



01234560

〒123 - 4567

県 市 ××区

000番地

統一ディスクロズ資料

厚生年金基金 御中

「厚生年金基金保険契約に関する資産運用報告書（一般勘定 + 特別勘定）」

（2009年 3月再送版）

|               |                 |         |
|---------------|-----------------|---------|
| 1. 貸借対照表      | 年度 - - - - -    | 1       |
| 2. 損益計算書      | 年度 - - - - -    | 2       |
| 3. 付表         | 年度 - - - - -    | 3       |
| 4. 資産運用状況表    | 単月、四半期、年度 - - - | 4 ~ 6   |
| 5. 損益状況表      | 単月、四半期、年度 - - - | 7 ~ 9   |
| 6. 運用実績表      | 単月、四半期、年度 - - - | 10 ~ 12 |
| 7. 修正総合利回り計算表 | 単月、四半期、年度 - - - | 13 ~ 15 |
| 8. 運用実績表（月次）  | 年度 - - - - -    | 16      |

## 貸 借 対 照 表

厚生年金基金 御中

(単位：円・%)

| 資 産           |                 | 前 期                |               | 当 期                |       |
|---------------|-----------------|--------------------|---------------|--------------------|-------|
|               |                 | ( 2008年 3月31日 現在 ) | 構 成 比         | ( 2009年 3月31日 現在 ) | 構 成 比 |
| 国内債券計         | 債 券             | 0                  | 0.0           | 0                  | 0.0   |
|               | (うち既経過利息前払金)    | 0                  | 0.0           | 0                  | 0.0   |
|               | (うち委託証拠金)       | 0                  | 0.0           | 0                  | 0.0   |
|               | 合 同 運 用 口       | 0                  | 0.0           | 0                  | 0.0   |
| 国内新株予約権付社債計   | 新 株 予 約 権 付 社 債 | 0                  | 0.0           | 0                  | 0.0   |
|               | (うち既経過利息前払金)    | 0                  | 0.0           | 0                  | 0.0   |
|               | (うち委託証拠金)       | 0                  | 0.0           | 0                  | 0.0   |
|               | 合 同 運 用 口       | 0                  | 0.0           | 0                  | 0.0   |
| 国内株式計         | 株 式             | 0                  | 0.0           | 0                  | 0.0   |
|               | (うち委託証拠金)       | 0                  | 0.0           | 0                  | 0.0   |
|               | (うち委託証拠金)       | 0                  | 0.0           | 0                  | 0.0   |
|               | 合 同 運 用 口       | 0                  | 0.0           | 0                  | 0.0   |
| 外国債券計         | 外 貨 建 債 券       | 0                  | 0.0           | 0                  | 0.0   |
|               | (うち既経過利息前払金)    | 0                  | 0.0           | 0                  | 0.0   |
|               | (うち委託証拠金)       | 0                  | 0.0           | 0                  | 0.0   |
|               | 合 同 運 用 口       | 0                  | 0.0           | 0                  | 0.0   |
| 外国株式計         | 外 貨 建 株 式       | 0                  | 0.0           | 0                  | 0.0   |
|               | (うち委託証拠金)       | 0                  | 0.0           | 0                  | 0.0   |
|               | (うち委託証拠金)       | 0                  | 0.0           | 0                  | 0.0   |
|               | 合 同 運 用 口       | 0                  | 0.0           | 0                  | 0.0   |
| その他資産計        | 合 同 運 用 口       | 0                  | 0.0           | 0                  | 0.0   |
|               | 貸 付 金           | 0                  | 0.0           | 0                  | 0.0   |
|               | 不 動 産           | 0                  | 0.0           | 0                  | 0.0   |
|               | そ の 他           | 0                  | 0.0           | 0                  | 0.0   |
| 短期資金計         | 合 同 運 用 口       | 0                  | 0.0           | 0                  | 0.0   |
|               | 円 貨 短 期 資 金     | 0                  | 0.0           | 0                  | 0.0   |
|               | 合 同 運 用 口       | 0                  | 0.0           | 0                  | 0.0   |
|               | 外 貨 資 金         | 0                  | 0.0           | 0                  | 0.0   |
| 未 収 金         | 0               | 0.0                | 0             | 0.0                |       |
| 外 貨 未 収 金     | 0               | 0.0                | 0             | 0.0                |       |
| 一 般 勘 定       | 5,902,590,000   | 100.0              | 5,985,080,000 | 100.0              |       |
| 有期利率保証特約(無配当) | 0               | 0.0                | 0             | 0.0                |       |
| 合 計           | 5,902,590,000   | 100.0              | 5,985,080,000 | 100.0              |       |

| 負 債       |  | 前 期                |       | 当 期                |       |
|-----------|--|--------------------|-------|--------------------|-------|
|           |  | ( 2008年 3月31日 現在 ) | 構 成 比 | ( 2009年 3月31日 現在 ) | 構 成 比 |
| 元 本       |  | 5,782,140,000      | 98.5  | 8,902,590,000      | 99.0  |
| 実 質 収 益   |  | 120,450,000        | 1.5   | 82,490,000         | 1.0   |
| 仮 受 金 等   |  | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   |
| 未 払 金     |  | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   |
| 外 貨 未 払 金 |  | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   |
| 未 払 費 用   |  | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   |
| 合 計       |  | 5,902,590,000      | 100.0 | 5,985,080,000      | 100.0 |

# 見本

01234560  
株式会社

## 損 益 計 算 書

厚生年金基金 御中

第一生命保険株式会社

(単位:円)

| 利 益           | 前 期<br>(自 2007年 4月 2日 )<br>(至 2008年 3月 31日 ) | 当 期<br>(自 2008年 4月 1日 )<br>(至 2009年 3月 31日 ) |
|---------------|--|--|
| 債券            | 0  | 0  |
| 合同運用口         | 0  | 0  |
| 国内債券計         | 0  | 0  |
| 新株予約権付社債      | 0  | 0  |
| 合同運用口         | 0  | 0  |
| 国内新株予約権付社債計   | 0  | 0  |
| 株式            | 0  | 0  |
| 合同運用口         | 0  | 0  |
| 国内株式計         | 0  | 0  |
| 外貨建債券         | 0  | 0  |
| 合同運用口         | 0  | 0  |
| 外国債券計         | 0  | 0  |
| 外貨建株式         | 0  | 0  |
| 合同運用口         | 0  | 0  |
| 外国株式計         | 0  | 0  |
| 合同運用口         | 0  | 0  |
| 貸付金           | 0  | 0  |
| 不動産           | 0  | 0  |
| その他           | 0  | 0  |
| その他資産計        | 0  | 0  |
| 円貨短期資金        | 0  | 0  |
| 合同運用口         | 0  | 0  |
| 外貨資金          | 0  | 0  |
| 短期資金計         | 0  | 0  |
| 特別勘定(総合口)     | 0  | 0  |
| 一般勘定          | 123,180,000                                  | 92,780,000                                   |
| 有期利率保証特約(無配当) | 0  | 0  |
| 合 計           | 123,180,000                                  | 92,780,000                                   |

| 費 用      | 前 期<br>(自 2007年 4月 2日 )<br>(至 2008年 3月 31日 ) | 当 期<br>(自 2008年 4月 1日 )<br>(至 2009年 3月 31日 ) |
|----------|--|--|
| 固有の保険事務費 | 15,630,000                                   | 15,290,000                                   |
| 特別法人税    | 0  | 0  |
| 合 計      | 15,630,000                                   | 15,290,000                                   |
| 実 質 収 益  | 120,450,000                                  | 82,490,000                                   |

