

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／債券	
信託期間	無期限（2001年12月20日設定）	
運用方針	主として公社債への投資を行うことにより、安定した収益の確保を目指して運用を行います。	
主要運用対象	フコク日本債券ファンド	わが国の公社債を主要投資対象とするフコク日本債券マザーファンドを主要投資対象とします。なお、公社債に直接投資する場合があります。
	フコク日本債券マザーファンド	わが国の公社債を主要投資対象とします。
組入制限	フコク日本債券ファンド	株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は信託財産の純資産総額の5%以下とします。外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
	フコク日本債券マザーファンド	株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は信託財産の純資産総額の5%以下とします。外貨建資産への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
分配方針	年1回（毎年7月15日。休業日の場合は翌営業日。）決算を行い、基準価額水準・市況動向等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わないこともあります。	

フコク日本債券ファンド

運用報告書（全体版）

第22期

（決算日 2023年7月18日）

受益者のみなさまへ

平素は「フコク日本債券ファンド」にご投資いただき、厚くお礼申し上げます。

さて、当ファンドは、第22期の決算を行いましたので、期中の運用状況につきましてご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますよう、お願い申し上げます。

MYAM 明治安田アセットマネジメント株式会社

東京都千代田区大手町二丁目3番2号
ホームページ <https://www.myam.co.jp/>

〈運用報告書のお問い合わせ先〉

サポートデスク 0120-565787

（受付時間：営業日の午前9時～午後5時）

◎最近5期の運用実績

決算期	基準価額			NOMURA-BPI総合		債券組入比率	純資産総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率		
	円	円	%		%	%	百万円
(第18期) 2019年7月16日	12,258	20	1.5	391.86	2.2	97.9	4,796
(第19期) 2020年7月15日	11,980	20	△2.1	386.50	△1.4	99.1	4,715
(第20期) 2021年7月15日	11,996	20	0.3	388.77	0.6	98.9	4,791
(第21期) 2022年7月15日	11,538	20	△3.7	376.81	△3.1	99.1	4,533
(第22期) 2023年7月18日	11,268	0	△2.3	372.58	△1.1	98.7	4,363

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注3) NOMURA-BPI総合は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表する、国内で発行された公募利付債券の市場全体の動向を表す投資収益指数で、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社の知的財産です。野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、当ファンドの運用成果等に関し、一切責任はありません。

◎当期中の基準価額と市況等の推移

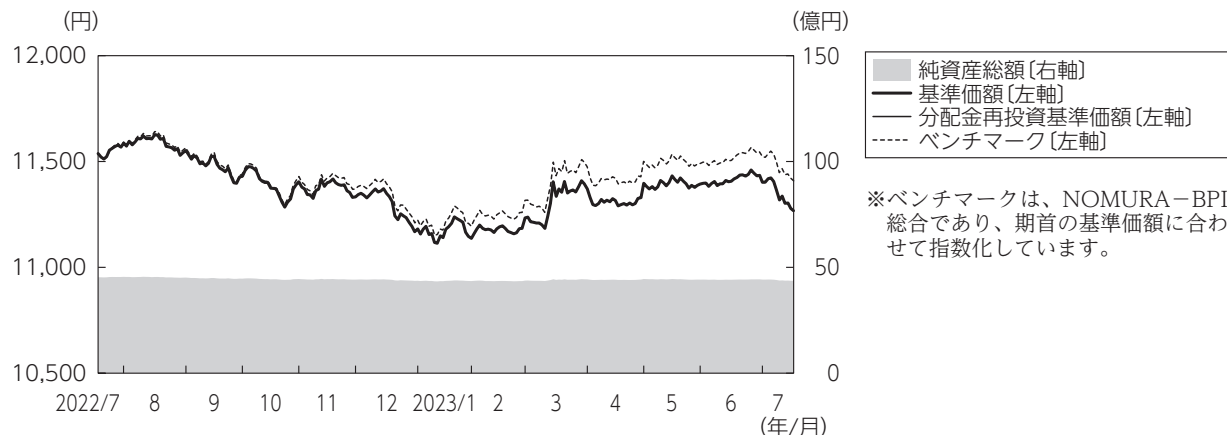
年月日	基準価額		NOMURA-BPI総合		債券組入比率
		騰落率	(ベンチマーク)	騰落率	
	円	%		%	%
(期首)2022年7月15日	11,538	—	376.81	—	99.1
7月末	11,587	0.4	378.55	0.5	98.8
8月末	11,552	0.1	377.66	0.2	98.7
9月末	11,430	△0.9	373.60	△0.9	98.7
10月末	11,404	△1.2	373.24	△0.9	98.9
11月末	11,333	△1.8	371.32	△1.5	98.6
12月末	11,182	△3.1	366.59	△2.7	98.8
2023年1月末	11,137	△3.5	365.59	△3.0	98.7
2月末	11,234	△2.6	369.57	△1.9	98.7
3月末	11,371	△1.4	374.74	△0.5	98.8
4月末	11,397	△1.2	375.60	△0.3	98.7
5月末	11,393	△1.3	375.26	△0.4	98.8
6月末	11,402	△1.2	376.28	△0.1	98.8
(期末)2023年7月18日	11,268	△2.3	372.58	△1.1	98.7

