

平成27年度 長期給付積立金の運用状況(第1四半期)

1 資産構成割合の推移

	平成27年3月末		(単位:億円) 平成27年6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	中心値	許容乖離幅
国内債券	61,541	58.4%	60,805	59.4%	63%	±6%
国内株式	16,429	15.6%	17,304	16.9%	12%	±5%
外国債券	6,196	5.9%	6,870	6.7%	5%	±3%
外国株式	12,806	12.2%	13,105	12.8%	9%	±5%
貸付金	2,350	2.2%	2,094	2.0%	6%	±3%
短期資産運用等	6,045	5.7%	2,157	2.1%	5%	±2%
合計	105,367	100.0%	102,336	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27年度第1四半期 (4~6月)
国内債券	△0.11%
国内株式	+5.88%
外国債券	+0.57%
外国株式	+2.31%
貸付金	+0.60%
短期資産運用等	+0.13%
合計	+1.22%

(参考)

平成26年度
+2.35%
+29.71%
+11.77%
+22.51%
+2.39%
+0.34%
+8.66%

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