

<2024年4月～2024年8月>

資産	内訳	前期末時価総額 <2024年3月末> (円)	全体構成比 (%)	時価総額(円) (2024年8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		
伝統資産 (リバランス運用+代替投資)	国内債券 (11)	リバランス(1)	標準スタイルミックス	74,574,314	1.0%	23,190,018	0.3%	47,038,803	-1,354,036	-2.88%	-1.45%	-1.41%
		三菱UFJ 代替 (10)	アンコンストレイントH(165F)	183,239,232	2.4%	186,516,506	2.4%	183,239,232	3,277,274	1.79%	1.79%	—
			クオリティフレッド(53F)	175,432,012	2.3%	176,031,282	2.3%	175,432,012	599,270	0.34%	0.34%	—
			Neuberger(短期EM)H	237,824,843	3.1%	240,934,972	3.1%	237,824,843	3,110,129	1.31%	1.31%	—
			第一生命	第2総合口	132,172,718	1.7%	174,139,492	2.3%	134,759,698	2,744,972	2.04%	1.95%
	国内債券小計		803,243,119	10.6%	800,812,270	10.4%	778,294,588	8,377,609	1.08%	1.08%	-1.41%	
	国内株式 (9)	リバランス(5)	個別スタイルミックス	398,530,329	5.2%	448,198,781	5.8%	433,817,566	-3,672,144	-0.85%	-1.49%	-1.79%
		三菱UFJ 代替 (4)	ミニムボラティリティ(87F)	199,417,684	2.6%	163,748,088	2.1%	191,734,935	4,332,674	2.26%	1.95%	1.99%
			エンゲージメントバリュー(123F)	73,723,920	1.0%	70,974,960	0.9%	73,723,920	-2,748,960	-3.73%	-3.73%	—
			りそな	小型株集中投資(Z)	64,178,874	0.8%	59,792,446	0.8%	64,178,874	-4,386,428	-6.83%	-6.84%
	国内株式小計		735,850,807	9.7%	742,714,275	9.6%	763,455,295	-6,474,858	-0.85%	-1.36%	-1.79%	
	外国債券 (12)	リバランス(9)	標準スタイルミックス	696,454,045	9.2%	758,339,040	9.8%	773,322,221	-2,491,594	-0.32%	0.02%	-0.11%
		三菱UFJ 代替 (3)	総合型PIMCO(45F)	119,672,834	1.6%	146,815,460	1.9%	140,132,469	-2,851,281	-2.03%	-0.02%	0.27%
			総合型PIMCO(46F)H	50,264,818	0.7%	140,643,672	1.8%	63,919,337	403,064	0.63%	0.52%	0.81%
			クオリティフレッド(211F)H	60,810,561	0.8%	61,030,557	0.8%	60,810,561	219,996	0.36%	0.36%	—
外国債券小計		927,202,258	12.2%	1,106,828,729	14.4%	1,038,184,588	-4,719,815	-0.45%	0.04%	-0.11%		
外国株式 (9)	リバランス(5.5)	33F(パッシブ)	359,949,241	4.7%	383,190,624	5.0%	377,983,619	14,886,415	3.94%	3.64%	3.69%	
		202F(グローバルコア型)	76,074,036	1.0%	75,356,240	1.0%	78,246,123	453,001	0.58%	0.16%	3.69%	
	三菱UFJ 代替 (3.5)	ISTOXXクオリティ(178F)	70,338,183	0.9%	72,141,642	0.9%	70,338,183	1,803,459	2.56%	2.56%	2.60%	
		グローバルフランチャイズ(180F)	71,887,276	0.9%	72,166,544	0.9%	71,887,276	279,268	0.39%	0.39%	3.34%	
		りそな	ロイヤルロンドンAM(3E)	62,430,156	0.8%	14,671,488	0.2%	39,526,089	2,237,476	5.66%	1.34%	3.69%
	第一生命	WCMクオリティ(総合口I)	72,699,304	1.0%	73,069,459	0.9%	72,342,216	888,954	1.23%	1.21%	3.33%	
外国株式小計		713,378,196	9.4%	690,595,997	9.0%	710,323,506	20,548,573	2.89%	2.44%	3.69%		
短期資産(2.5)	短期資産小計	319,499,426	4.2%	229,229,860	3.0%	241,046,362	121,759	0.05%	0.05%	0.00%		
合計(43.8)		3,499,173,806	46.1%	3,570,181,131	46.3%	3,531,304,339	17,853,268	0.51%	0.59%			
オルタナティブ	債券戦略 (8.5)	三菱UFJ	欧州バンクローンH	299,624,944	3.9%	302,303,165	3.9%	299,624,944	2,678,221	0.89%	0.89%	—
		三井住友	世界物価連動国債(159F)H	21,898,890	0.3%	21,772,920	0.3%	21,898,890	-125,970	-0.58%	-0.58%	-0.62%
		ウエリントンGTRH	293,816,857	3.9%	296,612,038	3.8%	293,816,857	2,795,181	0.95%	0.95%	—	
	債券戦略小計		615,340,691	8.1%	620,688,123	8.0%	615,340,691	5,347,432	0.87%	0.87%	—	
	国内株式 (1.5)	三菱UFJ	サステイナブル成長銘柄(74F)	71,056,016	0.9%	69,966,030	0.9%	71,056,016	-1,089,986	-1.53%	-1.53%	-1.79%
		りそな	株式口2A(M/N)	55,014,120	0.7%	52,976,560	0.7%	55,014,120	-2,037,560	-3.70%	-3.70%	—
	国内株式小計		126,070,136	1.7%	122,942,590	1.6%	126,070,136	-3,127,546	-2.48%	-2.47%	—	
	マルチストラ テジー (14.5)	三菱UFJ	Black stone AAM(FOFs)H	343,677,309	4.5%	347,554,556	4.5%	343,677,309	3,877,247	1.13%	1.13%	—
			LMRファンドリミテッド(FOFs)H	343,554,522	4.5%	343,755,420	4.5%	343,554,522	200,898	0.06%	0.06%	—
		みずほ	ファラロン(イベント・ドリアン)H	350,914,101	4.6%	359,422,986	4.7%	350,914,101	8,508,885	2.42%	2.43%	—
	マルチストラテジー小計		1,038,145,932	13.7%	1,050,732,962	13.6%	1,038,145,932	12,587,030	1.21%	1.21%	—	
	外国株式 (9.5)	みずほ	Marshall Wace(L/S)H	392,974,629	5.2%	406,461,758	5.3%	392,974,629	13,487,129	3.43%	3.43%	—
		三菱UFJ	North Rock(L/S)H	298,661,140	3.9%	307,399,473	4.0%	298,661,140	8,738,333	2.93%	2.93%	—
	外国株式小計		691,635,769	9.1%	713,861,231	9.3%	691,635,769	22,225,462	3.21%	3.21%	—	
	不動産(4.5)	みずほ	UBS不動産FOFsH	268,202,132	3.5%	259,549,535	3.4%	268,202,132	-8,652,597	-3.23%	-3.23%	—
S&P先進国REIT(91F)			55,634,065	0.7%	59,934,490	0.8%	55,634,065	4,300,425	7.73%	7.73%	7.80%	
不動産小計		323,836,197	4.3%	319,484,025	4.1%	323,836,197	-4,352,172	-1.34%	-1.35%	—		
インフラ(4.2)	三菱UFJ	KKRグローバルインフラコアH	300,000,000	4.0%	310,121,197	4.0%	303,584,650	10,121,197	3.33%	3.37%	—	
PE(4.3)	三菱UFJ	HarbourVest GPS	304,743,681	4.0%	308,149,487	4.0%	304,743,681	3,405,806	1.12%	1.12%	—	
短期資産(0)	キャッシュ	10,027,771	0.1%	10,031,980	0.1%	10,028,120	4,209	0.04%	0.04%	0.00%		
小計(47)		3,409,800,177	44.9%	3,456,011,595	44.8%	3,413,385,176	46,211,418	1.35%	1.36%			
生保(9.5)	第一生命	一般勘定	684,578,709	9.0%	686,594,066	8.9%	685,494,236	718,360	0.10%	0.10%	—	
合計(56.5)		4,094,378,886	53.9%	4,142,605,661	53.7%	4,098,879,412	46,929,778	1.14%	1.15%			
資産合計		7,593,552,692	100.0%	7,712,786,792	100.0%	7,630,183,751	64,783,046	0.85%	0.88%			

