

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) (2023年2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%	90,869,416	1.3%	185,415,660	-5,663,462	-3.05%	-2.72%	-3.01%	0.29%	
		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%	128,712,226	1.8%	163,583,524	-12,393,345	-7.58%	-5.66%	-	-
				クオリティブレッド(53F)	59,901,752	0.8%	114,604,044	1.6%	109,343,704	-3,796,742	-3.47%	-3.19%	-	-
				Neuberger(短期EM)H	239,851,037	3.4%	230,102,366	3.3%	239,851,037	-9,748,671	-4.06%	-4.07%	-	-
				第2総合口	133,693,893	1.9%	127,874,895	1.8%	131,987,414	-5,375,078	-4.07%	-4.03%	-	-
	国内債券小計			866,627,937	12.3%	692,162,947	9.9%	830,181,339	-36,977,298	-4.45%	-4.46%	-3.01%	-1.45%	
	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%	315,455,745	4.5%	384,988,850	12,229,023	3.18%	3.63%	4.04%	-0.41%	
		三菱UFJ リそな	代替 (3)	ミニマムボラティリティ(87F)	42,630,725	0.6%	96,520,940	1.4%	70,168,307	3,912,551	5.58%	3.88%	3.90%	-0.02%
				iSTOXXクオリティ(99F)	87,846,420	1.2%	0	0.0%	57,915,999	-1,841,067	-3.18%	-0.26%	-	-
				小型株集中投資(Z)	72,431,064	1.0%	91,258,272	1.3%	72,284,228	19,251,473	26.63%	26.68%	-	-
	国内株式小計			596,347,982	8.5%	503,234,957	7.2%	585,357,384	33,551,980	5.73%	5.98%	4.04%	1.94%	
	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%	447,965,966	6.4%	367,286,494	4,568,605	1.24%	0.06%	-1.76%	1.82%	
		三菱UFJ	代替 (7)	総合型PIMCO(45F)	235,869,088	3.3%	99,322,625	1.4%	419,868,027	-6,472,541	-1.54%	0.52%	0.44%	0.08%
				総合型PIMCO(46F)H	175,443,030	2.5%	51,814,950	0.7%	61,146,948	-13,583,969	-22.22%	-9.88%	-10.15%	0.27%
				パッシブH(44F)	91,119,168	1.3%	0	0.0%	20,143,455	-5,927,800	-29.43%	-9.92%	-9.80%	-0.12%
クオリティブレッド(211F)H				0	0.0%	50,016,807	0.7%	4,939,645	21,611	0.44%	0.04%	-	-	
外国債券小計			905,886,465	12.9%	649,120,348	9.3%	873,384,569	-21,394,094	-2.45%	-2.23%	-1.76%	-0.47%		
外国株式 (13.5)	リバランス(6)	33F(パッシブ)	273,889,964	3.9%	191,234,742	2.7%	208,406,147	7,457,966	3.58%	1.45%	1.61%	-0.16%		
			202F(グローバルコア型)	113,594,672	1.6%	133,177,555	1.9%	145,765,926	-19,773,431	-13.57%	-8.33%	1.61%	-9.94%	
	三菱UFJ	代替 (7.5)	パッシブH(50F)	102,476,340	1.5%	0	0.0%	37,244,713	-13,584,700	-36.47%	-16.69%	-16.30%	-0.39%	
			iSTOXXクオリティ(178F)	181,924,050	2.6%	46,175,472	0.7%	144,621,570	-4,671,476	-3.23%	-0.41%	-0.19%	-0.22%	
			グローバルフランチャイズ(180F)	166,695,370	2.4%	128,550,058	1.8%	217,933,777	2,161,521	0.99%	1.09%	1.67%	-0.58%	
			S&P先進国REIT(91F)	51,507,765	0.7%	47,323,004	0.7%	51,426,029	-4,024,036	-7.82%	-7.79%	-7.47%	-0.32%	
			WCMクオリティ(総合口I)	50,907,976	0.7%	48,909,324	0.7%	48,960,069	-1,702,706	-3.48%	-3.27%	1.22%	-4.49%	
	外国株式小計			940,996,137	13.4%	595,370,155	8.5%	854,358,231	-34,136,862	-4.00%	-3.19%	1.61%	-4.80%	
短期資産(2)	短期資産小計		102,827,654	1.5%	1,177,273,860	16.8%	455,929,467	-30,944	-0.01%	0.00%	0.00%	0.00%		
合計(50)			3,412,686,175	48.4%	3,617,162,267	51.6%	3,599,210,990	-58,987,218	-1.64%	-1.68%				

