

グッドニュースⅢ

2014年度（平成26年度）特別勘定の現況

●投資環境(2014年度)

日本株式市場

日経平均株価は、期初14,870円で始まりました。4月に5%から8%への消費増税が実施された直後の金融政策決定会合での現状維持決定を受け、4月中旬に同株価は今年度の安値となる13,885円まで下落しました。10月末に日銀が追加金融緩和を決定したことで外国為替市場において円安が進行し、輸出関連の大型株を中心に同株価は上昇し、12月には2007年7月以来の18,000円台まで到達しました。1月にはECBが量的緩和を3月に実施することを決定したことを好感し、米欧株価が上昇したこと等を受け、3月に日経平均株価は、2000年5月以来の今年度高値19,778円まで上昇しましたが、その後やや戻し期末は19,206円で終了しました。

外国株式市場

米国のS&P500は、期初1,873.96で始まりました。4月上旬の米企業減益決算等により、同指数は1,814.36まで一時下落しました。10月中旬にかけて世界経済の減速懸念、米国金融政策の量的緩和終了やエボラ出血熱の感染者拡大等によりリスク回避的な流れを受けて、同指数は一時1,820程度まで下落しました。12月に原油価格の急落、ロシアルーブルの急落、1月にスイスフランの急騰等を受けリスク回避的に同指数が2,000前後まで下落する局面がありましたが、その後堅調に推移し同指数は2月に史上最高値となる2,119.59をつけました。期末は若干値を戻しS&P500は2,067.89で終了しました。また、英国のFTSE100は、期初6,598.37で始まりました。10月中旬にかけて世界経済の減速懸念等によりリスク回避的な流れを受けて、同指数は一時6,072.68まで下落しました。その後は、徐々に上値を切り上げつつ堅調に推移し、同指数は3月には史上最高値となる7,065.08にまで上昇しました。その後、やや反落しFTSE100は6,773.04で終了しました。

日本債券市場

10年国債利回りは、期初0.64%で始まり、日銀の金融緩和策の買入継続等による国債の良好な需給環境を背景に、0.5%前後まで徐々に低下しました。9月には米国の早期利上げ観測や日本の株価上昇等に伴い、同利回りは0.58%程度まで上昇しました。10月末に日銀が追加金融緩和を決定すると、同利回りは0.44%程度まで低下しました。その後発表された2014年7-9月期GDPマイナス成長、消費増税の実施時期を2017年4月に確定すると安倍政権より意思表示があったことや日銀の追加緩和の効果等を受け、同利回りは1月に0.20%程度まで低下しました。1月下旬の金融政策決定会合で追加緩和策が見送られると同利回りは上昇に転じ、その後は0.30～0.50%程度の幅で推移しました。10年物国債利回りは0.40%で期末を迎えました。

外国債券市場

米国10年債利回りは、期初2.81%で始まりました。10月中旬にかけて、世界景気の減速懸念、エボラ熱感染者拡大、米国の量的緩和終了等を受けたりリスク回避的な動きから、同利回りは一時2.2%程度まで低下しました。また、年度後半に原油価格の下落が顕著となる中、インフレ率の低下、新興国経済の需要鈍化の観測等を背景に、同利回りは1月に1.64%まで低下しました。2～3月にかけては、米国労働市場の回復等を背景とする2015年内の利上げ観測等から2.2%程度まで同利回りが上昇する局面がありましたが、米国10年国債利回りは1.92%で期末を迎えました。また、ドイツ10年国債利回りは、期初1.56%で始まりました。その後、ECBによる追加緩和期待やデフレ懸念等を背景にほぼ年度を通じて同利回りの低下局面が継続しました。3月にはECBによる量的緩和導入が決定され、0.16%程度まで一段と低下しましたが、ドイツ10年国債利回りは、0.18%で期末を迎えました。

外国為替市場

ドル円相場は、期初1米ドル＝103.07円で始まりました。4月～8月までは1米ドル＝100～105円程度の狭い幅での動きが継続しましたが、9月にはGPIF改革による海外投資拡大等への期待から1米ドル＝110円程度まで円安・ドル高が進行しました。10月下旬～月末にかけFOMCにおける米国の量的緩和終了決定、日銀による追加緩和の決定等により、円安・ドル高が一段と進行し、12月には1米ドル＝122円近辺にまで到達しました。その後、3月まで1米ドル＝115～122円程度の幅で一進一退の動きが継続し、1米ドル＝119.95円で期末を迎えました。また、ユーロ円相場は、期初1ユーロ＝141.96円で始まりました。日銀の追加緩和決定による円安・ユーロ高が進行し、12月には1ユーロ＝149.78円に到達しました。その後、ECBの量的緩和導入決定等によりユーロは下落基調を強め、3月には一時1ユーロ＝126.91円まで円高・ユーロ安水準に到達し、1ユーロ＝128.68円で期末を迎えました。

