

平成25年度 長期給付積立金の運用状況(第3四半期)

1 資産構成割合の推移

	平成25年3月末		→	平成25年6月末		→	平成25年9月末		→	(単位:億円) 平成25年12月末		(参考) 基本ポートフォリオ	
	時価総額	構成割合		時価総額	構成割合		時価総額	構成割合		時価総額	構成割合	中心値	許容乖離幅
国内債券	59,602	61.0%		58,665	62.0%		59,684	61.2%		60,536	61.1%	63%	±6%
国内株式	12,615	12.9%		12,788	13.5%		13,610	14.0%		14,516	14.7%	12%	±5%
外国債券	5,129	5.3%		5,317	5.6%		5,079	5.2%		5,491	5.5%	5%	±3%
外国株式	9,942	10.2%		9,573	10.1%		10,236	10.5%		11,486	11.6%	9%	±5%
貸付金	3,754	3.8%		3,363	3.6%		3,230	3.3%		3,087	3.1%	6%	±3%
短期資産運用等	6,616	6.8%		4,932	5.2%		5,689	5.8%		3,943	4.0%	5%	±2%
合計	97,657	100.0%		94,638	100.0%		97,529	100.0%		99,059	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25年度第1四半期 (4~6月)	平成25年度第2四半期 (7~9月)	平成25年度第3四半期 (10~12月)	平成25年度通期 (4月~12月)
国内債券	△1.32%	+1.06%	+0.18%	△0.08%
国内株式	+9.91%	+5.90%	+8.85%	+26.37%
外国債券	+3.89%	+1.84%	+8.01%	+13.94%
外国株式	+6.59%	+7.24%	+16.17%	+31.76%
貸付金	+0.60%	+0.60%	+0.60%	+1.81%
短期資産運用等	+0.09%	△0.01%	+0.16%	+0.24%
合計	+1.37%	+2.29%	+3.48%	+7.23%

(参考)

平成24年度
+3.78%
+22.27%
+17.83%
+28.28%
+2.39%
+0.32%
+9.04%

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