

## グッドニュースⅢ

# 2016年度（平成28年度）特別勘定の現況

### ●投資環境(2016年度)

#### 日本株式市場

日経平均株価は、期初16,758円で始まりました。4～6月は、円高進行による企業業績の悪化懸念から軟調に推移し、6月の英・国民投票でEU離脱派が勝利すると、同株価は一時14,952円まで下落しました。その後は、円高の一服や堅調な海外株式市場を背景に、同株価はやや持ち直しました。11月の米大統領選挙でトランプ氏が勝利すると、積極的な財政政策への期待からグローバルにリスク選好的な姿勢が強まり、外国為替市場で円安ドル高が進行したことに支えられ、同株価は19,000円台まで上昇しました。1～3月では、同株価は高値圏で概ね横ばい推移となりました。期末の日経平均株価は18,909円でした。

#### 外国株式市場

米国のS&P500は、期初2,059で始まりました。6月の英・国民投票でEU離脱派が勝利すると、同株価は一時2,000まで下落しました。但し、底堅い企業業績に支えられ株価の戻りも早く、7～10月は概ね2,100～2,200のレンジで推移しました。11～3月は、米・大統領選でトランプ氏が勝利し、経済政策への期待が高まったことから、同株価は3月に2,395まで上昇、期末のS&P500は2,362でした。

また、英国のFTSE100は、期初6,174で始まりました。6月までは概ね横ばいで推移しましたが、英・国民投票でEU離脱派が勝利し、ポンド安が進行したことを好感し、株価は上昇しました。11月以降はグローバルにリスク選好的な動きとなったことにも支えられ、株価は3月には7,429まで上昇、期末のFTSE100は7,322でした。

#### 日本債券市場

10年国債利回りは、期初-0.03%で始まりました。4～7月は良好な需給環境に加え、日銀の追加緩和期待から同利回りは7月に-0.29%まで低下しました。同月、日銀は国債買入れ増額やマイナス金利深掘りを見送ったため、8月に同利回りは-0.04%まで上昇しました。9月に日銀が長短金利操作付き量的・質的金融緩和政策を導入し、10年国債利回りをゼロ%程度に誘導する方針を示したため、同利回りは10月まで概ね-0.05%程度で概ね横ばい推移となりました。11月の米・大統領選でトランプ氏が勝利して以降、米長期金利が大幅に上昇したことや、日銀の国債買入れオペを巡る不透明感から、同利回りは2月に0.12%まで上昇しました。但し、日銀は指値オペにより更なる金利上昇を容認しない姿勢を示したため、同利回りは低下に転じ、期末の10年国債利回りは0.07%でした。

#### 外国債券市場

米10年国債利回りは、期初1.77%で始まりました。英・国民投票でのEU離脱派の勝利をうけて、同利回りは7月上旬に1.36%まで低下しました。11月に米・大統領選でトランプ氏が勝利すると、積極的な財政政策への期待が高まり、米国経済の加速や米FRBの利上げペースの早まりが意識され、同利回りは3月に2.63%まで上昇しました。その後は、トランプ大統領の政策への不透明感から同利回りはやや低下し、期末の米10年国債利回りは2.41%でした。

また、ドイツ10年国債利回りは、期初0.15%で始まりました。ECBの金融緩和が長期化するなか、英・国民投票でEU離脱派が勝利すると、同利回りは-0.19%まで低下しました。10～12月は、欧州経済の回復や、米大統領選後のグローバルな金利上昇をうけ、同利回りは12月に0.40%まで上昇しました。1～3月は、仏大統領選を巡る不透明感や、ECBの金融緩和姿勢を巡る思惑から、金利は上下する局面もありましたが、期末のドイツ10年国債利回りは、0.33%でした。

#### 外国為替市場

ドル円相場は、期初1米ドル＝112.50円で始まりました。4月の日銀の追加緩和見送りや6月の英・国民投票でのEU離脱派の勝利をうけ、8月には1米ドル＝100円程度まで円高ドル安が進みました。11月の米・大統領選でトランプ氏が勝利すると、12月には118円程度まで円安ドル高が進みました。但し、1～3月は、トランプ大統領の政策への不透明感からやや円高ドル安傾向となり、期末は1米ドル＝111.89円でした。

また、ユーロ円相場は、期初1ユーロ＝128.04円で始まりました。英・国民投票でEU離脱派が勝利すると、欧州の政治・経済への懸念から7月には111円程度まで円高ユーロ安が進みました。11月以降は、米・大統領選でトランプ氏が勝利したことをうけてリスク選好的な動きとなり、12月には123円程度まで円安ユーロ高が進行しました。1月以降は、欧州政治リスクへの懸念からやや円高・ユーロ安傾向となり、期末は1ユーロ＝119.47円でした。

### ●運用実績の推移および運用方針

- ①当期の運用実績の推移 各特別勘定の運用状況をご参照ください。
- ②当期の運用方針 当社は、各特別勘定の運用方針に従い、特別勘定の運用を実施しました。
- ③今後の運用方針 当社は、今後とも、各特別勘定の運用方針に従い、特別勘定の運用を行う方針です。

