

グローバル・バランス型特別勘定 運用状況(2009年10月末現在)

運用方針

- 主に世界各国の株式および公社債に分散投資することによって、中長期的な成長を目指します。
- 基本資産配分は国内外株式50%、国内外公社債50%とします。
- 基本的に為替ヘッジは行いません。ただし、市況動向等を勘案して、為替ヘッジを行うことがあります。
- MSCI WORLDインデックス50%、シティグループ世界国債インデックス50%で加重平均した複合指数を上回る投資成果を目指します。
- 運用にあたっては、当社が選定した複数の投資信託を組み合わせた運用を行います。なお、運用成果の向上を図るため、特別勘定で投資する投資信託については、継続的にモニタリングを行い、適宜見直しを行ってまいります。

資産内訳

	金額(千円)	構成比
投資信託	14,404,712	98.5%
現預金・その他	225,828	1.5%
合計	14,630,540	100.0%

運用状況

2009年10月のグローバル株式市場は、MSCI KOKUSAI (現地通貨ベース)で2.30%の下落となりました。上昇する局面もありましたが、景気回復期待が弱まり、下落しました。世界債券市場は、Citigroup WGBI (現地通貨ベース)で0.12%の下落となりました。需給悪化懸念から利回りは上昇したものの、月末にはリスク回避の動きから低下に転じ、月を通してはほぼ変わらずとなりました。このような市場環境の中、円安の進行により当特別勘定は1.88%上昇しました。

10月は資金流入に合わせて「グローバル・ボンド・ファンドVA」の購入を行いました。

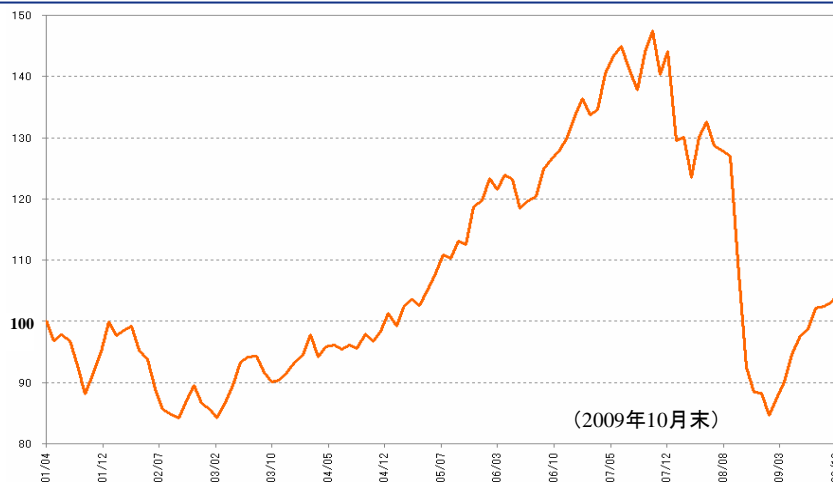
11月についても、内外株式部分については「RIC II World Equity Fund」および「グローバル成長株ファンド」を、内外公社債部分については「RIC Global Bond Fund」および「グローバル・ボンド・ファンドVA」を継続して保有する方針です。

ユニット・プライス騰落状況

ユニット・プライス	過去1ヵ月	過去3ヵ月	過去6ヵ月	過去1年	過去3年	過去5年	設定来
105.01896390	+1.88%	+2.82%	+11.03%	+13.50%	▲17.97%	+8.63%	+5.02%

(注)ユニット・プライスとは、特別勘定の運用実績を把握するための参考値で、特別勘定の運用を開始した時点(2001年5月1日)を「100」として数値化したものです。

ユニット・プライスの推移(運用開始日:2001年5月1日)



ポートフォリオの状況

[基本配分]

国内外株式 50%
国内外公社債 50%

[組入れ投資信託(投資比率)]

RIC II World Equity Fund (22.0%) : p21 下段
グローバル成長株ファンド (28.5%) : p22 上段
RIC Global Bond Fund (20.9%) : p22 下段
グローバル・ボンド・ファンドVA (27.0%) : p23 上段
現預金・その他 (1.5%)

(注)「p21 下段」等と記載してあるのは、各投資信託の運用状況を記載しているページです。ご参照ください。

ご注意

『当資料に関する「ご留意いただきたい事項」を2/27ページに掲載していますので、必ずご参照ください』

■将来の投資成果を保証するものではありません

当資料に記載されている事項は、現時点または過去の実績を示したものであり、将来の投資成果を保証するものではありません。