

寄附金資金運用報告書(令和6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			今年度(2024.4-2024.9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)			L収益率(※1)	
						E利息配当収益	F売却益		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	先進国債券	20%	-	-	-	11%	0	19	-103,900	103,080	-802	-0.06%
		クレジット(債券マルチ)		5,202,100	5,290,367	5,177,556		-112,812	2,697	0	111,709	114,406	2.32%
	グローバル株式	グローバル株式(内外上場株式)	20%	7,610,640	7,626,928	10,251,676	22%	2,624,748	3	1,345	-17,432	-16,083	-0.18%
	オルタナティブ	プライベート・エクイティ	60%	2,113,140	2,100,130	2,947,672	38%	847,542	0	0	18,929	18,929	0.65%
		不動産		6,766,951	6,925,089	6,917,144		-7,945	87,863	0	-58,927	28,935	0.38%
		プライベート・デット		3,555,200	4,565,256	4,520,672		-44,583	15,457	-1,115	-62,683	-48,341	-1.86%
		ヘッジファンド		3,102,300	3,148,638	3,206,484		57,845	5	35,980	-12,768	23,217	1.58%
その他(現金)		-	12,956,304	12,956,304	12,956,304	28%	-	-	-	-	-	-	
小計		100%	41,306,634	42,612,712	45,977,506	100%	3,364,794	106,043	-67,690	81,907	<b>120,261</b>	<b>0.90%</b>	
債券運用等(部局寄附金)	満期保有目的債券			3,000,000	2,999,694	-		-	23,426	-	-	23,426	0.78%
	債券パッシブファンド			-	-	-		-	216	-1,676,507	1,637,483	-38,809	0.34%
	単独運用金銭信託			400,000	401,738	401,882		143	974	-	-278	696	0.17%
	小計			3,400,000	3,401,433	-		-	24,615	-1,676,507	1,637,205	-14,687	0.47%
合計				44,706,634	46,014,145	-		-	130,658	-1,744,197	1,719,112	<b>105,574</b>	<b>0.80%</b>

\* 利息配当収益 = 利息・配当金収入 + 未収収益増減  
 \* 評価損益増減 = 当期末評価損益 - 前期末評価損益

※1 「L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。