

アクサ生命の変額個人年金保険


# 5年計画

 保証金額付特別勘定年金特約(定期Ⅰ型)付変額個人年金保険(06)  
 保証金額付特別勘定年金特約(定期Ⅱ型)付変額個人年金保険(06)

## 特別勘定（世界分散型3ODI） 四半期運用レポート

### 2011年4月～2011年6月

設定・運用は

 DIAMアセットマネジメント
 
**【利用する投資信託の委託会社】** DIAMアセットマネジメント株式会社（旧：興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社）

1999年に第一ライフ投信投資顧問、興銀NWアセットマネジメント、日本興業投信の3社が合併して発足しました。競争力のある運用ノウハウ・人材を結集し、高品質な商品およびサービスをご提供しています。

**【利用する投資信託の委託会社商号変更のお知らせ】**

2008年1月1日より、利用する投資信託の委託会社であります「興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社」が「DIAMアセットマネジメント株式会社」に商号変更いたしました。商号変更に伴う投資信託の名称・運用方針・運用体制などに変更はございません。当該日以後「商品パンフレット」「特別勘定のしおり」などに記載の同社名につきましては上記のようにお読替えいただきますようお願い申し上げます。

- ・アクサ生命保険株式会社の「保証金額付特別勘定年金特約(定期Ⅰ型)/(定期Ⅱ型)付変額個人年金保険(06)」は、特別勘定で運用を行う保険商品です。  
特別勘定の主たる運用手段として投資信託を用いますが、投資信託ではありません。
- ・当資料は、アクサ生命保険株式会社の「保証金額付特別勘定年金特約(定期Ⅰ型)/(定期Ⅱ型)付変額個人年金保険(06)」の運用状況等を開示するためのものであり、生命保険の募集を目的としたものではありません。
- ・当資料は、各種の信頼できると考えられる情報源から取得した情報に基づき作成した部分を含んでおりますが、その部分の正確性・完全性については、これを保証するものではありません。
- ・当資料中の運用実績に関するいかなる内容も過去の実績であり、将来の運用成果を示唆あるいは保証するものではありません。  
また、予告なしに当資料の内容が変更、廃止される場合がありますのであらかじめご承知おきください。
- ・商品内容の詳細については「契約締結前交付書面(■契約概要、■注意喚起情報)」、「商品パンフレット」、「ご契約のしおり・約款」、「特別勘定のしおり」をあわせてご覧ください。
- ・当資料に記載されている各表にある金額、比率、ファンドの資産構成等はそれぞれの項目を四捨五入等をしているので、合計等と合致しないことがあります。

# 保証金額付特別勘定年金特約（定期Ⅰ型）付変額個人年金保険（06） 保証金額付特別勘定年金特約（定期Ⅱ型）付変額個人年金保険（06） 特別勘定の四半期運用レポート（2011年4月～2011年6月）

- ・当資料中の運用実績に関するいかなる内容も過去の実績であり、将来の運用成果を示唆あるいは保証するものではありません。また、予告なしに当資料の内容が変更、廃止される場合がありますのであらかじめご承知おきください。
- ・当ページは、各種の信頼できると考えられる情報源から取得した情報に基づき、アクサ生命保険株式会社が作成し提供するものです。情報の内容に関しては万全を期しておりますが、その正確性・完全性については、これを保証するものではありません。

## 運用環境 [ 2011年4月～2011年6月 ]

### 【日本株式市場】

日本株式市場は下落し、TOPIX(東証株価指数)は3月末比▲2.32%下落の849.22ポイントで終了しました。  
4月は、原発事故収束見通しの不透明感から下落基調が続きました。さらに、米国景気の減速懸念やギリシャの財政懸念が強まったことなどから、6月中旬まで軟調な推移となりました。しかし、6月下旬にかけては、ギリシャ財政懸念の後退により欧米株式市場が上昇したことや、5月鉱工業生産指数の上昇を好感して買い優勢の展開となりました。  
業種別(東証33業種)では、業績改善期待から「ゴム製品」(3月末比+6.09%)が最も上昇した一方、任天堂の業績悪化により「その他製品」(同▲19.69%)が最も下落しました。

### 【外国株式市場】

米国株式市場は、4月は米格付け会社による米国国債の格付け見直し引下げを嫌気して、一時下落する局面もありましたが、好調な経済指標や企業的好決算などから上昇しました。5月以降は、国際商品市況の急落や世界的な景気減速と金融緩和と政策の転換が懸念され始めたこと、ギリシャの債務再編問題の緊迫化などを受けて下落しましたが、6月末に、ギリシャ議会で緊縮財政案が可決すると大きく反発しました。NYダウは、3月末比+0.77%上昇の12,414.34ドルで終了しました。  
欧州株式市場は、アイルランドの格下げを嫌気して下落する局面もありましたが、その後は、企業好決算などによる上昇、ギリシャ財政懸念を背景とした下落、6月末のギリシャ緊縮財政案可決による反発など、概ね、米国同様の推移となりました。市場別騰落率は、英FT100は3月末比+0.63%上昇、仏CAC40は同▲0.17%下落、独DAXは同+4.76%上昇となりました。

