

金融市場型(CS)特別勘定 運用状況(2009年7月末現在)

運用方針

- 主に国内の公社債を主要投資対象とする投資信託に投資することにより、中長期的に安定した投資成果を目指します。
- 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	224,186	87.8%
現預金・その他	31,163	12.2%
合計	255,349	100.0%

運用状況

2009年7月の国内債券市場は、NOMURA-BPIで0.11%の下落となりました。1.3%台後半で始まった10年物国債利回りは、世界経済の低迷長期化の懸念から低下基調で始まり、一時1.2%台後半まで低下しましたが、中旬には予想を上回る米企業決算の発表を受けて上昇に転じ、最終的には1.4%台前半で7月の取引を終了しました。一般債市場では、景気後退の底入れ期待の高まりを受けて、社債の対国債スプレッドが縮小しました。このような市場環境の中、当特別勘定は0.01%上昇しました。

現在、「ノムラ短期債券オープン」および「フィデリティ・マネー・プールVA」に投資しています。

7月は資金流入に合わせて「フィデリティ・マネー・プールVA」の購入を行いました。

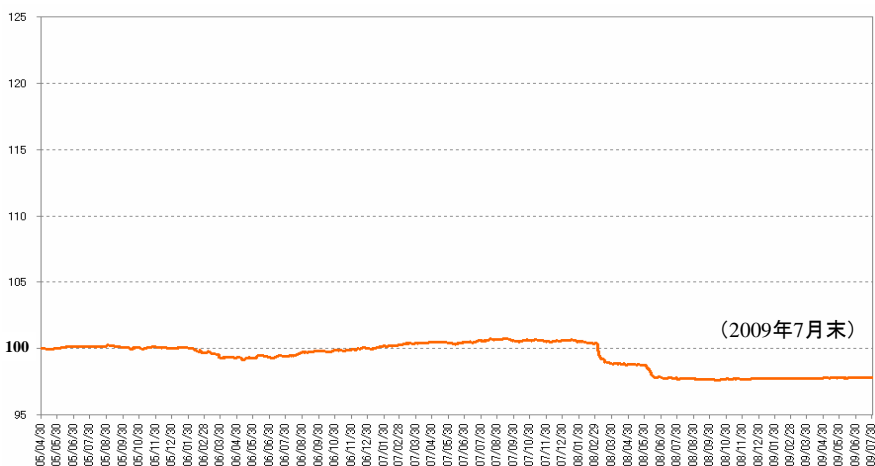
8月についても、これらのファンドへの投資を継続する方針ですが、ファンドへの投資配分・入れ替えについては適宜検討します。

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
97.81939686	+0.01%	+0.05%	+0.07%	+0.14%	▲1.59%	▲2.18%

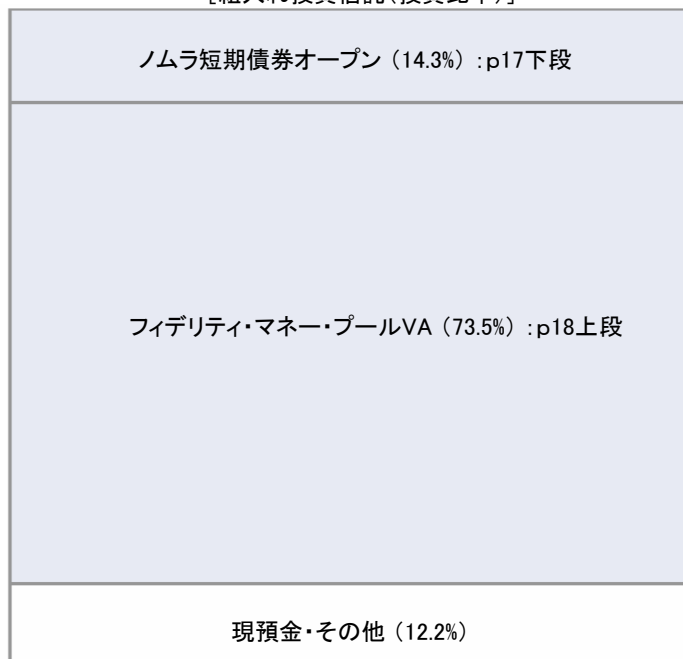
(注)ユニット・プライスとは、特別勘定の運用実績を把握するための参考値で、特別勘定の運用を開始した時点を「100」として数値化したものです。

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

[組入れ投資信託(投資比率)]



(注)「p17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2/23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。