

積立金の資産の構成の目標(モデルポートフォリオ)

厚生年金保険法(昭和29年法律第115号。以下「法」という。)第79条の5第1項及び被用者年金制度の一元化等を図るための厚生年金保険法等の一部を改正する法律(平成24年法律第63号)附則第28条第2項の規定に基づき、法第79条の6第1項に規定する管理運用の方針において同条第2項第3号の資産の構成(以下「基本ポートフォリオ」という。)を定めるに当たって参酌すべき積立金の資産の構成の目標(以下「モデルポートフォリオ」という。)を次のように定め、同法の施行の日(平成27年10月1日)から適用することとしたので、法第79条の5第3項及び被用者年金制度の一元化等を図るための厚生年金保険法等の一部を改正する法律附則第28条第2項の規定に基づき公表する。

平成27年3月20日

年金積立金管理運用独立行政法人
国家公務員共済組合連合会
地方公務員共済組合連合会
日本私立学校振興・共済事業団

資産	国内債券	国内株式	外国債券	外国株式
モデルポートフォリオ	35%	25%	15%	25%
中心値範囲	上記±10%	上記±9%	上記±4%	上記±8%

(備考)

- この表の数値は、短期資産を含む管理積立金(法第79条の6第1項に規定する管理積立金をいう。以下同じ。)全体に対する各資産の割合である。
- この表において「中心値範囲」とは、管理運用主体(法第79条の4第2項第3号に規定する管理運用主体をいう。)が管理積立金の運用において厚生年金保険事業の共通財源としての一体性を確保する観点から定められた、基本ポートフォリオにおける各資産の中心値が含まれるべき範囲をいう。
- この表に掲げる資産(以下「伝統的4資産」という。)以外の資産は、リスク・リターン特性に応じて、伝統的4資産のいずれかに区分して管理するものとする。ただし、短期資産は、伝統的4資産とは別に区分して管理することができる。
- 基本ポートフォリオにおいて短期資産の割合を定めるときは、この表の数値は、それぞれの数値に、1から短期資産の割合を控除した割合を乗じ、小数第一位を四捨五入した数値に読み替えることができるものとする。