

基金情報

No. 1

平成14年5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 TEL03-3633-6445

ホームページ <http://www.jade.dti.ne.jp/~glskkn/>

主要事業概況		平成14年4月末現在	対前月増減数
事業所数(件)		277	0
加入員数(人)	男子	6,809	279
	女子	2,873	177
	計	9,682	456
受給者数(人)	男子	3,226	16
	女子	1,689	1
	計	4,915	17
平均年金額(円)		404,223	2,264
年金資産額(円)		30,197,998,783	-158,643,830
修正総合利回り(%)		-1.01	3.00

65歳以上従業員の基金適用はじまる

65歳以上加入員225名

65歳以上加入員・適用状況

平成14年4月末現在

平成12年の厚生年金保険法の一部改正によって、平成14年4月1日から、65歳以上70歳未満の従業員の方も厚生年金の被保険者となることとなりました。これらの方々は、同時に、厚生年金基金にも加入することとなっています。

この4月に、新たに当基金の加入員となられた65歳以上の方々は、全事業所の半数に近い129の事業所において、計225名(1事業所当り1.7人)となっています。

この結果、平成14年4月末における加入員数は、新規採用者などと合せますと、対前月増減数で、昨年度より190名程度多い、456名の増加となり、合計加入員数では9,682名となっています。

加入員数(人)		平均標準給与月額(円)
男子	181	373,282
女子	44	308,636
計	225	360,640
事業所数	129事業所	

資産運用計画を集約

平成12年度の年金資産の運用は、基金制度始めて以来のマイナス(当基金・修正総合利回り-9.42%)という状況でしたが、平成13年度においても引き続きマイナス(当基金・修正総合利回り-4.01%)と、2年連続した最悪の運用状況でした。

この結果、年金資産の減少・積立不足の増大等基金の事業運営はもとより財政状況は、極めて厳しいものとなっています。

資産運用の受託機関各社は、平成14年度の年金資産運用計画において、格差はあるものの、運用環境が改善されるとの見方のもとに、一定の期待収益率(リターン)が得られることを予想しています。

年金資産の運用を委託している7社の年金資産運用計画に基づき、平成14年度の当基金の期待収益率を推計しますと、5.88%が見込まれます。

期待収益率 5.88%!

期待収益率 5.88% は、年金数理計算上の予定利率5.5%を上回るものですが、運用コスト等を考慮しますと、年金給付に必要な十分な資産の積立に不足します。より高い収益率結果を期待したいところです。

平成14年度・受託機関の年金資産運用計画

	市場予想				期待収益(リターン)率(%) ()内はリスク						計	
	国内債券	国内株式	外国債券	外国株式	国内債券	国内株式	外国債券	外国株式	短期資産	構成加重		シェア加重
	10年国債(%)	日経平均(円)	米10年国債(%)	NYダウ(円)								
大和銀行	1.8	12,500	5.4	11,500	0.4 (4.5)	9.8 (24.6)	2.7 (13.4)	9.6 (22.4)	0.0 (2.2)	4.52	2.22	
みずほ銀行	1.7	13,500	6.2	13,250	0.4 (3.9)	17.8 (22.4)	8.4 (14.5)	25.1 (19.2)	0.2 (1.0)	9.56	1.05	
UFJ銀行	1.5	—	5.3	10,500	0.2 (2.2)	—	4.1 (12.1)	10.6 (17.0)	0.0 (0.0)	2.32	0.46	
シュローター 投信投資顧問	—	12,000	—	—	—	9.0 (18.3)	—	—	0.0 (0.1)	8.91	0.54	
日興アセット マネジメント	—	12,500	—	—	—	11.5 (17.9)	—	—	0.0 (0.9)	11.36	0.68	
明治トレスナー アセットマネジメント	—	—	—	11,500	—	—	—	14.7 (19.2)	0.0 (0.1)	14.26	0.57	
ニッセイアセット マネジメント	—	—	—	11,150	—	—	—	9.2 (16.8)	0.0 (0.4)	9.03	0.36	
											5.88	

