

厚生年金保険給付積立金の平成27年度第3四半期運用状況

- 第3四半期の収益率は、実現収益率(期間率)がプラス0.79%、修正総合収益率(期間率)がプラス2.73%となりました。
- 第3四半期の収益率は、実現収益額がプラス481億円、総合収益額がプラス1,796億円となりました。
- 第3四半期末の運用資産額は、6兆8,509億円となりました。

※ 年金積立金は長期的な運用を行うものであり、その運用状況も長期的に判断することが必要ですが、情報公開を徹底する観点から、四半期ごとに運用状況の公表を行うものです。

総合収益は、各期末時点での時価に基づく評価であるため、評価損益を含んでおり、市場の動向によって変動するものであることに留意が必要です。

1. 収益率の状況

	平成26年度	平成27年度				
		第1四半期	第2四半期	第3四半期	第4四半期	年度
実現収益率(%)				0.79	-	0.79
修正総合収益率(%)				2.73 (2.81)	-	2.73 (2.81)

【参考】

	平成26年度	平成27年度				
		第1四半期	第2四半期	第3四半期	第4四半期	年度
修正総合収益率(%)				2.73 (2.81)	-	2.73 (2.81)
国内債券				0.54 (0.84)	-	0.54 (0.84)
国内株式				10.30	-	10.30
外国債券				-1.44	-	-1.44
外国株式				5.80	-	5.80

(注1) 収益率は、当該期間中に精算された運用手数料等を控除しています。

(注2) 平成27年度の各期間は期間率です。また、平成27年度の収益率は、年金制度が一元化された平成27年10月以降の収益率です。

(注3) 修正総合収益率は、実現収益率に時価評価による評価損益の増減を加味したものです。

(注4) ()書は、財政融資資金預託金を時価評価した場合の収益率です。

2. 収益額の状況

	平成26年度	平成27年度				
		第1四半期	第2四半期	第3四半期	第4四半期	年度
実現収益額(億円)				481	-	481
総合収益額(億円)				1,796 (1,948)	-	1,796 (1,948)

【参考】

	平成26年度	平成27年度				
		第1四半期	第2四半期	第3四半期	第4四半期	年度
総合収益額(億円)				1,796 (1,948)	-	1,796 (1,948)
国内債券				222 (373)	-	222 (373)
国内株式				1,039	-	1,039
外国債券				-37	-	-37
外国株式				571	-	571
短期資産				0.4	-	0.4

(注1) 上記数値は四捨五入のため、各数値の合算は合計額と必ずしも一致しません。

(注2) 収益額は、当該期間中に精算された運用手数料等を控除しています。

(注3) 平成27年度の収益額は、年金制度が一元化された平成27年10月以降の収益額です。

(注4) 総合収益額は、実現収益額に時価評価による評価損益の増減を加味したものです。

(注5) ()書は、財政融資資金預託金を時価評価した場合の収益額です。

3. 運用資産額の状況

	平成26年度末			平成27年度											
				第1四半期末			第2四半期末			第3四半期末			第4四半期末		
	簿価	時価	評価損益	簿価	時価	評価損益	簿価	時価	評価損益	簿価	時価	評価損益	簿価	時価	評価損益
国内債券	/	/	/	/	/	/	/	/	/	39,318	40,100 (43,870)	782 (4,552)	-	-	-
国内株式	/	/	/	/	/	/	/	/	/	8,957	11,397	2,439	-	-	-
外国債券	/	/	/	/	/	/	/	/	/	2,596	2,641	45	-	-	-
外国株式	/	/	/	/	/	/	/	/	/	8,265	10,739	2,474	-	-	-
短期資産	/	/	/	/	/	/	/	/	/	3,632	3,632	0	-	-	-
合計	/	/	/	/	/	/	/	/	/	62,768	68,509 (72,279)	5,741 (9,511)	-	-	-