付 表  
( 2008年 4月 1日 ~ 2009年 3月 31日 )

1 . 保 険 資 産 計 算 書

(単位：円)

| 項 目           | 前 期 末         | 当 期 末         |
|---------------|---------------|---------------|
| 貸借対照表資産総額     | 5,902,590,000 | 5,985,080,000 |
| 未 達 資 金       | 0             | 0             |
| 保 険 資 産 ( + ) | 5,902,590,000 | 5,985,080,000 |

2 . 費 用

(単位：円)

|          | 損益計算書上表示額<br>( + ) |            |   |
|----------|--------------------|------------|---|
|          | 当 期 支 払 済 額        | 当 期 未 払 額  |   |
| 固有の保険事務費 | 15,290,000         | 15,290,000 | 0 |
| 特別法人税    | 0                  | 0          | 0 |
| 合 計      | 15,290,000         | 15,290,000 | 0 |

3 . 利 回 り 表

(単位：円・%)

|             | 前 期 末         |       | 当 期 末         |       |
|-------------|---------------|-------|---------------|-------|
|             | 金 額           | 利 回 り | 金 額           | 利 回 り |
| 総 合 収 益     | 123,180,000   | 1.75  | 92,780,000    | 1.25  |
| 実 質 収 益     | 120,450,000   | 1.55  | 82,490,000    | 1.04  |
| 元 本 平 均 残 高 | 5,782,140,000 |       | 5,902,590,000 |       |

参 考 情 報

(単位：円)

|               |   |
|---------------|---|
| 当期キャピタルゲイン    | 0 |
| 当 期 末 評 価 損 益 | 0 |

## 資 産 運 用 状 況 表

( 2009年 3月 1日 ~ 2009年 3月 31日 )

01234560

株式会社

厚生年金基金 御中

第一生命保険株式会社

(単位：円・%)

| 資 産                   | 前 期 末 時 価 総 額<br>(2009年 2月28日現在) |       | 増 減 額      |       |            |           | 当 期 末 時 価 総 額<br>(2009年 3月31日現在) |       |
|-----------------------|----------------------------------|-------|------------|-------|------------|-----------|----------------------------------|-------|
|                       | 構成比                              |       | ( - + )    | 運 用 額 | 回 収 額      | そ の 他     | 構成比                              |       |
| 債 券                   | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0         | 0                                | 0.0   |
| (うち既経過利息前払金)          | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0         | 0                                | 0.0   |
| (うち委託証拠金)             | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0         | 0                                | 0.0   |
| 合 同 運 用 口             | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0         | 0                                | 0.0   |
| 国内債券計                 | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0         | 0                                | 0.0   |
| 新株予約権付社債              | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0         | 0                                | 0.0   |
| (うち既経過利息前払金)          | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0         | 0                                | 0.0   |
| 合 同 運 用 口             | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0         | 0                                | 0.0   |
| 国内新株予約権付社債計           | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0         | 0                                | 0.0   |
| 株 式                   | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0         | 0                                | 0.0   |
| (うち委託証拠金)             | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0         | 0                                | 0.0   |
| 合 同 運 用 口             | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0         | 0                                | 0.0   |
| 国内株式計                 | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0         | 0                                | 0.0   |
| 外 貨 建 債 券             | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0         | 0                                | 0.0   |
| (うち既経過利息前払金)          | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0         | 0                                | 0.0   |
| (うち委託証拠金)             | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0         | 0                                | 0.0   |
| 合 同 運 用 口             | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0         | 0                                | 0.0   |
| 外国債券計                 | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0         | 0                                | 0.0   |
| 外 貨 建 株 式             | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0         | 0                                | 0.0   |
| (うち委託証拠金)             | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0         | 0                                | 0.0   |
| 合 同 運 用 口             | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0         | 0                                | 0.0   |
| 外国株式計                 | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0         | 0                                | 0.0   |
| 合 同 運 用 口             | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0         | 0                                | 0.0   |
| 貸 付 金                 | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0         | 0                                | 0.0   |
| 不 動 産                 | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0         | 0                                | 0.0   |
| そ の 他                 | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0         | 0                                | 0.0   |
| その他資産計                | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0         | 0                                | 0.0   |
| 円 貨 短 期 資 金           | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0         | 0                                | 0.0   |
| 合 同 運 用 口             | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0         | 0                                | 0.0   |
| 外 貨 資 金               | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0         | 0                                | 0.0   |
| 未 収 金 ・ 未 払 金         | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0         | 0                                | 0.0   |
| 外 貨 未 収 金 ・ 外 貨 未 払 金 | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0         | 0                                | 0.0   |
| 短期資金計                 | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0         | 0                                | 0.0   |
| 特別勘定(総合口)             | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0         | 0                                | 0.0   |
| 一 般 勘 定               | 5,892,990,000                    | 100.0 | -6,903,000 | 0     | 15,290,000 | 8,480,000 | 5,985,080,000                    | 100.0 |
| 有期利率保証特約(無配当)         | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0         | 0                                | 0.0   |
| 合 計                   | 5,892,990,000                    | 100.0 | -6,903,000 | 0     | 15,290,000 | 8,480,000 | 5,985,080,000                    | 100.0 |

(注)

- 「その他」は、市場変動、未収収益の増減等、純粋な時価ベースの運用・回収異動額以外の金額を表示しています。
- 「未収金・未払金」「外貨未収金・外貨未払金」は、未収金と未払金を相殺したネット表示となっていることから、表示金額がマイナスとなることがあります。
- オフバランス資産は評価損益額を原資産に含めて表示しています。なお、オプションプレミアムについては時価評価額を原資産に含めて表示しています。

## 資 産 運 用 状 況 表

( 2009年 1月 1日 ~ 2009年 3月 31日 )

01234560

株式会社

厚生年金基金 御中

第一生命保険株式会社

(単位：円・%)

