

とどくんです

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	
	世界バランス 40R	世界バランス 50R
現預金・コールローン	456	66
有価証券	8,004	1,097
公社債	-	-
株式	-	-
外国証券	-	-
公社債	-	-
株式等	-	-
その他の証券	8,004	1,097
貸付金	-	-
その他	183	55
貸倒引当金	-	-
合計	8,645	1,219

※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	
	世界バランス 40R	世界バランス 50R
利息配当金等収入	5,863	1,082
有価証券売却益	-	-
有価証券償還益	-	-
有価証券評価益	1,931	288
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	-	-
有価証券償還損	-	-
有価証券評価損	7,578	1,295
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	215	74

※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
世界バランス 40R	SG 日本株式インデックスVAT*	409,166	356,400	6,373,800	4,772,484
	SG 日本債券インデックスVAT*	226,876	290,600	5,433,730	6,017,466
	CA 外国株式ファンドVAT*	194,595	264,700	3,879,003	3,873,668
	CA 外国債券ファンドVAT*	195,588	273,200	5,714,335	6,290,171
世界バランス 50R	SG 日本株式インデックスVAT*	52,234	45,700	1,085,863	819,896
	SG 日本債券インデックスVAT*	37,088	47,700	948,159	1,057,197
	CA 外国株式ファンドVAT*	46,544	63,700	1,001,303	1,004,235
	CA 外国債券ファンドVAT*	19,802	27,500	659,875	728,770

※単位未満切捨て

*適格機関投資家限定

●保有契約高(2016年度末)

(単位：件、百万円)

項目	件数	金額
年金受取総額保証付変額個人年金保険 GF とどくんです	2,226	10,311

※単位未満切捨て

●特別勘定の運用状況 ユニットプライスの推移と期間収益率(2016年度末)



ユニットプライス 2017年3月末現在	105.57
------------------------	--------

期間	1か月	3か月	6か月	1年
収益率	-0.20%	-1.06%	6.42%	1.15%



ユニットプライス 2017年3月末現在	108.88
------------------------	--------

期間	1か月	3か月	6か月	1年
収益率	-0.12%	-0.54%	8.04%	3.12%

※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。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。

特別勘定の内容

目標値110%または120%の場合の特別勘定

種類	特別勘定の名称	投資対象となる投資信託	運用会社	資産運用関係費用 (年率) ^(注)
総合型	世界バランス40R	SG日本株式インデックスVAT*	アムンディ・ジャパン	0.324% (税抜0.3%)程度
		SG日本債券インデックスVAT*		
		CA外国株式ファンドVAT*		
		CA外国債券ファンドVAT*		

*適格機関投資家限定

目標値130%または140%の場合の特別勘定

種類	特別勘定の名称	投資対象となる投資信託	運用会社	資産運用関係費用 (年率) ^(注)
総合型	世界バランス50R	SG日本株式インデックスVAT*	アムンディ・ジャパン	0.324% (税抜0.3%)程度
		SG日本債券インデックスVAT*		
		CA外国株式ファンドVAT*		
		CA外国債券ファンドVAT*		

*適格機関投資家限定

(注) 資産運用関係費用は、主な投資対象とする投資信託の信託報酬率を基本配分比率で加重平均した概算値です。主な投資対象とする投資信託の信託報酬率はそれぞれ異なりますので、各投資信託の価額の変動等に伴う実際の配分比率の変動により、資産運用関係費用も若干変動します。その他、監査報酬、信託事務の諸費用、有価証券の売買委託手数料および消費税等の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。

特別勘定の名称	運用方針
世界バランス40R	国内外の株式および債券を主要投資対象とする投資信託へ分散投資を行い、リスクを抑えながら中長期的な資産の成長を目指します。原則として為替ヘッジは行いません。基本資産配分は、日本株式20%、外国株式20%、日本債券(短期金融資産を含む)30%、外国債券30%です。
世界バランス50R	国内外の株式および債券を主要投資対象とする投資信託へ分散投資を行い、リスクを抑えながら中長期的な資産の成長を目指します。原則として為替ヘッジは行いません。基本資産配分は、日本株式20%、外国株式30%、日本債券(短期金融資産を含む)30%、外国債券20%です。

