

特別勘定（世界分散型30AF）


月次運用実績レポート

2016年8月

【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

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。

設定・運用は
DIAMアセットマネジメント 
ダイヤモンド

- ・ 当保険商品は特別勘定で運用を行います。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、特別勘定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「ご契約のしおり・約款」、「特別勘定のしおり」等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、資産構成等はそれぞれの項目を四捨五入等していますので、合計等と合致しないことがあります。

変額個人年金保険 (07)

特別勘定の月次運用実績レポート (2016年8月)

・当ページは、利用する投資信託の委託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。

運用環境

【日本株式市場】

国内株式市場は概ね横ばいとなりました。上旬は為替が円高に振れたこと等から下落しましたが、米国の雇用統計が市場予想を上回ると、米国景気の先行き安心感から反発に転じました。中旬にかけては、為替が1ドル＝100円近辺で膠着する中、国内株式市場も揉み合う動きとなりましたが、下旬にかけて為替が円安に振れると国内株式市場も反発する展開となり、前月末比では概ね横ばいとなりました。

【外国株式市場】

外国株式市場は米国では概ね横ばい、欧州では小幅な上昇となりました。米国では、夏季休暇のため取引が低調となり様子見姿勢が強い中、追加利上げの時期を巡って見方が揺れ動くのに連れて株式市場が推移する展開となり、狭いレンジ内での動きとなりました。一方欧州では、BOE(イングランド銀行)が市場予想を上回る金融緩和を決定したことが好感され、堅調な推移となりました。

【日本債券市場】

国内債券市場では、国債利回りは上昇(価格は下落)しました。7月末の日銀の金融政策決定会合でマイナス金利の拡大と長期国債の買い入れ増額が見送られた失望を引き継いだことや、10年国債入札が不調に終わったこと等を背景に8月上旬にかけて10年国債利回りは上昇しました。その後、30年国債入札が順調な結果となったこと等をきっかけに10年国債利回りの上昇は一服し、外国の国債利回りが膠着状態となる中、国内の国債利回りも小動きの推移となりました。

【外国債券市場】

外国債券市場では、米欧とも国債利回りは小幅に上昇(価格は下落)しました。米国の雇用統計が市場予想を上回ったことを背景に米欧の10年国債利回りは上昇する場面が見られたものの、経済指標が強弱入り混じり、FOMC(米連邦公開市場委員会)議事録が早期利上げを示唆する内容ではなかったこと等が国債利回りの低下要因となりました。一方、FRB(米連邦準備理事会)議長の講演での発言が追加利上げを示唆するものと受け止められたこと等が国債利回りの上昇要因となる中、米欧の10年国債利回りは膠着した動きとなり、前月末比では小幅に上昇する結果となりました。

【外国為替市場】

ドル/円相場は、7月末の日銀による追加緩和策への失望感等を背景に上旬にかけて円高ドル安に振れました。中旬にかけては1ドル＝100円近辺で膠着したものの、下旬にはFRB議長の講演での発言が追加利上げを示唆するものと受け止められたことから円安ドル高に振れ、前月末比では概ね同水準となりました。ユーロについては、対ドルで前月末比で概ね同水準となる中、ユーロ/円相場についてもドル/円相場と同様に前月末比で概ね同水準となりました。

○当資料は、DIAMアセットマネジメント株式会社が作成したものです。○当資料は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かか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およ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。○当資料に記載されている運用実績は税引前分配金を再投資したものとする基準価額の変化を示したものであり、税金および手数料は計算に含まれておりません。○当資料における内容は作成時点のものであり、今後予告なく変更される場合があります。○投資信託は1. 預金等や保険契約ではありません。また、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。加えて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. 購入金額については元本保証およ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。

変額個人年金保険 (07) 特別勘定の月次運用実績レポート (2016年8月)

・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の裁量の範囲外となります。

特別勘定の種類と運用方針について

| 特別勘定名 | 利用する投資信託の運用方針 |
|---|--|
| 世界分散型30AF | <ul style="list-style-type: none"> ● 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。 ● 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、原則として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% ● 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。 ● 当ファンドの主なリスクとして、資産配分リスク、価格変動リスク、為替リスク、信用リスク、金利変動リスク、流動性リスクなどがあります。 |
| 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) | |

特別勘定の運用状況

■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。



※ 特別勘定のユニットプライスは、特別勘定の設定日を100.00として計算しています。

| 特別勘定のユニットプライス | | 騰落率 (%) | |
|---------------|--------|---------|--------|
| 2016年8月末 | 113.71 | 過去1ヶ月 | ▲0.66% |
| 2016年7月末 | 114.46 | 過去3ヶ月 | ▲2.54% |
| 2016年6月末 | 112.36 | 過去6ヶ月 | ▲0.75% |
| 2016年5月末 | 116.68 | 過去1年 | ▲5.08% |
| 2016年4月末 | 115.86 | 過去3年 | 9.60% |
| 2016年3月末 | 116.95 | 設定来 | 13.71% |