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」は実質比率を記載しております。

運用経過の説明

■ 基準価額等の推移



第22期首(2022年7月15日)：11,538円

第22期末(2023年7月18日)：11,268円(既払分配金0円)

騰落率：△2.3%(分配金再投資ベース)

※分配金再投資基準価額は分配金実績があった場合、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

※分配金を再投資するかどうかについては、お客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客さまの損益の状況を示すものではありません。

■ 基準価額の主な変動要因

ファンドの運用方針に従い、マザーファンドを通じてわが国の公社債に投資を行いました。投資対象資産の価格変動等による基準価額の変動要因は以下の通りとなりました。

(下落要因)

- ・保有する事業債の信用スプレッドが大幅に拡大したこと

■投資環境

当期の国内債券市場で長期金利は上昇（債券価格は下落）しました。期首から12月中旬にかけて0.25%近辺での推移が続いた後、12月下旬に日銀がイールドカーブ・コントロールにおける長期金利の許容変動幅の拡大を決定したことから、大きく上昇しました。その後、2023年3月中旬には欧米での金融システム不安などを背景とした海外金利の低下を受けて0.20%台まで低下する場面がありました。4月上旬には、10年債入札が低調な結果となったことなどから上昇したものの、4月末の日銀金融政策決定会合において、現行の金融緩和政策の維持が決定されたことから大きく低下しました。7月に入り日銀による政策修正への警戒感が高まる中、上昇基調で推移し期末は0.480%で終了しました。

■当該投資信託のポートフォリオ

フコク日本債券ファンド

期首の運用方針に基づき、フコク日本債券マザーファンドの投資比率を高位に維持しました。なお、マザーファンドの運用に関して、富国生命投資顧問株式会社に国内公社債等の運用指図に関する権限を委託しております。

フコク日本債券マザーファンド

期首の運用方針に基づき、わが国の公社債を主要投資対象とし、公社債の組入比率は、原則として高位を維持しました。

デュレーション・残存期間構成は投資方針に基づき、機動的にコントロールしました。当期末のデュレーションは9.4年とベンチマークの9.1年に対してやや長めとしました。

