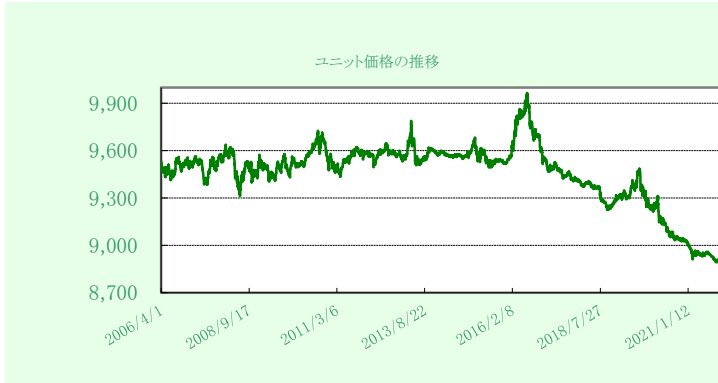


特別勘定名 **日本債券** MONTHLY REPORT(2021年12月31日現在)

特別勘定の運用概況

● ユニット価格とユニット価格騰落率の状況(単位:円、%)



	ユニット価格	騰落率
2021年1月31日	8983.0475	-0.36
2021年2月28日	8910.9674	-0.80
2021年3月31日	8944.5588	0.38
2021年4月30日	8945.8421	0.01
2021年5月31日	8937.4465	-0.09
2021年6月30日	8932.3000	-0.06
2021年7月31日	8951.7324	0.22
2021年8月31日	8939.2090	-0.14
2021年9月30日	8915.8084	-0.26
2021年10月31日	8897.3471	-0.21
2021年11月30日	8898.8481	0.02
2021年12月31日	8872.2880	-0.30
直近3ヶ月	-	-0.49
直近6ヶ月	-	-0.67
直近1年	-	-1.58
設定来	-	-11.28

・騰落率は、小数点第3位を四捨五入しています。

● 特別勘定資産の内訳(単位:百万円、%)

区分	金額	構成比
現預金・コールローン	0	33.2
有価証券等		
フコク日本債券ファンドVA	1	66.8
合計	2	100.0

・金額は、百万円未満を切り捨てて表示しています。  
・構成比は、小数点第2位を四捨五入しています。

ユニット価格は、特別勘定において投資信託受益証券の他に保険契約の異動等に備えて一定の現預金等を資産として保有していることおよびユニット価格の算出に当たり、保険関係費用等の諸費用を控除すること等により、特別勘定の主な投資対象である投資信託の基準価格とは異なります。

特別勘定の主な投資対象である投資信託の運用概況

【投資信託名】フコク日本債券ファンドVA〔適格機関投資家専用〕

【運用会社】明治安田アセットマネジメント株式会社

【運用方針】わが国の公社債を中心に投資を行い、ベンチマーク(NOMURA-BPI総合)を中長期的に上回る運用成果を目指します。

また、投資にあたっては、信用リスクを管理しながら、最終利回りを重視した銘柄選択を行い、マクロ経済分析をベースに、中長期的視点でデュレーションをコントロールし、付加価値を追求します。

以上の運用は、「フコク日本債券マザーファンド」受益証券への投資を通じて行われます。

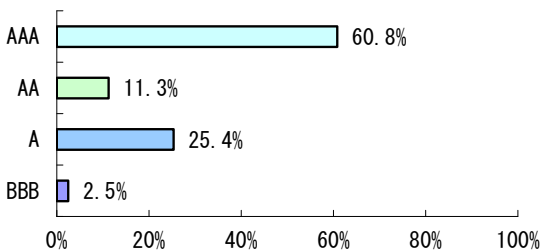
◆◆マザーファンド公社債種別構成比  
(組入資産に対する比率)

	マザーファンド	ベンチマーク
国債	58.3%	83.8%
地方債	2.5%	6.3%
政府保証債	-	1.8%
金融債	-	0.3%
事業債	39.2%	6.0%
その他	-	1.8%

◆◆マザーファンド公社債組入上位10銘柄

	銘柄名	ウェイト	残存年数
1	第136回利付国債5年	8.03%	1.4年
2	第356回利付国債10年	6.45%	7.7年
3	第154回利付国債20年	6.35%	13.7年
4	第166回利付国債20年	5.93%	16.7年
5	第146回利付国債5年	4.28%	3.9年
6	第147回利付国債20年	4.24%	11.9年
7	第139回利付国債5年	3.39%	2.2年
8	第41回利付国債30年	2.80%	21.9年
9	第59回利付国債30年	2.67%	26.4年
10	第16回楽天グループ無担保社債	2.50%	4.9年

◆◆マザーファンド公社債格付構成比



(注) 格付けはR&I, JCR, S&P, Moody'sの最も高いものを採用しています

◆◆マザーファンド公社債残存別構成比

(組入資産に対する比率)

	マザーファンド	ベンチマーク
1年未満	-	-
短期(1年~3年)	20.3%	19.9%
中期(3年~7年)	26.0%	26.6%
長期(7年~11年)	18.0%	17.9%
超長期(11年超)	35.7%	35.6%

※このレポートはご契約者に特別勘定の運用状況を開示するためのものであり、募集を目的とするものではありません。また、上記の表とグラフ等はいずれも過去の実績を示したものであり、現在または将来の運用成果・内容を保証するものではありません。

[引受保険会社]  
富国生命保険相互会社