### 【日本債券市場】

日本債券市場は、4月上旬の金利上昇後に低下し、5月中旬以降は揉み合いでの推移となり、新発10年国債利回りは1.130%となりました(3月末は1.255%)。  
4月は東日本大震災の復興・復旧に向けた政策が意識される中、財源として国債の増発が警戒されたことなどから、金利は1.3%台へと上昇しました。しかしその後、株価が弱含みに転じたことなどから、金利は低下基調で推移し、5月上旬には1.1%台前半となりました。5月中旬以降は、軟調な経済指標や投資家の根強い債券投資需要などから、概ね1.1%台前半で底堅く推移しました。  
日銀は、金利政策を据え置き、年0～0.1%程度を維持しました。無担保コール(翌日物)は0.1%程度の水準で推移しました。

### 【外国債券市場】

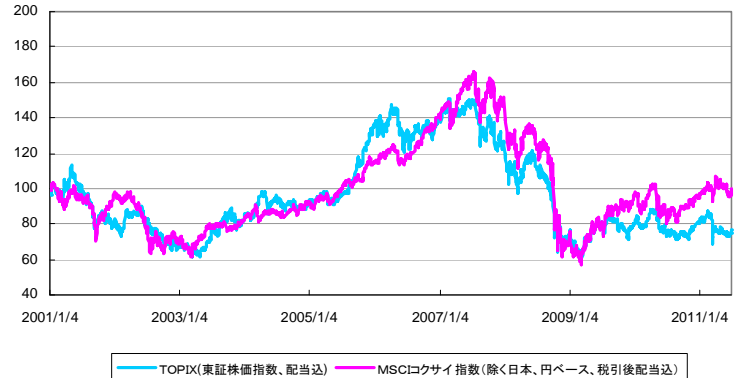
米国債券市場は、FRB(米連邦準備制度理事会)が量的緩和政策延長の必要が低いと示唆したことなどから、金利は上昇して始まりました。その後、米政府が財政赤字削減策を発表したことや、国際商品市況の急落、欧州財政懸念などを背景に低下しました。しかし、6月下旬にかけて、ギリシャの財政懸念の後退などから再び上昇に転じて期末を迎えました。米10年国債利回りは、6月末には3.160%となりました(3月末は3.470%)。  
欧州債券市場も、概ね、米国同様の動きとなりました。ECB(欧州中央銀行)の利上げ実施などから、金利は上昇して始まりましたが、欧州財政懸念の強まりからリスク回避の買いが優勢となったことなどを受けて低下しました。期末に再び上昇に転じ、独10年国債利回りは、6月末には3.025%となりました(3月末は3.354%)。  
FRBは、FF(フェデラル・ファンド)金利の誘導目標を据え置き、年0.0～0.25%を維持しました。ECBIは4月に政策金利を0.25%引き上げ、年1.25%としました。

### 【外国為替市場】

米ドル/円相場は、4月上旬に米国景気回復期待から一時円安にふれた後、米株値の下落や米国債の格付け見直しの引き下げ、米長期金利の低下などから、5月上旬にかけて円高が進行しました。その後は、ギリシャの金融支援策を巡る動向を睨みながら、揉み合いでの推移となりました。円は対ドルで3月末比2円42銭(+2.91%)円高ドル安の1ドル=80円73銭となりました。  
ユーロ/円相場は、ECBによる利上げの実施などを受けて円安が進行した後、ギリシャの財政懸念が強まったことなどからリスク回避の動きが強まり、円高基調での推移となりました。円は対ユーロで3月末比0円73銭(+0.62%)円高ユーロ安の1ユーロ=116円84銭となりました。

