

令和6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7年7月に公表いたしました令和6年度業務概況書【厚生年金保険給付積立金】につきまして、外部のリスク管理ツールの提供データの誤りに伴い、推定トラッキングエラー等の数値及びグラフの一部を修正いたします。

修正点は次頁以降のとおりです。

令和7年7月

② トラッキングエラー（市場リスク）

(修正前)P23頁

ア 資産全体の推定トラッキングエラー

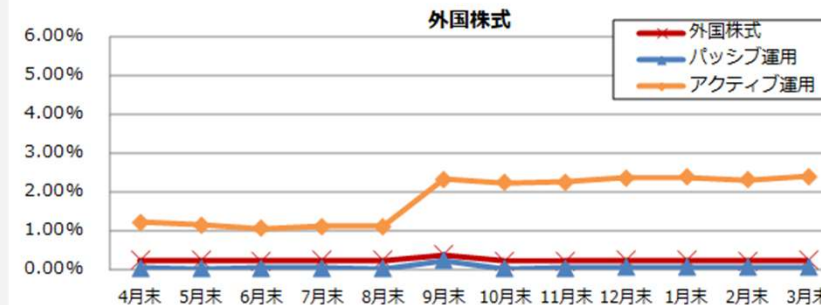
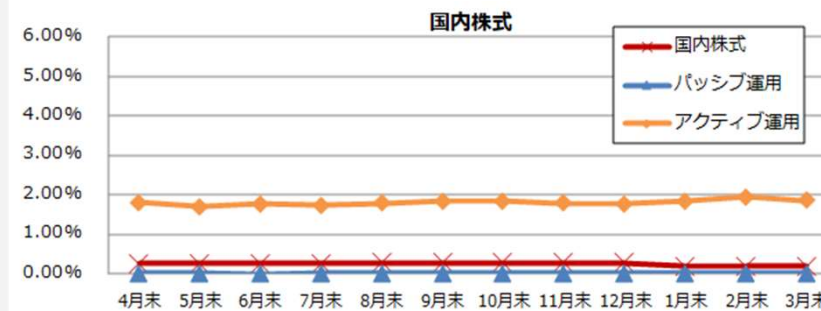
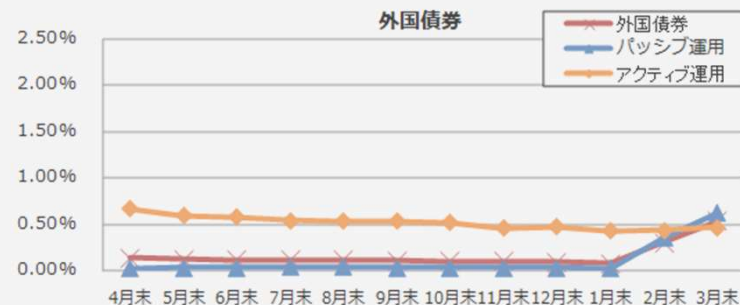
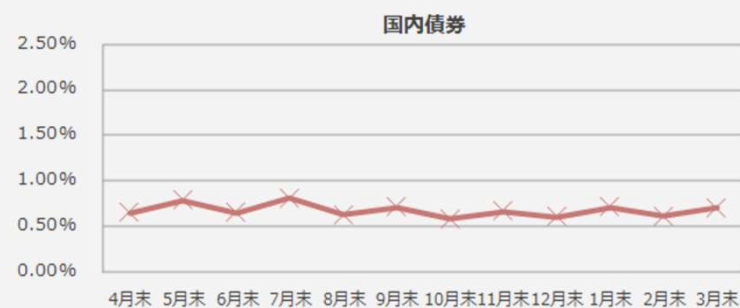
0.2%から0.4%の範囲で推移しました。令和6年度末時点で0.21%となっています。



