

運用資産の構成状況(令和5年9月末)

一般の中小企業退職金共済事業等勘定 給付経理

当月末の運用資産構成状況は、次のとおりである。

(単位：百万円)

資産区分	基本ポートフォリオ	資産額	資産構成比
自家運用	56.9%	3,079,510	57.4%
委託運用	国内債券	1,098,517	20.5%
	国内株式	238,909	4.5%
	外国債券	468,199	8.7%
	外国株式	477,812	8.9%
	委託運用小計	2,283,437	42.6%
合計	100.0%	5,362,948	100.0%

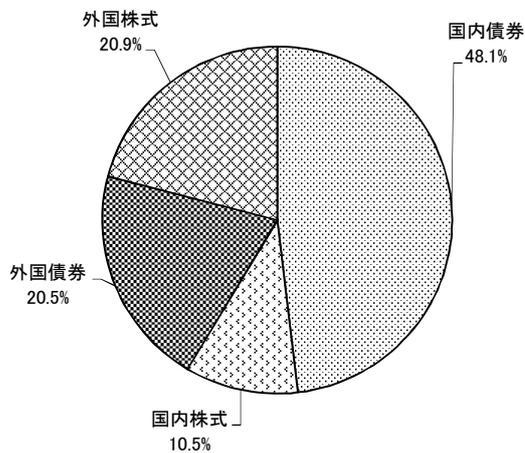
- (注) 1. 自家運用(簿価)は、国内債券(簿価)のほか生命保険(一般勘定)、短期資産を含んでおり、委託運用は包括信託のみである。
 2. 委託運用の資産額は、合同運用の全体額を総口数で除して求めた額に各経理毎の保有口数を乗じて算出した額である。
 3. 単位未満は四捨五入しているため、内訳と計が一致しないことがある。

うち委託運用部分と乖離許容幅※

資産区分	基本ポートフォリオ	資産構成比	乖離許容幅	乖離状況
国内債券	50.7%	48.1%	±5.3%	△ 2.6%
国内株式	9.0%	10.5%	±2.4%	1.5%
外国債券	22.0%	20.5%	±2.4%	△ 1.5%
外国株式	18.3%	20.9%	±5.3%	2.6%
計	100.0%	100.0%	—	—

※令和3年10月に移行した新基本ポートフォリオでは、自家運用部分は流動性確保を目的とした簿価評価資産、委託運用部分は利回り獲得を目的とした時価評価資産、という役割や評価方法の違いに鑑みて、基本ポートフォリオの効率性を維持するための乖離許容幅は、委託運用部分のみに設定した。

資産構成比(委託運用部分)



基本ポートフォリオ乖離状況(委託運用部分)

