

資産	内訳	前期末時価総額 <2023年3月末> (円)	全体構成比 (%)	時価総額(円) (2024年3月末)	全体構成比 (%)	修正簿価平残 (円)	総合収益 (円)	修正総合収 益率(%)	時間加重収 益率(%)	BM	超過収益 (%)			
伝統資産 (リバランス運用+代替投資)	国内債券 (10)	リバランス(1.7)	標準スタイルミックス	92,116,269	1.3%	74,574,314	1.0%	116,355,861	-2,461,338	-2.12%	-1.73%	-2.20%	0.47%	
		三菱UFJ 三井住友 第一生命	代替 (8.3)	アンコンストレイントH(165F)	129,697,595	1.8%	183,239,232	2.4%	132,303,738	550,050	0.42%	0.38%	-	-
				クオリティスプレッド(53F)	113,333,544	1.6%	175,432,012	2.3%	117,267,489	2,105,798	1.80%	1.85%	-	-
				Neuberger(短期EM)H	230,151,840	3.3%	237,824,843	3.1%	230,151,840	7,673,003	3.33%	3.33%	-	-
		第2総合口	128,796,199	1.8%	132,172,718	1.7%	127,736,293	4,112,847	3.22%	3.21%	-	-		
	国内債券小計		694,095,447	9.9%	803,243,119	10.6%	723,815,221	11,980,360	1.66%	1.67%	-2.20%	3.87%		
	国内株式 (9.6)	リバランス(3.1)	個別スタイルミックス	322,231,064	4.6%	398,530,329	5.2%	184,600,261	76,652,997	41.52%	41.41%	41.34%	0.07%	
		三菱UFJ りそな	代替 (6.5)	ミニムボラティリティ(87F)	97,651,020	1.4%	199,417,684	2.6%	303,203,823	93,756,781	30.92%	33.43%	33.38%	0.05%
				エンゲージメントバリュ(123F)	0	0.0%	73,723,920	1.0%	49,586,338	24,018,362	48.44%	48.04%	-	-
		小型株集中投資(2)	91,949,881	1.3%	64,178,874	0.8%	90,861,745	13,598,637	14.97%	15.66%	30.79%	-15.13%		
	国内株式小計		511,831,965	7.3%	735,850,807	9.7%	628,252,167	208,026,777	33.11%	32.68%	41.34%	-8.66%		
	外国債券 (12)	リバランス(9)	標準スタイルミックス	664,621,564	9.5%	696,454,045	9.2%	613,833,988	102,049,215	16.62%	16.27%	15.27%	1.00%	
		三菱UFJ	代替 (3)	総合型PIMCO(45F)	99,117,648	1.4%	119,672,834	1.6%	129,634,870	20,691,296	15.96%	17.85%	16.53%	1.32%
				総合型PIMCO(46F)H	52,558,330	0.7%	50,264,818	0.7%	28,087,683	-670,596	-2.39%	-1.17%	-1.97%	0.80%
				クオリティスプレッド(211F)H	50,078,259	0.7%	60,810,561	0.8%	61,596,340	1,157,573	1.88%	1.55%	-	-
外国債券小計		866,375,801	12.4%	927,202,258	12.2%	833,152,881	123,227,488	14.79%	14.88%	15.27%	-0.39%			
外国株式 (6.5)	リバランス(3.2)	33F(パッシブ)		230,209,758	3.3%	359,949,241	4.7%	143,958,028	55,946,878	38.86%	42.60%	42.92%	-0.32%	
		202F(グローバルコア型)		95,300,307	1.4%	76,074,036	1.0%	31,250,559	15,249,970	48.80%	40.22%	42.92%	-2.70%	
	三菱UFJ りそな みずほ	代替 (3.3)	iSTOXXクオリティ(178F)	46,763,765	0.7%	70,338,183	0.9%	36,622,873	13,900,184	37.95%	43.35%	43.59%	-0.24%	
			グローバルフランチャイズ(180F)	130,782,464	1.9%	71,887,276	0.9%	102,520,412	31,441,140	30.67%	31.70%	42.96%	-11.26%	
			ロイヤルロンドン(外貨建口3E)	0	0.0%	62,430,156	0.8%	2,294,663	2,441,091	106.38%	4.07%	-	-	
	S&P先進国REIT(91F)	44,698,512	0.6%	55,634,065	0.7%	44,624,799	11,189,737	25.08%	25.09%	25.23%	-0.14%			
	WCMクオリティ(総合口I)	48,571,827	0.7%	72,699,304	1.0%	51,820,180	24,618,363	47.51%	51.13%	40.79%	10.34%			
外国株式小計		596,326,633	8.5%	769,012,261	10.1%	413,091,514	154,787,363	37.47%	38.59%	42.92%	-4.33%			
短期資産(5.8)	短期資産小計	465,912,582	6.6%	319,507,622	4.2%	599,315,514	-43,434	-0.01%	-0.01%	0.00%	-0.01%			
合計(43.8)		3,134,542,428	44.7%	3,554,816,067	46.8%	3,197,627,297	497,978,554	15.57%	16.26%					
オルタナティブ	債券戦略 (8)	三菱UFJ	欧州バンクローンH	360,869,444	5.1%	299,624,944	3.9%	274,833,194	18,755,500	6.82%	7.17%			