イ 政策ベンチマークに対する推定トラッキングエラー

国内債券・国内株式は、安定的に推移しました。

外国債券・外国株式は、主にベンチマークの変更・マネージャーの入れ替えの影響により、変動がありました。

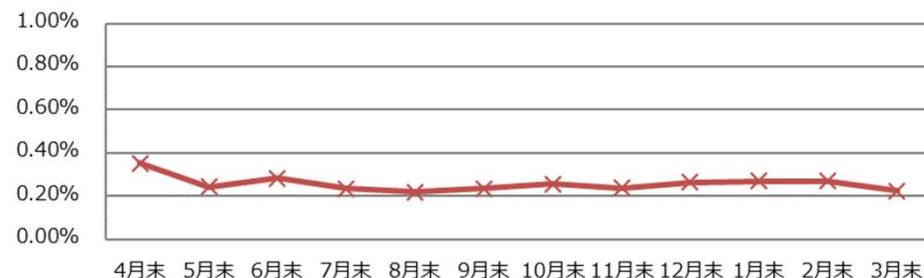


② トラッキングエラー（市場リスク）

(修正後)P23頁

ア 資産全体の推定トラッキングエラー

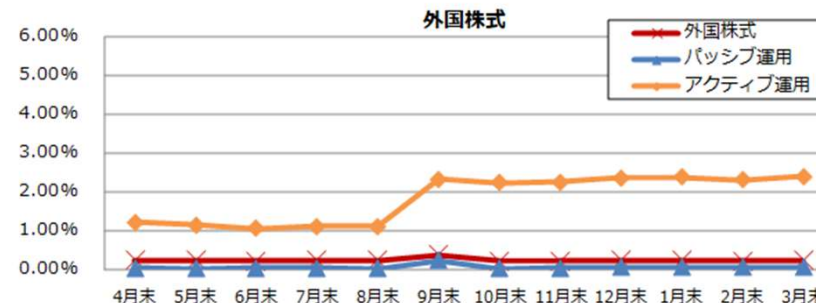
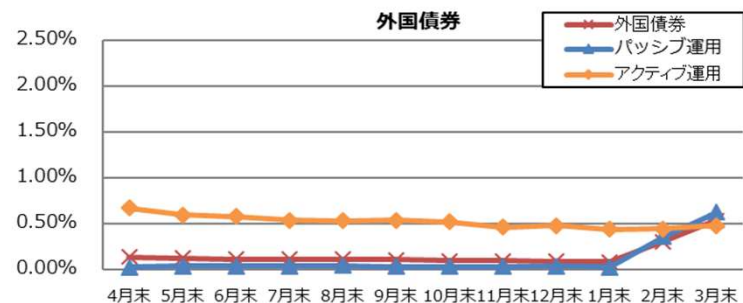
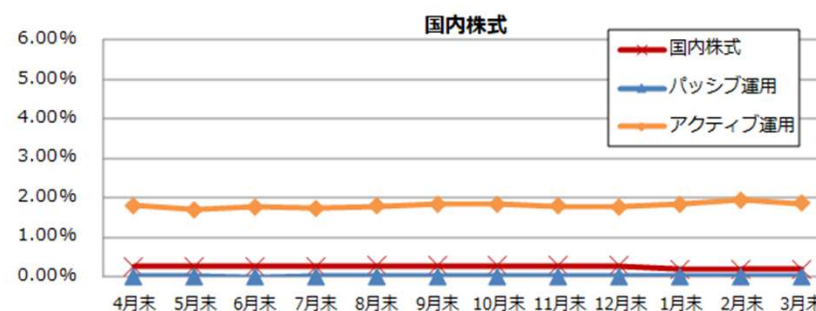
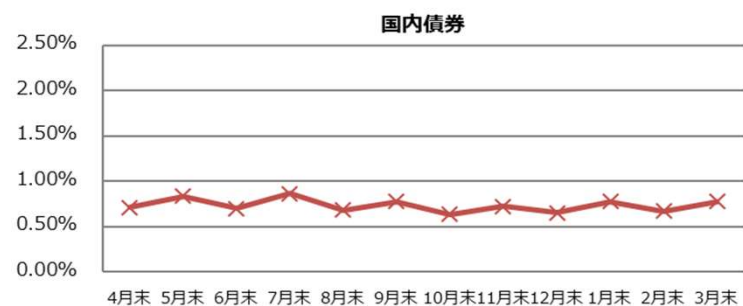
0.2%から0.4%の範囲で推移しました。令和6年度末時点で0.22%となっています。