特別勘定の運用状況

2017年3月末現在

●特別勘定 純資産総額の内訳

特別勘定の名称	運用資産				投資対象となる投資信託	運用会社	資産配分		純資産総額 (百万円)
	株式		債券				資産額 (百万円)	配分	
	日本	外国	日本	外国					
世界バランス40R	●				SG日本株式インデックスVAT*	アムンディ・ジャパン	1,647	19.1%	8,645
				●	SG日本債券インデックスVAT*		2,097	24.3%	
		●			CA外国株式ファンドVAT*		1,716	19.9%	
				●	CA外国債券ファンドVAT*		2,543	29.4%	
					現預金その他		—	640	
世界バランス50R	●				SG日本株式インデックスVAT*	アムンディ・ジャパン	223	18.3%	1,219
				●	SG日本債券インデックスVAT*		284	23.3%	
		●			CA外国株式ファンドVAT*		354	29.1%	
				●	CA外国債券ファンドVAT*		235	19.3%	
					現預金その他		—	122	

*適格機関投資家限定

【特別勘定名】	【特別勘定が利用するファンド名：日本株式】
世界バランス40R	SG 日本株式インデックスVAT(適格機関投資家限定)
世界バランス50R	

- ◆とどくんです(年金受取総額保証付変額個人年金保険GF)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、組み入れファンドの損益に、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。
- ◆当資料は、アムンディ・ジャパン株式会社による運用報告を、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、当資料の内容に関して、東京海上日動あんしん生命保険株式会社は一切責任を負いません。
- ◆当該投資信託は、適格機関投資家専用で設定された投資信託です。このため、ご契約者は、当該投資信託を直接購入することはできません。

- 組入れ投資信託名：SG 日本株式インデックスVAT(適格機関投資家限定)
- 投資信託委託会社：アムンディ・ジャパン株式会社
- 組入れ投資信託の運用方針：東証株価指数(TOPIX)の動きに連動する投資成果を目標とします。
- 主要投資対象：りそな・日本株式インデックス・マザーファンド受益証券(以下、マザーファンド)
- ベンチマーク：東証株価指数(TOPIX)

■基準価額、純資産総額

基準価額	10,532 円
純資産総額	1,870 百万円

■資産構成

	比率(%)
実質組入比率	99.9
内現物等組入比率	96.3
内先物等組入比率	3.6
現金等比率	0.1

■騰落率(税引前分配金込み、%)

	直近1ヵ月	直近6ヵ月
当ファンド	-0.64	15.52
ベンチマーク	-0.59	15.60

■基準価額とベンチマークの推移グラフ



※ベンチマークの東証株価指数(TOPIX、配当込み)は設定日を10,000として指数化しております(設定日:2006年4月28日)。基準価額は1万円当たりで、信託報酬控除後のものです。

■組入上位10銘柄

(組入銘柄数:1,513銘柄)

NO	銘柄名	業種名	比率(%)
1	トヨタ自動車	輸送用機器	3.20
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	2.28
3	日本電信電話	情報・通信業	1.63
4	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.54
5	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.41
6	本田技研工業	輸送用機器	1.31
7	KDDI	情報・通信業	1.25
8	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1.18
9	ソニー	電気機器	1.15
10	ファナック	電気機器	1.02

■組入上位10業種

NO	業種名	比率(%)
1	電気機器	12.97
2	輸送用機器	9.12
3	銀行業	8.12
4	情報・通信業	7.79
5	化学	6.84
6	機械	5.19
7	医薬品	4.78
8	小売業	4.65
9	食料品	4.54
10	卸売業	4.50

※組入上位10銘柄、組入上位10業種はマザーファンドについて記載。組入上位10銘柄の比率はマザーファンドの純資産総額に対する割合。組入上位10業種の比率はマザーファンドの国内株式評価総額に対する割合。

注)東証株価指数(TOPIX)は、東京証券取引所第一部に上場している全銘柄の株価を、それぞれの上場株式数で加重平均した指数です。新規上場銘柄や有償増資などに対しては、修正を加えることで指数の連続性を維持しています。東証株価指数(TOPIX)は、東京証券取引所の知的財産であり、この指数の算出、数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利は東京証券取引所が有しています。東京証券取引所は、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止又はTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行なう権利を有しています。

注) 当資料は信頼できるとされる情報に基づきアムンディ・ジャパン株式会社により作成されていますが、アムンディ・ジャパン株式会社はその正確性、完全性を保証するものではありません。

【特別勘定名】

世界バランス40R

世界バランス50R

【特別勘定が利用するファンド名：日本債券】

SG 日本債券インデックスVAT(適格機関投資家限定)

