—	—	—	—	—	—	—
	オセアニア	—	—	—	—	—	—	—
	アジア	—	—	—	—	—	—	—
	中南米	—	—	—	—	—	—	—
	中東	—	—	—	—	—	—	—
	アフリカ	—	—	—	—	—	—	—
	国際機関	—	—	—	—	—	—	—
	合 計	—	—	—	—	—	—	—
	平成19年度末	北米	906,949	36.1	906,949	36.1	—	—
ヨーロッパ		1,407,979	56.1	1,407,979	56.1	—	—	—
オセアニア		11,012	0.4	11,012	0.4	—	—	—
アジア		—	—	—	—	—	—	—
中南米		—	—	—	—	—	—	—
中東		—	—	—	—	—	—	—
アフリカ		—	—	—	—	—	—	—
国際機関		183,931	7.3	183,931	7.3	—	—	—
合 計		2,509,872	100.0	2,509,872	100.0	—	—	—

3) 外貨建資産の通貨別構成

(単位：百万円、%)

区 分	平成18年度末		平成19年度末	
	金額	占率	金額	占率
米ドル	—	—	951,634	40.4
ユーロ	—	—	1,085,715	46.1
スターリングポンド	—	—	232,595	9.9
カナダドル	—	—	72,885	3.1
オーストラリアドル	—	—	11,250	0.5
合 計	—	—	2,354,081	100.0

(29) 海外投融資利回り

(単位：%)

区 分	平成18年度末	平成19年度末
海外投融資利回り	—	▲5.95

(30) 公共関係投融資の概況（新規引受額、貸出額）

(単位：百万円)

区 分		平成18年度	平成19年度
公共債	国債	—	248,290
	地方債	—	—
	公社・公団債	—	49
	小 計	—	248,340
貸 付	政府関係機関	—	—
	公共団体・公企業	—	12,278
	小 計	—	12,278
合 計		—	260,618

(31) 各種ローン金利

該当ありません。

(32) その他の資産明細表

(単位：百万円)

資産の種類		取得原価	当期増加額	当期減少額	減価償却 累計額	期末残高	摘 要
平成18年度	その他	—	—	—	—	—	
	合 計	—	—	—	—	—	
平成19年度	その他	1,431	6,123	5,067	—	1,056	
	合 計	1,431	6,123	5,067	—	1,056	