

# advantage

アヴァンタージュ

保証金額付特別勘定年金特約(終身型)付変額個人年金保険(06)

特別勘定(世界分散型40CM(512)/世界分散型20CM(513))

## 月次運用レポート

2011年6月



**【利用する投資信託の委託会社】 中央三井アセットマネジメント株式会社**

中央三井アセットマネジメント株式会社は、1999年7月に三信投資顧問株式会社と中信投資顧問株式会社が合併して誕生した投資信託委託会社です。現在、投資信託委託業務を中心に個人および法人のお客様に多様な商品サービスを提供しており、変額個人年金保険向け投資信託については特に力を入れています。

- ・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(終身型)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(終身型)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していますので、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（終身型）付変額個人年金保険（06） 特別勘定の月次運用レポート（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6月 ]

### 【日本株式市場】

日本株式市場は、上昇しました。TOPIX(東証株価指数)は前月末比+1.28%上昇の849.22ポイントで終了しました。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欧米株式市場が下落したことを受けて、中旬までは軟調な推移となりました。下旬には、ギリシャ財政懸念後退などにより欧米株式市場が上昇したことや、5月鉱工業生産指数が上昇したこと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、原子力損害賠償支援機構法案の閣議決定を受けて「電気・ガス業」(前月末比+13.19%)が最も上昇した一方、任天堂の下落により「その他製品」(同▲10.09%)が最も下落しました。

### 【外国株式市場】

米国株式市場は、5月米ISM製造業景況指数や5月雇用統計など経済指標の悪化を背景にした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による世界的な景気減速懸念から売り優勢の展開が続きました。下旬にかけては、ギリシャ財政懸念後退などから反発しましたが、前月末比では下落し、NYダウは前月末比▲1.24%下落の12,414.34ドルで終了しました。

欧州株式市場は、世界経済の減速懸念やギリシャの財政懸念が強まったことなどを受けて多くの市場で下落しましたが、月末には、ギリシャ緊縮財政案可決を受けて反発しました。市場別騰落率は、英FT100が前月末比▲0.74%下落、仏CAC40が同▲0.62%下落、独DAXは同+1.13%上昇となりました。

### 【日本債券市場】

日本債券市場は、揉み合いでの推移が続き、新発10年国債利回りは1.13%となりました(前月末は1.15%)。上旬は、政局不安などを受け財政懸念が強まったことなどから、金利は1.1%台後半に上昇しました。中旬以降は、4月機械受注が予想を下回ったことなど軟調な経済指標や、世界経済の減速懸念、投資家の根強い債券投資需要などが買い材料となり、概ね1.1%台前半で底堅く推移しました。日銀は、政策金利を据え置き、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(米連邦準備理事会)が米国の景気回復鈍化を背景に低金利を長期間維持する方針を示したことや、ギリシャの財政懸念が再び強まったことなどから、金利は低下しました。しかし下旬にかけては、ギリシャの財政懸念が後退したことや株価の上昇などが売り材料となり、米10年国債利回りは、月末は3.160%となりました(前月末は3.061%)。

欧州債券市場は、ギリシャの財政懸念が強まったことを受けて比較的安全とされる独国債が買われ、金利は低下しました。しかし、下旬にかけては上昇に転じ、独10年国債利回りは、月末には3.025%となりました(前月末は3.020%)。

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。ECB(欧州中央銀行)は政策金利を据え置き、年1.25%を維持しました。

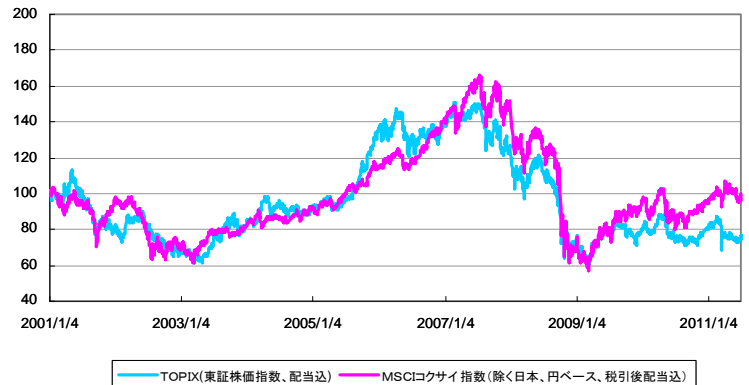
### 【外国為替市場】

米ドル/円相場は、上旬は、米国景気の減速懸念などから円高が進行しました。その後、ギリシャの金融支援策を巡る動向を睨みながら、小幅な値動きでの推移が続き、円は対ドルで前月末比0円15銭(+0.19%)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、ギリシャの財政懸念が強まったことなどから円高が進行した後、下旬にかけては、ギリシャでの緊縮財政案の可決による財政懸念の後退を受けてリスク回避の動きが弱まり、円安となりました。円は対ユーロで前月末比0円57銭(▲0.49%)円安ユーロ高の1ユーロ=116円84銭となりました。

