

変額個人年金保険GF(IV型)
〈年金原資保証特約(IV型)付加〉

とどくんです
プレミア

特別勘定レポート

2018年(平成30年)11月発行

特別勘定： GTバランス20
GTバランス40
GTバランス60
(販売期間：2009/12/1～2010/2/28)

最終ページには「ご負担いただく費用について」、「投資リスクについて」等が記載されておりますので、必ずご確認ください。

「とどくんですプレミア」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GF(IV型)〈年金原資保証特約(IV型)付加〉の商品名です。「とどくんですプレミア」には専用の特別勘定グループが設定されています。



TOKIOMARINE
NICHIDO

東京海上日動あんしん生命

ご契約者さまへのご案内

- 当資料はご契約者さまに特別勘定の運用状況や運用概況などをお知らせするための資料です。
- 当資料はご契約者さまの運用状況などをご案内する「ご契約状況のお知らせ」とは異なります。ご契約者さまの個別の運用状況は掲載されておきませんのでご了承ください。
- 今回の月次運用レポートは発行月前月末時点の最新データによるものです。
- 各種データの収集、加工のためにデータ基準日からレポートのご提供までお時間をいただいております。何卒ご了承ください。
- 各種変更手続き、積立金額のご照会など、ご契約に関するお問い合わせは下記フリーダイヤルまでご連絡ください。

テレホンサービス 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。)

- ホームページによる情報提供とサービス

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>

ご契約者さま専用ページでは、ログインIDとパスワードを使って、インターネットから住所変更などのお手続きや運用状況の確認を行うことができます。
データは毎営業日に更新されますので、いつでも最新の情報を得ることができます。

ログインIDとパスワードはご契約者さまご本人において厳重に管理していただき、第三者に開示されることのないようお願い申し上げます。

- 東京海上日動あんしん生命保険株式会社では、個別の運用に関するご相談は承っておりません。運用のご相談は、担当の代理店・生命保険募集人をお願いいたします。

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* ¹ | GTインデックス40VA* ¹ | GTインデックス60VA* ¹ |
| 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* ¹ * ² | | |
| 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* ³ | 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* ⁴ | | |

*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。

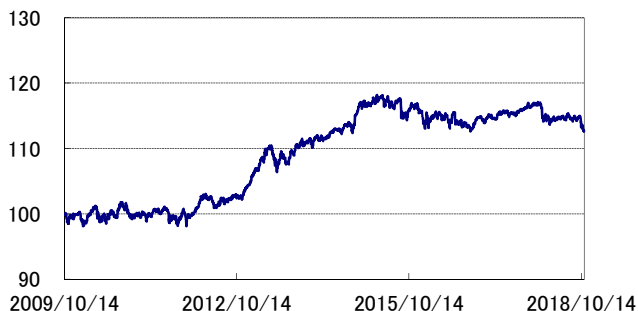
・当資料は、生命保険契約の募集および当該投資信託の勧誘を目的としたものではありません。

・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 |
|-------------|----------|--------|
| 2017年11月30日 | 116.55 | 0.13% |
| 2017年12月31日 | 116.77 | 0.19% |
| 2018年1月31日 | 116.35 | -0.36% |
| 2018年2月28日 | 115.28 | -0.91% |
| 2018年3月31日 | 114.12 | -1.01% |
| 2018年4月30日 | 114.25 | 0.11% |
| 2018年5月31日 | 114.59 | 0.29% |
| 2018年6月30日 | 114.44 | -0.13% |
| 2018年7月31日 | 114.78 | 0.29% |
| 2018年8月31日 | 114.98 | 0.18% |
| 2018年9月30日 | 114.83 | -0.13% |
| 2018年10月31日 | 112.66 | -1.89% |

●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 | 5 | 96.1% |
| 現預金その他 | 0 | 3.9% |
| 純資産総額 | 5 | 100.0% |

| 1か月 | 3か月 | 6か月 | 1年 | 設定来 |
|--------|--------|--------|--------|--------|
| -1.89% | -1.85% | -1.39% | -3.21% | 12.67% |