●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2014年度決算(決算日：2015年3月31日)を行いました。当資料は2014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(2015年4月発行(2015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(2014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	24	504
有価証券	13	9	9,740
公社債	-	-	-
株式	-	-	-
外国証券	-	-	-
公社債	-	-	-
株式等	-	-	-
その他の証券	13	9	9,740
貸付金	-	-	-
その他	0	427	459
貸倒引当金	-	-	-
合計	14	461	10,703

※単位未満切捨て

●特別勘定の運用収支状況(2014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	3,506	6,716	176
有価証券売却益	-	-	-
有価証券償還益	-	-	-
有価証券評価益	1	3,105	186
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	-	-	5
有価証券償還損	-	-	-
有価証券評価損	3,236	4,698	43
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	271	5,123	313

※単位未満切捨て

●有価証券の売買状況(2014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)	27,724	35,800	17,288,454	18,664,976
GT バランス 40	GT インデックス 40VA (適格機関投資家限定)	18,745,344	21,688,000	68,286,389	75,897,695
GT バランス 60	GT インデックス 60VA (適格機関投資家限定)	15,114,437	17,298,000	7,073,340	7,939,295

※単位未満切捨て

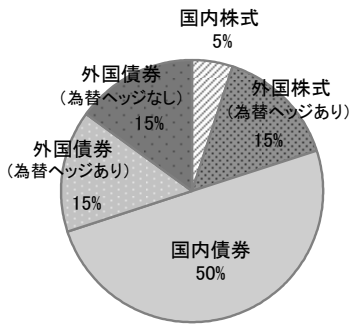
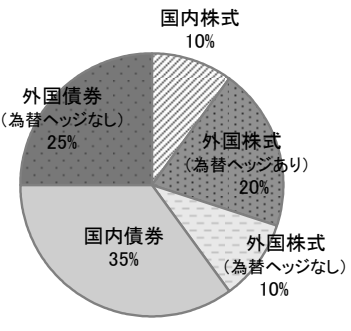
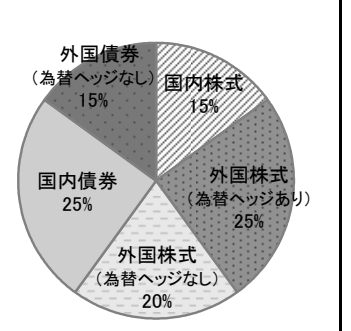
●保有契約高(2014年度末)

(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	1,792	10,315

※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。		
主な投資対象となる投資信託と運用会社	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。 
	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 ^{*2}		
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*3}		
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 ^{*4}	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 ^{*5}		

*1 適格機関投資家限定

*2 2014年4月1日付で、商号が「東京海上アセットマネジメント投信株式会社」から「東京海上アセットマネジメント株式会社」に変更となりました。

*3 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。

*4 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。

*5 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。

※ 2015年3月28日付で、名称が「ゴールドマン・サックス・スペシャライズド・インベストメンツ」から「スペシャライズド・インベストメンツSIF」に変更となりました。

・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。

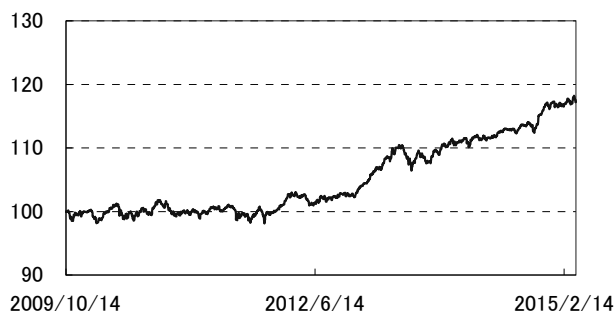
・当資料中の運用実績に関するいかなる内容も過去の実績であり、将来の運用成果を示唆あるいは保証するものではありません。

特別勘定の運用状況

2015年3月末現在

GTバランス20

●ユニットプライスの推移



●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	13	95.6%
現預金その他	0	4.4%
純資産総額	14	100.0%

