

平成26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26年3月末		→	平成26年6月末		→	平成26年9月末		→	(単位:億円) 平成26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	60,839	60.8%		61,039	62.7%		60,929	60.7%		61,992	60.7%	63%	±6%
国内株式	13,498	13.5%		13,189	13.5%		13,974	13.9%		14,831	14.5%	12%	±5%
外国債券	5,516	5.5%		5,545	5.7%		5,819	5.8%		6,396	6.3%	5%	±3%
外国株式	11,461	11.5%		11,047	11.3%		11,269	11.2%		12,581	12.3%	9%	±5%
貸付金	2,957	3.0%		2,653	2.7%		2,546	2.5%		2,456	2.4%	6%	±3%
短期資産運用等	5,803	5.8%		3,926	4.0%		5,781	5.8%		3,836	3.8%	5%	±2%
合計	100,074	100.0%		97,399	100.0%		100,318	100.0%		102,093	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26年度第1四半期 (4~6月)	平成26年度第2四半期 (7~9月)	平成26年度第3四半期 (10~12月)	平成26年度通期 (4~12月)
国内債券	+0.74%	+0.48%	+1.54%	+2.77%
国内株式	+5.03%	+5.95%	+6.19%	+17.85%
外国債券	+0.49%	+5.34%	+9.25%	+15.42%
外国株式	+3.01%	+5.77%	+11.26%	+20.38%
貸付金	+0.60%	+0.60%	+0.60%	+1.81%
短期資産運用等	△0.03%	+0.15%	+0.22%	+0.36%
合計	+1.50%	+2.06%	+3.65%	+7.30%

(参考)

平成25年度
+0.72%
+17.70%
+14.48%
+31.62%
+2.39%
+0.20%
+6.64%

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