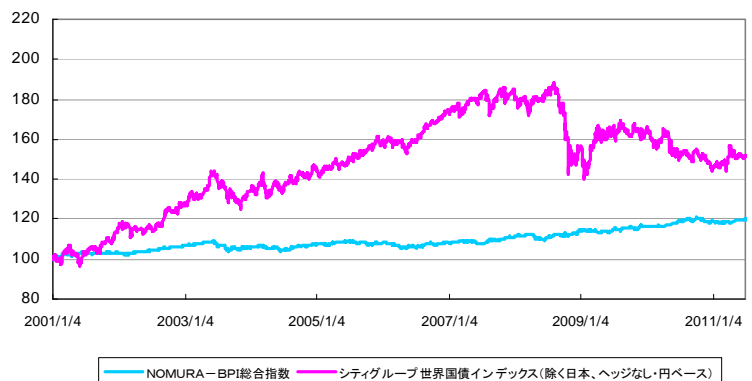
### 日本と外国の株式市場の推移

\*下記グラフは2001年1月4日を100として指数化しています。

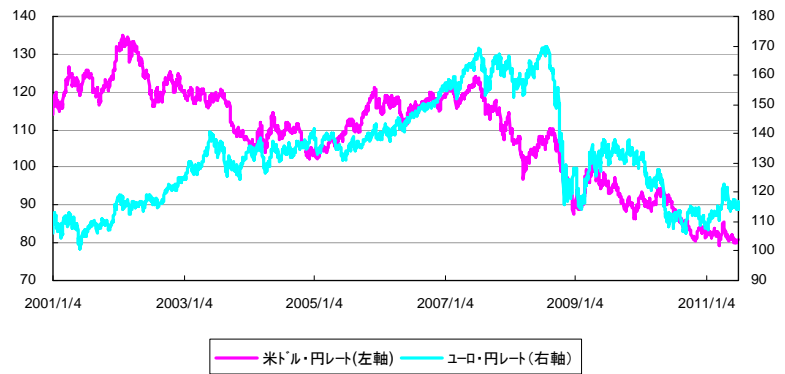


### 日本と外国の債券市場の推移

\*下記グラフは2001年1月4日を100として指数化しています。



### 外国為替市場の推移



出所:株式会社三菱東京UFJ銀行の対顧客電信相場仲値

【募集代理店】 取扱者(生命保険募集人)  
株式会社みずほ銀行

【引受保険会社】  
アクサ生命保険株式会社  
〒108-8020 東京都港区白金1 17 3  
TEL: 0120 375 193  
アクサ生命株式会社 <http://www.axa.co.jp/life/>

保証金額付特別勘定年金特約（定期Ⅰ型）付変額個人年金保険（06）  
 保証金額付特別勘定年金特約（定期Ⅱ型）付変額個人年金保険（06）  
**特別勘定の四半期運用レポート** （2011年4月～2011年6月）

・当資料中の運用実績に関するいかなる内容も過去の実績であり、将来の運用成果を示唆あるいは保証するものではありません。また、予告なしに当資料の内容が変更、廃止される場合がありますのであらかじめご承知おきください。  
 ・特別勘定資産は、投資信託を利用している部分の他に、保険契約の異動等に備える部分を加えたものとなります。後者の部分については、利用する投資信託の委託会社であるDIAMアセットマネジメント株式会社の裁量の範囲外となります。

**特別勘定の運用状況 [2011年6月末日現在]**

特別勘定名	利用する投資信託の運用方針
世界分散型30DI	<ul style="list-style-type: none"> <li>● 当ファンドは、日本および世界の株式、債券などへ分散投資を行い、安定した収益の確保と信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。投資対象となる各資産の合成インデックスをベンチマークとし、ベンチマークに連動する投資成果を目指します。</li> <li>● 基本資産配分比率は下記の通りとなります。当ファンドにおいて、外国債券の資産配分比率である40%のうち、15%相当部分を為替ヘッジします。                      国内株式：10% 外国株式：20%                      国内債券：30% 外国債券(為替ヘッジなし)：25%                      外国債券(為替ヘッジあり)：15%</li> <li>● リバランスは、1ヵ月毎(月末時点)に基本資産配分比率に戻すことを原則とします。</li> <li>● 当ファンドの主なリスクとして、価格変動リスク、為替リスク、信用リスク、金利変動リスクなどがあります。</li> </ul>
利用する投資信託	
DIAM アクサ グローバル バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	

■特別勘定のユニットプライスの推移

※特別勘定のユニットプライスは、各特別勘定で利用している投資信託の基準価額とは異なります。



特別勘定の ユニットプライス	騰落率(%)
2011年6月末 79.92	過去1ヵ月 ▲ 0.55
2011年5月末 80.37	過去3ヵ月 ▲ 1.02
2011年4月末 81.30	過去6ヵ月 0.77
2011年3月末 80.74	過去1年 2.01
2011年2月末 80.49	過去3年 ▲ 13.99
2011年1月末 79.87	設定来 ▲ 20.07

・世界分散型30DIの特別勘定のユニットプライスは、特別勘定の設定日(2007年2月13日)を100.00として計算しております。  
 ・騰落率は、該当月の月末のユニットプライスに対する今月末のユニットプライスの変動率を表しています。

■特別勘定資産の内訳

項目	世界分散型30DI	
	金額(千円)	比率(%)
その他有価証券	14,418,549	99.4
現預金・コールローン	91,589	0.6
その他	—	—
合計	14,510,139	100.0

・特別勘定で利用している国内投資信託は、いずれも「その他有価証券」の項目に含まれています。  
 ・金額の単位未満は切捨てとしました。また、比率については小数点第二位を四捨五入しております。

【募集代理店】 取扱者(生命保険募集人)  
株式会社みずほ銀行

【引受保険会社】  
アクサ生命保険株式会社  
〒108-8020 東京都港区白金1 17 3  
TEL: 0120 375 193  
アクサ生命株式会社 http://www.axa.co.jp/life/

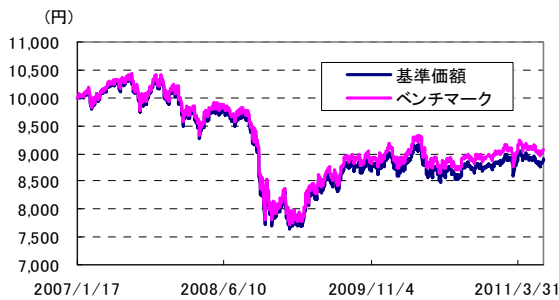
# 保証金額付特別勘定年金特約（定期Ⅰ型）付変額個人年金保険（06） 保証金額付特別勘定年金特約（定期Ⅱ型）付変額個人年金保険（06） 特別勘定の四半期運用レポート（2011年4月～2011年6月）

