全体分

鹿児島県病院企業年金基金

<2022年4月～2022年8月>

リバランスファンド　代替投資ファンド　オルタナティブ等

基金ホームページ ： ID usrkkikin パスワード bikikn2288

資産			内訳	前期末時価総額 <2022年3月末> (円)	全体構成比 (%)	時価総額（円） (2022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	超過収益 (%)
伝統資産（リバランス運用＋代替投資）	国内債券 (12.5)	リバランス(3)	標準スタイルミックス	196,568,379	2.8%	195,288,081	2.8%	196,568,379	-1,280,298	-0.65%	-0.65%	-0.88%	0.23%
		三菱UFJ 代替(9.5)	アンコンストレインド(165F)	236,612,876	3.4%	179,020,710	2.6%	201,604,040	-7,586,532	-3.76%	-3.47%	-	-
			クオリティスプレッド(53F)	59,901,752	0.8%	119,130,352	1.7%	98,393,308	-762,167	-0.77%	-0.63%	-	-
		三井住友	Neuberger(短期EM)	239,851,037	3.4%	231,134,578	3.3%	239,851,037	-8,716,459	-3.63%	-3.63%	-	-
		第一生命	第2総合口	133,693,893	1.9%	132,201,918	1.9%	133,379,372	-1,048,055	-0.79%	-0.78%	-	-
	国内債券小計			866,627,937	12.3%	856,775,639	12.2%	869,796,136	-19,393,511	-2.23%	-2.21%	-0.88%	-1.33%
	国内株式 (9)	リバランス(6)	個別スタイルミックス	393,439,773	5.6%	396,253,158	5.7%	393,439,773	2,813,385	0.72%	0.72%	1.14%	-0.42%
		三菱UFJ 代替(3)	ミニマムボラティリティ(87F)	42,630,725	0.6%	75,785,099	1.1%	63,606,216	3,161,382	4.97%	3.11%	3.17%	-0.06%
			iSTOXXクオリティ(99F)	87,846,420	1.2%	56,030,088	0.8%	67,667,834	-1,813,329	-2.68%	-0.23%	-0.29%	0.06%
		りそな	小型株集中投資(Z)	72,431,064	1.0%	80,748,606	1.2%	72,431,064	8,317,542	11.48%	11.48%	-	-
				596,347,982	8.5%	608,816,951	8.7%	597,144,887	12,478,980	2.09%	2.14%	1.14%	1.00%
	外国債券 (13)	リバランス(6)	標準スタイルミックス	403,455,179	5.7%	405,786,180	5.8%	398,778,389	12,367,805	3.10%	3.15%	1.82%	1.33%
		三菱UFJ 代替(7)	綜合型PIMCO(45F)	235,869,088	3.3%	438,012,948	6.2%	375,676,112	12,192,033	3.25%	2.66%	3.31%	-0.65%
			綜合型PIMCO(46F)H	175,443,030	2.5%	104,413,379	1.5%	96,273,138	-11,006,264	-11.43%	-6.46%	-6.15%	-0.31%
			パッシブH(44F)	91,119,168	1.3%	25,696,494	0.4%	50,068,030	-5,402,982	-10.79%	-7.07%	-7.12%	0.05%
	外国債券小計			905,886,465	12.9%	973,909,001	13.9%	920,795,669	8,150,592	0.89%	0.93%	1.82%	-0.89%
	外国株式 (13.5)	リバランス(6)	33F(パッシブ)	273,889,964	3.9%	138,380,933	2.0%	286,256,754	4,562,958	1.59%	-0.95%	-0.85%	-0.10%
			202F(グローバルコア型)	113,594,672	1.6%	186,662,905	2.7%	96,343,529	-16,619,700	-17.25%	-7.38%	-0.85%	-6.53%
		三菱UFJ 代替(7.5)	パッシブH(50F)	102,476,340	1.5%	19,251,152	0.3%	59,571,503	-13,177,097	-22.12%	-12.98%	-12.71%	-0.27%
			iSTOXXクオリティ(178F)	181,924,050	2.6%	175,033,320	2.5%	181,924,050	-6,890,730	-3.79%	-3.79%	-3.77%	-0.02%
			グローバルフランチャイズ(180F)	166,695,370	2.4%	221,674,719	3.2%	200,995,706	4,998,859	2.49%	1.88%	-0.77%	2.65%
		みずほ	S&P先進国REIT(91F)	51,507,765	0.7%	49,308,195	0.7%	51,507,765	-2,199,570	-4.27%	-4.27%	-4.03%	-0.24%
		第一生命	WCMクオリティ(総合口Ⅰ)	50,907,976	0.7%	49,147,231	0.7%	50,667,352	-1,464,799	-2.89%	-2.80%	-0.51%	-2.29%
	外国株式小計			940,996,137	13.4%	839,458,455	12.0%	927,266,659	-30,790,079	-3.32%	-3.34%	-0.85%	-2.49%
	短期資産(2)		短期資産小計	102,827,654	1.5%	293,710,248	4.2%	210,858,875	0	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
合計(50)				3,412,686,175	48.4%	3,572,670,294	50.9%	3,525,862,226	-29,554,018	**-0.84%**	**-0.93%**		
オルタナティブ	債券戦略 (11)	三菱UFJ	欧州バンクローン	327,918,649	4.7%	354,863,988	5.1%	333,997,080	-3,054,661	-0.91%	-1.29%		
			世界物価連動国債(159F)H	114,978,304	1.6%	22,549,016	0.3%	77,173,129	-12,417,719	-16.09%	-10.77%		
			外債米総合連動(547F)	91,869,012	1.3%	27,192,256	0.4%	44,482,519	-4,667,084	-10.49%	-6.39%		
		三井住友	BlueBayクレジットLS	262,632,708	3.7%	260,846,916	3.7%	262,632,708	-1,785,792	-0.68%	-0.68%		
	債券戦略小計			797,398,673	11.3%	665,452,176	9.5%	718,285,436	-21,925,256	-3.05%	-2.61%		
	損害保険(0)	三菱UFJ	ネフィラ損害保険戦略	1,510,319	0.0%	1,748,178	0.0%	1,510,319	237,859	15.75%	15.75%		
	国内株式 (5)	三菱UFJ	サスティナブル成長銘柄(74F)	150,476,289	2.1%	211,156,386	3.0%	153,493,040	717,030	0.47%	1.15%		
			FSI日本株戦略(122F)	155,887,704	2.2%	51,097,112	0.7%	122,730,409	-14,788,414	-12.05%	-5.19%		
		りそな	株式口2A(M/N)	53,287,044	0.8%	53,626,524	0.8%	53,287,044	339,480	0.64%	0.64%		
	国内株式小計			359,651,037	5.1%	315,880,022	4.5%	329,510,493	-13,731,904	-4.17%	-1.57%		
	マルチストラテジー (20)	三菱UFJ	DRF(184F_マルチ)	225,196,380	3.2%	209,073,165	3.0%	225,196,380	-16,123,215	-7.16%	-7.16%		
			Black stone AAM(FOFs)	328,849,085	4.7%	335,676,512	4.8%	328,849,085	6,827,427	2.08%	2.08%		
			LMRファンドリミテッド(FOF)	332,602,545	4.7%	331,442,511	4.7%	332,602,545	-1,160,034	-0.35%	-0.35%		
		三井住友	Pictet(M/N)	192,828,378	2.7%	186,448,075	2.7%	192,828,378	-6,380,303	-3.31%	-3.31%		
		みずほ	ファラロン(イベント・ドリブン)	347,703,012	4.9%	342,124,872	4.9%	347,703,012	-5,578,140	-1.60%	-1.60%		
	マルチストラテジー小計			1,427,179,400	20.3%	1,404,765,135	20.0%	1,427,179,400	-22,414,265	-1.57%	-1.57%		
	外国株式(5)	みずほ	Marshall Wace(L/S)	372,594,124	5.3%	374,428,208	5.3%	372,594,124	1,834,084	0.49%	0.49%		
	外国株式小計			372,594,124	5.3%	374,428,208	5.3%	372,594,124	1,834,084	0.49%	0.49%		
	短期資産(0)		キャッシュ	1,888,695	0.0%	1,945,133	0.0%	12,321,236	0	0.00%	0.00%		
小計(41)				2,960,222,248	42.0%	2,764,218,852	39.4%	2,861,401,008	-55,999,482	-1.96%	-1.68%		
	一般勘定(9)	第一生命	一般勘定	674,818,729	9.6%	676,266,315	9.6%	675,340,987	707,720	0.10%	0.10%		
合計(50)				3,635,040,977	51.6%	3,440,485,167	49.1%	3,536,741,995	-55,291,762	**-1.56%**	**-1.35%**		
資産合計				7,047,727,152	100.0%	7,013,155,461	100.0%	7,062,604,221	-84,845,780	**-1.20%**	**-1.11%**		

