

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10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%	193,188,400	2.8%	196,568,379	-3,379,979	-1.72%	-1.72%	-2.04%	0.32%	
		三菱UFJ 三井住友 第一生命	代替 (9.5)	アンコンストレイントH(165F)	236,612,876	3.4%	102,659,910	1.5%	188,029,262	-13,450,889	-7.15%	-6.99%	-	-
				クオリティブレッド(53F)	59,901,752	0.8%	116,744,048	1.7%	104,274,757	-1,656,738	-1.59%	-1.38%	-	-
				Neuberger(短期EM)H	239,851,037	3.4%	223,841,628	3.2%	239,851,037	-16,009,409	-6.67%	-6.68%	-	-
				第2総合口	133,693,893	1.9%	130,400,717	1.9%	132,918,312	-2,849,256	-2.14%	-2.14%	-	-
	国内債券小計		866,627,937	12.3%	766,834,703	11.0%	861,641,747	-37,346,271	-4.33%	-4.34%	-2.04%	-2.30%		
	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%	393,963,671	5.6%	393,367,337	561,403	0.14%	0.14%	0.46%	-0.32%	
		三菱UFJ りそな	代替 (3)	ミニマムボラティリティ(87F)	42,630,725	0.6%	75,162,503	1.1%	66,176,625	2,538,786	3.84%	2.26%	2.32%	-0.06%
				iSTOXXクオリティ(99F)	87,846,420	1.2%	55,183,752	0.8%	65,195,081	-2,659,665	-4.08%	-1.74%	-1.86%	0.12%
				小型株集中投資(2)	72,431,064	1.0%	85,255,524	1.2%	72,381,634	13,248,725	18.30%	18.35%	-	-
	国内株式小計		596,347,982	8.5%	609,565,450	8.7%	597,120,677	13,689,249	2.29%	2.35%	0.46%	1.89%		
	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%	333,011,919	4.8%	382,169,843	19,602,655	5.13%	5.06%	3.59%	1.47%	
		三菱UFJ	代替 (7)	総合型PIMCO(45F)	235,869,088	3.3%	551,885,461	7.9%	415,495,060	16,073,311	3.87%	3.77%	4.66%	-0.89%
総合型PIMCO(46F)H				175,443,030	2.5%	22,313,922	0.3%	80,139,057	-13,094,505	-16.34%	-10.98%	-10.52%	-0.46%	
バッシブH(44F)				91,119,168	1.3%	0	0.0%	36,410,135	-5,927,800	-16.28%	-9.92%	-9.80%	-0.12%	
外国債券小計		905,886,465	12.9%	907,211,302	13.0%	914,214,095	16,653,661	1.82%	1.85%	3.59%	-1.74%			
外国株式 (13.5)	リバランス(6)	33F(バッシブ)	273,889,964	3.9%	144,780,152	2.1%	244,127,344	10,962,177	4.49%	3.63%	3.76%	-0.13%		
	三菱UFJ みずほ 第一生命	代替 (7.5)	202F(グローバルコア型)	113,594,672	1.6%	185,908,814	2.7%	126,034,736	-17,373,791	-13.78%	-7.75%	3.76%	-11.51%	
			バッシブH(50F)	102,476,340	1.5%	0	0.0%	49,188,696	-13,584,700	-27.62%	-16.69%	-16.30%	-0.39%	
			iSTOXXクオリティ(178F)	181,924,050	2.6%	76,523,132	1.1%	171,861,757	-4,336,221	-2.52%	-0.67%	-0.57%	-0.10%	
			グローバル franchises(180F)	166,695,370	2.4%	256,310,704	3.7%	211,314,767	9,903,628	4.69%	3.99%	3.51%	0.48%	
			S&P先進国REIT(91F)	51,507,765	0.7%	47,885,592	0.7%	51,480,250	-3,461,448	-6.72%	-6.70%	-6.47%	-0.22%	
			WCMクオリティ(総合口I)	50,907,976	0.7%	50,475,086	0.7%	50,107,345	-136,944	-0.27%	-0.18%	2.35%	-2.53%	
外国株式小計		940,996,137	13.4%	761,883,480	10.9%	904,114,895	-18,027,299	-1.99%	-1.60%	3.76%	-5.36%			
短期資産(2)	短期資産小計	102,827,654	1.5%	561,045,790	8.0%	274,115,189	-30,944	-0.01%	0.00%	0.00%	0.00%			
合計(50)		3,412,686,175	48.4%	3,606,540,725	51.5%	3,551,206,603	-25,061,604	-0.71%	-0.78%					
オルタナティブ	債券戦略 (11)	三菱UFJ 三井住友	欧州バンクローンH	327,918,649	4.7%	338,205,653	4.8%	340,815,845	-19,712,996	-5.78%	-5.93%			
			世界物価連動国債(159F)H	114,978,304	1.6%	20,901,636	0.3%	62,356,493	-14,065,099	-22.56%	-17.29%			
			外債米総合連動(547F)H	91,869,012	1.3%	11,081,976	0.2%	34,631,833	-5,775,606	-16.68%	-12.66%			
			BlueBayクレジットLS	262,632,708	3.7%	259,451,649	3.7%	262,632,708	-3,181,059	-1.21%	-1.21%			
	債券戦略小計		797,398,673	11.3%	629,640,914	9.0%	700,436,879	-42,734,760	-6.10%	-5.77%				
	損害保険(0)	三菱UFJ	ネフィラ損害保険戦略	1,510,319	0.0%	1,738,581	0.0%	1,510,319	228,262	15.11%	15.11%			
	国内株式 (5)	三菱UFJ りそな	代替	サステナブル成長銘柄(74F)	150,476,289	2.1%	208,926,102	3.0%	171,454,426	-998,050	-0.58%	0.34%		
				FSI日本株戦略(122F)	155,887,704	2.2%	50,487,718	0.7%	103,260,570	-15,397,808	-14.91%	-6.32%		
				株式口2A(M/N)	53,287,044	0.8%	54,301,712	0.8%	53,287,044	1,014,668	1.90%	1.90%		
	国内株式小計		359,651,037	5.1%	313,715,532	4.5%	328,002,040	-15,381,190	-4.69%	-2.08%				
	マルチストラ テジー (20)	三菱UFJ 三井住友 みずほ	代替	DRF(184F_マルチ)	225,196,380	3.2%	93,582,090	1.3%	211,796,635	-31,003,160	-14.64%	-15.17%		
				Black stone AAM(FOFs)	328,849,085	4.7%	334,401,861	4.8%	328,849,085	5,552,776	1.69%	1.69%		
				LMRファンドリミテッド(FOF)	332,602,545	4.7%	336,310,155	4.8%	332,602,545	3,707,610	1.11%	1.11%		
Pictet(M/N)				192,828,378	2.7%	184,965,515	2.6%	192,828,378	-7,862,863	-4.08%	-4.08%			
ファラロン(イベントドリブン)				347,703,012	4.9%	337,844,163	4.8%	347,703,012	-9,858,849	-2.84%	-2.84%			
マルチストラテジー小計		1,427,179,400	20.3%	1,287,103,784	18.4%	1,413,779,655	-39,464,486	-2.79%	-2.76%					
外国株式(5)	みずほ	Marshall Wace(L/S)	372,594,124	5.3%	381,984,579	5.5%	372,594,124	9,390,455	2.52%	2.52%				
外国株式小計		372,594,124	5.3%	381,984,579	5.5%	372,594,124	9,390,455	2.52%	2.52%					
短期資産(0)	キャッシュ	1,888,695	0.0%	101,482,070	1.5%	22,221,074	-157	0.00%	0.00%					
小計(41)		2,960,222,248	42.0%	2,715,665,460	38.8%	2,838,544,091	-87,961,876	-3.10%	-2.83%					
一般勘定(9)	第一生命	一般勘定	674,818,729	9.6%	676,548,569	9.7%	675,403,016	989,974	0.15%	0.15%				
合計(50)		3,635,040,977	51.6%	3,392,214,029	48.5%	3,513,947,107	-86,971,902	-2.48%	-2.27%					
資産合計		7,047,727,152	100.0%	6,998,754,754	100.0%	7,065,153,710	-112,033,506	-1.59%	-1.49%					