		三井住友	世界物価連動国債(159F)H	21,211,022	0.3%	21,898,890	0.3%	21,308,907	-1,297,364	-6.09%	-6.16%			
		ウエルントンGTRH	298,731,409	4.3%	293,816,857	3.9%	298,622,370	-4,698,790	-1.57%	-1.57%				
	債券戦略小計		680,811,875	9.7%	615,340,691	8.1%	594,764,471	12,759,346	2.15%	2.23%				
	損害保険(0)	三菱UFJ	ネフィラ損害保険戦略	1,539,786	0.0%	0	0.0%	1,261,562	178,156	14.12%	11.57%			
	国内株式 (3.2)	三菱UFJ	サステイナブル成長銘柄(74F)	115,347,760	1.6%	71,056,016	0.9%	112,934,807	30,740,230	27.22%	29.88%			
		りそな	株式口2A(M,N)	103,200,224	1.5%	55,014,120	0.7%	101,377,911	1,818,785	1.79%	1.83%			
	国内株式小計		218,547,984	3.1%	126,070,136	1.7%	214,312,718	32,559,015	15.19%	16.65%				
	マルチストラ テジー (14.1)	三菱UFJ	Black stone AAM(FOFs)H	337,822,471	4.8%	343,677,309	4.5%	337,822,471	5,854,838	1.73%	1.73%			
			LMRファンドリミテッド(FOFs)H	346,903,016	4.9%	343,554,522	4.5%	346,903,016	-3,348,494	-0.97%	-0.97%			
		みずほ	ファラロン(イベント・ドリブ)H	343,730,514	4.9%	350,914,101	4.6%	343,730,514	7,183,587	2.09%	2.09%			
	マルチストラテジー小計		1,028,456,001	14.7%	1,038,145,932	13.7%	1,028,456,001	9,689,931	0.94%	0.95%				
	外国株式 (9.2)	みずほ	Marshall Wace(L/S)H	368,763,131	5.3%	392,974,629	5.2%	368,763,131	24,211,498	6.57%	6.57%			
		三菱UFJ	North Rock(L/S)H	300,000,000	4.3%	298,661,140	3.9%	300,000,000	-1,338,860	-0.45%	-0.45%			
	外国株式小計		668,763,131	9.5%	691,635,769	9.1%	668,763,131	22,872,638	3.42%	3.42%				
不動産(4.1)	みずほ	UBS不動産FOFsH	0	0.0%	268,202,132	3.5%	298,360,655	-31,797,868	-10.66%	-10.60%				
インフラ(4.1)	三菱UFJ	KKRグローバルインフラコアH	0	0.0%	300,000,000	4.0%	77,049,180	0	0.00%	0.00%				
P.E(4.1)	三菱UFJ	HarbourVest GPS	0	0.0%	304,743,681	4.0%	125,811,147	1,803,681	1.43%	0.60%				
短期資産(0)	キャッシュ	600,311,152	8.6%	10,019,575	0.1%	238,070,016	2,770,239	1.16%	1.17%					
小計(46.8)		3,198,429,929	45.6%	3,354,157,916	44.2%	3,246,848,881	50,835,138	1.57%	1.49%					
生保(9.4)	第一生命	一般勘定	679,538,056	9.7%	682,438,514	9.0%	680,614,383	1,701,536	0.25%	0.25%				
合計(56.2)		3,877,967,985	55.3%	4,036,596,430	53.2%	3,927,463,264	52,536,674	1.34%	1.29%					
資産合計		7,012,510,413	100.0%	7,591,412,497	100.0%	7,125,090,561	550,515,228	7.73%	7.82%					

リバランス契約 (300044647)	内訳	前期末時価総額 <2023年3月末> (円)	構成比(%)	時価総額(円) (2024年3月末)	構成比(%)	修正簿価平残 (円)	総合収益 (円)	修正総合収 益率(%)	時間加重収 益率(%)	BM	超過収益 (%)	
国内債券	標準スタイルミックス	92,116,269	5.1%	74,574,314	3.9%	116,355,861	-2,461,338	-2.12%	-1.73%	-2.20%	0.47%	
国内株式	個別スタイルミックス	322,231,064	17.7%	398,530,329	20.7%	184,600,261	76,652,997	41.52%	41.41%	41.34%	0.07%	
外国債券	標準スタイルミックス	664,621,564	36.6%	696,454,045	36.2%	613,833,988	102,049,215	16.62%	16.27%	15.27%	1.00%	
外国株式	33F(パッシブ)		230,209,758	12.7%	359,949,241	18.7%	143,958,028	55,946,878	38.86%	42.60%	42.92%	-0.32%
	202F(グローバルコア型)		95,300,307	5.2%	76,074,036	4.0%	31,250,559	15,249,970	48.80%	40.22%	42.92%	-2.70%
小計		325,510,065	17.9%	436,023,277	22.7%	175,208,587	71,196,848	40.64%	42.82%	42.92%	-0.10%	
短期資産	短期金融資産(50F)	412,241,211	22.7%	319,374,635	16.6%	561,689,197	-43,139	-0.01%	-0.01%	0.00%	-0.01%	
合計		1,816,720,173	100.0%	1,924,956,600	100.0%	1,651,687,897	247,394,583	14.98%	15.78%	18.38%	-2.60%	