当社は2016年度決算(決算日：2017年3月31日)を行いました。当資料は2016年度の運用状況をご報告するものです。

3ページ以降は特別勘定レポート(2017年4月発行(2017年3月末現在))からの抜粋となります。最新の運用状況は当社ホームページにてご確認いただけます。

## ●特別勘定資産の内訳(2016年度末)

(単位：百万円)

区分	金額		
	GTバランス 20	GTバランス 40	GTバランス 60
現預金・コールローン	0	85	248
有価証券	8	2,137	4,817
公社債	-	-	-
株式	-	-	-
外国証券	-	-	-
公社債	-	-	-
株式等	-	-	-
その他の証券	8	2,137	4,817
貸付金	-	-	-
その他	0	20	0
貸倒引当金	-	-	-
合計	8	2,243	5,066

※単位未満切捨て

## ●特別勘定の運用収支状況(2016年度)

(単位：百万円)

区分	金額		
	GTバランス 20	GTバランス 40	GTバランス 60
利息配当金等収入	0	361	26
有価証券売却益	-	-	-
有価証券償還益	-	-	-
有価証券評価益	0	44	23
為替差益	-	-	-
金融派生商品収益	-	-	-
その他の収益	-	-	-
有価証券売却損	-	2	1
有価証券償還損	-	-	-
有価証券評価損	0	82	-
為替差損	-	-	-
金融派生商品費用	-	-	-
その他の費用及び損失	-	-	-
収支差額	0	321	49

※単位未満切捨て

## ●有価証券の売買状況(2016年度)

(単位：千口、千円)

特別勘定の名称	銘柄	買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
GTバランス20	GTインデックス20VA (適格機関投資家限定)	-	-	133	172
GTバランス40	GTインデックス40VA (適格機関投資家限定)	2,797,256	3,670,000	7,311,670	9,264,873
GTバランス60	GTインデックス60VA (適格機関投資家限定)	6,835,437	8,462,400	3,144,465	3,866,187

※単位未満切捨て

## ●保有契約高(2016年度末)

(単位：件、百万円)

項目	件数	金額
変額個人年金保険GF(IV型)〈年金原資保証特約(IV型)付加〉グッドニュースⅢ	1,292	6,987

※単位未満切捨て

## 特別勘定の内容

特別勘定の名称	GTバランス20	GTバランス40	GTバランス60
特別勘定の運用方針	主な投資対象となる投資信託を通じ、実質的にデリバティブ取引等を活用して国内外の株式および債券等の値動きに連動する運用を行い、中長期的な財産の成長を目指します。		
	基本資産配分は国内株式5%、外国株式(為替ヘッジあり)15%、国内債券(短期金融資産を含む)50%、外国債券(為替ヘッジあり)15%、外国債券(為替ヘッジなし)15%です。	基本資産配分は国内株式10%、外国株式(為替ヘッジあり)20%、外国株式(為替ヘッジなし)10%、国内債券(短期金融資産を含む)35%、外国債券(為替ヘッジなし)25%です。	基本資産配分は国内株式15%、外国株式(為替ヘッジあり)25%、外国株式(為替ヘッジなし)20%、国内債券(短期金融資産を含む)25%、外国債券(為替ヘッジなし)15%です。
主な投資対象となる投資信託と運用会社			
	GTインデックス20VA* <sup>1</sup>	GTインデックス40VA* <sup>1</sup>	GTインデックス60VA* <sup>1</sup>
	東京海上アセットマネジメント		
上記投資信託の投資対象となる外国投資法人	グローバル・トラッカー・ポートフォリオ* <sup>1*2</sup>		
上記外国投資法人の投資管理会社およびデリバティブ取引等の相手先	シェア・クラス I (グローバル・トラッカー20)	シェア・クラス I (グローバル・トラッカー40)	シェア・クラス I (グローバル・トラッカー60)
	ゴールドマン・サックス・インターナショナル		
設定日	2009年10月14日	2013年3月29日	2013年11月29日
移転条件* <sup>3</sup>	積立金額が基本保険金額の110%未満	積立金額が基本保険金額の110%以上120%未満	積立金額が基本保険金額の120%以上
資産運用関係費用	年率0.192104%(税込)程度* <sup>4</sup>		

\*1 適格機関投資家限定

\*2 グローバル・トラッカー・ポートフォリオは、ルクセンブルク籍の外国投資法人(専門投資信託)であるスペシャライズド・インベストメンツSIF内のポートフォリオで、上記の基本資産配分に応じた3つのシェア・クラス(グローバル・トラッカー20、同40、同60)を発行します。このポートフォリオには投資顧問会社は指名されておりません。なお、規定された投資方針に基づいた資産投資事務の遂行を投資管理会社が委託されて行います。

\*3 移転条件とは基本保険金額に対する積立金額の所定の割合により3つの特別勘定間で積立金を自動的に移転する条件をいいます。

\*4 資産運用関係費用は、「GTインデックス20VA」の信託報酬率 0.112104%(税抜0.1038%)と「グローバル・トラッカー・ポートフォリオ」の信託報酬率0.08%の合計を記載しています。

