

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
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	0.62%	
合 計				55,798,979	56,331,702	-		-	437,487	-26,634	3,263,980	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。