

令和7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	国内株式	外国債券	外国株式	短期資産	一般勘定	オルタナ	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	1,504	199	413	551	457			3,124	1.88%	---	---	---
	モルガンスタンレー				540	0			540	0.41%	0.41%	7.84%	▲7.43%
	クオリティスプレッド	617				0			617	0.78%	0.78%	▲0.19%	+0.97%
	レラティブバリュー							305	305	▲0.59%	▲0.59%	0.50%	▲1.09%
	BAAM					0		316	316	1.62%	1.62%	0.50%	+1.12%
みずほ信託銀行	国内債券パッシブ					0			0	0.10%	---	---	---
	44公社債口	503				0			503	0.65%	0.65%	▲0.19%	+0.84%
	GLPファンド					25		510	536	▲0.36%	▲0.38%	0.50%	▲0.88%
	ヒューリック					3		120	123	0.00%	0.00%	0.50%	▲0.50%
	東京建物					3		80	83	0.00%	0.00%	0.50%	▲0.50%
	野村不動産					12		270	282	2.91%	2.99%	0.50%	+2.49%
	大和証券マンションファンド					4		127	131	2.52%	2.55%	0.50%	+2.06%
りそな銀行	国内債券パッシブ	2				0			2	▲0.16%	---	---	---
	国内株式A口		648						648	10.54%	10.54%	7.52%	+3.02%
	ブルックフィールド（インフラ）					29		528	557	0.98%	0.98%	0.50%	+0.48%
	JR東日本私募REIT					0		204	204	0.97%	0.97%	0.50%	+0.47%
三井住友信託銀行	ブルーベイ			340					340	▲1.71%	▲1.71%	1.23%	▲2.94%
	ブルデンシャル			204					204	1.34%	1.34%	1.23%	+0.11%
	マッコーリー（インフラ）					154		707	861	▲1.75%	▲1.75%	0.50%	▲2.24%
	三菱商事私募REIT					2		60	62	0.00%	0.00%	0.50%	▲0.50%
スパークス	長期厳選投資		282			9			290	7.13%	7.36%	7.52%	▲0.16%
第一生命	新一般勘定						604		604	0.06%	---	---	---
日本生命	新一般勘定						366		366	0.12%	---	---	---
	新一般勘定（2022）						1,294		1,294	0.12%	---	---	---
明治安田生命	新一般勘定						100		100	0.32%	---	---	---
合計	---	21.7%	9.3%	7.9%	9.0%	5.8%	19.6%	26.7%	100.0%	1.28%			
		2,626	1,129	957	1,091	699	2,365	3,227	12,093				
	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			
										153			

	国内債券	国内株式	外国債券	外国株式	短期資産	一般勘定	オルタナ	合計
政策アセットミックス	22%	9%	8%	9%	2%	20%	30%	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	346.68	346.68	348.51										-0.19
	新発10年国債利回り	1.49	1.310	1.500	1.420										-
国内株式	TOPIX(配当込)	4,626.52	4,641.96	4,878.83	4,974.53										7.52
	日経平均株価	35,617.56	36,045.38	37,965.10	40,487.39										13.67
外国債券	FTSE WGBI (ex JAPAN)円ベース	598.49	588.81	593.42	605.84										1.23
	米国10年国債利回り	4.210	4.160	4.400	4.230										-
外国株式	MSCI KOKUSAI	8,617.13	8,276.19	8,883.19	9,292.92										7.84
	S&P500	5,611.85	5,569.06	5,911.69	6,204.95										10.57
	ダウ平均	42,001.76	40,669.36	42,270.07	44,094.77										4.98
	ナスダック総合指数	17,299.29	17,446.34	19,113.77	20,369.73										17.75
	上海総合	3,335.75	3,279.03	3,347.49	3,444.43										3.26
為替	円/ドル相場 (ロンドン 16:00)	149.54	142.64	144.29	144.45										-3.41
	円/ユーロ相場 (ロンドン 16:00)	161.53	162.15	163.81	169.56										4.97
	当基金修正総合収益率 A (%)	0.96	▲ 0.41	0.65	1.28										
	複合ベンチマーク B (%)	0.27	▲ 0.27	0.67	1.61										
	A-B (%)	0.69	▲ 0.13	▲ 0.03	▲ 0.33										

