

令和6年3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 総合収益率	ファンド単体 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	1,573			182	583	623	808	3,769	8.73%	---	---	---	
	ロングターム・グローバル・グロース							0	0	29.65%	16.53%	18.17%	▲1.64%	運用終了
	モルガンスタンレー						511	0	511	32.10%	31.77%	42.92%	▲11.15%	
	東急不動産							0	0	5.66%	1.88%	1.00%	+0.88%	運用終了
	クオリティスブレッド	412						0	412	1.85%	1.84%	▲2.20%	+4.04%	
	レラティブバリュー		300						300	0.00%	0.00%	2.00%	▲2.0%	3月運用開始
	BAAM		300						300	0.00%	0.00%	2.00%	▲2.0%	3月運用開始
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	0.66%	0.66%	▲2.20%	+2.86%	
	GLP不動産ファンド		495					29	525	5.17%	5.42%	2.00%	+3.42%	
	ヒューリック		64					2	66	5.54%	5.58%	2.00%	+3.58%	
	東京建物		79					3	82	5.13%	5.19%	2.00%	+3.19%	
	野村不動産		260					1	262	4.68%	4.46%	2.00%	+2.46%	
	大和証券マンションファンド		124						124	0.96%	0.96%	2.00%	▲1.04%	
りそな銀行	国内債券バッシブ	21						193	214	▲1.35%	---	---	---	
	国内株式A口				607				607	37.90%	42.99%	41.34%	+1.65%	
	国内株式Z口 (中小型)				170				170	15.44%	17.67%	41.34%	▲23.67%	
	ブルックフィールド		530					228	758	0.05%	0.20%	2.00%	▲1.80%	3月運用開始
三井住友信託銀行	ブルーベイ					331		0	331	21.01%	21.25%	15.27%	+5.98%	
	ブルデンシャル					195		0	195	20.23%	20.59%	15.27%	+5.32%	
	スビーン (米国地方債)		124						124	▲2.73%	▲2.74%	2.00%	▲4.74%	
	ウェリントンGTR							679	679	▲1.01%	▲0.09%	2.00%	▲2.09%	
	三菱商事私募REIT		58						58	1.41%	8.49%	2.00%	+6.49%	
スパークス	長期厳選投資				211			59	270	38.62%	53.86%	41.34%	+12.52%	
第一生命	新一般勘定			635					635	0.92%	---	---	---	
	第二総合口									1.83%	1.00%	1.00%	+0.0%	運用終了
日本生命	新一般勘定			366					366	1.35%	---	---	---	
	新一般勘定 (2022)			1,355					1,355	1.15%	---	---	---	
	新一般勘定 (無配当)									0.13%	---	---	---	
合計	---	18.6%	18.8%	19.0%	9.4%	8.9%	9.1%	16.1%	100.0%	8.34%				
		2,303	2,335	2,356	1,170	1,108	1,134	2,003	12,409					
	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 総合収益額				
										1,029				

	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	359.31	366.88	368.38	365.75	366.90	366.50	-2.20
	新発10年国債利回り	0.32	0.385	0.430	0.395	0.600	0.640	0.770	0.950	0.660	0.620	0.730	0.710	0.730	---
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	3,781.64	3,986.65	3,977.63	4,288.36	4,499.61	4,699.20	41.34
	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	30,858.85	33,486.89	33,464.17	36,286.71	39,166.19	40,369.44	43.96
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	549.10	561.86	557.41	571.37	577.75	587.98	15.27
	米国10年国債利回り	3.470	3.425	3.646	3.840	3.960	4.110	4.570	4.930	4.330	3.880	3.910	4.250	4.200	---
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	6,451.43	6,894.85	6,902.61	7,228.89	7,724.69	8,067.19	42.92
	S&P500	4,109.31	4,169.48	4,179.83	4,450.38	4,588.96	4,507.66	4,288.05	4,193.80	4,567.80	4,769.83	4,845.65	5,096.27	5,254.35	27.86
	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	33,052.87	35,950.89	37,689.54	38,150.30	38,996.39	39,807.37	19.63
	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	12,851.24	14,226.22	15,011.35	15,164.01	16,091.92	16,379.46	34.02
	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	3,018.77	3,029.67	2,974.94	2,788.55	3,015.17	3,041.17	-7.08
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	151.45	147.84	140.98	146.18	149.67	151.35	13.72
	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	160.07	161.30	155.73	158.79	161.97	163.46	13.05
	当基金修正総合収益率 A (%)	▲ 0.07	1.04	1.61	3.77	3.62	3.82	3.50	2.75	4.32	4.37	6.16	7.68	8.34	
	複合ベンチマーク B (%)	▲ 0.29	0.98	1.52	3.54	3.43	3.48	3.16	2.52	4.37	4.44	5.72	7.07	8.11	
	A-B (%)	0.22	0.06	0.09	0.23	0.19	0.34	0.34	0.23	▲ 0.05	▲ 0.07	0.44	0.61	0.23	

