

令和7年5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	1,496			195	404	527	483	3,105	0.44%	---	---	---
	モルガンスタンレー						537	0	537	▲0.02%	▲0.02%	3.09%	▲3.11%
	クオリティスプレッド	615						0	615	0.51%	0.51%	▲0.71%	+1.22%
	レラティブバリュー		304						304	▲0.96%	▲0.96%	0.33%	▲1.29%
	BAAM		312					0	312	0.43%	0.43%	0.33%	+0.10%
みずほ信託銀行	国内債券パッシブ							0	0	0.07%	---	---	---
	44公社債口	502						0	502	0.34%	0.34%	▲0.71%	+1.05%
	GLPファンド		510					25	536	▲0.36%	▲0.38%	0.33%	▲0.71%
	ヒューリック		120					3	123	0.00%	0.00%	0.33%	▲0.33%
	東京建物		80					3	83	0.00%	0.00%	0.33%	▲0.33%
	野村不動産		270					12	282	2.91%	2.99%	0.33%	+2.66%
	大和証券マンションファンド		127					4	131	2.52%	2.55%	0.33%	+2.22%
りそな銀行	国内債券パッシブ	2						0	2	▲0.65%	---	---	---
	国内株式A口				634				634	8.14%	8.14%	5.45%	+2.69%
	ブルックフィールド（インフラ）		527					31	559	1.28%	1.30%	0.33%	+0.97%
	JR東日本私募REIT		204					0	204	0.97%	0.97%	0.33%	+0.64%
三井住友信託銀行	ブルーベイ					334			334	▲3.32%	▲3.32%	▲0.85%	▲2.47%
	ブルデンシャル					200			200	▲0.96%	▲0.96%	▲0.85%	▲0.11%
	マッコーリー（インフラ）		721					151	873	▲0.48%	▲0.48%	0.33%	▲0.81%
	三菱商事私募REIT		60					2	62	0.00%	0.00%	0.33%	▲0.33%
スパークス	長期厳選投資				273			9	282	3.93%	4.06%	5.45%	▲1.39%
第一生命	新一般勘定			606					606	0.04%	---	---	---
日本生命	新一般勘定			366					366	0.08%	---	---	---
	新一般勘定（2022）			1,300					1,300	0.08%	---	---	---
明治安田生命	新一般勘定			100					100				
合計	---	21.7%	26.9%	19.7%	9.1%	7.8%	8.8%	6.0%	100.0%	0.65%			
		2,615	3,236	2,372	1,102	938	1,064	724	12,052				
	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			
										78			

	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	349.16	351.19	346.68											0.58
	新発10年国債利回り	1.49	1.310	1.500											---
国内株式	TOPIX (配当込)	4,626.52	4,641.96	4,878.83											0.33
	日経平均株価	35,617.56	36,045.38	37,965.10											1.20
外国債券	FTSE WGBI (ex JAPAN)円ベース	598.49	588.81	593.42											-1.62
	米国10年国債利回り	4.210	4.160	4.403											---
外国株式	MSCI KOKUSAI	8,617.13	8,276.19	8,883.19											-3.96
	S&P500	5,611.85	5,569.06	5,911.69											-0.76
	ダウ平均	42,001.76	40,669.36	42,270.07											-3.17
	ナスダック総合指数	17,299.29	17,446.34	19,113.77											0.85
	上海総合	3,335.75	3,279.03	3,347.49											-1.70
為替	円／ドル相場 (ロンドン 16:00)	149.54	142.64	144.29											-4.61
	円／ユーロ相場 (ロンドン 16:00)	161.53	162.15	163.81											0.38
	当基金修正総合収益率 A (%)	0.96	▲ 0.41	0.65											
	複合ベンチマーク B (%)	0.27	▲ 0.27	0.68											
	A-B (%)	0.69	▲ 0.14	▲ 0.03											

