

寄附金資金運用報告書(令和2年度)

(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(1-3月期)運用実績				今期(2020.4-2021.3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)			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	3,353,697 30.8%	3,277,061 26.4%	-76,635	22	0	-71,970	-71,948	22	0	-70,793	-70,771	-2.11%
		クレジット(債券マルチ)		3,300,000	3,195,750 29.3%	3,548,406 28.5%	352,656	85,967	0	-135,290	-49,323	100,710	0	350,990	451,700	14.13%
	グローバル株式	グローバル株式(内外上場株式)	20%	2,200,000	2,016,269 18.5%	3,056,401 24.6%	1,040,132	32,516	0	325,421	357,937	32,516	0	1,041,008	1,073,524	53.24%
	オルタナティブ	プライベート・エクイティ	20%	1,100,041	1,207,181 11.1%	1,417,631 11.4%	210,450	0	0	69,865	69,865	0	0	210,583	210,583	17.45%
		不動産		1,094,911	1,121,989 10.3%	1,130,361 9.1%	8,372	0	0	-8	-8	45,764	0	8,331	54,095	4.82%
	小計			100%	10,994,952	10,894,885 100.0%	12,429,860 100.0%	1,534,975	118,505	0	188,018	306,523	179,012	0	1,540,118	1,719,131
目的指定寄附金	満期保有目的債券		-	16,800,000	16,801,088	17,342,990	541,902	41,154	-	-	41,154	182,638	0	-	182,638	1.09%
	債券パッシブファンド		-	14,700,000	14,752,048	14,688,738	-63,311	0	0	-358,502	-358,502	186,168	0	-246,971	-60,803	-0.52%
	単独運用金銭信託		-	1,000,000	1,047,642	1,063,021	15,380	1,831	-	-1,530	301	7,715	-	-7,002	713	0.07%
	定期預金		-	500,000	500,000	500,000	0	616	-	-	616	2,500	-	-	2,500	0.50%
	小計		-	33,000,000	33,100,778	33,594,749	493,971	43,602	0	-360,032	-316,431	379,020	0	-253,972	125,048	0.38%
合計				43,994,952	43,995,663	46,024,609	2,028,946	162,106	0	-172,014	-9,908	558,033	0	1,286,146	1,844,179	4.19%

【概況コメント】
 今四半期(1月~3月)は、1月末に米個人投資家による投機的な売買が市場全体を混乱させたものの、2月以降は海外での新型コロナ向けワクチン接種拡大による景気回復期待が高まった。その結果、株式市場はリスクオン相場となり世界的に上昇、債券市場は景気回復期待やインフレ懸念から米国を中心に金利が上昇した。為替は、米金利上昇を受け日米金利差の拡大を意識した円売り・ドル買いが優勢となり対ドルで円安へ推移、対ユーロでも市場のリスク選好的な動きを背景に円安となった。
 ・国内株式は9.3%、外国株式は12.7%上昇
 ・国内債券は▲0.4%と小幅に下落
 ・外国債券(ヘッジあり)では国債型で▲3.8%、総合型で▲3.0%とそれぞれ下落
 一方、外国債券(ヘッジなし)では対ドル、対ユーロ共に円安に推移したため、国債型で1.3%、総合型で2.7%上昇

* 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