リバランス契約 (300044647)		内訳	前期末時価総額 <2022年3月末> (円)	構成比(%)	時価総額（円） (2022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	超過収益 (%)
リバランスファンド	国内債券	標準スタイルミックス	196,568,379	13.2%	195,288,081	12.2%	196,568,379	-1,280,298	-0.65%	-0.65%	-0.88%	0.23%
	国内株式	個別スタイルミックス	393,439,773	26.5%	396,253,158	24.8%	393,439,773	2,813,385	0.72%	0.72%	1.14%	-0.42%
	外国債券	標準スタイルミックス	403,455,179	27.2%	405,786,180	25.4%	398,778,389	12,367,805	3.10%	3.15%	1.82%	1.33%
	外国株式	33F(パッシブ)	273,889,964	18.5%	138,380,933	8.7%	286,256,754	4,562,958	1.59%	-0.95%	-0.85%	-0.10%
		202F(グローバルコア型)	113,594,672	7.7%	186,662,905	11.7%	96,343,529	-16,619,700	-17.25%	-7.38%	-0.85%	-6.53%
		小計	387,484,636	26.1%	325,043,838	20.4%	382,600,283	-12,056,742	-3.15%	-3.79%	-0.85%	-2.94%
	短期資産	短期金融資産(50F)	102,796,094	6.9%	273,491,043	17.1%	198,235,754	0	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
合計			1,483,744,061	100.0%	1,595,862,300	100.0%	1,569,622,578	1,844,150	**0.12%**	**0.02%**	0.51%	-0.49%

リバランス契約 (300044647)	下限	2022年度中心値	上限
国内債券	4%	13%	22%
国内株式	4%	26%	40%
外国債券	8%	26%	44%
外国株式	4%	26%	40%
短期資産	5%	9%	79%

政策アセットミックス(全体)	下限	2022年度中心値	上限
国内債券	6.0%	12.5%	20.0%
国内株式	2.0%	9.0%	17.0%
外国債券	5.0%	13.0%	21.0%
外国株式	4.5%	13.5%	20.5%
短期資産	1.0%	2.0%	18.0%
オルタナ等	45.0%	50.0%	55.0%