

資産			内訳	前期末時価総額 ＜2023年3月末＞ (円)	全体構成比 (%)	時価総額(円) (2023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)	リバランス(3)	標準スタイルミックス	92,116,269	1.3%	120,065,178	1.7%	112,672,157	-2,003,957	-1.78%	-1.51%	-1.86%	0.35%	
		三菱UFJ	代替 (9)	アンコンストレイント ^H (165F)	129,697,595	1.8%	128,277,128	1.8%	129,697,595	-1,420,467	-1.10%	-1.10%	-	-
				クオリティスプレッド ^H (53F)	113,333,544	1.6%	114,820,920	1.6%	113,333,544	1,487,376	1.31%	1.31%	-	-
				Neuberger(短期EM) ^H	230,151,840	3.3%	230,064,136	3.2%	230,151,840	-87,704	-0.04%	-0.04%	-	-
		第一生命		第2総合口	128,796,199	1.8%	129,053,932	1.8%	128,280,603	994,061	0.77%	0.77%	-	-
	国内債券小計			694,095,447	9.9%	722,281,294	10.0%	714,135,739	-1,030,691	-0.14%	-0.14%	-1.86%	1.72%	
	国内株式 (8)	リバランス(4.5)	個別スタイルミックス	322,231,064	4.6%	224,390,200	3.1%	210,932,899	32,254,162	15.29%	17.23%	16.66%	0.57%	
		三菱UFJ	代替 (3.5)	ミニマムボラティリティ(87F)	97,651,020	1.4%	316,554,961	4.4%	250,581,917	38,916,038	15.53%	16.13%	16.17%	-0.04%
				エンゲージメントバリュ(123F)	0	0.0%	59,550,000	0.8%	49,019,607	9,550,000	19.48%	19.10%	-	-
		りそな		小型株集中投資(Z)	91,949,881	1.3%	97,764,731	1.3%	91,949,881	5,814,850	6.32%	6.32%	13.85%	-7.53%
	国内株式小計			511,831,965	7.3%	698,259,892	9.6%	602,484,304	86,535,050	14.36%	14.43%	16.66%	-2.23%	
	外国債券 (12)	リバランス(9)	標準スタイルミックス	664,621,564	9.5%	670,245,683	9.2%	665,405,719	55,750,061	8.38%	8.29%	7.74%	0.55%	
		三菱UFJ	代替 (3)	総合型PIMCO(45F)	99,117,648	1.4%	137,502,596	1.9%	111,856,613	8,399,384	7.51%	8.30%	8.20%	0.10%
				総合型PIMCO(46F) ^H	52,558,330	0.7%	21,639,084	0.3%	33,360,512	-917,526	-2.75%	-2.27%	-2.51%	0.24%
				クオリティスプレッド ^H (211F) ^H	50,078,259	0.7%	50,924,418	0.7%	76,466,003	870,471	1.14%	0.98%	-	-
	外国債券小計			866,375,801	12.4%	880,311,781	12.1%	887,088,847	64,102,390	7.23%	7.41%	7.74%	-0.33%	
	外国株式 (8)	リバランス(4.5)		33F(パッシブ)	230,209,758	3.3%	203,467,800	2.8%	160,292,442	29,328,509	18.30%	18.11%	18.24%	-0.13%
				202F(グローバルコア型)	95,300,307	1.4%	25,706,934	0.4%	27,868,700	4,718,018	16.93%	15.74%	18.24%	-2.50%
		三菱UFJ	代替 (3.5)	iSTOXXクオリティ(178F)	46,763,765	0.7%	33,032,811	0.5%	38,385,321	6,279,385	16.36%	18.69%	18.80%	-0.11%
				グローバルフランチャイズ ^H (180F)	130,782,464	1.9%	109,526,184	1.5%	112,042,710	18,748,220	16.73%	17.83%	18.17%	-0.34%
				S&P先進国REIT(91F)	44,698,512	0.6%	49,640,112	0.7%	44,698,512	4,941,600	11.06%	11.06%	11.11%	-0.06%
		第一生命		WCMクオリティ(総合口Ⅰ)	48,571,827	0.7%	56,809,345	0.8%	48,240,677	8,728,404	18.09%	18.10%	17.30%	0.80%
	外国株式小計			596,326,633	8.5%	478,183,186	6.6%	431,528,362	72,744,136	16.86%	17.06%	18.24%	-1.18%	
	短期資産(5)		短期資産小計	465,912,582	6.6%	690,018,782	9.5%	626,090,219	-43,434	-0.01%	0.00%	0.00%	0.00%	
	合計(45)			3,134,542,428	44.7%	3,469,054,935	47.8%	3,261,327,471	222,307,451	6.82%	6.99%			
	オル タ ナ テ ィ ブ	債券戦略 (8)	三菱UFJ	欧州バンクローン ^H	360,869,444	5.1%	268,506,077	3.7%	280,533,383	7,636,633	2.72%	2.93%		