| 資 産                       | 前 期 末 時 価 総 額<br>(2008年12月31日現在) |       | 増 減 額     |       |            |            | 当 期 末 時 価 総 額<br>(2009年 3月31日現在) |       |
|---------------------------|----------------------------------|-------|-----------|-------|------------|------------|----------------------------------|-------|
|                           |                                  | 構 成 比 | ( - + )   | 運 用 額 | 回 収 額      | そ の 他      |                                  | 構 成 比 |
| 債 券                       | 0                                | 0.0   | 0         | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| (うち既経過利息前払金)              | 0                                | 0.0   | 0         | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| (うち委託証拠金)                 | 0                                | 0.0   | 0         | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| 合 同 運 用 口                 | 0                                | 0.0   | 0         | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| 国内債券計                     | 0                                | 0.0   | 0         | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| 新株予約権付社債                  | 0                                | 0.0   | 0         | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| (うち既経過利息前払金)              | 0                                | 0.0   | 0         | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| 合 同 運 用 口                 | 0                                | 0.0   | 0         | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| 国内新株予約権付社債計               | 0                                | 0.0   | 0         | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| 株 式                       | 0                                | 0.0   | 0         | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| (うち委託証拠金)                 | 0                                | 0.0   | 0         | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| 合 同 運 用 口                 | 0                                | 0.0   | 0         | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| 国内株式計                     | 0                                | 0.0   | 0         | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| 外 貨 建 債 券                 | 0                                | 0.0   | 0         | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| (うち既経過利息前払金)              | 0                                | 0.0   | 0         | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| (うち委託証拠金)                 | 0                                | 0.0   | 0         | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| 合 同 運 用 口                 | 0                                | 0.0   | 0         | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| 外国債券計                     | 0                                | 0.0   | 0         | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| 外 貨 建 株 式                 | 0                                | 0.0   | 0         | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| (うち委託証拠金)                 | 0                                | 0.0   | 0         | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| 合 同 運 用 口                 | 0                                | 0.0   | 0         | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| 外国株式計                     | 0                                | 0.0   | 0         | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| 合 同 運 用 口                 | 0                                | 0.0   | 0         | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| 貸 付 金                     | 0                                | 0.0   | 0         | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| 不 動 産                     | 0                                | 0.0   | 0         | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| そ の 他                     | 0                                | 0.0   | 0         | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| その他資産計                    | 0                                | 0.0   | 0         | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| 円 貨 短 期 資 金               | 0                                | 0.0   | 0         | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| 合 同 運 用 口                 | 0                                | 0.0   | 0         | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| 外 貨 資 金                   | 0                                | 0.0   | 0         | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| 未 収 金 ・ 未 払 金             | 0                                | 0.0   | 0         | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| 外 貨 未 収 金 ・ 外 貨 未 払 金     | 0                                | 0.0   | 0         | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| 短期資金計                     | 0                                | 0.0   | 0         | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| 特 別 勘 定 ( 総 合 口 )         | 0                                | 0.0   | 0         | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| 一 般 勘 定                   | 5,877,020,000                    | 100.0 | 8,044,000 | 0     | 15,290,000 | 24,450,000 | 5,985,080,000                    | 100.0 |
| 有 期 利 率 保 証 特 約 ( 無 配 当 ) | 0                                | 0.0   | 0         | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| 合 計                       | 5,877,020,000                    | 100.0 | 8,044,000 | 0     | 15,290,000 | 24,450,000 | 5,985,080,000                    | 100.0 |

(注)

- 1 「その他」は、市場変動、未収収益の増減等、純粋な時価ベースの運用・回収異動額以外の金額を表示しています。
- 2 「未収金・未払金」「外貨未収金・外貨未払金」は、未収金と未払金を相殺したネット表示となっていることから、表示金額がマイナスとなることがあります。
- 3 オフバランス資産は評価損益額を原資産に含めて表示しています。なお、オプションプレミアムについては時価評価額を原資産に含めて表示しています。

## 資 産 運 用 状 況 表

( 2008年 4月 1日 ~ 2009年 3月 31日 )

01234560

株式会社

厚生年金基金 御中

第一生命保険株式会社

(単位：円・%)

| 資 産                       | 前 期 末 時 価 総 額<br>(2008年 3月31日現在) |       | 増 減 額      |       |            |            | 当 期 末 時 価 総 額<br>(2009年 3月31日現在) |       |
|---------------------------|----------------------------------|-------|------------|-------|------------|------------|----------------------------------|-------|
|                           | 構成比                              |       | ( - + )    | 運 用 額 | 回 収 額      | そ の 他      | 構成比                              |       |
| 債 券                       | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| (うち既経過利息前払金)              | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| (うち委託証拠金)                 | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| 合 同 運 用 口                 | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| 国内債券計                     | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| 新株予約権付社債                  | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| (うち既経過利息前払金)              | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| 合 同 運 用 口                 | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| 国内新株予約権付社債計               | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| 株 式                       | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| (うち委託証拠金)                 | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| 合 同 運 用 口                 | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| 国内株式計                     | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| 外 貨 建 債 券                 | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| (うち既経過利息前払金)              | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| (うち委託証拠金)                 | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| 合 同 運 用 口                 | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| 外国債券計                     | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| 外 貨 建 株 式                 | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| (うち委託証拠金)                 | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| 合 同 運 用 口                 | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| 外国株式計                     | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| 合 同 運 用 口                 | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| 貸 付 金                     | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| 不 動 産                     | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| そ の 他                     | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| その他資産計                    | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| 円 貨 短 期 資 金               | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| 合 同 運 用 口                 | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| 外 貨 資 金                   | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| 未 収 金 ・ 未 払 金             | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| 外 貨 未 収 金 ・ 外 貨 未 払 金     | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| 短期資金計                     | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| 特 別 勘 定 ( 総 合 口 )         | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| 一 般 勘 定                   | 5,902,590,000                    | 100.0 | 82,490,000 | 0     | 15,290,000 | 92,780,000 | 5,985,080,000                    | 100.0 |
| 有 期 利 率 保 証 特 約 ( 無 配 当 ) | 0                                | 0.0   | 0          | 0     | 0          | 0          | 0                                | 0.0   |
| 合 計                       | 5,902,590,000                    | 100.0 | 82,490,000 | 0     | 15,290,000 | 92,780,000 | 5,985,080,000                    | 100.0 |

(注)

- 「その他」は、市場変動、未収収益の増減等、純粋な時価ベースの運用・回収異動額以外の金額を表示しています。
- 「未収金・未払金」「外貨未収金・外貨未払金」は、未収金と未払金を相殺したネット表示となっていることから、表示金額がマイナスとなることがあります。
- オフバランス資産は評価損益額を原資産に含めて表示しています。なお、オプションプレミアムについては時価評価額を原資産に含めて表示しています。

## 損 益 状 況 表

( 2009年 3月 1日 ~ 2009年 3月 31日 )

01234560

株式会社

厚生年金基金 御中

第一生命保険株式会社

(単位：円)

| 利 益                   | 実 現 損 益 額 |             |               | 未 収 収 益 増 減 額 | 評 価 損 益 増 減 額 | 総 合 収 益<br>( + + ) |
|-----------------------|-----------|-------------|---------------|---------------|---------------|--------------------|
|                       |           | 利 金 ・ 配 当 金 | 売 却 ・ 償 還 損 益 |               |               |                    |
| 債 券                   | 0         | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 合 同 運 用 口             | 0         | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 国 内 債 券 計             | 0         | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 新 株 予 約 権 付 社 債       | 0         | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 合 同 運 用 口             | 0         | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 国 内 新 株 予 約 権 付 社 債 計 | 0         | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 株 式                   | 0         | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 合 同 運 用 口             | 0         | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 国 内 株 式 計             | 0         | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 外 貨 建 債 券             | 0         | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 合 同 運 用 口             | 0         | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 外 国 債 券 計             | 0         | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 外 貨 建 株 式             | 0         | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 合 同 運 用 口             | 0         | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 外 国 株 式 計             | 0         | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 合 同 運 用 口             | 0         | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 貸 付 金                 | 0         | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 不 動 産                 | 0         | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| そ の 他                 | 0         | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| そ の 他 資 産 計           | 0         | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 円 貨 短 期 資 金           | 0         | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 合 同 運 用 口             | 0         | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 外 貨 資 金               | 0         | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 短 期 資 金 計             | 0         | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 特 別 勘 定 ( 総 合 口 )     | 0         | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 一 般 勘 定               | 8,480,000 | 8,480,000   | 0             | 0             | 0             | 8,480,000          |
| 有 期 保 証 約 ( 無 配 当 )   | 0         | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 合 計                   | 8,480,000 | 8,480,000   | 0             | 0             | 0             | 8,480,000          |



## 損 益 状 況 表

( 2009年 1月 1日 ~ 2009年 3月 31日 )

