運用実績に関する最新情報は
ホームページから

https://www.tmn-anshin.co.jp

ベストシナリオ

変額個人年金保険GF（Ⅱ型）
〈年金受取総額保証特約（Ⅱ型）付加〉

特別勘定：BS世界バランス55

（販売期間：2007.12.3～2010.2.28）

特別勘定レポート
2019年10月発行

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。

「ベストシナリオ」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（Ⅱ型）〈年金受取総額保証特約（Ⅱ型）付加〉の商品名です。「ベストシナリオ」には専用の特別勘定グループが設定されています。

TOKIO MARINE NICHIDO 東京海上日動あんしん生命

B1410014-000

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り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

https://www.tmn-anshin.co.jp

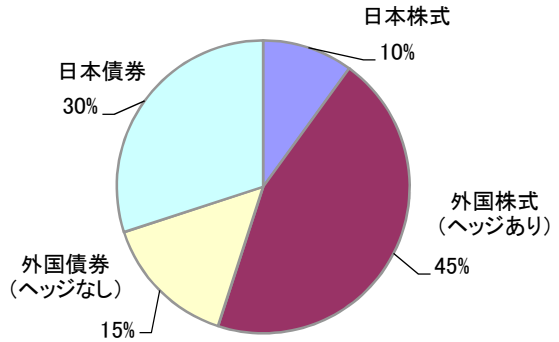
ご契約者さま専用ページでは、ログインIDとパスワードを使って、インターネットから住所変更などのお手続きや運用状況の確認を行うことができます。
データは毎営業日に更新されますので、いつでも最新の情報を得ることができます。

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に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・生命保険募集人にお願いいたします。

特別勘定の内容

この商品の特別勘定は以下のとおりです。
なお投資対象となる投資信託については、次ページ以降をご覧ください。

種類	総合型	投資対象となる投資信託	DIAM世界バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）
特別勘定の名称	BS世界バランス55	運用会社	アセットマネジメントOne株式会社
特別勘定の設定日	2007年12月13日	資産運用関係費用（年率）(注)	0.27%（税抜0.25%）程度
運用方針	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。外国株式部分については原則として為替ヘッジを行い、外国債券部分については原則として為替ヘッジを行いません。 基本資産配分は、日本株式10%、外国株式（ヘッジあり）45%、外国債券（ヘッジなし）15%、日本債券（短期金融資産を含む）30%です。		

（注）資産運用関係費用は、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、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。

特別勘定の運用状況

2019年9月末現在

●ユニットプライスの推移

●特別勘定　純資産総額の内訳

	金額(百万円)	構成比
投資信託	23	95.5%
現預金その他	1	4.5%
純資産総額	24	100.0%

※ 保険契約の解約等の異動に備えて、若干の現預金を保有しています。
※金額は単位未満を切り捨てて、構成比は小数点第2位を四捨五入して、表示しています。

●ユニットプライスの期間収益率

	ユニットプライス	前月比	期間収益率（左記基準日より2019年9月末現在まで）
2018年9月30日	118.08	0.55%	−1.00%
2018年10月31日	112.51	−4.72%	3.90%
2018年11月30日	113.54	0.91%	2.96%
2018年12月31日	108.30	−4.61%	7.94%
2019年1月31日	112.21	3.61%	4.18%
2019年2月28日	114.58	2.11%	2.02%
2019年3月31日	115.17	0.51%	1.50%
2019年4月30日	116.86	1.47%	0.03%
2019年5月31日	113.85	−2.58%	2.68%
2019年6月30日	116.40	2.24%	0.43%
2019年7月31日	117.48	0.93%	−0.50%
2019年8月31日	115.93	−1.32%	0.83%
2019年9月30日	116.90	0.83%	−

※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、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。

・ベストシナリオ（変額個人年金保険GF（Ⅱ型）〈年金受取総額保証特約（Ⅱ型）付加〉）（BS世界バランス55）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。

