

海外株式プラス型(CS)特別勘定 運用状況(2009年8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 | 1,910,193 | 97.8% |
| 現預金・その他 | 43,184 | 2.2% |
| 合計 | 1,953,376 | 100.0% |

運用状況

2009年8月の世界株式市場は、MSCI KOKUSAI(現地通貨ベース)で4.08%の上昇となりました。経済指標の改善や予想を上回る企業決算を受けて、景気底入れ期待が高まる中、底堅い値動きとなりました。米連邦公開市場委員会は政策金利を0.25%に据え置き、声明文では景気が底入れしつつあるとの見方が示されました。このような市場環境の中、当特別勘定は0.46%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。

8月は資金流入に合わせて「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」の購入を行いました。

9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5ヵ月 | 過去1年 | 過去3年 | 設定率 |
|--------------|--------|--------|---------|---------|---------|--------|
| 104.85482561 | +0.46% | +8.35% | +50.76% | ▲28.00% | ▲24.14% | +4.85% |

(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(48.0%) : p13下段 |
| SGロシア東欧株ファンド(11.0%) : p14下段 |
| JFアジア株・アクティブ・オープンVA(18.9%) : p14上段 |
| JPM・BRICS5ファンド(19.8%) : p15上段 |
| 現預金・その他(2.2%) |

(注)「p13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2/23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。