

海外株式プラス型(CS)特別勘定 運用状況(2010年3月末現在)

運用方針

- 主に海外の主要国ならびに新興成長国の株式を主要投資対象とする投資信託に投資することにより、積極的に高い投資成果を目指します。
- 海外の主要国の株式に50%程度、新興成長国の株式に50%程度投資することを基本とします。ただし、市況動向等を勘案して、当該配分を変更することがあります。
- 原則として為替ヘッジは行いません。
- 運用にあたっては、運用スタイルの分散や運用会社の固有リスクの分散を図るため、基本的に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、各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	2,586,788	99.6%
現預金・その他	10,557	0.4%
合計	2,597,345	100.0%

運用状況

2010年3月の世界株式市場は、MSCI KOKUSAI(現地通貨ベース)で6.15%上昇しました。良好な経済指標と企業業績の発表を受け、景気回復期待が高まり上昇しました。欧州では域内での財政問題支援の方向性が示されたこと、米国ではFRBの低金利継続が主な材料となりました。このような市場環境の中、円安が進行したこともあり、当特別勘定は12.77%上昇しました。

現在、「ステート・ストリート外国株式インデックス・ファンドVA1」、「SGロシア東欧株ファンド」、「JFアジア株・アクティブ・オープンVA」および「JPM・BRICS5ファンド」に投資しています。

3月は資金流出入に合わせて、「JFアジア株・アクティブ・オープンVA」の購入、および「ステート・ストリート外国株式インデックス・ファンドVA1」の売却を行いました。

4月についても、これらのファンド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	設定率
123.00999537	+12.77%	+4.09%	+13.37%	+60.58%	▲24.56%	+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(2005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:2005年5月1日)



ポートフォリオの状況

〔基本配分〕

海外主要国 50%程度
新興成長国 50%程度

〔組入れ投資信託(投資比率)〕

ステート・ストリート外国株式インデックス・ファンドVA1(48.9%) : p13上段
SGロシア東欧株ファンド(11.4%) : p14上段
JFアジア株・アクティブ・オープンVA(20.9%) : p13下段
JPM・BRICS5ファンド(18.4%) : p14下段
現預金・その他(0.4%)

(注)「p13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2/22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。