GTインデックス40VA、GTインデックス60VAの信託報酬率は、GTインデックス20VAと同率です。

信託報酬の他、信託事務の諸費用、有価証券の売買委託手数料および税金等がかかりますが、費用の発生前に金額や計算方法を確定することが困難なため表示することができません。またこれらの費用は投資信託(外国投資法人を含む)の純資産総額より差し引かれます。したがって、ご契約者さまはこれらの費用を間接的に負担することになります。なお、資産運用関係費用は、運用手法の変更等により将来変更される可能性があります。

・変額個人年金保険GF(IV型)〈年金原資保証特約(IV型) 付加〉は特別勘定で運用を行う商品です。特別勘定は投資信託を主な投資対象としていますが、当商品は投資信託とは異なる商品です。また、当資料に掲載されている投資信託の開示情報はあくまでも参考情報であり、ご契約者が直接投資信託を保有するものではありません。

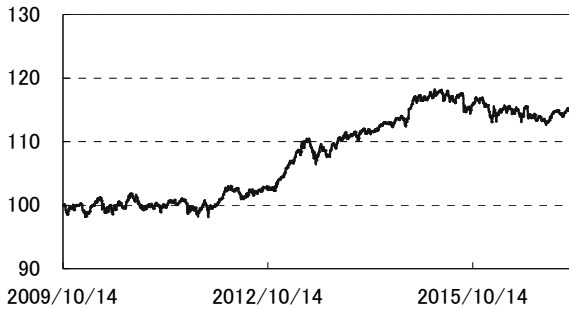
・当資料は、生命保険契約の募集および当該投資信託の勧誘を目的としたものではありません。

・特別勘定が用いる投資信託の値動きは、特別勘定のユニットプライスの値動きとは異なります。ユニットプライス算出のためには、組入ファンドの損益に、保険契約の異動等に備えたキャッシュ・ポジション部分の損益、保険関係費用等を加味する必要があります。

・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。

GTバランス20

●ユニットプライスの推移



●ユニットプライスの期間収益率 ※1

	ユニットプライス	前月比
2016年4月30日	115.21	-0.41%
2016年5月31日	115.11	-0.08%
2016年6月30日	113.73	-1.20%
2016年7月31日	115.48	1.54%
2016年8月31日	114.05	-1.24%
2016年9月30日	114.03	-0.02%
2016年10月31日	113.18	-0.74%
2016年11月30日	113.76	0.51%
2016年12月31日	114.73	0.86%
2017年1月31日	114.45	-0.25%
2017年2月28日	115.04	0.52%
2017年3月31日	114.69	-0.31%

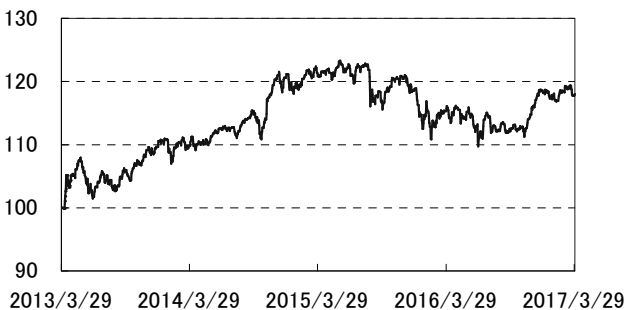
●特別勘定 純資産総額の内訳 ※2

	金額(百万円)	構成比
投資信託	8	96.0%
現預金その他	0	4.0%
純資産総額	8	100.0%

1か月	3か月	6か月	1年	設定来
-0.31%	-0.04%	0.58%	-0.85%	14.70%

GTバランス40

●ユニットプライスの推移



●ユニットプライスの期間収益率 ※1

	ユニットプライス	前月比
2016年4月30日	115.85	-0.20%
2016年5月31日	115.18	-0.58%
2016年6月30日	111.00	-3.63%
2016年7月31日	114.48	3.13%
2016年8月31日	112.85	-1.42%
2016年9月30日	112.58	-0.24%
2016年10月31日	112.61	0.03%
2016年11月30日	115.51	2.57%
2016年12月31日	118.23	2.36%
2017年1月31日	118.07	-0.14%
2017年2月28日	118.39	0.27%
2017年3月31日	118.03	-0.30%

●特別勘定 純資産総額の内訳 ※2

	金額(百万円)	構成比
投資信託	2,137	95.3%
現預金その他	105	4.7%
純資産総額	2,243	100.0%

1か月	3か月	6か月	1年	設定来
-0.30%	-0.17%	4.84%	1.68%	18.04%

GTバランス60

●ユニットプライスの推移



●ユニットプライスの期間収益率 ※1

	ユニットプライス	前月比
2016年4月30日	107.39	0.28%
2016年5月31日	106.53	-0.79%
2016年6月30日	101.55	-4.68%
2016年7月31日	105.93	4.32%
2016年8月31日	104.59	-1.27%
2016年9月30日	104.36	-0.22%
2016年10月31日	104.78	0.40%
2016年11月30日	108.51	3.57%
2016年12月31日	111.91	3.13%
2017年1月31日	112.20	0.26%
2017年2月28日	112.65	0.40%
2017年3月31日	112.45	-0.18%