*市場予想は年度末の予想中央値です。

*期待収益率における資産別のリターン及びリスクは各受託機関の標準型運用におけるものです。

*期待収益率の計「構成加重」は各受託機関における資産構成割合をもって、「シェア加重」は各受託機関への資産配分(シェア)割合をもってそれぞれ加重修正したものです。

業務概況の周知が義務化

加入員への周知

— 基金だよりによる周知と 監事監査規程の変更 —

加入員に対する業務概況の周知については、本年度から、年4回発行している「基金だより」に周知事項を逐次掲載して行うこととします。

また、年金受給者についても、「受給者だより」によって周知に努めることとしています。

なお、基金の規約や予算・決算、事業の概要などは、当基金のホームページで見ることができます。

確定給付企業年金法の施行に伴い、厚生年金基金関連法令の一部が改正され、基金の業務概況を加入員に周知することが義務付けられました。また、監事監査の監査事項に業務概況の周知に関する事項が加えられました。

監査事項の追加

業務概況の周知に関する監査事項の追加については、「東日本硝子業厚生年金基金監事監査規程」の一部を変更することとしました。

また、本年度の監事監査から周知事項を対象とした監査の実施をお願いすることとしています。

業務概況の周知事項(年1回以上周知)

規約
給付の額及び設計
加入員数及び受給者数並びに支給額及び支給概況
徴収掛金及び徴収金の額並びに徴収時期及び徴収概況
積立金の額、責任準備金の額及び最低積立基準額との比較その他積立の概況
運用収益・運用損失、資産の構成割合その他運用の概況並びに運用の基本方針の概要
基本方針その他事業に係る重要事項

辻会計事務所が合併・法人化

辻・本郷税理士法人としてスタート

当基金は、経理関係監査について、公認会計士辻会計事務所と顧問契約を結んでいます。

この辻会計事務所は、平成14年4月1日本郷公認会計士事務所と合併し、法人化を図った新たな「辻・本郷税理士法人」を設立しました。

当基金は、引き続き同法人に毎月の監査を委託していくこととしています。

年金資産運用委員会の開催

第28回年金資産運用委員会が平成5月28日ガラス会館にて開催されました。

議事事項は、次のとおりで、年金資産の運用の評価・確認、今後の運用への検討などの審議が行われました。

- 1 平成13年度の年金資産の運用結果
- 2 平成14年度の運用計画
- 3 平成14年度(4月末)の年金資産の運用状況
- 4 今後の運用方針

財政運営委員会の開催

第18回財政運営委員会が年金資産運用委員会に引続き開催されました。

当日の議事内容は、確定給付企業年金法の施行に伴い、昨年から本年にかけて改正された厚生年金基金関連法令に係る措置への対応でした。

財政運営委員会における時宜事項と審議結果の概要は、次のとおりです。

資産・財政の両委員会開催

大和銀信の格付けは

「A-」

(3/1・日本格付研究所・長期優先債務)

大和銀信託銀行・営業開始

大和銀行は年金・法人信託部門を分社化し、大和銀信託銀行株式会社(社長:黒石 輯)を設立していましたが、平成14年3月1日から大和銀信託銀行の営業が開始されました。

これに伴い、当基金の年金資産運用(一部)を大和銀行から大和銀信託銀行に移行することとなり、所定の変更の手続きを済ませました。

また、分社化とともに、業務提携先が検討されていましたが、平成14年3月22日フランス最大のリテールバンクであるクレディ・アグリコルS.A.と資本提携・業務提携の合意に達しています。

厚生労働省の監査 本年10月に予定

厚生労働省関東信越厚生局は、当基金の事業全般にわたる監査を本年10月(予定)に実施する旨通知してきました。

具体的な日時・監査官等は、現在不明ですが、丸一日年金資産の運用状況等を中心に監査が実施されることが想定されています。