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 |
|-------------|----------|--------|
| 2017年11月30日 | 123.16 | -0.04% |
| 2017年12月31日 | 124.32 | 0.94% |
| 2018年1月31日 | 124.58 | 0.21% |
| 2018年2月28日 | 122.19 | -1.92% |
| 2018年3月31日 | 119.57 | -2.15% |
| 2018年4月30日 | 120.91 | 1.13% |
| 2018年5月31日 | 120.72 | -0.16% |
| 2018年6月30日 | 120.37 | -0.29% |
| 2018年7月31日 | 121.81 | 1.20% |
| 2018年8月31日 | 122.57 | 0.63% |
| 2018年9月30日 | 123.05 | 0.39% |
| 2018年10月31日 | 118.10 | -4.02% |

●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 | 0 | 96.0% |
| 現預金その他 | 0 | 4.0% |
| 純資産総額 | 1 | 100.0% |

| 1か月 | 3か月 | 6か月 | 1年 | 設定来 |
|--------|--------|--------|--------|--------|
| -4.02% | -3.04% | -2.32% | -4.15% | 18.11% |

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 |
|-------------|----------|--------|
| 2017年11月30日 | 119.74 | 0.03% |
| 2017年12月31日 | 121.33 | 1.33% |
| 2018年1月31日 | 122.76 | 1.18% |
| 2018年2月28日 | 119.71 | -2.49% |
| 2018年3月31日 | 115.72 | -3.34% |
| 2018年4月30日 | 117.88 | 1.87% |
| 2018年5月31日 | 117.69 | -0.16% |
| 2018年6月30日 | 117.96 | 0.23% |
| 2018年7月31日 | 120.29 | 1.97% |
| 2018年8月31日 | 121.38 | 0.90% |
| 2018年9月30日 | 122.16 | 0.64% |
| 2018年10月31日 | 114.96 | -5.89% |

●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 | 1,926 | 54.2% |
| 現預金その他 | 1,628 | 45.8% |
| 純資産総額 | 3,555 | 100.0% |

| 1か月 | 3か月 | 6か月 | 1年 | 設定来 |
|--------|--------|--------|--------|--------|
| -5.89% | -4.43% | -2.48% | -3.97% | 14.97% |

※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。

【月次マーケット概況】

2018年10月31日現在

主要指数の動き

| 指数名称 | 国内株式 | 国内債券 | 為替 | | |
|------------|----------|------------|----------|----------|----------|
| | TOPIX | 10年日本国債利回り | 円/米ドル | 円/ユーロ | 円/英ポンド |
| 2018/9/28 | 1,817.25 | 0.13% | 113.57 円 | 132.14 円 | 148.53 円 |
| 2018/10/31 | 1,646.12 | 0.13% | 113.26 円 | 128.43 円 | 143.90 円 |
| 騰落(変化)率 | -9.42% | -0.00% | -0.27% | -2.81% | -3.12% |

| 指数名称 | 海外株式 | | 海外債券 | | |
|------------|----------|---------------|-----------|-------------|-----------|
| | S&P 500 | EURO STOXX 50 | 10年米国債利回り | 10年ドイツ国債利回り | 10年英国債利回り |
| 2018/9/28 | 2,913.98 | 3,399.20 | 3.06% | 0.47% | 1.57% |
| 2018/10/31 | 2,711.74 | 3,197.51 | 3.14% | 0.39% | 1.44% |
| 騰落(変化)率 | -6.94% | -5.93% | 0.08% | -0.09% | -0.14% |

指数は現地月末ベースです。国内債券、海外債券の利回り騰落(変化)率については変化幅を表示しています。

出所:ブルームバーグ

10月の投資環境と今後の見通し

国内株式市場

10月の国内株式市場は、TOPIXは9.42%、日経平均株価は9.12%下落しました。月初、日経平均株価が27年振りの高値を更新した後、米中貿易摩擦への警戒感の高まりや米国金利の上昇などを受けて米国株式市場が下落したことから、国内株式市場も下落に転じました。中旬には、欧州政治の混乱や米国とサウジアラビア間の緊張の高まり等が嫌気され、米国株式市場が急落すると、世界同時株安の様相を呈し、11日の日経平均株価の下落幅は一時1,000円を超えました。その後、国内株式市場は反発する局面もありましたが、方向感を欠き軟調に推移しました。下旬は、日米で企業決算が本格化し、中国の設備投資意欲の減退や原材料費・人件費の上昇などで業績の上方修正期待が剥落する会社が散見されるなか、国内株式市場は下落基調で推移し、TOPIXは一時年初来安値を更新しました。

