

# 基金情報

No. 40 平成17年6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17年度・主要事業概況					
事項	5月末数	対前月増減数	事項	5月末数(累計)	
事業所数(件)	249	-1	年金掛金	調定額(円) 120,148,812	
加入員数(人)	男子	5,516	-11	収納額(円)	119,172,242
	女子	2,328	-10	収納率	99.19%
	計	7,844	-21	事務費掛金調定額(円)	7,229,928
平均標準給与月額(円)	男子	341,718	-140	資産運用	信託資産額 298億58百万円
	女子	222,131	-240		修正総合利回り -1.00%
	計	306,226	-112		ベンチマーク差 -0.57%
受給者数(人)	5,533	16	慶弔金	16件 34万円	
平均年金額(円)	447,745	311	保養所利用者数	331人	

## 資産運用委員会 運用体系の一部見直し案を取りまとめへ

平成17年6月28日に第47回年金資産運用委員会・第34回財政運営委員会が開催されました。  
 年金資産運用委員会においては、前回に引き続き、資産運用の効率化に向けての審議が行われ、大和総研の意見や受託機関の提案についての聴取も行われました。  
 また、財政運営委員会においては、昨年の年金制度の改正による年金ポータビリティの拡充や保養所の廃止に関する審議が行われました。

### 国内の債券と株式運用を効率化

年金資産運用委員会は、今年度中を目途とした資産運用の見直しの検討を行っています。しかし、今年度、収益が得られないあるいはマイナスと見込まれている国内債券や、依然としてパフォーマンスが低迷しているヘッジファンドと市場型国内株式については、当面、運用スタイルの分散化などにより効率化を図ることとしました。  
 国内債券については、市場並みの収益を目指すパッシブファンドを分散させ、変動利付国債と物価連動国債ファンドを組合せる案が、ヘッジファンドについては、クレジットスプレッド戦略ファンドを組合せる案が浮上しています。  
 また、国内株式については、市場型ファンドに同じ市場型ですがクオンツタイプのファンドを組合せる案があります。  
 これらは、基本的な資産構成や受託機関シェアなどを変更せずに行うもので、最終的な委員のご意見を早急にまとめ、7月から変更することが予定されています。

### みずほ信託の日本債券が アジアインベスター誌より表彰

さる4月、香港を中心とするアジア圏の投資家向け大手雑誌である「アジアインベスター」誌は、2004年のパフォーマンス部門にみずほ信託の「国内債券アクティブファンド」を選定し、表彰しました。  
 また、T&Dアセットマネジメントの日本債券やピムコ社とフィッシャーフランス社のグローバル債券も同時に表彰されています。

### 平成16年人口動態統計を発表 出生率1.29

厚生労働省は、6月1日に平成16年の人口動態統計(概数)を発表しました。  
 これによる「特殊出生率」(1人の女性が一生に生む子供の数)は、前年と同率の1.29となっています。  
 しかし、出生数では、前年よりも12,775人少なく、111万835人となっています。  
 また、年齢階級別でも変化が生じています。  
 29歳以下・・・前年に引き続き低下(32,280人減)  
 30歳以上・・・30～34歳が上昇に転じ、35歳以上は引き続き上昇(30歳以上は19,507人増加)  
 自然増加数(出生と死亡の差)は、82,127人と初めて10万人を割っています。  
 死亡数は、102万8,708人で13,757人の増加となっています。

### 在職年金の2割停止を解除

65歳未満で在職中に年金を受けている方については、一律に年金額の2割が支給停止されていました。  
 この2割の支給停止は、平成16年の年金制度の改正により、平成17年4月1日から廃止されました。  
 これに伴い、先般、当基金の在職年金受給者のうち、該当の159人の方の2割支給停止の解除を行ったところです。

## 基金関連・動向と状況

### 財政運営委員会

#### 年金ポータビリティと保養所問題を審議

財政運営委員会では、年金ポータビリティでの問題点の整理や保養所の廃止への検討が進められ、ポータビリティにおいては他の基金なり企業年金給付の受入れは困難である旨の概ねの意見集約が図られました。  
 また、保養所問題については、売却への依頼に着手することでの意見がまとまりました。

### 選定代議員に 山本喜夫氏を選任

さる2月9日の植野清代議員の退任により欠員となっていました選定代議員に、目黒化工(株)取締役総務部長の山本喜夫氏を選任することとなりました。

### 鮭延俊一理事が退任

当基金の理事・代議員としてご活躍いただきました目黒化工(株)常務取締役の鮭延俊一様は、平成17年6月22日同社の役員をご退任にられました。  
 これに伴い、当基金の理事・代議員の職も退任することとなりました。  
 鮭延俊一様には、理事・代議員の他、年金資産運用委員会及び財政運営委員会の委員としてもお骨折りをいただき、年金制度・基金制度の転換期やかかってない資産運用の低迷期において、適切なお意見などを賜り、基金の円滑な事業運営にご貢献いただきました。  
 今後のご活躍とご健勝を祈念いたしたいと存じます。

