



特別勘定の月次運用レポート



2021年8月末現在

特定ファンド

特別勘定名

組入投資信託名

運用会社

特定ファンドA0806A

豪ドル参照為替トリガー付
収益分配ファンド2008-06
適格機関投資家限定

BNPパリバ・アセットマネジメント
株式会社

特定ファンドA0806Aのしくみ

豪ドル/円為替レートを指標として取り引きされる金融派生商品(デリバティブ)を内包した債券などに投資することにより、定期的な収益分配を目指しつつ、一定の条件(※)のもとに一時払保険料を確保することを目標に運用を行う特別勘定です。

※繰上償還または運用開始から4年経過後の判定日以降、最終判定日まで、為替レートがスタート為替より40円以上円高とならずに満期償還を迎えた場合

ユニットプライスと収益率の推移



【引受保険会社】

カーディフ生命保険株式会社

〒150-0031 東京都渋谷区桜丘町20-1 渋谷インフォスター

お客さま相談室: 03-6415-8275

<https://life.cardif.co.jp/>

月曜日～金曜日 9:00～18:00 (祝日・年末年始除く)

月次運用レポート

2021年8月31日現在

組入投資信託名

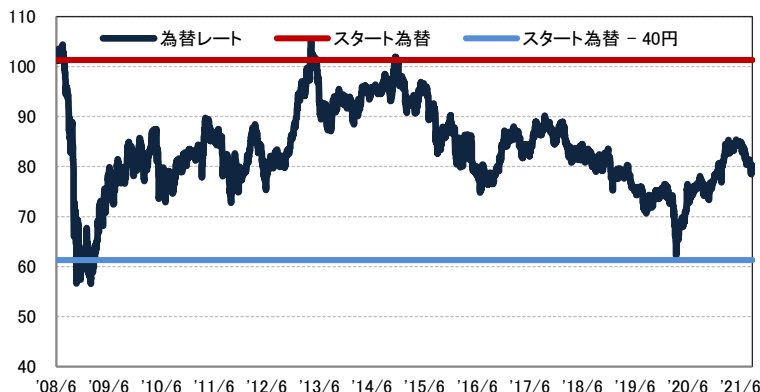
豪ドル参照為替トリガー付収益分配ファンド2008-06 適格機関投資家限定

【運用会社】 **BNPパリバ・アセットマネジメント株式会社**

【運用方針】 「BNPP債」(豪ドル/円為替レートの水準により利息および償還価格が変動する性格を有する債券)を主要投資対象とし、信託期間中の定期的な収益分配を目指しつつ、一定条件のもとに一定水準額を確保することを目標に運用を行います。

◆為替レートの推移

8/31現在: 80円18銭0厘



☆投資信託設定日は2008年6月10日です。

☆スタート為替は、2008年6月10日の為替レート*で、101円29銭0厘です。

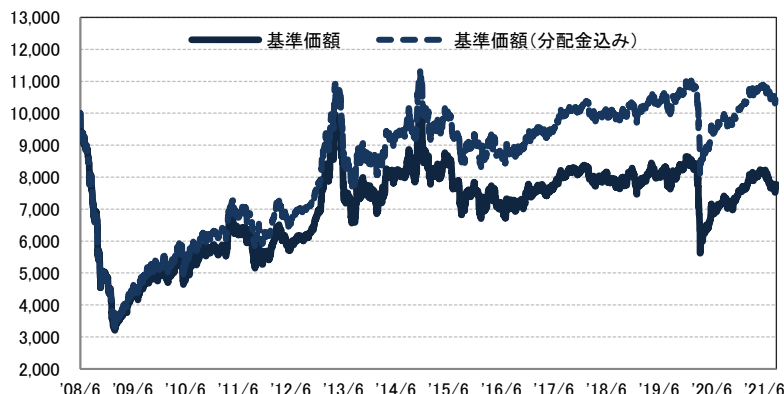
*為替レートとは日本の銀行営業日における東京時間午前10時のロイター画面JPNUに表示される豪ドル/円為替レートの仲値(売値と買値の平均値)をさします。

☆スタート為替-40円は、61円29銭0厘です。

(一定条件の観察期間は2012年6月8日から2023年6月9日までです。)

◆基準価額の推移

8/31現在: 7,772円



◆基準価額の騰落率

(%)

1か月	3か月	6か月
0.45	-3.73	-0.66
1年	3年	設定来
8.76	7.91	5.54

※分配金は金額加算ベース

※小数点以下第3位四捨五入

◆市場概況

8月の主要先進国の10年国債利回りは概ね上昇しました。米国では、7月の米雇用統計が市場予想を上回り、失業率が1年以上ぶりの低水準となったことを受け、長期金利は上昇しました。その後、ジャクソンホール会議における米連邦準備制度理事会(FRB)のパウエル議長の量的金融緩和政策の段階的縮小(テーパリング)に関する発言を受け金利は低下し、月間の上昇幅は縮小しました。欧州では、欧州中央銀行(ECB)が掲げる物価目標を大きく上回る伸びを示した消費者物価指数(CPI)を受け、ドイツ連銀総裁やオーストリア中銀総裁らが、パンデミック緊急購入プログラム(PEPP)による量的緩和措置について次回ECB理事会で討議されるべきとの見解を示したことなどを背景に、欧州主要国の長期金利は上昇しました。