事業債については、信用スプレッドに魅力のある銘柄を購入し、事業債のオーバーウェイト幅を拡大しました。

当期末の一般債（国債以外の銘柄）の組入比率は45.8%となり、国債のベンチマークに対するアンダーウェイト幅は30.6ポイントとしました。

【債券特性】

期首

	デュレーション	終利(複利)	平均残存年数
マザーファンド	8.6年	0.5%	9.2年
ベンチマーク	9.2年	0.3%	10.1年

期末

	デュレーション	終利(複利)	平均残存年数
マザーファンド	9.4年	1.0%	10.5年
ベンチマーク	9.1年	0.5%	10.2年

【債券種類】

期首

	組入比率
国債	56.0%
事業債	41.4%
地方債	1.3%
MBS	1.3%

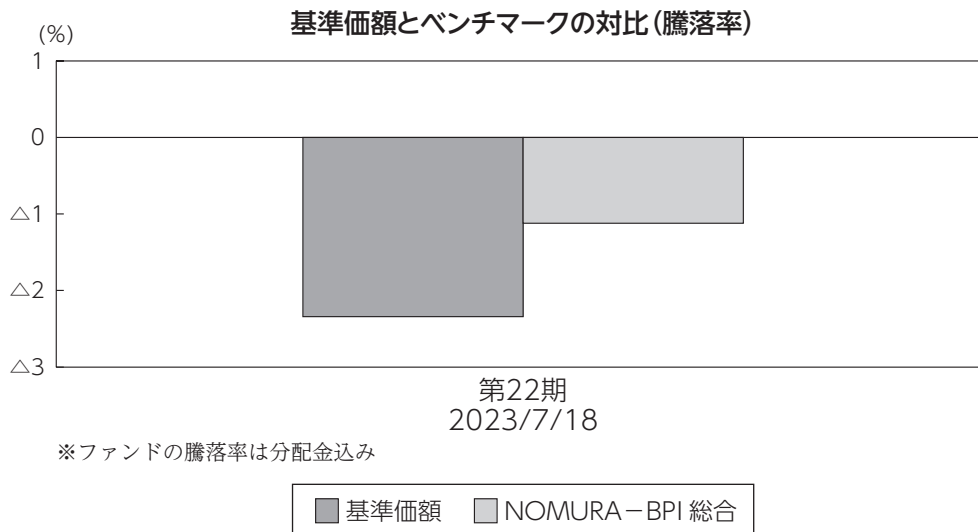
期末

	組入比率
国債	54.2%
事業債	43.4%
地方債	1.3%
MBS	1.2%

※組入比率は債券評価金額合計に対する割合です。

※組入比率は債券評価金額合計に対する割合です。

■当該投資信託のベンチマークとの差異



当期の基準価額の騰落率（分配金込み）は $\Delta 2.3\%$ になりました。ベンチマークの騰落率は $\Delta 1.1\%$ となり、騰落率の差異は $\Delta 1.2\%$ となりました。この差異に関する主な要因は以下の通りです。

(プラス要因)

- ・ 事業債をオーバーウェイトとしていたこと

(マイナス要因)

- ・ 保有する中期ゾーンの事業債の信用スプレッドが大幅に拡大したこと
- ・ 超長期ゾーンをアンダーウェイトとしていたこと
- ・ 信託報酬等のファンド運用上の諸費用を計上したこと

■ 分配金

- ・ 収益分配については、分配対象額の水準、基準価額水準等を勘案し、見送りとさせていただきます。
- ・ 収益分配にあてず信託財産内に留保した利益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

分配原資の内訳

(単位：円・%、1万口当たり、税引前)

項目	第22期
	(2022年7月16日~2023年7月18日)
当期分配金	—
(対基準価額比率)	—
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	2,565

(注1) 対基準価額比率は当期分配金(税込み)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注2) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

今後の運用方針

フコク日本債券ファンド

引き続き、フコク日本債券マザーファンドの投資比率を高位に維持する方針です。

なお、マザーファンドの運用に関して、富国生命投資顧問株式会社に国内公社債等の運用指図に関する権限を委託します。

フコク日本債券マザーファンド

引き続き、わが国の公社債を主要投資対象とし、公社債の組入比率は、原則として高位を維持します。

デュレーションは、景気・物価情勢や金融・財政政策、需給動向などに対する見通しを基に、やや短めから長めの範囲で機動的にコントロールする方針です。

残存期間構成は、イールドカーブの見通しに基づき、当初は長期・超長期ゾーンのアンダーウェイトを基本とし、その後は、機動的にコントロールする方針です。

種別構成は、事業債の対ベンチマークでの現状のオーバーウェイト幅を基本とし、信用スプレッド動向を注視しながら、オーバーウェイト幅をコントロールする方針です。

個別銘柄は、企業の信用力評価や信用スプレッド判断をもとに、魅力のある銘柄を購入する一方、個別銘柄の損益状況やファンド特性等を考慮して、売却を検討する方針です。

◎1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2022年7月16日～2023年7月18日)		
	金額	比率	
(a)信託報酬	69 円	0.610 %	(a)信託報酬＝期中の平均基準価額×期末の信託報酬率 ※期中の平均基準価額は11,368円です。
(投信会社)	(40)	(0.355)	ファンドの運用、基準価額の算出、法定書類の作成等の対価
(販売会社)	(25)	(0.222)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
(受託会社)	(4)	(0.033)	ファンド財産の管理、投信会社からの指図の実行等の対価
(b)その他費用	0	0.003	(b)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(監査費用)	(0)	(0.002)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(その他)	(0)	(0.001)	信託事務の処理等に要する諸費用、信託財産に関する租税等
合 計	69	0.613	

(注1)期中の費用(消費税等のかかるものは消費税等を含む)は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。なお、その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