●特別勘定 純資産総額の内訳 ※2

	金額(百万円)	構成比
投資信託	4,817	95.1%
現預金その他	248	4.9%
純資産総額	5,066	100.0%

1か月	3か月	6か月	1年	設定来
-0.18%	0.48%	7.75%	5.01%	12.45%

※1 ユニットプライスは小数点第3位以下を切り捨てて表示しています。前月比および期間収益率は、小数点第3位を四捨五入しています。  
 ユニットプライス(単位価格)とは、各特別勘定資産の積立金の1ユニット(単位)に対する価格のことをいい、特別勘定資産の評価を反映しています。  
 ※2 金額は単位未満を切り捨て、構成比は小数点第2位を四捨五入して、表示しています。

・変額個人年金保険GF(IV型×年金原資保証特約(IV型)付加)は特別勘定で運用を行う商品です。特別勘定は投資信託を主な投資対象としていますが、当商品は投資信託とは異なる商品です。また、当資料に掲載されている投資信託の開示情報はあくまでも参考情報であり、ご契約者が直接投資信託を保有するものではありません。  
 ・当資料は、生命保険契約の募集および当該投資信託の勧誘を目的としたものではありません。  
 ・特別勘定が用いる投資信託の値動きは、特別勘定のユニットプライスの値動きとは異なります。ユニットプライス算出のためには、組入ファンドの損益に、保険契約の異動等に備えたキャッシュ・ポジション部分の損益、保険関係費用等を加味する必要があります。  
 ・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。

## 【組入投資信託の運用概況】

2017年3月31日現在

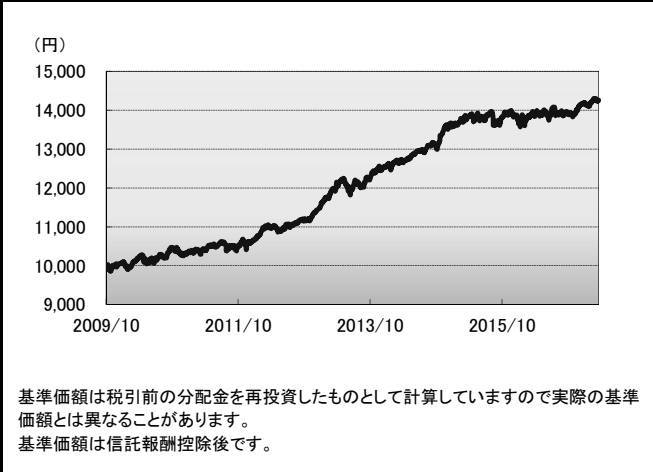
### GTインデックス20VA<適格機関投資家限定>

運用レポート(2017年3月31日現在)

#### 【ファンドの特色】

国内外の株式先物・債券先物指数などに連動する投資成果を目標として運用を行う外国投資法人「スペシャライズド・インベストメンツS1F」のサブ・ファンドである「グローバル・トラッカー・ポートフォリオ」の投資証券「シェアクラス1(グローバル・トラッカー20)」への投資を通じて、信託財産の中長期的な成長を目指します。

#### 基準価額の推移(税引前分配金再投資)



#### 騰落率(税引前分配金再投資)

	1か月 (2017/2/28)	3か月 (2016/12/30)	6か月 (2016/9/30)	1年 (2016/3/31)	設定来 (2009/10/14)
当ファンド	-0.08%	+0.68%	+2.08%	+2.04%	+42.55%

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

#### 基準価額・純資産総額

基準価額	14,255円
純資産総額	8百万円
設定日	2009年10月14日
決算日	原則5月18日 (休業日の場合は翌営業日)
信託期間	無期限

#### ポートフォリオ構成

名称	組入比率(%)
グローバル・トラッカー20	99.7
短期金融資産など	0.3
合計	100.0

※ 短期金融資産などは、組入有価証券以外のものです。

※ 組入比率は、純資産総額に占める割合です。

※ 計理処理の仕組み上、直近の追加・解約分が反映されないことなどにより、「短期金融資産など」の比率が大きくプラスになる場合またはマイナスになる場合があります。

#### 分配金情報(税引前)

※分配金は1万口当たり

基準日現在、分配実績はありません。

※ 分配金額は、収益配分方針に基づいて委託会社が決定します。

分配対象額が少額の場合などには、分配を行わない場合があります。

### 《GTインデックス20VA<適格機関投資家限定>の主要投資対象》

#### ◆グローバル・トラッカー20

ファンドの特色・・・スワップ取引およびレポ取引を通じて、日本を含む世界主要国の国債および株式に対する分散されたエクスポージャーから投資収益を獲得することを投資目的とします。(当投資証券のベンチマークは「グローバル・トラッカー・ポートフォリオのベンチマークについて」に記載)