- ・当資料中の運用実績に関するいかなる内容も過去の実績であり、将来の運用成果を示唆あるいは保証するものではありません。また、予告なしに当資料の内容が変更、廃止される場合がありますのであらかじめご承知おください。
- ・特別勘定資産は、投資信託を利用している部分の他に、保険契約の異動等に備える部分を加えたものとなります。後者の部分については、利用する投資信託の委託会社であるDIAMアセットマネジメント株式会社の裁量の範囲外となります。
- ・当ページは、DIAMアセットマネジメント株式会社による運用報告を、アクサ生命保険株式会社が提供するものであり、内容に関して、アクサ生命保険株式会社は一切責任を負いません。

## DIAM アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)の運用状況 [2011年6月末日現在]

※ここでは、特別勘定で利用している投資信託の基準価額の推移等を記載しております。特別勘定のユニットプライスは、ファンドの基準価額とは異なります。

### 基準価額の推移(税引前分配金再投資)



基準価額は税引前の分配金を再投資したものと計算していますので実際の基準価額と異なることがあります。  
基準価額およびベンチマークは設定日(2007年1月18日)の前日を10,000として表示しております。  
基準価額は信託報酬(年率0.315%(税抜0.3%))控除後です。

### 騰落率(税引前分配金再投資)

	1か月 (2011/05/31)	3か月 (2011/03/31)	6か月 (2010/12/30)	1年 (2010/06/30)	3年 (2008/06/30)	設定来 (2007/01/17)
当ファンド	-0.37%	-0.45%	1.95%	4.42%	-7.91%	-11.11%
ベンチマーク	-0.34%	-0.39%	2.19%	4.70%	-6.76%	-9.26%
差	-0.03%	-0.06%	-0.24%	-0.28%	-1.15%	-1.85%

※騰落率は税引前の分配金を再投資したものと算出していますので実際の投資家利回りと異なる場合があります。

### 分配金情報(税引前)

※分配金は1万円当たり

第3期 (2009.06.22)	分配金	0 円
第4期 (2010.06.22)	分配金	0 円
第5期 (2011.06.22)	分配金	0 円
累計分配金		0 円

※直近3年分

※分配対象額が少額の場合には、分配を行わない場合があります。

### ファンドの特色

- 主な投資対象** ..... 主として国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド、国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドおよび外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの各受益証券への投資を通じ、国内株式・国内債券・外国株式・外国債券へ投資します。
- 投資方針** ..... マザーファンド受益証券への投資を通じ、内外の株式および公社債を実質的な主要投資対象とし、安定した収益の確保と信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
- ベンチマーク** ..... 以下の各資産のベンチマークを基本資産配分比率で組入れた合成指数とします。

### 各資産のベンチマーク

- 【国内株式】 東証株価指数(TOPIX、配当込み)
- 【国内債券】 NOMURA-BPI総合
- 【外国株式】 MSCIコクサイ・インデックス(円換算ベース、配当込み)
- 【外国債券(為替ヘッジなし)】 シティグループ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)
- 【外国債券(為替ヘッジあり)】 シティグループ世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)

○当資料は、DIAMアセットマネジメント株式会社が独自に作成したものであり、金融商品取引法により義務づけられた資料ではありません。○当資料はあくまでも情報提供を目的とするものであり、投資家に対する投資勧誘を目的とするものではありません。○投資信託は、実質的に株式や債券等の値動きのある有価証券(外貨建資産には為替リスクもあります)に投資をしますので、市場環境、組入る有価証券の発行者に係る信用状況等の変化により基準価額は変動します。このため、購入金額について元本保証及び利回り保証のいずれもありません。○当資料は、DIAMアセットマネジメント株式会社が信頼できると判断したデータにより作成しておりますが、その内容の完全性、正確性について、同社が保証するものではありません。また掲載データはあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を保証するものではありません。投資信託は1. 預金・金融債・保険契約ではありません。また、預金保険機構及び保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。また証券会社を通じて購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。2. 金融機関の預金・金融債あるいは保険契約における保険金額とは異なり、購入金額については元本保証及び利回り保証のいずれもありません。3. 投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合がありますが、これによる損失は購入者が負担することとなります。

### 当月末基準価額・純資産総額

基準価額	8,889 円
純資産総額	30,039 百万円
設定日	2007年1月18日
決算日	原則 6月 22日
信託期間	無期限

### ポートフォリオ構成

	実質組入比率	基本資産配分比率	差
国内株式	10.1%	10.0%	0.1%
国内債券	29.7%	30.0%	-0.3%
外国株式	20.3%	20.0%	0.3%
外国債券	38.7%	40.0%	-1.3%
現金等	1.2%	0.0%	1.2%
合計	100.0%	100.0%	-

※計理処理の仕組み上、直近の追加設定分が反映されないことなどにより、ファンドの実質組入比率と基本資産配分比率が、一時的に大幅に乖離したり「現金等」の比率がマイナスになる場合があります。  
※株式には投資証券、投資信託受益証券及び新株予約権証券を含む場合があります。  
※外国債券の資産配分比率である40%のうち、15%相当部分を為替ヘッジします。

設定・運用は  
DIAMアセットマネジメント



【募集代理店】 取扱者(生命保険募集人)  
株式会社みずほ銀行

【引受保険会社】  
アクサ生命保険株式会社  
〒108-8020 東京都港区白金1 17 3  
TEL: 0120 375 193  
アクサ生命 <http://www.axa.co.jp/life/>



