

# 2011年度 決算内容のお知らせ

代議員会(2012年6月28日開催)において2011年度決算が承認されましたので、内容をお知らせします。

## 2011年度 決算概要

[損益計算書] 期間中の年金・一時金の支払いや掛金収入、年金資産の運用結果による収支を示しています。

(単位: 億円)

| 支 出          | 2011年度 | 2010年度 | 収 入     | 2011年度 | 2010年度 |
|--------------|--------|--------|---------|--------|--------|
| 給付費          | 626    | 590    | 掛金      | 758    | 659    |
| (年金)         | (443)  | (435)  | (標準)    | (234)  | (224)  |
| (一時金)        | (183)  | (155)  | (特別)    | (330)  | (332)  |
| 移換金等         | 24     | 21     | (特例)    | (194)  | (103)  |
| 数理債務増加額      | 0      | 325    | 受換金等    | 4      | 385    |
| 未償却過去勤務債務減少額 | 228    | 186    | 数理債務減少額 | 118    | 0      |
| 運用報酬等        | 16     | 16     | 運用収益    | 176    | 58     |
| 当年度剰余金       | 162    | 0      | 当年度不足金  | 0      | 36     |
| 合 計          | 1,056  | 1,138  | 合 計     | 1,056  | 1,138  |

[貸借対照表] 年度末(3月末)の基金の資産及び負債の状況を示しています。

(単位: 億円)

| 資 産          | 2011年度 | 2010年度 | 負 債    | 2011年度 | 2010年度 |
|--------------|--------|--------|--------|--------|--------|
| 流動資産         | 225    | 618    | 流動負債等  | 93     | 85     |
| 固定資産(運用資産)   | 6,744  | 6,071  | 数理債務   | 9,803  | 9,921  |
| 未償却過去勤務債務残高等 | 2,834  | 3,062  | 別途積立金  | 0      | 0      |
| 繰越不足金        | 255    | 219    | 当年度剰余金 | 162    | 0      |
| 当年度不足金       | 0      | 36     |        |        |        |
| 合 計          | 10,058 | 10,006 | 合 計    | 10,058 | 10,006 |

## 2011年度の 財政検証

法令に基づき毎決算時に基金財政が健全な状態にあるか、「継続基準」「非継続基準」の2つの観点で実施することが義務付けられています。

### [継続基準による検証]

基金を継続して運営する上で必要となる債務(数理債務)に対し、年金資産の積立状況を検証するものです。基準に抵触した場合は掛金の見直しを行います。

➡ 2011年度末は検証の結果、掛金の見直しは不要となりました。

### [非継続基準による検証]

基金が解散すると仮定した場合に必要となる額(最低積立基準額)に対し、年金資産の積立状況を検証するものです。基準に抵触した場合は掛金の追加拠出の義務が発生します。

➡ 2011年度末は検証の結果、掛金追加拠出の義務は発生しませんでした。



2011年度は、厳しい経済環境の下、資産運用においては目標に達しませんが、会社からの追加掛金の拠出等により、当年度剰余金を確保する決算となりました。

引き続き資産運用におけるリスク抑制を図るなど、中長期的に財政健全化に向けた取組みを継続して実施します。



## 市場動向と当基金の運用結果

2011年度の資産運用環境は、欧州の財政問題や円高など厳しい状況が続き、内外株式市場など低調に推移しましたが、年明けから各国の追加金融緩和等を受け、内外株価は上昇基調に転じました。その結果、当基金全体の運用利回りは2.7%、年金資産残高は、6,744億円となりました。

[資産区分別市場利回り]

| 資産種類 | 2011年度 | 2010年度 |
|------|--------|--------|
| 国内株式 | 0.6%   | -9.2%  |
| 外国株式 | 0.5%   | 2.4%   |
| 国内債券 | 3.1%   | 2.0%   |
| 外国債券 | 5.0%   | -7.5%  |



[当基金の運用利回り推移 (2003年度～2011年度)]

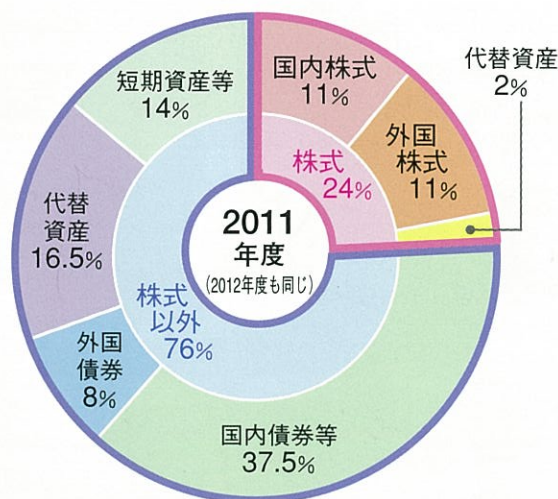


## 当基金の政策的資産構成割合

当基金では、制度運営・維持に必要な運用利回り(3.5%)を達成するため、「政策的資産構成割合」を策定のうえ各資産に分散投資し、リスク管理を図りながら、安定的な運用をめざしています。

当基金の2011年度の政策的資産構成割合は、右図の通り、株式資産が24%、株式以外の資産が76%です。リスク抑制を図るため、安定的に収受できる利息や配当収入を重視しており、国内債券等の比率を高くしています。

また、2012年度の政策的資産構成割合は前年度と同じです。



### ●AIJ問題について●

当基金では、年金資産の消失問題等で報道されているAIJ投資顧問への運用委託は一切ございません。

## 当基金の現況 (2012年3月31日現在)

| 項 目     |                   | 2011年度   | 2010年度   |
|---------|-------------------|----------|----------|
| 加入会社数   |                   | 86社      | 86社      |
| 加 入 者 数 |                   | 121,732人 | 109,678人 |
| 受給権者数   | キャッシュバランスプラン      | 13,145人  | 11,153人  |
|         | 旧制度(加算年金、適格退職年金等) | 56,958人  | 56,870人  |



※2011年度の数値には、2012年4月加入会社分を含みます。  
 ※2012年4月に新規加入した会社は、次の通りです。  
 (株)日立ソリューションズ、(株)日立ソリューションズ九州、  
 (株)日立ソリューションズサービス、(株)日立ソリューションズ  
 デザイン、(株)日立ソリューションズバリュー、日立ビジネス  
 ソリューション(株)。(50音順)

