

# 平成24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24年3月末 |        | → | 平成24年6月末 |        | → | (単位:億円)<br>平成24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<br>中心値 | 許容乖離幅 |
| 国内債券    | 56,906   | 61.3%  |   | 56,766   | 65.0%  |   | 56,252              | 63.7%  | 63%              | ±6%   |
| 国内株式    | 11,665   | 12.6%  |   | 10,404   | 11.9%  |   | 10,128              | 11.5%  | 12%              | ±5%   |
| 外国債券    | 4,178    | 4.5%   |   | 4,027    | 4.6%   |   | 4,042               | 4.6%   | 5%               | ±3%   |
| 外国株式    | 9,570    | 10.3%  |   | 8,740    | 10.0%  |   | 9,160               | 10.4%  | 9%               | ±5%   |
| 貸付金     | 4,583    | 4.9%   |   | 4,202    | 4.8%   |   | 4,047               | 4.6%   | 6%               | ±3%   |
| 短期資産運用等 | 5,989    | 6.4%   |   | 3,140    | 3.6%   |   | 4,691               | 5.3%   | 5%               | ±2%   |
| 合計      | 92,890   | 100.0% |   | 87,280   | 100.0% |   | 88,320              | 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24年度第1四半期<br>(4月～6月) | 平成24年度第2四半期<br>(7月～9月) | 平成24年度通期<br>(4月～9月) |
|---------|------------------------|------------------------|---------------------|
| 国内債券    | +1.16%                 | +0.54%                 | +1.71%              |
| 国内株式    | △10.00%                | △3.52%                 | △13.12%             |
| 外国債券    | △3.64%                 | +0.36%                 | △3.29%              |
| 外国株式    | △7.54%                 | +4.93%                 | △3.04%              |
| 貸付金     | +0.60%                 | +0.60%                 | +1.20%              |
| 短期資産運用等 | △0.02%                 | △0.01%                 | △0.04%              |
| 合計      | △1.50%                 | +0.46%                 | △1.05%              |

(参考)

| 平成23年度 |
|--------|
| +2.82% |
| +1.41% |
| +4.56% |
| +1.12% |
| +2.40% |
| +0.15% |
| +2.38% |

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