

寄附金資金運用報告書(令和3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保有割合	A元本投資額	投資来評価損益			直近四半期(7-9月期)運用実績				今期(4-9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(運用コストを含む)(e+f+g)			H総合収益(運用コストを含む)(E+F+G)			L修正総合収益率		
								e.利息配当収益	f.売却益	g.評価損益増減	E利息配当収益	F売却益	G評価損益増減			
東大基金	円ベース債券	先進国債券	60%	3,300,000	3,301,109 29.9%	3,307,674 25.3%	6,565	0	0	-2,719	-2,719	0	0	30,613	30,613	0.94%
		クレジット(債券マルチ)		3,300,000	3,349,434 30.3%	3,616,122 27.7%	266,688	40,631	0	-39,892	738	45,355	0	22,361	67,716	1.91%
	グローバル株式	グローバル株式(内外上場株式)	20%	2,200,000	2,182,703 19.8%	3,352,902 25.7%	1,170,199	0	0	99,727	99,727	0	0	296,500	296,500	9.70%
	オルタナティブ	プライベート・エクイティ	20%	1,100,041	1,100,005 10.0%	1,638,055 12.5%	538,049	0	0	84,493	84,493	0	0	220,424	220,424	15.55%
		不動産		1,094,911	1,116,801 10.1%	1,154,364 8.8%	37,563	0	0	-4	-4	21,856	0	2,148	24,004	2.12%
	小計			100%	10,994,952	11,050,052 100.0%	13,069,116 100.0%	2,019,064	40,631	0	141,604	182,235	67,210	0	572,046	639,256
目的指定寄附金	満期保有目的債券		-	15,800,000	15,801,088	16,293,950	492,862	40,563	-	-	40,563	82,011	0	-	82,011	0.52%
	債券パッシブファンド		-	14,700,000	14,883,434	14,786,853	-96,581	0	0	-2,211	-2,211	0	0	98,115	98,115	0.67%
	単独運用金銭信託		-	900,000	942,442	955,303	12,861	1,538	-	-1,620	-82	1,857	-	-1,934	-77	-0.01%
	定期預金 ¹⁾		-	0	0	0	0	96	-	-	96	719	-	-	719	0.00%
	小計		-	-	31,400,000	31,626,964	32,036,106	409,142	42,198	0	-3,831	38,366	84,588	0	96,181	180,769
合計				42,394,952	42,677,016	45,105,222	2,428,207	82,828	0	137,773	220,601	151,798	0	668,227	820,025	1.92%

1)2021年7月14日運用終了

【概況コメント】
 今四半期(7~9月)は、新型コロナウイルスワクチン接種の進展や好調な企業業績から景気回復期待が高まった一方、デルタ株の感染拡大や中国恒大集団のデフォルト懸念等から投資家の警戒感が高まる局面もあった。外国株式市場では、7、8月は堅調に推移したものの、9月に中国恒大集団のデフォルト懸念が高まったことで大きく下落、四半期全体では小幅な上昇となった。国内株式市場では、7月に4度目の緊急事態宣言が発令され下落したが、9月に次期政権による経済対策期待の高まりと新型コロナウイルスの新規感染者数が減少したことを受け、四半期全体では上昇した。債券市場は、国内で小幅に上昇した一方、日本を除く主要先進国ではFRBによる年内のテーパリング等が意識され8、9月の金利上昇幅が大きかったため四半期全体で下落した。為替市場は、対ドルで円安へ推移したものの対ユーロでは円高へ推移した。
 ・国内株式は5.3%、外国株式は0.3%の上昇
 ・国内債券は0.1%と小幅に上昇
 外国債券(ヘッジあり)は国債型で-0.2%、総合型で-0.0%の下落、ヘッジなしでは国債型で-0.9%、総合型で-0.4%の下落

- * 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
- * 修正総合収益率 = 今期収益額 / 元本平均残高