

平成27年度 長期経理等積立金の運用状況

1 運用収益額と収益率

(単位:億円)

	上半期 (4月～9月)	下半期 (10月～3月)				平成27年度 合計
	長期	厚生年金保険 (旧1・2階)	経過的長期 (旧3階)	退職等年金 (新3階)	計	
運用資産額	5,948	2,877	2,777	61	5,716	5,716
実現収益額	103	36	54	0	90	194
実現収益率	1.84%	1.30%	2.05%	0.08%	1.66%	3.50%
総合収益額	-72	12	5	0	19	-53
修正総合収益率	-1.17%	0.41%	0.20%	5.99%	0.34%	-0.87%

(注)・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ことに留意が必要である

・上記数字は四捨五入のため、各数字の合算と合計数字は一致しないことがある

・各収益率は、期間利回りであり、年率換算していない

2 運用資産の構成割合(平成28年3月31日現在:時価ベース)

(単位:億円)

	厚生年金保険(旧1・2階)		経過的長期(旧3階)		退職等年金(新3階)	
国内債券	1,152	(40.05%)	1,283	(46.21%)	50	(81.16%)
国内株式	455	(15.81%)	480	(17.29%)	0	(0.00%)
外国債券	333	(11.56%)	335	(12.07%)	0	(0.00%)
外国株式	468	(16.26%)	511	(18.39%)	0	(0.00%)
短期資産	469	(16.32%)	168	(6.05%)	12	(18.84%)
合計	2,877	(100.00%)	2,777	(100.00%)	61	(100.00%)

(注)・上記数字は四捨五入のため、各数字の合算と合計数字は一致しないことがある

参考 基本ポートフォリオ(平成27年9月30日策定)

	構成割合	許容乖離幅	
国内債券	35%	±15%	(20~50%)
国内株式	25%	±14%	(11~39%)
外国債券	15%	±6%	(9~21%)
外国株式	25%	±12%	(13~37%)

(注)ただし、退職等年金(新3階)は国内債券100%