

寄附金資金運用報告書(2025年度上半期[4月－9月])

(単位:千円)

寄附金種類	基本ポートフォリオ区分	実践ポートフォリオ投資対象資産(戦略)	基本ポートフォリオ(2023.1決定)	A元本投資額	投資来評価損益			今期(2025.4-2025.9月期)運用実績					
					B簿価額(割合)(%)	C時価額(割合)(%)		D評価損益(C-B)	H 総合収益(E+F+G)			J収益率(※1)	
									E利息配当収益	F売却益、雑益-運用コスト	G評価損益増減		
高度化ポートフォリオ(東大基金・部局寄附金)	円ベース債券	クレジット(債券マルチ)	20%	-	-	-	14%	-	40	-125,268	111,054	-14,173	-0.27%
		アンコンストレインド		8,311,600	8,337,868	8,501,044		163,176	28	0	207,348	207,376	2.44%
	グローバル株式	グローバル株式(内外上場株式)	20%	8,949,824	8,929,224	13,203,050	22%	4,273,826	1	-6	2,132,230	2,132,225	19.26%
	オルタナティブ	プライベート・エクイティ	60%	4,153,640	4,120,360	5,162,045	46%	1,041,685	0	0	20,181	20,181	0.39%
		不動産		8,756,914	8,897,619	9,329,676		432,058	173,753	99,627	465,875	739,256	7.62%
		プライベート・デット		5,910,100	6,292,349	6,525,347		232,998	243,379	-988	15,752	258,143	4.54%
		ヘッジファンド		6,312,300	6,349,060	6,484,538		135,478	99	0	311,921	312,019	5.05%
	その他(現金)		-	10,204,601	10,204,601	10,204,601	17%	-	-	-	-	-	-
	小計		100%	52,598,979	53,131,080	59,410,302	100%	6,279,221	417,300	-26,634	3,264,361	3,655,027	6.73%
債券運用等(部局寄附金)	満期保有目的債券			3,000,000	2,999,739	-	-	19,688	-	-	19,688	19,688	0.66%
	単独運用金銭信託			200,000	200,882	200,776		-106	498	0	-381	117	0.06%
	小計			3,200,000	3,200,621	-	-	20,186	0	-381	19,805	19,805	0.62%
合計				55,798,979	56,331,702	-	-	437,487	-26,634	3,263,980	3,674,832	3,674,832	6.41%

* 利息配当収益 = 利息・配当金収入+未収収益増減

* 未収収益増減 = 当期末未収収益-前期末未収収益

* 評価損益増減 = 当期末評価損益-前期末評価損益

※1 「J収益率」は2024.Q4より満期保有目的債券以外は、時間加重収益率に変更しています。