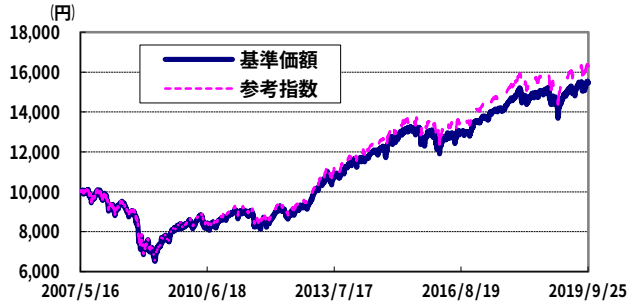
組入投信の運用状況

2019年9月末現在

■ ベストシナリオ〈変額個人年金保険GF〈Ⅱ型〉<年金受取総額保証特約〈Ⅱ型〉付加>〈BS世界バランス55〉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、アセットマネジメントOne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に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。

DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)
運用レポート(2019年9月30日現在)

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して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。
基準価額および参考指標は設定日〈2007年5月17日〉の前日を10,000として計算しています。
基準価額は信託報酬控除後です。

当月末基準価額・純資産総額

基準価額	15,446 円
解約価額	15,446 円
純資産総額	83 百万円
設定日	2007年5月17日
決算日	原則6月22日
信託期間	無期限

騰落率(税引前分配金再投資)

	1ヵ月	3ヵ月	6ヵ月	1年	3年	5年	設定来
ファンド	1.09%	1.11%	2.90%	1.52%	19.27%	26.64%	54.46%
参考指数	1.15%	1.27%	3.20%	1.91%	20.65%	29.29%	62.89%
差	-0.07%	-0.17%	-0.30%	-0.38%	-1.37%	-2.65%	-8.43%

※騰落率は税引前の分配金を再投資したも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。

ポートフォリオ構成

	実質組入比率	基本配分比率	差
国内株式	9.9%	10.0%	-0.1%
国内債券	30.4%	30.0%	0.4%
外国株式	46.0%	45.0%	1.0%
外国債券	14.6%	15.0%	-0.4%
現金等	-0.8%	0.0%	-0.8%
合計	100.0%	100.0%	ー

※計理処理の仕組みにより直近の追加設定分が反映されないことなどから、ファンドの実質組入比率と基本配分比率が、一時的に大幅に乖離したり「現金等」の比率がマイナスになる場合があります。
※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。
※外国株式部分については、原則として為替ヘッジを行います。一方、外国債券については、為替ヘッジを行いません。なお、為替ヘッジに伴う評価損益は現金等に含まれます。

分配金実績(税引前)

※分配金は1万口当たり

第10期	(2017.06.22)	0 円
第11期	(2018.06.22)	0 円
第12期	(2019.06.24)	0 円
設定来累計分配金		0 円

※直近3年分
※分配対象額が少額の場合には、分配を行わない場合があります。

ファンドの特色

主な投資対象 ・・・・・・・ 主として国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド、国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンドおよび外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの各受益証券への投資を通じ、国内株式・外国株式・国内債券・外国債券へ投資します。

投資方針 ・・・・・・・ 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。外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券に含まれる外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行います。

参考指数 ・・・・・・・ 東証株価指数(TOPIX、配当込み)、NOMURA-BPI総合、MSCIコクサイ・インデックス(円ヘッジベース、配当込み)、FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)を基本資産配分で合成したものを参考指数としています。
なお、ベンチマークは特定しません。

各マザーファンドのベンチマーク

〔国内株式〕	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド ：	東証株価指数(TOPIX、配当込み)
〔国内債券〕	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド ：	NOMURA-BPI総合
〔外国株式〕	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド ：	MSCIコクサイ・インデックス(円換算ベース、配当込み)
〔外国債券〕	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド ：	FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)

○当資料は、アセットマネジメントOne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、アセットマネジメントOne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。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。

組入投信の運用状況

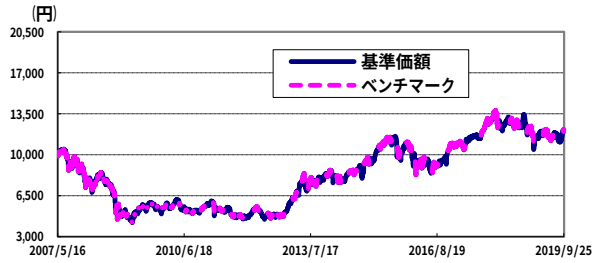
2019年9月末現在

■ ベストシナリオ（変額個人年金保険GF（Ⅱ型）<年金受取総額保証特約（Ⅱ型）付加>（BS世界バランス55）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、アセットマネジメントOne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に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。