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10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	196,568,379	13.2%	193,188,400	11.9%	196,568,379	-3,379,979	-1.72%	-1.72%	-2.04%	0.32%
国内株式	個別スタイルミックス	393,439,773	26.5%	393,963,671	24.3%	393,367,337	561,403	0.14%	0.14%	0.46%	-0.32%
外国債券	標準スタイルミックス	403,455,179	27.2%	333,011,919	20.5%	382,169,843	19,602,655	5.13%	5.06%	3.59%	1.47%
外国株式	33F(バッシブ)	273,889,964	18.5%	144,780,152	8.9%	244,127,344	10,962,177	4.49%	3.63%	3.76%	-0.13%
	202F(グローバルコア型)	113,594,672	7.7%	185,908,814	11.5%	126,034,736	-17,373,791	-13.78%	-7.75%	3.76%	-11.51%
小計		387,484,636	26.1%	330,688,966	20.4%	370,162,080	-6,411,614	-1.73%	-2.12%	3.76%	-5.88%
短期資産	短期金融資産(50F)	102,796,094	6.9%	371,958,849	22.9%	236,266,890	-24,421	-0.01%	0.00%	0.00%	0.00%
合計		1,483,744,061	100.0%	1,622,811,805	100.0%	1,578,534,531	10,348,044	0.66%	0.51%	1.92%	-1.41%

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%