

Aコース (為替ヘッジあり・毎月)

Bコース (為替ヘッジなし・毎月)

Cコース (為替ヘッジあり・年2回)

Dコース (為替ヘッジなし・年2回)

愛称：アメリカン・フロート

■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／海外／その他資産（貸付債権）
信託期間	2013年9月12日から無期限です。
運用方針	投資信託証券への投資を通じて、主として米ドル建ての銀行貸付債権に投資を行い、安定的な金利収入の確保と信託財産の成長をめざして運用を行います。
主要投資対象	投資信託証券（外国籍投資信託証券および国内投資信託証券（親投資信託を含みます。）を含みます。）を主要投資対象とします。 ・ケイマン籍外国投資信託「マニユライフ・インベストメンツ・トラスト・フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA」 ・親投資信託「マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド」
主な投資制限	①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 ②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ③同一銘柄の投資信託証券への投資割合には制限を設けません。
分配方針	毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。 ①分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 ②収益分配金額は、委託会社が基準価額の水準・市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合等には、分配を行わないことがあります。

## 運用報告書（全体版）

Aコース (為替ヘッジあり・毎月) /  
Bコース (為替ヘッジなし・毎月)

第91期 (決算日 2021年4月5日)  
第92期 (決算日 2021年5月6日)  
第93期 (決算日 2021年6月7日)  
第94期 (決算日 2021年7月5日)  
第95期 (決算日 2021年8月5日)  
第96期 (決算日 2021年9月6日)

Cコース (為替ヘッジあり・年2回) /  
Dコース (為替ヘッジなし・年2回)  
第16期 (決算日 2021年9月6日)

### －受益者のみなさまへ－

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。  
さて、「マニユライフ・変動高金利戦略ファンド Aコース (為替ヘッジあり・毎月) / Bコース (為替ヘッジなし・毎月)」は第96期、「マニユライフ・変動高金利戦略ファンド Cコース (為替ヘッジあり・年2回) / Dコース (為替ヘッジなし・年2回)」は第16期の決算を行いました。  
ここに、各期中の運用状況をご報告申し上げます。今後とも一層のお引立てを賜りますようお願い申し上げます。

マニユライフ・インベストメント・マネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-8-1 丸の内トラストタワーN館

お問い合わせ先

サポートダイヤル：03-6267-1901

受付時間：営業日の午前9時～午後5時

ホームページアドレス：www.mamj.co.jp/

## 【Aコース】

### ■最近5作成期の運用実績

作成期	決算期	基準価額			参考指数		株式組入比率	債券組入比率	投資信託証券比率	純資産総額	
		(分配落)	税込分配金	期中騰落率		騰落率					
第12作成期	67期（2019年4月5日）	円 7,639	円 40	% △ 0.4		% 12,521	0.4	% —	0.0	% 98.9	百万円 1,311
	68期（2019年5月7日）	7,661	40	0.8	12,657	1.1	—	0.0	97.7	1,275	
	69期（2019年6月5日）	7,564	40	△ 0.7	12,623	△ 0.3	—	0.0	97.1	1,229	
	70期（2019年7月5日）	7,534	25	△ 0.1	12,663	0.3	—	0.0	97.0	1,185	
	71期（2019年8月5日）	7,527	25	0.2	12,744	0.6	—	0.0	97.6	1,168	
	72期（2019年9月5日）	7,462	25	△ 0.5	12,716	△ 0.2	—	0.0	96.3	1,138	
第13作成期	73期（2019年10月7日）	7,414	25	△ 0.3	12,719	0.0	—	0.0	97.1	1,119	
	74期（2019年11月5日）	7,362	25	△ 0.4	12,711	△ 0.1	—	0.0	97.7	1,084	
	75期（2019年12月5日）	7,337	25	0.0	12,804	0.7	—	0.0	99.4	1,049	
	76期（2020年1月6日）	7,370	25	0.8	12,993	1.5	—	0.0	98.0	1,030	
	77期（2020年2月5日）	7,342	25	△ 0.0	13,044	0.4	—	0.0	97.9	995	
第14作成期	78期（2020年3月5日）	7,202	25	△ 1.6	12,895	△ 1.1	—	0.0	96.9	976	
	79期（2020年4月6日）	6,290	25	△12.3	11,250	△12.8	—	0.0	102.5	851	
	80期（2020年5月7日）	6,480	25	3.4	11,757	4.5	—	0.0	96.7	877	
	81期（2020年6月5日）	6,747	25	4.5	12,355	5.1	—	0.0	100.2	909	
	82期（2020年7月6日）	6,702	25	△ 0.3	12,388	0.3	—	0.0	99.2	890	
	83期（2020年8月5日）	6,768	25	1.4	12,612	1.8	—	0.0	96.9	928	
第15作成期	84期（2020年9月7日）	6,856	25	1.7	12,866	2.0	—	0.0	99.2	926	
	85期（2020年10月5日）	6,786	25	△ 0.7	12,871	0.0	—	0.0	98.2	907	
	86期（2020年11月5日）	6,788	25	0.4	12,931	0.5	—	0.0	96.5	900	
	87期（2020年12月7日）	6,883	25	1.8	13,232	2.3	—	0.0	97.7	896	
	88期（2021年1月5日）	6,900	25	0.6	13,361	1.0	—	0.0	96.9	886	
	89期（2021年2月5日）	6,923	25	0.7	13,534	1.3	—	0.0	99.4	875	
第16作成期	90期（2021年3月5日）	6,913	25	0.2	13,597	0.5	—	0.0	99.4	790	
	91期（2021年4月5日）	6,874	25	△ 0.2	13,612	0.1	—	0.0	102.0	772	
	92期（2021年5月6日）	6,861	25	0.2	13,679	0.5	—	0.0	98.8	762	
	93期（2021年6月7日）	6,863	25	0.4	13,757	0.6	—	0.0	98.1	741	
	94期（2021年7月5日）	6,843	25	0.1	13,809	0.4	—	0.0	100.9	732	
	95期（2021年8月5日）	6,801	25	△ 0.2	13,805	△ 0.0	—	0.0	97.8	722	
96期（2021年9月6日）	6,797	25	0.3	13,885	0.6	—	0.0	98.2	716		

（注1）基準価額は1万円当たり、騰落率は分配金込みです。

（注2）当ファンドの参考指数は、クレディ・スイス・レパレッジド・ローン・インデックス（配当込み/米ドルベース）（以下Aコースにおいて、参考指数といいます。）です。当参考指数は、ファンドの設定日の前営業日を10,000として、委託会社が算出したものです。

（注3）当ファンドは親投資信託を組入れますので、「株式組入比率」、「債券組入比率」は実質比率を記載しております。

#### 参考指数に関して

クレディ・スイス・レパレッジド・ローン・インデックスは、クレディ・スイス証券が算出する、銀行貸付債権の値動きを示す代表的な指数です。

## ■ 当作成期中の基準価額と市況等の推移

決算期	年 月 日	基 準 価 額		参 考 指 数		株 式 組 入 比 率	債 券 組 入 比 率	投 資 信 託 証 券 比 率
		円	騰 落 率		騰 落 率			
第91期	(期 首) 2021年3月5日	6,913	—	13,597	—	—	0.0	99.4
	3月末	6,901	△0.2	13,608	0.1	—	0.0	101.7
	(期 末) 2021年4月5日	6,899	△0.2	13,612	0.1	—	0.0	102.0
第92期	(期 首) 2021年4月5日	6,874	—	13,612	—	—	0.0	102.0
	4月末	6,888	0.2	13,678	0.5	—	0.0	97.8
	(期 末) 2021年5月6日	6,886	0.2	13,679	0.5	—	0.0	98.8
第93期	(期 首) 2021年5月6日	6,861	—	13,679	—	—	0.0	98.8
	5月末	6,885	0.3	13,748	0.5	—	0.0	99.4
	(期 末) 2021年6月7日	6,888	0.4	13,757	0.6	—	0.0	98.1
第94期	(期 首) 2021年6月7日	6,863	—	13,757	—	—	0.0	98.1
	6月末	6,866	0.0	13,801	0.3	—	0.0	99.7
	(期 末) 2021年7月5日	6,868	0.1	13,809	0.4	—	0.0	100.9
第95期	(期 首) 2021年7月5日	6,843	—	13,809	—	—	0.0	100.9
	7月末	6,827	△0.2	13,805	△0.0	—	0.0	97.1
	(期 末) 2021年8月5日	6,826	△0.2	13,805	△0.0	—	0.0	97.8
第96期	(期 首) 2021年8月5日	6,801	—	13,805	—	—	0.0	97.8
	8月末	6,819	0.3	13,867	0.5	—	0.0	97.5
	(期 末) 2021年9月6日	6,822	0.3	13,885	0.6	—	0.0	98.2

(注1) 騰落率は期首比です。(期末基準価額は分配金を含みます。)

(注2) 基準価額は1万円当たりで表示しています。

(注3) 当ファンドの参考指数は、クレディ・スイス・レバレッジド・ローン・インデックス（配当込み/米ドルベース）です。当参考指数は、ファンドの設定日の前営業日を10,000として、委託会社が算出したものです。

(注4) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、「株式組入比率」、「債券組入比率」は実質比率を記載しております。

## 【Bコース】

### ■最近5作成期の運用実績

作成期	決算期	基準価額			参考指数		株式組入比率	債券組入比率	投資信託証券比率	純資産総額
		(分配落)	税込分配金	期中騰落率		騰落率				
第12作成期	67期（2019年4月5日）	円 8,711	円 60	% △ 0.3	13,955	% 0.3	% —	% 0.0	% 97.7	百万円 5,107
	68期（2019年5月7日）	8,659	60	0.1	13,965	0.1	—	0.0	98.8	4,913
	69期（2019年6月5日）	8,360	60	△ 2.8	13,606	△ 2.6	—	0.0	98.9	4,694
	70期（2019年7月5日）	8,298	60	△ 0.0	13,621	0.1	—	0.0	97.9	4,542
	71期（2019年8月5日）	8,161	60	△ 0.9	13,510	△ 0.8	—	0.0	98.6	4,393
	72期（2019年9月5日）	8,081	60	△ 0.2	13,489	△ 0.2	—	0.0	97.7	4,261
第13作成期	73期（2019年10月7日）	8,039	60	0.2	13,533	0.3	—	0.0	97.5	4,126
	74期（2019年11月5日）	8,112	60	1.7	13,784	1.9	—	0.0	97.5	4,047
	75期（2019年12月5日）	8,076	60	0.3	13,899	0.8	—	0.0	98.6	3,848
	76期（2020年1月6日）	8,045	60	0.4	14,002	0.7	—	0.0	98.1	3,676
	77期（2020年2月5日）	8,091	60	1.3	14,233	1.7	—	0.0	97.7	3,591
第14作成期	78期（2020年3月5日）	7,775	60	△ 3.2	13,822	△ 2.9	—	0.0	97.5	3,400
	79期（2020年4月6日）	6,867	60	△ 10.9	12,219	△ 11.6	—	0.0	97.5	2,955
	80期（2020年5月7日）	6,864	60	0.8	12,454	1.9	—	0.0	98.4	2,956
	81期（2020年6月5日）	7,301	60	7.2	13,435	7.9	—	0.0	97.5	3,148
	82期（2020年7月6日）	7,135	60	△ 1.5	13,293	△ 1.1	—	0.0	99.3	3,049
	83期（2020年8月5日）	7,037	60	△ 0.5	13,277	△ 0.1	—	0.0	97.6	2,969
第15作成期	84期（2020年9月7日）	7,144	60	2.4	13,641	2.7	—	0.0	97.6	2,979
	85期（2020年10月5日）	6,991	60	△ 1.3	13,548	△ 0.7	—	0.0	97.6	2,867
	86期（2020年11月5日）	6,876	60	△ 0.8	13,443	△ 0.8	—	0.0	97.5	2,776
	87期（2020年12月7日）	6,927	60	1.6	13,728	2.1	—	0.0	97.5	2,718
	88期（2021年1月5日）	6,854	60	△ 0.2	13,738	0.1	—	0.0	98.3	2,629
	89期（2021年2月5日）	6,999	60	3.0	14,238	3.6	—	0.0	97.7	2,663
第16作成期	90期（2021年3月5日）	7,106	60	2.4	14,625	2.7	—	0.0	97.6	2,671
	91期（2021年4月5日）	7,212	60	2.3	15,013	2.7	—	0.0	97.3	2,682
	92期（2021年5月6日）	7,083	60	△ 1.0	14,908	△ 0.7	—	0.0	97.5	2,608
	93期（2021年6月7日）	7,068	60	0.6	15,026	0.8	—	0.0	98.1	2,564
	94期（2021年7月5日）	7,113	60	1.5	15,301	1.8	—	0.0	96.9	2,584
	95期（2021年8月5日）	6,945	60	△ 1.5	15,090	△ 1.4	—	0.0	98.8	2,467
96期（2021年9月6日）	6,918	60	0.5	15,202	0.7	—	0.0	97.4	2,458	

（注1）基準価額は1万円当たり、騰落率は分配金込みです。

（注2）当ファンドの参考指数は、クレディ・スイス・レバレッジド・ローン・インデックス（配当込み/円換算ベース/三菱UFJ銀行T M）（以下Bコースにおいて、参考指数といたします。）です。当参考指数は、ファンドの設定日の前営業日を10,000として委託会社が算出したものです。

（注3）当ファンドは親投資信託を組入れますので、「株式組入比率」、「債券組入比率」は実質比率を記載しております。

参考指数に関して

クレディ・スイス・レバレッジド・ローン・インデックスは、クレディ・スイス証券が算出する、銀行貸付債権の値動きを示す代表的な指数です。

## ■ 当作成期中の基準価額と市況等の推移

決算期	年 月 日	基準 価 額		参 考 指 数		株 式 組 入 比 率	債 券 組 入 比 率	投 資 信 託 証 券 比 率
		騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率			
第91期	(期 首) 2021年3月5日	円 7,106	% —	14,625	% —	% —	% 0.0	% 97.6
	3月末	7,278	2.4	15,017	2.7	—	0.0	96.6
	(期 末) 2021年4月5日	7,272	2.3	15,013	2.7	—	0.0	97.3
第92期	(期 首) 2021年4月5日	7,212	—	15,013	—	—	0.0	97.3
	4月末	7,120	△1.3	14,852	△1.1	—	0.0	98.2
	(期 末) 2021年5月6日	7,143	△1.0	14,908	△0.7	—	0.0	97.5
第93期	(期 首) 2021年5月6日	7,083	—	14,908	—	—	0.0	97.5
	5月末	7,136	0.7	15,042	0.9	—	0.0	98.4
	(期 末) 2021年6月7日	7,128	0.6	15,026	0.8	—	0.0	98.1
第94期	(期 首) 2021年6月7日	7,068	—	15,026	—	—	0.0	98.1
	6月末	7,136	1.0	15,212	1.2	—	0.0	98.6
	(期 末) 2021年7月5日	7,173	1.5	15,301	1.8	—	0.0	96.9
第95期	(期 首) 2021年7月5日	7,113	—	15,301	—	—	0.0	96.9
	7月末	6,995	△1.7	15,067	△1.5	—	0.0	97.7
	(期 末) 2021年8月5日	7,005	△1.5	15,090	△1.4	—	0.0	98.8
第96期	(期 首) 2021年8月5日	6,945	—	15,090	—	—	0.0	98.8
	8月末	6,978	0.5	15,191	0.7	—	0.0	96.6
	(期 末) 2021年9月6日	6,978	0.5	15,202	0.7	—	0.0	97.4