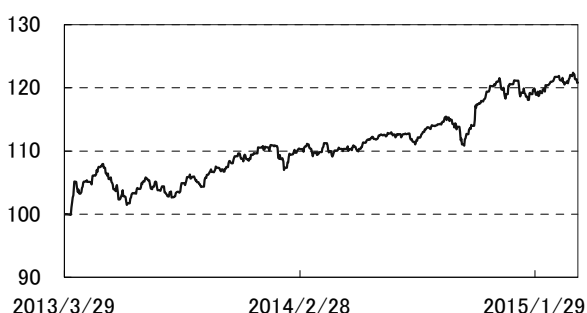
●ユニットプライスの期間収益率 ※1

	ユニットプライス	前月比
2014年4月30日	111.47	0.04%
2014年5月31日	112.36	0.79%
2014年6月30日	113.02	0.59%
2014年7月31日	113.02	0.00%
2014年8月31日	113.65	0.55%
2014年9月30日	113.91	0.23%
2014年10月31日	113.68	-0.20%
2014年11月30日	116.46	2.45%
2014年12月31日	117.26	0.68%
2015年1月31日	116.67	-0.50%
2015年2月28日	117.74	0.91%
2015年3月31日	117.36	-0.32%

1か月	3か月	6か月	1年	設定来
-0.32%	0.09%	3.03%	5.32%	17.38%

GTバランス40

●ユニットプライスの推移



●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	9	2.0%
現預金その他	451	98.0%
純資産総額	461	100.0%

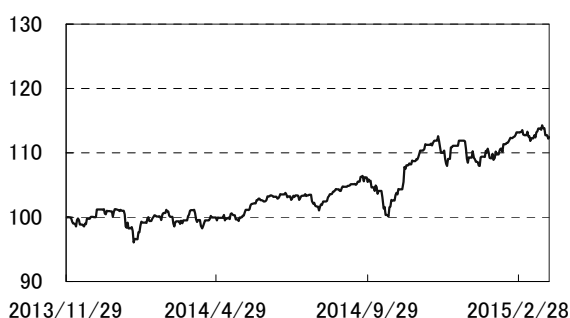
●ユニットプライスの期間収益率 ※1

	ユニットプライス	前月比
2014年4月30日	109.97	0.12%
2014年5月31日	111.30	1.21%
2014年6月30日	112.30	0.90%
2014年7月31日	112.72	0.37%
2014年8月31日	113.74	0.90%
2014年9月30日	115.06	1.17%
2014年10月31日	114.00	-0.92%
2014年11月30日	120.23	5.47%
2014年12月31日	121.16	0.77%
2015年1月31日	118.89	-1.87%
2015年2月28日	121.72	2.38%
2015年3月31日	120.80	-0.75%

1か月	3か月	6か月	1年	設定来
-0.75%	-0.29%	4.99%	9.98%	20.81%

GTバランス60

●ユニットプライスの推移



●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	9,740	95.1%
現預金その他	504	4.9%
純資産総額	10,244	100.0%

●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
2014年4月30日	99.47	-0.01%
2014年5月31日	101.12	1.65%
2014年6月30日	102.87	1.74%
2014年7月31日	103.36	0.47%
2014年8月31日	104.31	0.92%
2014年9月30日	105.86	1.49%
2014年10月31日	104.33	-1.45%
2014年11月30日	111.22	6.60%
2014年12月31日	111.90	0.61%
2015年1月31日	109.17	-2.44%
2015年2月28日	113.16	3.65%
2015年3月31日	112.46	-0.62%

1か月	3か月	6か月	1年	設定来
-0.62%	0.50%	6.23%	13.04%	12.46%

※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。

【組入投資信託の運用概況】

2015年3月31日現在

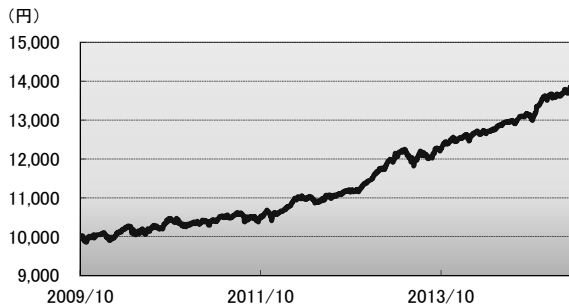
GTインデックス20VA<適格機関投資家限定>

運用レポート(2015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。
基準価額は信託報酬控除後です。

騰落率(税引前分配金再投資)

	1ヵ月 (2015/2/27)	3ヵ月 (2014/12/30)	6ヵ月 (2014/9/30)	1年 (2014/3/31)	設定来 (2009/10/14)
当ファンド	-0.09%	+0.81%	+4.68%	+8.74%	+37.75%