#### 基準価額の推移



#### 純資産総額

8百万円

#### 騰落率(税引前分配金再投資)

	1か月 (2017/2/28)	3か月 (2016/12/30)	6か月 (2016/9/30)	1年 (2016/3/31)	設定来 (2009/10/14)
グローバル・トラッカー20	-0.07%	+0.71%	+2.15%	+2.15%	+43.65%

■当資料は、東京海上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付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。■当資料は、東京海上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。■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。

設定・運用：東京海上アセットマネジメント

URL <http://www.tokiomarineam.co.jp/>

■この特別勘定レポートは、東京海上日動あんしん生命保険株式会社の変額個人年金保険の特別勘定の過去の運用状況等を開示するものであり、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。■特別勘定が投資する投資信託の運用状況は、当該投資信託の運用会社からの運用報告を東京海上日動あんしん生命保険株式会社より提供するものであり、東京海上日動あんしん生命保険株式会社はその正確性、完全性を一切保証しません。■巻末に「ご負担いただく費用について」「投資リスクについて」等を記載しておりますので、ご参照ください。

## 【組入投資信託の運用概況】

2017年3月31日現在

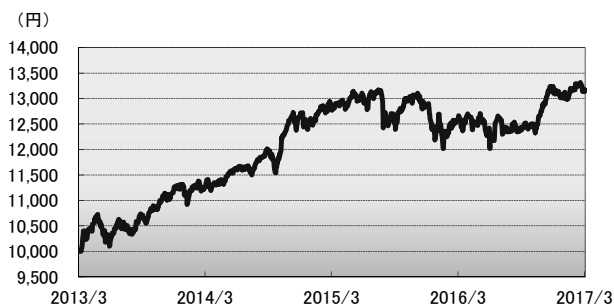
### GTインデックス40VA<適格機関投資家限定>

運用レポート(2017年3月31日現在)

#### 【ファンドの特色】

国内外の株式先物・債券先物指数などに連動する投資成果を目標として運用を行う外国投資法人「スペシャライズド・インベストメンツ I F」のサブ・ファンドである「グローバル・トラッカー・ポートフォリオ」の投資証券「シェアクラスI(グローバル・トラッカー40)」への投資を通じて、信託財産の中長期的な成長を目指します。

#### 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は異なることがあります。  
 基準価額は特別勘定の設定日(2013年3月29日)から表示しています。  
 基準価額は信託報酬控除後です。

#### 騰落率(税引前分配金再投資)

	1か月 (2017/2/28)	3か月 (2016/12/30)	6か月 (2016/9/30)	1年 (2016/3/31)	設定来 (2013/3/29)
当ファンド	-0.07%	+0.50%	+5.88%	+4.03%	+31.71%

※ 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ことがあります。  
 ※ 設定来は、特別勘定の設定日(2013年3月29日)を基準に計算しております。

#### 基準価額・純資産総額

基準価額	13,171円
純資産総額	2,139百万円
設定日	2009年10月14日
決算日	原則5月18日 (休業日の場合は翌営業日)
信託期間	無期限

#### ポートフォリオ構成

名称	組入比率(%)
グローバル・トラッカー40	99.4
短期金融資産など	0.6
合計	100.0

※ 短期金融資産などは、組入有価証券以外のものです。  
 ※ 組入比率は、純資産総額に占める割合です。  
 ※ 計理処理の仕組み上、直近の追加・解約分が反映されないことなどにより、「短期金融資産など」の比率が大きくプラスになる場合またはマイナスになる場合があります。

#### 分配金情報(税引前)

※分配金は1万口当たり

基準日現在、分配実績はありません。

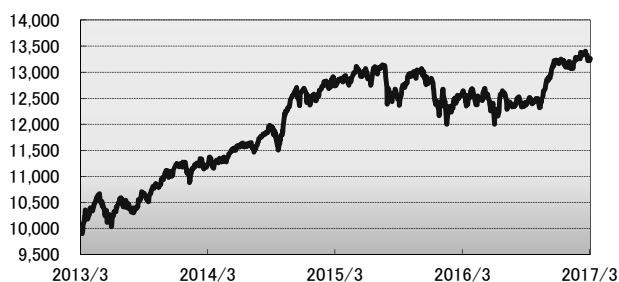
※ 分配金額は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。  
 分配対象額が少額の場合などには、分配を行わない場合があります。

### 《GTインデックス40VA<適格機関投資家限定>の主要投資対象》

#### ◆グローバル・トラッカー40

ファンドの特色・・・スワップ取引およびレポ取引を通じて、日本を含む世界主要国の国債および株式に対する分散されたエクスポージャーから投資収益を獲得することを投資目的とします。(当投資証券のベンチマークは「グローバル・トラッカー・ポートフォリオのベンチマークについて」に記載)

#### 基準価額の推移



基準価額は特別勘定の設定日(2013年3月29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。

#### 純資産総額

2,136百万円

#### 騰落率(税引前分配金再投資)

	1か月 (2017/2/28)	3か月 (2016/12/30)	6か月 (2016/9/30)	1年 (2016/3/31)	設定来 (2013/3/29)
グローバル・トラッカー40	-0.06%	+0.55%	+6.68%	+4.87%	+32.60%