8月の豪州長期金利(オーストラリア10年国債利回り)は、月間では低下しました。また、豪ドルは対円で下落しました。

◆当資料は、カーディフ生命保険株式会社(以下「当社」といいます)が「変額個人年金保険」の特別勘定グループについて運用状況等を開示するものであり、特別勘定の主な投資対象である投資信託の勧誘を目的としたものではありません。

◆「変額個人年金保険」は生命保険商品であり、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。

◆各特別勘定は、値動きのある証券に投資している投資信託を主な運用対象としていますので、運用状況によっては高い収益を期待できますが、一方で株式その他の有価証券の価格の下落や為替の変動等による価格変動リスク、為替リスク等を負うことになります。また、特別勘定および特別勘定の主な投資対象となる投資信託の内容が変更になることもあります。

◆各特別勘定のユニットプライスは、保険関係費用の控除などにより特別勘定が投資する投資信託の基準価額の値動きと必ずしも一致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。

◆月次運用レポートの「組入投資信託」にかかる部分は、BNPパリバ・アセットマネジメント株式会社によるマンスリーレポートを当社が提供するものであり、内容に関して、当社は一切の責任を負いません。

月次運用レポート

2021年8月末現在

特定ファンドA0806A「繰上償還」および「収益分配金」の判定日ならびに判定結果一覧

- ◇ 判定日の為替レートが、
 スタート為替以上の円安の場合、一時払保険料に対して 3.0%
 スタート為替未満の円高の場合、一時払保険料に対して 0.5%
 の収益分配金が実現されます。
- ◇ 運用開始から4年経過後の各判定日に為替レートがスタート為替以上の円安となった場合、特定ファンドはその運用を自動的に終了し、繰上償還となり、一時払保険料相当額を確保します。
- ◇ 運用開始から4年経過後の判定日以降、最終判定日まで、為替レートがスタート為替より40円以上円高となり満期償還となった場合、特定ファンドの積立金額はスタート為替に対するゴール為替の水準が反映されるため、年金原資は一時払保険料を下回ることがあります。

スタート為替決定日	スタート為替
2008年6月10日	101.290

	判定日	収益分配金 償還金 繰入日	判定日の 為替レート	収益分配金 (判定結果)	収益分配金 (設定来累計)
第1期	(2008年12月9日)	(2009年1月8日)	61.340	0.5%	0.5%
第2期	(2009年6月10日)	(2009年7月6日)	77.885	0.5%	1.0%
第3期	(2009年12月9日)	(2010年1月7日)	80.060	0.5%	1.5%
第4期	(2010年6月10日)	(2010年7月6日)	75.460	0.5%	2.0%
第5期	(2010年12月9日)	(2011年1月7日)	82.620	0.5%	2.5%
第6期	(2011年6月10日)	(2011年7月6日)	85.320	0.5%	3.0%
第7期	(2011年12月8日)	(2012年1月10日)	79.620	0.5%	3.5%
第8期	2012年6月8日	2012年7月5日	78.630	0.5%	4.0%
第9期	2012年12月7日	2013年1月9日	86.430	0.5%	4.5%
第10期	2013年6月10日	2013年7月4日	92.500	0.5%	5.0%
第11期	2013年12月9日	2014年1月9日	93.860	0.5%	5.5%
第12期	2014年6月10日	2014年7月4日	95.770	0.5%	6.0%
第13期	2014年12月9日	2015年1月8日	99.990	0.5%	6.5%
第14期	2015年6月10日	2015年7月6日	95.570	0.5%	7.0%
第15期	2015年12月9日	2016年1月7日	88.930	0.5%	7.5%
第16期	2016年6月10日	2016年7月6日	79.430	0.5%	8.0%
第17期	2016年12月8日	2017年1月10日	85.200	0.5%	8.5%
第18期	2017年6月9日	2017年7月6日	82.910	0.5%	9.0%
第19期	2017年12月8日	2018年1月10日	85.000	0.5%	9.5%
第20期	2018年6月8日	2018年7月5日	83.710	0.5%	10.0%
第21期	2018年12月7日	2019年1月9日	81.500	0.5%	10.5%
第22期	2019年6月10日	2019年7月4日	75.770	0.5%	11.0%
第23期	2019年12月9日	2020年1月9日	74.190	0.5%	11.5%
第24期	2020年6月10日	2020年7月6日	74.820	0.5%	12.0%
第25期	2020年12月9日	2021年1月7日	77.230	0.5%	12.5%
第26期	2021年6月10日	2021年7月6日	84.660	0.5%	13.0%
第27期	2021年12月9日	2022年1月7日			
第28期	2022年6月10日	2022年7月6日			
第29期	2022年12月8日	2023年1月10日			
第30期	2023年6月9日	2023年7月6日			

注1: ()は「収益分配金」のみの判定日/繰入日です。また、特定ファンド設定日時点の予定のため、法令の変更などにより銀行休業日に変更された場合には変更となる場合があります。

注2: 収益分配金欄には一時払保険料に対する百分率の数値を掲載しておりますが、特定ファンドの積立金を一部解約した場合には、一部解約した金額に応じて減額されます。