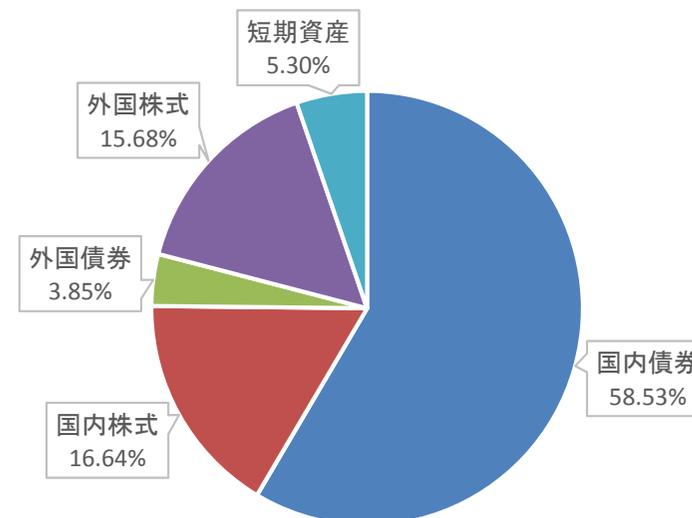
(注1) 上記数値は四捨五入のため、各数値の合算は合計額と必ずしも一致しません。

(注2) ()書は、財政融資資金預託金を時価評価した場合の金額です。

4. 資産構成割合

	資産構成割合
	平成27年度 第3四半期末
国内債券	58.53%
うち財政融資資金預託金	46.98%
国内株式	16.64%
外国債券	3.85%
外国株式	15.68%
短期資産	5.30%
合計	100.00%