※設定来は、特別勘定の設定日(2013年3月29日)を基準に計算しております。

■当資料は、東京海上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付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。■当資料は、東京海上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。■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。

設定・運用: 東京海上アセットマネジメント

URL <http://www.tokiomarineam.co.jp/>

■この特別勘定レポートは、東京海上日動あんしん生命保険株式会社の変額個人年金保険の特別勘定の過去の運用状況等を開示するものであり、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。■特別勘定が投資する投資信託の運用状況は、当該投資信託の運用会社からの運用報告を東京海上日動あんしん生命保険株式会社より提供するものであり、東京海上日動あんしん生命保険株式会社はその正確性、完全性を一切保証しません。■巻末に「ご負担いただく費用について」「投資リスクについて」等を記載しておりますので、ご参照ください。

## 【組入投資信託の運用概況】

2017年3月31日現在

### GTインデックス60VA<適格機関投資家限定>

運用レポート(2017年3月31日現在)

#### 【ファンドの特色】

国内外の株式先物・債券先物指数などに連動する投資成果を目標として運用を行う外国投資法人「スペシャライズド・インベストメンツ I F」のサブ・ファンドである「グローバル・トラッカー・ポートフォリオ」の投資証券「シェアクラスI(グローバル・トラッカー60)」への投資を通じて、信託財産の中長期的な成長を目指します。

#### 基準価額の推移(税引前分配金再投資)



#### 騰落率(税引前分配金再投資)

	1か月 (2017/2/28)	3か月 (2016/12/30)	6か月 (2016/9/30)	1年 (2016/3/31)	設定来 (2013/11/29)
当ファンド	+0.08%	+1.20%	+9.64%	+8.39%	+24.72%

※ 騰落率は税引前の分配金を再投資したもとして算出していますので実際の投資家利回りとは異なる場合があります。  
※ 設定来は、特別勘定の設定日(2013年11月29日)を基準に計算しております。

#### 基準価額・純資産総額

基準価額	12,471円
純資産総額	4,819百万円
設定日	2009年10月14日
決算日	原則5月18日 (休業日の場合は翌営業日)
信託期間	無期限

#### ポートフォリオ構成

名称	組入比率(%)
グローバル・トラッカー60	99.9
短期金融資産など	0.1
合計	100.0

※ 短期金融資産などは、組入有価証券以外のものです。  
※ 組入比率は、純資産総額に占める割合です。  
※ 計理処理の仕組み上、直近の追加・解約分が反映されないことなどにより、「短期金融資産など」の比率が大きくプラスになる場合またはマイナスに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

基準日現在、分配実績はありません。
-------------------

※ 分配金額は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。  
分配対象額が少額の場合などには、分配を行わない場合があります。

### 《GTインデックス60VA<適格機関投資家限定>の主要投資対象》

#### ◆グローバル・トラッカー60

ファンドの特色・・・スワップ取引およびレポ取引を通じて、日本を含む世界主要国の国債および株式に対する分散されたエクスポージャーから投資収益を獲得することを投資目的とします。(当投資証券のベンチマークは「グローバル・トラッカー・ポートフォリオのベンチマークについて」に記載)

#### 基準価額の推移



#### 純資産総額

4,816百万円
----------

#### 騰落率(税引前分配金再投資)

	1か月 (2017/2/28)	3か月 (2016/12/30)	6か月 (2016/9/30)	1年 (2016/3/31)	設定来 (2013/11/29)
グローバル・トラッカー60	+0.09%	+1.23%	+9.72%	+8.54%	+26.02%

※設定来は、特別勘定の設定日(2013年11月29日)を基準に計算しております。

■当資料は、東京海上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付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。■当資料は、東京海上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。■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。

設定・運用: 東京海上アセットマネジメント

URL <http://www.tokiomarineam.co.jp/>

■この特別勘定レポートは、東京海上日動あんしん生命保険株式会社の変額個人年金保険の特別勘定の過去の運用状況等を開示するものであり、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。■特別勘定が投資する投資信託の運用状況は、当該投資信託の運用会社からの運用報告を東京海上日動あんしん生命保険株式会社より提供するものであり、東京海上日動あんしん生命保険株式会社はその正確性、完全性を一切保証しません。■巻末に「ご負担いただく費用について」「投資リスクについて」等を記載しておりますので、ご参照ください。

## 【グローバル・トラッカー・ポートフォリオのベンチマークについて】

2017年3月31日現在

以下、「スペシャライズド・インベストメンツ I F」を「本投資法人」、「グローバル・トラッカー・ポートフォリオ」を「本ポートフォリオ」、「グローバル・トラッカー・ポートフォリオの投資証券」を「本投資証券」、「本投資証券への投資家」を「投資主」、「構成インデックスおよび構成サブ・インデックス」を「先物指数」ということがあります。