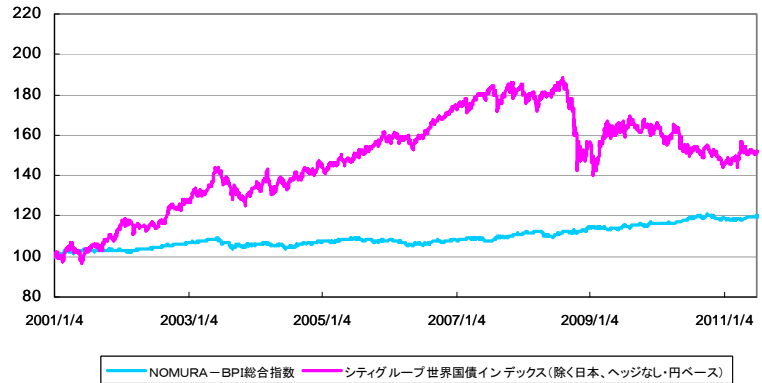
### 日本と外国の株式市場の推移

\*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。

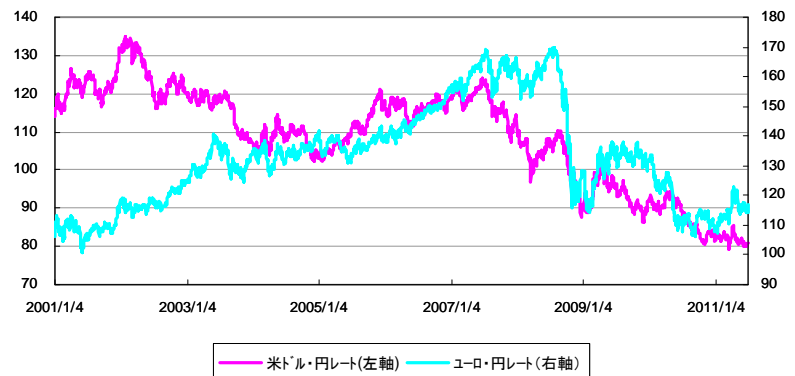


### 日本と外国の債券市場の推移

\*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

### 【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  
アクサ生命ホームページ <http://www.axa.co.jp/life/>

### 【取扱者(生命保険募集人)】

中央三井信託銀行株式会社

# 保証金額付特別勘定年金特約（終身型）付変額個人年金保険（06） 特別勘定の月次運用レポート（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中央三井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40CM(512)	<ul style="list-style-type: none"> <li>● 当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行い、実質的に国内外の株式および公社債等に投資を行います。当ファンドが主要投資対象とする各マザーファンドの基本配分比率は以下の通りとし、中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。 中央三井日本株式マザーファンド20%、中央三井日本債券マザーファンド30%、中央三井外国株式マザーファンド20%、中央三井外国債券マザーファンド30% *1</li> </ul>
利用する投資信託	*1: 当ファンドは、外貨建債券資産および中央三井外国債券マザーファンドの組入れに伴う実質組入外貨建資産の50%部分の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行います。
中央三井VAポートフォリオ40 (適格機関投資家専用)	<ul style="list-style-type: none"> <li>● 実際の資産配分については、基本配分比率に対して一定の変動許容幅を設け、その範囲内で調整を行います。</li> <li>● 当ファンドの主なリスク 株価変動リスク、金利変動リスク、信用リスク、流動性リスク、カントリーリスク、為替リスク</li> </ul>
特別勘定名	利用する投資信託の運用方針
世界分散型20CM(513)	<ul style="list-style-type: none"> <li>● 当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行い、実質的に国内外の株式および公社債等に投資を行います。当ファンドが主要投資対象とする各マザーファンドの基本配分比率は以下の通りとし、中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。 中央三井日本株式マザーファンド10%、中央三井日本債券マザーファンド40%、中央三井外国株式マザーファンド10%、中央三井外国債券マザーファンド40% *2</li> </ul>
利用する投資信託	*2: 当ファンドは、外貨建債券資産および中央三井外国債券マザーファンドの組入れに伴う実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行います。
中央三井VAポートフォリオ20 (適格機関投資家専用)	<ul style="list-style-type: none"> <li>● 実際の資産配分については、基本配分比率に対して一定の変動許容幅を設け、その範囲内で調整を行います。</li> <li>● 当ファンドの主なリスク 株価変動リスク、金利変動リスク、信用リスク、流動性リスク、カントリーリスク、為替リスク</li> </ul>