※ 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場合があります。

基準価額・純資産総額

基準価額	13,775円
純資産総額	14百万円
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	99.3
短期金融資産など	0.7
合計	100.0

※ 短期金融資産などは、組入資産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。

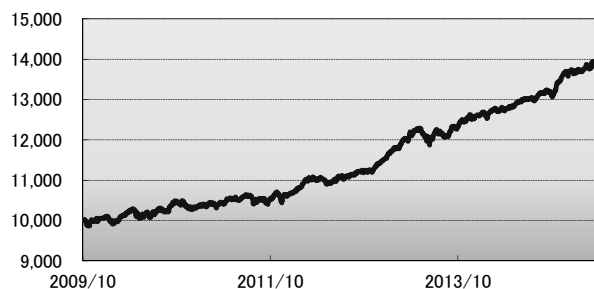
分配対象額が少額の場合などには、分配を行わない場合があります。

《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ボ取引を通じて、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

14百万円

騰落率(税引前分配金再投資)

	1ヵ月 (2015/2/27)	3ヵ月 (2014/12/30)	6ヵ月 (2014/9/30)	1年 (2014/3/31)	設定来 (2009/10/14)
グローバル・トラッカー20	-0.08%	+0.85%	+4.73%	+8.74%	+38.49%

■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】

2015年3月31日現在

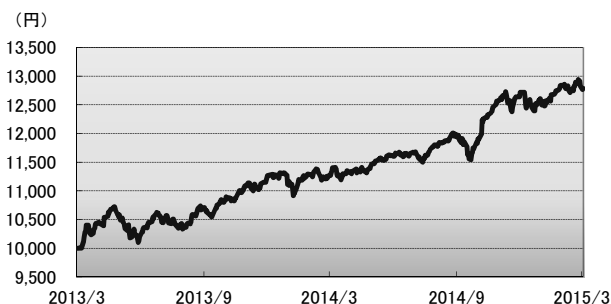
GTインデックス40VA＜適格機関投資家限定＞

運用レポート(2015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 (2015/2/27)	3ヵ月 (2014/12/30)	6ヵ月 (2014/9/30)	1年 (2014/3/31)	設定来 (2013/3/29)
当ファンド	-0.41%	+0.55%	+6.78%	+13.52%	+27.87%

※ 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場合があります。
※ 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	12,787円
純資産総額	11百万円
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	14.0
短期金融資産など	86.0
合計	100.0

※ 短期金融資産などは、組入資産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。

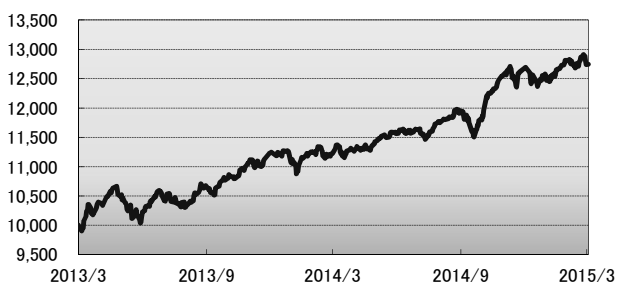
※ 分配金額は、収益配分方針に基づいて委託会社が決定します。
※ 分配対象額が少額の場合などには、分配を行わない場合があります。

《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

5百万円

騰落率(税引前分配金再投資)

	1ヵ月 (2015/2/27)	3ヵ月 (2014/12/30)	6ヵ月 (2014/9/30)	1年 (2014/3/31)	設定来 (2013/3/29)
グローバル・トラッカー40	-0.51%	+0.43%	+6.69%	+13.52%	+27.43%

※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】

2015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(2015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SIF」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	11,766円
純資産総額	9,741百万円
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	104.0
短期金融資産など	-4.0
合計	100.0

※ 短期金融資産などは、組入保有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か月 (2015/2/27)	3か月 (2014/12/30)	6か月 (2014/9/30)	1年 (2014/3/31)	設定来 (2013/11/29)
当ファンド	-0.31%	+1.33%	+8.05%	+16.70%	+17.67%

※ 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。

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	9,733百万円
-------	----------

騰落率(税引前分配金再投資)

	1か月 (2015/2/27)	3か月 (2014/12/30)	6か月 (2014/9/30)	1年 (2014/3/31)	設定来 (2013/11/29)
グローバル・トラッカー60	-0.30%	+1.35%	+8.41%	+16.99%	+18.80%

※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】

2015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。

MEMO

Handwriting practice lines consisting of 40 horizontal dotted lines.

MEMO

Handwriting practice lines consisting of 40 horizontal dotted lines.

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になります。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い合わせ



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。)



200101