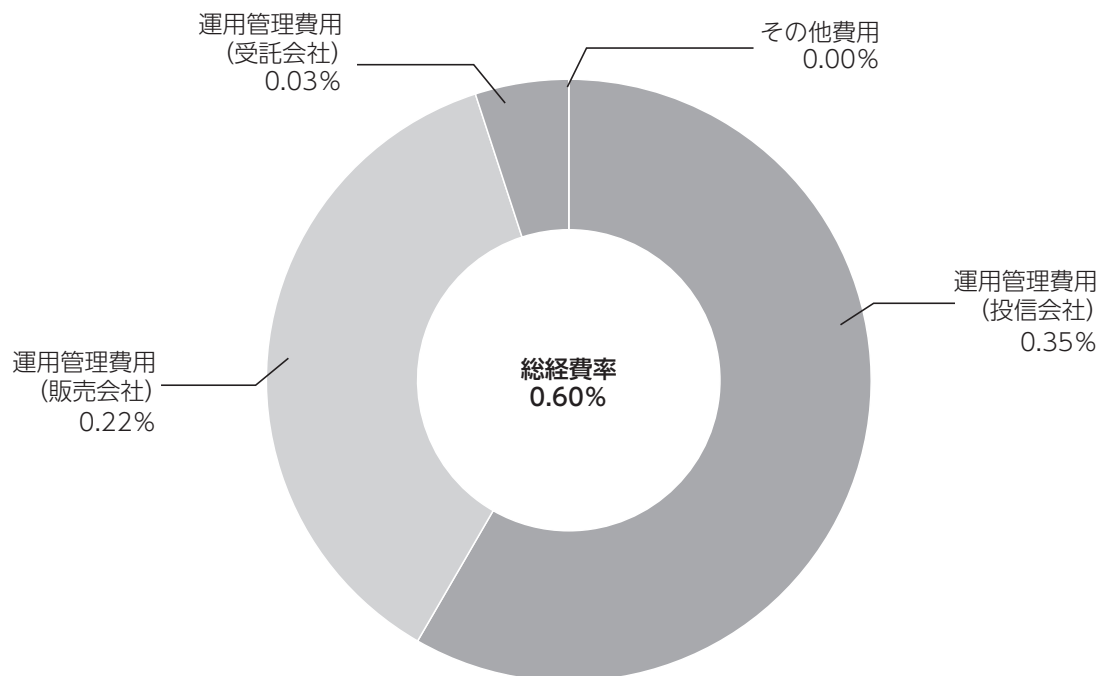
(注2)消費税は報告日の税率を採用しています。

(注3)各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注4)各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

(参考情報) 総経費率

期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.60%です。



(注) 費用は、1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

◎**売買及び取引の状況**(2022年7月16日～2023年7月18日)

○親投資信託の設定、解約状況

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
フコク日本債券マザーファンド	71,193	94,910	145,293	194,290

(注)単位未満は切り捨て。

◎**利害関係人との取引状況等**(2022年7月16日～2023年7月18日)

期中の利害関係人との取引はございません。

(注)利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

◎**組入資産明細表**

○親投資信託残高

種 類	期 首	当 期	末
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
フコク日本債券マザーファンド	3,346,925	3,272,825	4,337,475

(注1)口数・評価額の単位未満は切り捨て。

(注2)フコク日本債券マザーファンド全体の当期末受益権口数は(5,785,774千口)です。

◎投資信託財産の構成

2023年7月18日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
フコク日本債券マザーファンド	4,337,475	99.0
コール・ローン等、その他	41,822	1.0
投資信託財産総額	4,379,297	100.0

(注)評価額の単位未満は切り捨て。

◎資産、負債、元本及び基準価額の状況

2023年7月18日現在

項 目	当 期 末
(A)資 産	4,379,297,644円
コール・ローン等	41,822,354
フコク日本債券マザーファンド(評価額)	4,337,475,290
(B)負 債	15,641,328
未払解約金	2,243,711
未払信託報酬	13,348,694
未払利息	114
その他未払費用	48,809
(C)純資産総額(A - B)	4,363,656,316
元 本	3,872,741,973
次期繰越損益金	490,914,343
(D)受益権総口数	3,872,741,973口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,268円

◎損益の状況

自 2022年7月16日
至 2023年7月18日

項 目	当 期
(A)配 当 等 収 益	△ 5,506円
受 取 利 息	19
支 払 利 息	△ 5,525
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△ 71,704,138
売 買 益	5,316,534
売 買 損	△ 77,020,672
(C)信 託 報 酬 等	△ 27,149,137
(D)当期損益金(A + B + C)	△ 98,858,781
(E)前期繰越損益金	61,154,398
(F)追加信託差損益金	528,618,726
(配 当 等 相 当 額)	(663,475,268)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△134,856,542)
(G)計 (D + E + F)	490,914,343
(H)収 益 分 配 金	0
次期繰越損益金(G + H)	490,914,343
追加信託差損益金	528,618,726
(配 当 等 相 当 額)	(663,660,411)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△135,041,685)
分 配 準 備 積 立 金	329,723,957
繰 越 損 益 金	△367,428,340

