

令和3年度業務概況書【厚生年金保険給付積立金】の修正について

令和4年7月に公表いたしました令和3年度業務概況書【厚生年金保険給付積立金】につきまして、令和3年度末の外国債券の時価評価額に一部誤りがあったため修正いたします。

主な修正点は次頁以降のとおりです。

なお、令和4年度第1四半期、第2四半期及び第3四半期の運用状況につきましても、所要の修正を行いました。

令和5年2月

(1) 運用資産額、資産構成割合

(単位：億円, %)

| | 令和4年3月末 (修正前) | | | | 影響額 |
|------|---------------|---------------|---------------|--------|-----------|
| | 簿価 | 時価 | 評価損益額 | 構成割合 | |
| 国内債券 | 22,443 | 22,976 | 533 | 27.66 | - |
| 国内株式 | 15,191 | 19,726 | 4,535 | 23.75 | - |
| 外国債券 | 18,414 | <u>18,682</u> | <u>267</u> | 22.49 | <u>-3</u> |
| 外国株式 | 11,429 | 21,685 | 10,257 | 26.11 | - |
| 合計 | 67,477 | <u>83,069</u> | <u>15,592</u> | 100.00 | <u>-3</u> |

| | 令和4年3月末 (修正後) | | | | 影響額 |
|------|---------------|---------------|---------------|--------|-----------|
| | 簿価 | 時価 | 評価損益額 | 構成割合 | |
| 国内債券 | 22,443 | 22,976 | 533 | 27.66 | - |
| 国内株式 | 15,191 | 19,726 | 4,535 | 23.75 | - |
| 外国債券 | 18,414 | <u>18,679</u> | <u>264</u> | 22.49 | <u>-3</u> |
| 外国株式 | 11,429 | 21,685 | 10,257 | 26.11 | - |
| 合計 | 67,477 | <u>83,066</u> | <u>15,589</u> | 100.00 | <u>-3</u> |

(2) 総合収益額

(単位：億円)

| 総合収益額 | 令和3年度 (修正前) | | | | | 影響額 |
|-------|-------------|-------|-------|-------------|--------------|-----------|
| | 第1四半期 | 第2四半期 | 第3四半期 | 第4四半期 | 年度計 | |
| 国内債券 | 112 | 92 | 83 | 12 | 299 | - |
| 国内株式 | -75 | 1,054 | -363 | -408 | 207 | - |
| 外国債券 | 267 | -163 | 458 | <u>-226</u> | <u>337</u> | <u>-3</u> |
| 外国株式 | 1,738 | 70 | 2,297 | -145 | 3,960 | - |
| 合計 | 2,043 | 1,052 | 2,474 | <u>-767</u> | <u>4,803</u> | <u>-3</u> |

| 総合収益額 | 令和3年度 (修正後) | | | | | 影響額 |
|-------|-------------|-------|-------|-------------|--------------|-----------|
| | 第1四半期 | 第2四半期 | 第3四半期 | 第4四半期 | 年度計 | |
| 国内債券 | 112 | 92 | 83 | 12 | 299 | - |
| 国内株式 | -75 | 1,054 | -363 | -408 | 207 | - |
| 外国債券 | 267 | -163 | 458 | <u>-229</u> | <u>334</u> | <u>-3</u> |
| 外国株式 | 1,738 | 70 | 2,297 | -145 | 3,960 | - |
| 合計 | 2,043 | 1,052 | 2,474 | <u>-770</u> | <u>4,800</u> | <u>-3</u> |

(3) 修正総合収益率

(単位：%, pt)

| 修正総合 収益率 | 令和3年度 (修正前) | | | | |
|-------------|-------------|-------|-------|--------------|-------------|
| | 第1四半期 | 第2四半期 | 第3四半期 | 第4四半期 | 年度計 |
| 国内債券 | 0.49 | 0.39 | 0.36 | 0.05 | 1.29 |
| 国内株式 | -0.39 | 5.53 | -1.81 | -2.11 | 1.06 |
| 外国債券 | 1.69 | -0.98 | 2.56 | <u>-1.23</u> | <u>1.98</u> |
| 外国株式 | 8.77 | 0.34 | 12.76 | -0.72 | 21.20 |
| 合計 | 2.62 | 1.32 | 3.15 | -0.94 | <u>6.13</u> |

| 修正総合 収益率 | 令和3年度 (修正後) | | | | | 影響率 |
|-------------|-------------|-------|-------|--------------|-------------|--------------|
| | 第1四半期 | 第2四半期 | 第3四半期 | 第4四半期 | 年度計 | |
| 国内債券 | 0.49 | 0.39 | 0.36 | 0.05 | 1.29 | - |
| 国内株式 | -0.39 | 5.53 | -1.81 | -2.11 | 1.06 | - |
| 外国債券 | 1.69 | -0.98 | 2.56 | <u>-1.25</u> | <u>1.96</u> | <u>-0.02</u> |
| 外国株式 | 8.77 | 0.34 | 12.76 | -0.72 | 21.20 | - |
| 合計 | 2.62 | 1.32 | 3.15 | -0.94 | <u>6.12</u> | <u>-0.01</u> |

(4) 時間加重収益率

(単位：%, pt)

| | 令和3年度 (修正前) | | |
|------|-------------|-------------------|--------------|
| | 時間加重 収益率 | ベンチ マーク 収益率 | 超過 収益率 |
| 国内債券 | 1.31 | -1.22 | 2.53 |
| 国内株式 | 1.07 | 1.99 | -0.91 |
| 外国債券 | <u>2.09</u> | 1.96 | <u>0.13</u> |
| 外国株式 | 20.84 | 22.95 | -2.11 |
| 合計 | 6.19 | 6.30 | <u>-0.11</u> |

| | 令和3年度 (修正後) | | | 影響率 |
|------|-------------|-------------------|--------------|--------------|
| | 時間加重 収益率 | ベンチ マーク 収益率 | 超過 収益率 | |
| 国内債券 | 1.31 | -1.22 | 2.53 | - |
| 国内株式 | 1.07 | 1.99 | -0.91 | - |
| 外国債券 | <u>2.07</u> | 1.96 | <u>0.11</u> | <u>-0.02</u> |
| 外国株式 | 20.84 | 22.95 | -2.11 | - |
| 合計 | 6.19 | 6.30 | <u>-0.12</u> | <u>-0.01</u> |