



01234560

〒123 - 4567

県 市 ××区

000番地

統一ディスクローズ資料

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

見本

01234560
株式会社

貸 借 対 照 表

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		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	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 (自 2007年 4月 2日) (至 2008年 3月 31日)	当 期 (自 2008年 4月 1日) (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 (自 2007年 4月 2日) (至 2008年 3月 31日)	当 期 (自 2008年 4月 1日) (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 (+)		
	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 (2009年 2月28日現在)		増 減 額				当 期 末 時 価 総 額 (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)

- 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

(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 (2008年12月31日現在)		増 減 額				当 期 末 時 価 総 額 (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 (2008年 3月31日現在)		増 減 額				当 期 末 時 価 総 額 (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 (+ +)
		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 (+ +)
		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 (+ +)
		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 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 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 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 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 (2009年 2月28日 現在)	当 期 末 時 価 総 額 (2009年 3月31日 現在)	期 中 平 均 残 高 (期中日数： 31日)	総 合 収 益	修 正 総 合 利 回 り /
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 (2008年12月31日 現在)	当 期 末 時 価 総 額 (2009年 3月31日 現在)	期 中 平 均 残 高 (期中日数： 90日)	総 合 収 益	修 正 総 合 利 回 り /
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 (2008年 3月31日 現在)	当 期 末 時 価 総 額 (2009年 3月31日 現在)	期 中 平 均 残 高 (期中日数 : 365 日)	総 合 収 益	修 正 総 合 利 回 り /
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。