DIAM世界バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）

各マザーファンド運用状況（2019年9月30日現在）

◆国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド◆



※基準価額およびベンチマークは2007年5月16日の値を10,000として計算しています。

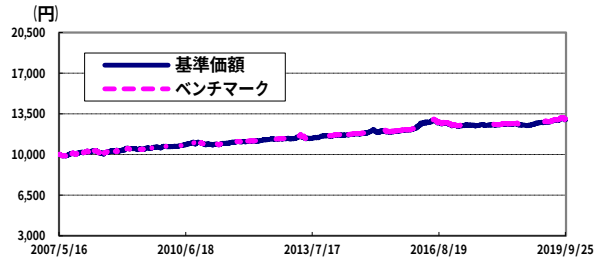
騰落率

	1ヵ月	3ヵ月	6ヵ月	1年	3年	5年	設定来
ファンド	6.04%	3.40%	0.97%	-10.38%	28.44%	33.41%	19.99%
ベンチマーク	6.04%	3.39%	0.96%	-10.37%	28.43%	33.46%	20.11%
差	0.00%	0.00%	0.00%	-0.01%	0.02%	-0.05%	-0.12%

純資産総額 251,176 百万円

※設定来の騰落率は2007年5月16日を基準に算出しています。
※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（㈱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、㈱東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、㈱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、㈱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。

◆国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド◆



※基準価額およびベンチマークは2007年5月16日の値を10,000として計算しています。

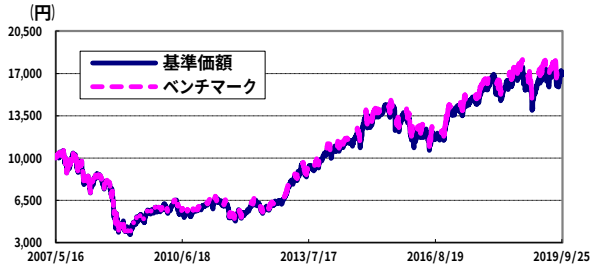
騰落率

	1ヵ月	3ヵ月	6ヵ月	1年	3年	5年	設定来
ファンド	-1.06%	0.38%	1.30%	4.02%	2.24%	10.25%	30.09%
ベンチマーク	-1.06%	0.40%	1.32%	4.03%	2.27%	10.31%	30.53%
差	-0.00%	-0.02%	-0.02%	-0.02%	-0.03%	-0.06%	-0.45%

純資産総額 241,485 百万円

※設定来の騰落率は2007年5月16日を基準に算出しています。
※ベンチマークは、NOMURA-BPI総合です。
■NOMURA-BPI総合は、野村證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證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、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。

◆外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド◆



※基準価額およびベンチマークは2007年5月16日の値を10,000として計算しています。

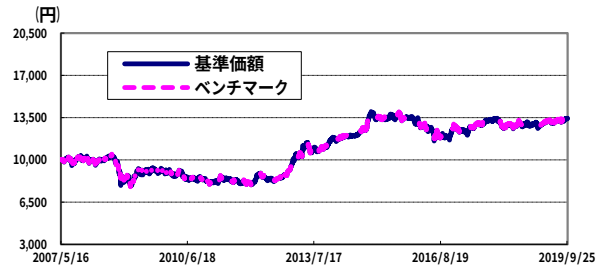
騰落率

	1ヵ月	3ヵ月	6ヵ月	1年	3年	5年	設定来
ファンド	3.22%	0.73%	2.16%	-2.94%	45.89%	41.94%	69.39%
ベンチマーク	3.22%	0.84%	2.35%	-2.67%	47.10%	43.96%	76.20%
差	-0.00%	-0.11%	-0.19%	-0.27%	-1.21%	-2.02%	-6.82%