(注1) 騰落率は期首比です。(期末基準価額は分配金を含みます。)

(注2) 基準価額は1万円当たりで表示しています。

(注3) 当ファンドの参考指数は、クレディ・スイス・レバレッジド・ローン・インデックス（配当込み/円換算ベース/三菱UFJ銀行T T M）です。当参考指数は、ファンドの設定日の前営業日を10,000として、委託会社が算出したものです。

(注4) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、「株式組入比率」、「債券組入比率」は実質比率を記載しております。

## 【Cコース】

### ■最近5期の運用実績

決算期	基準価額			参考指数		株式組入比率	債券組入比率	投資信託証券比率	純資産総額
	(分配落)	税込 分配金	期中 騰落率	騰落率	騰落率				
	円	円	%		%	%	%	%	百万円
12期(2019年9月5日)	10,206	0	△0.7	12,716	1.9	—	0.1	96.6	131
13期(2020年3月5日)	10,059	0	△1.4	12,895	1.4	—	0.1	96.8	106
14期(2020年9月7日)	9,771	0	△2.9	12,866	△0.2	—	0.1	98.4	91
15期(2021年3月5日)	10,063	0	3.0	13,597	5.7	—	0.2	99.2	69
16期(2021年9月6日)	10,109	0	0.5	13,885	2.1	—	0.2	97.0	65

(注1) 基準価額は1万口当たり、騰落率は分配金込みです。

(注2) 当ファンドの参考指数は、クレディ・スイス・レバレッジド・ローン・インデックス（配当込み/米ドルベース）（以下Cコースにおいて、参考指数といいます。）です。当参考指数は、ファンドの設定日の前営業日を10,000として、委託会社が算出したものです。

(注3) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、「株式組入比率」、「債券組入比率」は実質比率を記載しております。

参考指数に関して

クレディ・スイス・レバレッジド・ローン・インデックスは、クレディ・スイス証券が算出する、銀行貸付債権の値動きを示す代表的な指数です。

### ■当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		参考指数		株式組入比率	債券組入比率	投資信託証券比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率			
(期首) 2021年3月5日	円	%		%	%	%	%
	10,063	—	13,597	—	—	0.2	99.2
3月末	10,050	△0.1	13,608	0.1	—	0.2	101.6
4月末	10,066	0.0	13,678	0.6	—	0.2	96.7
5月末	10,095	0.3	13,748	1.1	—	0.2	97.9
6月末	10,105	0.4	13,801	1.5	—	0.2	98.7
7月末	10,081	0.2	13,805	1.5	—	0.2	98.0
8月末	10,105	0.4	13,867	2.0	—	0.2	96.7
(期末) 2021年9月6日	10,109	0.5	13,885	2.1	—	0.2	97.0

(注1) 騰落率は期首比です。（期末基準価額は分配金を含みます。）

(注2) 基準価額は1万口当たりで表示しています。

(注3) 当ファンドの参考指数は、クレディ・スイス・レバレッジド・ローン・インデックス（配当込み/米ドルベース）です。当参考指数は、ファンドの設定日の前営業日を10,000として、委託会社が算出したものです。

(注4) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、「株式組入比率」、「債券組入比率」は実質比率を記載しております。

## 【Dコース】

### ■最近5期の運用実績

決算期	基準価額			参考指数		株式組入比率	債券組入比率	投資信託証券比率	純資産総額
	(分配額)	税込分配金	期中騰落率	騰落率	騰落率				
	円	円	%		%	%	%	%	百万円
12期(2019年9月5日)	11,756	0	△4.1	13,489	△3.1	—	0.0	97.0	277
13期(2020年3月5日)	11,826	0	0.6	13,822	2.5	—	0.0	96.9	233
14期(2020年9月7日)	11,444	0	△3.2	13,641	△1.3	—	0.1	98.6	218
15期(2021年3月5日)	11,989	0	4.8	14,625	7.2	—	0.1	98.0	196
16期(2021年9月6日)	12,277	0	2.4	15,202	3.9	—	0.1	96.9	163

(注1) 基準価額は1万円当たり、騰落率は分配金込みです。

(注2) 当ファンドの参考指数は、クレディ・スイス・レパレジッド・ローン・インデックス（配当込み／円換算ベース／三菱UFJ銀行T T M）（以下Dコースにおいて、参考指数といたします。）です。当参考指数は、ファンドの設定日の前営業日を10,000として、委託会社が算出したものです。

(注3) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、「株式組入比率」、「債券組入比率」は実質比率を記載しております。

参考指数に関して

クレディ・スイス・レパレジッド・ローン・インデックスは、クレディ・スイス証券が算出する、銀行貸付債権の値動きを示す代表的な指数です。

### ■当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		参考指数		株式組入比率	債券組入比率	投資信託証券比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率			
(期首) 2021年3月5日	円	%		%	%	%	%
	11,989	—	14,625	—	—	0.1	98.0
3月末	12,279	2.4	15,017	2.7	—	0.1	97.8
4月末	12,114	1.0	14,852	1.6	—	0.1	97.2
5月末	12,244	2.1	15,042	2.9	—	0.1	97.3
6月末	12,346	3.0	15,212	4.0	—	0.1	98.3
7月末	12,203	1.8	15,067	3.0	—	0.1	99.0
8月末	12,277	2.4	15,191	3.9	—	0.1	96.9
(期末) 2021年9月6日	12,277	2.4	15,202	3.9	—	0.1	96.9

(注1) 騰落率は期首比です。（期末基準価額は分配金を含みます。）

(注2) 基準価額は1万円当たりで表示しています。

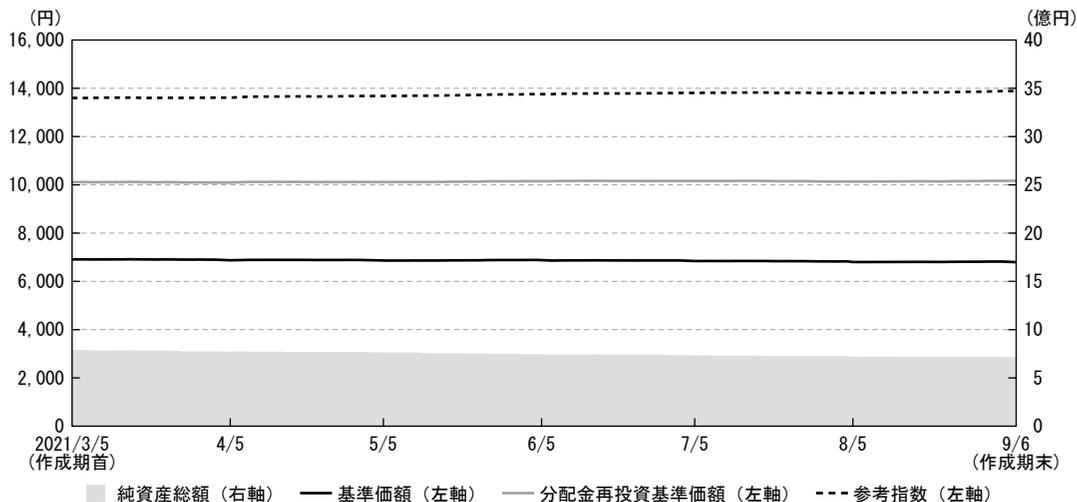
(注3) 当ファンドの参考指数は、クレディ・スイス・レパレジッド・ローン・インデックス（配当込み／円換算ベース／三菱UFJ銀行T T M）です。当参考指数は、ファンドの設定日の前営業日を10,000として、委託会社が算出したものです。

(注4) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、「株式組入比率」、「債券組入比率」は実質比率を記載しております。

## 運用経過

### ■基準価額等の推移（2021年3月6日から2021年9月6日まで）

#### Aコース



作成期首：6,913円

作成期末：6,797円（既払分配金150円）

騰落率：0.5%（分配金再投資ベース）

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資（複利運用）したものととして、委託会社が算出したもので、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

※当ファンドの参考指数は、クレディ・スイス・レバレッジド・ローン・インデックス（配当込み／米ドルベース）です。当参考指数は、ファンドの設定日の前営業日を10,000円として、委託会社が算出したものです。

※分配金を再投資するかどうかについては、お客様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。従って、各個人のお客様の損益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

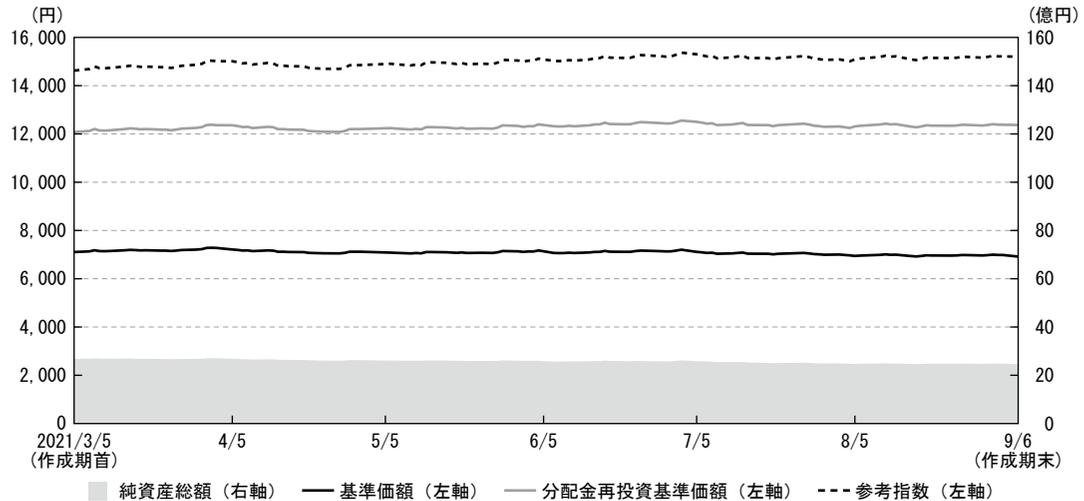
- ・投資先ファンドの保有する銀行貸付債権の安定的な利息収入がプラス寄与しました。
- ・為替ヘッジ取引にかかるコスト（ヘッジコスト）がマイナス寄与しました。

### ◆当作成期間の組入ファンドの騰落率

組入ファンド	騰落率
マニュアル・インベストメンツ・トラスト・フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA	1.4%
マニュアル・日本債券インデックス・マザーファンド	0.6%

## ■基準価額等の推移（2021年3月6日から2021年9月6日まで）

### Bコース



作成期首：7,106円

作成期末：6,918円（既払分配金360円）

騰落率：2.4%（分配金再投資ベース）

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資（複利運用）したものととして、委託会社が算出したもので、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

※当ファンドの参考指数は、クレディ・スイス・レパレジド・ローン・インデックス（配当込み/円換算ベース/三菱UFJ銀行T TM）です。当参考指数は、ファンドの設定日の前営業日を10,000として、委託会社が算出したものです。

※分配金を再投資するかどうかについては、お客様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。従って、各個人のお客様の損益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

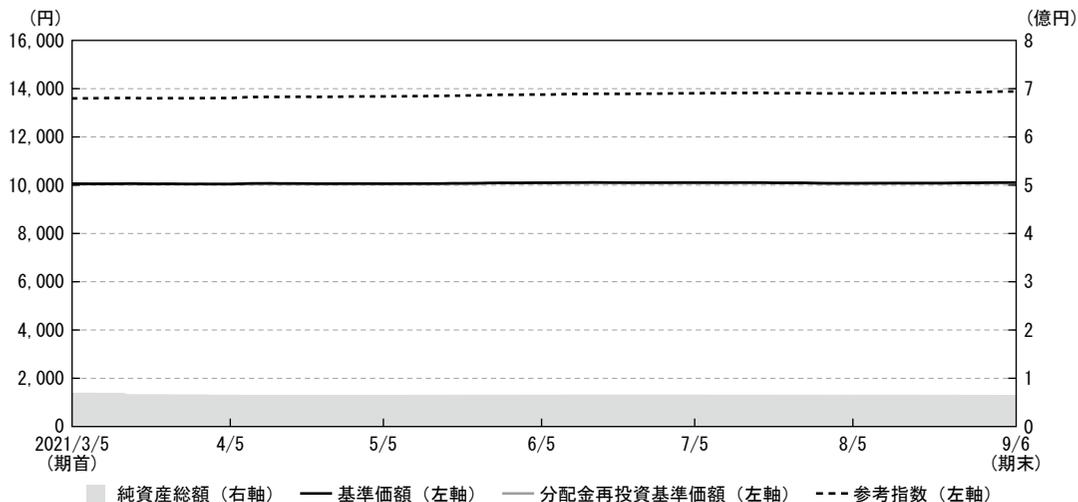
- ・投資先ファンドの保有する銀行貸付債権の安定的な利息収入がプラス寄与しました。
- ・円が米ドルに対し下落（円安）したことがプラス寄与しました。

### ◆当作成期間の組入ファンドの騰落率

組入ファンド	騰落率
マニュアル・インベストメンツ・トラスト・フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA	1.4%
マニュアル・日本債券インデックス・マザーファンド	0.6%

## ■基準価額等の推移（2021年3月6日から2021年9月6日まで）

### Cコース



期首：10,063円

期末：10,109円（既払分配金0円）

騰落率： 0.5%（分配金再投資ベース）

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資（複利運用）したものととして、委託会社が算出したもので、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

※当ファンドの参考指数は、クレディ・スイス・レバレッジド・ローン・インデックス（配当込み/米ドルベース）です。当参考指数は、ファンドの設定日の前営業日を10,000として、委託会社が算出したものです。

※分配金を再投資するかどうかについては、お客様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。従って、各個人のお客様の損益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

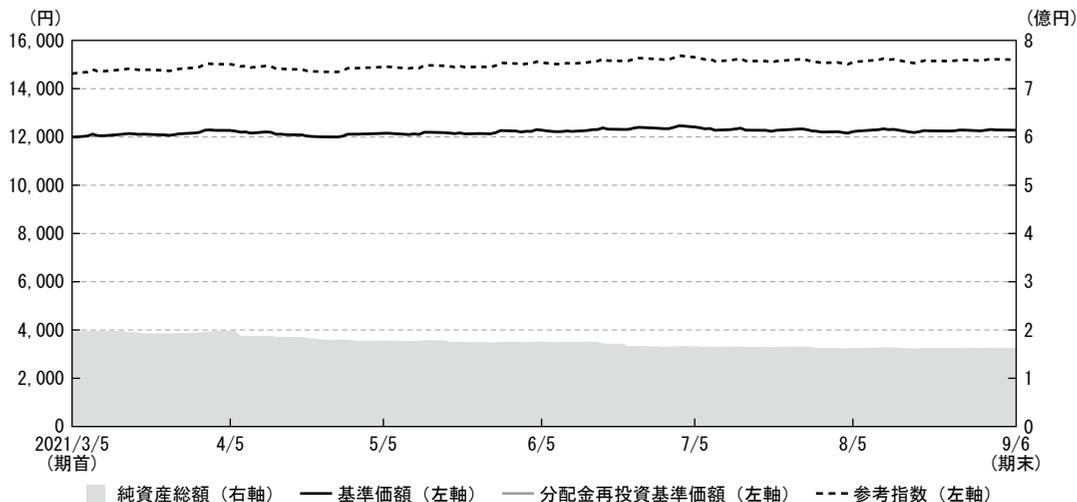
- ・投資先ファンドの保有する銀行貸付債権の安定的な利息収入がプラス寄与しました。
- ・為替ヘッジ取引にかかるコスト（ヘッジコスト）がマイナス寄与しました。

