

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 (10)	リバランス(1.7)	標準スタイルミックス	92,116,269	1.3%	117,465,901	1.6%	115,350,735	-4,603,234	-3.99%	-3.64%	-4.12%	0.48%	
		三菱UFJ 三井住友 第一生命	代替 (8.3)	アンコンストレイントH(165F)	129,697,595	1.8%	124,962,705	1.7%	129,697,595	-4,734,890	-3.65%	-3.65%	-	-
				クオリティブレッド(53F)	113,333,544	1.6%	114,201,180	1.6%	113,333,544	867,636	0.77%	0.77%	-	-
				Neuberger(短期EM)H	230,151,840	3.3%	227,909,758	3.2%	230,151,840	-2,242,082	-0.97%	-0.97%	-	-
				第2総合口	128,796,199	1.8%	126,079,248	1.8%	128,097,891	-1,980,623	-1.55%	-1.55%	-	-
	国内債券小計		694,095,447	9.9%	710,618,792	9.9%	716,631,605	-12,693,193	-1.77%	-1.75%	-4.12%	2.37%		
	国内株式 (9.6)	リバランス(3.1)	個別スタイルミックス	322,231,064	4.6%	173,778,596	2.4%	196,075,904	31,758,735	16.20%	14.40%	13.74%	0.66%	
		三菱UFJ りそな	代替 (6.5)	ミニムボラティリティ(87F)	97,651,020	1.4%	410,445,786	5.7%	275,324,770	34,307,047	12.46%	15.46%	15.51%	-0.05%
				エンゲージメントバリュ(123F)	0	0.0%	58,865,000	0.8%	49,299,065	8,865,000	17.98%	17.73%	-	-
				小型株集中投資(2)	91,949,881	1.3%	85,315,333	1.2%	91,882,871	-5,944,435	-6.47%	-6.53%	10.80%	-17.33%
	国内株式小計		511,831,965	7.3%	728,404,715	10.1%	612,582,610	68,986,347	11.26%	11.47%	13.74%	-2.27%		
	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%	656,947,800	9.1%	651,914,093	52,472,451	8.05%	7.75%	7.65%	0.10%	
		三菱UFJ	代替 (3)	総合型PIMCO(45F)	99,117,648	1.4%	137,654,440	1.9%	116,772,699	8,551,228	7.32%	8.42%	8.24%	0.18%
総合型PIMCO(46F)H				52,558,330	0.7%	20,890,928	0.3%	29,830,011	-1,665,682	-5.58%	-5.65%	-5.97%	0.32%	
クオリティブレッド(211F)H				50,078,259	0.7%	50,247,773	0.7%	68,973,435	588,550	0.85%	0.42%	-	-	
外国債券小計		866,375,801	12.4%	865,740,941	12.0%	867,490,238	59,946,547	6.91%	6.90%	7.65%	-0.75%			
外国株式 (6.5)	リバランス(3.2)	33F(パッシブ)		230,209,758	3.3%	146,472,960	2.0%	163,301,589	22,372,511	13.70%	14.15%	14.30%	-0.15%	
		202F(グローバルコア型)		95,300,307	1.4%	23,900,742	0.3%	25,539,656	2,911,826	11.40%	7.61%	14.30%	-6.69%	
	三菱UFJ みずほ 第一生命	代替 (3.3)	ISTOXXクオリティ(178F)	46,763,765	0.7%	32,272,184	0.4%	36,801,809	5,518,758	15.00%	15.96%	16.11%	-0.15%	
			グローバルフランチャイズ(180F)	130,782,464	1.9%	102,164,832	1.4%	108,480,758	11,548,298	10.65%	10.08%	14.28%	-4.20%	
			S&P先進国REIT(91F)	44,698,512	0.6%	45,727,660	0.6%	44,675,833	1,163,956	2.61%	2.60%	2.65%	-0.05%	
			WCMクオリティ(総合口1)	48,571,827	0.7%	53,790,252	0.7%	49,261,663	5,709,311	11.59%	11.82%	13.53%	-1.71%	
外国株式小計		596,326,633	8.5%	404,328,630	5.6%	428,061,308	49,224,660	11.50%	11.33%	14.30%	-2.97%			
短期資産(5.8)	短期資産小計	465,912,582	6.6%	404,295,713	5.6%	640,533,525	-43,434	-0.01%	-0.01%	0.00%	-0.01%			
合計(43.8)		3,134,542,428	44.7%	3,113,388,791	43.3%	3,265,299,286	165,420,927	5.07%	5.33%					
オルタナティブ	債券戦略 (8)	三菱UFJ 三井住友	欧州バンクローンH	360,869,444	5.1%	269,545,496	3.7%	277,286,434	8,676,052	3.13%	3.33%			
			世界物価連動国債(159F)H	21,211,022	0.3%	19,256,265	0.3%	21,211,022	-1,954,757	-9.22%	-9.22%			