・「ファミリーファンド方式」とは、投資家から投資された資金をまとめてベビーファンドとし、その資金をマザーファンドに投資して、その実質的な運用はマザーファンドで行う仕組みのことをいいます。

### ■特別勘定のユニットプライスの推移

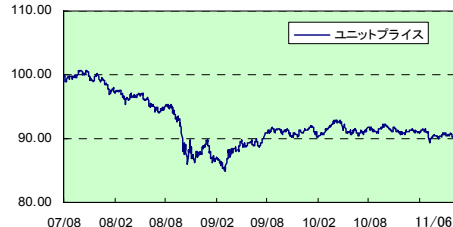
※ 特別勘定のユニットプライスは、特別勘定で利用している投資信託の基準価額とは異なります。

#### 世界分散型40CM(512)



・特別勘定のユニットプライスは、特別勘定の設定日(2007年8月8日)を100.00として計算しております。

#### 世界分散型20CM(513)



・特別勘定のユニットプライスは、特別勘定の設定日(2007年8月9日)を100.00として計算しております。

特別勘定のユニットプライス	騰落率(%)
2011年6月末	78.65 過去1ヵ月 ▲0.37
2011年5月末	78.95 過去3ヵ月 ▲1.21
2011年4月末	79.86 過去6ヵ月 ▲0.10
2011年3月末	79.61 過去1年 2.30
2011年2月末	80.17 過去3年 ▲15.16
2011年1月末	79.20 設定来 ▲21.34

・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。

特別勘定のユニットプライス	騰落率(%)
2011年6月末	90.45 過去1ヵ月 ▲0.29
2011年5月末	90.71 過去3ヵ月 ▲0.16
2011年4月末	90.68 過去6ヵ月 ▲0.67
2011年3月末	90.60 過去1年 ▲0.09
2011年2月末	91.30 過去3年 ▲4.78
2011年1月末	90.91 設定来 ▲9.55

### ■特別勘定資産の内訳

項目	世界分散型40CM(512)	
	金額(千円)	比率(%)
その他有価証券	10,007,958	99.4
現預金・コールローン	57,481	0.6
その他	—	—
合計	10,065,439	100.0

項目	世界分散型20CM(513)	
	金額(千円)	比率(%)
その他有価証券	839,785	99.2
現預金・コールローン	6,721	0.8
その他	—	—
合計	846,506	100.0

・各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。

#### 【取扱保険会社】

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/>

#### 【取扱者(生命保険募集人)】

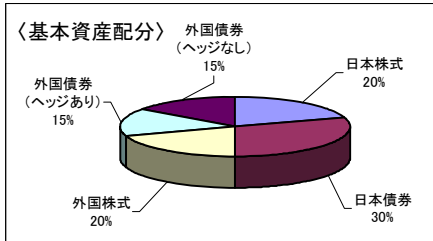
中央三井信託銀行株式会社

# 保証金額付特別勘定年金特約（終身型）付変額個人年金保険（06） 特別勘定の月次運用レポート（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中央三井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、中央三井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。

## 中央三井VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）の運用状況 [2011年6月末日現在]

### ■ファンドの特色



当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ない、実質的に国内外の株式および公社債等に投資を行います。

当ファンドが主要投資対象とする各マザーファンドは、それぞれ以下のベンチマーク(運用成果を判断するうえで基準とする指数)と連動する投資成果を目標とする運用を行います。

中央三井日本株式マザーファンド：「TOPIX(東証株価指数)」※1

※1ただし、配当込み指数を使用しています。

中央三井日本債券マザーファンド：「NOMURA-BPI総合」

中央三井外国株式マザーファンド：「MSCIコクサイ指数(円ベース)」※2

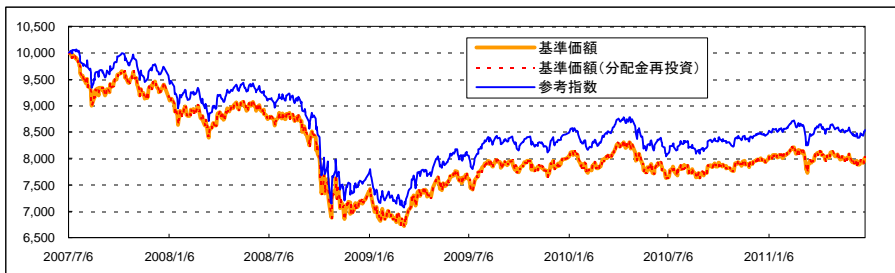
※2ただし、配当込み指数を使用しています。

中央三井外国債券マザーファンド：「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)」※3

※3「中央三井VAポートフォリオ40(適格機関投資家専用)」においては、中央三井外国債券マザーファンド受益証券の組入れに伴う実質的な組入れ外貨建資産の50%部分について原則として為替ヘッジを行いますので、上記合成指数の算出に際しては「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)」も併せて使用します。