## ◆当期間の組入ファンドの騰落率

組入ファンド	騰落率
マニユライフ・インベストメンツ・トラスト・フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA	1.4%
マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	0.6%

## ■基準価額等の推移（2021年3月6日から2021年9月6日まで）

### Dコース



期 首：11,989円

期 末：12,277円（既払分配金0円）

騰落率： 2.4%（分配金再投資ベース）

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資（複利運用）したものととして、委託会社が算出したもので、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

※当ファンドの参考指数は、クレディ・スイス・レバレッジド・ローン・インデックス（配当込み/円換算ベース/三菱UFJ銀行T T M）です。当参考指数は、ファンドの設定日の前営業日を10,000として、委託会社が算出したものです。

※分配金を再投資するかどうかについては、お客様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。従って、各個人のお客様の損益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

- ・投資先ファンドの保有する銀行貸付債権の安定的な利息収入がプラス寄与しました。
- ・円が米ドルに対し下落（円安）したことがプラス寄与しました。

### ◆当期間の組入ファンドの騰落率

組入ファンド	騰落率
マニュアル・インベストメンツ・トラスト・フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA	1.4%
マニュアル・日本債券インデックス・マザーファンド	0.6%

## ■投資環境

[米国債券／銀行貸付債権市況]

### 全コース共通

米10年国債利回りは期初に1.5%台で始まった後、バイデン新政権の大規模な追加経済対策の成立、堅調な米経済指標の発表、インフレ予想の強まりなどを背景に米国債利回りは上昇し、3月末には1.7%台となりました。4月以降、FRB（米連邦準備制度理事会）当局者による金融緩和策長期化の示唆、早期の量的緩和策縮小を否定するコメント、物価上昇の上振れは一時的との見解を示したことなどに加えて、新型コロナウイルス変異株の感染拡大による景気減速懸念や一部経済指標の鈍化などを背景に米国債利回りは低下し8月初旬には1.1%台となりました。その後、市場予想を上回る雇用統計の発表やインフラ投資法案成立期待などを受け、国債利回りは上昇し1.3%台で期を終えました。銀行貸付債権は、安定的な利息収入などを背景にトータルリターンベースでは期を通じて上昇しました。

[為替市況]

### Bコース／Dコース

外国為替市場では、円は米ドルに対して下落（円安）しました。期初に米ドルは107円台で始まり、バイデン新政権の大規模な追加経済対策の成立、堅調な米経済指標の発表、米長期金利の上昇などを受けて円安米ドル高が進み4月初旬には110円台となりました。4月下旬には、一時107円台まで円高米ドル安となりましたが、ワクチン接種の進展によって米国経済活動の再開が一段と進んだことなどがドル買い要因となり7月初旬には111円台まで円安米ドル高が進みました。その後、新型コロナウイルス変異株の世界的な感染拡大による景気減速懸念、米長期金利の低下などを背景に円高米ドル安が進み、当期末には109円台となりました。

[日本債券市況]

### 全コース共通

当期間の10年国債利回りは、作成期初0.096%から作成期末0.051%となり利回りは低下（価格は上昇）しました。

## ■当該投資信託のポートフォリオ

### 全コース共通

主要投資対象とするケイマン籍外国投資信託「マニユライフ・インベストメンツ・トラストーフロート・インカム・ファンド クラスA」（以下「MITーフロート・インカム・ファンド クラスA」といいます。）（米ドル建て）の組入比率は高位に維持しました。

Aコース、Cコースでは、円に対する米ドルの為替ヘッジ取引を活用し、為替リスクの低減を図っています。

### MITーフロート・インカム・ファンド クラスA

当該投資信託証券を通じて主に変動金利の米ドル建て銀行貸付債権に投資を行い、安定的なインカムゲイン（金利収入）の確保をめざして運用を行いました。

### マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド

NOMURA-BPI 総合に採用されている公社債に投資することにより、同インデックスの動きに連動する投資成果をめざして運用を行いました。

### Aコース

組入ファンド・資産	比率
MITーフロート・インカム・ファンド クラスA	98.2%
マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	0.0%
現預金等	1.8%
合計	100.0%

### Bコース

組入ファンド・資産	比率
MITーフロート・インカム・ファンド クラスA	97.4%
マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	0.0%
現預金等	2.6%
合計	100.0%

### Cコース

組入ファンド・資産	比率
MITーフロート・インカム・ファンド クラスA	97.0%
マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	0.2%
現預金等	2.9%
合計	100.0%

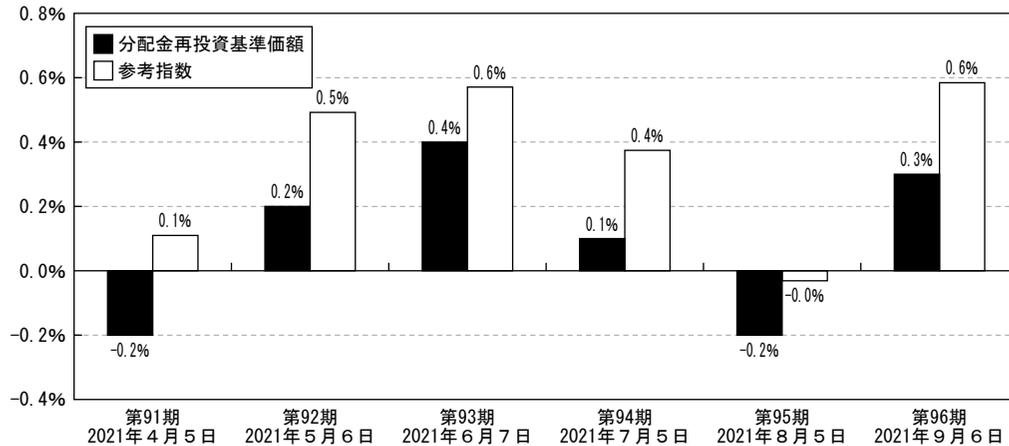
### Dコース

組入ファンド・資産	比率
MITーフロート・インカム・ファンド クラスA	96.9%
マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	0.1%
現預金等	3.1%
合計	100.0%

## ■当該投資信託のベンチマークとの差異

### Aコース

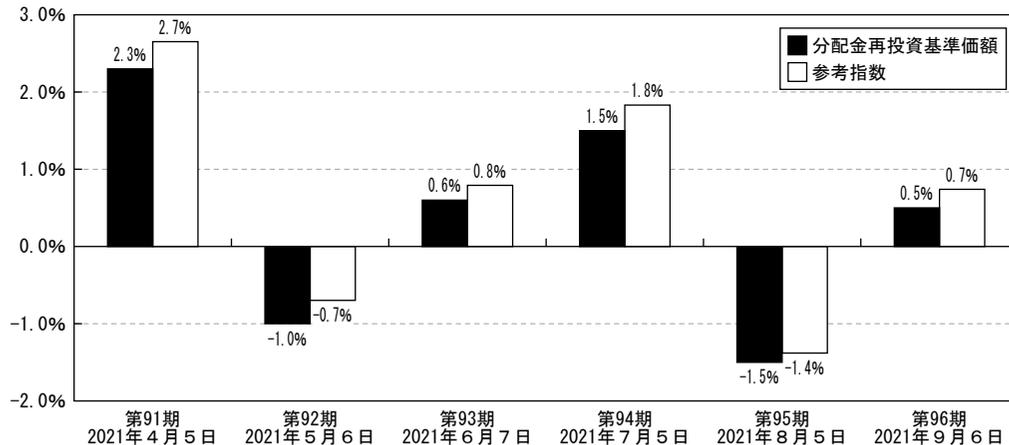
当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率の対比です。



※当ファンドの参考指数は、クレディ・スイス・レバレッジド・ローン・インデックス（配当込み/米ドルベース）です。当参考指数は、ファンドの設定日の前営業日を10,000として、委託会社が算出したものです。

### Bコース

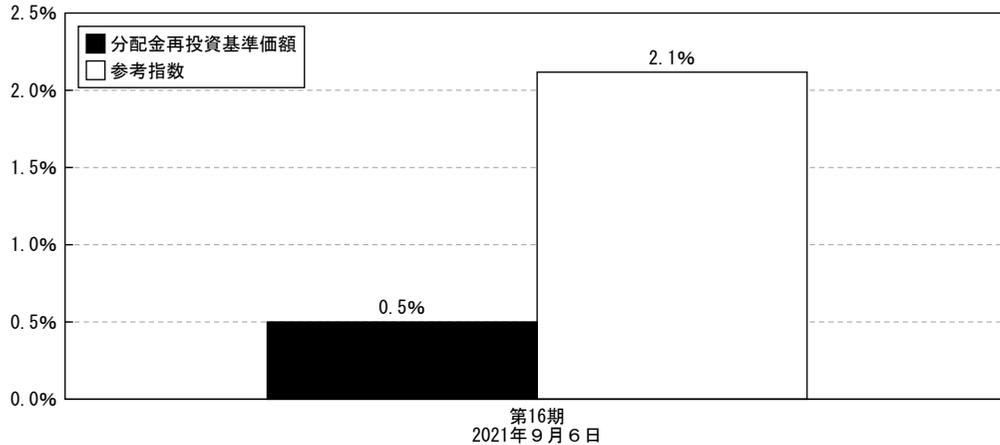
当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率の対比です。



※当ファンドの参考指数は、クレディ・スイス・レバレッジド・ローン・インデックス（配当込み/円換算ベース/三菱UFJ銀行T T M）です。当参考指数は、ファンドの設定日の前営業日を10,000として、委託会社が算出したものです。

## Cコース

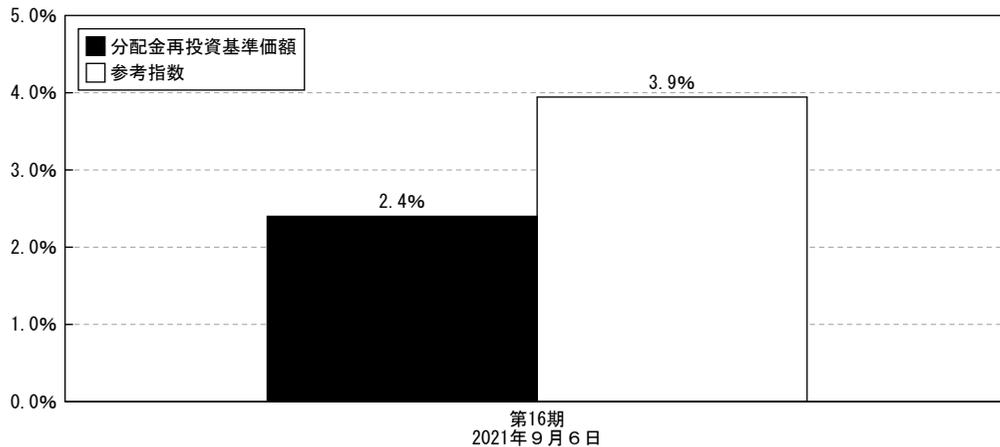
当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率の対比です。



※当ファンドの参考指数は、クレディ・スイス・レパレジッド・ローン・インデックス（配当込み/米ドルベース）です。当参考指数は、ファンドの設定日の前営業日を10,000として、委託会社が算出したものです。

## Dコース

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率の対比です。



※当ファンドの参考指数は、クレディ・スイス・レパレジッド・ローン・インデックス（配当込み/円換算ベース/三菱UFJ銀行T T M）です。当参考指数は、ファンドの設定日の前営業日を10,000として、委託会社が算出したものです。

## ■収益分配金について

### Aコース

当作成期間の収益分配は、分配方針に基づき第91期～第96期は25円、合計150円（1万口当たり、税引前）とさせていただきます。留保益の運用については、元本部分と同一の運用を行います。

#### [分配原資の内訳]

(1万口当たり、税引前)

	第91期	第92期	第93期	第94期	第95期	第96期
	自 2021年3月6日 至 2021年4月5日	自 2021年4月6日 至 2021年5月6日	自 2021年5月7日 至 2021年6月7日	自 2021年6月8日 至 2021年7月5日	自 2021年7月6日 至 2021年8月5日	自 2021年8月6日 至 2021年9月6日
当期分配金 (円)	25	25	25	25	25	25
(対基準価額比率) (%)	0.362	0.363	0.363	0.364	0.366	0.366
当期の収益 (円)	24	24	24	24	24	24
当期の収益以外 (円)	0	0	0	0	0	0
翌期繰越分配対象額 (円)	260	268	277	286	294	302

(注1) 当期分配金の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」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

(注3) 円未満は切り捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金(税込み)に合致しない場合があります。

### Bコース

当作成期間の収益分配は、分配方針に基づき第91期～第96期は60円、合計360円（1万口当たり、税引前）とさせていただきます。留保益の運用については、元本部分と同一の運用を行います。

#### [分配原資の内訳]

(1万口当たり、税引前)

	第91期	第92期	第93期	第94期	第95期	第96期
	自 2021年3月6日 至 2021年4月5日	自 2021年4月6日 至 2021年5月6日	自 2021年5月7日 至 2021年6月7日	自 2021年6月8日 至 2021年7月5日	自 2021年7月6日 至 2021年8月5日	自 2021年8月6日 至 2021年9月6日
当期分配金 (円)	60	60	60	60	60	60
(対基準価額比率) (%)	0.825	0.840	0.842	0.836	0.857	0.860
当期の収益 (円)	41	34	35	37	33	33
当期の収益以外 (円)	18	25	24	22	26	26
翌期繰越分配対象額 (円)	1,059	1,034	1,010	990	965	939

(注1) 当期分配金の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」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

(注3) 円未満は切り捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金(税込み)に合致しない場合があります。

## Cコース

基準価額水準・市況動向等を勘案した結果、分配金のお支払いは見送りとさせていただきます。  
なお、収益分配に充てず、信託財産内に留保した利益については、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

### [分配原資の内訳]

(1万口当たり、税引前)

		第16期	
		自 2021年3月6日 至 2021年9月6日	
当期分配金	(円)	—	
(対基準価額比率)	(%)	—	
当期の収益	(円)	—	
当期の収益以外	(円)	—	
翌期繰越分配対象額	(円)	4,302	

(注1) 当期分配金の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」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。  
また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

