

# 基金情報

No. 63

平成19年4月号

発行：東日本硝子業厚生年金基金  
〒130-0026 東京都墨田区両国4丁目36番6号 ガラス会館3階  
Tel 03-3633-6445 FAX 03-3633-7125  
ホームページ <http://www.glskkn.com>

## 平成18年度・主要事業概況

事項	3月末数	対前月増減数	事項	3月末数(累計)	
事業所数(件)	244	-1	年金掛金	調定額(円) 1,889,109,482	
加入員数(人)	男子	5,317	-27	収納額(円)	1,876,912,376
	女子	2,181	-61	収納率	99.35%
	計	7,498	-88	事務費掛金調定額(円)	78,964,704
平均標準給与月額(円)	男子	344,408	-590	資産運用	信託資産額(時価) 368億6,746万円
	女子	227,685	1,299		修正総合利回り 6.63%
	計	310,456	513		ベンチマーク差 1.72%
受給者数(人)	5,526	14	慶弔金の支給件数・金額	85件147万円	
平均年金額(円)	475,578	775	年金相談件数	1,086件	

## 平成18年度資産運用結果がまとまりました

### 修正総合利回り6.63%に

#### 4年連続のプラス利回り 外貨建資産が寄与

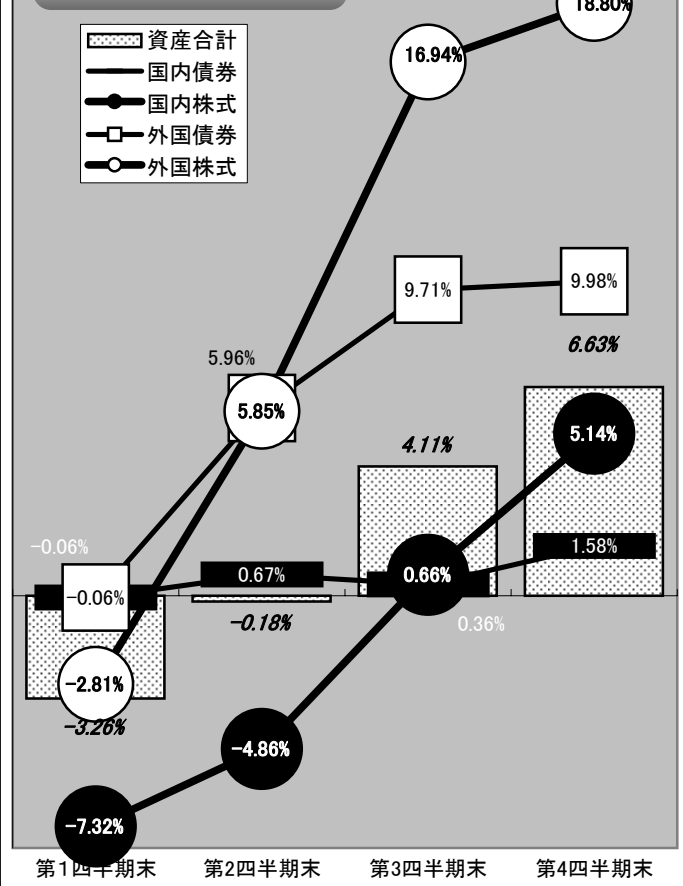
当基金の平成18年度(平成19年3月末)の運用結果は、修正総合利回り6.63%と4年連続のプラスで、年金資産時価総額は、368億円超となりました。

平成18年度の市場のインデックス(ベンチマーク)は、いずれの資産ともプラスで、なかでも外貨建資産が2ケタの伸びを示し、平均収益率の水準を押し上げました。外国株式のベンチマークは、原油価格の調整、米国経済の軟着陸期待の高まり、活発な企業合併・買収の報道などを背景に17.85%上昇しました。外国債券は、米国では金融引き締め懸念の後退などから金利は若干低下、欧州ではECBの利上げで水準が徐々に上がりましたが、ユーロ高やポンド高といった為替効果が大きく寄与し10.24%の上昇となりました。

