

令和6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	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	1,538			185	616	683	1,961	4,983	1.35%	---	---	---
	モルガンスタンレー						535	0	535	4.64%	4.64%	9.73%	▲5.09%
	クオリティスプレッド	412						0	412	0.20%	0.20%	▲2.45%	+2.65%
	レラティブバリュー		299						299	▲0.19%	▲0.19%	0.50%	▲0.69%
	BAAM		299					0	299	▲0.23%	▲0.23%	0.50%	▲0.73%
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	0.38%	0.38%	▲2.45%	+2.83%
	GLP不動産ファンド		495						495	0.01%	0.01%	0.50%	▲0.49%
	ヒューリック		119						119	0.00%	0.00%	0.50%	▲0.50%
	東京建物		79						79	0.00%	0.00%	0.50%	▲0.50%
	野村不動産		264					4	268	2.96%	2.97%	0.50%	+2.47%
	大和証券マンションファンド		125						125	2.52%	2.50%	0.50%	+2.0%
りそな銀行	国内債券パッシブ	2						0	2	▲0.65%	---	---	---
	国内株式A口				618				618	1.88%	1.88%	1.69%	+0.19%
	国内株式Z口（中小型）				161				161	▲5.06%	▲5.06%	1.69%	▲6.75%
	ブルックフィールド（インフラファンド）		563					-22	542	▲1.21%	▲1.19%	0.50%	▲1.69%
三井住友信託銀行	ブルーベイ					353		0	353	6.65%	6.65%	5.63%	+1.02%
	ブルデンシャル					208		0	208	6.63%	6.63%	5.63%	+1.0%
	マッコーリー（インフラファンド）		0						0	▲0.00%	0.00%	0.50%	▲0.50%
	三菱商事私募REIT		58						58	▲0.00%	0.00%	0.50%	▲0.50%
スパークス	長期厳選投資				224			59	283	4.79%	6.13%	1.69%	+4.44%
第一生命	新一般勘定			636					636	0.06%	---	---	---
日本生命	新一般勘定			366					366	0.12%	---	---	---
	新一般勘定（2022）			1,357					1,357	0.12%	---	---	---
合計	---	18.0%	18.4%	18.9%	9.5%	9.4%	9.8%	16.0%	100.0%	1.11%			
		2,250	2,302	2,359	1,188	1,176	1,218	2,002	12,496				
	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			
										139			

	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										-2.45
	新発10年国債利回り	0.73	0.870	1.070	1.050										---
国内株式	TOPIX (配当込)	4,699.20	4,656.27	4,710.15	4,778.56										1.69
	日経平均株価	40,369.44	38,405.66	38,487.90	39,583.08										-1.95
外国債券	FTSE WGBI (ex JAPAN)円ベース	587.98	597.68	605.54	621.10										5.63
	米国10年国債利回り	4.200	4.680	4.500	4.400										---
外国株式	MSCI KOKUSAI	8,067.19	8,086.78	8,458.06	8,851.88										9.73
	S&P500	5,254.35	5,035.69	5,277.51	5,460.48										3.92
	ダウ平均	39,807.37	37,815.92	38,686.32	39,118.86										-1.73
	ナスダック総合指数	16,379.46	15,657.82	16,735.02	17,732.60										8.26
	上海総合	3,041.17	3,104.82	3,086.81	2,967.40										-2.43
為替	円／ドル相場 (ロンドン 16:00)	151.35	157.37	157.14	160.86										6.29
	円／ユーロ相場 (ロンドン 16:00)	163.46	168.26	170.60	172.41										5.47
当基金修正総合収益率 A (%)		8.34	▲ 0.14	0.08	1.11										
複合ベンチマーク B (%)		8.11	▲ 0.12	0.20	1.07										
A-B (%)		0.23	▲ 0.02	▲ 0.12	0.04										

