

令和5年6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	比較対象	超過収益
三菱UFJ信託銀行	パッシブバランス	1,772			187	544	629	707	3,839	4.44%	---	---
	ロングターム・グローバル・グロース						35	0	35	9.65%	16.25%	▲6.59%
	モルガンスタンレー						552	0	552	13.16%	16.25%	▲3.08%
	東急不動産		482					0	482	0.98%	0.50%	+0.49%
	クオリティスプレッド	261						0	261	1.26%	0.41%	+0.85%
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	0.64%	0.41%	+0.22%
	GLP不動産ファンド		501					0	501	0.10%	0.50%	▲0.39%
	ヒューリック		63						63	0.00%	0.50%	▲0.50%
	東京建物		78						78	0.00%	0.50%	▲0.50%
	野村不動産		128						128	1.57%	0.50%	+1.07%
りそな銀行	国内債券パッシブ	229						310	539	0.19%	---	---
	国内株式A口				611				611	12.97%	14.45%	▲1.48%
	国内株式Z口（中小型）				206				206	11.54%	14.45%	▲2.91%
三井住友信託銀行	ブルーベイ					295		0	295	7.54%	7.62%	▲0.08%
	プルデンシャル					177		0	177	7.28%	7.62%	▲0.34%
	スピーーン（米国地方債）		125						125	▲1.96%	0.50%	▲2.45%
	ウェリントンGTR		509						509	▲1.36%	0.50%	▲1.86%
	三菱商事私募REIT		56					311	367	0.00%	0.50%	▲0.50%
スパークス	長期厳選投資				207			70	277	14.38%	14.45%	▲0.07%
第一生命	新一般勘定			632					632	0.06%	---	---
	第二総合口		293						293	1.31%	0.50%	+0.81%
日本生命	新一般勘定			363					363	0.12%	---	---
	新一般勘定（2022）			944					944	0.12%	---	---
	新一般勘定（無配当）			402					402	0.06%	---	---
合計	---	21.4%	18.7%	19.5%	10.1%	8.5%	10.1%	11.7%	100.0%	3.77%		
		2,560	2,234	2,340	1,211	1,016	1,215	1,399	11,976			
	政策アセットミックス判定	OK	要調整	OK	OK	OK	OK	OK		修正 総合収益額		
										438		

	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										0.41
	新発10年国債利回り	0.32	0.385	0.430	0.395										---
国内株式	TOPIX(配当込)	3,324.74	3,414.45	3,537.93	3,805.00										14.45
	日経平均株価	28,041.48	28,856.44	30,887.88	33,189.04										18.36
外国債券	FTSE WGBI (ex JAPAN)円ベース	510.10	525.91	528.31	548.99										7.62
	米国10年国債利回り	3.470	3.425	3.646	3.840										---
外国株式	MSCI KOKUSAI	5,644.42	5,884.48	5,971.30	6,561.38										16.25
	S&P500	4,109.31	4,169.48	4,179.83	4,450.38										8.30
	ダウ平均	33,274.15	34,098.16	32,908.27	34,407.60										3.41
	ナスダック総合指数	12,221.91	12,226.58	12,935.29	13,787.92										12.81
	上海総合	3,272.86	3,323.28	3,204.56	3,202.06										-2.16
為替	円/ドル相場(ロンドン 16:00)	133.09	136.17	139.71	144.54										8.60
	円/ユーロ相場(ロンドン 16:00)	144.59	150.33	148.94	157.69										9.06
当基金修正総合収益率 A(%)		▲ 0.07	1.04	1.61	3.77										
複合ベンチマーク B(%)		▲ 0.29	0.98	1.52	3.54										
A-B(%)		0.22	0.06	0.09	0.23										