(注3) 円未満は切り捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。

## Dコース

基準価額水準・市況動向等を勘案した結果、分配金のお支払いは見送りとさせていただきます。  
なお、収益分配に充てず、信託財産内に留保した利益については、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

### [分配原資の内訳]

(1万口当たり、税引前)

		第16期	
		自 2021年3月6日 至 2021年9月6日	
当期分配金	(円)	—	
(対基準価額比率)	(%)	—	
当期の収益	(円)	—	
当期の収益以外	(円)	—	
翌期繰越分配対象額	(円)	6,137	

(注1) 当期分配金の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」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。  
また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

(注3) 円未満は切り捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。

## ■今後の運用方針

### 全コース共通

主要投資対象とする「MIT-フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA」（米ドル建て）の投資信託証券への投資を通じて、主に米ドル建ての銀行貸付債権に投資を行い、安定的な金利収入の確保と信託財産の成長をめざす方針です。

また、Aコース、Cコースでは、為替変動リスクに対しては、円に対する米ドルの為替ヘッジ取引を活用し、リスクの低減を図る方針です。

### MIT-フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA

新型コロナウイルスワクチンの普及が進む一方で、各国で新型コロナウイルスの変異株の感染拡大も見られ、終息時期や経済への影響については、依然として見通し難い状況にあります。引き続き事態の進展には注視が必要と考えますが、追加経済対策や大規模金融緩和の継続などが経済の下支えになることが期待されます。新型コロナウイルスのワクチン普及によって経済回復の恩恵を受けると考えられるレジャー、航空などの銘柄については、投資機会を捉えていく方針です。今後、デフォルト率は低下していくと予想しますが、セクターによって差が出ると見えています。銀行貸付債権への投資では、信用力の分析や慎重な個別銘柄の選択を行うことによって、信用力の悪化を回避することが重要になると考えます。当ファンドは、引き続き企業調査を重視し、投資魅力の高いと考えられる銀行貸付債権への投資を行ってまいります。

### マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド

NOMURA-BPI総合に採用されている公社債に投資することにより、同インデックスの動きに連動する投資成果をめざす方針です。

## 【Aコース】

### ■ 1万円当たりの費用明細

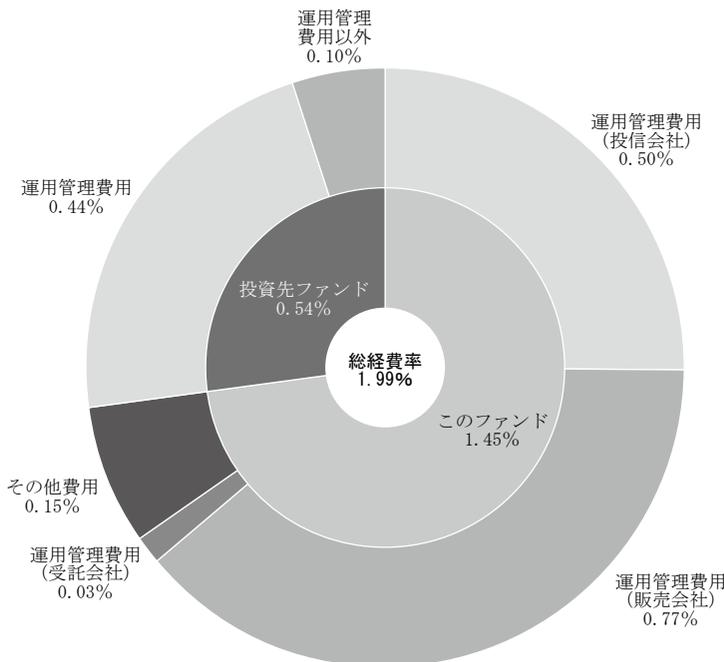
項目	第91期～第96期		項目の概要
	(2021年3月6日～2021年9月6日)		
	金額	比率	
平均基準価額	6,864円	—	作成期間の平均基準価額（月末値の平均値）です。
(a) 信託報酬 （投信会社） （販売会社） （受託会社）	45円 (17) (27) ( 1)	0.655% (0.251) (0.390) (0.014)	(a) 信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率 ・委託した資金の運用の対価 ・交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価 ・運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 募集手数料	—	—	
(c) 売買委託手数料	—	—	(c) 売買委託手数料＝作成期間の売買委託手数料÷作成期間の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(d) 有価証券取引税	—	—	(d) 有価証券取引税＝作成期間の有価証券取引税÷作成期間の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(e) その他費用 （保管費用） （監査費用） （印刷） （その他）	5 ( 0) ( 1) ( 4) ( 0)	0.074 (0.003) (0.016) (0.053) (0.001)	(e) その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数 その他費用 ・保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 ・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 ・印刷は、印刷会社等に支払う法定書類の作成等に係る費用 ・その他は、信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	50	0.729	

- \* 作成期間の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって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。  
\* 各項目毎に円未満は四捨五入してあります。  
\* 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。  
\* 各項目の費用は、このファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。  
\* 各比率は1万円当たりのそれぞれの費用金額を作成期間の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

（参考情報）

■ 総経費率

当作成期中の運用・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1.99%です。



総経費率 (①+②+③)	1.99%
①このファンドの費用の比率	1.45%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.44%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.10%

- \*①の費用は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。
- \*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。
- \*各比率は、年率換算した値です。
- \*投資先ファンドとは、このファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）です。
- \*①の費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。
- \*①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。
- \*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 (2021年3月6日から2021年9月6日まで)  
投資信託証券

決 算 期 銘 柄 名	第 91 期 ~ 第 96 期			
	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外国 (ケイマン諸島) MIT-フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA	口 4,088	千米ドル 297	口 14,014	千米ドル 1,025

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) 口数・金額の単位未満は切り捨てです。

親投資信託受益証券の設定、解約状況

当作成期において、設定および解約はありません。

■利害関係人との取引状況等 (2021年3月6日から2021年9月6日まで)  
期中の利害関係人との取引状況

当ファンド

当作成期中における利害関係人との取引等はありません。

マニュライフ・日本債券インデックス・マザーファンド

当作成期中における利害関係人との取引等はありません。

(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。

■第一種金融商品取引業又は第二種金融商品取引業を兼業している委託会社の自己の取引状況  
(2021年3月6日から2021年9月6日まで)

該当事項はありません。

■自社による当ファンドの設定・解約状況 (2021年3月6日から2021年9月6日まで)  
該当事項はありません。

## ■組入資産の明細（2021年9月6日現在）

### (1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた外貨建ファンドの明細

決 算 期		第 16 作 成 期 末			
銘 柄	口 数	評 価 額		組 入 比 率	
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
(ケイマン諸島)	口	千米ドル	千円	%	
MIT-フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA	88,705	6,401	703,121	98.2	
合 計	88,705	6,401	703,121		

(注1) 邦貨換算金額は、当作成期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 組入比率は、当作成期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

(注3) 口数・評価額の単位未満は切り捨てです。

### (2) 親投資信託残高

項 目	第15作成期末	第16作成期末	
	口 数	口 数	評 価 額
マネーライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	千口 91	千口 91	千円 111

(注1) マザーファンドの2021年9月6日現在の受益権総口数は9,534,819千口です。

(注2) 口数・評価額の単位未満は切り捨てです。

## ■有価証券の貸付及び借入の状況（2021年9月6日現在）

該当事項はありません。

## ■投資信託財産の構成

(2021年9月6日現在)

項 目	第 16 作 成 期 末	
	評 価 額	比 率
投 資 信 託 受 益 証 券	千円 703,121	% 97.4
マネーライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	111	0.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	18,718	2.6
投 資 信 託 財 産 総 額	721,950	100.0

(注1) 金額の単位未満は切り捨てております。

(注2) 当作成期末における外貨建純資産（703,143千円）の投資信託財産総額（721,950千円）に対する比率は97.4%です。

(注3) 外貨建資産は、当作成期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、当作成期末における邦貨換算レートは、1米ドル=109.83円です。

## ■資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第91期末 2021年4月5日	第92期末 2021年5月6日	第93期末 2021年6月7日	第94期末 2021年7月5日	第95期末 2021年8月5日	第96期末 2021年9月6日
<b>(A) 資 産</b>	<b>1,634,790,125円</b>	<b>1,564,570,294円</b>	<b>1,507,496,319円</b>	<b>1,523,640,249円</b>	<b>1,470,026,156円</b>	<b>1,422,926,958円</b>
コール・ローン等	19,582,622	14,937,470	22,249,007	13,646,444	13,026,334	18,176,220
投資信託受益証券(評価額)	787,864,589	753,961,232	727,342,438	739,312,352	706,284,541	703,121,283
マニュアル・日本債券 インデックス・ マザーファンド(評価額)	110,828	111,230	111,175	111,614	111,962	111,614
未 収 入 金	827,232,086	795,560,362	757,793,699	770,569,839	750,603,319	701,517,841
<b>(B) 負 債</b>	<b>862,611,825</b>	<b>801,577,120</b>	<b>765,810,030</b>	<b>790,895,767</b>	<b>747,602,075</b>	<b>706,557,722</b>
未 払 金	858,856,314	795,441,193	762,163,350	785,618,233	743,097,703	700,975,968
未払収益分配金	2,808,340	2,780,106	2,701,719	2,677,140	2,655,544	2,634,893
未 払 解 約 金	—	2,422,547	1,002	1,785,964	960,666	2,040,078
未払信託報酬	859,127	845,196	853,202	734,586	800,273	816,092
その他未払費用	88,044	88,078	90,757	79,844	87,889	90,691
<b>(C) 純資産総額(A-B)</b>	<b>772,178,300</b>	<b>762,993,174</b>	<b>741,686,289</b>	<b>732,744,482</b>	<b>722,424,081</b>	<b>716,369,236</b>
元 本	1,123,336,128	1,112,042,756	1,080,687,925	1,070,856,294	1,062,217,806	1,053,957,456
次期繰越損益金	△ 351,157,828	△ 349,049,582	△ 339,001,636	△ 338,111,812	△ 339,793,725	△ 337,588,220
<b>(D) 受 益 権 総 口 数</b>	<b>1,123,336,128口</b>	<b>1,112,042,756口</b>	<b>1,080,687,925口</b>	<b>1,070,856,294口</b>	<b>1,062,217,806口</b>	<b>1,053,957,456口</b>
1万口当たり基準価額(C/D)	6.874円	6.861円	6.863円	6.843円	6.801円	6.797円

(注1) 当ファンドの第91期首元本額は1,143,278,661円、第91～96期中追加設定元本額は5,832,194円、第91～96期中一部解約元本額は95,153,399円です。

(注2) 1口当たり純資産額は、第91期0.6874円、第92期0.6861円、第93期0.6863円、第94期0.6843円、第95期0.6801円、第96期0.6797円です。

(注3) 貸借対照表上の純資産総額が元本総額を下回っており、その差額は、第91期末351,157,828円、第92期末349,049,582円、第93期末339,001,636円、第94期末338,111,812円、第95期末339,793,725円、第96期末337,588,220円です。

※本運用報告書作成時点において、本計算期間に係るファンド監査は終了していません。

## ■損益の状況

項 目	第91期	第92期	第93期	第94期	第95期	第96期
	自 2021年3月6日 至 2021年4月5日	自 2021年4月6日 至 2021年5月6日	自 2021年5月7日 至 2021年6月7日	自 2021年6月8日 至 2021年7月5日	自 2021年7月6日 至 2021年8月5日	自 2021年8月6日 至 2021年9月6日
(A) 配 当 等 収 益	4,909,086円	4,597,073円	4,525,469円	4,518,965円	4,364,902円	4,347,202円
受 取 配 当 金	4,909,086	4,608,565	4,541,895	4,541,215	4,369,397	4,356,936
受 取 利 息	—	△ 11,492	△ 16,426	△ 22,250	△ 4,495	△ 9,734
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 5,538,289	△ 2,318,190	△ 707,627	△ 3,229,645	△ 5,240,112	△ 1,251,223
売 買 益	20,247,849	33,024,337	4,505,591	10,949,637	23,620,692	7,678,978
売 買 損	△ 25,786,138	△ 35,342,527	△ 5,213,218	△ 14,179,282	△ 28,860,804	△ 8,930,201
(C) 信 託 報 酬 等	△ 952,218	△ 935,749	△ 949,179	△ 819,588	△ 890,710	△ 909,326
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	△ 1,581,421	1,343,134	2,868,663	469,732	△ 1,765,920	2,186,653
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△207,518,706	△209,561,598	△204,804,511	△202,520,483	△202,859,635	△205,479,610
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△139,249,361	△138,051,012	△134,364,069	△133,383,921	△132,512,626	△131,660,370
(配 当 等 相 当 額)	( 27,206)	( 24,610)	( 26,056)	( 32,130)	( 26,180)	( 23,887)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△139,276,567)	(△138,075,622)	(△134,390,125)	(△133,416,051)	(△132,538,806)	(△131,684,257)
(G) 計 (D+E+F)	△348,349,488	△346,269,476	△336,299,917	△335,434,672	△337,138,181	△334,953,327
(H) 収 益 分 配 金	△ 2,808,340	△ 2,780,106	△ 2,701,719	△ 2,677,140	△ 2,655,544	△ 2,634,893
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	△351,157,828	△349,049,582	△339,001,636	△338,111,812	△339,793,725	△337,588,220
追 加 信 託 差 損 益 金	△139,276,321	△138,075,477	△134,390,005	△133,416,046	△132,538,119	△131,683,557
(配 当 等 相 当 額)	( 246)	( 145)	( 120)	( 5)	( 687)	( 700)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△139,276,567)	(△138,075,622)	(△134,390,125)	(△133,416,051)	(△132,538,806)	(△131,684,257)
分 配 準 備 積 立 金	29,271,159	29,872,969	29,944,650	30,707,910	31,290,545	31,861,533
繰 越 損 益 金	△241,152,666	△240,847,074	△234,556,281	△235,403,676	△238,546,151	△237,766,196

(注1) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) 損益の状況の中で(C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) 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4) 収益分配金の計算過程は以下の通りです。

第91期 計算期間末における費用控除後の配当等収益 (3,956,964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 (27,206円) および分配準備積立金 (28,095,575円) より分配対象収益は32,079,745円 (10,000口当たり285円) であり、うち2,808,340円 (10,000口当たり25円) を分配金額としております。

第92期 計算期間末における費用控除後の配当等収益 (3,661,417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 (24,610円) および分配準備積立金 (28,967,193円) より分配対象収益は32,653,220円 (10,000口当たり293円) であり、うち2,780,106円 (10,000口当たり25円) を分配金額としております。

第93期 計算期間末における費用控除後の配当等収益 (3,576,386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 (26,056円) および分配準備積立金 (29,044,047円) より分配対象収益は32,646,489円 (10,000口当たり302円) であり、うち2,701,719円 (10,000口当たり25円) を分配金額としております。

第94期 計算期間末における費用控除後の配当等収益 (3,699,461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 (32,130円) および分配準備積立金 (29,653,464円) より分配対象収益は33,385,055円 (10,000口当たり311円) であり、うち2,677,140円 (10,000口当たり25円) を分配金額としております。