# 保証金額付特別勘定年金特約（定期Ⅰ型）付変額個人年金保険（06） 保証金額付特別勘定年金特約（定期Ⅱ型）付変額個人年金保険（06） 特別勘定の四半期運用レポート（2011年4月～2011年6月）

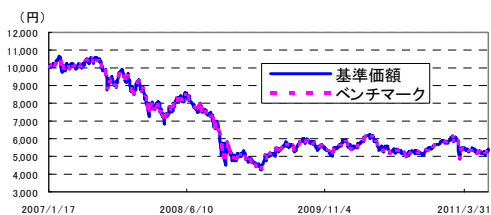
- 当資料中の運用実績に関するいかなる内容も過去の実績であり、将来の運用成果を示唆あるいは保証するものではありません。また、予告なしに当資料の内容が変更、廃止される場合がありますのであらかじめご承知おください。
- 特別勘定資産は、投資信託を利用している部分の他に、保険契約の異動等に備える部分を加えたものとなります。後者の部分については、利用する投資信託の委託会社であるDIAMアセットマネジメント株式会社の裁量の範囲外となります。
- 当ページは、DIAMアセットマネジメント株式会社による運用報告を、アクサ生命保険株式会社が提供するものであり、内容に関して、アクサ生命保険株式会社は一切責任を負いません。

## 各マザーファンドの運用状況 [2011年6月末日現在]

※ここでは、特別勘定で利用している投資信託のマザーファンドの基準価額推移等を記載しております。特別勘定のユニットプライスは、ファンドの基準価額とは異なります。

### ◆国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド◆

※比率は組入株式評価額に対する割合です。



※基準価額およびベンチマークは2007年1月17日の値を10,000として指数化しております。  
※ベンチマークは、東証株価指数(TOPIX、配当込み)です。

#### 組入上位10銘柄 (組入銘柄数:1666銘柄)

No	銘柄	業種	比率(%)
1	トヨタ自動車	輸送用機器	3.71
2	三菱UFJフィナンシャルG	銀行業	2.55
3	本田技研	輸送用機器	2.28
4	キヤノン	電気機器	2.07
5	三井住友フィナンシャルG	銀行業	1.62
6	みずほフィナンシャルG	銀行業	1.40
7	三菱商事	卸売業	1.35
8	武田薬品	医薬品	1.27
9	日本電信電話	情報・通信業	1.25
10	ファナック	電気機器	1.22

※株式には新株予約権証券を含む場合があります。

#### 騰落率

	1ヵ月 (2011/05/31)	3ヵ月 (2011/03/31)	6ヵ月 (2010/12/30)	1年 (2010/06/30)	3年 (2008/06/30)	設定来 (2007/01/17)
当ファンド	1.38%	-2.17%	-4.35%	3.11%	-31.77%	-45.97%
ベンチマーク	1.37%	-2.22%	-4.36%	3.12%	-31.72%	-45.97%
差	0.00%	0.05%	0.01%	-0.01%	-0.06%	-0.00%

純資産総額 267,649 百万円

※設定来の騰落率は2007年1月17日を基準に算出しています。

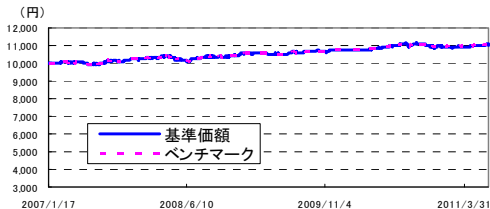
■東証株価指数(TOPIX)に関する知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。

#### 組入上位10業種

	業種名	当ファンド	ベンチマーク	差
1	電気機器	14.67	14.67	0.00
2	輸送用機器	10.49	10.49	-0.00
3	銀行業	9.12	9.12	0.00
4	化学	6.09	6.09	0.00
5	情報・通信業	5.98	5.98	-0.00
6	機械	5.43	5.43	-0.00
7	卸売業	5.34	5.34	0.00
8	医薬品	4.69	4.68	0.01
9	小売業	3.77	3.77	-0.00
10	陸運業	3.41	3.41	0.00

### ◆国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド◆

※比率は組入債券評価額に対する割合です。



※基準価額およびベンチマークは2007年1月17日の値を10,000として指数化しております。  
※ベンチマークは、NOMURA-BPI総合です。

#### 組入上位10銘柄 (組入銘柄数:653銘柄)

No	銘柄	比率(%)
1	3 1 3 回 利付国庫債券(10年)	1.68
2	3 1 2 回 利付国庫債券(10年)	1.59
3	9 3 回 利付国庫債券(5年)	1.49
4	6 6 回 利付国庫債券(5年)	1.36
5	8 9 回 利付国庫債券(5年)	1.30
6	3 1 0 回 利付国庫債券(10年)	1.29
7	2 8 5 回 利付国庫債券(10年)	1.28
8	3 0 6 回 利付国庫債券(10年)	1.27
9	2 9 3 回 利付国庫債券(10年)	1.27
10	3 0 5 回 利付国庫債券(10年)	1.21