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%	361,849,752	5.2%	346,960,565	3,931,103	1.13%	0.65%
			世界物価連動国債(159F)H	114,978,304	1.6%	20,606,313	0.3%	49,004,502	-14,360,422	-29.30%	-18.46%
			外債米総合連動(547F)H	91,869,012	1.3%	0	0.0%	22,833,406	-5,288,610	-23.16%	-8.52%
			BlueBay → GTR	262,632,708	3.7%	600,687,974	8.6%	262,679,611	3,855,266	1.47%	1.47%
	債券戦略小計			797,398,673	11.3%	983,144,039	14.0%	681,478,084	-11,862,663	-1.74%	-1.13%
	損害保険(0)	三菱UFJ	ネフィラ損害保険戦略	1,510,319	0.0%	1,486,787	0.0%	1,479,477	764,908	51.70%	50.64%
	国内株式 (5)	三菱UFJ リそな	サステナブル成長銘柄(74F)	150,476,289	2.1%	110,730,180	1.6%	180,615,494	-9,160,151	-5.07%	-3.73%
			FSI日本株戦略(122F)	155,887,704	2.2%	0	0.0%	80,906,512	-13,480,862	-16.66%	-2.72%
			株式口2A(M/N)	53,287,044	0.8%	53,007,916	0.8%	53,287,044	-279,128	-0.52%	-0.52%
	国内株式小計			359,651,037	5.1%	163,738,096	2.3%	314,809,050	-22,920,141	-7.28%	-4.60%
	マルチストラテジー (20)	三菱UFJ 三井住友 みずほ	DRF(184F_マルチ)	225,196,380	3.2%	0	0.0%	168,560,420	-24,639,768	-14.62%	-9.18%
			Black stone AAM(FOFs)	328,849,085	4.7%	336,869,031	4.8%	328,849,085	8,019,946	2.44%	2.44%
			LMRファンドリミテッド(FOF)	332,602,545	4.7%	347,813,812	5.0%	332,602,545	15,211,267	4.57%	4.57%
			Pictet(M/N)	192,828,378	2.7%	1,154,243	0.0%	181,211,940	-4,474,135	-2.47%	-2.47%
			ファラロン(イベント・ドリブン)	347,703,012	4.9%	347,820,549	5.0%	347,703,012	117,537	0.03%	0.03%
マルチストラテジー小計			1,427,179,400	20.3%	1,033,657,635	14.8%	1,358,927,002	-5,765,153	-0.42%	-0.43%	
外国株式(5)	みずほ	Marshall Wace(L/S)	372,594,124	5.3%	373,962,811	5.3%	372,594,124	1,368,687	0.37%	0.37%	
外国株式小計			372,594,124	5.3%	373,962,811	5.3%	372,594,124	1,368,687	0.37%	0.37%	
短期資産(0)	キャッシュ		1,888,695	0.0%	156,323,449	2.2%	81,381,290	-157	0.00%	0.00%	
小計(41)			2,960,222,248	42.0%	2,712,312,817	38.7%	2,810,669,027	-38,414,519	-1.37%	-1.07%	
一般勘定(9)	第一生命	一般勘定	674,818,729	9.6%	677,103,823	9.7%	675,458,912	1,545,228	0.23%	0.23%	
合計(50)			3,635,040,977	51.6%	3,389,416,640	48.4%	3,486,127,939	-36,869,291	-1.06%	-0.84%	
資産合計			7,047,727,152	100.0%	7,006,578,907	100.0%	7,085,338,929	-95,856,509	-1.35%	-1.28%	

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) (2023年2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%	90,869,416	5.5%	185,415,660	-5,663,462	-3.05%	-2.72%	-3.01%	0.29%
国内株式	個別スタイルミックス	393,439,773	26.5%	315,455,745	19.1%	384,988,850	12,229,023	3.18%	3.63%	4.04%	-0.41%
外国債券	標準スタイルミックス	403,455,179	27.2%	447,965,966	27.1%	367,286,494	4,568,605	1.24%	0.06%	-1.76%	1.82%
外国株式	33F(パッシブ)	273,889,964	18.5%	191,234,742	11.5%	208,406,147	7,457,966	3.58%	1.45%	1.61%	-0.16%
	202F(グローバルコア型)	113,594,672	7.7%	133,177,555	8.0%	145,765,926	-19,773,431	-13.57%	-8.33%	1.61%	-9.94%
小計		387,484,636	26.1%	324,412,297	19.6%	354,172,073	-12,315,465	-3.48%	-3.13%	1.61%	-4.74%
短期資産	短期金融資産(50F)	102,796,094	6.9%	477,101,773	28.8%	318,337,979	-24,421	-0.01%	-0.01%	0.00%	-0.01%
合計		1,483,744,061	100.0%	1,655,805,197	100.0%	1,610,201,058	-1,205,720	-0.07%	-0.14%	0.66%	-0.80%

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%