

第1年金・第2年金資産全体

平成28年度資産運用状況(平成28年4月～平成29年3月) 前年度一般勘定当年度配当確定後

円

A	B	C	D	E
平成28年4月1日時点 年金資産額	平成28年4月1日から 平成29年2月28日 の間の掛金からの拠出額 から給付額を引いた額	元本総額 A+B+F(移受換金)	平成28年4月1日から 平成29年2月28日 の間の運用収益 (総合収益)	C+D
36,494,378,176	1,612,087,254	38,106,465,430	1,280,100,676	39,386,566,106

円

	平成29年2月28日	総合収益	期中平均残高	修正総合利回り= 総合収益/期中平均残高
国内債券S01	0	21,032,559	7,064,374,323	0.298%
国内債券S15	13,082,367,375	-151,072,977	6,843,740,941	-2.207%
S57	1,785,620,718	-17,895,225	1,758,474,321	-1.018%
国内株式	5,809,768,341	794,416,930	4,913,902,140	16.167%
外国債券(ヘッジ付)	9,582,078,775	-151,549,379	9,555,889,601	-1.586%
外国株式	6,007,323,686	736,506,254	5,061,724,604	14.551%
その他	44,953,609	-36,991	158,269,134	-0.023%
短期資金	0	0	-13,337,211	0.000%
オルタナティブ	721,121,335	27,177,638	693,943,697	3.916%
住生一般勘定	1,032,662,985	11,678,385	1,020,984,600	1.144%
日生一般勘定	1,020,858,216	11,544,511	1,009,280,577	1.144%
日生特別勘定	299,811,066	-1,701,029	301,545,223	-0.564%
合計	39,386,566,106	1,280,100,676	38,368,791,950	3.336%

月別総合収益

円

	4月	5月	6月	第1四半期TOTAL
国内債券S01	113,303,497	46,650,648	160,572,622	320,526,767
国内債券S15	0	0	0	0
S57	-6,486,640	4,864,980	21,568,078	19,946,418
国内株式	-24,024,186	139,755,510	-469,698,213	-353,966,889
外国債券	-62,784,388	54,595,120	211,556,090	203,366,822
外国株式	-166,413,836	209,648,464	-409,284,474	-366,049,846
その他	125	-904	-3,906	-4,685
短期資金	0	0	0	0
オルタナティブ	-33,743,615	27,696,073	-47,509,274	-53,556,816
住生一般勘定	1,048,957	1,083,922	1,048,957	3,181,836
日生一般勘定	1,036,714	1,071,405	1,036,966	3,145,085
日生特別勘定	-641,801	585,787	250,935	194,921
合計	-178,705,173	485,951,005	-530,462,219	-223,216,387

月間利回り

-0.488%

1.328%

-1.425%

	7月	8月	9月	第2四半期TOTAL
国内債券S01	-106,555,104	-130,973,982	-61,965,122	-299,494,208
国内債券S15	0	0	52,674,458	52,674,458
S57	6,324,474	-2,108,158	-485,825	3,730,491
国内株式	279,608,255	18,622,794	19,630,323	317,861,372
外国債券	64,149,266	-13,648,780	-25,918,942	24,581,544
外国株式	174,865,412	52,346,909	-81,156,468	146,055,853
その他	-2,627	-3,962	-3,351	-9,940
短期資金	0	0	0	0
オルタナティブ	9,895,731	7,222,160	-15,755,926	1,361,965
住生一般勘定	1,083,922	1,083,922	1,048,956	3,216,800
日生一般勘定	1,071,532	1,071,531	1,036,967	3,180,030
日生特別勘定	697,041	111,526	-1,840,187	-1,031,620
合計	431,137,902	-66,276,040	-112,735,117	252,126,745

月間利回り

1.169%

-0.177%

-0.288%

	10月	11月	12月	第3四半期TOTAL
国内債券S01	0	0	0	0
国内債券S15	-26,982,164	-67,455,410	-72,278,523	-166,716,097
S57	-17,483,212	-21,687,230	-2,304,294	-41,474,736
国内株式	268,214,651	294,307,773	198,183,664	760,706,088
外国債券	-181,504,481	-217,070,370	20,142,530	-378,432,321
外国株式	73,940,508	536,702,325	282,517,724	893,160,557
その他	-4,997	-3,545	-4,608	-13,150
短期資金	0	0	0	0
オルタナティブ*	18,954,707	57,745,615	23,885,181	100,585,503
住生一般勘定	1,083,922	1,048,957	1,083,922	3,216,801
日生一般勘定	1,071,531	1,036,966	1,071,532	3,180,029
日生特別勘定	-1,868,069	-139,408	223,053	-1,784,424
合計	135,422,396	584,485,673	452,520,181	1,172,428,250
月間利回り	0.361%	1.544%	1.174%	

