

平成28年度 年金積立金の運用状況

1 運用収益額と収益率

(単位:億円)

	平成28年度			(参考)平成27年度下期		
	厚生年金保険 (旧1・2階)	経過の長期 (旧3階)	退職等年金 (新3階)	厚生年金保険 (旧1・2階)	経過の長期 (旧3階)	退職等年金 (新3階)
運用資産額	2,831	2,634	178	2,877	2,777	60
実現収益額	46	46	0	36	54	0
実現収益率	1.80%	1.80%	0.33%	1.30%	2.05%	0.08%
総合収益額	111	127	-	12	5	-
修正総合収益率	4.10%	4.77%	-	0.41%	0.20%	-

- (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
- ・運用資産額は期末の、厚生年金保険・経過の長期は時価ベース額であるが、退職等年金は満期保有目的の債券で運用を行っていることから簿価ベース額として、その実現収益のみ記載している
 - ・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29年3月31日現在)

(単位:億円)

	厚生年金保険(旧1・2階)		経過の長期(旧3階)		退職等年金(新3階)	
国内債券	993	(35.1%)	1,131	(42.9%)	168	(94.5%)
国内株式	517	(18.2%)	552	(21.0%)	0	(0.0%)
外国債券	315	(11.1%)	317	(12.0%)	0	(0.0%)
外国株式	541	(19.1%)	585	(22.2%)	0	(0.0%)
短期資産	466	(16.5%)	49	(1.9%)	10	(5.5%)
合計	2,831	(100.0%)	2,634	(100.0%)	178	(100.0%)

- (注)・厚生年金保険・経過の長期は時価ベース、退職等年金は簿価ベースである
- ・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

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%