純資産総額 334,307 百万円

※設定来の騰落率は2007年5月16日を基準に算出しています。
※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、知的所有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。

◆外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド◆



※基準価額およびベンチマークは2007年5月16日の値を10,000として計算しています。

騰落率

	1ヵ月	3ヵ月	6ヵ月	1年	3年	5年	設定来
ファンド	0.48%	1.46%	1.68%	2.22%	13.02%	6.26%	34.31%
ベンチマーク	0.46%	1.49%	1.67%	2.09%	12.97%	6.37%	34.69%
差	0.02%	-0.03%	0.00%	0.13%	0.05%	-0.11%	-0.38%

純資産総額 154,112 百万円

※設定来の騰落率は2007年5月16日を基準に算出しています。
※ベンチマークは、FTSE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。
■FTSE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FTSE Fixed Income LLCに帰属します。

○当資料は、アセットマネジメントOne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、アセットマネジメントOne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。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。

組入投信の運用状況

2019年9月末現在

■ ベストシナリオ（変額個人年金保険GF（Ⅱ型）<年金受取総額保証特約（Ⅱ型）付加>（BS世界バランス55）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、アセットマネジメントOne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に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。

DIAM世界バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）

各マザーファンド組入状況（2019年9月30日現在）

◆国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド◆

※比率は組入株式評価額に対する割合です。

組入上位10銘柄　（組入銘柄数：2124銘柄）

No.	銘柄	業種	比率(%)
1	トヨタ自動車	輸送用機器	3.54
2	ソニー	電気機器	1.87
3	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	1.64
4	日本電信電話	情報・通信業	1.52
5	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.45
6	キーエンス	電気機器	1.45
7	武田薬品工業	医薬品	1.42
8	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.13
9	本田技研工業	輸送用機器	1.04
10	任天堂	その他製品	1.01

※株式には新株予約権証券を含む場合があります。

組入上位10業種

№	業種	比率(%)
1	電気機器	14.04
2	情報・通信業	8.55
3	輸送用機器	7.86
4	化学	7.27
5	銀行業	5.87
6	医薬品	5.53
7	サービス業	5.20
8	機械	5.05
9	卸売業	4.86
10	小売業	4.80

◆国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド◆

※比率は組入債券評価額に対する割合です。

組入上位10銘柄　（組入銘柄数：399銘柄）

No.	銘柄	比率(%)
1	３５０回　利付国庫債券（１０年）	0.93
2	１３５回　利付国庫債券（５年）	0.91
3	３３８回　利付国庫債券（１０年）	0.91
4	１２８回　利付国庫債券（５年）	0.90
5	３５１回　利付国庫債券（１０年）	0.89
6	３４３回　利付国庫債券（１０年）	0.88
7	１２９回　利付国庫債券（５年）	0.87
8	３３４回　利付国庫債券（１０年）	0.86
9	３５２回　利付国庫債券（１０年）	0.85
10	３３５回　利付国庫債券（１０年）	0.85

セクター別比率

	比率
国債	78.99%
地方債	8.68%
金融債	0.33%
政保債	3.61%
社債	7.17%
円建外債	0.17%
ＭＢＳ	1.06%
ＡＢＳ	0.00%
合計	100.00%

ポートフォリオの状況

	ファンド
最終利回り	-0.08%
平均クーポン	1.03%
平均残存期間(年)	10.84
修正デュレーション	9.90

※ポートフォリオの状況は純資産総額を基に計算

◆外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド◆

※比率は組入株式評価額に対する割合です。

組入上位10銘柄　（組入銘柄数：1327銘柄）

No.	銘柄	国	業種	比率(%)
1	APPLE INC	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	2.67
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	ソフトウェア	2.66
3	AMAZON.COM INC	アメリカ	インターネット販売・通信販売	1.91
4	FACEBOOK INC	アメリカ	インタラクティブ・メディアおよびサービス	1.13
5	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	インタラクティブ・メディアおよびサービス	1.02
6	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	銀行	1.01
7	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	インタラクティブ・メディアおよびサービス	0.97
8	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	医薬品	0.91
9	NESTLE SA-REGISTERED	スイス	食品	0.88
10	PROCTER & GAMBLE CO	アメリカ	家庭用品	0.83