#### セクター別比率

	組入比率	ベンチマーク	差
国債	76.70%	75.46%	1.24%
地方債	6.82%	7.32%	-0.50%
金融債	1.49%	1.50%	-0.01%
政保債	4.66%	4.65%	0.01%
社債	9.26%	8.90%	0.36%
円建外債	0.29%	0.73%	-0.44%
MBS	0.78%	1.30%	-0.52%
ABS	0.00%	0.15%	-0.15%
合計	100.00%	100.00%	-

#### 騰落率

	1ヵ月 (2011/05/31)	3ヵ月 (2011/03/31)	6ヵ月 (2010/12/30)	1年 (2010/06/30)	3年 (2008/06/30)	設定来 (2007/01/17)
当ファンド	0.28%	0.98%	0.28%	0.52%	7.58%	10.38%
ベンチマーク	0.31%	1.09%	0.39%	0.64%	7.78%	10.61%
差	-0.04%	-0.11%	-0.11%	-0.12%	-0.21%	-0.23%

純資産総額 426,311 百万円

※設定来の騰落率は2007年1月17日を基準に算出しています。

■NOMURA-BPI総合は野村證券株式会社によって計算、公表されている投資収益指数で、野村證券株式会社の知的財産です。

#### ポートフォリオの状況

	当ファンド	ベンチマーク	差
平均複利回り	0.83%	0.83%	-0.01%
平均クーポン	1.45%	1.47%	-0.02%
平均残存期間	8.02	7.75	0.26
修正デュレーション	7.00	6.85	0.16

※ポートフォリオの状況は純資産総額をもとに計算しております。

※「複利回り」とは、個別債券等について満期まで保有した場合の複利回りを加重平均したものです。利回りは、計算日時点の評価にもとづくものであり、売却や償還による差損益等を考慮した後のファンドの「期待利回り」を示すものではありません。  
※「クーポン」とは、債券の額面に対して毎年受取れる利息の割合のことで表面利率をあらわします。

※「修正デュレーション」とは、債券価格の弾力性を示す指標として用いられ金利の変化に対する債券価格の変動率を示します。

○当資料は、DIAMアセットマネジメント株式会社が独自に作成したものであり、金融商品取引法により義務づけられた資料ではありません。○当資料はあくまでも情報提供を目的とするものであり、投資家に対する投資勧誘を目的とするものではありません。○投資信託は、実質的に株式や債券等の値動きのある有価証券(外貨建資産には為替リスクがあります)に投資をしますので、市場環境、組入有価証券の発行者に係る信用状況等の変化により基準価額は変動します。このため、購入金額について元本保証及び利回り保証のいずれもありません。○当資料は、DIAMアセットマネジメント株式会社が信頼できると判断したデータにより作成しておりますが、その内容の完全性、正確性について、同社が保証するものではありません。また掲載データはあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を保証するものではありません。投資信託は1. 預金・金融債・保険契約ではありません。また、預金・金融債・保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。また証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。2. 金融機関の預金・金融債あるいは保険契約における保険金額とは異なり、購入金額については元本保証及び利回り保証のいずれもありません。3. 投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合がありますが、これによる損失は購入者が負担することとなります。

設定・運用は

DIAMアセットマネジメント



【募集代理店】 取扱者(生命保険募集人)  
株式会社みずほ銀行

【引受保険会社】  
アクサ生命保険株式会社  
〒108-8020 東京都港区白金1 17 3  
TEL: 0120 375 193  
アクサ生命 http://www.axa.co.jp/life/

# 保証金額付特別勘定年金特約（定期Ⅰ型）付変額個人年金保険（06） 保証金額付特別勘定年金特約（定期Ⅱ型）付変額個人年金保険（06） 特別勘定の四半期運用レポート（2011年4月～2011年6月）

- 当資料中の運用実績に関するいかなる内容も過去の実績であり、将来の運用成果を示唆あるいは保証するものではありません。また、予告なしに当資料の内容が変更、廃止される場合がありますのであらかじめご承知おください。
- 特別勘定資産は、投資信託を利用している部分の他に、保険契約の異動等に備える部分を加えたものとなります。後者の部分については、利用する投資信託の委託会社であるDIAMアセットマネジメント株式会社の裁量の範囲外となります。
- 当ページは、DIAMアセットマネジメント株式会社による運用報告を、アクサ生命保険株式会社が提供するものであり、内容に関して、アクサ生命保険株式会社は一切責任を負いません。

## 各マザーファンドの運用状況 [2011年6月末日現在]

※ここでは、特別勘定で利用している投資信託のマザーファンドの基準価額推移等を記載しております。特別勘定のユニットプライスは、ファンドの基準価額とは異なります。

### ◆外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド◆

※比率は組入株式評価額に対する割合です。

※基準価額およびベンチマークは2007年1月17日の値を10,000として指数化しております。  
※ベンチマークは、MSCIコクサイ・インデックス(円換算ベース、配当込み)です。

1ヵ月	3ヵ月	6ヵ月	1年	3年	設定来
(2011/05/31)	(2011/03/31)	(2010/12/30)	(2010/06/30)	(2008/06/30)	(2007/01/17)
当ファンド	-2.22%	-3.71%	4.23%	19.29%	-21.98%
ベンチマーク	-2.18%	-3.67%	4.43%	19.33%	-21.16%
差	-0.04%	-0.04%	-0.21%	-0.04%	-0.83%