(注1)当ファンドの期首元本額は3,928,780,382円、期中追加設定元本額は380,593,685円、期中一部解約元本額は436,632,094円です。

(注2)1口当たり純資産額は1.1268円です。

(注3)損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注4)損益の状況の中で(C)信託報酬等には信託報酬等に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注5)損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注6)計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(663,660,411円)および分配準備積立金(329,723,957円)より分配対象収益は993,384,368円(10,000口当たり2,565円)ですが、当期に分配した金額はありません。

(注7)信託財産の運用指図に係る権限の一部を委託するために要した費用は、9,290,222円です。

フコク日本債券マザーファンド

運用報告書

第22期

(決算日 2023年7月18日)

「フコク日本債券マザーファンド」は、2023年7月18日に第22期決算を行いました。
以下、当マザーファンドの第22期の運用状況をご報告申し上げます。

当マザーファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	主として公社債への投資を行うことにより、安定した収益の確保を目指して運用を行います。
主要運用対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
組入制限	株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は信託財産の純資産総額の5%以下とします。 外貨建資産への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

◎最近5期の運用実績

決算期	基準価額		NOMURA-BPI総合		債券組入比率	純資産総額
		期中騰落率	(ベンチマーク)	期中騰落率		
	円	%		%	%	百万円
(第18期) 2019年 7月16日	14,005	2.1	391.86	2.2	98.4	7,635
(第19期) 2020年 7月15日	13,792	△1.5	386.50	△1.4	99.3	7,545
(第20期) 2021年 7月15日	13,918	0.9	388.77	0.6	99.4	7,973
(第21期) 2022年 7月15日	13,490	△3.1	376.81	△3.1	99.5	7,703
(第22期) 2023年 7月18日	13,253	△1.8	372.58	△1.1	99.3	7,667

(注)NOMURA-BPI総合は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表する、国内で発行された公募利付債券の市場全体の動向を表す投資収益指数で、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社の知的財産です。野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、当ファンドの運用成果等に関し、一切責任はありません。

◎当期中の基準価額と市況等の推移

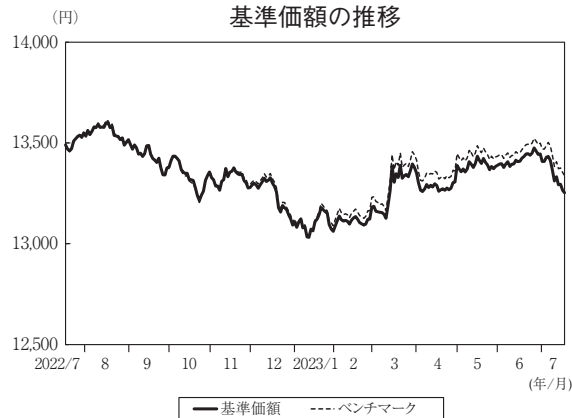
年 月 日	基準価額		NOMURA-BPI総合		債券組入比率
		騰落率	(ベンチマーク)	騰落率	
	円	%		%	%
(期首)2022年 7月15日	13,490	—	376.81	—	99.5
7月末	13,550	0.4	378.55	0.5	99.3
8月末	13,516	0.2	377.66	0.2	99.2
9月末	13,380	△0.8	373.60	△0.9	99.2
10月末	13,356	△1.0	373.24	△0.9	99.3
11月末	13,279	△1.6	371.32	△1.5	99.1
12月末	13,108	△2.8	366.59	△2.7	99.4
2023年 1月末	13,062	△3.2	365.59	△3.0	99.2
2月末	13,182	△2.3	369.57	△1.9	99.3
3月末	13,351	△1.0	374.74	△0.5	99.2
4月末	13,388	△0.8	375.60	△0.3	99.2
5月末	13,390	△0.7	375.26	△0.4	99.2
6月末	13,408	△0.6	376.28	△0.1	99.3
(期末)2023年 7月18日	13,253	△1.8	372.58	△1.1	99.3

(注)騰落率は期首比です。

◎当期中の運用経過と今後の運用方針(2022年7月16日～2023年7月18日)