第95期 計算期間末における費用控除後の配当等収益 (3,474,284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 (26,180円) および分配準備積立金 (30,446,312円) より分配対象収益は33,946,776円 (10,000口当たり319円) であり、うち2,655,544円 (10,000口当たり25円) を分配金額としております。

第96期 計算期間末における費用控除後の配当等収益 (3,437,971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 (23,887円) および分配準備積立金 (31,035,268円) より分配対象収益は34,497,126円 (10,000口当たり327円) であり、うち2,634,893円 (10,000口当たり25円) を分配金額としております。

※本運用報告書作成時点において、本計算期間に係るファンド監査は終了していません。

## ■分配金のお知らせ

決算期	第91期	第92期	第93期	第94期	第95期	第96期
1万口当たり分配金	25円	25円	25円	25円	25円	25円

- ・分配金は税込みです。
- ・分配金を再投資する場合、お手持り分配金は、各決算日現在の基準価額に基づいて、みなさまの口座に繰り入れて再投資しました。

### <課税上の取り扱い>

- ・分配金には、課税扱いとなる普通分配金と、非課税扱いとなる元本払戻金（特別分配金）があります。分配後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合は全額普通分配金となります。分配後の基準価額が個別元本を下回る場合は、下回る部分に相当する金額が元本払戻金（特別分配金）、残りの部分が普通分配金となります。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時に個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。
- ・普通分配金については配当所得として課税され、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率で源泉徴収されます。
- ・法人の場合は異なります。

※税法が改正された場合等は、上記内容が変更になる場合があります。

※課税上の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

## お知らせ

### ◆約款変更

該当事項はありません。

### ◆運用体制の変更

該当事項はありません。

## 【Bコース】

### ■ 1万口当たりの費用明細

項目	第91期～第96期		項目の概要
	(2021年3月6日～2021年9月6日)		
	金額	比率	
平均基準価額	7,107円	—	作成期間の平均基準価額（月末値の平均値）です。
(a) 信託報酬 （投信会社） （販売会社） （受託会社）	47円 (18) (28) (1)	0.655% (0.251) (0.390) (0.014)	(a) 信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率 ・委託した資金の運用の対価 ・交付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、購入後の情報提供等の対価 ・運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 募集手数料	—	—	
(c) 売買委託手数料	—	—	(c) 売買委託手数料＝作成期間の売買委託手数料÷作成期間の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(d) 有価証券取引税	—	—	(d) 有価証券取引税＝作成期間の有価証券取引税÷作成期間の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(e) その他費用 （保管費用） （監査費用） （印刷） （その他）	5 (0) (1) (4) (0)	0.067 (0.001) (0.015) (0.050) (0.001)	(e) その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数 その他費用 ・保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 ・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 ・印刷は、印刷会社等に支払う法定書類の作成等に係る費用 ・その他は、信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	52	0.722	

\*作成期間の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって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。

\*各項目毎に円未満は四捨五入してあります。

\*売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

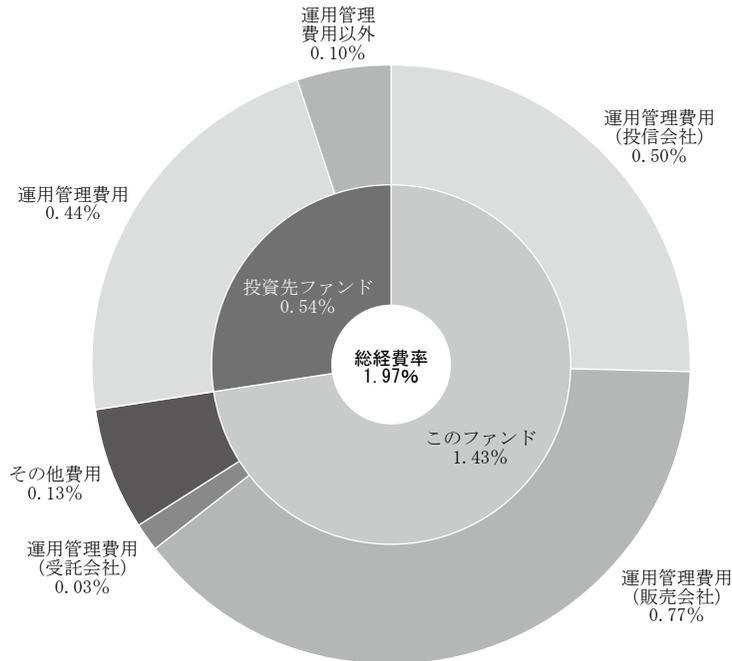
\*各項目の費用は、このファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

\*各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額を作成期間の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

（参考情報）

■ 総経費率

当作成期中の運用・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1.97%です。



総経費率 (①+②+③)	1.97%
①このファンドの費用の比率	1.43%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.44%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.10%

- \*①の費用は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。
- \*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。
- \*各比率は、年率換算した値です。
- \*投資先ファンドとは、このファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）です。
- \*①の費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。
- \*①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。
- \*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 (2021年3月6日から2021年9月6日まで)  
投資信託証券

決 算 期 銘 柄 名	第 91 期 ~ 第 96 期			
	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外国 (ケイマン諸島) MIT-フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA	口	千米ドル	口	千米ドル
	13,974	1,017	39,032	2,845

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) 口数・金額の単位未満は切り捨てです。

親投資信託受益証券の設定、解約状況

当作成期において、設定および解約はありません。

■ 利害関係人との取引状況等 (2021年3月6日から2021年9月6日まで)

期中の利害関係人との取引状況

当ファンド

当作成期中における利害関係人との取引等はありません。

マニュライフ・日本債券インデックス・マザーファンド

当作成期中における利害関係人との取引等はありません。

(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。

■ 第一種金融商品取引業又は第二種金融商品取引業を兼業している委託会社の自己の取引状況

(2021年3月6日から2021年9月6日まで)

該当事項はありません。

■ 自社による当ファンドの設定・解約状況 (2021年3月6日から2021年9月6日まで)

該当事項はありません。

## ■組入資産の明細（2021年9月6日現在）

### (1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた外貨建ファンドの明細

決 算 期		第 16 作 成 期 末			
銘 柄	口 数	評 価 額		組 入 比 率	
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
(ケイマン諸島)		千米ドル	千円	%	
MIT-フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA	302,205	21,810	2,395,407	97.4	
合 計	302,205	21,810	2,395,407		

(注1) 邦貨換算金額は、当作成期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 組入比率は、当作成期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

(注3) 口数・評価額の単位未満は切り捨てです。

### (2) 親投資信託残高

項 目	第15作成期末	第16作成期末	
	口 数	口 数	評 価 額
マネーライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	千口 91	千口 91	千円 111

(注1) マザーファンドの2021年9月6日現在の受益権総口数は9,534,819千口です。

(注2) 口数・評価額の単位未満は切り捨てです。

## ■有価証券の貸付及び借入の状況（2021年9月6日現在）

該当事項はありません。

## ■投資信託財産の構成

(2021年9月6日現在)

項 目	第 16 作 成 期 末	
	評 価 額	比 率
投 資 信 託 受 益 証 券	千円 2,395,407	% 96.4
マネーライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	111	0.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	90,318	3.6
投 資 信 託 財 産 総 額	2,485,836	100.0

(注1) 金額の単位未満は切り捨てております。

(注2) 当作成期末における外貨建純資産（2,395,447千円）の投資信託財産総額（2,485,836千円）に対する比率は96.4%です。

(注3) 外貨建資産は、当作成期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、当作成期末における邦貨換算レートは、1米ドル=109.83円です。

## ■資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第91期末 2021年4月5日	第92期末 2021年5月6日	第93期末 2021年6月7日	第94期末 2021年7月5日	第95期末 2021年8月5日	第96期末 2021年9月6日
<b>(A) 資 産</b>	<b>2,710,785,590円</b>	<b>2,640,662,420円</b>	<b>2,610,896,422円</b>	<b>2,664,137,179円</b>	<b>2,499,833,556円</b>	<b>2,485,836,570円</b>
コール・ローン等	99,475,519	98,082,773	95,487,049	55,740,727	60,796,820	90,317,054
投資信託受益証券(評価額)	2,611,199,243	2,542,468,417	2,515,298,198	2,504,766,901	2,438,924,774	2,395,407,902
マニュアル・日本債券 インデックス・ マザーファンド(評価額)	110,828	111,230	111,175	111,614	111,962	111,614
未 収 入 金	—	—	—	103,517,937	—	—
<b>(B) 負 債</b>	<b>27,988,569</b>	<b>32,259,350</b>	<b>46,863,215</b>	<b>80,084,158</b>	<b>32,428,411</b>	<b>27,384,454</b>
未 払 金	—	—	—	51,911,439	—	—
未払収益分配金	22,319,659	22,095,448	21,766,993	21,796,970	21,317,769	21,323,030
未 払 解 約 金	2,431,673	6,980,153	21,845,171	3,548,127	8,051,813	2,952,888
未 払 信 託 報 酬	2,947,546	2,893,704	2,951,129	2,565,429	2,769,085	2,810,938
その他未払費用	289,691	290,045	299,922	262,193	289,744	297,598
<b>(C) 純資産総額(A－B)</b>	<b>2,682,797,021</b>	<b>2,608,403,070</b>	<b>2,564,033,207</b>	<b>2,584,053,021</b>	<b>2,467,405,145</b>	<b>2,458,452,116</b>
元 本	3,719,943,189	3,682,574,787	3,627,832,188	3,632,828,489	3,552,961,616	3,553,838,372
次期繰越損益金	△1,037,146,168	△1,074,171,717	△1,063,798,981	△1,048,775,468	△1,085,556,471	△1,095,386,256
<b>(D) 受 益 権 総 口 数</b>	<b>3,719,943,189口</b>	<b>3,682,574,787口</b>	<b>3,627,832,188口</b>	<b>3,632,828,489口</b>	<b>3,552,961,616口</b>	<b>3,553,838,372口</b>
1万口当たり基準価額(C/D)	7,212円	7,083円	7,068円	7,113円	6,945円	6,918円

(注1) 当ファンドの第91期首元本額は3,759,292,758円、第91～96期中追加設定元本額は239,244,359円、第91～96期中一部解約元本額は444,698,745円です。

(注2) 1口当たり純資産額は、第91期0.7212円、第92期0.7083円、第93期0.7068円、第94期0.7113円、第95期0.6945円、第96期0.6918円です。

(注3) 貸借対照表上の純資産総額が元本総額を下回っており、その差額は、第91期末1,037,146,168円、第92期末1,074,171,717円、第93期末1,063,798,981円、第94期末1,048,775,468円、第95期末1,085,556,471円、第96期末1,095,386,256円です。

※本運用報告書作成時点において、本計算期間に係るファンド監査は終了していません。

## ■損益の状況

項 目	第91期	第92期	第93期	第94期	第95期	第96期
	自 2021年3月6日 至 2021年4月5日	自 2021年4月6日 至 2021年5月6日	自 2021年5月7日 至 2021年6月7日	自 2021年6月8日 至 2021年7月5日	自 2021年7月6日 至 2021年8月5日	自 2021年8月6日 至 2021年9月6日
(A) 配 当 等 収 益	16,247,396円	15,787,470円	15,493,340円	15,626,042円	15,029,842円	15,170,977円
受 取 配 当 金	16,291,206	15,822,294	15,670,185	15,704,448	15,088,297	15,200,540
受 取 利 息	△ 43,810	△ 34,824	△ 176,845	△ 78,406	△ 58,455	△ 29,563
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	48,271,072	△ 37,922,852	3,777,637	24,970,957	△ 50,497,348	△ 437,173
売 買 益	65,302,301	20,073	5,457,550	36,141,919	424,052	3,648,663
売 買 損	△ 17,031,229	△ 37,942,925	△ 1,679,913	△ 11,170,962	△ 50,921,400	△ 4,085,836
(C) 信 託 報 酬 等	△ 3,244,264	△ 3,183,000	△ 3,252,655	△ 2,828,786	△ 3,060,794	△ 3,110,215
(D) 当 期 繰 越 損 益 金 (A+B+C)	61,274,204	△ 25,318,382	16,018,322	37,768,213	△ 38,528,300	11,623,589
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 521,347,000	△ 470,708,055	△ 503,281,506	△ 495,075,682	△ 457,043,526	△ 508,783,106
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 554,753,713	△ 556,049,832	△ 554,768,804	△ 569,671,029	△ 568,666,876	△ 576,903,709
(配 当 等 相 当 額)	( 4,142,394)	( 2,195,804)	( 3,621,269)	( 8,103,621)	( 2,678,199)	( 3,704,316)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 558,896,107)	(△ 558,245,636)	(△ 558,390,073)	(△ 577,774,650)	(△ 571,345,075)	(△ 580,608,025)
(G) 計 (D+E+F)	△ 1,014,826,509	△ 1,052,076,269	△ 1,042,031,988	△ 1,026,978,498	△ 1,064,238,702	△ 1,074,063,226
(H) 収 益 分 配 金	△ 22,319,659	△ 22,095,448	△ 21,766,993	△ 21,796,970	△ 21,317,769	△ 21,323,030
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	△ 1,037,146,168	△ 1,074,171,717	△ 1,063,798,981	△ 1,048,775,468	△ 1,085,556,471	△ 1,095,386,256
追 加 信 託 差 損 益 金	△ 558,894,010	△ 558,244,646	△ 558,389,381	△ 577,772,236	△ 571,342,256	△ 580,606,809
(配 当 等 相 当 額)	( 2,097)	( 990)	( 692)	( 2,414)	( 2,819)	( 1,216)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 558,896,107)	(△ 558,245,636)	(△ 558,390,073)	(△ 577,774,650)	(△ 571,345,075)	(△ 580,608,025)
分 配 準 備 積 立 金	394,238,306	380,868,609	366,474,263	359,987,466	342,901,072	333,797,914
繰 越 損 益 金	△ 872,490,464	△ 896,795,680	△ 871,883,863	△ 830,990,698	△ 857,115,287	△ 848,577,361

(注1) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) 損益の状況の中で(C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) 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4) 収益分配金の計算過程は以下の通りです。

第91期 計算期間末における費用控除後の配当等収益（15,430,586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（4,142,394円）および分配準備積立金（396,987,082円）より分配対象収益は416,560,062円（10,000口当たり1,119円）であり、うち22,319,659円（10,000口当たり60円）を分配金額としております。

第92期 計算期間末における費用控除後の配当等収益（12,604,563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（2,195,804円）および分配準備積立金（388,164,680円）より分配対象収益は402,965,047円（10,000口当たり1,094円）であり、うち22,095,448円（10,000口当たり60円）を分配金額としております。

第93期 計算期間末における費用控除後の配当等収益（12,878,301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（3,621,269円）および分配準備積立金（371,742,378円）より分配対象収益は388,241,948円（10,000口当たり1,070円）であり、うち21,766,993円（10,000口当たり60円）を分配金額としております。

第94期 計算期間末における費用控除後の配当等収益（14,537,327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（8,103,621円）および分配準備積立金（359,145,902円）より分配対象収益は381,786,850円（10,000口当たり1,050円）であり、うち21,796,970円（10,000口当たり60円）を分配金額としております。