純資産総額 287,369 百万円  
※設定来の騰落率は2007年1月17日を基準に算出しています。

■MSCIコクサイ・インデックスは、MSCI Inc. が公表しているインデックスで、当指数に関する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc.に属しており、また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

組入上位10銘柄				組入上位10カ国			組入上位10業種	
No	銘柄	国名	業種	No	国名	比率	No	業種名
1	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	石油・ガス・消耗燃料	1	アメリカ	52.70%	1	エネルギー
2	APPLE INC	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	2	イギリス	10.04%	2	素材
3	NESTLE SA-REGISTERED	スイス	食品	3	カナダ	5.88%	3	銀行
4	INTL BUSINESS MACHINES CORP	アメリカ	情報技術サービス	4	フランス	5.01%	4	資本財
5	CHEVRON CORP	アメリカ	石油・ガス・消耗燃料	5	スイス	4.75%	5	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
6	GENERAL ELECTRIC CO	アメリカ	コングロマリット	6	ドイツ	4.46%	6	食品・飲料・タバコ
7	MICROSOFT CORP	アメリカ	ソフトウェア	7	オーストラリア	4.26%	7	ソフトウェア・サービス
8	AT&T INC	アメリカ	各種電気通信サービス	8	スペイン	1.78%	8	各種金融
9	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	医薬品	9	スウェーデン	1.52%	9	保険
10	PROCTER & GAMBLE CO	アメリカ	家庭用品	10	イタリア	1.33%	10	電気通信サービス

※株式には投資証券、投資信託受益証券及び新株予約権証券を含む場合があります。

### ◆外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド◆

※比率は組入債券評価額に対する割合です。

※基準価額およびベンチマークは2007年1月17日の値を10,000として指数化しております。  
※ベンチマークは、シティグループ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)です。

1ヵ月	3ヵ月	6ヵ月	1年	3年	設定来
(2011/05/31)	(2011/03/31)	(2010/12/30)	(2010/06/30)	(2008/06/30)	(2007/01/17)
当ファンド	-0.34%	0.09%	5.47%	1.18%	-17.38%
ベンチマーク	-0.32%	-0.06%	5.56%	0.88%	-17.35%
差	-0.02%	0.15%	-0.09%	0.30%	-0.03%

純資産総額 386,518 百万円  
※設定来の騰落率は2007年1月17日を基準に算出しています。

■シティグループ世界国債インデックスは、シティグループ・グローバル・マーケット・インクが開発した債券インデックスです。

組入上位10銘柄				通貨別比率		ポートフォリオの状況		
No	銘柄	通貨	組入比率(%)	残存年数	通貨	比率	当ファンド	ベンチマーク
1	US T N/B 4.0 11/15/12	米ドル	0.99	1.375	ユーロ	44.78%	2.72%	2.82%
2	US T N/B 4.0 02/15/14	米ドル	0.93	2.625	米ドル	38.22%	4.00%	3.65%
3	US T N/B 4.25 11/15/13	米ドル	0.93	2.375	イギリス・ポンド	7.95%	7.99	8.21
4	US T N/B 4.75 05/15/14	米ドル	0.83	2.875	カナダ・ドル	3.10%	5.77	5.91
5	US T N/B 4.25 08/15/13	米ドル	0.81	2.125	オーストラリア・ドル	1.20%	5.91	5.21
6	US T N/B 4.375 08/15/12	米ドル	0.78	1.125	メキシコ・ペソ	0.95%	8.1	8.1
7	US T N/B 1.5 07/15/12	米ドル	0.78	1.042	ポーランド・ズロチ	0.93%	8.21	8.21
8	US T N/B 1.125 12/15/12	米ドル	0.76	1.458	デンマーク・クローネ	0.89%	8.21	8.21
9	US T N/B 3.875 02/15/13	米ドル	0.72	1.625	スウェーデン・クローネ	0.72%	8.21	8.21
10	US T N/B 1.375 09/15/12	米ドル	0.72	1.208	マレーシア・リンギット	0.52%	8.21	8.21
					シンガポール・ドル	0.42%	8.21	8.21
					ノルウェー・クローネ	0.31%	8.21	8.21
					合計	100.00%		

※ポートフォリオの状況は純資産総額をもとに計算しております。  
※「複利回り」とは、個別債券等について満期まで保有した場合の複利回りを加重平均したものです。利回りは、計算日時点の詳細にもとづくものであり、売却や償還による差損益等を考慮した後のファンドの「期待利回り」を示すものではありません。  
※「クーポン」とは、債券の額面に対して毎年受取る利息の割合のことで表面利率をあらわします。  
※「修正デュレーション」とは、債券価格の弾力性を示す指標として用いられ金利の変化に対する債券価格の変動率を示します。

○当資料は、DIAMアセットマネジメント株式会社が独自に作成したものであり、金融商品取引法により義務づけられた資料ではありません。○当資料はあくまでも情報提供を目的とするものであり、投資家に対する投資勧誘を目的とするものではありません。○投資信託は、実質的に株式や債券等の値動きのある有価証券(外資証券資産には為替リスクも含まれます)に投資をしますので、市場環境、組入有価証券の発行者に係る信用状況等の変化により基準価額は変動します。このため、購入金額については元本保証及び利回り保証のいずれもありません。○当資料は、DIAMアセットマネジメント株式会社が信頼できると判断したデータにより作成しておりますが、その内容の完全性、正確性について、当社が保証するものではありません。また掲載データはあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を保証するものではありません。投資信託は1. 預金・金融債・保険契約ではありません。また、預金・金融債・保険契約及び保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。また証券会社を通じて購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。2. 金融機関の預金・金融債あるいは保険契約における保険金額とは異なり、購入金額については元本保証及び利回り保証のいずれもありません。3. 投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合がありますが、これによる損失は購入者が負担することとなります。

