

<2022年4月～2022年12月>

基金ホームページ：ID usrkikin パスワード bikkn2288

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12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(%)	時間加重重 収益率(%)	BM	超過収益 (%)	
国内債券 (12.5)	リバランス(3)	標準スタイルミックス	2.8%	189,508,544	2.7%	189,508,544	-7,059,835	-3.59%	-3.59%	-3.79%	0.20%	
	三菱UFJ 代替 (9.5)	アンコンストレイントH(165F)	3.4%	103,757,434	1.5%	171,411,931	-12,353,365	-7.21%	-6.00%	-	-	
		クオリティブレッド(53F)	0.8%	59,901,752	1.7%	107,404,294	-3,705,678	-3.45%	-3.11%	-	-	
		Neuberger(短期EM)H	3.4%	239,851,037	3.3%	239,851,037	-9,535,032	-3.98%	-3.98%	-	-	
	第一生命	第2総合口	1.9%	128,040,523	1.8%	132,343,581	-5,209,450	-3.94%	-3.91%	-	-	
国内債券小計			12.3%	766,317,614	11.1%	847,579,222	-37,863,360	-4.47%	-4.40%	-3.79%	-0.61%	
国内株式 (9)	リバランス(6)	個別スタイルミックス	5.6%	386,473,785	5.6%	386,473,785	-6,928,483	-1.76%	-1.76%	-1.30%	-0.46%	
	三菱UFJ 代替 (3)	ミニムボラティリティ(87F)	0.6%	74,344,348	1.1%	67,606,707	1,720,631	2.55%	1.15%	1.19%	-0.04%	
		iSTOXXクオリティ(99F)	1.2%	87,846,420	0.8%	63,819,331	-4,673,019	-7.32%	-5.32%	-5.51%	0.19%	
	りそな	小型株集中投資(2)	1.0%	72,431,064	1.2%	72,321,496	13,372,493	18.49%	18.52%	-	-	
国内株式小計			8.5%	599,367,823	8.7%	597,057,782	3,491,622	0.58%	0.63%	-1.30%	1.93%	
外国債券 (13)	リバランス(6)	標準スタイルミックス	5.7%	307,529,289	4.4%	369,376,738	-5,879,975	-1.59%	-2.98%	-4.87%	1.89%	
	三菱UFJ 代替 (7)	総合型PIMCO(45F)	3.3%	235,869,088	7.4%	443,648,398	-19,992,995	-4.51%	-3.01%	-2.86%	-0.15%	
		総合型PIMCO(46F)H	2.5%	175,443,030	0.3%	66,528,587	-12,792,644	-19.23%	-9.78%	-9.79%	0.01%	
		パッシブ(44F)	1.3%	91,119,168	0.0%	26,367,186	-5,927,800	-22.48%	-9.92%	-9.80%	-0.12%	
外国債券小計			12.9%	845,964,227	12.2%	905,920,909	-44,593,414	-4.92%	-5.02%	-4.87%	-0.15%	
外国株式 (13.5)	リバランス(6)	33F(パッシブ)	3.9%	131,147,899	1.9%	220,688,072	-2,670,076	-1.21%	-6.13%	-6.02%	-0.11%	
	202F(グローバルコア型)		1.6%	168,532,416	2.4%	142,553,844	-34,750,189	-24.38%	-16.37%	-6.02%	-10.35%	
	三菱UFJ 代替 (7.5)	パッシブ(50F)	1.5%	0	0.0%	41,814,554	-13,584,700	-32.49%	-16.69%	-16.30%	-0.39%	
		iSTOXXクオリティ(178F)	2.6%	181,924,050	1.0%	156,460,872	-8,923,258	-5.70%	-6.62%	-6.47%	-0.15%	
		グローバルランチ(180F)	2.4%	166,695,370	3.5%	219,106,513	-4,676,244	-2.13%	-1.93%	-5.82%	3.89%	
	みずほ	S&P先進国REIT(91F)	0.7%	51,507,765	0.6%	51,446,774	-7,881,184	-15.32%	-15.31%	-15.09%	-0.22%	
	第一生命	WCMクオリティ(総合口I)	0.7%	50,907,976	0.6%	49,399,024	-5,857,786	-11.86%	-11.49%	-5.87%	-5.62%	
外国株式小計			13.4%	701,567,342	10.1%	881,469,653	-78,343,437	-8.89%	-9.39%	-6.02%	-3.37%	
短期資産(2)	短期資産小計		1.5%	612,689,105	8.8%	342,479,117	-30,944	-0.01%	0.00%	0.00%	0.00%	
合計(50)			48.4%	3,525,906,111	50.9%	3,574,506,683	-157,339,533	-4.40%	-4.23%			
債券戦略 (11)	三菱UFJ	欧州バンクローンH	4.7%	350,397,044	5.1%	344,609,558	-7,521,605	-2.18%	-2.54%			
		世界物価連動国債(159F)H	1.6%	20,710,781	0.3%	54,113,055	-14,255,954	-26.34%	-18.04%			
		外債米総合連動(547F)H	1.3%	11,305,692	0.2%	28,181,888	-5,551,890	-19.70%	-10.89%			
	三井住友	BlueBayクレジットLS	3.7%	265,571,670	3.8%	262,632,708	2,938,962	1.12%	1.12%			
	債券戦略小計			11.3%	647,985,187	9.4%	689,537,209	-24,390,487	-3.54%	-3.03%		
	損害保険(0)	三菱UFJ	ネフィラ損害保険戦略	0.0%	2,171,624	0.0%	1,510,319	661,305	43.79%	43.79%		
	国内株式 (5)	三菱UFJ	サステナブル成長銘柄(74F)	2.1%	196,361,238	2.8%	181,403,814	-13,562,914	-7.48%	-5.69%		
			FSI日本株戦略(122F)	2.2%	49,268,930	0.7%	92,428,259	-16,616,596	-17.98%	-8.59%		
		りそな	株式口2A(M/N)	0.8%	53,241,780	0.8%	53,287,044	-45,264	-0.08%	-0.09%		
	国内株式小計			5.1%	298,871,948	4.3%	327,119,117	-30,224,774	-9.24%	-6.72%		
マルチストラ テジー (20)	三菱UFJ	DRF(184F_マルチ)	3.2%	96,294,240	1.4%	191,275,932	-28,291,010	-14.79%	-12.71%			
		Black stone AAM(FOFs)	4.7%	335,152,945	4.8%	328,849,085	6,303,860	1.92%	1.92%			
		LMRファンドリミテッド(FOF)	4.7%	340,942,941	4.9%	332,602,545	8,340,396	2.51%	2.51%			
	三井住友	Pictet(M/N)	2.7%	186,064,198	2.7%	192,828,378	-6,764,180	-3.51%	-3.51%			
	みずほ	ファラロン(イベント・ドリブン)	4.9%	339,819,477	4.9%	347,703,012	-7,883,535	-2.27%	-2.27%			
マルチストラテジー小計			20.3%	1,298,273,801	18.7%	1,393,258,952	-28,294,469	-2.03%	-1.98%			
外国株式(5)	みずほ	Marshall Wace(L/S)	5.3%	372,862,956	5.4%	372,594,124	268,832	0.07%	0.07%			
外国株式小計			5.3%	372,862,956	5.4%	372,594,124	268,832	0.07%	0.07%			
短期資産(0)	キャッシュ		0.0%	101,482,070	1.5%	39,802,628	-157	0.00%	0.00%			
小計(41)			42.0%	2,721,647,586	39.3%	2,823,822,349	-81,979,750	-2.90%	-2.61%			
一般勘定(9)	第一生命	一般勘定	9.6%	676,830,823	9.8%	675,437,526	1,272,228	0.19%	0.19%			
合計(50)			51.6%	3,398,478,409	49.1%	3,499,259,875	-80,707,522	-2.31%	-2.09%			
資産合計			100.0%	6,924,384,520	100.0%	7,073,766,558	-238,047,055	-3.37%	-3.24%			

