

金融市場型(CS)特別勘定 運用状況(2010年9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	76,863	93.3%
現預金・その他	5,521	6.7%
合計	82,384	100.0%

運用状況

2010年9月の国内債券市場はNOMURA-BPI(総合)で0.10%上昇しました。月初は米国の景気に対する懸念が和らいだことや民主党代表選挙の小沢氏の出馬から財政拡大懸念が高まったこと等を背景に国内長期金利は上昇基調で推移しました。14日に菅首相が再選すると財政規律が維持されるとの期待から国内長期金利は低下(価格は上昇)しました。15日の政府・日銀の円売りドル買い介入も金融緩和が強化されるとの観測に繋がり、長期金利の低下要因となりました。このような市場環境の中、当特別勘定は0.02%下落しました。

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。

9月は当勘定における投資信託の売買はありませんでした。

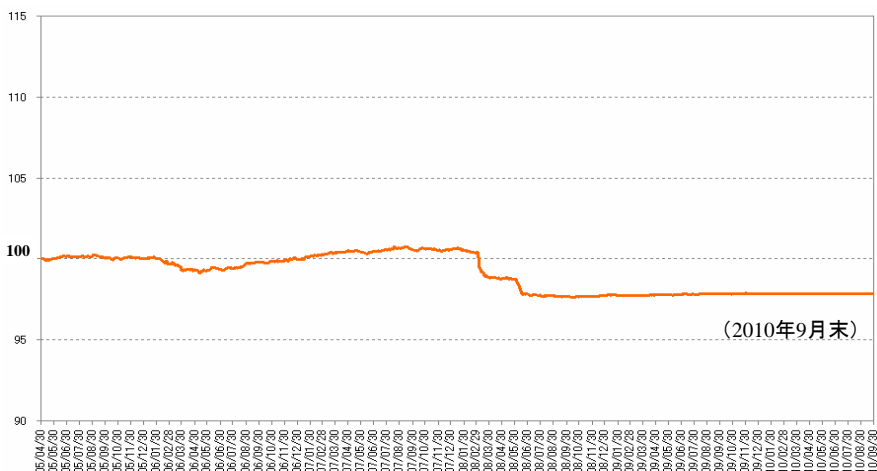
10月についても、これらのファンドへの投資を継続する方針ですが、ファンドへの投資配分・入れ替えについては適宜検討します。

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
97.84280952	▲0.02%	▲0.03%	▲0.01%	+0.00%	▲2.73%	▲2.16%

(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も「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)]

ノムラ短期債券オープン (14.2%) :p17上段
フィデリティ・マネー・プールVA (79.1%) :p17下段
現預金・その他 (6.7%)

(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2/22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。