

厚生年金保険給付積立金の平成28年度第1四半期運用状況

- 第1四半期の収益率は、実現収益率(期間率)がプラス0.56%、修正総合収益率(期間率)がマイナス2.18%となりました。
- 第1四半期の収益額は、実現収益額がプラス341億円、総合収益額がマイナス1,427億円となりました。
- 第1四半期末の運用資産額は、6兆4,197億円となりました。

※ 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、情報公開を積極的に行う観点から、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

(単位：%)

	平成27年度			平成28年度				
	第3四半期	第4四半期	年度計	第1四半期	第2四半期	第3四半期	第4四半期	年度計
実現収益率	0.79	0.28	1.06	0.56	-	-	-	0.56
修正総合収益率	2.73 (2.81)	-2.23 (-0.86)	0.37 (1.87)	-2.18 (-1.28)	-	-	-	-2.18 (-1.28)

【参考】

(単位：%)

	平成27年度			平成28年度				
	第3四半期	第4四半期	年度計	第1四半期	第2四半期	第3四半期	第4四半期	年度計
修正総合収益率	2.73 (2.81)	-2.23 (-0.86)	0.37 (1.87)	-2.18 (-1.28)	-	-	-	-2.18 (-1.28)
国内債券	0.54 (0.84)	1.13 (3.13)	1.66 (3.95)	0.96 (2.06)	-	-	-	0.96 (2.06)
国内株式	10.30	-12.13	-2.95	-6.98	-	-	-	-6.98
外国債券	-1.44	-1.11	-2.50	-8.17	-	-	-	-8.17
外国株式	5.80	-5.97	-0.59	-7.67	-	-	-	-7.67
短期資産	0.02	0.01	0.03	0.00	-	-	-	0.00

(注1) 各四半期の収益率は期間率です。また、平成27年度「年度計」は平成27年度下半期の期間率です。

(注2) 収益率は、運用手数料控除後のものです。

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

(注4) 国内債券には、財投預託金を含みます。

(注5) ()内は、財投預託金を国債の利回りを参照すること等により評価した場合の収益率です。

2. 収益額の状況

(単位：億円)

	平成27年度			平成28年度				
	第3四半期	第4四半期	年度計	第1四半期	第2四半期	第3四半期	第4四半期	年度計
実現収益額	481	176	657	341	-	-	-	341
総合収益額	1,796 (1,948)	-1,549 (-628)	248 (1,320)	-1,427 (-898)	-	-	-	-1,427 (-898)

【参考】

(単位：億円)

	平成27年度			平成28年度				
	第3四半期	第4四半期	年度計	第1四半期	第2四半期	第3四半期	第4四半期	年度計
総合収益額	1,796 (1,948)	-1,549 (-628)	248 (1,320)	-1,427 (-898)	-	-	-	-1,427 (-898)
国内債券	222 (373)	450 (1,372)	672 (1,745)	381 (911)	-	-	-	381 (911)
国内株式	1,039	-1,338	-299	-725	-	-	-	-725
外国債券	-37	-31	-68	-266	-	-	-	-266
外国株式	571	-630	-59	-818	-	-	-	-818
短期資産	0	1	1	0	-	-	-	0

(注1) 平成27年度「年度計」は平成27年度下半期の収益額です。

(注2) 収益額は、運用手数料控除後のものです。

(注3) 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4) 国内債券には、財投預託金を含みます。

(注5) ()内は、財投預託金を国債の利回りを参照すること等により評価した場合の収益率です。

(注6) 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。

3. 運用資産額の状況

(単位：億円)

	平成27年度						平成28年度		
	第3四半期末			第4四半期末			第1四半期末		
	簿価	時価	評価 損益	簿価	時価	評価 損益	簿価	時価	評価 損益
国内債券	39,318	40,100 (43,870)	782 (4,552)	40,931	41,969 (46,660)	1,038 (5,729)	37,851	39,071 (44,292)	1,221 (6,441)
国内株式	8,957	11,397	2,439	9,167	10,216	1,049	9,384	9,719	336
外国債券	2,596	2,641	45	3,216	3,214	-2	3,416	3,149	-267
外国株式	8,265	10,739	2,474	8,713	10,547	1,834	8,999	9,951	952
短期資産	3,632	3,632	0	914	914	0	2,307	2,307	0
合計	62,768	68,509 (72,279)	5,741 (9,511)	62,942	66,861 (71,552)	3,919 (8,610)	61,956	64,197 (69,418)	2,241 (7,462)

(注1) 国内債券には、財投預託金を含みます。

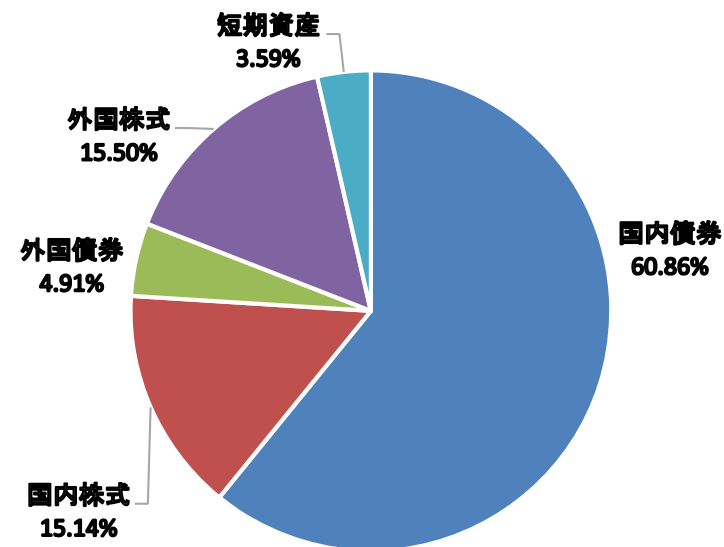
(注2) ()内は、財投預託金を国債の利回りを参照すること等により評価した場合の収益率です。

(注3) 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。

4. 資産構成割合

(単位：億円)

	平成28年度 第1四半期末	
	資産額	構成割合
国内債券	39,071	60.86%
(うち財投預託金)	31,380	48.88%
国内株式	9,719	15.14%
外国債券	3,149	4.91%
外国株式	9,951	15.50%
短期資産	2,307	3.59%
合計	64,197	100.00%



(注1) 財投預託金については、簿価評価としています。

(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) 基本ポートフォリオを踏まえた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。

(注4) 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。

5. 運用環境