※ 実際のユニットプライスの小数点第三位を四捨五入して表示しています。

※ 騰落率は、該当月の月末のユニットプライスに対する当月末のユニットプライスの変動率を表しています。

※ ユニットプライスは、弊社ホームページにて各営業日にご確認いただくことができます。

■特別勘定資産の内訳

| 項目 | 金額(千円) | 比率(%) |
|---------|-----------|--------|
| 現預金・その他 | 118,671 | 1.3% |
| その他有価証券 | 9,242,149 | 98.7% |
| 合計 | 9,360,820 | 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います。

変額個人年金保険 (07) 特別勘定の月次運用実績レポート (2016年8月)

・投資信託の運用状況は、利用する投資信託の委託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

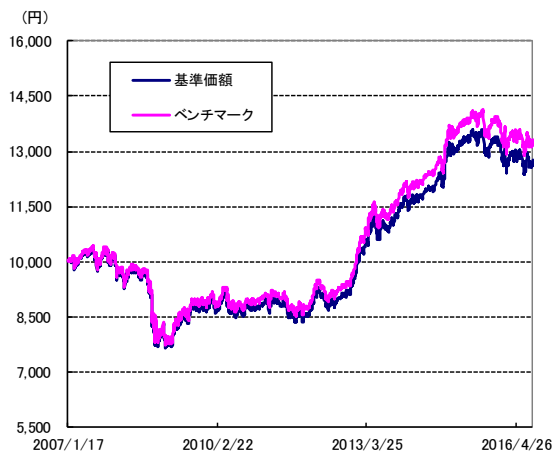
【運用方針】

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。

■各マザーファンドとベンチマーク

| 利用する投資信託名 | 基本資産配分比率 | マザーファンド受益証券 | 委託会社 | ベンチマーク | 参照ページ |
|--|----------|-------------|--------------------|---|-------|
| 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) | 国内株式 | 10.0% | DIAMアセットマネジメント株式会社 | 東証株価指数 (TOPIX、配当込み) | 5ページ |
| | 国内債券 | 30.0% | | NOMURA-BPI総合 | 5ページ |
| | 外国株式 | 20.0% | | MSCIロクサイ・インデックス (円換算ベース、配当込み) | 5ページ |
| | 外国債券 | 40.0% | | シティ世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) ※外国債券の資産配分比率である40%のうち、原則として15%相当部分を為替ヘッジしますので、合成指数の算出に際しては、「シティ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。 | 5ページ |

■基準価額の推移



- ※ 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控除後です。

■概況

| | 当月末 |
|------------|---------|
| 基準価額 | 12,765円 |
| 純資産総額(百万円) | 18,865 |

■騰落率

| | 過去1か月 | 過去3か月 | 過去6か月 | 過去1年 | 過去3年 | 設定来 |
|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| ファンド | ▲0.47% | ▲2.00% | 0.40% | ▲2.93% | 17.73% | 27.65% |
| ベンチマーク | ▲0.42% | ▲1.92% | 0.59% | ▲2.50% | 19.19% | 33.17% |
| 差 | ▲0.05% | ▲0.07% | ▲0.19% | ▲0.42% | ▲1.46% | ▲5.52% |

- ※ 投資信託の騰落率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算しています。また、投資信託の騰落率と実際の投資家利回りは異なります。

■資産構成

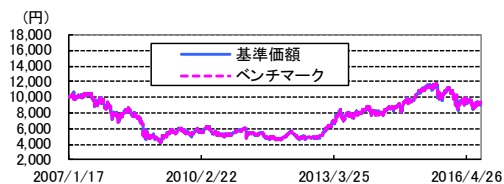
| | 基本資産配分比率 | 当投資信託の資産構成 |
|------|----------|------------|
| 国内株式 | 10.00% | 10.10% |
| 国内債券 | 30.00% | 29.49% |
| 外国株式 | 20.00% | 20.06% |
| 外国債券 | 40.00% | 39.15% |
| 現金等 | — | 1.21% |
| 合計 | 100.00% | 100.00% |

- ※ 当投資信託の資産構成は、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一時的に大幅に乖離したり「現金等」の値がマイナスで表示されることがあります。
- ※ 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。

変額個人年金保険(07) 特別勘定の月次運用実績レポート (2016年8月)

《参考情報》 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

■基準価額の推移



- ※ 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。
- ※ 東証株価指数(TOPIX)は、株式会社東京証券取引所(株)東京証券取引所の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は(株)東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、(株)東京証券取引所により、提供、保証又は販売されるものではなく、(株)東京証券取引所は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