第95期 計算期間末における費用控除後の配当等収益（11,969,140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（2,678,199円）および分配準備積立金（349,574,321円）より分配対象収益は364,221,660円（10,000口当たり1,025円）であり、うち21,317,769円（10,000口当たり60円）を分配金額としております。

第96期 計算期間末における費用控除後の配当等収益（12,060,857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（3,704,316円）および分配準備積立金（339,356,987円）より分配対象収益は355,122,160円（10,000口当たり999円）であり、うち21,323,030円（10,000口当たり60円）を分配金額としております。

※本運用報告書作成時点において、本計算期間に係るファンド監査は終了していません。

## ■分配金のお知らせ

決算期	第91期	第92期	第93期	第94期	第95期	第96期
1万口当たり分配金	60円	60円	60円	60円	60円	60円

- ・分配金は税込みです。
- ・分配金を再投資する場合、お手持り分配金は、各決算日現在の基準価額に基づいて、みなさまの口座に繰り入れて再投資しました。

### <課税上の取り扱い>

- ・分配金には、課税扱いとなる普通分配金と、非課税扱いとなる元本払戻金（特別分配金）があります。分配後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合は全額普通分配金となります。分配後の基準価額が個別元本を下回る場合は、下回る部分に相当する金額が元本払戻金（特別分配金）、残りの部分が普通分配金となります。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時に個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。
- ・普通分配金については配当所得として課税され、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率で源泉徴収されます。
- ・法人の場合は異なります。

※税法が改正された場合等は、上記内容が変更になる場合があります。

※課税上の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

## お知らせ

### ◆約款変更

該当事項はありません。

### ◆運用体制の変更

該当事項はありません。

## 【Cコース】

### ■ 1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2021年3月6日～2021年9月6日)		
	金額	比率	
平均基準価額	10,083円	—	期中の平均基準価額（月末値の平均値）です。
(a) 信託報酬 （投信会社） （販売会社） （受託会社）	66円 (25) (39) ( 1)	0.655% (0.251) (0.390) (0.014)	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 ・委託した資金の運用の対価 ・交付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、購入後の情報提供等の対価 ・運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 募集手数料	—	—	
(c) 売買委託手数料	—	—	(c) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(d) 有価証券取引税	—	—	(d) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(e) その他費用 （保管費用） （監査費用） （印刷） （その他）	13 ( 2) (10) ( 1) ( 0)	0.130 (0.021) (0.100) (0.008) (0.001)	(e) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 その他費用 ・保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 ・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 ・印刷は、印刷会社等に支払う法定書類の作成等に係る費用 ・その他は、信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	79	0.785	

\* 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって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。

\* 各項目毎に円未満は四捨五入してあります。

\* 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

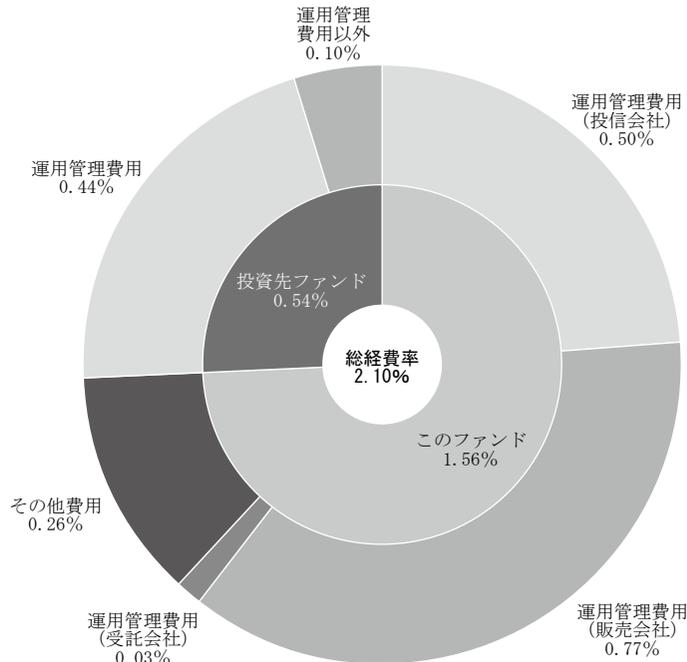
\* 各項目の費用は、このファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

\* 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

（参考情報）

■ 総経費率

当期中の運用・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2.10%です。



総経費率 (①+②+③)	2.10%
①このファンドの費用の比率	1.56%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.44%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.10%

- \*①の費用は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。
- \*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。
- \*各比率は、年率換算した値です。
- \*投資先ファンドとは、このファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）です。
- \*①の費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。
- \*①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。
- \*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（2021年3月6日から2021年9月6日まで）**  
**投資信託証券**

銘 柄 名	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外国（ケイマン諸島） MIT-フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA	口 341	千米ドル 24	口 1,021	千米ドル 75

（注1）金額は受渡代金です。

（注2）口数・金額の単位未満は切り捨てです。

**親投資信託受益証券の設定、解約状況**

当期において、設定および解約はありません。

**■利害関係人との取引状況等（2021年3月6日から2021年9月6日まで）**

**期中の利害関係人との取引状況**

**当ファンド**

当期中における利害関係人との取引等はありません。

**マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド**

当期中における利害関係人との取引等はありません。

（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。

**■第一種金融商品取引業又は第二種金融商品取引業を兼業している委託会社の自己の取引状況**

（2021年3月6日から2021年9月6日まで）

該当事項はありません。

**■自社による当ファンドの設定・解約状況（2021年3月6日から2021年9月6日まで）**

該当事項はありません。

## ■組入資産の明細（2021年9月6日現在）

### (1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた外貨建ファンドの明細

決 算 期 銘 柄	口 数	当 期 末		組 入 比 率
		外 貨 建 金 額	評 価 額	
(ケイマン諸島)		千米ドル	千円	%
MIT-フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA	8,019	578	63,565	97.0
合 計	8,019	578	63,565	

(注1) 邦貨換算金額は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 組入比率は、当期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

(注3) 口数・評価額の単位未満は切り捨てです。

### (2) 親投資信託残高

項 目	期首（前期末）	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
マネーライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	千口 91	千口 91	千円 111

(注1) マザーファンドの2021年9月6日現在の受益権総口数は9,534,819千口です。

(注2) 口数・評価額の単位未満は切り捨てです。

## ■有価証券の貸付及び借入の状況（2021年9月6日現在）

該当事項はありません。

## ■投資信託財産の構成

(2021年9月6日現在)

項 目	当 期 末	比 率
	評 価 額	
	千円	%
投 資 信 託 受 益 証 券	63,565	96.0
マネーライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	111	0.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	2,571	3.8
投 資 信 託 財 産 総 額	66,247	100.0

(注1) 金額の単位未満は切り捨てております。

(注2) 当期末における外貨建純資産（63,568千円）の投資信託財産総額（66,247千円）に対する比率は96.0%です。

(注3) 外貨建資産は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、当期末における邦貨換算レートは、1米ドル=109.83円です。

## ■資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	当 期 末 2021年9月6日
(A) 資 産	129,713,120円
コール・ローン等	2,521,194
投資信託受益証券(評価額)	63,565,696
マネーライフ・日本債券インデックス・マザーファンド(評価額)	111,614
未 収 入 金	63,514,616
(B) 負 債	64,162,954
未 払 金	63,465,556
未 払 解 約 金	191,888
未 払 信 託 報 酬	434,541
そ の 他 未 払 費 用	70,969
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	65,550,166
元 本	64,841,082
次 期 繰 越 損 益 金	709,084
(D) 受 益 権 総 口 数	64,841,082口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,109円

(注1) 当ファンドの期首元本額は69,460,997円、期中追加設定元本額は999,616円、期中一部解約元本額は5,619,531円です。

(注2) 1口当たり純資産額は1.0109円です。

## ■損益の状況

項 目	当 期 自 2021年3月6日 至 2021年9月6日
(A) 配 当 等 収 益	2,372,514円
受 取 配 当 金	2,371,106
受 取 利 息	1,408
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 1,564,001
売 買 益	3,121,095
売 買 損	△ 4,685,096
(C) 信 託 報 酬 等	△ 520,157
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	288,356
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 212,822
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	633,550
(配 当 等 相 当 額)	( 7,021,721)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 6,388,171)
(G) 計 (D+E+F)	709,084
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	709,084
追 加 信 託 差 損 益 金	633,550
(配 当 等 相 当 額)	( 7,021,721)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 6,388,171)
分 配 準 備 積 立 金	20,874,006
繰 越 損 益 金	△20,798,472

(注1) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) 損益の状況の中で(C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) 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4) 収益分配金の計算過程は以下の通りです。  
計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,852,909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(7,021,721円)および分配準備積立金(19,021,097円)より分配対象収益は27,895,727円(10,000口当たり4,302円)ですが、当期に分配した金額はありません。

※本運用報告書作成時点において、本計算期間に係るファンド監査は終了していません。

## お知らせ

### ◆約款変更

該当事項はありません。

### ◆運用体制の変更

該当事項はありません。

## 【Dコース】

### ■ 1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2021年3月6日～2021年9月6日)		
	金額	比率	
平均基準価額	12,243円	—	期中の平均基準価額（月末値の平均値）です。
(a) 信託報酬 （投信会社） （販売会社） （受託会社）	80円 (31) (48) ( 2)	0.655% (0.251) (0.390) (0.014)	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 ・委託した資金の運用の対価 ・交付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、購入後の情報提供等の対価 ・運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 募集手数料	—	—	
(c) 売買委託手数料	—	—	(c) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(d) 有価証券取引税	—	—	(d) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(e) その他費用 （保管費用） （監査費用） （印刷） （その他）	16 ( 1) ( 9) ( 5) ( 0)	0.127 (0.011) (0.070) (0.044) (0.002)	(e) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 その他費用 ・保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 ・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 ・印刷は、印刷会社等に支払う法定書類の作成等に係る費用 ・その他は、信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	96	0.782	

\* 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって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。

\* 各項目毎に円未満は四捨五入してあります。

\* 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

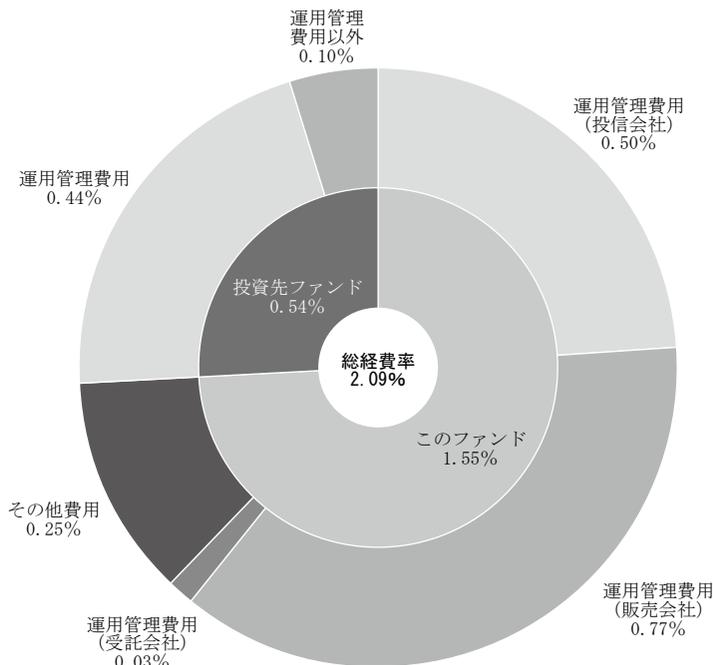
\* 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

\* 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

（参考情報）

■ 総経費率

当期中の運用・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2.09%です。



総経費率 (①+②+③)	2.09%
①このファンドの費用の比率	1.55%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.44%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.10%

- \*①の費用は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。
- \*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。
- \*各比率は、年率換算した値です。
- \*投資先ファンドとは、このファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）です。
- \*①の費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。
- \*①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。
- \*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（2021年3月6日から2021年9月6日まで）**  
**投資信託証券**

銘 柄 名	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外国（ケイマン諸島） MIT-フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA	口	千米ドル	口	千米ドル
	789	57	5,008	367

（注1）金額は受渡代金です。

（注2）口数・金額の単位未満は切り捨てです。

**親投資信託受益証券の設定、解約状況**

当期において、設定および解約はありません。

**■利害関係人との取引状況等（2021年3月6日から2021年9月6日まで）**

**期中の利害関係人との取引状況**

**当ファンド**

当期中における利害関係人との取引等はありません。

**マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド**

当期中における利害関係人との取引等はありません。

（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。

**■第一種金融商品取引業又は第二種金融商品取引業を兼業している委託会社の自己の取引状況**

（2021年3月6日から2021年9月6日まで）

該当事項はありません。

**■自社による当ファンドの設定・解約状況（2021年3月6日から2021年9月6日まで）**

該当事項はありません。

## ■組入資産の明細（2021年9月6日現在）

### (1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた外貨建ファンドの明細

決 算 期 銘 柄	口 数	当 期 末		組 入 比 率
		外 貨 建 金 額	評 価 額 邦貨換算金額	
(ケイマン諸島) MIT-フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA	19,948	千米ドル 1,439	千円 158,117	% 96.9
合 計	19,948	1,439	158,117	

(注1) 邦貨換算金額は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 組入比率は、当期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

(注3) 口数・評価額の単位未満は切り捨てです。

### (2) 親投資信託残高

項 目	期首（前期末）	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
マニュアル・日本債券インデックス・マザーファンド	千口 91	千口 91	千円 111

(注1) マザーファンドの2021年9月6日現在の受益権総口数は9,534,819千口です。

(注2) 口数・評価額の単位未満は切り捨てです。

## ■有価証券の貸付及び借入の状況（2021年9月6日現在）

該当事項はありません。

## ■投資信託財産の構成

(2021年9月6日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投 資 信 託 受 益 証 券	千円 158,117	% 96.1
マニュアル・日本債券インデックス・マザーファンド	111	0.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	6,336	3.8
投 資 信 託 財 産 総 額	164,564	100.0

(注1) 金額の単位未満は切り捨てております。

(注2) 当期末における外貨建純資産（158,124千円）の投資信託財産総額（164,564千円）に対する比率は96.1%です。

(注3) 外貨建資産は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、当期末における邦貨換算レートは、1米ドル=109.83円です。

## ■資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	当 期 末 2021年9月6日
(A) 資 産	164,564,017円
コール・ローン等	6,335,085
投資信託受益証券(評価額)	158,117,318
マニュアル・日本債券インデックス・マザーファンド(評価額)	111,614
(B) 負 債	1,348,688
未 払 解 約 金	14
未 払 信 託 報 酬	1,151,083
そ の 他 未 払 費 用	197,591
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	163,215,329
元 本	132,948,011
次 期 繰 越 損 益 金	30,267,318
(D) 受 益 権 総 口 数	132,948,011口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,277円

