

2019年度 決算内容のお知らせ

2020年7月6日に開催した代議員会において、2019年度の決算が承認されましたので、その内容をお知らせします。

2019年度 決算概要 (リスク分担型)

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。

(2019年4月1日～2020年3月31日)

(単位：億円)

支出		
	2019年度	2018年度
給付費	27	0
(年金)	(1)	(0)
(一時金)	(26)	(0)
移換金等	14	0
責任準備金増加額	139	2,397
運用損失	48	0
運用報酬等	3	0
合計	231	2,397

収入		
	2019年度	2018年度
掛金	178	0
(標準)	(109)	(0)
(リスク対応)	(69)	(0)
受換金等	45	2,397
責任準備金減少額	0	0
運用収益	8	0
合計	231	2,397

※掛金は各月末日現在で計算した額を翌月末日までに納付いただいています（会社が全額負担しています）。

貸借対照表 年度末における資産と負債（将来の年金給付のために積み立てておくべき資産）の状況を示しています。

(2020年3月31日現在)

(単位：億円)

資産		
	2019年度	2018年度
流動資産	78	2,397
固定資産（運用資産）	2,461	0
合計	2,539	2,397

負債		
	2019年度	2018年度
流動負債	3	0
責任準備金	2,536	2,397
合計	2,539	2,397

(その他諸数値)

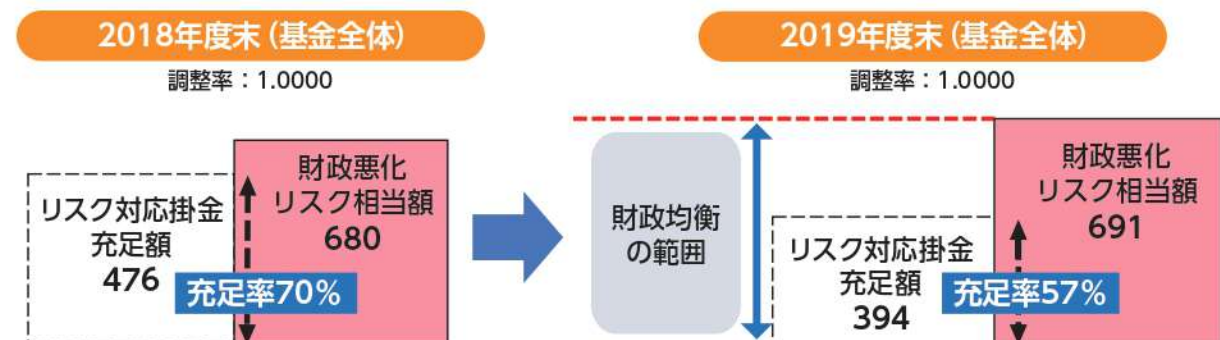
	2019年度	2018年度
リスク充足額	394	476
未償却過去勤務債務残高等	0	0

	2019年度	2018年度
財政悪化リスク相当額	691	680
数理債務	2,409	2,243

2019年度 財政検証

- 2019年度は財政均衡状況にあるため、2021年度の給付調整率は1.0000となります。
- 給付に必要な財源とは別に、財政悪化リスク相当額に対するリスク対応財源（リスク対応掛金充足額）を確保しています。
リスク対応財源は、コロナ禍の影響により減少しましたが、財政悪化リスク相当額に対し57%の水準を確保しています。

(単位：億円)



日立企業年金基金

☎ 03-4554-5500 [受付時間：土日祝日・年末年始などの休日を除く平日 8:50～12:00、12:45～17:20]