■概況

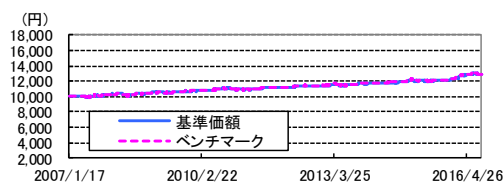
| | |
|------------|---------|
| | 当月末 |
| 純資産総額(百万円) | 282,426 |

■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 | 0.54% | ▲3.46% | 3.66% | ▲11.66% | 27.50% | ▲6.06% |
| ベンチマーク | 0.55% | ▲3.47% | 3.64% | ▲11.66% | 27.55% | ▲5.96% |
| 差 | ▲0.01% | 0.01% | 0.02% | ▲0.00% | ▲0.05% | ▲0.10% |

《参考情報》 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

■基準価額の推移



- ※ 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。
- ※ NOMURA-BPI総合は、野村証券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村証券株式会社に帰属します。なお、野村証券株式会社は、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

■概況

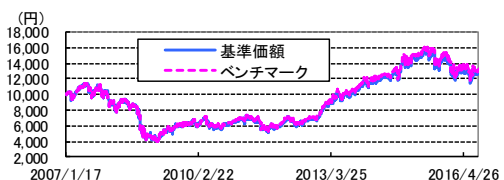
| | |
|------------|---------|
| | 当月末 |
| 純資産総額(百万円) | 384,721 |

■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 | ▲0.95% | ▲0.60% | 1.43% | 5.77% | 10.76% | 27.89% |
| ベンチマーク | ▲1.03% | ▲0.61% | 1.42% | 5.78% | 10.80% | 28.31% |
| 差 | 0.08% | 0.01% | 0.00% | ▲0.01% | ▲0.05% | ▲0.42% |

《参考情報》 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

■基準価額の推移



- ※ 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。
- ※ 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、知的財産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。

■概況

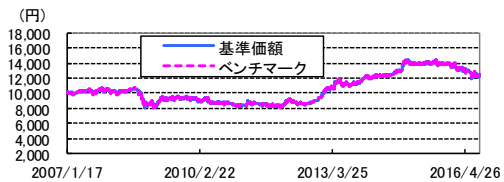
| | |
|------------|---------|
| | 当月末 |
| 純資産総額(百万円) | 256,283 |

■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 | ▲0.30% | ▲4.13% | 2.10% | ▲8.99% | 31.44% | 28.54% |
| ベンチマーク | ▲0.19% | ▲3.98% | 2.32% | ▲8.64% | 32.52% | 32.70% |
| 差 | ▲0.11% | ▲0.15% | ▲0.22% | ▲0.35% | ▲1.08% | ▲4.17% |

《参考情報》 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

■基準価額の推移



- ※ 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。
- ※ シティ世界国債インデックスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利はシティグループ・インデックスLLCに帰属します。

■概況

| | |
|------------|---------|
| | 当月末 |
| 純資産総額(百万円) | 260,994 |

■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 | ▲0.73% | ▲4.69% | ▲5.22% | ▲10.21% | 12.53% | 24.88% |
| ベンチマーク | ▲0.65% | ▲4.63% | ▲5.19% | ▲10.09% | 12.73% | 25.21% |
| 差 | ▲0.08% | ▲0.05% | ▲0.03% | ▲0.12% | ▲0.20% | ▲0.33% |

変額個人年金保険 (07) の投資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】

この商品にかかる費用の合計額は、下記の各費用の合計額となります。

〈ご契約時〉

| 項目 | 費用 | ご負担いただく時期 |
|-------|---------------------------|-----------------------------|
| 契約初期費 | 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。 |

〈積立期間中および特別勘定年金支払期間中〉

| 項目 | 費用 | ご負担いただく時期 |
|---------|---|---|
| 保険契約関係費 | 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 | 投資信託の純資産総額に対して 年率0.324%程度 (税抜:0.30%程度) ^{※1} | 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。 |

※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、信託事務の諸費用等、有価証券の売買委託手数料及び消費税等の税金等の諸費用がかかりますが、これらの諸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、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諸費用を間接的に負担することとなります。

これらの運用関係費は、特別勘定の廃止もしくは統合・運用協力会社の変更・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〉

※ 一般勘定で運用する年金とは、確定年金・保証期間付終身年金・保証期間付夫婦連生終身年金・一時金付終身年金を意味します。(年金支払特約等によりお受け取りいただく年金を含みます。)

| 項目 | 費用 | ご負担いただく時期 |
|-------|--------------------------------------|---------------------|
| 年金管理費 | 年金額に対して 1.0% ^{※2} | 年金支払日に責任準備金から控除します。 |

※2 年金管理費は、将来変更される可能性があります。