◇グローバル・トラッカー・ポートフォリオのベンチマークは、以下の各インデックスを各比率で合成した複合指数をベンチマークとします。

資産区分	構成インデックス		グローバル・トラッカー20 構成比率	グローバル・トラッカー40 構成比率	グローバル・トラッカー60 構成比率
	構成サブ・インデックス				
日本株式	日本株式先物ロール戦略インデックス		5%	10%	15%
外国株式 (ヘッジあり)	米国株式先物ロール戦略インデックス		15%	20%	25%
	欧州株式先物ロール戦略インデックス				
外国株式 (ヘッジなし)	米国株式先物ロール戦略インデックス		-	10%	20%
	欧州株式先物ロール戦略インデックス				
日本債券	日本国債先物ロール戦略インデックス		50%	35%	25%
外国債券 (ヘッジあり)	グローバル国債先物バスケット インデックス	米国国債先物ロール戦略 インデックス	15%	-	-
		欧州国債先物ロール戦略 インデックス			
		英国国債先物ロール戦略 インデックス			
外国債券 (ヘッジなし)	グローバル国債先物バスケット インデックス	米国国債先物ロール戦略 インデックス	15%	25%	15%
		欧州国債先物ロール戦略 インデックス			
		英国国債先物ロール戦略 インデックス			

構成インデックスまたは構成サブ・インデックス(併せて「先物指数」)が参照する先物取引が対象とする原資産

- 日本株式: 日本株式先物ロール戦略インデックス[東証株価指数 (TOPIX®)]
- 外国株式: 米国株式先物ロール戦略インデックス[S&P 500® Index]、欧州株式先物ロール戦略インデックス[EURO STOXX 50® Index]
- 日本債券: 日本国債先物ロール戦略インデックス[10年物日本国債]
- 外国債券: グローバル国債先物バスケットインデックス: 構成サブ・インデックス
  - 米国国債先物ロール戦略インデックス[10年物米国財務省証券]
  - 欧州国債先物ロール戦略インデックス[ドイツ国債]
  - 英国国債先物ロール戦略インデックス[英国国債]

※各先物指数(グローバル国債先物バスケットインデックスを除く)は、上記 [ ]内に記載された 原資産を対象とする先物取引の直近限月のトータル・リターン(金利付収益)に連動するように開発された指数です。先物指数が参照するのは関連する先物取引の価格であるため、先物指数の値動きは先物取引が対象とする原資産である株価指数または国債の値動きに必ずしも連動するものではありません。また、これらの先物指数が参照する先物取引には四半期毎に満期が到来するため、直近限月の先物取引は一定のルールに基づいて第2限月の先物取引へ乗り替えられます(「ロール」)。このロールに伴って損益が発生する場合があること、またロールに伴う損益、金利その他の要因によって先物指数の値動きが関連する先物取引の値動きと連動しない場合があります。

※外国株式および外国債券資産の一部については、上記の指数バスケットに対して実質的にスワップ取引において為替ヘッジを行います。為替ヘッジは部分的に行われ、為替ヘッジの対象となる構成インデックスおよび構成サブ・インデックスの加重評価額、日本円マネー・マーケット資産と外貨マネー・マーケット資産のパフォーマンスの差額を用いて計算されます。なお為替ヘッジは構成インデックスまたは構成サブ・インデックスの価額の計算後に適用され、当該価額自体には反映されません。

### <免責条項>

各構成インデックス(グローバル国債先物バスケットインデックスおよびその構成サブ・インデックスを含みます。本段落について以下同じ。)は、ゴールドマン・サックス・インターナショナル(以下「GSI」といいます)に帰属しますが、計算については、欧州株式先物ロール戦略インデックスの場合はストックス・リミテッド(以下「ストックス社」といいます)、その他のインデックスの場合はスタンダード・アンド・プアーズ(以下「S&P」といいます)に委託されています。ストックス社、S&Pおよびその関連会社は、当該指数の計算に関しての過失に対し責任を負うものではありません。GSIおよびその関連会社は、各インデックスの計算に関し、第三者である計算代理人によるエラー、不作為、遅延に関して一切の責任を負いません。このインデックスを直接間接を問わず参照する商品に関し、GSIおよびその関連会社は、当該商品への投資家に対して投資助言を行うものではなく、当該商品の運用成果に関し一切責任を負いません。また、東証株価指数(TOPIX®)、S&P 500® IndexおよびEURO STOXX 50® Indexは、各々東京証券取引所、S&Pおよびストックス社が算出・公表する株価指数であり、知的財産権は各社に帰属します。これらの株価指数に関し、各公表機関の許諾無しに各株価指数の全部または一部を複製、頒布、使用すること等は禁止されています。各公表機関は各株価指数の確実性および完全性を保証するものではありません。各公表機関はこの商品の運用成果に関し一切責任はありません。先物指数への投資のリスクおよび免責条項の詳細については、「特別勘定のしおり」を必ずご覧ください。

■当資料は、東京海上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付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。■当資料は、東京海上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。■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。