			ウエリントンGTRH	298,731,409	4.3%	298,756,616	4.2%	298,698,147	240,969	0.08%	0.08%			
	債券戦略小計		680,811,875	9.7%	587,558,377	8.2%	597,195,603	6,962,264	1.17%	1.24%				
	損害保険(0)	三菱UFJ	ネフィラ損害保険戦略	1,539,786	0.0%	1,954,096	0.0%	1,539,786	414,310	26.91%	26.91%			
	国内株式 (3.2)	三菱UFJ りそな	サステナブル成長銘柄(74F)	115,347,760	1.6%	120,159,940	1.7%	115,347,760	4,812,180	4.17%	4.17%			
			株式口2A(M/N)	103,200,224	1.5%	103,845,088	1.4%	103,200,224	644,864	0.62%	0.63%			
	国内株式小計		218,547,984	3.1%	224,005,028	3.1%	218,547,984	5,457,044	2.50%	2.51%				
	マルチストラ テジー (14.1)	三菱UFJ みずほ	Black stone AAM(FOFs)H	337,822,471	4.8%	337,289,424	4.7%	337,822,471	-533,047	-0.16%	-0.16%			
			LMRファンドリミテッド(FOFs)H	346,903,016	4.9%	345,331,044	4.8%	346,903,016	-1,571,972	-0.45%	-0.45%			
			ファラロン(イベントドリブン)H	343,730,514	4.9%	341,414,385	4.7%	343,730,514	-2,316,129	-0.67%	-0.67%			
	マルチストラテジー小計		1,028,456,001	14.7%	1,024,034,853	14.2%	1,028,456,001	-4,421,148	-0.43%	-0.43%				
	外国株式 (9.2)	みずほ 三菱UFJ	Marshall Wace(L/S)H	368,763,131	5.3%	375,614,390	5.2%	368,763,131	6,851,259	1.86%	1.86%			
			North Rock(L/S)H	300,000,000	4.3%	292,080,984	4.1%	300,000,000	-7,919,016	-2.64%	-2.64%			
	外国株式小計		668,763,131	9.5%	667,695,374	9.3%	668,763,131	-1,067,757	-0.16%	-0.16%				
	不動産(4.1)	みずほ	UBS不動産FOFsH	0	0.0%	282,755,516	3.9%	297,196,261	-17,244,484	-5.80%	-5.75%			
インフラ(4.1)	三菱UFJ	KKRグローバルインフラコアH	0	0.0%	0	0.0%	0	0.00%	0.00%					
P.E(4.1)	三菱UFJ	HarbourVest GPS	0	0.0%	302,890,020	4.2%	2,800,000	2,710,020	96.79%	1.25%				
短期資産(0)	キャッシュ	600,311,152	8.6%	308,762,225	4.3%	313,644,322	-24,388	-0.01%	-0.01%					
小計(46.8)		3,198,429,929	45.6%	3,399,655,489	47.3%	3,128,143,088	-7,214,139	-0.23%	-0.23%					
生保(9.4)	第一生命	一般勘定	679,538,056	9.7%	681,760,000	9.5%	680,507,211	994,730	0.15%	0.15%				
合計(56.2)		3,877,967,985	55.3%	4,081,415,489	56.7%	3,808,650,299	-6,219,409	-0.16%	-0.17%					
資産合計		7,012,510,413	100.0%	7,194,804,280	100.0%	7,073,949,585	159,201,518	2.25%	2.34%					

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 (%)		
リ バ ラ ン ス フ ア ン ド	国内債券	標準スタイルミックス	92,116,269	5.1%	117,465,901	7.7%	115,350,735	-4,603,234	-3.99%	-3.64%	-4.12%	0.48%	
	国内株式	個別スタイルミックス	322,231,064	17.7%	173,778,596	11.4%	196,075,904	31,758,735	16.20%	14.40%	13.74%	0.66%	
	外国債券	標準スタイルミックス	664,621,564	36.6%	656,947,800	43.2%	651,914,093	52,472,451	8.05%	7.75%	7.65%	0.10%	
	外国株式	33F(パッシブ)		230,209,758	12.7%	146,472,960	9.6%	163,301,589	22,372,511	13.70%	14.15%	14.30%	-0.15%
		202F(グローバルコア型)		95,300,307	5.2%	23,900,742	1.6%	25,539,656	2,911,826	11.40%	7.61%	14.30%	-6.69%
	小計		325,510,065	17.9%	170,373,702	11.2%	188,841,245	25,284,337	13.39%	13.18%	14.30%	-1.12%	
短期資産	短期金融資産(50F)	412,241,211	22.7%	401,087,295	26.4%	596,412,659	-43,139	-0.01%	-0.01%	0.00%	-0.01%		
合 計		1,816,720,173	100.0%	1,519,653,294	100.0%	1,748,954,639	104,869,150	6.00%	6.28%	6.86%	-0.58%		