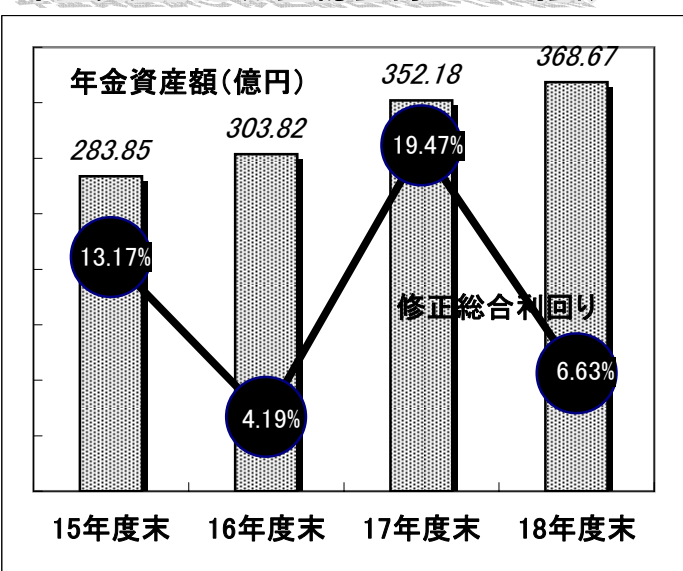
格付投資情報センター(R&I)の運用対象サービスの対象となっている厚生年金基金、企業年金基金、税制適格年金等の平成18年度の平均収益率(推計)は、4.45%で、それを上回る結果となりました。

R&Iの評価対象基金の内訳は、中小企業等が集まり設立された「総合型」厚生年金基金が3分の1で、企業年金基金、税制適格年金が3分の2となっています。平均収益率(推計)は、「総合型」厚生年金基金が、5.13%、企業年金基金等が4.32%となっています。

## 年金資産の運用状況 修正総合利回り <平成18年度>



## 年金資産額と修正総合利回りの推移



## 5月の事業予定

- 5月10日 代議員選挙
- 5月15日 運用業務報告書提出
- 5月16日 理事選挙
- 5月23日 理事長選挙
- 5月23日 資産運用委員会

### 【お願い】

当「基金情報」を加入員の方々が閲覧いただけるようご配慮方お願いいたします

### ホームページでもご覧いただけます

当「基金情報」をホームページに掲載しています  
創刊号から直近号までご覧いただけます  
加入員の方も職場や家庭でぜひお読みください  
<http://www.glskkn.com>

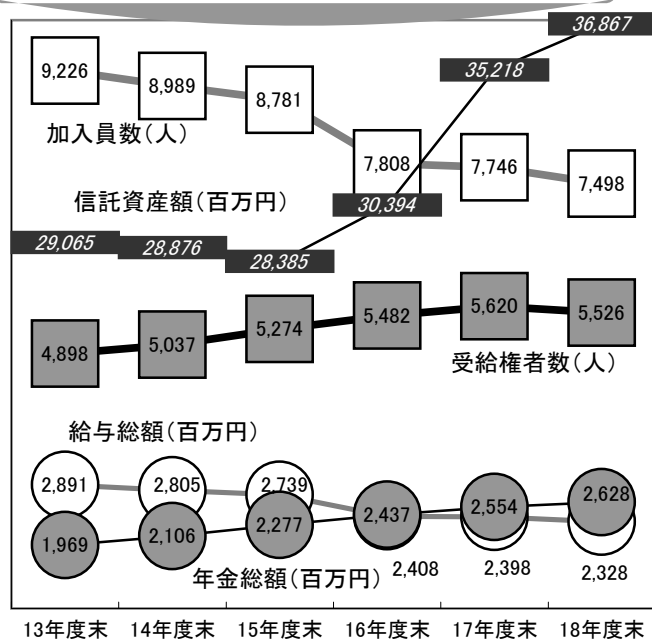
## 運用実績表(平成18年度)