◆とどくんです(年金受取総額保証付変額個人年金保険GF)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、組み入れファンドの損益に、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。

◆当資料は、アムンディ・ジャパン株式会社による運用報告を、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、当資料の内容に関して、東京海上日動あんしん生命保険株式会社は一切責任を負いません。

◆当該投資信託は、適格機関投資家専用で設定された投資信託です。このため、ご契約者は、当該投資信託を直接購入することはできません。

- 組入れ投資信託名： SG 日本債券インデックスVAT(適格機関投資家限定)
- 投資信託委託会社： アムンディ・ジャパン株式会社
- 組入れ投資信託の運用方針： NOMURA-BPI(総合)の動きに連動する投資成果を目標とします。
- 主要投資対象： りそな・日本債券インデックス・マザーファンド受益証券(以下、マザーファンド)
- ベンチマーク： NOMURA-BPI(総合)

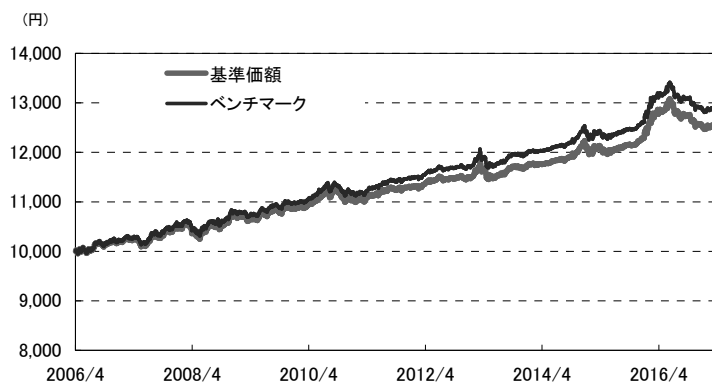
■基準価額、純資産総額

基準価額	12,528 円
純資産総額	2,382 百万円

■資産構成

	比率(%)
実質組入比率	98.3
内現物等組入比率	98.3
内先物等組入比率	0.0
現金等比率	1.7

■基準価額とベンチマークの推移グラフ



※ベンチマークのNOMURA-BPI(総合)は設定日を10,000として指数化しております(設定日：2006年4月28日)。基準価額は1万円当たりで、信託報酬控除後のものです。

■騰落率(税引前分配金込み、%)

	直近1ヵ月	直近6ヵ月
当ファンド	-0.17	-1.93
ベンチマーク	-0.11	-1.82

■組入上位10銘柄

(組入銘柄数:47銘柄)

NO	銘柄名	利率(%)	償還日	比率(%)
1	第374回利付国債(2年)	0.100	2019/3/15	8.83
2	第305回利付国債(10年)	1.300	2019/12/20	3.53
3	第24回利付国債(30年)	2.500	2036/9/20	3.42
4	第307回利付国債(10年)	1.300	2020/3/20	3.25
5	第126回利付国債(20年)	2.000	2031/3/20	3.15
6	第47回利付国債(20年)	2.200	2020/9/21	3.06
7	第312回利付国債(10年)	1.200	2020/12/20	2.97
8	第722回東京都公募公債	0.800	2023/6/20	2.96
9	第725回東京都公募公債	0.660	2023/9/20	2.94
10	第139回共同発行市場公募地方債	0.544	2024/10/25	2.92

※組入上位10銘柄、債券種別比率はマザーファンドについて記載。組入上位10銘柄の比率はマザーファンドの純資産総額に対する割合。債券種別比率の合計値は、四捨五入の関係で100%にならない場合があります。

■債券種別比率

種別	比率(%)
国債	79.38
地方債	8.96
政保・特殊債	2.94
金融債	0.00
事業債等	8.72

■ポートフォリオの状況

平均複利利回り(%)	0.17
平均クーポン(%)	1.18
平均残存年数(年)	9.39
修正デュレーション(年)	8.84

注)NOMURA-BPI(総合)とは、野村証券株式会社が発表しているわが国の代表的な債券パフォーマンスインデックスで、国債の他、地方債、政府保証債、金融債、事業債、円建外債で構成されており、ポートフォリオの投資収益率・利回り・クーポン・デュレーション等の各指標が日々公表されています。NOMURA-BPI(総合)は野村証券株式会社の知的財産であり、この指数の算出、数値の公表、利用など指数に関するすべての権利は、野村証券株式会社が有しております。野村証券株式会社は、NOMURA-BPI(総合)の算出もしくは公表の方法の変更、NOMURA-BPI(総合)の算出もしくは公表の停止またはNOMURA-BPI(総合)の商標の変更もしくは使用の停止を行なう権利を有しています。