今後の国内株式市場は、不透明な世界経済や国際情勢の中で神経質な展開が続くものの、株価のバリュエーション(投資価値を測るための指標)は割安な水準にあると考えることから、米国の中間選挙を通過した後は政治的な不透明感がある程度後退して、上昇に転じる展開を予想します。

海外株式市場

10月の海外株式市場は大幅に下落しました。月初は、株式市場の高値警戒感が台頭するなか、米国長期金利の上昇から上値の重い展開となりました。その後、イタリアの財政問題への不透明感が高まったことや一部の米国企業が業績に対する慎重な見通しを示したことなどから、世界経済の減速や企業業績の先行きに対する懸念が高まり、海外株式市場は下落しました。月後半は、中国の2018年7-9月期GDP(国内総生産)および米国新築住宅販売件数が事前予想を下回ったことや、アマゾンドットコムやアルファベットなどの一部の米国大手企業の決算が失望されたことから、海外株式市場は下落しました。

今後の海外株式市場は、米中貿易摩擦を巡る不透明感の高まりや米国の中間選挙を控えていることなどから、当面はボラティリティ(変動性)が大きい展開を予想します。ただし、中長期的には一部企業の決算は失望されたものの、米国企業の7-9月期決算は総じて堅調に推移しており、投資家の注目が企業業績に移る局面になれば、海外株式市場は徐々に上昇していく展開に戻ると予想します。

国内債券市場

10月の国内長期金利(10年国債利回り)は、狭いレンジ内で推移しました。月上旬、好調な経済指標の発表を受けて米国債利回りが急上昇すると、10年国債利回りも0.16%程度の水準まで上昇しました。中旬以降は、世界的な株安をきっかけに市場参加者がリスク回避的になったことから10年国債利回りは小幅に低下し、その後は狭いレンジ内で推移しました。月下旬、注目されていた日銀による市場参加者との「市場調節に関する懇談会」では債券市場に影響する新たな材料は出ず、市場参加者の間に安心感が広がったことから、10年国債利回りは低下に転じました。月末の日銀金融政策決定会合の結果は現状維持となりましたが、11月の日銀による国債買い入れオペ減額への警戒感から10年国債利回りは小幅に上昇し0.13%程度の水準で月を終えました。

今後の国内債券市場は、米国中間選挙や欧州の政治情勢を巡って主要国の長期金利動向には不透明感がありますが、日銀によるイールドカーブ・コントロール政策下にある国内長期金利は基本的には狭いレンジ内で推移すると思われます。

海外債券市場

10月の米国債利回りは上昇しました。月初は、米国雇用統計で発表された失業率の低下や平均時給の上昇などから米国債利回りは上昇しました。その後は、米中貿易摩擦への懸念などを背景とした米国株式市場の下落とともに米国債利回りは小幅に低下しましたが、月後半に入りFOMC(米連邦公開市場委員会)議事要旨で利上げ継続姿勢が示されたことや、株式市場がやや落ち着いたことなどから、月末にかけて米国債利回りは上昇しました。ドイツ国債利回りは低下しました。月初は堅調な米国雇用統計などを背景にドイツ国債利回りは上昇しましたが、その後はイタリアの予算案を巡るイタリア政府とEU(欧州連合)との対立を背景にイタリアの財政懸念が強まったことなどからドイツ国債利回りは低下しました。新興国債券と先進国債券のスプレッド(利回り格差)は拡大しました。米中貿易摩擦やサウジアラビア情勢に対する懸念、米国株式市場の下落などから、投資家のリスク回避姿勢が強まりました。

今後の米国債利回りは、米国の経済成長の加速と物価上昇期待から緩やかに上昇することを想定します。また、ドイツ国債利回りは、ユーロ圏の経済成長を背景に緩やかに上昇することを想定します。