### ■基準価額の推移

※ 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。



- ・グラフは、中央三井VAポートフォリオ40(適格機関投資家専用)の設定日(2007年7月9日)の前営業日を10,000として指数化しています。
- ・基準価額および基準価額(分配金再投資)は、信託報酬(純資産総額に対し、年率0.294%程度(税抜0.28%程度))控除後の値です。
- ・基準価額(分配金再投資)は、分配金(税引前)を再投資したものと計算しています。
- ・参考指数は、TOPIX(東証株価指数)20%、NOMURA-BPI総合30%、MSCIコクサイ指数(円ベース)20%、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)15%、および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)15%で組み合わせた合成指数です。

### ■概況

	2011年6月30日	前月末	前月末比
基準価額	8,017円	8,032円	-15円
純資産総額(百万円)	29,856	30,018	-162

	基準価額	日付
設定来高値	9,991円	2007年7月9日
設定来安値	6,724円	2009年3月10日

### ■資産構成

	基本配分比率	ファンドの資産構成
中央三井日本株式マザーファンド	20.0%	20.3%
中央三井日本債券マザーファンド	30.0%	29.5%
中央三井外国株式マザーファンド	20.0%	20.4%
中央三井外国債券マザーファンド(ヘッジあり)	15.0%	14.8%
中央三井外国債券マザーファンド(ヘッジなし)	15.0%	15.0%
コール・その他	0.0%	0.0%
合計	100.0%	100.0%

- ・ファンドの資産構成は、純資産総額に対する比率です。
- ・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「コール・その他」の値がマイナスで表示されることがあります。
- ・REITの組み入れがある場合、REITは株式に含めて表示しています。

### ■騰落率

	過去1ヵ月	過去3ヵ月	過去6ヵ月	過去1年	過去3年	設定来
ファンド	-0.19%	-0.64%	+1.05%	+4.69%	-9.22%	-19.83%
参考指数	-0.09%	-0.42%	+1.32%	+5.39%	-6.85%	-14.58%
差	-0.09%	-0.23%	-0.27%	-0.70%	-2.37%	-5.25%

・ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。また、ファンドの騰落率と実際の投資者利回りとは異なります。

### ■分配金実績(税引前)

・下記は、1万口当たりの税引前分配金実績です。

	直近期	2期前	3期前	4期前	5期前	6期前	設定来累計
決算日	2011年2月21日	2010年2月22日	2009年2月23日	2008年2月21日	-	-	-
分配金	0.00円	0.00円	0.00円	0.00円	-	-	0円

・表示桁未満の数値がある場合、四捨五入で処理しております。

### 【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

アクサ生命ホームページ <http://www.axa.co.jp/life/>

### 【取扱者(生命保険募集人)】

中央三井信託銀行株式会社

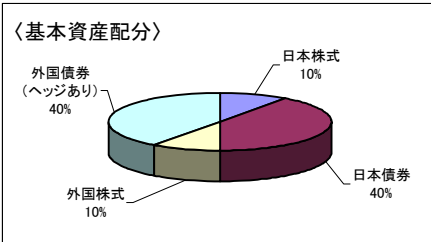


# 保証金額付特別勘定年金特約（終身型）付変額個人年金保険（06） 特別勘定の月次運用レポート（2011年6月）

- ・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中央三井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、中央三井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。

## 中央三井VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）の運用状況 [2011年6月末日現在]

### ■ファンドの特色



当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ない、実質的に国内外の株式および公社債等に投資を行います。

当ファンドが主要投資対象とする各マザーファンドは、それぞれ以下のベンチマーク(運用成果を判断するうえで基準とする指数)と連動する投資成果を目標とする運用を行います。

