

# 平成27年度第3四半期運用状況の概要

退職等年金給付組合積立金

## 退職等年金給付組合積立金の運用について

退職等年金給付組合積立金の運用は、国債利回り等に連動する形で給付水準を決めるキャッシュバランス型年金の特性を踏まえ、長期的な観点から安全かつ効率的に行うことにより、退職等年金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、134億円となりました。
- 第3四半期の実現収益率（期間率）は、+0.12%となりました。
- 第3四半期の実現収益額は、+0億円（7百万円）となりました。なお、総合収益額は、+0億円（48百万円）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		134		
実現収益率		+0.12%		+0.12%
実現収益額 (総合収益額)		+0 (+0)		+0 (+0)

※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、退職等年金給付組合積立金が、原則として、給付対応等で必要な短期資産を除く全額を国内債券に投資し、それを満期まで持ち切る運用を行うことから、簿価評価（簿価+未収収益）としています。

（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

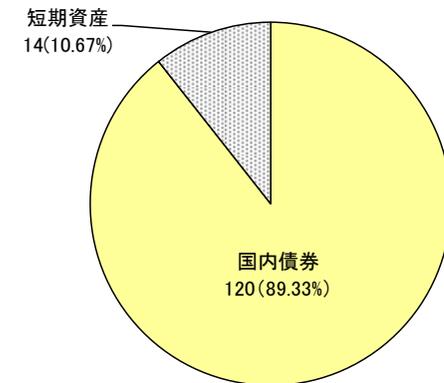
退職等年金給付組合積立金

(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	
	簿価+未収収益 (時価総額)	構成割合	簿価+未収収益 (時価総額)	構成割合	簿価+未収収益 (時価総額)	構成割合
国内債券			120 (120)	89.33%		
短期資産			14 (14)	10.67%		
合計			134 (135)	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100%です。  
 (注3) 退職等年金給付組合積立金は、原則として、給付対応等で必要な短期資産を除く全額を国内債券に投資し、それを満期まで持ち切る運用を行うことから、簿価評価(簿価+未収収益)としています。

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

	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
実現収益率	+0.12%		+0.12%
国内債券	+0.20%		+0.20%
短期資産	+0.01%		+0.01%

(注1) 新3階の債券は簿価での評価となるため、評価損益を除いた実現利回りを使用しています。

(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月以降のものです。

<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

(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
実現収益額 (総合収益額)	+0 (+0)		+0 (+0)
国内債券	+0		+0
短期資産	+0		+0

(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) 新3階の債券は簿価での評価となるため、評価損益を除いた実現収益額を使用しています。

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。

<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

<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