

グローバル・バランス型特別勘定 運用状況 (2010年2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 | 14,101,951 | 99.2% |
| 現預金・その他 | 119,414 | 0.8% |
| 合計 | 14,221,365 | 100.0% |

運用状況

2010年2月のグローバル株式市場はMSCI KOKUSAI(現地通貨ベース)で2.33%の上昇となりました。EUがギリシャへの財政支援に合意したことや、欧米諸国の良好な企業決算発表などを受け、上昇しました。グローバル債券市場は、Citigroup WGBI(現地通貨ベース)で0.53%の上昇となりました。FRBの公定歩合引き上げなどは利回り上昇(価格は下落)の材料となったものの、一部経済指標の悪化や、ギリシャなど一部欧州諸国の財政赤字懸念等から月末にかけて利回りは低下(価格は上昇)しました。このような市場環境の中、当特別勘定は円高の進行などにより0.76%下落しました。

2月は資金流入に合わせて「グローバル成長株ファンド」の購入を行いました。

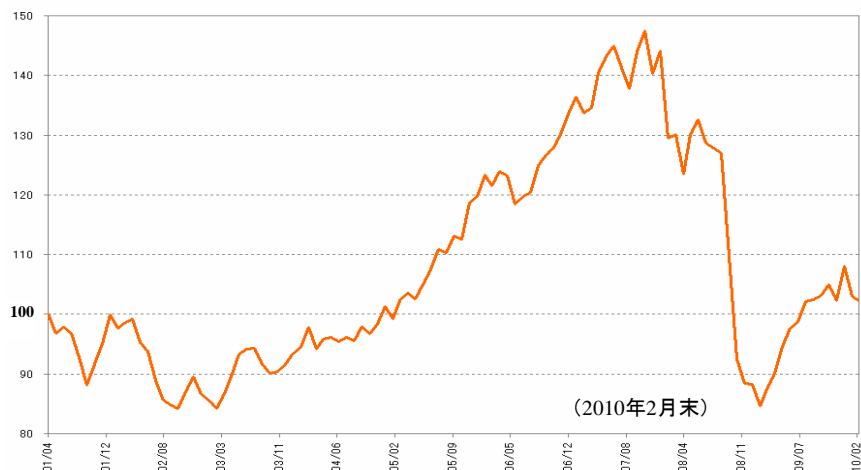
3月についても、内外株式部分については「RIC II World Equity Fund」および「グローバル成長株ファンド」を、内外公社債部分については「RIC Global Bond Fund」および「グローバル・ボンド・ファンドVA」を継続して保有する方針ですが、ファンドへの投資配分・入れ替えについては適宜検討します。

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 |
|--------------|--------|--------|--------|---------|---------|--------|--------|
| 102.24886149 | ▲0.76% | ▲0.02% | ▲0.19% | +17.01% | ▲23.54% | ▲0.11% | +2.25% |

(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 (22.3%) : p21 下段 |
| グローバル成長株ファンド (28.0%) : p22 上段 |
| RIC Global Bond Fund (21.1%) : p22 下段 |
| グローバル・ボンド・ファンドVA (27.8%) : p23 上段 |
| 現預金・その他 (0.8%) |

(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。