### 三井アセット信託・新たな中小型株ファンドを立ち上げ

三井アセット信託は、さる5月、運用対象の多様化により幅広い顧客のニーズに応えるため、2タイプの企業年金向けの中小型国内株ファンドを立ち上げました。  
 1つは、「日本株式リサーチ中小型ファンド」  
 成長性・収益性判断の40～80銘柄構成 利回り目標：年5～10%  
 2つは、「日本株式クオンツ小型ファンド」  
 成長性・割安判断の100～200銘柄構成 超過収益目標：4%程度

### 厚生年金基金の総幹事数 信託・生保とも大幅減

厚生年金基金数は、解散や代行返上などにより大幅に減少していますが、これに伴い、年金資産運用を行う受託機関の窓口である総幹事数社の数も激減しています。  
 R&Iの調べによると、平成16年度末の総幹事数(総幹事任命基金数)は835であり、前年度末比511(38%)の減となっています。  
 総幹事数は、減少率が低かったりそな信託銀行が前年度に引続き首位を確保していますが、他の信託銀行や生保会社の減少率は3～5割程度と高い状況にあります。

基金の平成16年度末・総幹事数

総幹事 信託・生保	総幹 事数	前年度末比 件数	割合
りそな信託	155	-42	-21.3%
三井アセット	106	-74	-41.1%
三菱信託	104	-69	-49.9%
みずほ信託	99	-74	-42.8%
UFJ信託	93	-64	-40.8%
住友信託	61	-53	-46.5%
第一生命	78	-35	-31.0%
日本生命	62	-45	-42.1%
住友生命	31	-18	-36.7%
明治安田	28	-27	-49.1%
三井生命	8	-9	-52.9%
大同生命	6	0	0.0%
富国生命	4	0	0.0%
T&D生命	0	-1	-100.0%

## 平成16年度の事業結果 《 ③ 掛金の収納状況 》

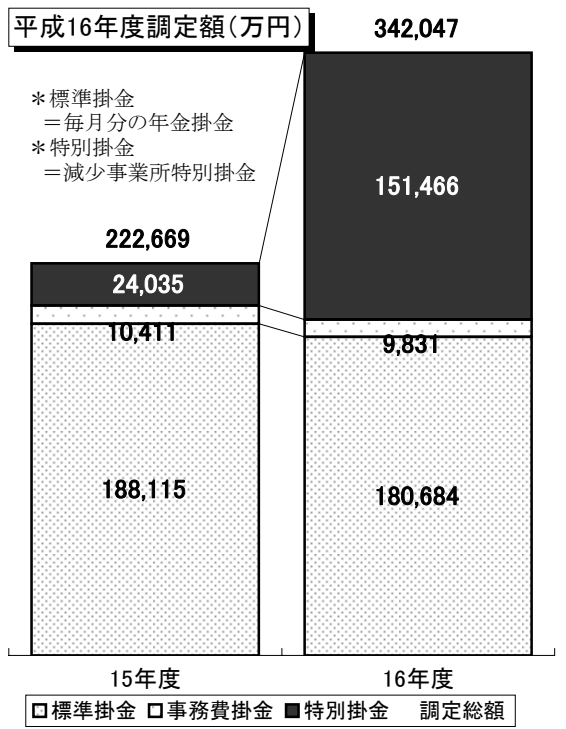
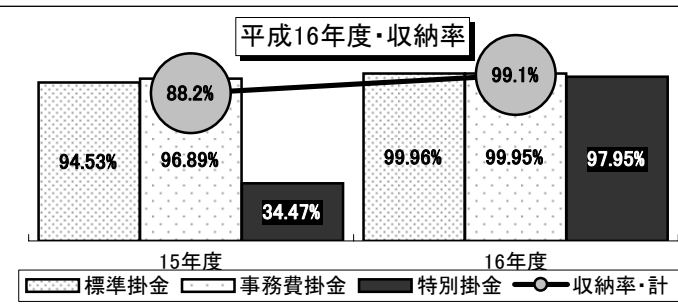
### 収納率は減少事業所特別掛金が引下げ

平成16年度における調定総額は、34億2,047万円となっています。調定総額は、前年度比11億9,378万円の増となっていますが、これは減少事業所特別掛金の増加に伴うもので、毎月分の掛金対比では8,000万円程度の減となっています。

一方、調定額に対する収納率は、99.1%（収納総額33億8,831万円）に及び、また向上が図られています。未収金は、前年度比2,317万円の増となり、平成16年度末で3,216万円となっています。

