

世界株式型(為替ヘッジあり)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、為替ヘッジを行います。
- MSCI KOKUSAIインデックス(円ヘッジ)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	371,587	96.8%
現預金・その他	12,384	3.2%
合計	383,971	100.0%

運用状況

2009年10月の世界株式市場は、MSCI KOKUSAI(現地通貨ベース)で2.30%の下落となりました。月の前半は、良好な企業決算等を好感して上昇しましたが、後半は世界の景気回復への期待感が後退して下落する、変動性の高い展開となりました。このような市場環境の中、当特別勘定は組み入れ投資信託が堅調であったことから0.13%の下落に留まりました。

当特別勘定では、資産規模を勘案し、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。

10月は資金流入に合わせて「ラッセル外国株式ファンドI-4A」の購入を行いました。

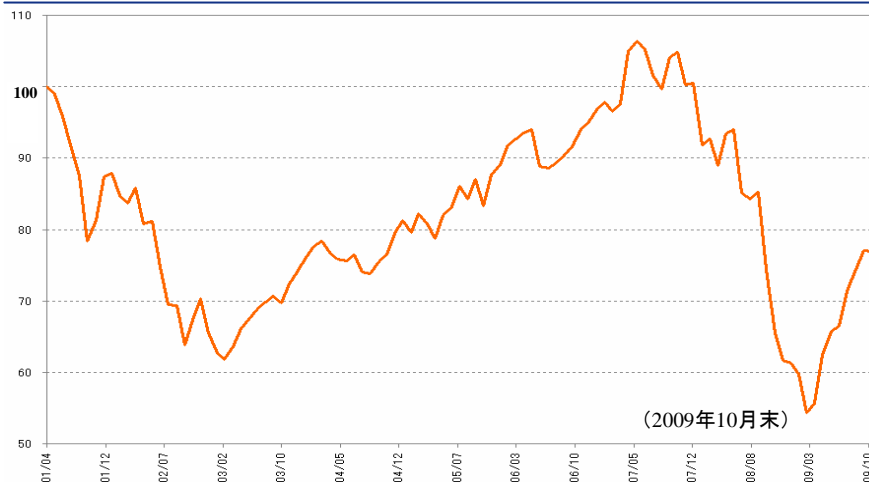
11月についても、「ラッセル外国株式ファンドI-4A」、「年金積立インデックスファンド海外株式(ヘッジあり)」への投資を継続する方針ですが、ファンドへの投資配分・入れ替えについては適宜検討します。

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
76.99269096	▲0.13%	+7.86%	+23.51%	+17.44%	▲18.11%	+0.78%	▲23.01%

(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

[組み入れ投資信託(投資比率)]

ラッセル外国株式ファンドI-4A (70.6%) : p20下段
年金積立インデックスファンド海外株式(ヘッジあり) (26.2%) : p21上段
現預金・その他 (3.2%)

(注)「p20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。