

平成23年度 長期給付積立金の運用状況(第2四半期)

1 資産構成割合の推移

	平成23年3月末		→	平成23年6月末		→	(単位:億円) 平成23年9月末		(参考)	
	時価総額	構成割合		時価総額	構成割合		時価総額	構成割合	基本ポートフォリオ 中心値	許容乖離幅
国内債券	57,826	61.8%		57,618	64.2%		57,044	64.8%	63%	±6%
国内株式	11,100	11.9%		10,799	12.0%		9,868	11.2%	12%	±5%
外国債券	3,852	4.1%		3,873	4.3%		3,770	4.3%	5%	±3%
外国株式	9,182	9.8%		9,013	10.0%		7,262	8.3%	9%	±5%
貸付金	5,560	5.9%		5,113	5.7%		4,934	5.6%	6%	±3%
短期資産運用等	6,070	6.5%		3,376	3.8%		5,120	5.8%	5%	±2%
合計	93,590	100.0%		89,792	100.0%		87,999	100.0%	100%	—

注 それぞれの項目は、単位未満について四捨五入しているため、必ずしも合計と一致しない。

2 運用状況

〈修正総合利回り〉

	平成23年度第1四半期 (4~6月)	平成23年度第2四半期 (7~9月)	平成23年度通期 (4月~9月)
国内債券	+0.99%	+1.08%	+2.09%
国内株式	△1.84%	△10.00%	△11.60%
外国債券	+0.63%	△4.02%	△3.41%
外国株式	△1.75%	△21.50%	△22.78%
貸付金	+0.60%	+0.60%	+1.20%
短期資産運用等	+0.01%	△0.07%	△0.07%
合計	+0.28%	△2.79%	△2.50%

(参考)

平成22年度
+1.92%
△6.50%
△6.73%
+4.15%
+2.40%
△0.03%
+0.80%

$$\text{修正総合利回り} = \frac{\text{実現損益} + \text{未収収益増減} + \text{評価損益増減}}{\text{簿価平残} + \text{前期末未収収益} + \text{前期末評価損益}} \times 100(\%)$$