	1月	2月	3月	第4四半期TOTAL
国内債券S01	0	0		0
国内債券S15	-71,172,905	34,141,567		-37,031,338
S57	-13,621,976	13,524,578		-97,398
国内株式	26,337,967	43,478,392		69,816,359
外国債券	-89,111,350	88,045,926		-1,065,424
外国株式	-74,953,556	138,293,246		63,339,690
その他	-4,947	-4,269		-9,216
短期資金	0	0		0
オルタナティブ*	-17,291,655	-3,921,359		-21,213,014
住生一般勘定	1,083,922	979,026		2,062,948
日生一般勘定	1,071,532	967,835		2,039,367
日生特別勘定	-1,171,028	2,091,122		920,094
合計	-238,833,996	317,596,064	0	78,762,068
月間利回り	-0.610%	0.812%		

構成比

	残高		A		B	
	平成29年2月28日	構成比	オルタナティブ・一般勘定・特別勘定 除く構成比	政策アセットミックス		
国内債券S01	0	0.00%	0.00%	37.6%		
国内債券S15	13,082,367,375	33.22%	36.03%	0.0%		
S57	1,785,620,718	4.53%	4.92%	5.0%		
国内株式	5,809,768,341	14.75%	16.00%	14.7%		
外国債券	9,582,078,775	24.33%	26.39%	28.0%		
外国株式	6,007,323,686	15.25%	16.54%	14.7%		
その他	44,953,609	0.11%	0.12%	0.0%		
短期資金	0	0.00%	0.00%	0.0%		
オルタナティブ*	721,121,335	1.83%				
住生一般勘定	1,032,662,985	2.62%				
日生一般勘定	1,020,858,216	2.59%				
日生特別勘定	299,811,066	0.76%				
合計	39,386,566,106	100%	100%	100%		

	乖離幅(A-B)
国内債券	-37.6%
国内債券S15	36.0%
S57	-0.1%
国内株式	1.3%
外国債券	-1.6%
外国株式	1.8%
その他	0.1%
短期資金	0.0%
オルタナティブ*	
住生一般勘定期初	
日生一般勘定期初	
日生特別勘定期初	

オルタナ期初	693,943,697
住生一般勘定期初	1,020,984,600
日生一般勘定期初	1,009,132,318
日生特別勘定期初	301,693,482

	元本	
オルタナ・一般勘定以外	35,140,309,243	イ
オルタナ	694,806,895	ロ
住生一般勘定 ^ハ	1,020,984,600	ハ
日生一般勘定 ^ホ	1,009,378,198	ホ
日生特別勘定 ^ヘ	301,447,602	ヘ
合計	38,166,926,538	
前年度特別勘定運用報酬	245,880	5月振替
	上期運用報酬	
オルタナ以外	59,597,910	
オルタナ・投資顧問報酬	683,640	
オルタナ・住信箱代	179,558	
合計	60,461,108	
上期移管(第1契約 →第2契約・オルタナ)	863,198	

35,835,116,138

住生一般勘定	
業務委託費	
運用報酬	
日生一般勘定	
業務委託費	0
運用報酬	
日生特別勘定	
業務委託費	0
運用報酬	

	運用報酬通期計
オルタナ一般勘定以外	59,597,910
オルタナ	863,198
住生一般勘定	0
日生一般勘定	0
日生特別勘定	0
総合計	60,461,108

運用報酬総合計	60,461,108
---------	------------

日付	移受換金F
----	-------

	下期運用報酬
オルタナ以外	
オルタナ・投資顧問報酬	
オルタナ・住信箱代	
合計	0
下期移管(第1契約 →第2契約・オルタナ)	0

国内債券S01/S15+S57(通期)			
平成29年2月28日	総合収益(通期)	期中平均残高(通期)	修正総合利回り(通期) = 総合収益/期中平均残高
14,867,988,093	-147,935,643	15,666,589,585	-0.944%
14,867,988,093	-147,935,643	15,666,589,587	-0.944%
0	0	-2	-0.0

住生+日生		住信+SMAM	
簿価合計	2,331,810,400	簿価合計	35,835,116,138
時価合計	2,353,332,267	時価合計	37,033,233,839

平成28年度資産運用状況(平成28年4月～平成29年3月) 前年度一般勘定当年度配当確定後

	月間修正総合 月間期中平均残高 利回り		月間修正総合 月間期中平均残高 利回り		月間修正総合 月間期中平均残高 利回り	
	4月		5月		6月	
国内債券S01	12,866,807,320	0.881%	12,979,452,441	0.359%	13,016,741,906	1.234%
国内債券S15	0	#DIV/0!	0	#DIV/0!	0	#DIV/0!
S57	1,750,581,970	-0.371%	1,744,095,330	0.279%	1,748,960,310	1.233%
国内株式	4,671,219,612	-0.514%	4,701,641,301	2.972%	4,910,719,975	-9.565%
外国債券	9,498,868,441	-0.661%	9,436,084,053	0.579%	9,490,679,173	2.229%
外国株式	4,697,708,404	-3.542%	4,617,189,856	4.541%	4,896,799,190	-8.358%
その他	152,148,232	0.000%	134,594,038	-0.001%	152,498,364	-0.003%
短期資金	-10,167,240	0.000%	-6,939,296	0.000%	-20,121,741	0.000%
オルタナティブ	693,943,697	-4.863%	660,200,082	4.195%	687,896,155	-6.906%
住生一般勘定	1,021,526,561	0.103%	1,022,593,000	0.106%	1,023,659,440	0.102%
日生一般勘定	1,009,603,460	0.103%	1,010,784,395	0.106%	1,011,957,590	0.102%
日生特別勘定	301,757,975	-0.213%	300,989,132	0.195%	301,456,081	0.083%
合計	36,653,998,432	-0.488%	36,600,684,332	1.328%	37,221,246,443	-1.425%

