

# 令和5年9月末 資産構成割合状況表及び運用実績表

(単位：百万円)

|           | 内容                | 国内債券  | オルタナ  | 一般勘定  | 国内株式  | 外国債券  | 外国株式  | 短期資産  | 合計     | 修正<br>総合収益率 | ファンド単体<br>収益率 | 比較対象   | 超過収益    |
|-----------|-------------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|-------------|---------------|--------|---------|
| 三菱UFJ信託銀行 | バッシブバランス          | 1,720 |       |       | 192   | 540   | 626   | 699   | 3,777  | 2.88%       | ---           | ---    | ---     |
|           | ロングターム・グローバル・グロース |       |       |       |       |       |       | 0     | 0      | 12.99%      | 16.53%        | 15.83% | +0.70%  |
|           | モルガンスタンレー         |       |       |       |       |       | 548   | 0     | 548    | 13.76%      | 13.14%        | 15.83% | ▲2.69%  |
|           | 東急不動産             |       | 482   |       |       |       |       | 0     | 482    | 1.86%       | 1.88%         | 1.00%  | +0.88%  |
|           | クオリティスプレッド        | 260   |       |       |       |       |       | 0     | 260    | 1.19%       | 1.16%         | ▲2.57% | +3.73%  |
| みずほ信託銀行   | 国内債券バッシブ          |       |       |       |       |       |       | 0     | 0      | 0.00%       | ---           | ---    | ---     |
|           | 44公社債口            | 296   |       |       |       |       |       | 0     | 296    | 0.21%       | 0.21%         | ▲2.57% | +2.78%  |
|           | GLP不動産ファンド        |       | 502   |       |       |       |       | 18    | 519    | 3.88%       | 4.02%         | 1.00%  | +3.02%  |
|           | ヒューリック            |       | 64    |       |       |       |       | 1     | 65     | 3.18%       | 3.18%         | 1.00%  | +2.18%  |
|           | 東京建物              |       | 79    |       |       |       |       | 1     | 80     | 2.43%       | 2.43%         | 1.00%  | +1.43%  |
|           | 野村不動産             |       | 255   |       |       |       |       |       | 255    | 1.39%       | 1.57%         | 1.00%  | +0.57%  |
|           | 大和証券マンションファンド     |       | 123   |       |       |       |       |       | 123    | 0.00%       | 0.00%         | 1.00%  | ▲1.0%   |
| りそな銀行     | 国内債券バッシブ          | 222   |       |       |       |       |       | 308   | 530    | ▲1.21%      | ---           | ---    | ---     |
|           | 国内株式A口            |       |       |       | 629   |       |       |       | 629    | 16.29%      | 18.31%        | 17.25% | +1.06%  |
|           | 国内株式Z口（中小型）       |       |       |       | 185   |       |       |       | 185    | 2.15%       | 2.45%         | 17.25% | ▲14.81% |
| 三井住友信託銀行  | ブルーベイ             |       |       |       |       | 301   |       | 0     | 301    | 10.11%      | 10.17%        | 6.86%  | +3.31%  |
|           | ブルデンシャル           |       |       |       |       | 178   |       | 0     | 178    | 9.67%       | 9.53%         | 6.86%  | +2.67%  |
|           | スビーン（米国地方債）       |       | 119   |       |       |       |       |       | 119    | ▲6.19%      | ▲6.19%        | 1.00%  | ▲7.19%  |
|           | ウェリントンGTR         |       | 517   |       |       |       |       |       | 517    | 0.22%       | 0.22%         | 1.00%  | ▲0.78%  |
|           | 三菱商事私募REIT        |       | 57    |       |       |       |       | 353   | 410    | 0.83%       | 4.07%         | 1.00%  | +3.08%  |
| スパークス     | 長期厳選投資            |       |       |       | 206   |       |       | 70    | 276    | 13.98%      | 17.94%        | 17.25% | +0.69%  |
| 第一生命      | 新一般勘定             |       |       | 632   |       |       |       |       | 632    | 0.13%       | ---           | ---    | ---     |
|           | 第二総合口             |       |       |       |       |       |       |       |        | 1.00%       | 1.00%         | 1.00%  | +0.0%   |
| 日本生命      | 新一般勘定             |       |       | 363   |       |       |       |       | 363    | 0.25%       | ---           | ---    | ---     |
|           | 新一般勘定（2022）       |       |       | 945   |       |       |       |       | 945    | 0.25%       | ---           | ---    | ---     |
|           | 新一般勘定（無配当）        |       |       | 402   |       |       |       |       | 402    | 0.13%       | ---           | ---    | ---     |
| 合計        | ---               | 21.0% | 18.5% | 19.7% | 10.2% | 8.6%  | 9.9%  | 12.2% | 100.0% | 3.50%       |               |        |         |
|           |                   | 2,498 | 2,197 | 2,343 | 1,212 | 1,019 | 1,174 | 1,450 | 11,893 |             |               |        |         |
|           | 政策アセットミックス判定      | OK    | 要調整   | OK    | OK    | OK    | OK    | 要調整   |        | 修正<br>総合収益額 |               |        |         |
|           |                   |       |       |       |       |       |       |       |        | 406         |               |        |         |