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12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%	189,508,544	11.8%	189,508,379	-7,059,835	-3.59%	-3.59%	-3.79%	0.20%
国内株式	個別スタイルミックス	393,439,773	26.5%	386,473,785	24.1%	393,310,246	-6,928,483	-1.76%	-1.76%	-1.30%	-0.46%
外国債券	標準スタイルミックス	403,455,179	27.2%	307,529,289	19.1%	369,376,738	-5,879,975	-1.59%	-2.98%	-4.87%	1.89%
外国株式	33F(パッシブ)	273,889,964	18.5%	131,147,899	8.2%	220,688,072	-2,670,076	-1.21%	-6.13%	-6.02%	-0.11%
	202F(グローバルコア型)	113,594,672	7.7%	168,532,416	10.5%	142,553,844	-34,750,189	-24.38%	-16.37%	-6.02%	-10.35%
小計			26.1%	299,680,315	18.7%	363,241,916	-37,420,265	-10.30%	-11.30%	-6.02%	-5.28%
短期資産	短期金融資産(50F)	102,796,094	6.9%	423,602,164	26.4%	271,083,337	-24,421	-0.01%	-0.01%	0.00%	-0.01%
合計			100.0%	1,606,794,097	100.0%	1,593,580,617	-57,312,979	-3.60%	-3.55%	-3.45%	-0.10%

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%
オルタナティブ	45.0%	50.0%	55.0%