

平成28年4月～9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9月末）

資産運用状況

（単位：億円、%）

運用の方法等		平成28年3月末			平成28年9月末		
		資産額	構成比	利回り	資産額	構成比	利回り
運自家	有価証券	24,066	52.74	1.00	24,048	53.08	0.77
	預金	1,556	3.41	0.03	1,560	3.44	0.00
	小計	25,622	56.16	0.97	25,608	56.52	0.73
運委用託	金銭信託	18,425	40.38	△ 2.84	17,993	39.71	△ 4.68
	生命保険資産	1,580	3.46	1.45	1,707	3.77	1.17
	有価証券信託	(11,048)	(45.91)	0.01	(9,868)	(41.03)	0.02
	小計	20,005	43.84	△ 2.48	19,700	43.48	△ 4.18
合計		45,628	100.00	△ 0.58	45,308	100.00	△ 1.44

* 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月末の金銭信託の資産額は中退共資産の資産額、当月末の金銭信託の資産額は合同運用の全体額を総口数で除して求めた額に中退共資産の保有口数を乗じて算出した額である。

* 平成28年3月末の利回りは決算利回り、当月末の利回りは年率換算利回りであり費用控除前である。

* 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	7,740	0.79	0.68	0.11
国内株式	3,584	△ 0.19	△ 0.79	0.60
外国債券	3,300	△ 8.66	△ 8.71	0.05
外国株式	3,369	△ 4.83	△ 4.56	△ 0.26
合計	17,993	△ 2.33	-	0.12

* 時価総額は、合同運用の全体額を総口数で除して求めた額に中退共資産の保有口数を乗じて算出した額である。

* 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。