

世界債券型特別勘定 運用状況 (2010年3月末現在)

運用方針

- 主に内外の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公社債50%、海外公社債50%とします。
- 海外公社債の投資部分に対し、原則として、為替ヘッジは行いません。
- NOMURA-BPI(総合)50%、シティグループ世界国債インデックス(除く日本)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	7,774,884	99.2%
現預金・その他	66,646	0.8%
合計	7,841,530	100.0%

運用状況

2010年3月の世界債券市場は、Citigroup WGBI(現地通貨ベース)で0.03%の下落となりました。米国では需給悪化などを受けて、利回りは上昇(価格は下落)したものの、欧州では払拭されきれない財政懸念問題を背景に利回りは低下し債券価格は上昇しました。このような市場環境の中、当特別勘定は円安の進行もあり、2.23%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。

3月は資金流入に合わせて「ラッセル日本債券ファンドI-1」の購入を行いました。

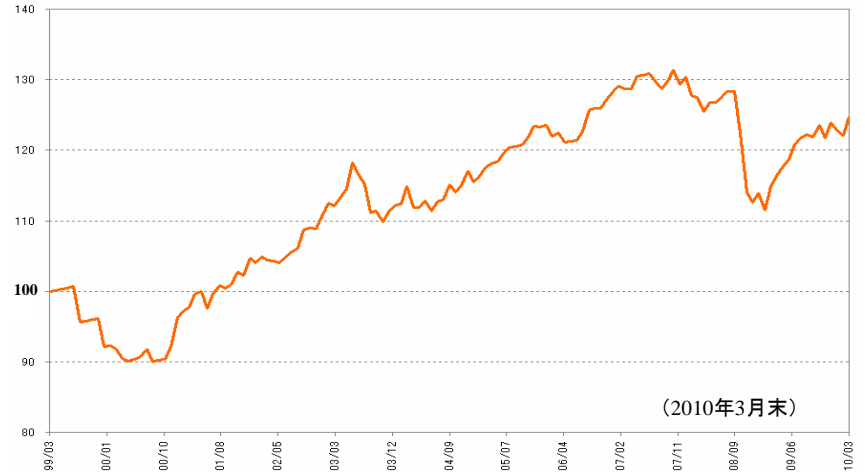
4月についても、グローバル債券運用を行う「RIC Global Bond Fund」、「グローバル・ボンド・ファンドVA」および国内債券運用を行う「ラッセル日本債券ファンドI-1」への投資を継続する方針ですが、ファンドへの投資配分・入れ替えについては適宜検討します。また、国内公社債と海外公社債の投資割合の調整にあたっては、「RIC Global Bond Fund」および「グローバル・ボンド・ファンドVA」における国内公社債の組入れ比率および現金等の比率を勘案しています。

ユニット・プライス騰落状況

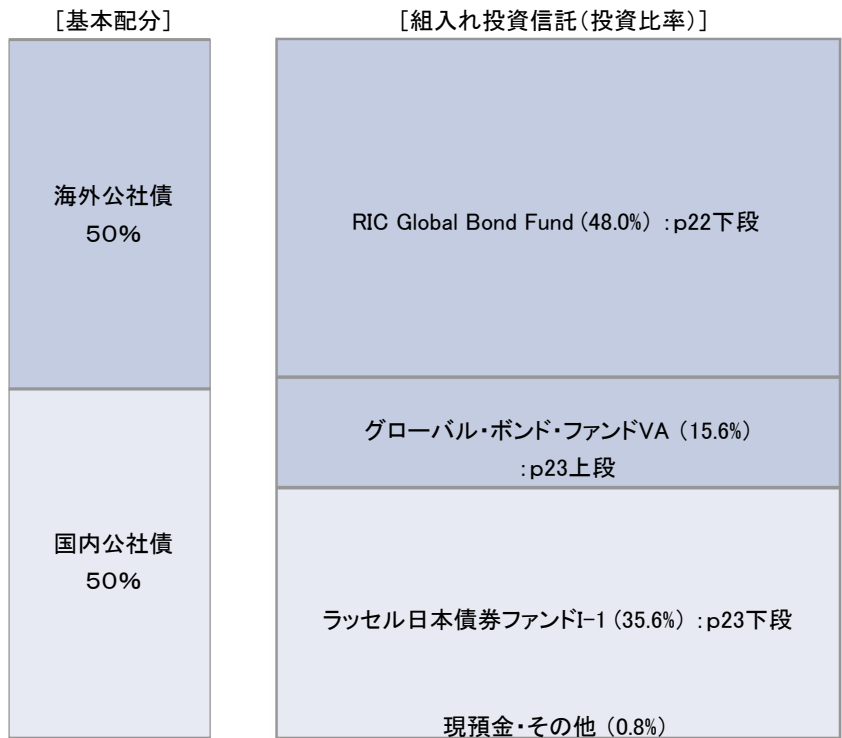
ユニット・プライス	過去1ヵ月	過去3ヵ月	過去6ヵ月	過去1年	過去3年	過去5年	設定来
124.76525863	+2.23%	+0.66%	+2.40%	+7.31%	▲3.01%	+6.06%	+24.77%

(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



(注)「p22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。