受託機関名	時価総額	評価損益額	評価損益率	修正総合利回	複合ベンチマーク	ベンチマーク差
りそな信託	14,399,058,608円	2,193,976,112円	17.98%	4.17%	4.65%	-0.48%
みずほ信託	2,478,092,819円	14,343,764円	0.58%	1.45%	2.17%	-0.72%
三井アセット信託	3,245,042,382円	1,456,645,166円	81.45%	4.36%	0.29%	4.07%
三菱UFJ信託	3,716,321,426円	682,418,974円	22.49%	20.58%	2.99%	17.59%
シュローダー	1,843,076,563円	236,794,079円	14.74%	-5.03%	0.29%	-5.32%
大和住銀	4,451,745,067円	1,963,470,067円	78.91%	2.70%	0.91%	1.79%
東京海上	1,317,628,499円	17,628,322円	1.36%	2.88%	2.17%	0.71%
ニッセイアセット	3,112,078,829円	322,019,786円	11.54%	21.21%	17.85%	3.36%
パークレイズ	2,304,413,220円	804,402,039円	53.63%	17.48%	17.85%	-0.37%
合計	36,867,457,413円	7,691,698,309円	26.36%	6.63%	4.91%	1.72%

## 受託機関別アセットアロケーション

アセットアロケーション	受託機関	シェア	
パッシブコア	バランス (内債：35 内株20 外債17 外株14 その他14)	りそな信託銀行 35%	
特化型 (アクティブ運用)	国内債券 (債券代替)	変動利付国債	りそな信託銀行 5%
		物価連動国際	りそな信託銀行 3%
		為替アルファ型	三菱UFJ信託銀行 7%
		ファンドオブ・ヘッジファンズ	みずほ信託銀行 5%
		クレジットスプレッド戦略	みずほ信託銀行 5%
		TMAロングショート	東京海上アセットマネジメント投信 5%
		日本株LSニュートラルF1	大和住銀投信投資顧問 3%
	国内株式 (株式代替)	リサーチ市場型	三井アセット信託銀行 3%
		クオンツ市場型	三井アセット信託銀行 3%
		成長型	シュローダー投信投資顧問 3%
		割安型	大和住銀投信投資顧問 6%
	外国債券	J-REIT	三菱UFJ信託銀行 3%
	アクティブファンド(PIMCO)	三菱UFJ信託銀行 2%	
	外国株式	市場型	パークレイズ・グローバルインバスター 6%
割安型		ニッセイアセットマネジメント 6%	

## 主要事業の推移



## 設立事業所の異動(規約変更関係等)・3月処理分

異動区分	事業所名	異動内容(新)	適用年月日
事業所削除	ビルキントンスペシャルグラス㈱	閉鎖	H19.3.31
事業主変更	玉井工業硝子(株)	福島 隆	H19.3.1
事業主変更	寿特殊硝子(株)	飯田 圭輔	H19.1.1

## 基金関連・動向と状況

平成19年4月分より当基金の掛金率  
が変更となりました。

平成19年4月分より、当基金の掛金率が変更となりました。今年度は段階的引上げの最終年度にあたります。特別掛金2.4%→2.7%、合計6.8%→7.1%に変更されました。

## 基金用語

## 【 加入員 】

厚生年金基金の設立事業所に使用される厚生年金の被保険者(第4種被保険者を除く。)をいいます。

すなわち、厚生年金保険の適用事業所が基金に加入して設立事業所となった以後については、その事業所に使用される被保険者は、当然に基金の加入員とされます。

なお、第4種被保険者については、事業主が保険料の負担義務を負わないため、基金の加入員とはなりません。また、加入員の資格を取得した月に資格を喪失した場合は、取得に遡って加入員でなかったものとみなされます。