

寄附金資金運用報告書（令和6年度通期運用実績報告）

(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(2024.4-2025.3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)				L収益率 (※2)
									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%	-	-	-	15%	0	63	-103,900	103,080	-758	-0.06%
		クレジット (債券マルチ)		1,100,000	1,145,858	1,034,804		-111,054	5,404	-1	-7,569	-2,165	-0.20%
		アンコンストレインド		7,311,600	7,337,840	7,293,668		-44,172	11	0	76,864	76,875	1.48%
	グローバル株式	グローバル株式 (内外上場株式)	20%	8,949,824	8,929,229	11,070,825	20%	2,141,596	93,261	403,832	-500,583	-3,489	0.44%
	オルタナティブ	プライベート・エクイ ティ	60%	3,833,640	3,800,360	4,821,864	43%	1,021,505	5	0	192,892	192,897	3.98%
		不動産		9,031,071	9,092,370	9,058,553		-33,818	253,867	-13	-125,005	128,849	1.52%
		プライベート・デット		5,385,100	5,523,460	5,742,204		218,744	111,884	-8,981	199,154	302,057	6.11%
		ヘッジファンド		3,812,300	3,848,961	3,672,519		-176,442	10	35,980	-247,056	-211,066	-4.71%
	その他(現金)		-	11,534,075	11,534,075	11,534,075	21%	-	-	-	-	-	-
	小 計			100%	50,957,610	51,212,153	54,228,512	100%	3,016,359	464,505	326,916	-308,222	483,200
債券運用等 (部局寄附金)	満期保有目的債券			3,000,000	2,999,739	-		-	43,007	-	-	43,007	1.43%
	債券バッシブファンド			-	-	-		-	216	-1,676,518	1,637,494	-38,809	0.00%
	単独運用金銭信託			200,000	202,186	201,569		-617	1,863	0	-93	1,770	0.71%
	小 計			3,200,000	3,201,926	-		-	45,085	-1,676,518	1,637,401	5,967	0.59%
合 計				54,157,610	54,414,079	-		-	509,591	-1,349,602	1,329,179	489,167	1.41%

* 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。