

令和7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	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	1,490	205	424	583	468			3,170	3.03%	---	---	---
	モルガンスタンレー				100	450			550	2.42%	3.09%	14.00%	▲10.91%
	クオリティスプレッド	617				0			617	0.81%	0.81%	▲1.20%	+2.01%
	レラティブバリュー							305	305	▲0.56%	▲0.56%	0.66%	▲1.22%
	BAAM					0		316	316	1.86%	1.86%	0.66%	+1.20%
みずほ信託銀行	国内債券パッシブ					0			0	0.14%	---	---	---
	44公社債口	505				0			505	0.89%	0.89%	▲1.20%	+2.09%
	GLPファンド					25		510	536	▲0.36%	▲0.38%	0.66%	▲1.05%
	ヒューリック					3		123	126	2.84%	2.90%	0.66%	+2.24%
	東京建物					3		83	86	2.89%	3.00%	0.66%	+2.33%
	野村不動産					12		270	282	2.91%	2.99%	0.66%	+2.32%
	大和証券マンションファンド					4		127	131	2.52%	2.55%	0.66%	+1.89%
りそな銀行	国内債券パッシブ	300				0			300	▲3.51%	---	---	---
	国内株式A口		356						356	12.46%	14.65%	10.93%	+3.72%
	ブルックフィールド（インフラ）					9		546	555	0.66%	0.66%	0.66%	▲0.0%
	JR東日本私募REIT					0		204	204	0.97%	0.97%	0.66%	+0.31%
三井住友信託銀行	ブルーベイ			355					355	2.71%	2.71%	3.99%	▲1.28%
	ブルデンシャル					207			207	2.85%	2.97%	3.99%	▲1.02%
	マッコーリー（インフラ）					129		737	865	▲1.30%	▲1.30%	0.66%	▲1.96%
	三菱商事私募REIT					2		61	63	1.08%	1.08%	0.66%	+0.42%
スパークス	長期厳選投資		284			9			293	8.14%	8.41%	10.93%	▲2.52%
第一生命	新一般勘定						603		603	0.08%	---	---	---
日本生命	新一般勘定						367		367	0.17%	---	---	---
	新一般勘定（2022）						1,294		1,294	0.17%	---	---	---
明治安田生命	新一般勘定						100		100	0.43%	---	---	---
合計	---	23.9%	6.9%	6.4%	5.6%	10.8%	19.4%	26.9%	100.0%	1.99%			
		2,911	846	779	683	1,322	2,364	3,283	12,187				
	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			

	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	344.96									-1.20
	新発10年国債利回り	1.49	1.310	1.500	1.420	1.550									—
国内株式	TOPIX (配当込)	4,626.52	4,641.96	4,878.83	4,974.53	5,132.22									10.93
	日経平均株価	35,617.56	36,045.38	37,965.10	40,487.39	41,069.82									15.31
外国債券	FTSE WGBI (ex JAPAN)円ベース	598.49	588.81	593.42	605.84	622.40									3.99
	米国10年国債利回り	4.210	4.160	4.400	4.230	4.380									—
外国株式	MSCI KOKUSAI	8,617.13	8,276.19	8,883.19	9,292.92	9,823.83									14.00
	S&P500	5,611.85	5,569.06	5,911.69	6,204.95	6,339.39									12.96
	ダウ平均	42,001.76	40,669.36	42,270.07	44,094.77	44,130.98									5.07
	ナスダック総合指数	17,299.29	17,446.34	19,113.77	20,369.73	21,122.45									22.10
	上海総合	3,335.75	3,279.03	3,347.49	3,444.43	3,573.21									7.12
為替	円／ドル相場 (ロンドン 16:00)	149.54	142.64	144.29	144.45	150.49									0.64
	円／ユーロ相場 (ロンドン 16:00)	161.53	162.15	163.81	169.56	172.25									6.64
	当基金修正総合収益率 A (%)	0.96	▲ 0.41	0.65	1.28	1.99									
	複合ベンチマーク B (%)	0.27	▲ 0.27	0.67	1.61	2.47									
	A-B (%)	0.69	▲ 0.13	▲ 0.03	▲ 0.33	▲ 0.48									