|            | 国内債券 | オルタナ | 一般勘定 | 国内株式 | 外国債券 | 外国株式 | 短期資産 | 合計   |
|------------|------|------|------|------|------|------|------|------|
| 政策アセットミックス | 22%  | 30%  | 20%  | 9%   | 8%   | 9%   | 2%   | 100% |

## ベンチマーク推移

| 市場インデックス               |                          | 前年度3月末        | 4月          | 5月          | 6月          | 7月          | 8月          | 9月          | 10月 | 11月 | 12月 | 1月 | 2月 | 3月 | 年度利回り (%) |
|------------------------|--------------------------|---------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-----|-----|-----|----|----|----|-----------|
| 国内債券                   | NOMURA-BPI 総合            | 374.74        | 375.61      | 375.27      | 376.29      | 370.43      | 367.76      | 365.13      |     |     |     |    |    |    | -2.57     |
|                        | 新発10年国債利回り               | 0.32          | 0.385       | 0.430       | 0.395       | 0.600       | 0.640       | 0.770       |     |     |     |    |    |    | ---       |
| 国内株式                   | TOPIX(配当込)               | 3,324.74      | 3,414.45    | 3,537.93    | 3,805.00    | 3,861.80    | 3,878.51    | 3,898.26    |     |     |     |    |    |    | 17.25     |
|                        | 日経平均株価                   | 28,041.48     | 28,856.44   | 30,887.88   | 33,189.04   | 33,172.22   | 32,619.34   | 31,857.62   |     |     |     |    |    |    | 13.61     |
| 外国債券                   | FTSE WGBI (ex JAPAN)円ベース | 510.10        | 525.91      | 528.31      | 548.99      | 542.08      | 549.57      | 545.08      |     |     |     |    |    |    | 6.86      |
|                        | 米国10年国債利回り               | 3.470         | 3.425       | 3.646       | 3.840       | 3.960       | 4.110       | 4.570       |     |     |     |    |    |    | ---       |
| 外国株式                   | MSCI KOKUSAI             | 5,644.42      | 5,884.48    | 5,971.30    | 6,561.38    | 6,669.77    | 6,674.18    | 6,537.96    |     |     |     |    |    |    | 15.83     |
|                        | S&P500                   | 4,109.31      | 4,169.48    | 4,179.83    | 4,450.38    | 4,588.96    | 4,507.66    | 4,288.05    |     |     |     |    |    |    | 4.35      |
|                        | ダウ平均                     | 33,274.15     | 34,098.16   | 32,908.27   | 34,407.60   | 35,559.53   | 34,721.91   | 33,507.50   |     |     |     |    |    |    | 0.70      |
|                        | ナスダック総合指数                | 12,221.91     | 12,226.58   | 12,935.29   | 13,787.92   | 14,346.02   | 14,034.97   | 13,219.32   |     |     |     |    |    |    | 8.16      |
|                        | 上海総合                     | 3,272.86      | 3,323.28    | 3,204.56    | 3,202.06    | 3,291.04    | 3,119.88    | 3,110.48    |     |     |     |    |    |    | -4.96     |
| 為替                     | 円/ドル相場(ロンドン 16:00)       | 133.09        | 136.17      | 139.71      | 144.54      | 142.08      | 145.58      | 149.23      |     |     |     |    |    |    | 12.12     |
|                        | 円/ユーロ相場(ロンドン 16:00)      | 144.59        | 150.33      | 148.94      | 157.69      | 156.65      | 158.01      | 157.99      |     |     |     |    |    |    | 9.27      |
| <b>当基金修正総合収益率 A(%)</b> |                          | <b>▲ 0.07</b> | <b>1.04</b> | <b>1.61</b> | <b>3.77</b> | <b>3.62</b> | <b>3.82</b> | <b>3.50</b> |     |     |     |    |    |    |           |
| <b>複合ベンチマーク B(%)</b>   |                          | <b>▲ 0.29</b> | <b>0.98</b> | <b>1.52</b> | <b>3.54</b> | <b>3.43</b> | <b>3.48</b> | <b>3.16</b> |     |     |     |    |    |    |           |
| <b>A-B(%)</b>          |                          | <b>0.22</b>   | <b>0.06</b> | <b>0.09</b> | <b>0.23</b> | <b>0.19</b> | <b>0.34</b> | <b>0.34</b> |     |     |     |    |    |    |           |