世界物価連動国債(159F) ^H				21,211,022	0.3%	20,079,955	0.3%	21,211,022	-1,131,067	-5.33%	-5.33%			
三井住友			ウエリントンGTR ^H	298,731,409	4.3%	296,321,776	4.1%	298,731,409	-2,409,633	-0.81%	-0.81%			
債券戦略小計			680,811,875	9.7%	584,907,808	8.1%	600,475,814	4,095,933	0.68%	0.75%				
損害保険(0)		三菱UFJ	ネフィラ損害保険戦略	1,539,786	0.0%	2,019,281	0.0%	1,539,786	479,495	31.14%	31.14%			
国内株式 (3)		三菱UFJ	サステナブル成長銘柄(74F)	115,347,760	1.6%	130,757,300	1.8%	115,347,760	15,409,540	13.36%	13.36%			
		りそな	株式口2A(M/N)	103,200,224	1.5%	105,215,424	1.5%	103,200,224	2,015,200	1.95%	1.95%			
国内株式小計			218,547,984	3.1%	235,972,724	3.3%	218,547,984	17,424,740	7.97%	7.98%				
マルチス トラテ ジー (15)		三菱UFJ	Black stone AAM(FOFs) ^H	337,822,471	4.8%	336,884,220	4.6%	337,822,471	-938,251	-0.28%	-0.28%			
			LMRファンドリミテッド(FOFs) ^H	346,903,016	4.9%	341,527,874	4.7%	346,903,016	-5,375,142	-1.55%	-1.55%			
		みずほ	ファラロン(イベント・ドリブン) ^H	343,730,514	4.9%	343,552,377	4.7%	343,730,514	-178,137	-0.05%	-0.05%			
マルチストラテジー小計			1,028,456,001	14.7%	1,021,964,471	14.1%	1,028,456,001	-6,491,530	-0.63%	-0.63%				
外国株式 (10)		みずほ	Marshall Wace(L/S) ^H	368,763,131	5.3%	374,628,094	5.2%	368,763,131	5,864,963	1.59%	1.59%			
		三菱UFJ	North Rock(L/S) ^H	300,000,000	4.3%	294,513,849	4.1%	300,000,000	-5,486,151	-1.83%	-1.83%			
外国株式小計			668,763,131	9.5%	669,141,943	9.2%	668,763,131	378,812	0.06%	0.05%				
不動産(4.5)		みずほ	UBS不動産FOFs ^H	0	0.0%	289,223,687	4.0%	296,078,431	-10,776,313	-3.64%	-3.59%			
インフラ(4.5)		三菱UFJ	KKRグローバルインフラコア ^H	0	0.0%	0	0.0%	0	0	0.00%	0.00%			
短期資産(0)		キャッシュ	600,311,152	8.6%	299,946,053	4.1%	311,079,590	-24,388	-0.01%	-0.01%				
小計(45)			3,198,429,929	45.6%	3,103,175,967	42.8%	3,124,940,737	5,086,749	0.16%	0.17%				
生保(10)		第一生命	一般勘定	679,538,056	9.7%	681,476,348	9.4%	680,404,325	711,078	0.10%	0.10%			
合計(55)			3,877,967,985	55.3%	3,784,652,315	52.2%	3,805,345,062	5,797,827	0.15%	0.16%				
資産合計			7,012,510,413	100.0%	7,253,707,250	100.0%	7,066,672,533	228,105,278	3.23%	3.28%				

リバランス契約 (300044647)		内訳	前期末時価総額 ＜2023年3月末＞ (円)	構成比(%)	時価総額(円) (2023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	92,116,269	5.1%	120,065,178	6.4%	112,672,157	-2,003,957	-1.78%	-1.51%	-1.86%	0.35%
	国内株式	個別スタイルミックス	322,231,064	17.7%	224,390,200	12.0%	210,932,899	32,254,162	15.29%	17.23%	16.66%	0.57%
	外国債券	標準スタイルミックス	664,621,564	36.6%	670,245,683	35.8%	665,405,719	55,750,061	8.38%	8.29%	7.74%	0.55%
	外国株式	33F(パッシブ)	230,209,758	12.7%	203,467,800	10.9%	160,292,442	29,328,509	18.30%	18.11%	18.24%	-0.13%
		202F(グローバルコア型)	95,300,307	5.2%	25,706,934	1.4%	27,868,700	4,718,018	16.93%	15.74%	18.24%	-2.50%
		小計	325,510,065	17.9%	229,174,734	12.3%	188,161,142	34,046,527	18.09%	17.61%	18.24%	-0.63%
	短期資産	短期金融資産(50F)	412,241,211	22.7%	625,929,591	33.5%	576,858,690	-43,139	-0.01%	-0.01%	0.00%	-0.01%
合 計		1,816,720,173	100.0%	1,869,805,386	100.0%	1,754,030,611	120,003,654	6.84%	7.03%	8.26%	-1.23%	