

令和6年8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	パッシブバランス	1,553			179	582	646	1,837	4,797	▲0.01%	---	---	---
	モルガンスタンレー						513	0	513	0.39%	0.39%	3.69%	▲3.30%
	クオリティスプレッド	413						0	413	0.34%	0.34%	▲1.41%	+1.75%
	レラティブバリュー		299						299	▲0.37%	▲0.37%	0.83%	▲1.20%
	BAAM		300					0	300	▲0.11%	▲0.11%	0.83%	▲0.94%
みずほ信託銀行	国内債券パッシブ							0	0	0.00%	---	---	---
	44公社債口	298						0	298	0.59%	0.59%	▲1.41%	+2.0%
	GLP不動産ファンド		501						501	1.21%	1.24%	0.83%	+0.41%
	ヒューリック		120					1	121	2.27%	1.88%	0.83%	+1.05%
	東京建物		80					2	82	2.98%	3.02%	0.83%	+2.19%
	野村不動産		264					4	268	2.96%	2.97%	0.83%	+2.14%
	大和証券マンションファンド		125						125	2.53%	2.50%	0.83%	+1.67%
りそな銀行	国内債券パッシブ	2						30	32	▲1.01%	---	---	---
	国内株式A口				599				599	▲1.29%	▲1.29%	▲1.79%	+0.50%
	国内株式Z口 (中小型)				128				128	▲7.13%	▲6.87%	▲1.79%	▲5.08%
	ブルックフィールド (インフラファンド)		520					29	549	0.16%	0.27%	0.83%	▲0.56%
三井住友信託銀行	ブルーベイ					331		0	331	▲0.01%	▲0.01%	▲0.11%	+0.10%
	ブルデンシヤル					196		0	196	0.84%	0.84%	▲0.11%	+0.95%
	マッコリー (インフラファンド)		0						0	0.01%	0.01%	0.83%	▲0.82%
	三菱商事私募REIT		59					1	60	3.03%	3.05%	0.83%	+2.22%
スパークス	長期厳選投資				228			49	277	2.68%	3.36%	▲1.79%	+5.15%
第一生命	新一般勘定			626					626	0.10%	---	---	---
日本生命	新一般勘定			367					367	0.21%	---	---	---
	新一般勘定 (2022)			1,337					1,337	0.21%	---	---	---
合計	---	18.5%	18.6%	19.1%	9.3%	9.1%	9.5%	16.0%	100.0%	0.13%			
		2,266	2,267	2,329	1,134	1,109	1,159	1,954	12,219				
	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			
										17			

	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	366.50	362.35	356.53	357.51	357.15	361.33								-1.41
	新発10年国債利回り	0.73	0.870	1.070	1.050	1.050	0.890								---
国内株式	TOPIX(配当込)	4,699.20	4,656.27	4,710.15	4,778.56	4,752.72	4,615.06								-1.79
	日経平均株価	40,369.44	38,405.66	38,487.90	39,583.08	39,101.82	38,647.75								-4.26
外国債券	FTSE WGBI (ex JAPAN)円ベース	587.98	597.68	605.54	621.10	594.97	587.34								-0.11
	米国10年国債利回り	4.200	4.680	4.500	4.400	4.030	3.900								---
外国株式	MSCI KOKUSAI	8,067.19	8,086.78	8,458.06	8,851.88	8,407.35	8,364.94								3.69
	S&P500	5,254.35	5,035.69	5,277.51	5,460.48	5,522.30	5,648.40								7.50
	ダウ平均	39,807.37	37,815.92	38,686.32	39,118.86	40,842.79	41,563.08								4.41
	ナスダック総合指数	16,379.46	15,657.82	16,735.02	17,732.60	17,599.40	17,713.63								8.15
	上海総合	3,041.17	3,104.82	3,086.81	2,967.40	2,938.75	2,842.21								-6.54
為替	円/ドル相場(ロンドン 16:00)	151.35	157.37	157.14	160.86	150.46	145.61								-3.79
	円/ユーロ相場(ロンドン 16:00)	163.46	168.26	170.60	172.41	162.81	161.17								-1.40
	当基金修正総合収益率 A (%)	8.34	▲ 0.14	0.08	1.11	0.24	0.13								
	複合ベンチマーク B (%)	8.11	▲ 0.12	0.20	1.07	0.26	0.16								
	A-B (%)	0.23	▲ 0.02	▲ 0.12	0.04	▲ 0.02	▲ 0.03								

