

平成28年4月～平成29年3月の運用実績

林業退職金共済事業等勘定 給付経理 (平成29年3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29年3月末		
		資産額	構成比	利回り	資産額	構成比	利回り
運自 用家	有価証券	72	51.28	1.16	78	54.07	0.83
	預金	16	11.67	0.01	15	10.20	-
	小計	89	62.95	1.07	93	64.27	0.69
運委 用託	金銭信託	52	37.05	4.20	52	35.73	4.70
	小計	52	37.05	4.20	52	35.73	4.70
合計		141	100.00	2.23	145	100.00	2.10

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

* 平成29年3月末の金銭信託の資産額は林退共資産の資産額、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林退共資産の保有口数を乗じて算出した額である。

* 利回りは決算利回りである。

* 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	25	△ 1.04	△ 1.15	0.11
国内株式	9	15.49	14.69	0.80
外国債券	13	△ 1.89	△ 4.15	2.26
外国株式	5	14.09	14.51	△ 0.41
合計	52	4.77	-	0.62

* 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林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。

* 基本ポートフォリオ改定に伴い、平成29年2月1日に外国債券のベンチマークを為替ヘッジ付きの指数に変更した。

収益率の差+2.26%のうち、為替ヘッジを平成28年12月末に先行して実施した影響+2.04%が平成29年1月に発生している

* 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。