

令和2年 3月末 年金資産運用結果について

● 運用機関別（速報）

（単位：円・％）

運用機関	運用スタイル	前期末(平成31年3月31日) 時価総額 ①	当期末(令和2年3月末) 時価総額 ②	前期比 差額 ③	総合収益 ⑤	時間加重 収 益 率
三菱UFJ信託銀行	パッシブ	3,397,078,390	3,720,711,505	323,633,115	△ 2,655,162	-0.03
三井住友信託	外株	509,057,312	293,265,804	△ 215,791,508	57,883,281	9.98
みずほ信託銀行	日本株集中投資	433,194,824	428,844,437	△ 4,350,387	112,284	0.01
りそな銀行	外債アクティブ	529,175,723	551,294,426	22,118,703	25,425,845	4.81
朝日ライフアセットマネジメント	代替四資産	1,072,180,226	1,085,803,491	13,623,265	13,623,265	1.27
アセットマネジメントOne	日本株	306,687,156	279,568,619	△ 27,118,537	△ 27,118,537	-8.84
東京海上アセットマネジメント	日本株低ボラティリティ	321,874,574	298,942,063	△ 22,932,511	△ 22,932,511	-7.12
MFSインベストメント	外株	564,552,153	496,732,381	△ 67,819,772	△ 67,819,772	-12.01
アライアンス・パースタイン	代替資産	349,440,786	335,309,541	△ 14,131,245	△ 14,131,245	-4.04
合 計		7,483,241,144	7,490,472,267	7,231,123	△ 37,612,552	-0.53

※ベンチマーク 2.00%です。

● 令和2年の3月末までの収支概要

（単位：千円）

		<table><tr><td>企業年金基金(3月末資産額)</td></tr><tr><td>7,483,241</td></tr></table>	企業年金基金(3月末資産額)	7,483,241		<table><tr><td>年金・一時金</td></tr><tr><td>531,501</td></tr></table>	年金・一時金	531,501		
企業年金基金(3月末資産額)										
7,483,241										
年金・一時金										
531,501										
	→	↓								
<table><tr><td>掛金</td></tr><tr><td>1,151,638</td></tr></table>	掛金	1,151,638		<table><tr><td>収入 : 1,158,693</td></tr><tr><td>支出 : 651,462</td></tr></table>	収入 : 1,158,693	支出 : 651,462		<table><tr><td>移換金</td></tr><tr><td>32,933</td></tr></table>	移換金	32,933
掛金										
1,151,638										
収入 : 1,158,693										
支出 : 651,462										
移換金										
32,933										
		↓								
<table><tr><td>脱退一時金相当額受入金</td></tr><tr><td>7,055</td></tr></table>	脱退一時金相当額受入金	7,055		<table><tr><td>3月末資産額</td></tr><tr><td>7,990,472</td></tr></table>	3月末資産額	7,990,472	←	<table><tr><td>業務委託費</td></tr><tr><td>14,254</td></tr></table>	業務委託費	14,254
脱退一時金相当額受入金										
7,055										
3月末資産額										
7,990,472										
業務委託費										
14,254										
<table><tr><td>総合収益</td></tr><tr><td></td></tr></table>	総合収益					<table><tr><td>コンサルタント料</td></tr><tr><td>4,320</td></tr></table>	コンサルタント料	4,320		
総合収益										
コンサルタント料										
4,320										
				<table><tr><td>信託報酬・投資顧問料</td></tr><tr><td>30,788</td></tr></table>	信託報酬・投資顧問料	30,788				
信託報酬・投資顧問料										
30,788										
				<table><tr><td>特別支出</td></tr><tr><td>53</td></tr></table>	特別支出	53				
特別支出										
53										
				<table><tr><td>総合収益(損失)</td></tr><tr><td>37,613</td></tr></table>	総合収益(損失)	37,613				
総合収益(損失)										
37,613										

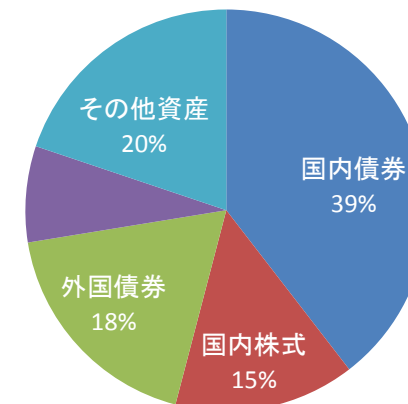
※ 総合収益(運用収益)は、速報値です。
今後の運用状況により変化します。

※ 速報値の時価総額金額と支出概要3月末資産の差額
500.000千円は4月運用分です。

※ 総合収益(運用収益)は、速報値です。
今後の運用状況により変化します。

※ 速報値の時価総額金額と支出概要3月末資産の差額
500,000千円は4月運用分です。

● 資産別資産割合



● 運用機関別・資産別（速報）

（単位：百万円）

運用機関	期初資産額 平成31年3月31日	国内債券		国内株式		外国債券		外国株式		その他資産		資産合計		
		①資産額	利回り	③資産額	利回り	④資産額	利回り	⑤資産額	利回り	⑥資産額	利回り	⑧資産額	利回り	割合
三菱UFJ信託銀行	3,397	2,961	▲ 0.17	83	▲ 8.36	531	4.29	81	▲ 10.24	65	▲ 0.03	3,721	▲ 0.03	49.7
三井住友信託	509					293	▲ 1.31					293	9.98	3.9
みずほ信託銀行	433			429	0.01							429	0.01	5.7
りそな銀行	529					551	4.81					551	4.81	7.4
朝日ライフアセットマネジメント	1,072									1,086	1.27	1,086	1.27	14.5
アセットマネジメントOne	307			280	▲ 8.84							280	▲ 8.84	3.7
東京海上アセットマネジメント	322			299	▲ 7.12							299	▲ 7.12	4.0
MFSインベストメント	565							497	▲ 12.01			497	▲ 12.01	6.6
アライアンス・ハーンスタイン	349									335	▲ 4.04	335	▲ 4.04	4.5
合 計	7,483	2,961	▲ 0.17	1,090	▲ 4.97	1,375	3.94	578	▲ 5.86	1,486	0.08	7,490	▲ 0.53	100.0
			割合 39.5		割合 14.6		割合 18.4		割合 7.7		割合 19.8			100.0
令和元年度アセットミックス			35.0		16.0		12.0		16.0		21.0			

- ※ 資産合計のベンチマーク 2.00%です。
- ※ 利回りについては時間加重を用いています。
- ※ 百万円未満四捨五入のため「運用機関別（速報）」の合計額と相違する場合があります。
- ※ 令和2年1月30日代議員会にて決定いただいた、ウェリントン（三井住友信託扱い）の解約分の振替によるペリキフォート（三菱UFJ信託扱い）の5億円は、4月からの運用のためこの表に含まれていません。
- ※ ウェリントン解約時点の残余金分は三菱UFJ信託外債（パッシブ）に振替えています。
- ※ ウェリントン解約時までの年度収益率はプラス25.7%です。
- ※ 本年7月に確定する当基金の本年度決算における総資産額には、厚生年金基金からの分配金受入額の残り30%、約30億円を含みますので、収益率は速報値と相違します。