運用資産別の構成割合



(注1) 上記数値は四捨五入のため、各数値の合算は合計値と必ずしも一致しません。

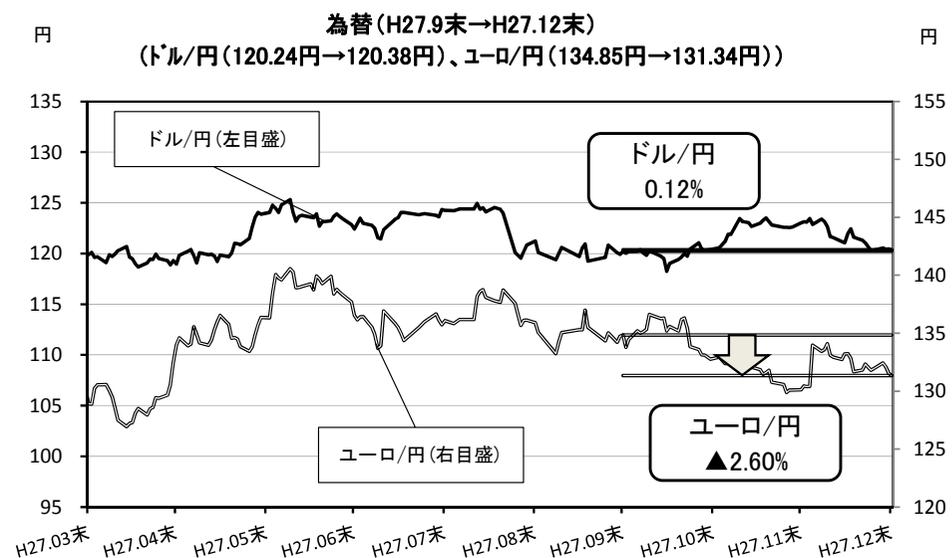
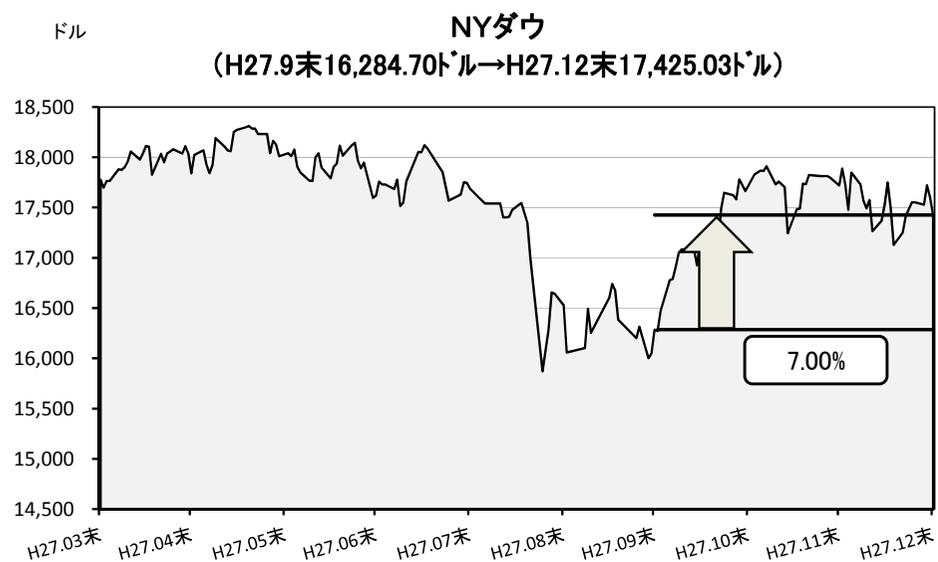
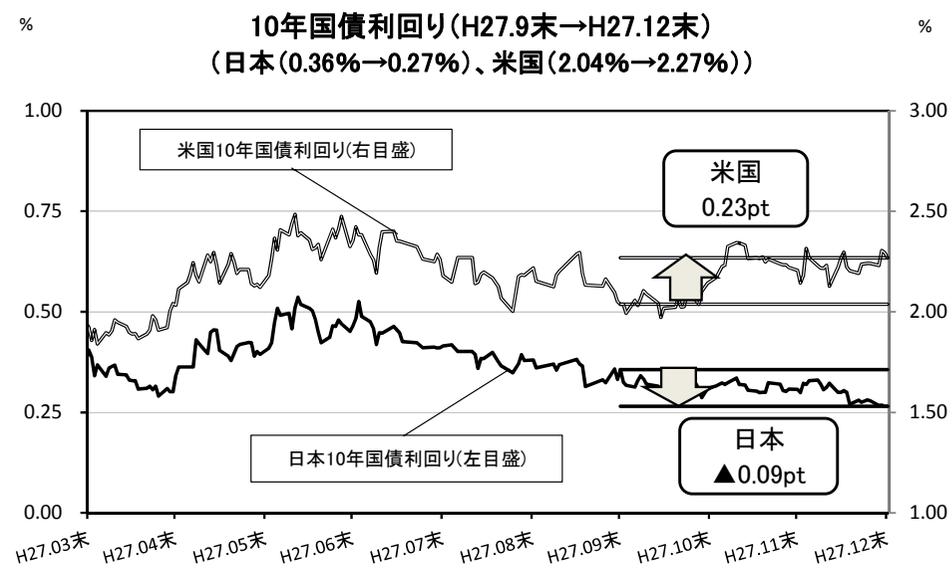
(注2) 基本ポートフォリオは、国内債券35%(±30%)、国内株式25%(±10%)、外国債券15%(±10%)、外国株式25%(±10%)です。

(注3) 財政融資資金預託金については、簿価評価としています。

(注4) 短期資産については、各資産の乖離許容幅の中で管理しています。

(注5) 資産の大幅な移動が必要であることから、当面、乖離許容幅を超過することがあります。

5. 運用環境



被用者年金一元化法の施行に伴う積立金の概算仕分けについて

H27.9.30時点		H27.10.1時点	
長期給付積立金 (時価)		厚生年金保険給 付積立金(時価)	経過的長期給付 積立金(時価)
7兆8,127億円		7兆1,116億円	7,011億円

(参考)

一元化前の厚生年金(旧厚生年金)の積立比率(概算政府積立比率)
 =平成26年度末の旧厚生年金の積立金の見込み額(164.8兆円)
 ÷平成27年度の旧厚生年金の1・2階支出の見込み額(33.7兆円)
 =4.9年分

国共済の積立金概算仕分け額(厚生年金保険給付積立金)
 =平成27年度の1・2階支出の見込額(1.5兆円)
 ×概算政府積立比率(4.9年)
 =7兆1,116億円