01234560

株式会社

厚生年金基金 御中

第一生命保険株式会社

(単位：円)

| 利 益                       | 実 現 損 益 額  |             |               | 未 収 収 益 増 減 額 | 評 価 損 益 増 減 額 | 総 合 収 益<br>( + + ) |
|---------------------------|------------|-------------|---------------|---------------|---------------|--------------------|
|                           |            | 利 金 ・ 配 当 金 | 売 却 ・ 償 還 損 益 |               |               |                    |
| 債 券                       | 0          | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 合 同 運 用 口                 | 0          | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 国 内 債 券 計                 | 0          | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 新 株 予 約 権 付 社 債           | 0          | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 合 同 運 用 口                 | 0          | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 国 内 新 株 予 約 権 付 社 債 計     | 0          | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 株 式                       | 0          | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 合 同 運 用 口                 | 0          | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 国 内 株 式 計                 | 0          | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 外 貨 建 債 券                 | 0          | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 合 同 運 用 口                 | 0          | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 外 国 債 券 計                 | 0          | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 外 貨 建 株 式                 | 0          | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 合 同 運 用 口                 | 0          | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 外 国 株 式 計                 | 0          | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 合 同 運 用 口                 | 0          | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 貸 付 金                     | 0          | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 不 動 産                     | 0          | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| そ の 他                     | 0          | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| そ の 他 資 産 計               | 0          | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 円 貨 短 期 資 金               | 0          | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 合 同 運 用 口                 | 0          | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 外 貨 資 金                   | 0          | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 短 期 資 金 計                 | 0          | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 特 別 勘 定 ( 総 合 口 )         | 0          | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 一 般 勘 定                   | 24,450,000 | 24,450,000  | 0             | 0             | 0             | 24,450,000         |
| 有 期 利 率 保 証 特 約 ( 無 配 当 ) | 0          | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 合 計                       | 24,450,000 | 24,450,000  | 0             | 0             | 0             | 24,450,000         |

## 損 益 状 況 表

( 2008年 4月 1日 ~ 2009年 3月 31日 )

01234560

株式会社

厚生年金基金 御中

第一生命保険株式会社

(単位：円)

| 利 益                       | 実 現 損 益 額  |             |               | 未 収 収 益 増 減 額 | 評 価 損 益 増 減 額 | 総 合 収 益<br>( + + ) |
|---------------------------|------------|-------------|---------------|---------------|---------------|--------------------|
|                           |            | 利 金 ・ 配 当 金 | 売 却 ・ 償 還 損 益 |               |               |                    |
| 債 券                       | 0          | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 合 同 運 用 口                 | 0          | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 国 内 債 券 計                 | 0          | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 新 株 予 約 権 付 社 債           | 0          | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 合 同 運 用 口                 | 0          | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 国 内 新 株 予 約 権 付 社 債 計     | 0          | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 株 式                       | 0          | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 合 同 運 用 口                 | 0          | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 国 内 株 式 計                 | 0          | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 外 貨 建 債 券                 | 0          | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 合 同 運 用 口                 | 0          | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 外 国 債 券 計                 | 0          | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 外 貨 建 株 式                 | 0          | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 合 同 運 用 口                 | 0          | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 外 国 株 式 計                 | 0          | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 合 同 運 用 口                 | 0          | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 貸 付 金                     | 0          | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 不 動 産                     | 0          | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| そ の 他                     | 0          | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| そ の 他 資 産 計               | 0          | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 円 貨 短 期 資 金               | 0          | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 合 同 運 用 口                 | 0          | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 外 貨 資 金                   | 0          | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 短 期 資 金 計                 | 0          | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 特 別 勘 定 ( 総 合 口 )         | 0          | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 一 般 勘 定                   | 92,780,000 | 92,780,000  | 0             | 0             | 0             | 92,780,000         |
| 有 期 利 率 保 証 特 約 ( 無 配 当 ) | 0          | 0           | 0             | 0             | 0             | 0                  |
| 合 計                       | 92,780,000 | 92,780,000  | 0             | 0             | 0             | 92,780,000         |

## 運 用 実 績 表

( 2009年 3月 1日 ~ 2009年 3月 31日 )

01234560

株式会社

厚生年金基金 御中

第一生命保険株式会社

( 単位 : 円 ・ % )

|                           | 前 期 末 時 価 総 額      |       | 当 期 末 時 価 総 額      |       | 時 間 加 重<br>収 益 率 |
|---------------------------|--------------------|-------|--------------------|-------|------------------|
|                           | ( 2009年 2月28日 現在 ) | 構 成 比 | ( 2009年 3月31日 現在 ) | 構 成 比 |                  |
| 債 券                       | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 合 同 運 用 口                 | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 国内債券計                     | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 新株予約権付社債                  | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 合 同 運 用 口                 | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 国内新株予約権付社債計               | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 株 式                       | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 合 同 運 用 口                 | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 国内株式計                     | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 外 貨 建 債 券                 | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 合 同 運 用 口                 | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 外国債券計                     | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 外 貨 建 株 式                 | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 合 同 運 用 口                 | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 外国株式計                     | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 合 同 運 用 口                 | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 貸 付 金                     | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 不 動 産                     | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| そ の 他                     | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| その他資産計                    | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 円 貨 短 期 資 金               | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 合 同 運 用 口                 | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 外 貨 資 金                   | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 未 収 金 ・ 未 払 金             | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 外 貨 未 収 金 ・ 外 貨 未 払 金     | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 短期資金計                     | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 特 別 勘 定 ( 総 合 口 )         | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 一 般 勘 定                   | 5,892,990,000      | 100.0 | 5,985,080,000      | 100.0 | 0.10             |
| 有 期 利 率 保 証 特 約 ( 無 配 当 ) | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 合 計                       | 5,892,990,000      | 100.0 | 5,985,080,000      | 100.0 | 0.10             |

(注)

- 「既経過利息前払金」「委託証拠金」は原資産に含めて計上しています。
- 「未収金・未払金」「外貨未収金・外貨未払金」は、未収金と未払金を相殺したネット表示となっていることから、表示金額がマイナスとなることがあります。
- オフバランス資産は評価損益額を原資産に含めて表示しています。なお、オプションプレミアムについては、時価評価額を原資産に含めて表示しています。
- 時間加重収益率は、修正デーツ法にて算出しています。その際用いる所有期間は、一般勘定残高をもとに計算しています。

## 運 用 実 績 表

( 2009年 1月 1日 ~ 2009年 3月 31日 )

01234560

株式会社

厚生年金基金 御中

第一生命保険株式会社

(単位：円・%)

|                           | 前 期 末 時 価 総 額      |       | 当 期 末 時 価 総 額      |       | 時 間 加 重<br>収 益 率 |
|---------------------------|--------------------|-------|--------------------|-------|------------------|
|                           | ( 2008年12月31日 現在 ) | 構 成 比 | ( 2009年 3月31日 現在 ) | 構 成 比 |                  |
| 債 券                       | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 合 同 運 用 口                 | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 国内債券計                     | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 新株予約権付社債                  | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 合 同 運 用 口                 | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 国内新株予約権付社債計               | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 株 式                       | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 合 同 運 用 口                 | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 国内株式計                     | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 外 貨 建 債 券                 | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 合 同 運 用 口                 | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 外国債券計                     | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 外 貨 建 株 式                 | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 合 同 運 用 口                 | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 外国株式計                     | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 合 同 運 用 口                 | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 貸 付 金                     | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 不 動 産                     | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| そ の 他                     | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| その他資産計                    | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 円 貨 短 期 資 金               | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 合 同 運 用 口                 | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 外 貨 資 金                   | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 未 収 金 ・ 未 払 金             | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 外 貨 未 収 金 ・ 外 貨 未 払 金     | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 短期資金計                     | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 特 別 勘 定 ( 総 合 口 )         | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 一 般 勘 定                   | 5,877,020,000      | 100.0 | 5,985,080,000      | 100.0 | 0.31             |
| 有 期 利 率 保 証 特 約 ( 無 配 当 ) | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 合 計                       | 5,877,020,000      | 100.0 | 5,985,080,000      | 100.0 | 0.31             |