中央三井日本株式マザーファンド: 「TOPIX(東証株価指数)」※1

※1ただし、配当込み指数を使用しています。

中央三井日本債券マザーファンド: 「NOMURA-BPI総合」

中央三井外国株式マザーファンド: 「MSCIコクサイ指数(円ベース)」※2

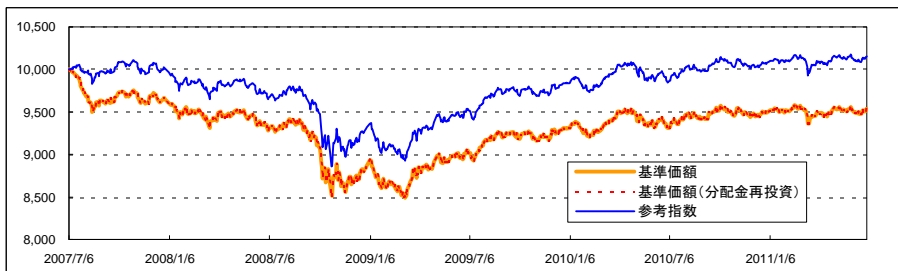
※2ただし、配当込み指数を使用しています。

中央三井外国債券マザーファンド: 「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)」※3

※3「中央三井VAポートフォリオ20(適格機関投資家専用)」においては、中央三井外国債券マザーファンド受益証券の組入れに伴う実質的な組入れ外資産について原則として為替ヘッジを行いますので、上記合成指数の算出に際しては「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)」を使用します。

### ■基準価額の推移

※ 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。



- ・グラフは、中央三井VAポートフォリオ20(適格機関投資家専用)の設定日(2007年7月9日)の前営業日を10,000として指数化しています。
- ・基準価額および基準価額(分配金再投資)は、信託報酬(純資産総額)に対し、年率0.294%程度(税抜0.28%程度)控除後の値です。
- ・基準価額(分配金再投資)は、分配金(税引前)を再投資したものと計算しています。
- ・参考指数は、TOPIX(東証株価指数)10%、NOMURA-BPI総合40%、MSCIコクサイ指数(円ベース)10%、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)40%で組み合わせた合成指数です。

### ■概況

	2011年6月30日	前月末	前月末比
基準価額	9,535円	9,545円	-10円
純資産総額(百万円)	1,990	2,014	-24

	基準価額	日付
設定来高値	9,991円	2007年7月9日
設定来安値	8,489円	2009年3月10日

### ■資産構成

	基本配分比率	ファンドの資産構成
中央三井日本株式マザーファンド	10.0%	10.2%
中央三井日本債券マザーファンド	40.0%	39.5%
中央三井外国株式マザーファンド	10.0%	10.2%
中央三井外国債券マザーファンド(ヘッジあり)	40.0%	39.6%
コール・その他	0.0%	0.4%
合計	100.0%	100.0%

- ・ファンドの資産構成は、純資産総額に対する比率です。
- ・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「コール・その他」の値がマイナスで表示されることがあります。
- ・REITの組み入れがある場合、REITは株式に含めて表示しています。

### ■騰落率

	過去1ヵ月	過去3ヵ月	過去6ヵ月	過去1年	過去3年	設定来
ファンド	-0.10%	+0.41%	+0.46%	+2.24%	+2.02%	-4.65%
参考指数	-0.06%	+0.58%	+0.81%	+2.90%	+4.55%	+1.56%
差	-0.04%	-0.17%	-0.35%	-0.66%	-2.53%	-6.21%

・ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。また、ファンドの騰落率と実際の投資者利回りは異なります。

### ■分配金実績(税引前)

・下記は、1万口当たりの税引前分配金実績です。

	直近期	2期前	3期前	4期前	5期前	6期前	設定来累計
決算日	2011年2月21日	2010年2月22日	2009年2月23日	2008年2月21日	-	-	-
分配金	0.00円	0.00円	0.00円	0.00円	-	-	0円

・表示桁未満の数値がある場合、四捨五入で処理しております。

### 【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

アクサ生命ホームページ: <http://www.axa.co.jp/life/>

### 【取扱者(生命保険募集人)】

中央三井信託銀行株式会社

# 保証金額付特別勘定年金特約（終身型）付変額個人年金保険（06） 特別勘定の月次運用レポート（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中央三井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、中央三井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。

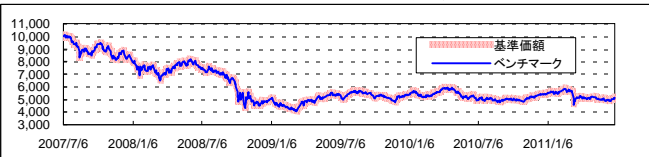
## 各マザーファンドの運用状況 [2011年6月末日現在]

※ 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。

### 中央三井日本株式マザーファンド

※ ベンチマーク/BM：TOPIX(東証株価指数配当込み)

純資産総額： 252,516 百万円



- ・2007年7月9日の前営業日を10,000として指数化しています。
- ・下記比率は、純資産総額に対する当該評価金額等の比率となります。

#### 組入上位10銘柄

組入銘柄数： 1,588 銘柄

銘柄	業種	比率
1 トヨタ自動車	輸送用機器	3.58%
2 三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	2.46%
3 本田技研工業	輸送用機器	2.20%
4 キヤノン	電気機器	2.00%
5 三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.57%
6 みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1.36%
7 三菱商事	卸売業	1.31%
8 武田薬品工業	医薬品	1.23%
9 日本電信電話	情報・通信業	1.21%
10 ファナック	電気機器	1.18%
合計		18.09%

