

## 平成27年4月～平成28年3月の運用実績

一般の中小企業退職金共済事業等勘定 給付経理 (平成28年3月末)

### 資産運用状況

(単位：億円、%)

運用の方法等		平成27年3月末			平成28年3月末		
		資産額	構成比	利回り	資産額	構成比	利回り
運用 自家	有価証券	24,146	52.76	1.25	24,066	52.74	1.00
	預金	1,040	2.27	0.04	1,556	3.41	0.03
	小計	25,186	55.03	1.22	25,622	56.16	0.97
運用 委託	金銭信託	18,601	40.64	14.60	18,425	40.38	△ 2.84
	生命保険資産	1,979	4.33	1.98	1,580	3.46	1.45
	有価証券信託	(11,910)	(49.32)	0.01	(11,048)	(45.91)	0.01
	小計	20,581	44.97	13.24	20,005	43.84	△ 2.48
合計		45,767	100.00	6.61	45,628	100.00	△ 0.58

\* 金銭信託（新団体生存保険含む）は時価総額、その他の資産は帳簿価額である。

\* 平成28年3月末の利回りは決算確定前の利回りである。

\* 有価証券信託は自家運用により取得した有価証券の信託による運用であり、内数である。  
また、構成比は有価証券に対する構成比である。

\* 単位未満は四捨五入しているため、内訳と計が一致しないことがある。

### 金銭信託（新団体生存保険含む）

(単位：億円、%)

	時価総額	時間加重 収益率 (①)	ベンチマーク 騰落率 (②)	超過収益率 (①-②)
国内債券	7,657	5.65	5.40	0.25
国内株式	3,597	△ 11.39	△ 10.82	△ 0.57
外国債券	3,623	△ 2.63	△ 2.74	0.11
外国株式	3,549	△ 9.25	△ 8.64	△ 0.60
合計	18,425	△ 2.63	-	△ 0.12

\* 超過収益率の合計は、基本ポートフォリオに定める各資産の資産配分で加重した合計値である。

\* 単位未満は四捨五入しているため、内訳と計が一致しないことがある。