1 基準価額

(1) 基準価額の推移と主な変動要因



※ベンチマークはNOMURA-BPI総合であり、期首の基準価額に合わせ指数化しております。

基準価額は期首13,490円で始まり期末13,253円で終わりました。騰落率は $\Delta 1.8\%$ でした。

基準価額の主な変動要因は以下の通りです。

(下落要因)

- ・保有する事業債の信用スプレッドが大幅に拡大したこと

<投資環境>

当期の国内債券市場で長期金利は上昇(債券価格は下落)しました。期首から12月中旬にかけて0.25%近辺での推移が続いた後、12月下旬に日銀がイールドカーブ・コントロールにおける長期金利の許容変動幅の拡大を決定したこと、大きく上昇しました。その後、2023年3月中旬には欧米での金融システム不安などを背景とした海外金利の低下を受けて0.20%台まで低下する場面がありました。4月上旬には、10年債入札が低調な結果となったことなどから上昇したものの、4月末の日銀金融政策決定会合において、現行の金融緩和政策の維持が決定されたことから大きく低下しました。7月に入り日銀による政策修正への警戒感が高まる中、上昇基調で推移し期末は0.480%で終了しました。

(2) ベンチマークとの差異

基準価額の騰落率は $\Delta 1.8\%$ になりました。一方、ベンチマークの騰落率は $\Delta 1.1\%$ となり、騰落率の差異は $\Delta 0.6\%$ となりました。この差異に関する主な要因は以下の通りです。

(プラス要因)

- ・事業債をオーバーウェイトとしていたこと

(マイナス要因)

- ・保有する中期ゾーンの事業債の信用スプレッドが大幅に拡大したこと
- ・超長期ゾーンをアンダーウェイトとしていたこと

2 運用経過

運用概況

期首の運用方針に基づき、わが国の公社債を主要投資対象とし、公社債の組入比率は、原則として高位を維持しました。

なお、富国生命投資顧問株式会社に国内公社債等の運用指図に関する権限を委託しております。

デュレーション・残存期間構成は投資方針に基づき、機動的にコントロールしました。当期末のデュレーションは9.4年とベンチマークの9.1年に対してやや長めとしました。

事業債については、信用スプレッドに魅力のある銘柄を購入し、事業債のオーバーウェイト幅を拡大しました。

当期末の一般債(国債以外の銘柄)の組入比率は45.8%となり、国債のベンチマークに対するアンダーウェイト幅は30.6ポイントとしました。

【債券特性】

期首

	デュレーション	終利(複利)	平均残存年数
マザーファンド	8.6年	0.5%	9.2年
ベンチマーク	9.2年	0.3%	10.1年

期末

	デュレーション	終利(複利)	平均残存年数
マザーファンド	9.4年	1.0%	10.5年
ベンチマーク	9.1年	0.5%	10.2年

【債券種類】

期首

	組入比率
国債	56.0%
事業債	41.4%
地方債	1.3%
MBS	1.3%

※組入比率は債券評価金額合計に対する割合です。

期末

	組入比率
国債	54.2%
事業債	43.4%
地方債	1.3%
MBS	1.2%

※組入比率は債券評価金額合計に対する割合です。

3 今後の運用方針

引き続き、わが国の公社債を主要投資対象とし、公社債の組入比率は、原則として高位を維持します。

なお、富国生命投資顧問株式会社に国内公社債等の運用指図に関する権限を委託します。

デュレーションは、景気・物価情勢や金融・財政政策、需給動向などに対する見通しを基に、やや短めから長めの範囲で機動的にコントロールする方針です。

残存期間構成は、イールドカーブの見通しに基づき、当初は長期・超長期ゾーンのアンダーウェイトを基本とし、その後は、機動的にコントロールする方針です。

種別構成は、事業債の対ベンチマークでの現状のオーバーウェイト幅を基本とし、信用スプレッド動向を注視しながら、オーバーウェイト幅をコントロールする方針です。

個別銘柄は、企業の信用力評価や信用スプレッド判断をもとに、魅力のある銘柄を購入する一方、個別銘柄の損益状況やファンド特性等を考慮して、売却を検討する方針です。

◎1万口当たりの費用明細

項 目	当 期		項目の概要
	(2022年7月16日～2023年7月18日)		
	金額	比率	
(a)その他費用	0 円	0.001 %	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 ※期中の平均基準価額は13,330円です。
(その他)	(0)	(0.001)	信託事務の処理等に要する諸費用、信託財産に関する租税等
合 計	0	0.001	