#### 騰落率

	過去1ヵ月	過去3ヵ月	過去6ヵ月	過去1年	過去3年	設定来
ファンド	+1.37%	-2.15%	-4.34%	+3.17%	-31.54%	-48.32%
ベンチマーク	+1.37%	-2.22%	-4.36%	+3.12%	-31.72%	-48.51%
差	+0.00%	+0.08%	+0.02%	+0.05%	+0.17%	+0.19%

- ・騰落率は、2007年7月9日以降の情報について記載しています。
- ・設定来の騰落率は、2007年7月9日の前営業日を起点として計算しています。

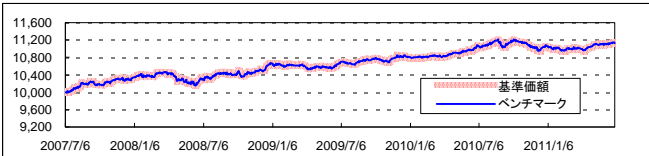
#### 組入上位10業種

業種	比率	BM構成比
1 電気機器	14.16%	14.67%
2 輸送用機器	10.13%	10.49%
3 銀行業	8.80%	9.12%
4 化学	5.89%	6.09%
5 情報・通信業	5.78%	5.98%
6 機械	5.23%	5.43%
7 卸売業	5.19%	5.34%
8 医薬品	4.52%	4.68%
9 小売業	3.65%	3.77%
10 陸運業	3.30%	3.41%
合計	66.65%	68.97%

### 中央三井日本債券マザーファンド

※ ベンチマーク/BM：NOMURA-BPI総合

純資産総額： 357,961 百万円



- ・2007年7月9日の前営業日を10,000として指数化しています。
- ・下記比率は、純資産総額に対する当該評価金額等の比率となります。

#### 組入上位10銘柄

組入銘柄数： 1,020 銘柄

銘柄	クーポン	償還日	比率
1 利付国庫債券(10年)第312回	1.200%	2020年12月20日	1.41%
2 利付国庫債券(5年)第87回	0.500%	2014年12月20日	1.15%
3 利付国庫債券(10年)第285回	1.700%	2017年3月20日	1.08%
4 利付国庫債券(5年)第90回	0.300%	2015年6月20日	1.03%
5 利付国庫債券(10年)第313回	1.300%	2021年3月20日	1.03%
6 利付国庫債券(10年)第305回	1.300%	2019年12月20日	0.98%
7 利付国庫債券(10年)第288回	1.700%	2017年9月20日	0.96%
8 利付国庫債券(5年)第93回	0.500%	2015年12月20日	0.95%
9 利付国庫債券(5年)第86回	0.600%	2014年9月20日	0.93%
10 利付国庫債券(10年)第284回	1.700%	2016年12月20日	0.88%
合計			10.41%

・「クーポン」とは、債券の額面に対して毎年受け取れる利息の割合のことで表面利率を表します。

#### 騰落率

	過去1ヵ月	過去3ヵ月	過去6ヵ月	過去1年	過去3年	設定来
ファンド	+0.31%	+1.10%	+0.44%	+0.68%	+7.67%	+11.19%
ベンチマーク	+0.31%	+1.09%	+0.39%	+0.64%	+7.78%	+11.28%
差	-0.01%	+0.02%	+0.05%	+0.04%	-0.11%	-0.09%

- ・騰落率は、2007年7月9日以降の情報について記載しています。
- ・設定来の騰落率は、2007年7月9日の前営業日を起点として計算しています。

#### 債券種別資産構成比

種別	比率	BM構成比
国債	74.90%	75.46%
地方債	7.26%	7.32%
政府保証債	4.61%	4.65%
金融債	1.48%	1.50%
事業債	8.80%	8.90%
円建外債	0.71%	0.73%
MBS債	1.33%	1.30%
ABS債	0.00%	0.15%
コール・その他	0.91%	0.00%
合計	100.00%	100.00%

#### ポートフォリオプロフィール

	ファンド	BM	差
平均複利回り	0.82%	0.83%	-0.01%
平均クーポン	1.45%	1.47%	-0.02%
平均残存年数	8.16	7.75	0.41
デュレーション	6.96	6.89	0.07

- ・利回り・残存年数は、債券現物部分について計算しております。
- ・「複利回り」とは、個別の債券等を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。あくまで、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。
- ・「デュレーション」とは、投資した債券の利子及び元本の平均回収期間を表す指標です。