組入上位10カ国

№	国	比率
1	米国	65.65%
2	英国	5.92%
3	カナダ	3.88%
4	フランス	3.80%
5	スイス	3.77%
6	ドイツ	3.09%
7	オーストラリア	2.55%
8	オランダ	1.94%
9	アイルランド	1.85%
10	スペイン	1.06%

組入上位10業種

№	業種	比率
1	ソフトウェア・サービス	9.43%
2	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.97%
3	銀行	7.88%
4	資本財	7.03%
5	メディア・娯楽	5.91%
6	エネルギー	5.62%
7	食品・飲料・タバコ	5.03%
8	小売	4.88%
9	ヘルスケア機器・サービス	4.71%
10	各種金融	4.38%

※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。

◆外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド◆

※比率は組入債券評価額に対する割合です。

組入上位10銘柄　（組入銘柄数：596銘柄）

No.	銘柄	通貨	比率(%)	残存年数
1	US T N/B 2.0 05/31/21	米ドル	0.87	1.667
2	US T N/B 1.375 04/30/21	米ドル	0.80	1.583
3	US T N/B 2.125 08/15/21	米ドル	0.80	1.875
4	US T N/B 2.0 11/15/21	米ドル	0.75	2.125
5	US T N/B 2.125 12/31/21	米ドル	0.75	2.250
6	US T N/B 2.125 09/30/21	米ドル	0.72	2.000
7	US T N/B 2.5 01/31/21	米ドル	0.71	1.333
8	US T N/B 2.25 03/31/21	米ドル	0.71	1.500
9	US T N/B 1.75 12/31/20	米ドル	0.65	1.250
10	US T N/B 2.0 02/15/22	米ドル	0.61	2.375

通貨別比率

通貨	現物
ＵＳドル	47.98%
カナダ・ドル	1.84%
メキシコ・ペソ	0.74%
イギリス・ポンド	6.34%
デンマーク・クローネ	0.46%
ノルウェー・クローネ	0.18%
ユーロ	38.28%
スウェーデン・クローネ	0.31%
ポーランド・ズロチ	0.51%
オーストラリア・ドル	1.90%
シンガポール・ドル	0.41%
マレーシア・リンギット	0.49%
南アフリカ・ランド	0.53%
合計	100.00%

ポートフォリオの状況

	ファンド
最終利回り	0.98%
平均クーポン	2.77%
平均残存期間(年)	9.52
修正デュレーション	7.62

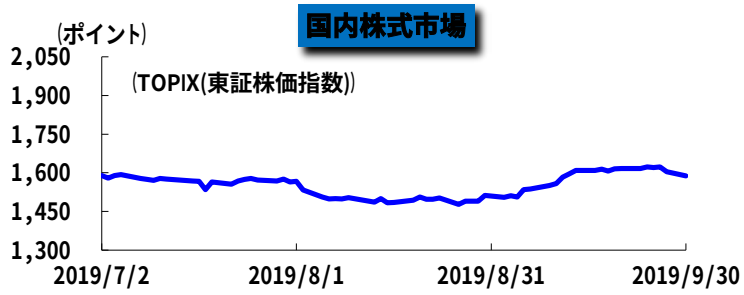
※ポートフォリオの状況は純資産総額を基に計算

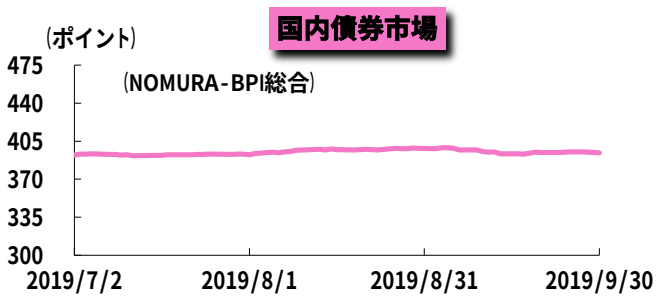
○当資料は、アセットマネジメントOne株式会社が作成したものです。
○当資料は情報提供を目的とするものであり、投資家に対する投資勧誘を目的とするものではありません。
○投資信託は、実質的に株式や債券等の値動きのある有価証券（外貨建資産には為替リスクもあります）に投資をしますので、市場環境、組入有価証券の発行者にかかる信用状況等の変化により基準価額は変動します。このため、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。
○当資料は、アセットマネジメントOne株式会社が信頼できると判断したデータにより作成しておりますが、その内容の完全性、正確性について、同社が保証するものではありません。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。