注) 当資料は信頼できるとされる情報に基づきアムンディ・ジャパン株式会社により作成されていますが、アムンディ・ジャパン株式会社はその正確性、完全性を保証するものではありません。

【特別勘定名】 世界バランス40R 世界バランス50R	【特別勘定が利用するファンド名：外国株式】 CA外国株式ファンドVAT(適格機関投資家限定)
<ul style="list-style-type: none"> とどくんです(年金受取総額保証付変額個人年金保険GF)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、組み入れファンドの損益に、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。 当資料は、アムンディ・ジャパン株式会社による運用報告を、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、当資料の内容に関して、東京海上日動あんしん生命保険株式会社は一切責任を負いません。 当該投資信託は、適格機関投資家専用で設定された投資信託です。このため、ご契約者は、当該投資信託を直接購入することはできません。 	

■ 組入れ投資信託名: CA外国株式ファンドVAT(適格機関投資家限定)

■ 投資信託委託会社: アムンディ・ジャパン株式会社

■ 組入投資信託の運用方針: ① CA外国株式マザーファンド(以下「マザーファンド」といいます)を主要投資対象とし、MSCIコクサイ・インデックス(円換算ベース)に連動する投資成果を目指して運用を行います。
② CA外国株式マザーファンドは、日本を除く世界の主要国の株式を主要投資対象とします。
③ CA外国株式マザーファンドの組入比率は、原則として高位を維持します。
④ 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。ただし、エクスポージャーの調整等を目的として為替予約取引等を活用する場合があります。

■ ベンチマーク: MSCIコクサイ・インデックス(円換算ベース)

■ 基準価額、純資産総額

基準価額(円)	17,467
純資産総額(百万円)	2,474

■ 資産構成

実質株式組入比率	99.83%
内現物等組入比率	97.94%
内先物等組入比率	1.89%
現金等比率	2.06%

■ 騰落率(税引前分配金込み)

	直近1ヵ月	直近6ヵ月	1年
当ファンド	0.91%	21.37%	14.22%
ベンチマーク	0.94%	21.55%	14.30%
超過収益	-0.03%	-0.18%	-0.07%

■ 基準価額の推移グラフ(税引前分配金込み)



※ベンチマークのMSCIコクサイ・インデックス(円換算ベース)は設定日を10,000として指数化しております(設定日:2006年4月28日)。MSCIコクサイ・インデックス(円換算ベース)とは、MSCI Inc.が発表している日本を除く主要先進国の株式市場の動きを捉える代表的な株価指標で、その著作権はMSCI Inc.に帰属しております。円換算ベースとは、ドルベースの指数を円換算したものです。MSCI Inc.は、当ファンドの運用成績等に関し、何ら責任を負うものではありません。※上記グラフは過去の実績であり、将来の運用成果をお約束するものではありません。※基準価額は1万円当たりで、信託報酬控除後のものです。

■ 組入上位10銘柄等 ※

組入上位10銘柄

No	銘柄	国名	業種	比率
1	APPLE	アメリカ	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	2.31%
2	MICROSOFT	アメリカ	ソフトウェア・サービス	1.49%
3	EXXON MOBIL	アメリカ	エネルギー	1.05%
4	AMAZON.COM	アメリカ	小売	1.05%
5	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	1.02%
6	FACEBOOK	アメリカ	ソフトウェア・サービス	1.00%
7	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	銀行	0.97%
8	GENERAL ELECTRIC	アメリカ	資本財	0.82%
9	WELLS FARGO	アメリカ	銀行	0.80%
10	ALPHABET-A	アメリカ	ソフトウェア・サービス	0.78%
組入全銘柄数: 1,064銘柄			上位10銘柄合計	11.29%

組入上位10カ国 *

No	国名	比率
1	アメリカ	64.47%
2	イギリス	7.06%
3	フランス	4.04%
4	カナダ	3.74%
5	ドイツ	3.61%
6	スイス	3.41%
7	オーストラリア	2.95%
8	スペイン	1.32%
9	香港	1.30%
10	オランダ	1.23%

組入上位10業種

No	業種名	比率
1	銀行	9.49%
2	ソフトウェア・サービス	9.11%
3	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.52%
4	資本財	7.32%
5	エネルギー	6.96%
6	食品・飲料・タバコ	5.81%
7	素材	4.83%
8	各種金融	4.20%
9	保険	4.07%
10	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.89%