(注1) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注2) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

◎売買及び取引の状況(2022年7月16日～2023年7月18日)

○公社債

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国 内	国 債 証 券	5,594,554	5,659,511
	特 殊 債 券	—	—
	社債券（投資法人債券を含む）	698,700	(4,839)
			499,383

(注1) 金額は受渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注2) 単位未満は切り捨て。

(注3) ()内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注4) 社債券（投資法人債券を含む）には新株予約権付社債（転換社債）は含まれておりません。

◎利害関係人との取引状況等(2022年7月16日～2023年7月18日)

期中の利害関係人との取引はございません。

(注) 利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

◎組入資産明細表

○国内(邦貨建)公社債(種類別)

区 分	当 期				末		
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	う ち B B 格 以 下 組 入 比 率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
					5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
	千 円	千 円	%	%	%	%	%
国 債 証 券	4,320,000	4,124,379	53.8	—	47.3	6.5	—
地 方 債 証 券	100,000	97,996	1.3	—	1.3	—	—
特殊債券(除く金融債)	93,895	90,985	1.2	—	1.2	—	—
普通社債券(含む投資法人債券)	3,400,000	3,302,305	43.1	—	11.1	20.3	11.7
合 計	7,913,895	7,615,665	99.3	—	60.8	26.9	11.7

(注1)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注2)単位未満は切り捨て。

(注3)—印は組み入れなし。

(注4)評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

○国内(邦貨建)公社債(銘柄別)

銘 柄 名	当 期		末		償還年月日
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	額 面 金 額	
	%	千 円	千 円	千 円	
(国債証券)					
第147回 利付国債 (5年)	0.005	50,000	50,060		2026/ 3/20
第 8回 利付国債 (40年)	1.4	70,000	69,617		2055/ 3/20
第 10回 利付国債 (40年)	0.9	100,000	85,619		2057/ 3/20
第 14回 利付国債 (40年)	0.7	150,000	116,221		2061/ 3/20
第348回 利付国債 (10年)	0.1	450,000	451,120		2027/ 9/20
第358回 利付国債 (10年)	0.1	460,000	455,022		2030/ 3/20
第363回 利付国債 (10年)	0.1	670,000	654,817		2031/ 6/20
第 41回 利付国債 (30年)	1.7	220,000	241,808		2043/12/20
第 54回 利付国債 (30年)	0.8	260,000	236,256		2047/ 3/20
第 67回 利付国債 (30年)	0.6	280,000	232,117		2050/ 6/20
第 74回 利付国債 (30年)	1.0	280,000	254,998		2052/ 3/20
第154回 利付国債 (20年)	1.2	220,000	232,859		2035/ 9/20
第160回 利付国債 (20年)	0.7	320,000	315,862		2037/ 3/20
第166回 利付国債 (20年)	0.7	170,000	165,350		2038/ 9/20
第172回 利付国債 (20年)	0.4	310,000	282,214		2040/ 3/20
第179回 利付国債 (20年)	0.5	310,000	280,432		2041/12/20
小 計		4,320,000	4,124,379		
(地方債証券)					
第801回 東京都公募公債	0.085	100,000	97,996		2029/12/20
(特殊債券(除く金融債))					
第178回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.48	93,895	90,985		2057/ 3/10