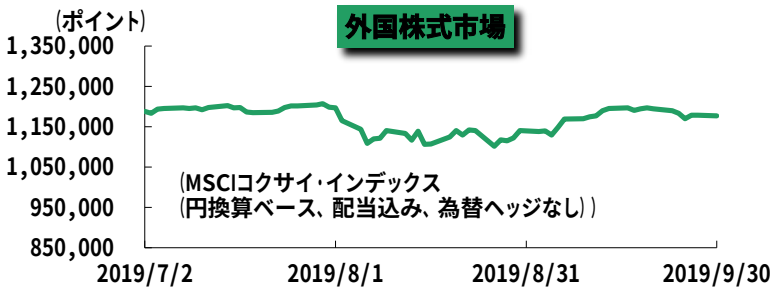
組入投信の運用状況
【運用環境】

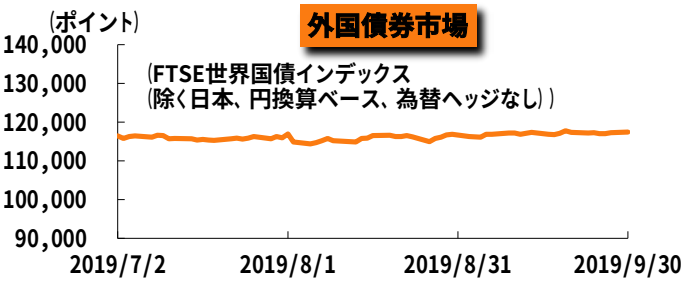
2019年9月30日現在

●主要指数の推移（直近90日）









●当月の運用環境

【国内株式】
国内株式市場は上昇しました。中旬までは、米中協議の再開を好感したことや為替市場でドル/円相場が円安の動きとなったこと等を背景に上昇しました。下旬には、国内企業業績への懸念がくすぶる中、外国株式市場の上昇が一服したこと等を背景に国内株式市場は上げ幅を縮小しました。

【国内債券】
国内債券市場では、10年国債利回りは上昇しました。月前半にかけては、米欧の国債利回りの上昇や、日銀総裁の発言等を背景に国内の10年国債利回りも上昇しました。月後半にかけては、米欧の国債利回りが低下に転じたこと等を背景に国内の10年国債利回りも低下しましたが、前月末比では上昇しました。

【外国株式】
外国株式市場は上昇しました。月前半にかけては、米中対立の緩和期待が高まったことを背景に米欧とも堅調な推移となりました。また、欧州では英国の合意なきEU離脱に対する懸念が後退したこと等も相場を支える要因となりました。下旬には、米民主党が大統領の弾劾に向けた調査を開始すると発表したことなどが上値を抑える材料となりました。

【外国債券】
外国債券市場では、米欧とも10年国債利回りは上昇しました。月前半にかけては、米中対立の緩和期待が高まったことや英国の合意なき離脱に対する懸念が後退したこと等を背景に米欧とも10年国債利回りは上昇しました。月後半に入ると、欧州中央銀行（ECB）が量的緩和策の再開を決定したことや、米民主党が大統領の弾劾に向けた調査を開始すると発表したことなどを背景に米欧とも10年国債利回りは低下に転じ徐々に上昇幅を縮小しました。

【為替】
ドル/円相場は、月前半にかけては米国の長期金利の上昇による日米金利差拡大等を背景に円安ドル高の動きとなりましたが、その後は米国の長期金利の上昇が一服するなか、方向感に欠ける動きとなりました。またユーロは、ユーロ圏の景気減速懸念がユーロ安材料となったものの、ユーロ/円相場については、欧州の長期金利の上昇が円安ユーロ高材料となり、前月末比では概ね横ばいとなりました。