為替市場

10月の米ドル円為替レートはおおむね横ばいとなりました。月前半は、米国株式市場や原油価格の下落などを受けて円高米ドル安基調となりました。月後半は、FRB(米連邦準備制度理事会)の利上げ継続姿勢や堅調な米国消費者信頼感指数などの経済指標を背景に米ドルは上昇し、前月末対比ではおおむね横ばいとなりました。ユーロ米ドルはユーロ安米ドル高となりました。月初は、欧州の軟調な経済指標などからユーロ安米ドル高となりました。月央に、米国株式市場の下落などを背景に米ドルが売られユーロ高となる場面もありましたが、その後は、イタリアの財政懸念や軟調なユーロ圏PMI(購買担当者景気指数)などからユーロ安が進行し、前月末対比ユーロ安米ドル高で月を終えました。

今後の米ドル円相場は、米国の経済成長を背景に米国の利上げが意識される一方、新興国の経済情勢に対する懸念が払拭しきれないことから、米ドル円は横ばいで推移すると予想します。また、ユーロ米ドル相場は、ユーロ圏経済は底堅く推移するとみているものの、イタリアの2019年度予算案に対する懸念から、当面は横ばいで推移すると予想します。

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。

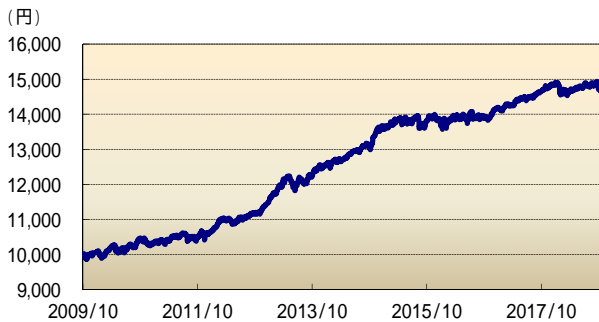
GTインデックス20VA <適格機関投資家限定>

運用レポート(2018年10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S 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)



基準価額は税引前の分配金を再投資したのとして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。
基準価額は信託報酬控除後です。

騰落率(税引前分配金再投資)

| | 1ヵ月 (2018/9/28) | 3ヵ月 (2018/7/31) | 6ヵ月 (2018/4/27) | 1年 (2017/10/31) | 設定来 (2009/10/14) |
|-------|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|---------------------|
| 当ファンド | -1.72% | -1.20% | +0.01% | -0.48% | +46.53% |

騰落率は税引前の分配金を再投資したのとして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。

基準価額・純資産総額

| | |
|-------|--------------------------|
| 基準価額 | 14,653円 |
| 純資産総額 | 6百万円 |
| 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。

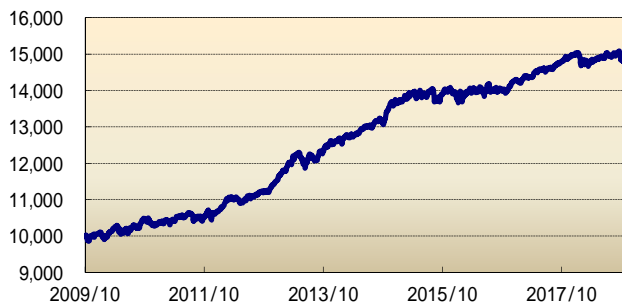
分配金額は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。
分配対象額が少額の場合などには、分配を行わないことがあります。

(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



基準価額はGTインデックス20VA <適格機関投資家限定> の設定日を10,000として表示しております。
基準価額は信託報酬等控除後です。

純資産総額

6百万円

騰落率(税引前分配金再投資)

| | 1ヵ月 (2018/9/28) | 3ヵ月 (2018/7/31) | 6ヵ月 (2018/4/27) | 1年 (2017/10/31) | 設定来 (2009/10/14) |
|---------------|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|---------------------|
| グローバル・トラッカー20 | -1.72% | -1.18% | +0.06% | -0.38% | +47.93% |