※組入上位10銘柄・組入上位10カ国・組入上位10業種はマザーファンドベースです。※比率はマザーファンドの純資産総額に占める割合です。

*国別配分はMSCI分類に基づき表示しております。

注) 当資料は信頼できると思われる情報に基づきアムンディ・ジャパン株式会社により作成されていますが、アムンディ・ジャパン株式会社はその正確性、完全性を保証するものではありません。

【特別勘定名】

世界バランス40R

世界バランス50R

【特別勘定が利用するファンド名：外国債券】

CA外国債券ファンドVAT(適格機関投資家限定)

- ・とどくんです(年金受取総額保証付変額個人年金保険GF)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、組み入れファンドの損益に、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。
- ・当資料は、アムンディ・ジャパン株式会社による運用報告を、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、当資料の内容に関して、東京海上日動あんしん生命保険株式会社は一切責任を負いません。
- ・当該投資信託は、適格機関投資家専用で設定された投資信託です。このため、ご契約者は、当該投資信託を直接購入することはできません。

■ 組入れ投資信託名: CA外国債券ファンドVAT(適格機関投資家限定)

■ 投資信託委託会社: アムンディ・ジャパン株式会社

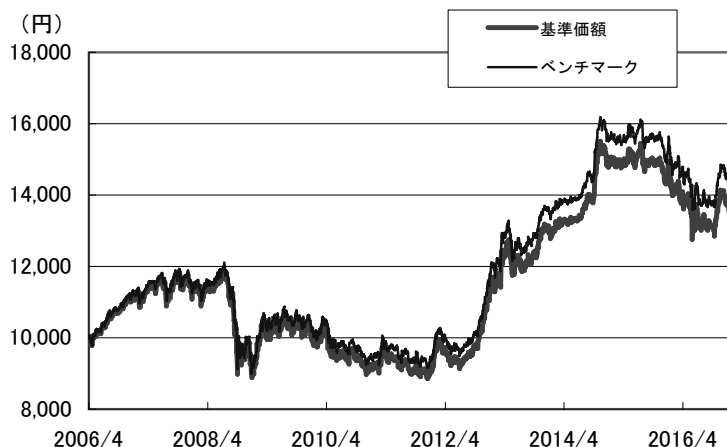
- 組入投資信託の運用方針:
- ① CA外国債券マザーファンド(以下「マザーファンド」といいます)を主要投資対象とし、ベンチマークに連動する投資成果を目指して運用を行います。
 - ② CA外国債券マザーファンドは、日本を除く世界の主要国の公社債(国債等)を主要投資対象とします。
 - ③ CA外国債券マザーファンドの組入比率は、原則として高位を維持します。
 - ④ 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。ただし、エクスポージャーの調整等を目的として為替予約取引等を活用する場合があります。

■ ベンチマーク: シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

■ 基準価額、純資産総額

基準価額(円)	13,652
純資産総額(百万円)	6,956

■ 基準価額の推移グラフ(税引前分配金込み)



■ 資産構成

実質債券組入比率	97.40%
内現物等組入比率	97.40%
内先物等組入比率	0.00%
現金等比率	2.60%

■ 騰落率(税引前分配金込み)

	直近1ヵ月	直近6ヵ月	1年
当ファンド	0.01%	4.16%	-5.04%
ベンチマーク	-0.33%	3.18%	-5.12%
超過収益	0.34%	0.98%	0.07%

※ベンチマークのシティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)は設定日を10,000として指数化しております(設定日:2006年4月28日)。※シティ世界国債インデックスはCitigroup Index LLCにより開発、算出および公表されている債券インデックスです。※上記グラフは過去の実績であり、将来の運用成果をお約束するものではありません。※基準価額は1万円当たりで、信託報酬控除後のものです。

■ 組入上位10銘柄等 ※

組入上位10銘柄

No	銘柄	利率	償還日	通貨	比率
1	米国国債	3.125%	2021/5/15	米ドル	6.74%
2	米国国債	1.000%	2019/9/30	米ドル	6.67%
3	米国国債	6.250%	2023/8/15	米ドル	3.29%
4	米国国債	0.875%	2018/7/15	米ドル	2.43%
5	イタリア国債	4.250%	2020/3/1	ユーロ	2.18%
6	米国国債	2.750%	2042/8/15	米ドル	1.82%
7	米国国債	3.375%	2044/5/15	米ドル	1.61%
8	フランス国債	4.250%	2023/10/25	ユーロ	1.52%
9	米国国債	2.000%	2025/2/15	米ドル	1.50%
10	フランス国債	0.500%	2019/11/25	ユーロ	1.46%
組入全銘柄数: 338銘柄		上位10銘柄合計		29.24%	