2019年度 資産運用状況のお知らせ

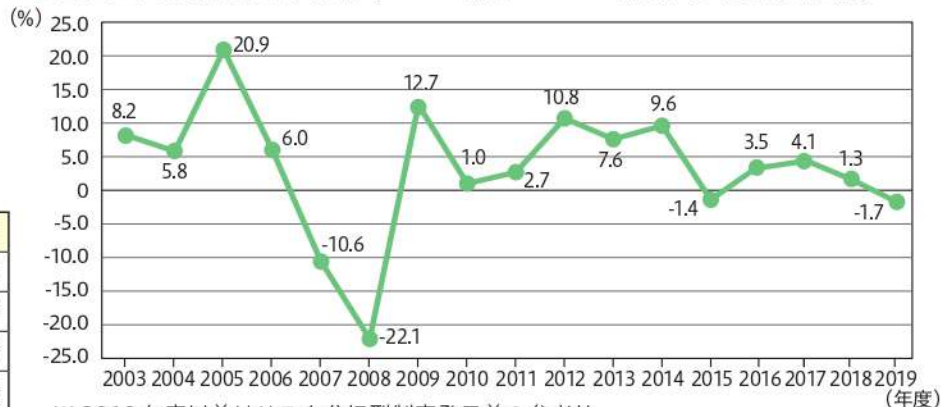
市場動向と当基金の運用結果(リスク分担型)

2019年度は、米中が通商協議の第一段階で合意したことなどを背景にして、2020年1月頃までは株式市場が好調に推移していました。しかし、2月以降、新型コロナウイルスの感染拡大と経済への影響などを懸念して株価が大幅に下落し、国内株式・外国株式の利回りがマイナスとなったため、当基金の運用利回りは-1.7%となりました。

●資産区分別市場利回り

資産種類	2019年度	2018年度
国内株式	-9.5%	-5.0%
外国株式	-12.4%	10.1%
国内債券	-0.2%	2.0%
外国債券	4.4%	2.5%

●当基金の運用利回り推移(2003年度～2019年度、手数料控除前)



※ 2018年度以前はリスク分担型制度発足前の参考値。

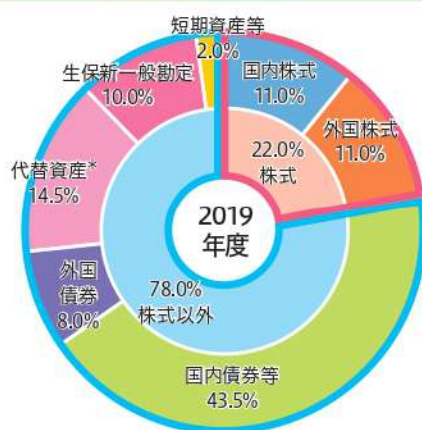
当基金の政策的資産構成割合(リスク分担型)

当基金では、制度運営・維持に必要な収益率(2.5%)を確保するため、「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、安定的運用を行ってまいりました。

当基金の2019年度の政策的資産構成割合は、右図のとおり、株式資産が22.0%、株式以外の資産が78.0%となっています。

下方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た運用も実施しております。

*伝統的資産運用(株や債券)以外で利息や配当収入を得る運用等。



当基金の資産運用の基本方針(リスク分担型)

当基金の年金資産運用は、加入者・年金受給権者に対する年金給付および一時金給付の支払いに必要かつ十分な時価資産の蓄積を図るために、中長期的に安定した総合収益を確保し、将来にわたって健全な年金財政を維持することを目的として「資産運用の基本方針」を策定し、当該基本方針に沿って運用しております。

「資産運用の基本方針」の主な規定内容

- ・年金資産の運用の目標に関する事項
- ・年金資産の資産構成割合に関する事項
- ・運用受託機関の選任・評価に関する事項
- ・運用業務に関し遵守すべき事項 等

※「資産運用の基本方針」は、日立基金のホームページの「資産運用について」に掲載しています。

資産運用委員会の議事概要(リスク分担型)

当基金は、資産運用および財政運営に関する理事会の諮問機関として、資産運用委員会を設置しています。

2019年度は6月、2020年1月の全2回実施し、各委員会において、運用実績や今後の運用環境見通し、運用受託機関の評価等について報告および確認を行いました。

6月	・2018年度決算の報告および財政状況の確認 ・2019年度の資産構成割合の再検証
1月	・2020年度の資産構成割合および確定給付型からリスク分担型への資産分割・移行等について検討し、理事会および代議員会への提案を確認



日立企業年金基金

ホームページ: <https://family.hitachi.co.jp/nenkin/> [ユーザー名: hitachi パスワード: kikin]