イ 政策ベンチマークに対する推定トラッキングエラー

国内債券・国内株式は、安定的に推移しました。

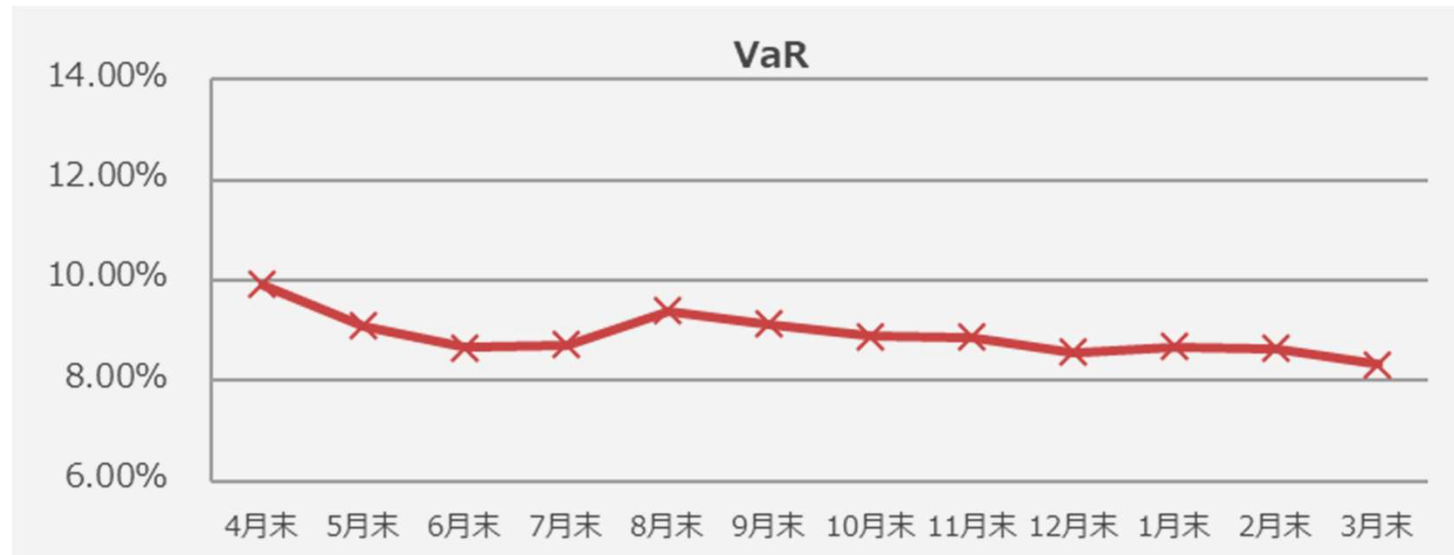
外国債券・外国株式は、主にベンチマークの変更・マネージャーの入れ替えの影響により、変動がありました。



④ VaR（市場リスク）

(修正前)P25頁

VaRは8%から10%の幅で推移しました。

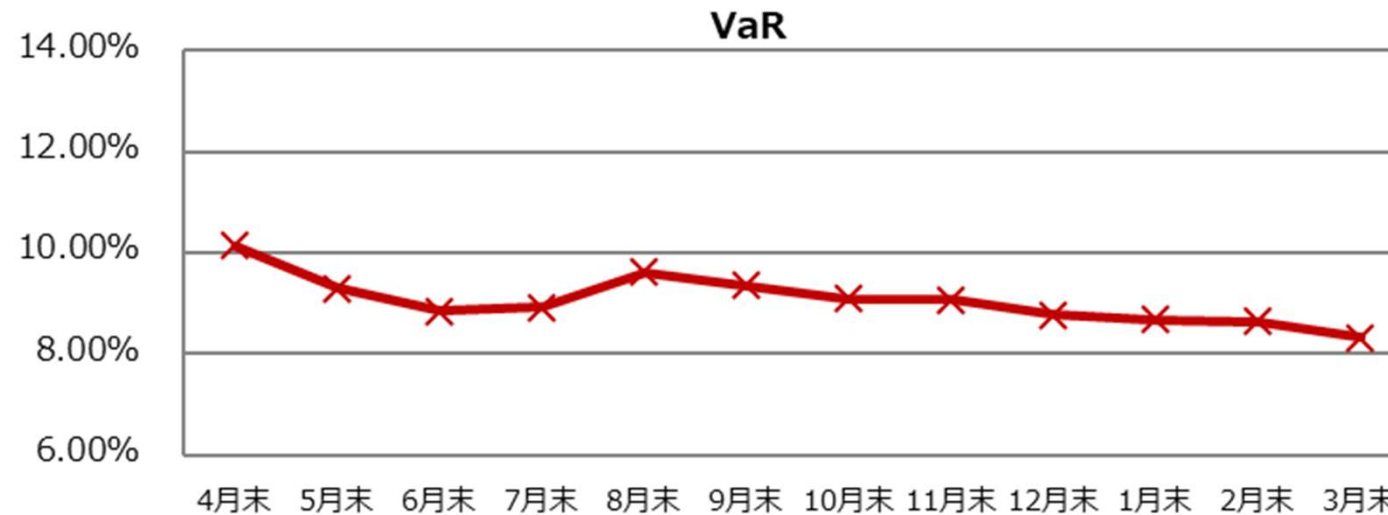


(注) VaR（バリュー・アット・リスク）とは、各資産を一定期間保有（保有期間）すると仮定した場合に、ある一定の確率の範囲内（信頼水準）で発生しうる最大損失率を表したもので、ここでは、分散共分散法で、信頼水準は1σ、保有期間1年、観測期間は2年で算出しています。

④ VaR（市場リスク）

(修正後)P25頁

VaRは8%から10%の幅で推移しました。



(注) VaR（バリュー・アット・リスク）とは、各資産を一定期間保有（保有期間）すると仮定した場合に、ある一定の確率の範囲内（信頼水準）で発生しうる最大損失率を表したもので、ここでは、分散共分散法で、信頼水準は1σ、保有期間1年、観測期間は2年で算出しています。