・表示桁未満の数値がある場合、四捨五入で処理しております。

#### 【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  
アクサ生命ホームページ <http://www.axa.co.jp/life/>

#### 【取扱者(生命保険募集人)】

中央三井信託銀行株式会社

# 保証金額付特別勘定年金特約（終身型）付変額個人年金保険（06） 特別勘定の月次運用レポート（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通知おきください。
- ・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中央三井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、中央三井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。

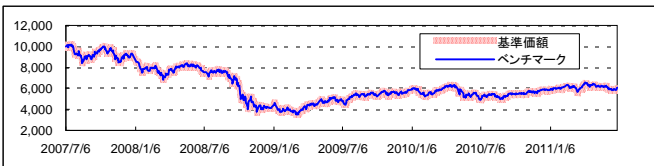
## 各マザーファンドの運用状況 [2011年6月末日現在]

※ 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。

### 中央三井外国株式マザーファンド

※ ベンチマーク/BM：MSCIコクサイ指数(円ベース配当込み)

純資産総額： 278,166 百万円



・2007年7月9日の前営業日を10,000として指数化しています。

・下記比率は、純資産総額に対する当該評価金額等の比率となります。

組入上位10銘柄		組入銘柄数: 1,320 銘柄	
銘柄	国名	業種	比率
1 EXXON MOBIL CORPORATION	アメリカ	エネルギー	1.68%
2 APPLE INC	アメリカ	テクノロジー・ハードウェアおよび携帯	1.30%
3 NESTLE SA-REGISTERD	スイス	食品・飲料・タバコ	0.91%
4 INTERNATIONAL BUSINESS MACHINE	アメリカ	ソフトウェア・サービス	0.88%
5 CHEVRON CORP	アメリカ	エネルギー	0.86%
6 GENERAL ELECTRIC	アメリカ	資本財	0.83%
7 MICROSOFT CORP	アメリカ	ソフトウェア・サービス	0.82%
8 AT&T INC	アメリカ	電気通信サービス	0.78%
9 JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	0.77%
10 PROCTER & GAMBLE CO	アメリカ	家庭用品・パーソナル用品	0.74%
合計			9.57%

### 騰落率

	過去1ヵ月	過去3ヵ月	過去6ヵ月	過去1年	過去3年	設定来
ファンド	-2.24%	-3.73%	+4.20%	+19.39%	-21.81%	-40.35%
ベンチマーク	-2.05%	-3.37%	+3.90%	+19.60%	-20.81%	-39.45%
差	-0.19%	-0.36%	+0.29%	-0.20%	-1.00%	-0.90%

・騰落率は、2007年7月9日以降の情報について記載しています。

・設定来の騰落率は、2007年7月9日の前営業日を起点として計算しています。

### 組入上位10業種

業種	比率
1 エネルギー	11.88%
2 素材	7.92%
3 銀行	7.70%
4 資本財	7.64%
5 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.28%
6 食品・飲料・タバコ	6.20%
7 ソフトウェア・サービス	5.11%
8 各種金融	5.02%
9 保険	4.06%
10 電気通信サービス	4.00%
合計	66.80%

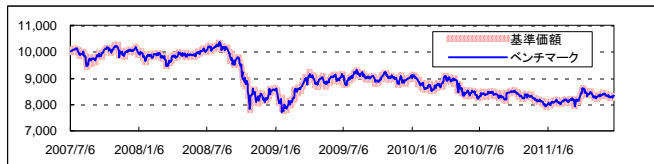
### 組入上位10カ国

国名	比率	BM構成比
1 アメリカ	52.61%	54.39%
2 イギリス	10.17%	10.57%
3 カナダ	5.63%	5.85%
4 フランス	4.86%	5.20%
5 ドイツ	4.33%	4.49%
6 オーストラリア	4.11%	4.29%
7 スイス	4.04%	4.15%
8 スペイン	1.70%	1.79%
9 スウェーデン	1.49%	1.56%
10 オランダ	1.32%	1.25%

### 中央三井外国債券マザーファンド

※ ベンチマーク/BM：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)