当		期		末		
銘	柄	名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
(普通社債券(含む投資法人債券))			%	千円	千円	
第370回	北海道電力	(一般担保付)	0.33	100,000	95,333	2031/ 5/23
第 31回	東京電力パワーグリッド	(一般担保付)	0.98	100,000	99,902	2029/10/ 9
第 38回	東京電力パワーグリッド	(一般担保付)	0.58	100,000	100,106	2025/ 7/16
第 39回	東京電力パワーグリッド	(一般担保付)	1.08	100,000	99,766	2030/ 7/16
第 42回	東京電力パワーグリッド	(一般担保付)	1.13	100,000	98,720	2032/10/ 8
第 47回	東京電力パワーグリッド	(一般担保付)	0.68	100,000	95,763	2031/ 8/29
第 1回	東京電力リニューアブルパワー		0.18	100,000	99,778	2024/ 9/ 9
第 23回	大和ハウス工業無担保社債	(特定社債間限定同順位特約付)	0.3	100,000	97,069	2030/ 9/13
第 32回	三菱ケミカルホールディングス無担保社債		0.23	100,000	99,307	2027/ 2/26
第 19回	Zホールディングス無担保社債		0.35	100,000	98,990	2026/ 7/28
第 15回	楽天グループ無担保社債		0.5	100,000	94,593	2024/12/ 2
第 16回	楽天グループ無担保社債		0.6	200,000	162,738	2026/12/ 2
第 17回	楽天グループ無担保社債		0.8	100,000	71,093	2028/12/ 1
第 22回	パナソニック無担保社債		0.29	100,000	98,792	2027/12/24
第 67回	日産自動車無担保社債		1.015	100,000	100,022	2026/ 1/20
第 17回	N T T ファイナンス無担保社債		0.28	100,000	99,611	2027/12/20
第 52回	日産フィナンシャルサービス無担保社債		0.28	100,000	99,673	2024/ 9/20
第 23回	S B I ホールディングス無担保社債		0.73	100,000	100,039	2023/12/ 1
第 27回	S B I ホールディングス無担保社債		0.8	100,000	99,958	2024/12/23
第 32回	S B I ホールディングス無担保社債		1.1	100,000	100,370	2025/12/ 5
第 35回	S B I ホールディングス無担保社債		1.15	200,000	199,778	2028/ 6/ 6
第 22回	ポケットカード無担保社債		0.3	100,000	99,568	2025/10/29
第 41回	リコーリース無担保社債		0.14	100,000	99,494	2026/ 4/17
第 14回	イオンフィナンシャルサービス無担保社債		0.29	100,000	100,036	2024/ 2/ 2
第 16回	イオンフィナンシャルサービス無担保社債		0.27	100,000	99,653	2025/ 6/24
第 39回	ジャックス無担保社債		0.555	100,000	100,002	2027/ 7/16
第 27回	オリエントコーポレーション無担保社債		0.33	100,000	99,662	2026/ 1/22
第 33回	オリエントコーポレーション無担保社債		0.839	100,000	100,627	2028/ 3/ 6
第135回	三菱地所無担保社債		0.26	100,000	95,867	2031/ 6/20
第 65回	西日本旅客鉄道無担保社債		0.24	100,000	96,722	2030/ 8/27
第 3回	近鉄エクスプレス無担保社債		0.34	100,000	99,593	2025/ 9/10
第 8回	ピー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債		0.499	100,000	99,680	2024/12/12
小 計				3,400,000	3,302,305	
合 計				7,913,895	7,615,665	

(注)額面・評価額の単位未満は切り捨て。

◎投資信託財産の構成

2023年7月18日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公 社 債	7,615,665	97.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	168,833	2.2
投 資 信 託 財 産 総 額	7,784,498	100.0

(注)評価額の単位未満は切り捨て。

◎資産、負債、元本及び基準価額の状況

2023年7月18日現在

項 目	当 期 末
(A)資 産	7,784,498,316円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	41,080,412
公 社 債 (評 価 額)	7,615,665,793
未 収 入 金	118,091,600
未 収 利 息	8,762,341
前 払 費 用	898,170
(B)負 債	116,880,069
未 払 金	116,879,600
未 払 利 息	112
そ の 他 未 払 費 用	357
(C)純 資 産 総 額 (A - B)	7,667,618,247
元 本	5,785,774,619
次 期 繰 越 損 益 金	1,881,843,628
(D)受 益 権 総 口 数	5,785,774,619口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	13,253円

◎損益の状況

自 2022年7月16日
至 2023年7月18日

項 目	当 期
(A)配 当 等 収 益	40,555,351円
受 取 利 息	40,562,875
支 払 利 息	△ 7,524
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△ 177,149,999
売 買 益	11,693,920
売 買 損	△ 188,843,919
(C)信 託 報 酬 等	△ 47,517
(D)当 期 損 益 金 (A + B + C)	△ 136,642,165
(E)前 期 繰 越 損 益 金	1,993,027,016
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	93,554,195
(G)解 約 差 損 益 金	△ 68,095,418
(H)計 (D + E + F + G)	1,881,843,628
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	1,881,843,628

(注1)当親ファンドの期首元本額は5,710,357,680円、期中追加設定元本額は278,625,805円、期中一部解約元本額は203,208,866円です。

(注2)当親ファンドの当期末元本の内訳は、フコク日本債券ファンド3,272,825,240円、フコク株50大河1,055,917,525円、フコク株25大河972,396,457円、フコク株75大河484,635,397円です。

(注3)1口当たり純資産額は1,3253円です。

(注4)損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注5)損益の状況の中で(C)信託報酬等には信託報酬等に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注6)損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注7)損益の状況の中で(G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。