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。

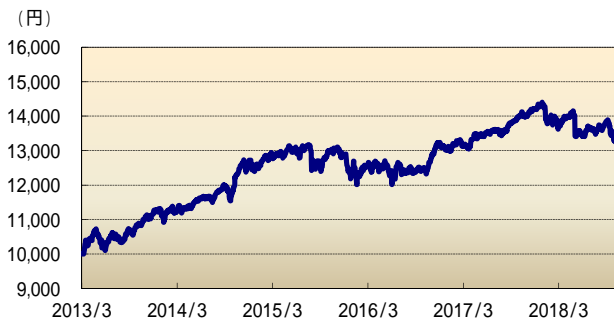
GTインデックス40VA <適格機関投資家限定>

運用レポート(2018年10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ヵ月 (2018/9/28) | 3ヵ月 (2018/7/31) | 6ヵ月 (2018/4/27) | 1年 (2017/10/31) | 設定来 (2013/3/29) |
|-------|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| 当ファンド | -3.95% | -2.45% | -4.71% | -5.16% | +32.89% |

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は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 | 13,289円 |
| 純資産総額 | 3百万円 |
| 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 | 57,745.5 |
| 短期金融資産など | -57,645.5 |
| 合計 | 100.0 |

短期金融資産などは、組入資産以外のものです。
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、分配を行わないことがあります。

(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等控除後です。

純資産総額

3百万円

騰落率(税引前分配金再投資)

| | 1ヵ月 (2018/9/28) | 3ヵ月 (2018/7/31) | 6ヵ月 (2018/4/27) | 1年 (2017/10/31) | 設定来 (2013/3/29) |
|---------------|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| グローバル・トラッカー40 | -3.95% | -2.43% | -0.66% | -1.07% | +39.89% |

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。

GTインデックス60VA <適格機関投資家限定>

運用レポート(2018年10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)



基準価額・純資産総額

| | |
|-------|--------------------------|
| 基準価額 | 13,389円 |
| 純資産総額 | 1,928百万円 |
| 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。

騰落率(税引前分配金再投資)

| | 1ヵ月 (2018/9/28) | 3ヵ月 (2018/7/31) | 6ヵ月 (2018/4/27) | 1年 (2017/10/31) | 設定来 (2013/11/29) |
|-------|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|---------------------|
| 当ファンド | -5.84% | -3.84% | -1.03% | -1.17% | +33.90% |

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は異なることがあります。
 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。

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、分配を行わないことがあります。

(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

| | |
|-------|----------|
| 純資産総額 | 1,927百万円 |
|-------|----------|

騰落率(税引前分配金再投資)

| | 1ヵ月 (2018/9/28) | 3ヵ月 (2018/7/31) | 6ヵ月 (2018/4/27) | 1年 (2017/10/31) | 設定来 (2013/11/29) |
|---------------|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|---------------------|
| グローバル・トラッカー60 | -5.83% | -3.80% | -0.97% | -1.05% | +35.52% |

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】

2018年10月31日現在

以下、「スペシャライズド・インベストメンツSIF」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・リミテッド(以下「ストック社」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&ブアーズ(以下「S&P」といいます)に委託されています。ストック社、S&Pおよびその関連会社は、当該指数の計算に関する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。

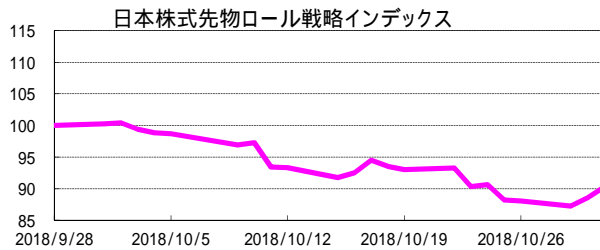
【グローバル・トラッカー・ポートフォリオのベンチマークについて】

2018年10月31日現在

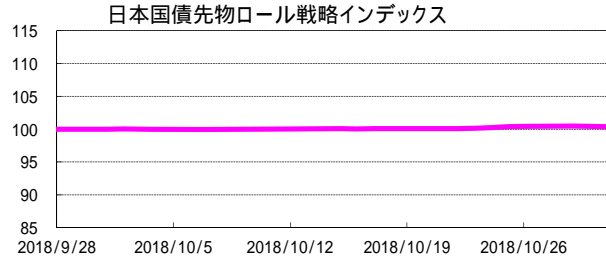
構成インデックスの推移(過去1ヵ月)