設定・運用は  
**DIAMアセットマネジメント**  
ダイアム

【募集代理店】 取扱者（生命保険募集人）  
株式会社みずほ銀行

【引受保険会社】  
アクサ生命保険株式会社  
〒108-8020 東京都港区白金1 17 3  
TEL: 0120 375 193  
アクサ生命 <http://www.axa.co.jp/life/>

# 保証金額付特別勘定年金特約（定期Ⅰ型）付変額個人年金保険（06） 保証金額付特別勘定年金特約（定期Ⅱ型）付変額個人年金保険（06） リスク及び諸費用について

## 【投資リスクについて】

この保険は積立金額および年金額等が特別勘定資産の運用実績に応じて変動（増減）するしくみの変額個人年金保険です。特別勘定資産の運用は、投資信託を利用して国内外の株式・公社債等で行なっており、株式および公社債の価格変動と為替変動等に伴う投資リスクがあります。特別勘定資産の運用実績が積立金額に直接反映されますので、運用実績によっては、ご契約を解約した場合の払い戻し金額等が一時払保険料等を下回る場合があります。

## 【諸費用について】

**⚠** ご契約者にご負担いただくこの保険の費用は、契約初期費用・保険契約管理費・運用関係費の合計金額となります。なお、年金種類の変更により一般勘定年金を選択された場合には、年金管理費がかかります。

### 特別勘定繰入前に控除される費用

項目	費用	ご負担いただく時期
契約初期費用	一時払保険料に対して <b>5%</b> (例)一時払保険料1,000万円の場合、 <b>50万円</b>	一時払保険料を特別勘定に繰り入れる際に、一時払保険料から控除します。

### 据置期間中に控除される費用

項目	費用	ご負担いただく時期
保険契約管理費	特別勘定の積立金額に対して <b>年率2.3%</b> (例)その日の特別勘定の積立金額が1,000万円の場合、 <b>1日あたり約631円</b>	毎日、特別勘定の積立金額から控除します。
運用関係費*1	投資信託の純資産額に対して <b>年率0.315%程度</b> (税抜き:年率0.30%) (例)その日の投資信託の純資産額が1,000万円の場合、 <b>1日あたり約87円</b>	特別勘定にて利用する投資信託において、毎日、投資信託の純資産額から控除します。

### 年金受取開始日以後に控除される費用(特別勘定年金受取期間中)

項目	費用	ご負担いただく時期
保険契約管理費	特別勘定の積立金額に対して <b>年率2.3%</b> (例)その日の特別勘定の積立金額が1,000万円の場合、 <b>1日あたり約631円</b>	毎日、特別勘定の積立金額から控除します。
運用関係費*1	投資信託の純資産額に対して <b>年率0.315%程度</b> (税抜き:年率0.30%) (例)その日の投資信託の純資産額が1,000万円の場合、 <b>1日あたり約87円</b>	特別勘定にて利用する投資信託において、毎日、投資信託の純資産額から控除します。

### 年金受取開始日以後に控除される費用(年金の種類の変更により一般勘定年金を選択した場合)

\*「年金払特約(06)」により年金をお受け取りいただく場合を含みます。

項目	費用	ご負担いただく時期
年金管理費*2	年金額に対して <b>1.0%</b> (例)年金額が100万円の場合、 <b>1万円</b>	年金受取日に、責任準備金から控除します。

\*1 運用関係費は、主に利用する投資信託の信託報酬率を記載しています。信託報酬の他、お客さまにご負担いただく手数料には、信託事務の諸費用等、有価証券の売買委託手数料および消費税等の税金等の諸費用がかかりますが、これらの費用は運用資産額や取引量などによって変動するため、費用の発生前に具体的な金額や計算方法を記載することが困難であり、表示することができません。また、これらの費用は特別勘定がその保有資産から負担するため、基準価額に反映することとなります。したがって、お客さまはこれらの費用を間接的に負担することとなります。なお、運用関係費は運用手法の変更、運用資産額の変動などの理由により、将来変更される可能性があります。

\*2 年金管理費は、将来変更となる可能性があります。

## 【その他の留意事項について】

### ■受取総額保証金額(定期型)

受取総額保証金額の最低保証は、据置期間(5年～17年)と特別勘定年金受取期間(3年～15年)の合計期間が20年である場合に限られます。積立期間中にご契約を解約される場合、もしくは年金受取期間中に積立金額を一括でお受け取りいただく場合には、お受け取りになる金額が一時払保険料を下回る場合があります。

【募集代理店】 取扱者(生命保険募集人)  
株式会社みずほ銀行

【引受保険会社】  
アクサ生命保険株式会社  
〒108-8020 東京都港区白金1 17 3  
TEL: 0120 375 193  
アクサ生命株式会社 <http://www.axa.co.jp/life/>