

平成27年度第3四半期運用状況の概要

経過の長期給付組合積立金

経過の長期給付組合積立金の運用について

経過の長期給付組合積立金の運用は、新規の掛金収入が発生しないという閉鎖型年金の特性を踏まえ、下振れリスクに特に留意しつつ、将来にわたる負債と積立金との関係を常に意識しながら、長期的な観点から安全かつ効率的に行うことにより、経過の長期給付事業の運営の安定に資することを目的として行うこととされています。

- 第3四半期の運用資産額は、5兆8,853億円となりました。
- 第3四半期の修正総合収益率（期間率）は、+2.52%となりました。なお、実現収益率は、+0.97%です。
- 第3四半期の総合収益額は、+1,451億円となりました。なお、実現収益額は、+489億円です。

（単位：億円）

	平成27年度			
	期初(10月1日)	第3四半期	第4四半期	年度通期
資産残高	58,014	58,853		
修正総合収益率 (実現収益率)		+2.52% (+0.97%)		+2.52% (+0.97%)
総合収益額 (実現収益額)		+1,451 (+489)		+1,451 (+489)

※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。

総合収益額は、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。

（注1）資産残高は時価総額（時価と未収収益を合算したもの）です。

（注2）収益率及び収益額は、当該期間中に清算された運用手数料等を控除したものです。

（注3）収益率及び収益額は、各期間に係るものです。

また、平成27年度の収益率及び収益額は、被用者年金制度が一元化された平成27年10月以降のものであります。

資産状況

経過的長期給付組合積立金

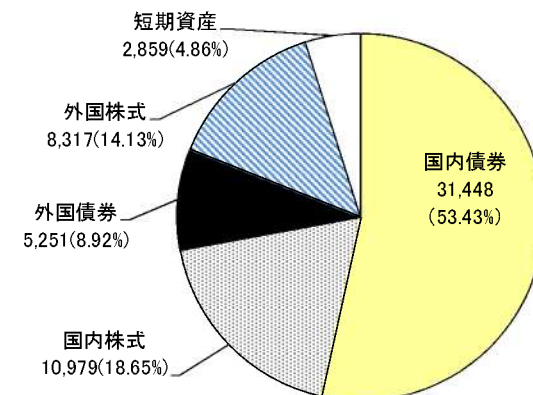
(単位:億円)

	平成27年度					
	期初(10月1日)		第3四半期		第4四半期	
	時価総額 (簿価)	構成割合	時価総額 (簿価)	構成割合	時価総額 (簿価)	構成割合
国内債券	33,534 (30,832)	57.80%	31,448 (28,604)	53.43%		
国内株式	8,886 (6,967)	15.32%	10,979 (8,367)	18.65%		
外国債券	5,082 (4,449)	8.76%	5,251 (4,750)	8.92%		
外国株式	7,040 (5,081)	12.13%	8,317 (6,139)	14.13%		
短期資産	3,473 (3,473)	5.99%	2,859 (2,861)	4.86%		
合計	58,014 (50,803)	100.00%	58,853 (50,721)	100.00%		

(注1) 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% (±15%)、国内株式25% (±14%)、外国債券15% (±6%)、外国株式25% (±12%) です。

平成27年度第3四半期 運用資産別の構成割合



収益率の状況

経過的長期給付組合積立金

	平成27年度		
	第3四半期 (10月～12月)	第4四半期 (1月～3月)	年度通期
修正総合収益率 (実現収益率)	+2.52% (+0.97%)		+2.52% (+0.97%)
国内債券	+0.93%		+0.93%
国内株式	+9.57%		+9.57%
外国債券	▲1.38%		▲1.38%
外国株式	+4.77%		+4.77%
短期資産	▲0.04%		▲0.04%

(注1) 修正総合収益率は、運用成果を測定する尺度の一つです。

総合収益率は分母の元本平均残高を簿価ベースで算出しますが、修正総合収益率では元本平均残高を時価ベースで算出します。
 なお、当該期間中に清算された運用手数料等を控除したものとなっています。

(注2) 収益率は各期間に係るものです。また、平成27年度の収益率は、被用者年金制度が一元化された平成27年10月以降のものであります。

<修正総合収益率の計算式>

$$\frac{\text{売買損益} + \text{利息} \cdot \text{配当金収入} + \text{未収収益増減} + \text{評価損益増減}}{\text{簿価平残} + \text{前期末未収収益} + \text{前期末評価損益}}$$

<実現収益率の計算式>

$$\frac{\text{売買損益} + \text{利息} \cdot \text{配当金収入} + \text{未収収益増減}}{\text{簿価平残}}$$

収益額の状況

経過的長期給付組合積立金

(単位:億円)

	平成27年度		
	第3四半期 (10月～12月)	第4四半期 (1月～3月)	年度通期
総合収益額 (実現収益額)	+1,451 (+489)		+1,451 (+489)
国内債券	+305		+305
国内株式	+875		+875
外国債券	▲71		▲71
外国株式	+343		+343
短期資産	▲1		▲1

(注1) 数値は四捨五入のため、各数値の合算と合計値は必ずしも一致しません。

(注2) 総合収益額は、実現収益額に加え資産の時価評価による評価損益を加味することにより時価に基づく収益把握を行ったものです。
なお、当該期間中に清算された運用手数料等を控除したものとなっています。

(注3) 収益額は各期間に係るものです。また、平成27年度の収益額は、被用者年金制度が一元化された平成27年10月以降のものです。

<総合収益額の計算式>

売買損益+利息・配当金収入+未収収益増減+評価損益増減

<実現収益額の計算式>

売買損益+利息・配当金収入+未収収益増減