(注)

- 「既経過利息前払金」「委託証拠金」は原資産に含めて計上しています。
- 「未収金・未払金」「外貨未収金・外貨未払金」は、未収金と未払金を相殺したネット表示となっていることから、表示金額がマイナスとなることがあります。
- オフバランス資産は評価損益額を原資産に含めて表示しています。なお、オプションプレミアムについては、時価評価額を原資産に含めて表示しています。
- 時間加重収益率は、修正デーツ法にて算出しています。その際用いる所有期間は、一般勘定残高をもとに計算しています。

## 運 用 実 績 表

( 2008年 4月 1日 ~ 2009年 3月 31日 )

01234560

株式会社

厚生年金基金 御中

第一生命保険株式会社

( 単位 : 円 ・ % )

|                           | 前 期 末 時 価 総 額      |       | 当 期 末 時 価 総 額      |       | 時 間 加 重<br>収 益 率 |
|---------------------------|--------------------|-------|--------------------|-------|------------------|
|                           | ( 2008年 3月31日 現在 ) | 構 成 比 | ( 2009年 3月31日 現在 ) | 構 成 比 |                  |
| 債 券                       | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 合 同 運 用 口                 | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 国内債券計                     | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 新株予約権付社債                  | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 合 同 運 用 口                 | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 国内新株予約権付社債計               | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 株 式                       | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 合 同 運 用 口                 | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 国内株式計                     | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 外 貨 建 債 券                 | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 合 同 運 用 口                 | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 外国債券計                     | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 外 貨 建 株 式                 | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 合 同 運 用 口                 | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 外国株式計                     | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 合 同 運 用 口                 | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 貸 付 金                     | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 不 動 産                     | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| そ の 他                     | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| その他資産計                    | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 円 貨 短 期 資 金               | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 合 同 運 用 口                 | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 外 貨 資 金                   | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 未 収 金 ・ 未 払 金             | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 外 貨 未 収 金 ・ 外 貨 未 払 金     | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 短期資金計                     | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 特 別 勘 定 ( 総 合 口 )         | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 一 般 勘 定                   | 5,902,590,000      | 100.0 | 5,985,080,000      | 100.0 | 1.25             |
| 有 期 利 率 保 証 特 約 ( 無 配 当 ) | 0                  | 0.0   | 0                  | 0.0   | -                |
| 合 計                       | 5,902,590,000      | 100.0 | 5,985,080,000      | 100.0 | 1.25             |

(注)

- 「既経過利息前払金」「委託証拠金」は原資産に含めて計上しています。
- 「未収金・未払金」「外貨未収金・外貨未払金」は、未収金と未払金を相殺したネット表示となっていることから、表示金額がマイナスとなることがあります。
- オフバランス資産は評価損益額を原資産に含めて表示しています。なお、オプションプレミアムについては、時価評価額を原資産に含めて表示しています。
- 時間加重収益率は、修正デーツ法にて算出しています。その際用いる所有期間は、一般勘定残高をもとに計算しています。

## 修正総合利回り計算表

( 2009年 3月 1日 ~ 2009年 3月 31日 )

01234560

株式会社

厚生年金基金 御中

第一生命保険株式会社

(単位：円・%)

| 利 益                       | 前 期 末 時 価 総 額<br>( 2009年 2月28日 現在 ) | 当 期 末 時 価 総 額<br>( 2009年 3月31日 現在 ) | 期 中 平 均 残 高<br>( 期中日数： 31日 ) | 総 合 収 益   | 修 正 総 合 利 回 り<br>/ |
|---------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|------------------------------|-----------|--------------------|
| 債 券                       | 0                                   | 0                                   | 0                            | 0         | -                  |
| 合 同 運 用 口                 | 0                                   | 0                                   | 0                            | 0         | -                  |
| 国 内 債 券 計                 | 0                                   | 0                                   | 0                            | 0         | -                  |
| 新 株 予 約 権 付 社 債           | 0                                   | 0                                   | 0                            | 0         | -                  |
| 合 同 運 用 口                 | 0                                   | 0                                   | 0                            | 0         | -                  |
| 国 内 新 株 予 約 権 付 社 債 計     | 0                                   | 0                                   | 0                            | 0         | -                  |
| 株 式                       | 0                                   | 0                                   | 0                            | 0         | -                  |
| 合 同 運 用 口                 | 0                                   | 0                                   | 0                            | 0         | -                  |
| 国 内 株 式 計                 | 0                                   | 0                                   | 0                            | 0         | -                  |
| 外 貨 建 債 券                 | 0                                   | 0                                   | 0                            | 0         | -                  |
| 合 同 運 用 口                 | 0                                   | 0                                   | 0                            | 0         | -                  |
| 外 国 債 券 計                 | 0                                   | 0                                   | 0                            | 0         | -                  |
| 外 貨 建 株 式                 | 0                                   | 0                                   | 0                            | 0         | -                  |
| 合 同 運 用 口                 | 0                                   | 0                                   | 0                            | 0         | -                  |
| 外 国 株 式 計                 | 0                                   | 0                                   | 0                            | 0         | -                  |
| 合 同 運 用 口                 | 0                                   | 0                                   | 0                            | 0         | -                  |
| 貸 付 金                     | 0                                   | 0                                   | 0                            | 0         | -                  |
| 不 動 産                     | 0                                   | 0                                   | 0                            | 0         | -                  |
| そ の 他                     | 0                                   | 0                                   | 0                            | 0         | -                  |
| そ の 他 資 産 計               | 0                                   | 0                                   | 0                            | 0         | -                  |
| 円 貨 短 期 資 金               | 0                                   | 0                                   | 0                            | 0         | -                  |
| 合 同 運 用 口                 | 0                                   | 0                                   | 0                            | 0         | -                  |
| 外 貨 資 金                   | 0                                   | 0                                   | 0                            | 0         | -                  |
| 未 収 金 ・ 未 払 金             | 0                                   | 0                                   | 0                            | 0         | -                  |
| 外 貨 未 収 金 ・ 外 貨 未 払 金     | 0                                   | 0                                   | 0                            | 0         | -                  |
| 短 期 資 金 計                 | 0                                   | 0                                   | 0                            | 0         | -                  |
| 特 別 勘 定 ( 総 合 口 )         | 0                                   | 0                                   | 0                            | 0         | -                  |
| 一 般 勘 定                   | 5,892,990,000                       | 5,985,080,000                       | 5,996,780,000                | 8,480,000 | 0.10               |
| 有 期 利 率 保 証 特 約 ( 無 配 当 ) | 0                                   | 0                                   | 0                            | 0         | -                  |
| 合 計                       | 5,892,990,000                       | 5,985,080,000                       | 5,996,780,000                | 8,480,000 | 0.10               |
| 特 別 勘 定 ( 第 1 特 約 )       | 0                                   | 0                                   | 0                            | 0         | -                  |
| 特 別 勘 定 ( 第 2 特 約 )       | 0                                   | 0                                   | 0                            | 0         | -                  |
| 一 般 勘 定                   | 5,902,590,000                       | 5,902,590,000                       | 5,902,590,000                | 8,480,000 | 0.11               |
| 有 期 利 率 保 証 特 約 ( 無 配 当 ) | 0                                   | 0                                   | 0                            | 0         | -                  |
| 元 本 合 計                   | 5,902,590,000                       | 5,902,590,000                       | 5,902,590,000                | 8,480,000 | 0.11               |

