

寄附金資金運用報告書(令和2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)			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	3,306,955 30.0%	3,363,897 28.6%	56,942	0	0	9,787	9,787	0	0	10,201	10,201	0.31%
		クレジット(債券マルチ)		3,300,000	3,313,990 30.1%	3,562,269 30.3%	248,279	8,626	0	69,512	78,138	11,554	0	354,965	366,519	11.45%
	グローバル株式	グローバル株式(内外上場株式)	20%	2,200,000	2,183,580 19.8%	2,421,863 20.6%	238,282	0	0	166,704	166,704	0	0	405,594	405,594	19.23%
	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%	1,255,591 10.7%	155,585	0	0	92,138	92,138	0	0	48,542	48,542	4.02%
		不動産		1,094,911	1,117,959 10.1%	1,149,767 9.8%	31,807	0	0	-4	-4	23,036	0	4,742	27,778	2.48%
	小計			100%	10,994,952	11,022,490 100.0%	11,753,387 100.0%	730,896	8,626	0	338,137	346,763	34,589	0	824,045	858,634
目的指定寄附金	満期保有目的債券		-	17,800,000	17,801,774	18,410,394	608,620	48,614	-	-	48,614	96,700	0	-	96,700	0.54%
	債券バシブファンド		-	10,000,000	9,999,865	10,273,002	273,137	0	0	51,984	51,984	0	0	220,954	220,954	2.20%
	単独運用金銭信託		-	1,040,000	1,045,108	1,063,948	18,840	1,882	-	-1,580	302	4,015	-	-3,572	444	0.04%
	定期預金		-	500,000	500,000	500,000	0	630	-	-	630	1,253	-	-	1,253	0.25%
	小計		-	-	29,340,000	29,346,747	30,247,344	900,597	51,126	0	50,404	101,530	101,969	0	217,382	319,351
合計				40,334,952	40,369,237	42,000,730	1,631,493	59,752	0	388,540	448,292	136,558	0	1,041,427	1,177,985	2.92%

【概況コメント】  
 今四半期(7月~9月)は、新型コロナ感染拡大に抑制傾向が見られ、経済活動正常化の動きが進展した。株式市場では前四半期から続く各国政府・中央銀行の経済・金融政策の恩恵もあり、企業決算や各国経済指標に改善が見られ、実態経済でも底打ちの期待から堅調に推移した。しかし、9月にはコロナ後の上昇相場を牽引してきた米国テクノロジー関連株の高値警戒感や、米中对立激化などにより株価調整局面を迎えた。為替ではFRBが22年末まで政策金利を据え置くことを発表し、米中对立激化と合わせ米ドルが全面安となった。  
 国内株式は5.2%上昇し、外国株式は5.8%上昇。  
 国内債券は前四半期から一転0.2%上昇。外国債券(ヘッジあり)は国債型で0.7%上昇、総合型で0.7%上昇。  
 外国債券(ヘッジなし)では、国債型で0.8%上昇、総合型で0.5%上昇とヘッジの有無によるリターンの差がほとんど見られなかった。  
 為替は欧州での新型コロナ感染抑制傾向と堅調な経済指標を好感し、ユーロ円が2.1%上昇する一方、米ドル円は▲2.2%となった。

- \* 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