	月間修正総合 月間期中平均残高 利回り		月間修正総合 月間期中平均残高 利回り		月間修正総合 月間期中平均残高 利回り	
	7月		8月		9月	
国内債券S01	13,177,314,528	-0.809%	13,070,759,424	-1.002%	3,774,547,195	-1.642%
国内債券S15	0	#DIV/0!	0	#DIV/0!	10,749,992,270	0.490%
S57	1,770,528,388	0.357%	1,776,852,862	-0.119%	1,774,714,022	-0.027%
国内株式	4,532,328,816	6.169%	4,874,636,824	0.382%	4,916,927,427	0.399%
外国債券	9,702,235,263	0.661%	9,766,384,529	-0.140%	9,752,204,249	-0.266%
外国株式	4,538,512,458	3.853%	4,824,921,439	1.085%	4,986,825,416	-1.627%
その他	194,101,861	-0.001%	155,199,205	-0.003%	187,405,491	-0.002%
短期資金	-10,284,348	0.000%	-10,730,595	0.000%	-17,239,376	0.000%
オルタナティブ	640,386,881	1.545%	650,282,612	1.111%	657,504,772	-2.396%
住生一般勘定	1,024,725,879	0.106%	1,025,809,801	0.106%	1,026,876,241	0.102%
日生一般勘定	1,013,011,839	0.106%	1,014,083,370	0.106%	1,015,137,619	0.102%
日生特別勘定	301,707,016	0.231%	302,404,057	0.037%	302,487,826	-0.608%
合計	36,884,568,581	1.169%	37,450,603,528	-0.177%	39,127,383,152	-0.288%

	月間修正総合 月間期中平均残高 利回り		月間修正総合 月間期中平均残高 利回り		月間修正総合 月間期中平均残高 利回り	
	10月		11月		12月	
国内債券S01	0	0.000%	0	0.000%	0	0.000%
国内債券S15	12,952,665,182	-0.208%	12,925,683,018	-0.522%	12,910,173,307	-0.560%
S57	1,771,269,838	-0.987%	1,753,266,885	-1.237%	1,745,472,724	-0.132%
国内株式	4,958,905,566	5.409%	5,247,460,545	5.609%	5,541,768,318	3.576%
外国債券	9,727,116,149	-1.866%	9,627,265,523	-2.255%	9,494,771,900	0.212%
外国株式	4,996,114,090	1.480%	5,127,681,270	10.467%	5,663,908,067	4.988%
その他	136,058,834	-0.004%	177,993,489	-0.002%	151,051,763	-0.003%
短期資金	-9,846,121	0.000%	-21,144,186	0.000%	-11,346,695	0.000%
オルタナティブ	641,748,846	2.954%	660,703,553	8.740%	718,449,168	3.325%
住生一般勘定	1,027,942,680	0.105%	1,029,009,119	0.102%	1,030,075,559	0.105%
日生一般勘定	1,016,191,868	0.105%	1,017,246,117	0.102%	1,018,300,366	0.105%
日生特別勘定	300,675,396	-0.621%	298,807,327	-0.047%	298,667,919	0.075%
合計	37,518,842,328	0.361%	37,843,972,660	1.544%	38,561,292,396	1.174%

	月間修正総合 月間期中平均残高 利回り		月間修正総合 月間期中平均残高 利回り		月間修正総合 月間期中平均残高 利回り	
	1月		2月		3月	
国内債券S01	0	0.000%	0	0.000%		0.000%
国内債券S15	12,968,496,599	-0.549%	13,005,555,376	0.263%		#DIV/0!
S57	1,767,265,441	-0.771%	1,769,413,395	0.764%		#DIV/0!
国内株式	5,739,951,982	0.459%	5,766,289,949	0.754%		#DIV/0!
外国債券	9,525,199,897	-0.936%	9,468,058,674	0.930%		#DIV/0!
外国株式	5,945,922,312	-1.261%	5,869,030,440	2.356%		#DIV/0!
その他	141,620,872	-0.003%	159,610,113	-0.003%		#DIV/0!
短期資金	-11,304,426	0.000%	-18,587,724	0.000%		#DIV/0!
オルタナティブ	742,334,349	-2.329%	725,042,694	-0.541%		#DIV/0!
住生一般勘定	1,031,159,481	0.105%	1,032,190,955	0.095%		#DIV/0!
日生一般勘定	1,019,371,898	0.105%	1,020,391,581	0.095%		#DIV/0!
日生特別勘定	298,890,972	-0.392%	297,719,944	0.702%		#DIV/0!
合計	39,168,909,377	-0.610%	39,094,715,397	0.812%	0	#DIV/0!