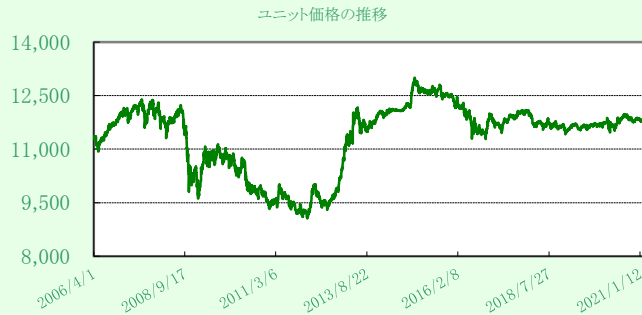


特別勘定名 外国債券 MONTHLY REPORT(2021年3月31日現在)

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
2020年4月29日	11617.4439	-0.67
2020年5月30日	11722.1562	0.90
2020年6月29日	11798.8100	0.65
2020年7月30日	11886.6780	0.74
2020年8月30日	11934.4039	0.40
2020年9月29日	11832.1115	-0.86
2020年10月30日	11765.7307	-0.56
2020年11月29日	11817.6386	0.44
2020年12月30日	11863.7901	0.39
2021年1月30日	11828.7253	-0.30
2021年2月28日	11757.0792	-0.61
2021年3月31日	11883.4271	1.07
直近3ヶ月	-	0.17
直近6ヶ月	-	0.43
直近1年	-	1.60
設定来	-	18.83

*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	40.4
有価証券等		
安田外国債券ファンドVA	0	59.6
合計	0	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】明治安田VA外国債券ファンド〔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】日本を除く主要国の公社債を主要投資対象とし、ベンチマーク(シティグループ世界国債インデックス(日本を除く)円ベース)

を中長期的に上回る投資成果を目指します。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。

以上の運用は、「明治安田外国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。

【国別組入比率】 (%)	債券比率		通貨比率	
	マザーファンド	ベンチマーク	マザーファンド	ベンチマーク
米国	44.3	44.4	44.5	44.4
カナダ	2.4	2.0	2.4	2.0
オーストラリア	2.1	2.2	2.1	2.2
その他ドル圏	—	—	—	—
ドル圏計	48.8	48.6	49.1	48.6
ユーロ圏	37.8	41.0	38.1	41.0
その他欧州	1.7	1.8	1.7	1.8
欧州大陸計	39.5	42.7	39.8	42.7
英国	6.3	6.5	6.3	6.5
日本	—	—	3.1	—
その他地域	1.7	2.2	1.7	2.2
キャッシュ	3.7	—	—	—
合計	100.0	100.0	100.0	100.0

【組入上位10銘柄】	【組入銘柄数:10銘柄】				
	銘柄名	償還日	種類	組入比率	
1	US TREASURY N/B 0.625% 30/8/15	2030/08/15	国債	9.9%	
2	US TREASURY N/B 1.625% 26/2/15	2026/02/15	国債	9.8%	
3	US TREASURY N/B 2.5% 24/5/15	2024/05/15	国債	9.5%	
4	SPANISH GOV'T 2.15% 25/10/31	2025/10/31	国債	4.8%	
5	UK TSY GILT 1.75% 49/1/22	2049/01/22	国債	3.8%	
6	FRANCE O.A.T. 2.75% 27/10/25	2027/10/25	国債	3.1%	
7	BTPS 0.95% 23/3/15	2023/03/15	国債	2.5%	
8	FRANCE O.A.T. 3.25% 45/5/25	2045/05/25	国債	2.4%	
9	US TREASURY N/B 2.5% 45/2/15	2045/02/15	国債	2.3%	
10	BTPS 4.75% 28/9/1	2028/09/01	国債	2.3%	

【組入債券格付内訳】 (%)	AAA	AA	A	BBB	BB	その他	合計
マザーファンド	52.7	20.0	13.7	13.5	—	—	100.0
ベンチマーク	59.6	22.9	7.1	10.4	—	—	100.0

※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