

欧州株式型特別勘定 運用状況 (2009年8月末現在)

運用方針

- 主に欧州企業の株式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。
- 原則として、為替ヘッジは行いません。
- MSCIヨーロッパ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 | 2,558,395 | 98.2% |
| 現預金・その他 | 46,183 | 1.8% |
| 合計 | 2,604,578 | 100.0% |

運用状況

2009年8月の欧州株式市場は、MSCI Europe (現地通貨ベース)で5.89%の上昇となりました。経済指標の改善や予想を上回る企業決算を受けて、景気底入れ期待が高まる中、底堅い値動きとなりました。欧州中央銀行は政策金利を1.00%に据え置きました。外為市場では日本円が上昇し、ユーロ・円相場は1.36%の円高となりました。このような市場環境の中、当特別勘定は5.56%上昇しました。

当特別勘定では、マルチ・マネージャー型の投資信託を中心とした運用を行っています。

8月は資金流入に合わせて「フィデリティ・欧州株・ファンド」の購入を行いました。

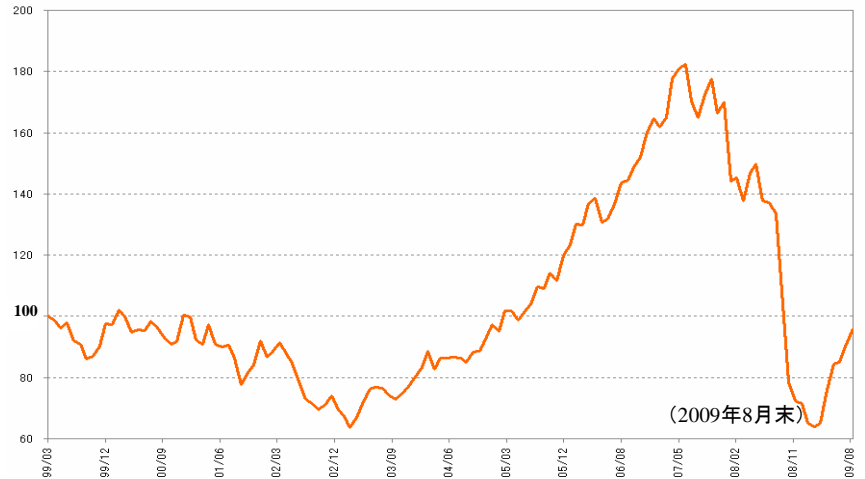
9月についても、マルチ・マネージャー型の「RIC II Pan European Equity Fund」を中心とした投資を継続する方針ですが、ファンドへの投資配分・入れ替えについては適宜検討します。

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 |
|-------------|--------|---------|---------|---------|---------|---------|--------|
| 95.94733357 | +5.56% | +13.76% | +50.12% | ▲28.20% | ▲33.13% | +13.10% | ▲4.05% |

(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(1999年4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:1999年4月1日)



ポートフォリオの状況

[組入れ投資信託(投資比率)]



(注)「p19上段」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2/28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。