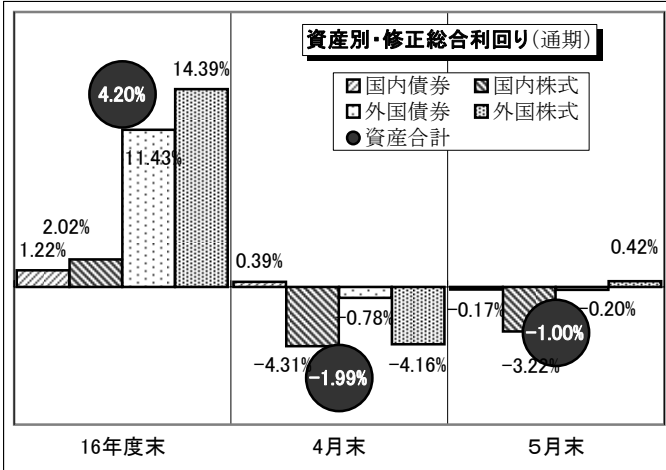
この未収金の97%に当たる3,111万円は減少事業所特別掛金の未収金であり、減少事業所特別掛金の収納率は毎月分の掛金に対するものより劣後しています。

なお、前年度以前の繰越額を含む調定総額（平成16年度要収納対象分）は、37億2,376万円で、これに対する収納率は91.11%となっています。



「お問い合わせ」コーナーに「基金情報」を加入員の方々が

## 年金資産の運用状況・速報 <平成17年度>



### 【5月の市場概況】

内債：一時上昇も、低調な内株動向などを背景に1.2%台で推移  
内株：米株市場の戻りやGDP予想上回りで景気減速懸念後退から反発  
外債：消費者物価指数予想が下回り利上げ加速懸念後退等で低下基調  
外株：出遅れ感のテクノロジーや金融等が買われ株式市場は戻り歩調

### 納期内納入9割・督促13件/月

平成16年度における調定件数（告知事業所数）は月平均258件で、未納事業所に対する督促状の発行件数は月平均13件となっています。

納入の告知や督促による納入状況は、納付期限内に納付していただいた事業所数は233件（90.3%）で、督促による指定期限までの納入件数を加えますと251件（97.2%）にのぼっています。

残る未納事業所7件（2.8%）については、書面や電話などによる督促を行っています。この督促件数は月平均18.5件となっており、未納事業所1件に対し平均2.6回の督促を行ったこととなります。

このほか、倒産事業所などの未納分に対し、厚生労働大臣の認可を受け、3件の滞納処分（交付要求）を行っています。

### 倒産などによる減少事業所特別掛金の収納率・低

減少事業所特別掛金の調定や収納状況は、年度内における減少事業所数やその減少事由などによって異なっています。

調定額は、減少事業所数やその加入員数の多寡などによって大きな差が生じます。

また、収納額や率は、減少事由（任意脱退と倒産など）によって極端な差が生じます。

平成16年度における減少事業所特別掛金の調定額は、15億1,466万円余となっています。これに対する収納額は、14億8,355万円余であり、収納率は97.95%と2%程度の未収が生じています。

その未収は、倒産事業所に対するものであり、任意脱退の収納率100%に比し極めて収納率は低いか収納が不可といえ、全体の収納率を低めています。

### 減少事業所特別掛金の調定・収納状況

	14年度			15年度			16年度		
	任脱	倒産	計	任脱	倒産	計	任脱	倒産	計
調定額	24	0	24	0	24	24	148	3	151
収納額	24	0	24	0	8	8	148	0	148
収納率	100	0	100	0	34	34	100	0	98

金額単位：千円 収納率＝%

任意脱退による減少事業所特別掛金は、納付が脱退の条件でもあり、常に100%の収納となっています。

過去3年度の収納状況は、倒産等のある年度（15・16年度）の収納率は低く抑えられています。

### 7月の事業予定

- 27日 年金資産運用委員会・財政運営委員会の開催
- 27日 理事会の開催
- 下旬～ 第1四半期の運用状況ヒヤリング
- 29日 第1四半期・業務報告書の厚生労働大臣あて提出

決算代議員会は9月12日に開催が予定されています

### 基金用語

### 【 総幹事 】

総幹事〔総幹事会社〕とは、複数の受託機関を取りまとめる役割をする信託銀行または生命保険会社をいいます。

厚生年金基金が複数の受託機関と信託契約や保険契約を結び、基金の運用管理を委ねる場合に、各受託機関への年金給付の指示などを総幹事を窓口として行う仕組みが採られています。

これを総幹事制といい、基金は受託機関のなかの一社を選び、総幹事会社に任命することとなっています。

当基金においては「りそな信託銀行」を総幹事として任命しています。

総幹事は、年金資産の運用以外の制度の管理・運用業務なども統括します。