

令和6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 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	1,537			184	590	649	1,965	4,925	▲0.02%	---	---	---
	モルガンスタンレー						523	0	523	2.29%	2.29%	4.22%	▲1.93%
	クオリティスプレッド	412						0	412	0.09%	0.09%	▲2.55%	+2.64%
	レラティブバリュー		299						299	▲0.38%	▲0.38%	0.66%	▲1.04%
	BAAM		302					0	302	0.53%	0.53%	0.66%	▲0.13%
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	0.46%	0.46%	▲2.55%	+3.01%
	GLP不動産ファンド		495						495	0.01%	0.01%	0.66%	▲0.65%
	ヒューリック		121						121	2.40%	1.88%	0.66%	+1.22%
	東京建物		82						82	2.97%	3.02%	0.66%	+2.36%
	野村不動産		264					4	268	2.96%	2.97%	0.66%	+2.31%
	大和証券マンションファンド		125						125	2.52%	2.50%	0.66%	+1.84%
りそな銀行	国内債券パッシブ	2						0	2	▲0.87%	---	---	---
	国内株式A口				613				613	1.01%	1.01%	1.14%	▲0.13%
	国内株式Z口（中小型）				155				155	▲8.89%	▲8.89%	1.14%	▲10.03%
	ブルックフィールド（インフラファンド）		527					15	542	▲1.21%	▲1.16%	0.66%	▲1.83%
三井住友信託銀行	ブルーベイ					338		0	338	2.17%	2.17%	1.19%	+0.98%
	ブルデンシャル					198		0	198	1.91%	1.91%	1.19%	+0.72%
	マッコーリー（インフラファンド）		0						0	▲0.00%	0.00%	0.66%	▲0.66%
	三菱商事私募REIT		59						59	1.12%	1.12%	0.66%	+0.46%
スパークス	長期厳選投資				218			59	277	2.71%	3.47%	1.14%	+2.33%
第一生命	新一般勘定			635					635	0.08%	---	---	---
日本生命	新一般勘定			366					366	0.17%	---	---	---
	新一般勘定（2022）			1,356					1,356	0.17%	---	---	---
合計	---	18.1%	18.3%	19.0%	9.4%	9.1%	9.5%	16.5%	100.0%	0.24%			
		2,248	2,272	2,357	1,170	1,126	1,172	2,043	12,389				
	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			
										31			

	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									-2.55
	新発10年国債利回り	0.73	0.870	1.070	1.050	1.050									---
国内株式	TOPIX (配当込)	4,699.20	4,656.27	4,710.15	4,778.56	4,752.72									1.14
	日経平均株価	40,369.44	38,405.66	38,487.90	39,583.08	39,101.82									-3.14
外国債券	FTSE WGBI (ex JAPAN)円ベース	587.98	597.68	605.54	621.10	594.97									1.19
	米国10年国債利回り	4.200	4.680	4.500	4.400	4.030									---
外国株式	MSCI KOKUSAI	8,067.19	8,086.78	8,458.06	8,851.88	8,407.35									4.22
	S&P500	5,254.35	5,035.69	5,277.51	5,460.48	5,522.30									5.10
	ダウ平均	39,807.37	37,815.92	38,686.32	39,118.86	40,842.79									2.60
	ナスダック総合指数	16,379.46	15,657.82	16,735.02	17,732.60	17,599.40									7.45
	上海総合	3,041.17	3,104.82	3,086.81	2,967.40	2,938.75									-3.37
為替	円／ドル相場 (ロンドン 16:00)	151.35	157.37	157.14	160.86	150.46									-0.58
	円／ユーロ相場 (ロンドン 16:00)	163.46	168.26	170.60	172.41	162.81									-0.39
	当基金修正総合収益率 A (%)	8.34	▲ 0.14	0.08	1.11	0.24									
	複合ベンチマーク B (%)	8.11	▲ 0.12	0.20	1.07	0.26									
	A-B (%)	0.23	▲ 0.02	▲ 0.12	0.04	▲ 0.02									