純資産総額： 423,733 百万円



・2007年7月9日の前営業日を10,000として指数化しています。

・下記比率は、純資産総額に対する当該評価金額等の比率となります。

組入上位10銘柄		組入銘柄数: 593 銘柄	
銘柄	国名	クーポン	償還日
1 US TREASURY N/B 3.125	アメリカ	3.125%	2019年5月15日
2 US TREASURY N/B 1.5	アメリカ	1.500%	2013年12月31日
3 US TREASURY N/B 1.75	アメリカ	1.750%	2012年8月15日
4 US TREASURY N/B 2.625	アメリカ	2.625%	2014年7月31日
5 US TREASURY N/B 3	アメリカ	3.000%	2017年2月28日
6 US TREASURY N/B 3.625	アメリカ	3.625%	2021年2月15日
7 US TREASURY N/B 2.625	アメリカ	2.625%	2018年1月31日
8 US TREASURY N/B 1.875	アメリカ	1.875%	2012年6月15日
9 US TREASURY N/B 2.625	アメリカ	2.625%	2016年2月29日
10 US TREASURY N/B 3.625	アメリカ	3.625%	2020年2月15日
合計			6.73%

・「クーポン」とは、債券の額面に対して毎年受け取れる利息の割合のことで表面利率をあらわします。

### 騰落率

	過去1ヵ月	過去3ヵ月	過去6ヵ月	過去1年	過去3年	設定来
ファンド	-0.33%	+0.09%	+5.41%	+1.11%	-17.24%	-16.69%
ベンチマーク	-0.18%	+0.25%	+5.02%	+1.11%	-16.98%	-16.67%
差	-0.15%	-0.16%	+0.39%	+0.00%	-0.27%	-0.02%

・騰落率は、2007年7月9日以降の情報について記載しています。

・設定来の騰落率は、2007年7月9日の前営業日を起点として計算しています。

### 組入上位10カ国

国名	比率	BM構成比
1 アメリカ	37.12%	37.39%
2 イタリア	10.12%	10.49%
3 フランス	10.10%	10.49%
4 ドイツ	9.92%	10.03%
5 イギリス	7.76%	7.68%
6 スペイン	4.48%	4.69%
7 カナダ	3.02%	2.94%
8 ベルギー	2.79%	2.90%
9 オランダ	2.65%	2.80%
10 オーストリア	1.90%	1.96%

### ポートフォリオプロフィール

	ファンド	BM	差
平均複利利回り	2.79%	2.82%	-0.02%
平均クーポン	3.81%	3.65%	0.16%
平均残存年数	8.12	8.21	-0.09
デュレーション	5.97	6.06	-0.09

・利回り・残存年数は、債券現物部分について計算しております。

・「複利利回り」とは、個別の債券等を満期まで保有した場合の複利利回りを加重平均したものです。あくまで、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。

・「デュレーション」とは、投資した債券の利子及び元本の平均回収期間を表す指標です。

・表示桁未満の数値がある場合、四捨五入で処理しております。

### 【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  
アクサ生命ホームページ <http://www.axa.co.jp/life/>

### 【取扱者(生命保険募集人)】

中央三井信託銀行株式会社

# 保証金額付特別勘定年金特約（終身型）付変額個人年金保険（06）の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もど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】

この保険では、「契約初期費用」、「保険契約管理費」、「運用関係費」の合計額をご負担いただきます。  
※一般勘定で運用する年金の支払期間中には、年金管理費をご負担いただきます。

## 【ご契約時】

項目	費用	ご負担いただく時期
契約初期費用	ご契約の締結等に必要の費用 一時払保険料に対して 5.0%	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。

## 【積立（運用）期間中および年金支払期間中】

項目	費用	ご負担いただく時期
保険契約管理費	既払年金累計金額と死亡一時金額の合計金額の最低保証、死亡給付金額の最低保証、災害死亡給付金額のお支払い、ならびに、ご契約の維持等に必要の費用 特別勘定の積立金額に対して 年率2.3%	積立金額に対して左記割合（率）を乗じた金額の1/365を、毎日、特別勘定の積立金額から控除します。
運用関係費	投資信託の信託報酬など、特別勘定の運用等に必要の費用 投資信託の純資産総額に対して 年率0.294%程度 (税抜0.28%程度)*	特別勘定にて利用する投資信託における純資産総額に対して左記割合（率）を乗じた金額の1/365を、毎日、投資信託の純資産総額から控除します。

\*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、お客様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等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、これらの費用は各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、お客様はこれらの費用を間接的に負担することとなります。  
\*運用手法の変更・運用資産額の変動等の理由により、将来変更される可能性があります。

## 【一般勘定で運用する年金の支払期間中】

※年金の種類を変更した場合や「年金払特約(06)」により年金としてお受け取りいただく場合です。

項目	費用	ご負担いただく時期
年金管理費	年金のお支払いや管理等に必要な費用 年金額に対して 1.0%*	年金支払日に責任準備金から控除します。

\*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（終身型）

受取総額保証金額の最低保証は、年金を特別勘定終身年金でお受け取りいただく場合に限られます。特別勘定終身年金以外の方法でお受け取りいただく場合や、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。