

令和5年7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 | 比較対象   | 超過収益   |
|-----------|-------------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|-------------|--------|--------|
| 三菱UFJ信託銀行 | パッシブバランス          | 1,745 |       |       | 190   | 537   | 639   | 714   | 3,825  | 3.82%       | ---    | ---    |
|           | ロングターム・グローバル・グロース |       |       |       |       |       |       | 34    | 34     | 9.61%       | 18.17% | ▲8.56% |
|           | モルガンスタンレー         |       |       |       |       |       | 553   | 0     | 553    | 13.90%      | 18.17% | ▲4.27% |
|           | 東急不動産             |       | 482   |       |       |       |       | 0     | 482    | 0.99%       | 0.66%  | +0.33% |
|           | クオリティスプレッド        | 261   |       |       |       |       |       | 0     | 261    | 1.27%       | ▲1.15% | +2.42% |
| みずほ信託銀行   | 国内債券パッシブ          |       |       |       |       |       |       | 0     | 0      | 0.00%       | ---    | ---    |
|           | 44公社債口            | 297   |       |       |       |       |       | 0     | 297    | 0.39%       | ▲1.15% | +1.54% |
|           | GLP不動産ファンド        |       | 501   |       |       |       |       | 0     | 501    | 0.10%       | 0.66%  | ▲0.56% |
|           | ヒューリック            |       | 65    |       |       |       |       |       | 65     | 3.18%       | 0.66%  | +2.52% |
|           | 東京建物              |       | 80    |       |       |       |       |       | 80     | 2.43%       | 0.66%  | +1.77% |
|           | 野村不動産             |       | 128   |       |       |       |       |       | 128    | 1.57%       | 0.66%  | +0.90% |
| りそな銀行     | 国内債券パッシブ          | 225   |       |       |       |       |       | 310   | 535    | ▲0.58%      | ---    | ---    |
|           | 国内株式A口            |       |       |       | 622   |       |       |       | 622    | 14.91%      | 16.15% | ▲1.24% |
|           | 国内株式Z口（中小型）       |       |       |       | 202   |       |       |       | 202    | 10.19%      | 16.15% | ▲5.96% |
| 三井住友信託銀行  | ブルーベイ             |       |       |       |       | 293   |       | 0     | 293    | 7.23%       | 6.27%  | +0.96% |
|           | プルデンシャル           |       |       |       |       | 176   |       | 0     | 176    | 7.63%       | 6.27%  | +1.36% |
|           | ヌビーン（米国地方債）       |       | 123   |       |       |       |       |       | 123    | ▲3.00%      | 0.66%  | ▲3.66% |
|           | ウェリントンGTR         |       | 509   |       |       |       |       |       | 509    | ▲1.32%      | 0.66%  | ▲1.98% |
|           | 三菱商事私募REIT        |       | 56    |       |       |       |       | 461   | 517    | 0.00%       | 0.66%  | ▲0.66% |
| スパークス     | 長期厳選投資            |       |       |       | 208   |       |       | 70    | 278    | 14.90%      | 16.15% | ▲1.25% |
| 第一生命      | 新一般勘定             |       |       | 632   |       |       |       |       | 632    | 0.08%       | ---    | ---    |
|           | 第二総合口             |       | 142   |       |       |       |       |       | 142    | 1.05%       | 0.66%  | +0.39% |
| 日本生命      | 新一般勘定             |       |       | 363   |       |       |       |       | 363    | 0.17%       | ---    | ---    |
|           | 新一般勘定（2022）       |       |       | 945   |       |       |       |       | 945    | 0.17%       | ---    | ---    |
|           | 新一般勘定（無配当）        |       |       | 402   |       |       |       |       | 402    | 0.08%       | ---    | ---    |
| 合計        | ---               | 21.1% | 17.4% | 19.6% | 10.2% | 8.4%  | 10.0% | 13.3% | 100.0% | 3.62%       |        |        |
|           |                   | 2,528 | 2,086 | 2,341 | 1,223 | 1,006 | 1,192 | 1,590 | 11,965 |             |        |        |
|           | 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 |        |        |
|           |                   |       |       |       |       |       |       |       |        | 420         |        |        |

|            |      |      |      |      |      |      |      |      |
|------------|------|------|------|------|------|------|------|------|
|            | 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    |    |    |     |     |     |    |    |    | -1.15     |
|      | 新発10年国債利回り               | 0.32      | 0.385     | 0.430     | 0.395     | 0.600     |    |    |     |     |     |    |    |    | ---       |
| 国内株式 | TOPIX(配当込)               | 3,324.74  | 3,414.45  | 3,537.93  | 3,805.00  | 3,861.80  |    |    |     |     |     |    |    |    | 16.15     |
|      | 日経平均株価                   | 28,041.48 | 28,856.44 | 30,887.88 | 33,189.04 | 33,172.22 |    |    |     |     |     |    |    |    | 18.30     |
| 外国債券 | FTSE WGBI (ex JAPAN)円ベース | 510.10    | 525.91    | 528.31    | 548.99    | 542.08    |    |    |     |     |     |    |    |    | 6.27      |
|      | 米国10年国債利回り               | 3.470     | 3.425     | 3.646     | 3.840     | 3.960     |    |    |     |     |     |    |    |    | ---       |
| 外国株式 | MSCI KOKUSAI             | 5,644.42  | 5,884.48  | 5,971.30  | 6,561.38  | 6,669.77  |    |    |     |     |     |    |    |    | 18.17     |
|      | S&P500                   | 4,109.31  | 4,169.48  | 4,179.83  | 4,450.38  | 4,588.96  |    |    |     |     |     |    |    |    | 11.67     |
|      | ダウ平均                     | 33,274.15 | 34,098.16 | 32,908.27 | 34,407.60 | 35,559.53 |    |    |     |     |     |    |    |    | 6.87      |
|      | ナスダック総合指数                | 12,221.91 | 12,226.58 | 12,935.29 | 13,787.92 | 14,346.02 |    |    |     |     |     |    |    |    | 17.38     |
|      | 上海総合                     | 3,272.86  | 3,323.28  | 3,204.56  | 3,202.06  | 3,291.04  |    |    |     |     |     |    |    |    | 0.56      |
| 為替   | 円／ドル相場(ロンドン 16:00)       | 133.09    | 136.17    | 139.71    | 144.54    | 142.08    |    |    |     |     |     |    |    |    | 6.75      |
|      | 円／ユーロ相場(ロンドン 16:00)      | 144.59    | 150.33    | 148.94    | 157.69    | 156.65    |    |    |     |     |     |    |    |    | 8.34      |
|      | 当基金修正総合収益率 A(%)          | ▲ 0.07    | 1.04      | 1.61      | 3.77      | 3.62      |    |    |     |     |     |    |    |    |           |
|      | 複合ベンチマーク B(%)            | ▲ 0.29    | 0.98      | 1.52      | 3.54      | 3.43      |    |    |     |     |     |    |    |    |           |
|      | A-B(%)                   | 0.22      | 0.06      | 0.09      | 0.23      | 0.19      |    |    |     |     |     |    |    |    |           |