リバランス契約 (300044647)	内訳	前期末時価総額 <2024年3月末> (円)	構成比(%)	時価総額(円) (2024年8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
国内債券	標準スタイルミックス	74,574,314	3.9%	23,190,018	1.2%	47,038,803	-1,354,036	-2.88%	-1.45%	-1.41%
国内株式	個別スタイルミックス	398,530,329	20.7%	448,198,781	23.4%	433,817,566	-3,672,144	-0.85%	-1.49%	-1.79%
外国債券	標準スタイルミックス	696,454,045	36.2%	758,339,040	39.6%	773,322,221	-2,491,594	-0.32%	0.02%	-0.11%
外国株式	33F(パッシブ)	359,949,241	18.7%	383,190,624	20.0%	377,983,619	14,886,415	3.94%	3.64%	3.69%
	202F(グローバルコア型)	76,074,036	4.0%	75,356,240	3.9%	78,246,123	453,001	0.58%	0.18%	3.69%
小計		436,023,277	22.7%	458,546,864	23.9%	456,229,742	15,339,416	3.36%	3.05%	3.69%
短期資産	短期金融資産(50F)	319,374,635	16.6%	229,076,308	11.9%	239,672,904	121,715	0.05%	0.05%	0.00%
合計		1,924,956,600	100.0%	1,917,351,011	100.0%	1,950,081,239	7,943,357	0.41%	0.53%	0.43%

リバランス契約 (300044647)	下限	2024年度中心値	上限
国内債券	0%	4%	13%
国内株式	4%	22%	35%
外国債券	4%	39%	52%
外国株式	4%	24%	37%
短期資産	4%	11%	86%

政策アセットミックス(全体)	下限	2024年度中心値
国内債券	5.0%	11.0%
国内株式	2.0%	9.0%
外国債券	2.0%	12.0%
外国株式	2.0%	9.0%
短期資産	1.0%	2.5%
オルタナ等	51.0%	56.5%