## 修正総合利回り計算表

( 2009年 1月 1日 ~ 2009年 3月 31日 )

01234560

株式会社

厚生年金基金 御中

第一生命保険株式会社

(単位：円・%)

| 利 益                       | 前 期 末 時 価 総 額<br>( 2008年12月31日 現在 ) | 当 期 末 時 価 総 額<br>( 2009年 3月31日 現在 ) | 期 中 平 均 残 高<br>( 期中日数： 90日 ) | 総 合 収 益    | 修 正 総 合 利 回 り<br>/ |
|---------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|------------------------------|------------|--------------------|
| 債 券                       | 0                                   | 0                                   | 0                            | 0          | -                  |
| 合 同 運 用 口                 | 0                                   | 0                                   | 0                            | 0          | -                  |
| 国 内 債 券 計                 | 0                                   | 0                                   | 0                            | 0          | -                  |
| 新 株 予 約 権 付 社 債           | 0                                   | 0                                   | 0                            | 0          | -                  |
| 合 同 運 用 口                 | 0                                   | 0                                   | 0                            | 0          | -                  |
| 国 内 新 株 予 約 権 付 社 債 計     | 0                                   | 0                                   | 0                            | 0          | -                  |
| 株 式                       | 0                                   | 0                                   | 0                            | 0          | -                  |
| 合 同 運 用 口                 | 0                                   | 0                                   | 0                            | 0          | -                  |
| 国 内 株 式 計                 | 0                                   | 0                                   | 0                            | 0          | -                  |
| 外 貨 建 債 券                 | 0                                   | 0                                   | 0                            | 0          | -                  |
| 合 同 運 用 口                 | 0                                   | 0                                   | 0                            | 0          | -                  |
| 外 国 債 券 計                 | 0                                   | 0                                   | 0                            | 0          | -                  |
| 外 貨 建 株 式                 | 0                                   | 0                                   | 0                            | 0          | -                  |
| 合 同 運 用 口                 | 0                                   | 0                                   | 0                            | 0          | -                  |
| 外 国 株 式 計                 | 0                                   | 0                                   | 0                            | 0          | -                  |
| 合 同 運 用 口                 | 0                                   | 0                                   | 0                            | 0          | -                  |
| 貸 付 金                     | 0                                   | 0                                   | 0                            | 0          | -                  |
| 不 動 産                     | 0                                   | 0                                   | 0                            | 0          | -                  |
| そ の 他                     | 0                                   | 0                                   | 0                            | 0          | -                  |
| そ の 他 資 産 計               | 0                                   | 0                                   | 0                            | 0          | -                  |
| 円 貨 短 期 資 金               | 0                                   | 0                                   | 0                            | 0          | -                  |
| 合 同 運 用 口                 | 0                                   | 0                                   | 0                            | 0          | -                  |
| 外 貨 資 金                   | 0                                   | 0                                   | 0                            | 0          | -                  |
| 未 収 金 ・ 未 払 金             | 0                                   | 0                                   | 0                            | 0          | -                  |
| 外 貨 未 収 金 ・ 外 貨 未 払 金     | 0                                   | 0                                   | 0                            | 0          | -                  |
| 短 期 資 金 計                 | 0                                   | 0                                   | 0                            | 0          | -                  |
| 特 別 勘 定 ( 総 合 口 )         | 0                                   | 0                                   | 0                            | 0          | -                  |
| 一 般 勘 定                   | 5,877,020,000                       | 5,985,080,000                       | 5,969,150,000                | 24,450,000 | 0.30               |
| 有 期 利 率 保 証 特 約 ( 無 配 当 ) | 0                                   | 0                                   | 0                            | 0          | -                  |
| 合 計                       | 5,877,020,000                       | 5,985,080,000                       | 5,969,150,000                | 24,450,000 | 0.30               |
| 特 別 勘 定 ( 第 1 特 約 )       | 0                                   | 0                                   | 0                            | 0          | -                  |
| 特 別 勘 定 ( 第 2 特 約 )       | 0                                   | 0                                   | 0                            | 0          | -                  |
| 一 般 勘 定                   | 5,902,590,000                       | 5,902,590,000                       | 5,902,590,000                | 24,450,000 | 0.31               |
| 有 期 利 率 保 証 特 約 ( 無 配 当 ) | 0                                   | 0                                   | 0                            | 0          | -                  |
| 元 本 合 計                   | 5,902,590,000                       | 5,902,590,000                       | 5,902,590,000                | 24,450,000 | 0.31               |

## 修正総合利回り計算表

( 2008年 4月 1日 ~ 2009年 3月 31日 )

01234560

株式会社

厚生年金基金 御中

第一生命保険株式会社

(単位:円・%)

| 利 益                       | 前 期 末 時 価 総 額<br>( 2008年 3月31日 現在 ) | 当 期 末 時 価 総 額<br>( 2009年 3月31日 現在 ) | 期 中 平 均 残 高<br>( 期中日数: 365 日 ) | 総 合 収 益    | 修 正 総 合 利 回 り<br>/ |
|---------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|--------------------------------|------------|--------------------|
| 債 券                       | 0                                   | 0                                   | 0                              | 0          | -                  |
| 合 同 運 用 口                 | 0                                   | 0                                   | 0                              | 0          | -                  |
| 国 内 債 券 計                 | 0                                   | 0                                   | 0                              | 0          | -                  |
| 新 株 予 約 権 付 社 債           | 0                                   | 0                                   | 0                              | 0          | -                  |
| 合 同 運 用 口                 | 0                                   | 0                                   | 0                              | 0          | -                  |
| 国 内 新 株 予 約 権 付 社 債 計     | 0                                   | 0                                   | 0                              | 0          | -                  |
| 株 式                       | 0                                   | 0                                   | 0                              | 0          | -                  |
| 合 同 運 用 口                 | 0                                   | 0                                   | 0                              | 0          | -                  |
| 国 内 株 式 計                 | 0                                   | 0                                   | 0                              | 0          | -                  |
| 外 貨 建 債 券                 | 0                                   | 0                                   | 0                              | 0          | -                  |
| 合 同 運 用 口                 | 0                                   | 0                                   | 0                              | 0          | -                  |
| 外 国 債 券 計                 | 0                                   | 0                                   | 0                              | 0          | -                  |
| 外 貨 建 株 式                 | 0                                   | 0                                   | 0                              | 0          | -                  |
| 合 同 運 用 口                 | 0                                   | 0                                   | 0                              | 0          | -                  |
| 外 国 株 式 計                 | 0                                   | 0                                   | 0                              | 0          | -                  |
| 合 同 運 用 口                 | 0                                   | 0                                   | 0                              | 0          | -                  |
| 貸 付 金                     | 0                                   | 0                                   | 0                              | 0          | -                  |
| 不 動 産                     | 0                                   | 0                                   | 0                              | 0          | -                  |
| そ の 他                     | 0                                   | 0                                   | 0                              | 0          | -                  |
| そ の 他 資 産 計               | 0                                   | 0                                   | 0                              | 0          | -                  |
| 円 貨 短 期 資 金               | 0                                   | 0                                   | 0                              | 0          | -                  |
| 合 同 運 用 口                 | 0                                   | 0                                   | 0                              | 0          | -                  |
| 外 貨 資 金                   | 0                                   | 0                                   | 0                              | 0          | -                  |
| 未 収 金 ・ 未 払 金             | 0                                   | 0                                   | 0                              | 0          | -                  |
| 外 貨 未 収 金 ・ 外 貨 未 払 金     | 0                                   | 0                                   | 0                              | 0          | -                  |
| 短 期 資 金 計                 | 0                                   | 0                                   | 0                              | 0          | -                  |
| 特 別 勘 定 ( 総 合 口 )         | 0                                   | 0                                   | 0                              | 0          | -                  |
| 一 般 勘 定                   | 5,902,590,000                       | 5,985,080,000                       | 5,942,070,000                  | 92,780,000 | 1.24               |
| 有 期 利 率 保 証 特 約 ( 無 配 当 ) | 0                                   | 0                                   | 0                              | 0          | -                  |
| 合 計                       | 5,902,590,000                       | 5,985,080,000                       | 5,942,070,000                  | 92,780,000 | 1.24               |
| 特 別 勘 定 ( 第 1 特 約 )       | 0                                   | 0                                   | 0                              | 0          | -                  |
| 特 別 勘 定 ( 第 2 特 約 )       | 0                                   | 0                                   | 0                              | 0          | -                  |
| 一 般 勘 定                   | 5,902,590,000                       | 5,902,590,000                       | 5,902,590,000                  | 92,780,000 | 1.25               |
| 有 期 利 率 保 証 特 約 ( 無 配 当 ) | 0                                   | 0                                   | 0                              | 0          | -                  |
| 元 本 合 計                   | 5,902,590,000                       | 5,902,590,000                       | 5,902,590,000                  | 92,780,000 | 1.25               |