設定・運用: 東京海上アセットマネジメント

URL <http://www.tokiomarineam.co.jp/>

■この特別勘定レポートは、東京海上日動あんしん生命保険株式会社の変額個人年金保険の特別勘定の過去の運用状況等を開示するものであり、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。■特別勘定が投資する投資信託の運用状況は、当該投資信託の運用会社からの運用報告を東京海上日動あんしん生命保険株式会社より提供するものであり、東京海上日動あんしん生命保険株式会社はその正確性、完全性を一切保証しません。■巻末に「ご負担いただく費用について」「投資リスクについて」等を記載しておりますので、ご参照ください。







## ご負担いただく費用について

この商品にかかる費用は、運用期間中の下記「保険関係費用(保険契約管理費)」、「資産運用関係費用(資産運用管理費)」および年金支払期間中の下記「保険関係費用(年金管理費)」を合計した金額となります。また、運用成果を確保した場合は「運用成果確保時費用」が、運用成果を確保する前に解約・積立金の一部引出をした場合は「解約控除」が、経過年数に応じて別途かかります。

	項目	内容	費用	備考(適用時期等)
運用期間中	保険関係費用 (保険契約管理費)	新契約成立および維持管理等に必要な費用(基本保険金額を最低保証するための費用等を含みます)	年率 <b>2.78%</b>	特別勘定の純資産総額に対して左記の年率/365日を乗じた額を毎日控除します。
	資産運用関係費用*1 (資産運用管理費)	保険関係費用(保険契約管理費)以外で、特別勘定の運用にかかる費用(信託報酬率を記載しています)	年率 <b>0.192104%</b> (税込)程度	特別勘定の投資対象となる投資信託等の純資産総額に対して左記の年率/365日を乗じた額を毎日控除します。
運用成果確保時	運用成果確保時費用	契約日から1年以上6年未満に据置期間付確定年金へ移行した場合にかかる費用	<b>5.0%~1.0%</b>	契約日からの経過年数に応じ、基本保険金額に左記の率を乗じた額を積立金額から控除します。
解約・積立金の一部引出時	解約控除	契約日から6年未満に解約もしくは積立金の一部引出をした場合*2にかかる費用	<b>6.0%~1.0%</b>	契約日からの経過年数に応じ、基本保険金額*3に左記の率を乗じた額を積立金額(積立金の一部引出の場合は一部引出額)から控除します。
年金支払期間中	保険関係費用 (年金管理費)	契約の維持管理等に必要な費用	<b>1.0%以内</b>	年金支払開始日以降、年金年額に左記の率を乗じた額を毎年の年金支払日に責任準備金から控除します。

- \*1 資産運用関係費用は、投資信託(外国投資法人を含む)の信託報酬率の合計を記載しています。信託報酬の他、信託事務の諸費用、有価証券の売買委託手数料および税金等がかかりますが、費用の発生前に金額や計算方法を確定することが困難なため表示することができません。またこれらの費用は投資信託(外国投資法人を含む)の純資産総額より差し引かれます。したがって、ご契約者さまはこれらの費用を間接的に負担することになります。なお、資産運用関係費用は、運用手法の変更等により将来変更される可能性があります。
- \*2 据置期間付確定年金へ移行した後の積立金の全額引出・一部引出には解約控除は適用されません。
- \*3 積立金の一部引出の場合は、一部引出により減額される基本保険金額となります。

## 投資リスクについて

この商品は、将来受け取る年金額、解約払戻金額、死亡保険金額等が特別勘定の運用実績に基づいて増減するしくみの生命保険(変額個人年金保険)です。特別勘定は実質的にデリバティブ取引等を活用して国内外の株式・債券等の値動きに連動することを旨とする投資信託に投資されますので、ご契約者は収益を期待できる一方、株価や債券価格等の下落・金利や為替の変動等の投資リスクも負うこととなります。そのため、運用実績およびご負担いただく費用により、解約払戻金等のお受け取りになる金額の合計額が、一時払保険料の額を下回り、損失が生じるおそれがあります。また、積立金の自動移転が生じた場合には、特別勘定の種類によっては投資リスクが異なることとなりますのでご注意ください。

## ご注意いただきたい事項

- 変額個人年金保険GF(IV型)<年金原資保証特約(IV型)付加>は東京海上日動あんしん生命保険株式会社を引受保険会社とする生命保険です。預金とは異なり、元本保証はありません。また、預金保険制度の対象ではありません。
- 変額個人年金保険GF(IV型)<年金原資保証特約(IV型)付加>は運用期間満了時点で積立金額が基本保険金額(一時払保険料相当額)を下回った場合には、基本保険金額(一時払保険料相当額)の100%が年金原資として最低保証されます。ただし、年金原資が保証されるためには、運用期間(契約日から10年間)満了まで運用いただくことが必要です。運用期間中に解約・積立金の一部引出をした場合の解約払戻金額には最低保証はありません。


商品の内容に関しては「ご契約のしおり・約款」、「特別勘定のしおり」等をご覧ください。

【募集代理店】

【引受保険会社】

東京海上日動あんしん生命保険株式会社  
ホームページ <http://www.tmn-anshin.co.jp>

ご契約内容・各種手続きに関するお問合せ

 **0120-155-730**

受付時間 月~金/9:00~17:00  
(祝日および12月31日~1月3日は休業とさせていただきます。)



\*300101\*