各インデックスは現地月末ベース、前月末を100として表示しています。

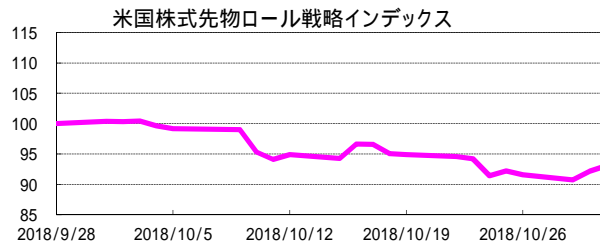
日本株式



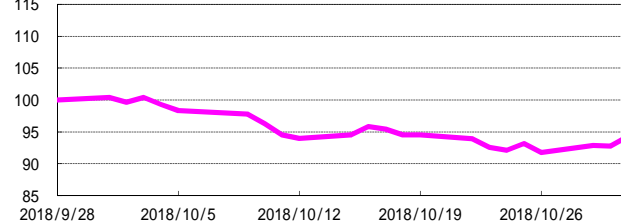
日本債券



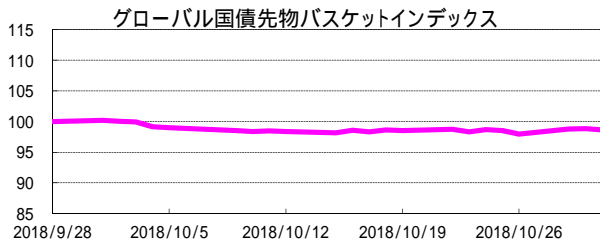
外国株式(現地通貨ベース)



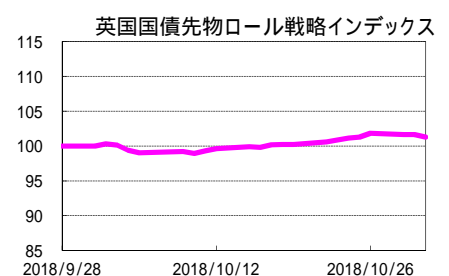
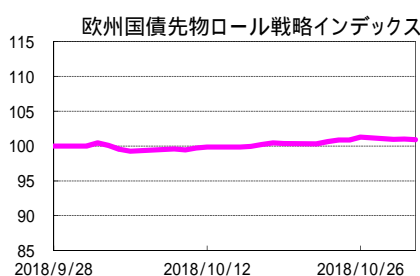
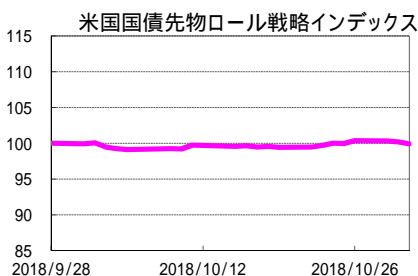
欧州株式先物ロール戦略インデックス



外国債券(円ベース)



外国債券 構成サブ・インデックス(現地通貨ベース)



構成インデックスの騰落率

| | 日本株式 | 日本債券 | 外国株式(現地通貨ベース) | |
|-----|----------------------|-------------------|---------------------------|-------------------|
| | 日本株式先物ロール戦略インデックス | 日本国債先物ロール戦略インデックス | 米国株式先物ロール戦略インデックス | 欧州株式先物ロール戦略インデックス |
| 1ヵ月 | -9.71% | +0.36% | -6.94% | -5.73% |
| | 外国債券(円ベース) | | 外国債券 構成サブ・インデックス(現地通貨ベース) | |
| | 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 | 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 |
| 1ヵ月 | -1.39% | -0.09% | +0.89% | +1.28% |

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 2.78% | 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 0.192104% (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 | 5.0%~1.0% | 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 | 6.0%~1.0% | 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 | 1.0%以内 | 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目指す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。)