運 用 実 績 表 ( 月 次 )

( 2008年 4月 1日 ~ 2009年 3月 31日 運用期中日数 : 365 日間 )

01234560

株式会社

厚生年金基金 御中

第一生命保険株式会社

時 価 総 額

( 単位 : 円 )

|               | 2008 年3月末     | 2008 年4月末     | 2008 年5月末     | 2008 年6月末     | 2008 年7月末     | 2008 年8月末     | 2008 年9月末     |
|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|
| 国 内 債 券       | 0             | 0             | 0             | 0             | 0             | 0             | 0             |
| 国内新株予約権付社債    | 0             | 0             | 0             | 0             | 0             | 0             | 0             |
| 国 内 株 式       | 0             | 0             | 0             | 0             | 0             | 0             | 0             |
| 外 国 債 券       | 0             | 0             | 0             | 0             | 0             | 0             | 0             |
| 外 国 株 式       | 0             | 0             | 0             | 0             | 0             | 0             | 0             |
| そ の 他 資 産     | 0             | 0             | 0             | 0             | 0             | 0             | 0             |
| 短 期 資 金       | 0             | 0             | 0             | 0             | 0             | 0             | 0             |
| 特別勘定(総合口)     | 0             | 0             | 0             | 0             | 0             | 0             | 0             |
| 一 般 勘 定       | 5,902,590,000 | 5,910,730,000 | 5,919,130,000 | 5,919,220,000 | 5,934,610,000 | 5,945,000,000 | 5,952,120,000 |
| 有期利率保証特約(無配当) | 0             | 0             | 0             | 0             | 0             | 0             | 0             |
| 合 計           | 5,902,590,000 | 5,910,730,000 | 5,919,130,000 | 5,919,220,000 | 5,934,610,000 | 5,945,000,000 | 5,952,120,000 |

|               | 2008 年10月末    | 2008 年11月末    | 2008 年12月末    | 2009 年1月末     | 2009 年2月末     | 2009 年3月末     | 2008 年度平均     |
|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|
| 国 内 債 券       | 0             | 0             | 0             | 0             | 0             | 0             | 0             |
| 国内新株予約権付社債    | 0             | 0             | 0             | 0             | 0             | 0             | 0             |
| 国 内 株 式       | 0             | 0             | 0             | 0             | 0             | 0             | 0             |
| 外 国 債 券       | 0             | 0             | 0             | 0             | 0             | 0             | 0             |
| 外 国 株 式       | 0             | 0             | 0             | 0             | 0             | 0             | 0             |
| そ の 他 資 産     | 0             | 0             | 0             | 0             | 0             | 0             | 0             |
| 短 期 資 金       | 0             | 0             | 0             | 0             | 0             | 0             | 0             |
| 特別勘定(総合口)     | 0             | 0             | 0             | 0             | 0             | 0             | 0             |
| 一 般 勘 定       | 5,960,510,000 | 5,968,600,000 | 5,977,020,000 | 5,985,410,000 | 5,992,990,000 | 5,985,080,000 | 5,950,850,000 |
| 有期利率保証特約(無配当) | 0             | 0             | 0             | 0             | 0             | 0             | 0             |
| 合 計           | 5,960,510,000 | 5,968,600,000 | 5,977,020,000 | 5,985,410,000 | 5,992,990,000 | 5,985,080,000 | 5,950,850,000 |

時間加重収益率

( 単位 : % )

|               | 4月   | 5月   | 6月   | 7月   | 8月   | 9月   | 10月  | 11月  | 12月  | 1月   | 2月   | 3月  | 2008年度 |
|---------------|------|------|------|------|------|------|------|------|------|------|------|-----|--------|
| 国 内 債 券       | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -   | -      |
| 国内新株予約権付社債    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -   | -      |
| 国 内 株 式       | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -   | -      |
| 外 国 債 券       | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -   | -      |
| 外 国 株 式       | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -   | -      |
| そ の 他 資 産     | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -   | -      |
| 短 期 資 金       | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -   | -      |
| 特別勘定(総合口)     | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -   | -      |
| 一 般 勘 定       | 0.10 | 0.11 | 0.10 | 0.11 | 0.11 | 0.10 | 0.11 | 0.10 | 0.11 | 0.11 | 0.09 | 0.1 | 1.25   |
| 有期利率保証特約(無配当) | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -   | -      |
| 合 計           | 0.10 | 0.11 | 0.10 | 0.11 | 0.11 | 0.10 | 0.11 | 0.10 | 0.11 | 0.11 | 0.09 | 0.1 | 1.25   |

## 報告書のご提供方法について

「資産運用状況表」「損益状況表」「運用実績表」「修正総合利回り計算表」のご提供方法  
標記帳票につきましては、毎月ご提供いたします。

なお、3月分報告につきましては、4月と5月の2回のご提供となります。（以降、1回目のご報告を『3月分報告（例月版）』、2回目のご報告を『3月分報告（再送版）』といいます。）  
ご報告内容は、月次データ、四半期データ、年度始来累計データから構成されます。

「貸借対照表」「損益計算書」「付表」「運用実績表（月次）」のご提供方法  
標記帳票につきましては、年1回5月にご提供いたします。

## 一般勘定系商品（厚生年金基金保険一般勘定、有期利率保証特約（無配当））のデータ作成基準について

4月分報告～3月分報告（例月版）について

上記報告書については、弊社において当月内（年度始来累計等の通期報告においては当月末まで）に入出金があった取引を対象に作成いたします。したがって、  
受託機関間で送金途上の資金等いわゆる未配付等資産については報告数値に反映しておりません。

また、3月分報告（例月版）につきましては、「固有の保険事務費」、「契約者配当金（有期利率保証特約（無配当）を除く）」を反映しておりません。

3月分報告（再送版）について

上記報告書については、弊社において当月内（年度始来累計等の通期報告においては当月末まで）に入出金があった取引および総幹事会社において当年度末までに入出金があった  
取引を対象に作成いたします。