■当資料は、アセットマネジメントOne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、アセットマネジメントOne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。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。

■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。

組入投信の運用状況

2019年9月30日現在

■東証株価指数（TOPIX）は、株式会社東京証券取引所（㈱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、㈱東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、㈱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、㈱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。
■NOMURA-BPI総合は、野村證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證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、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。
■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、知的所有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。
■FTSE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FTSE Fixed Income LLCに帰属します。

◆用語解説◆

■ 基準価額

投資信託に組み入れている株式や公社債などをすべて計算日の時価で評価し、債券の利息や株式の配当金などの収入を加えて資産総額を算出します。そこから投資信託の運用に必要な経費等を差し引いて純資産総額を出し、さらに計算日の受益権口数で割ったものです。

■ 参考指標

当ファンドが投資する各マザーファンドのベンチマークを、基本配分比率で合成したものを参考指標とします。

■ ファミリーファンド

ファンドが特定のファンドに投資する形態の商品設計のものをさします。受益者が購入するファンドをベビーファンド、そのファンドが投資するファンドをマザーファンドといいます。実質的な運用はマザーファンドで行うことにより運用の効率化を図っています。

■ ベンチマーク

ベンチマークとは、市場平均を表す指標のことで、運用実績の良し悪しを判断するための基準値となるものです。なお、パッシブ運用においては、定められたベンチマークの動きに連動する運用成果を目標とします。

■ デュレーション

デュレーションとは、「金利変動に対する債券価格の変動性」を意味するもので、債券デュレーションが長いほど金利変動に対する価格感応度が高くなります。このため、債券投資におけるリスク尺度として使用されています。

■ イールドカーブ

イールドカーブとは、公社債の償還までの期間（残存年数）を横軸、利回りを縦軸にとり、グラフを描き、描かれた曲線をいいます。利回り曲線とも言い、金利の期間構造の分析に用いられます。

■ クーポン

クーポンとは、債券の額面に対して毎年受取れる利息の割合のことで表面利率をあらわします。

■ 為替ヘッジ

外貨建て資産に投資する際の為替変動リスクを回避する手法のことをいいます。なお、為替変動リスクとは、為替相場は、日々変動するため、海外の市場に投資する場合や、外貨建ての金融商品に投資する場合、為替変動によって差損益が生じる可能性があることをいいます。

■当資料は、アセットマネジメントOne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、アセットマネジメントOne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。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。

■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、契約時の下記「契約初期費用」、運用期間中の下記「保険関係費用（保険契約管理費）」および「資産運用関係費用（資産運用管理費）」、年金受取期間中の下記「保険関係費用（年金管理費）」を合計した金額となります。

	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（ファンド）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（ファンド）の純資産総額に対して年率**2.45**%	特別勘定（ファンド）の純資産総額に対して年率2.45%／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（ファンド）の運用にかかる費用	特別勘定（ファンド）の投資対象となる投資信託の純資産総額に対して 年率**0.27**%（税抜0.25%）程度	特別勘定（ファンド）の投資対象となる投資信託の純資産総額に対して年率0.27%程度／365日を乗じた額を毎日控除します。
年金受取期間中	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、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

この商品は、年金額や解約払戻金等が特別勘定（ファンド）の運用実績に基づいて変動するしくみの変額個人年金保険です。特別勘定（ファンド）の資産運用には、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク、信用リスク等の投資リスクがあります。そのため、株価や債券価格の下落、為替の変動等により、年金や解約払戻金等のお受け取りになる合計額が一時払保険料の額を下回る場合があり、損失が生じるおそれがあります。

ご注意いただきたい事項

■「ベストシナリオ（変額個人年金保険GF（Ⅱ型）〈年金受取総額保証特約（Ⅱ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あり、預金とは異なります。

■「ベストシナリオ（変額個人年金保険GF（Ⅱ型）〈年金受取総額保証特約（Ⅱ型）付加〉）」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（年金受取期間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（「基本保険金額の100%」の最低保証ではありません）。また、運用期間満了前に解約した場合の解約払戻金には、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】

株式会社みずほ銀行

【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 https://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。）