

令和6年12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	1,539			293	608	712	614	3,766	1.99%	---	---	---
	モルガンスタンレー						561	0	561	9.87%	9.88%	14.33%	▲4.45%
	クオリティスプレッド	413						0	413	0.70%	0.70%	▲2.42%	+3.12%
	レラティブバリュー		304						304	1.22%	1.22%	1.50%	▲0.28%
	BAAM		306					0	306	1.95%	1.95%	1.50%	+0.45%
みずほ信託銀行	国内債券パッシブ							0	0	0.02%	---	---	---
	44公社債口	299						0	299	1.17%	1.17%	▲2.42%	+3.59%
	GLP不動産ファンド		502					13	515	4.02%	4.15%	1.50%	+2.66%
	ヒューリック		120					1	121	2.08%	1.88%	1.50%	+0.38%
	東京建物		80					2	81	3.00%	3.02%	1.50%	+1.52%
	野村不動産		266					8	274	5.67%	5.72%	1.50%	+4.22%
	大和証券マンションファンド		126					2	128	5.23%	5.21%	1.50%	+3.72%
りそな銀行	国内債券パッシブ	2						151	153	▲0.45%	---	---	---
	国内株式A口				622				622	2.51%	2.51%	1.96%	+0.55%
	国内株式Z口（中小型）									▲12.94%	▲7.75%	1.96%	▲9.71%
	ブルックフィールド（インフラファンド）		565					-18	547	▲0.15%	▲0.05%	1.50%	▲1.55%
三井住友信託銀行	ブルーベイ					357			357	8.03%	8.04%	4.21%	+3.83%
	ブルデンシヤル					206			206	5.65%	5.65%	4.21%	+1.44%
	マッコーリー（インフラファンド）		788					110	897	▲2.90%	▲0.17%	1.50%	▲1.67%
	三菱商事私募REIT		59					1	60	3.02%	3.05%	1.50%	+1.55%
スパークス	長期厳選投資				284			9	293	8.55%	8.93%	1.96%	+6.97%
第一生命	新一般勘定			608					608	0.19%	---	---	---
日本生命	新一般勘定			365					365	0.38%	---	---	---
	新一般勘定（2022）			1,302					1,302	0.38%	---	---	---
合計	---	18.5%	25.6%	18.7%	9.8%	9.6%	10.5%	7.3%	100.0%	2.16%			
		2,253	3,115	2,276	1,199	1,170	1,273	893	12,180				
	政策アセットミックス判定	OK	OK	OK	OK	OK	OK	OK		修正 総合収益額			
										266			

	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	362.34	360.51	357.99	357.61				-2.42
	新発10年国債利回り	0.73	0.870	1.070	1.050	1.050	0.890	0.860	0.940	1.050	1.090				---
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	4,544.38	4,629.83	4,606.07	4,791.22				1.96
	日経平均株価	40,369.44	38,405.66	38,487.90	39,583.08	39,101.82	38,647.75	37,919.55	39,081.25	38,208.03	39,894.54				-1.18
外国債券	FTSE WGBI (ex JAPAN)円ベース	587.98	597.68	605.54	621.10	594.97	587.34	586.13	605.02	597.76	612.76				4.21
	米国10年国債利回り	4.200	4.680	4.500	4.400	4.030	3.900	3.780	4.290	4.170	4.570				---
外国株式	MSCI KOKUSAI	8,067.19	8,086.78	8,458.06	8,851.88	8,407.35	8,364.94	8,382.59	8,761.89	9,058.20	9,223.08				14.33
	S&P500	5,254.35	5,035.69	5,277.51	5,460.48	5,522.30	5,648.40	5,762.48	5,705.45	6,032.38	5,881.63				11.94
	ダウ平均	39,807.37	37,815.92	38,686.32	39,118.86	40,842.79	41,563.08	42,330.15	41,763.46	44,910.65	42,544.22				6.88
	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	18,189.17	18,095.15	19,218.17	19,310.79				17.90
	上海総合	3,041.17	3,104.82	3,086.81	2,967.40	2,938.75	2,842.21	3,336.50	3,279.82	3,326.46	3,351.76				10.21
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	143.04	152.33	150.19	157.16				3.84
	円／ユーロ相場(ロンドン 16:00)	163.46	168.26	170.60	172.41	162.81	161.17	159.64	165.37	158.62	162.73				-0.44
当基金修正総合収益率 A(%)		8.34	▲ 0.14	0.08	1.11	0.24	0.13	0.17	1.14	1.30	2.16				
複合ベンチマーク B(%)		8.11	▲ 0.12	0.20	1.07	0.26	0.16	0.12	0.91	0.98	1.74				
A-B(%)		0.23	▲ 0.02	▲ 0.12	0.04	▲ 0.02	▲ 0.03	0.05	0.23	0.32	0.42				