## 「貸借対照表」について

貸借対照表は、決算日における年金資産の資産価額を時価・約定ベースで表示するものです。

- （1）資産価額は、決算日での時価評価額に未収収益を加算した数値を表示しています。
- （2）決算日での既約定未受渡代金相当額を「未払金」（購入時）、「未収金」（売却時）として、それぞれ負債項目、資産項目に表示しています。なお、資産運用状況表においては、「未収金・未払金」としてネットの金額を資産項目に計上しています。
- （3）デリバティブ資産については評価損益額を原資産に含めて計上しています。（オプションについてはプレミアムの時価評価額を原資産に含めて表示しています。）
- （4）為替については、原資産そのものの評価に係るものは原資産に含めて表示していますが、外貨建資産全体に対するヘッジ等の為替取引に伴う時価評価額については「外貨資金」に表示しています。
- （5）特別勘定第1特約については、総合口におけるお客様持ち分の時価総額を総合口ファンド全体の資産配分比率に基づいて按分し、投資対象別口における各口お客様持ち分の時価総額と合算して、  
該当資産の合同運用口に計上しています。

## 「損益計算書」について

損益計算書は、期中での年金資産の運用損益を、未収収益や評価損益も加味して表示するものです。

- （1）特別勘定第2特約の運用収益（総合収益）は、各資産毎の実現損益（インカム収益、売却損益、その他損益等）に、評価損益増減と未収収益増減を加えています。
- （2）運用取引に係る利益（売却益等）と損失（売却損等）はネットで表示しています。
- （3）費用項目には運用および管理に係る報酬、特別法人税等の金額を決算日での未払分も含めて計上しています。
- （4）デリバティブ資産の損益は原資産に含めて計上しています。
- （5）ヘッジ等の為替取引に伴う損益は、原則「外貨資金」に計上しています。但し、特定資産で損益を認識できる場合は、該当資産に計上しています。
- （6）外貨未払金、外貨未収金については計上時と受渡時との間では為替損益が発生することがあり、発生した為替損益は「外貨資金」に計上しています。

## 「付表」について

付表は、貸借対照表、損益計算書に加えて財政決算の基礎数値を提供するものです。

## 「資産運用状況表」について

資産運用状況表は、期中における年金資産の増減を時価・約定ベースで表示するものです。

- (1) 「その他」には運用、回収以外の要因（予定利息、市場変動、未収収益の増減等）による増減額を表示しています。
- (2) 「未収金・未払金」は未収金と未払金との移動額を相殺したネットに表示しています。このためマイナスとなる場合があります。
- (3) 先物等のデリバティブ資産は原資産に含めて計上しています。
- (4) 為替については、原資産そのものの評価に係るものは原資産に含めて表示していますが、外貨建資産全体に対するヘッジ等の為替取引については「外貨資金」に表示しています。

## 「損益状況表」について

損益状況表は、期中に発生した損益の内訳を約定ベースで表示するものです。

- (1) 先物等のデリバティブ資産の損益は原資産に含めて表示しています。
- (2) 外貨既経過利息前払金、外貨委託証拠金で発生した為替損益は原資産に、外貨未収金、外貨未払金で発生した為替損益は「外貨資金」に計上しています。
- (3) 「その他損益」には、雑損益を計上しています。

## 「運用実績表」について

運用実績表は、基準日における年金資産の時価総額と時間加重収益率を資産毎に約定ベースで表示するものです。

- (1) 既経過利息前払金、委託証拠金は原資産に含めて計上しています。
- (2) 「未収金・未払金」は未収金の残高と未払金の残高をネットに表示しています。このためマイナスとなることがあります。
- (3) 決算処理に伴う未収収益、評価損益の繰入・戻入は時間加重収益率計算上のキャッシュフロー認識を行っておりません。
- (4) 時間加重収益率は、下記の算式により算出しております。

< 修正ディーツ法 >

$$R = \frac{S_{n+1} - S_n - (C_{in} - C_{out})}{S_n + (C_{in} \text{積数} - C_{out} \text{積数}) / t}$$

R : 月次収益率

$S_{n+1}$  : 月末「時価総額」(当月末時点の時価残高 + 未収収益)

$S_n$  : 月初「時価総額」(前月末時点の時価残高 + 未収収益)

$C_{in}$  : 月中流入資金(キャッシュイン)の合計: 「運用額」の月中累計

$C_{out}$  : 月中流出資金(キャッシュアウト)の合計: 「回収額」の月中累計

$C_{in}$ 積数 : CF積数(イ) = (各 $C_{in}$  × 各 $C_{in}$ の発生日から当月末日までの日数)

$C_{out}$ 積数 : CF積数(ア) = (各 $C_{out}$  × 各 $C_{out}$ の発生日から当月末日までの日数)

t : 当月の月中日数 = 「終了年月日」 - 「開始年月日」 + 1

$$\text{時間加重収益率(通期)} = \{ (1 + R_1) \times (1 + R_2) \times (1 + R_3) \times \dots \times (1 + R_n) \} - 1$$

(%表示、小数点以下第3位四捨五入)

注) 一般勘定系商品の時間加重収益率につきましては、特に下記の点にご留意下さい。

一般勘定系商品は、通常一定期間単利で付利される利率保証型商品となっております。キャッシュフローの発生状況や、その残高が負値になった場合等には、時間加重収益率が異常値となることがあります。

単利運用商品について時間加重収益率を算出した場合、同一の保証利率であっても、キャッシュフローの発生状況等により値は変化し、修正総合利回りとも大きく乖離することがあります。

これは時間加重収益率が複利の概念であることに起因しており、これらの商品は、時間加重収益率の概念になじみにくいものと言えます。

## 「修正総合利回り計算表」について

修正総合利回り計算表は、基準日における年度資産の修正総合利回りをその計算基礎数値とともに、資産毎に約定ベースで表示するものです。

「元本」以外の項目の「期中平均残高」は、

一般勘定系商品については、

当該資産の簿価積数（簿価残高×運用日数）期中累計÷期中日数。

特別勘定第1特約については、

当該資産の積立金積数（積立金残高×運用日数）期中累計÷期中日数 + 前期末評価損益。

特別勘定第2特約については、

当該資産の取得原価積数（取得原価残高×運用日数）期中累計÷期中日数 + 前期末評価損益 + 前期末未収収益。

「元本」の項目の「期中平均残高」は、

一般勘定系商品については、

当該資産の元本積数（元本残高×運用日数）期中累計÷期中日数。

特別勘定第1特約については、

平成12年度 … 当該資産の元本積数（元本残高×運用日数）期中累計÷期中日数 + 前期末評価損益。

平成13年度以降… 当該資産の元本積数（元本残高×運用日数）期中累計÷期中日数 - 前保険年度末評価損益 + 前期末評価損益。

特別勘定第2特約については、

平成12年度 … 当該資産の元本積数（元本残高×運用日数）期中累計÷期中日数 - 前保険年度末未収収益 + 前期末評価損益 + 前期末未収収益。

平成13年度以降… 当該資産の元本積数（元本残高×運用日数）期中累計÷期中日数 - 前保険年度末評価損益 - 前保険年度末未収収益 + 前期末評価損益 + 前期末未収収益。

## 「運用実績表（月次）」について

運用実績表（月次）は、毎月末の時価総額およびこれらの年度平均、ならびに月次ベース・年次ベースの時間加重収益率を資産毎に表示するものです。

時価総額の「年度平均」については、各月の時価総額の年度平均（投入時期等に依らず13ヶ月で除した値）を表示しています。