通貨別比率(組入上位5通貨)

No	通貨	比率
1	米ドル	43.92%
2	ユーロ	38.01%
3	英ポンド	6.93%
4	豪ドル	2.08%
5	カナダドル	2.05%

ポートフォリオの状況

平均複利回り(%)	1.46
平均クーポン(%)	2.88
平均残存期間(年)	8.50
修正デュレーション(年)	7.01

※組入上位10銘柄・通貨別比率・ポートフォリオの状況はマザーファンドベースです。※比率はマザーファンドの純資産総額に占める割合です。

注) 当資料は信頼できるとされる情報に基づきアムンディ・ジャパン株式会社により作成されていますが、アムンディ・ジャパン株式会社はその正確性、完全性を保証するものではありません。

ご 注 意 い た だ き た い 事 項

ご負担いただく費用について

この商品にかかる費用の合計は、下記「契約初期費用」、「保険関係費用」および「資産運用関係費用」の合計となります（ただし、目標値の変更により積立金の移転が1保険年度12回を超えた場合には、別途「積立金移転費用」がかかりますのでご注意ください）。

	項目	内容	費用	備考(適用時期等)
ご契約時	契約初期費用	当保険の新契約成立等のために必要な費用	一時払保険料の 4%	特別勘定への繰入前に一時払保険料から控除します。
運用期間中	保険関係費用 (保険契約管理費)	当保険の維持管理等に必要な費用	特別勘定の純資産総額に対して年率 2.55%	特別勘定の純資産総額に対して年率2.55%/365日を乗じた額を毎日控除します。
	資産運用関係費用* (資産運用管理費)	特別勘定の運用に係る費用	特別勘定の投資対象となる投資信託の純資産総額に対して年率 0.324% 程度(税抜0.3%程度)	特別勘定の投資対象となる投資信託の純資産総額に対して年率0.324%程度/365日を乗じた額を毎日控除します。
	積立金移転費用	1保険年度に12回を超える積立金の移転の際	1保険年度13回以上の移転の際:一回につき 1,000円	移転時に積立金から控除します。
年金支払期間中	保険関係費用 (年金管理費)	当保険の維持管理等に必要な費用	年金額に対して 1.0% 以内	年金支払開始日以降、年1回の年金支払日に責任準備金から控除します。

* 資産運用関係費用は、主な投資対象とする投資信託の信託報酬率を基本配分比率で加重平均した概算値です。主な投資対象とする投資信託の信託報酬率はそれぞれ異なりますので、各投資信託の価額の変動等に伴う実際の配分比率の変動により、資産運用関係費用も若干変動します。
その他、監査報酬、信託事務の諸費用、有価証券の売買委託手数料および消費税等の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。

投資リスクについて

この商品をご契約者から払い込まれた一時払保険料を積立金として特別勘定で運用します。この商品の特別勘定は国内外の株式および債券等の各資産を主要投資対象とする投資信託等に投資することにより運用を行います。この商品では、特別勘定の運用実績が将来お受け取りになる年金額・解約払戻金額・死亡保険金額等の変動(増減)につながるため、高い収益性が期待できる反面、投資の対象となる株価や債券価格等が下落した場合には積立金額も下落します。また、外国株式や外国債券を投資対象としている場合は為替相場の影響を受けますので、為替相場の変動により積立金額が下落する場合があります。その結果、解約払戻金額・年金原資等が払込保険料総額を下回り、ご契約者が損失を被ることがあります。これらのリスクはご契約者に帰属することになりますので十分ご注意ください。また、目標値の変更により積立金の移転が生じた際には、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

- 「とどくんです(年金受取総額保証付変額個人年金保険GF)」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。
- 「とどくんです(年金受取総額保証付変額個人年金保険GF)」は運用期間満了時点で積立金額が基本保険金額を下回った場合でも年金受取総額で基本保険金額の100%を最低保証します。ただし、年金の受取方法は確定年金(年金支払期間15年)のみとなり、一括受取を希望される場合は基本保険金額の90%を最低保証します。

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。)



100601