(注1) 当ファンドの期首元本額は163,867,711円、期中追加設定元本額は6,847,519円、期中一部解約元本額は37,767,219円です。

(注2) 1口当たり純資産額は1,2277円です。

## ■損益の状況

項 目	当 期 自 2021年3月6日 至 2021年9月6日
(A) 配 当 等 収 益	5,882,607円
受 取 配 当 金	115,526,669,790
受 取 利 息	△115,520,787,183
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 893,531
売 買 益	3,019,200
売 買 損	△ 3,912,731
(C) 信 託 報 酬 等	△ 1,370,521
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	3,618,555
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	7,679,953
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	18,968,810
(配 当 等 相 当 額)	( 28,369,429)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 9,400,619)
(G) 計 (D+E+F)	30,267,318
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	30,267,318
追 加 信 託 差 損 益 金	18,968,810
(配 当 等 相 当 額)	( 28,369,429)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 9,400,619)
分 配 準 備 積 立 金	53,222,994
繰 越 損 益 金	△ 41,924,486

(注1) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) 損益の状況の中で(C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) 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4) 収益分配金の計算過程は以下の通りです。  
計算期間末における費用控除後の配当等収益(4,512,604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(28,369,429円)および分配準備積立金(48,710,390円)より分配対象収益は81,592,423円(10,000口当たり6,137円)ですが、当期に分配した金額はありません。

※本運用報告書作成時点において、本計算期間に係るファンド監査は終了していません。

## お知らせ

### ◆約款変更

該当事項はありません。

### ◆運用体制の変更

該当事項はありません。

## <参考情報>

### ■組入投資信託証券の概要

#### MIT-フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA

管 理 会 社	マネュライフ・インベストメント・マネジメント（HK）リミテッド
投資顧問会社	マネュライフ・インベストメント・マネジメント（US）LLC（実質的な運用を行います。）
信 託 期 間	無期限です。
運 用 方 針	①主に変動金利の米ドル建て銀行貸付債権に分散投資を行い、金利収入の確保と魅力的なリスク調整後トータル・リターン獲得をめざします。 ②米ドル建てまたは米ドル以外の通貨建ての債券（ハイ・イールド債券を含みます。）等に投資を行う場合もあります。米ドル以外の通貨建ての資産に投資した場合には、原則として実質的に米ドル建てとなるように為替取引を行います。 ③徹底したボトムアップ・アプローチによる調査に基づき、割安な銘柄に投資を行います。 ④投資後も保有銘柄について継続的なモニタリングを行い、価格下落リスクの低減を図ります。
投 資 制 限	投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%を超えないものとします。 株式への直接投資は行いません。

### ■投資対象とする投資信託証券の資産の状況

以下は、当ファンドの作成期間末日における、投資対象ファンドの直近計算期間末日の情報を記載しています。

#### MIT-フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA

##### ○ポートフォリオ特性

	特性値
平均クーポン	4.02%
直接利回り	4.14%
最終利回り	4.39%
平均デュレーション	1.50年
残存年数	4.60年
平均格付け	B+

※現地の2020年12月最終営業日のデータです。

※特性値は純資産総額から現預金等を除いて計算しています。

※平均格付けは、原則、S&P社、ムーディーズ社、フィッチ社の格付けをもとに、当社が独自の基準に基づき算出したものです。

また、平均格付けは、当ファンド、および投資対象ファンドに係る信用格付けではありません。

##### ○組入上位10銘柄

（組入銘柄数92銘柄）

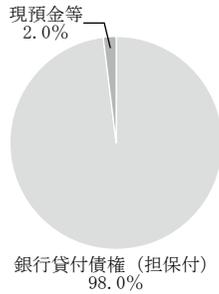
	銘柄名	組入比率
1	シーザーズ・リゾート・コレクション	1.67%
2	APXグループ	1.65%
3	ウーバー・テクノロジーズ	1.57%
4	リフィニティブ	1.50%
5	コーナーストーン・ビルディング・プランズ	1.48%
6	ダイナスティ・アクイジション	1.43%
7	セレクト・メディカル	1.41%
8	アルティメット・ソフトウェア・グループ	1.41%
9	アシュリオン	1.40%
10	イントラード	1.39%

※現地の2020年12月最終営業日のデータです。

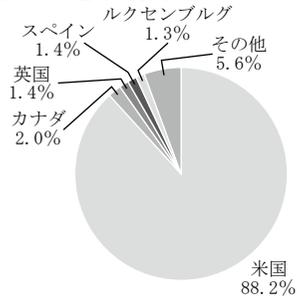
※組入比率は純資産総額に対する比率です。

※個別の銘柄の取引を推奨するものではありません。また上記銘柄について将来の組入れを保証するものではありません。

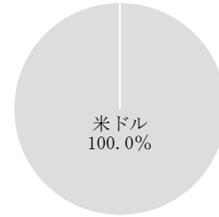
### ○資産別配分



### ○国・地域別配分



### ○通貨別配分



※現地の2020年12月最終営業日のデータです。

※資産別配分および通貨別配分は、純資産総額に対する比率です。また、国・地域別配分は、純資産総額から現預金等を除いて計算しています。

※各数値を四捨五入しているため、合計値が100%にならないことがあります。

当ファンドの運用報告書作成時点において、入手可能な直前計算期間の「M I T－フローティング・レート・インカム・ファンド」の情報を委託会社が抜粋・一部翻訳したものを記載しております。

## ■費用の明細

(2020年1月1日から2020年12月31日まで)  
(単位：米ドル)

マネジメントフィー	157,790
カストディーフィー等	19,914
トラスティーフィー	12,000
監査報酬等	34,260
評価手数料	25,100
取引手数料	2,753
年間権限費用	1,211
会計及びその他専門家費用	3,638
その他費用	40,183
<b>費用合計</b>	<b>296,849</b>

■有価証券明細表 2020年12月31日

銀行貸付債権(米ドル建)

銘柄名	数量	評価額(米ドル)	投資比率(%)
CAESARS RESORT COLLECTIO TRANCHE B1 TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +450	600,000.00	601,915	1.68
APX GROUP INC TERM B TERM LOA USD-LIBOR-BBA 3M +500BPS 31/12/2025	597,000.00	595,593	1.66
UBER TECHNOLOGIES INC TERM TERM LOAN USD LIBOR BBA 3M + 400BPS	559,920.26	563,614	1.57
FINANCIAL & RISK US HOLD TERM B TREM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M+325BPS	539,653.28	539,578	1.50
PISCES MIDCO INC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +375BPS	531,591.80	532,629	1.48
DYNASTY ACQUISITION CO I TERM TERM LOAN USD-LIBOR BBA 3M + 350BPS	539,958.47	516,692	1.44
UKG INC TERM LOAN USD-LIBOR-BBA +325 BPS 03/05/2026	500,000.00	509,617	1.42
SELECTOR MEDICAL CORP TERM B TERM LOAN USD · LIBOR BBA 3M +250BPS	507,664.16	508,533	1.42
ASURION LLC TERM B2 TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +600 14/07/2025	500,000.00	504,560	1.41
ARCH COAL INC TERM LOAN TERM B USD-LIBOR-BBA-3M +500BPS 14/06/2026	495,000.00	495,839	1.38
GRIFOLS WORLDWIDE OPERAT TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M 200+	496,250.00	496,656	1.38
ALPHA 3 BV TERM B1 TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M 300+ 25/01/2024	497,438.34	496,289	1.38
WEST CORP TERM B1 TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M+350BPS	513,384.34	495,881	1.38
CONSOLIDATED CONTAINER CO TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M+300BPS	484,887.90	484,878	1.35
TRANSDIGM INC TERM F TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +225BPS	492,756.62	484,166	1.35
TWIN RIVER MANAGEMENT GROUP TRANCHE B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA	493,750.00	484,684	1.35
BIDFAIR MERGERIGHT INC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR BBA 3M + 550BPS	480,255.78	481,130	1.34
SEDGWICK CMS INC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR BBA 3M + 325BPS	489,026.40	482,247	1.34
SCIENTIFIC GAMES INTERNATIO TERM B5 TERM LOAN USD 3M+275BPS 14/08/2024	489,563.44	479,505	1.34
AIR METHODS CORP TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +350BPS	493,622.45	478,052	1.33
PROJECT ALPHA INTERMEDIA TERM B TERM LOAN USD-LIBOR BBA 3M +400BPS	472,402.90	473,965	1.32
CSC HOLDINGS LLC TERM B5 TERM LOAN USD-LIBOR BBA 3M+250BPS 15/04/2027	475,764.96	473,508	1.32
NAB HOLDINGS LLC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +350BPS 30/06/2024	471,318.78	469,014	1.31
GARDNER DENVER INC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +175BPS	471,702.54	466,084	1.30
BWAY CORP TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +325BPS	474,126.20	463,742	1.29
INTELSAT TERM B2 TERM LOAN USD- LIBOR-BBA 3M +375BPS 27/11/2023	450,000.00	459,294	1.28
HOYA MIDCO LLC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +350BPS 30/06/2024	470,762.34	453,555	1.26
ACRISURE LLC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +350BPS	449,673.52	448,556	1.25
IBC CAPITAL LTD TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +375 BPS	453,516.36	450,060	1.25
LIONS GATE CAPITAL HOLD TERM B TERM LOAN USD-LIBOR BBA 3M + 225BPS	453,582.86	449,730	1.25
GEMS MENASA CAYMAN LTD TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA +500BPS	442,798.26	444,606	1.24
USI INC/NY TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +300BPS 16/05/2024	446,962.98	441,369	1.23
UNITED RENTALS NORTH AM TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +175BPS	436,555.36	436,340	1.22
GATES GLOBAL LLC TERM LOAN USD-LIBO R-BBA 3M +275BPS 31/03/2027	433,555.56	433,051	1.21
PCI GAMING AUTHORITY TERM LOAN USD-LIBOR-BBA +250 BPS 31/05/2026	439,134.61	435,050	1.21
QUORUM HEALTH CORP TERM LOAN USD-LIBOR BBA 3M +825BPS 29/04/2025	429,569.42	432,350	1.20
GENTIVA HEALTH TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +275BPS	430,868.50	430,231	1.20
TWIN RIVER MANAGEMENT GROUP TRANCHE B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA +800 BPS	399,000.00	426,481	1.19
WIDOPENWEST FINANCE LLC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR BBA 3M + 325BPS	422,635.34	423,193	1.18
SKYMILES IP LTD TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +375BPS 16/09/2027	400,000.00	420,406	1.17
EVERI PAYMENTS INC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M+275BPS 09/05/2024	419,501.35	415,820	1.16
VP CPP HOLDINGS LLC TERM B TERM LOAN-USD-LIBOR BBA 3M + 375BPS	437,235.08	414,517	1.15
ALMONDE INC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M+350BPS 16/06/2024	412,486.66	408,235	1.14
PG&E CORP TERM B-EXIT TERM LOAN LOAN USD-LIBOR BBA 3M +350BPS	399,000.00	404,547	1.13
ALTICE FRANCE SA TRANCHE B13 TERM LOAN USD-LIBOR-BBA +400 BPS	398,982.19	400,891	1.12
CNT HOLDINGS I CORP TRANCHE B TERM LOAN USD-LIBOR BBA 3M +375BPS	400,000.00	403,100	1.12
VIRGIN MEDIA BRISTOL LLC TRANCHE N TERM LOAN USD-LIBOR-BBA +250 BPS	400,000.00	397,288	1.11
JANE STREET GROUP LLC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +300BPS	392,137.24	393,145	1.10
CORAL-US CO-BORROWER LLC TERM B5 TERM LOAN USD-LIBOR BBA 3M +BPS	400,000.00	395,419	1.10
CSC HOLDINGS LLC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR BBA 3M+225BPS 15/01/2026	394,974.85	389,922	1.09
ENDO INTERNATIONAL PLC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M + 425BPS	396,923.08	392,140	1.09
NAVISTAR INC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR 350BPS 30/11/2024	385,430.22	387,312	1.08
LOWER CADENCE HOLDINGS L TERM B TERM LOAN USA-LIBOR-BBA 3M +400BPS	395,000.00	386,158	1.08
DHX MEDIA LTD TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +375BPS 22/12/2023	397,747.51	388,939	1.08
VICTORY CAPITAL HOLDINGS TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +225BPS	380,535.49	382,283	1.07
EDELMAN FINANCIAL CENTER TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +325BPS	389,783.97	384,540	1.07
TEAM HEALTH HOLDINGS INC TERM B TERM LOAN USD LIBOR BBA 3M +275BPS	421,582.26	379,995	1.06
ISTAR FINANCIAL INC TRANCHE B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +275BPS	373,785.81	375,201	1.05

銘柄名	数量	評価額(米ドル)	投資比率 (%)
SABRE GBLB INC TRANCHE B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +400BPS 10/12/2027	375,000.00	376,406	1.05
CHANGE HEALTHCARE HOLDINGS B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA +250 BPS	376,367.10	375,175	1.05
TEMPO ACQUISITION LLC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M+325BPS	369,908.66	368,213	1.03
VALEANT PHARMACEUTICALS TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +300BPS	371,072.14	369,772	1.03
COGECO COMMUNICATIONS US TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M+200BPS	370,229.98	366,562	1.02
RACKSPACE HOSTING INC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +400BPS	359,504.70	364,306	1.01
EMERALD TOPCO INC TERM LOAN USD-LIBOR BBA 3M+350BPS 25/07/2026	346,500.00	345,715	0.96
ALTRA INDUSTRIAL MOTION TERM B TERM LOAN USA-LIBOR-BBA 3M +200BPS	333,858.27	334,295	0.93
AVAYA INC TERM B-EXT TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M 425BPS 15/12/2027	327,646.34	328,984	0.92
GARDA WORLD SECURITY CORP TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M+475BPS	329,791.38	330,960	0.92
AERIAL MERGER SUB INC TERM TERM LOAN USD LIBOR BBA 3M +800BPS	353,450.62	315,249	0.88
ARCHES BUYER INC TERM LOAN USD-LIBO R-BBA 3M +325BPS 06/12/2027	310,000.00	310,814	0.87
MA FINANCECO LLC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +425BPS 05/06/2025	298,125.00	301,591	0.84
BASS PRO GROUP LLC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +500BPS 25/09/2024	299,228.79	300,609	0.84
CONSOLIDATED COMMUNICATIONS TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA-3M +475BPS	300,000.00	302,298	0.84
MEREDITH CORP TERM B TERM LOAN USD-LIBOR BBA 3M+250BPS 31/01/2025	304,559.23	302,325	0.84
MCGRAW HILL TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +475BPS	307,925.83	301,425	0.84
SS&C TECHNOLOGIES INC TERM B5 TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M+ 175BPS	299,214.90	296,675	0.83
CENTURYLINK INC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +225BPS	299,246.23	296,211	0.83
ZIGGO FINANCING PARTNERS TERM I TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +250BPS	300,000.00	298,314	0.83
GOODYEAR TIRE & RUBBER TERM LOAN USD-LIBOR BBA 3M +200BPS	306,666.66	299,438	0.83
STANDARD AERO LTD TERM TERM LOAN USD-LIBOR BBA 3M +350BPS	290,676.66	278,151	0.77
WESTERN DIGITAL CORP TERM B4 TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +175BPS	271,016.10	271,064	0.76
NASCAR HOLDINGS INC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR BBA 3M +275BPS	270,840.43	270,161	0.75
LCPR LOAN FINANCING LLC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +500BPS	250,000.00	251,911	0.70
JBS USA LUX SA TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +200BPS 01/05/2026	249,367.09	247,564	0.69
DELTA AIR LINES INC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +475BPS	199,500.00	204,814	0.57
MATCH GROUP INC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M + 175BPS	200,000.00	198,518	0.55
AUSTIN BIDCO INC TRANCHE B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +425BPS	185,000.00	184,538	0.51
REYNOLDS GROUP HOLDINGS TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +300BPS	165,650.46	165,105	0.46
CCM MERGER INC TERM B TERM LOAN USD -LIBOR-BBA3M +375BPS 29/10/2025	125,000.00	125,531	0.35
LSC COMMUNICATIONS INC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M+550BPS	476,439.30	98,095	0.27
AVAYA INC TERM B-EXT TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M 425 15/12/2027	13,000.56	13,080	0.04
有価証券 合計		35,455,964	98.78
その他資産		438,681	1.22
純資産総額		35,894,645	100.00

## マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド

## 第12期

決算日 2021年2月15日

(計算期間：2020年2月18日～2021年2月15日まで)

## ■当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2009年2月13日から無期限です。
主要投資対象	NOMURA-BPI総合に採用されている公社債を主要投資対象とします。
運用方針	①主としてNOMURA-BPI総合に採用されている公社債に投資することにより、同インデックスの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。 ②公社債の組入比率は原則として高位を維持します。 ③資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。
投資制限	①債券への投資割合は、制限を設けません。 ②外貨建資産への投資は行いません。

## ■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		NOMURA-BPI総合*		株式 組入比率	債券 組入比率	投資信託 証券比率	純資産 総額
	円	騰落率	(ベンチマーク)	騰落率				
8期(2017年2月15日)	11,851	1.0	11,880	1.0	—	98.5	—	百万円 20,091
9期(2018年2月15日)	11,967	1.0	11,996	1.0	—	98.7	—	17,683
10期(2019年2月15日)	12,156	1.6	12,185	1.6	—	98.7	—	14,666
11期(2020年2月17日)	12,296	1.2	12,328	1.2	—	99.4	—	13,257
12期(2021年2月15日)	12,129	△1.4	12,152	△1.4	—	99.3	—	12,225

(注1) 基準価額は1万円当たりで表示しています。

(注2) 当ファンドのベンチマークは、NOMURA-BPI総合(以下「ベンチマーク」といいます。)です。当ベンチマークは、ファンドの設定日の前営業日を10,000として、委託会社が算出したものです。

## ※ベンチマークに関して

NOMURA-BPI総合とは、野村證券株式会社の金融工学等研究部門が発表しているわが国の債券市場全体の動向を反映する投資収益指数(パフォーマンス)で、一定の組入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。NOMURA-BPI総合は、同社の知的財産であり、同指数に関する一切の権利は同社に帰属します。野村證券株式会社は、当該指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、当ファンドの運用成果等に関して一切責任を負うものではありません。

## ■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*		株式 組入比率	債券 組入比率	投資信託 証券比率
	円	騰落率	(ベンチマーク)	騰落率			
(期首) 2020年2月17日	12,296	—	12,328	—	—	99.4	—
2月末	12,411	0.9	12,441	0.9	—	99.1	—
3月末	12,209	△0.7	12,243	△0.7	—	99.1	—
4月末	12,254	△0.3	12,285	△0.3	—	99.5	—
5月末	12,203	△0.8	12,232	△0.8	—	99.1	—
6月末	12,160	△1.1	12,183	△1.2	—	99.2	—
7月末	12,198	△0.8	12,226	△0.8	—	99.3	—
8月末	12,143	△1.2	12,168	△1.3	—	99.2	—
9月末	12,179	△1.0	12,204	△1.0	—	99.4	—
10月末	12,162	△1.1	12,185	△1.2	—	99.4	—
11月末	12,180	△0.9	12,201	△1.0	—	99.2	—
12月末	12,183	△0.9	12,203	△1.0	—	99.3	—
2021年1月末	12,151	△1.2	12,173	△1.3	—	99.4	—
(期末) 2021年2月15日	12,129	△1.4	12,152	△1.4	—	99.3	—

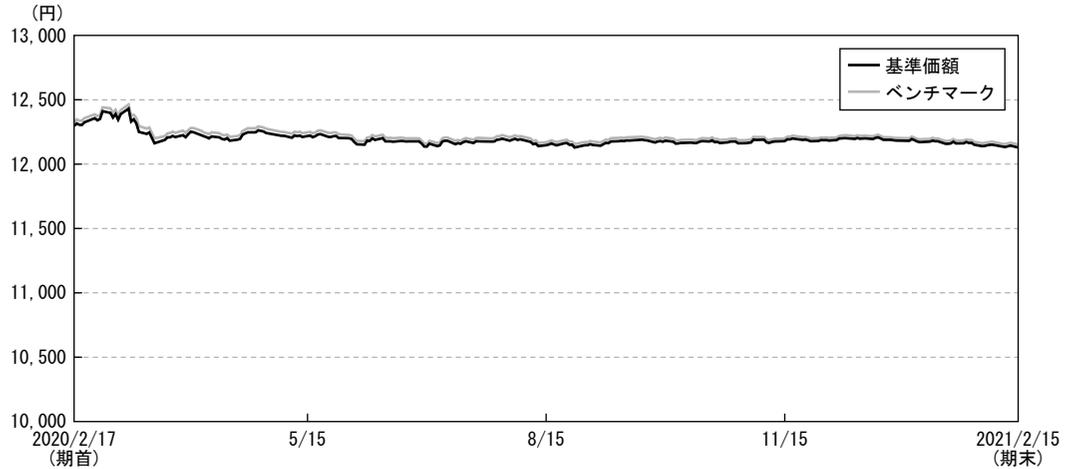
(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 基準価額は1万円当たりで表示しています。

(注3) 当ファンドのベンチマークは、NOMURA-BPI総合です。当ベンチマークは、ファンドの設定日の前営業日を10,000として、委託会社が算出したものです。

## 運用経過

## ■基準価額等の推移（2020年2月18日から2021年2月15日まで）



期 首 : 12,296円

期 末 : 12,129円

騰落率 :  $\Delta 1.4\%$ 

※当ファンドのベンチマークは、NOMURA-BPI総合です。当ベンチマークは、ファンドの設定日の前営業日を10,000として、委託会社が算出したものです。

## ■基準価額の主な変動要因

資産のほぼ全額を債券に投資したことにより、債券市況とほぼ同様の推移となりました。

## ■投資環境

国内債券市場は、新型コロナウイルスの影響から一時的にボラティリティが高まる場面もあったものの、日銀のイールドカーブ・コントロールのもとで概ね低位で安定して推移しました。10年国債利回りは、新型コロナウイルスの感染拡大を受けてグローバルに安全資産需要が高まったことから、2020年3月上旬にかけて低下しましたが、その後は財政出動による国債の増発観測や投資家による国債換金売りの動きなどから大きく上昇する展開となりました。4月には日銀が資産買い入れを拡充し、緩和姿勢を強化したことなどから一時的に低下する場面もありましたが、その後は日銀のイールドカーブ・コントロールを背景として概ね横ばいで推移しました。2021年2月には景気回復期待の高まりでグローバルに先進国金利が上昇したことや日銀の「点検」に対する警戒感などから上昇しました。こうした中、10年国債利回りは、期末には0.08%（2月15日）となり、前期末（-0.03%）に比べ、上昇しました。

## ■当該投資信託のポートフォリオ

当ファンドは、主に、NOMURA-BPI総合に採用されている公社債に投資することにより、当該インデックスの動きに連動する投資成果をめざして運用を行いました。

## ■当該投資信託のベンチマークとの差異

当ファンドの、当期の基準価額の騰落率は1.4%の低下となりました。同期間におけるベンチマーク（NOMURA-BPI総合）の騰落率は1.4%の低下となり、ベンチマークに沿った運用を行った結果、基準価額はベンチマークと同様の動きとなりました。

## ■今後の運用方針

当ファンドの運用の基本方針に従い、今後もNOMURA-BPI総合に採用されている公社債に投資することにより、当該インデックスの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

■ 1 万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2020年2月18日～2021年2月15日)		
	金額	比率	
平均基準価額	12,202円	—	期中の平均基準価額（月末値の平均値）です。
(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 その他費用
（その他）	(0)	(0.001)	・その他は、信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	0	0.001	

\* 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって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。

\* 各項目毎に円未満は四捨五入してあります。

\* 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

■ 売買及び取引の状況（2020年2月18日から2021年2月15日まで）

公社債

		買付額	売付額
国    内	国債証券	1,055,555 千円	1,590,804 千円
	地方債証券	—	102,065
	特殊債証券	—	(10,441)
	社債券（投資法人債券を含む）	117,989	100,362 (100,000)

(注1) 金額は受け渡し代金です。（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ております。

(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（2020年2月18日から2021年2月15日まで）

当期中における利害関係人との取引等はありません。

(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。

## ■組入資産の明細（2021年2月15日現在）

## (A) 債券種類別開示

## 国内（邦貨建）公社債

区 分	当 期		末				
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	内BB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	8,993,000 ( 270,000)	10,027,639 ( 330,324)	82.0 ( 2.7)	— (—)	59.2 ( 2.7)	17.3 ( —)	5.6 ( —)
地 方 債 証 券	800,000 ( 800,000)	840,622 ( 840,622)	6.9 ( 6.9)	— (—)	6.0 ( 6.0)	— ( —)	0.8 (0.8)
特 殊 債 証 券 (除 く 金 融 債)	638,253 ( 638,253)	646,446 ( 646,446)	5.3 ( 5.3)	— (—)	1.6 ( 1.6)	3.7 ( 3.7)	— ( —)
金 融 債 証 券	100,000 ( 100,000)	100,003 ( 100,003)	0.8 ( 0.8)	— (—)	— ( —)	— ( —)	0.8 (0.8)
普 通 社 債 証 券 (含 む 投 資 法 人 債 証 券)	500,000 ( 500,000)	529,926 ( 529,926)	4.3 ( 4.3)	— (—)	2.7 ( 2.7)	0.8 ( 0.8)	0.8 (0.8)
合 計	11,031,253 ( 2,308,253)	12,144,637 ( 2,447,321)	99.3 (20.0)	— (—)	69.5 (13.0)	21.8 ( 4.5)	8.0 (2.5)

(注1) ( )内は非上場債で内書きです。

(注2) 組入比率は、当期末の純資産総額に対する評価額の割合です。

(注3) 額面金額・評価額の単位未満は切り捨てです。

(注4) —印は組入れがありません。

## (B) 個別銘柄開示

## 国内（邦貨建）公社債

銘 柄	期 名	当 期 末				
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日	
		%	千円	千円		
国債証券						
第1回利付国債(40年)		2.4	120,000	172,743	2048/3/20	
第6回利付国債(40年)		1.9	50,000	67,399	2053/3/20	
第7回利付国債(40年)		1.7	20,000	25,966	2054/3/20	
第11回利付国債(40年)		0.8	50,000	51,777	2058/3/20	
第13回利付国債(40年)		0.5	50,000	46,715	2060/3/20	
第321回利付国債(10年)		1.0	100,000	101,225	2022/3/20	
第322回利付国債(10年)		0.9	50,000	50,558	2022/3/20	
第324回利付国債(10年)		0.8	120,000	121,489	2022/6/20	
第325回利付国債(10年)		0.8	100,000	101,475	2022/9/20	
第326回利付国債(10年)		0.7	300,000	304,566	2022/12/20	
第331回利付国債(10年)		0.6	200,000	203,742	2023/9/20	
第332回利付国債(10年)		0.6	200,000	204,134	2023/12/20	
第333回利付国債(10年)		0.6	300,000	306,741	2024/3/20	
第334回利付国債(10年)		0.6	200,000	204,828	2024/6/20	
第335回利付国債(10年)		0.5	200,000	204,436	2024/9/20	
第336回利付国債(10年)		0.5	100,000	102,353	2024/12/20	

決 算 銘 柄	期 名	当 期			末	
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日	
国債証券		%	千円	千円		
第339回利付国債 (10年)		0.4	200,000	204,446	2025/6/20	
第340回利付国債 (10年)		0.4	150,000	153,529	2025/9/20	
第344回利付国債 (10年)		0.1	60,000	60,623	2026/9/20	
第345回利付国債 (10年)		0.1	200,000	202,112	2026/12/20	
第346回利付国債 (10年)		0.1	70,000	70,749	2027/3/20	
第350回利付国債 (10年)		0.1	200,000	202,062	2028/3/20	
第351回利付国債 (10年)		0.1	350,000	353,475	2028/6/20	
第356回利付国債 (10年)		0.1	180,000	181,312	2029/9/20	
第358回利付国債 (10年)		0.1	370,000	372,009	2030/3/20	
第2回利付国債 (30年)		2.4	200,000	242,486	2030/2/20	
第6回利付国債 (30年)		2.4	41,000	50,983	2031/11/20	
第12回利付国債 (30年)		2.1	120,000	148,368	2033/9/20	
第15回利付国債 (30年)		2.5	50,000	64,899	2034/6/20	
第18回利付国債 (30年)		2.3	110,000	141,070	2035/3/20	
第21回利付国債 (30年)		2.3	100,000	129,150	2035/12/20	
第25回利付国債 (30年)		2.3	120,000	156,411	2036/12/20	
第28回利付国債 (30年)		2.5	120,000	161,989	2038/3/20	
第29回利付国債 (30年)		2.4	190,000	254,334	2038/9/20	
第32回利付国債 (30年)		2.3	50,000	66,787	2040/3/20	
第34回利付国債 (30年)		2.2	90,000	119,455	2041/3/20	
第35回利付国債 (30年)		2.0	120,000	155,198	2041/9/20	
第36回利付国債 (30年)		2.0	50,000	64,864	2042/3/20	
第37回利付国債 (30年)		1.9	100,000	128,031	2042/9/20	
第38回利付国債 (30年)		1.8	150,000	189,540	2043/3/20	
第39回利付国債 (30年)		1.9	50,000	64,260	2043/6/20	
第40回利付国債 (30年)		1.8	50,000	63,322	2043/9/20	
第41回利付国債 (30年)		1.7	50,000	62,363	2043/12/20	
第44回利付国債 (30年)		1.7	50,000	62,529	2044/9/20	
第45回利付国債 (30年)		1.5	50,000	60,393	2044/12/20	
第46回利付国債 (30年)		1.5	50,000	60,424	2045/3/20	
第48回利付国債 (30年)		1.4	50,000	59,334	2045/9/20	
第49回利付国債 (30年)		1.4	100,000	118,706	2045/12/20	
第51回利付国債 (30年)		0.3	100,000	92,992	2046/6/20	
第62回利付国債 (30年)		0.5	70,000	67,265	2049/3/20	
第65回利付国債 (30年)		0.4	30,000	27,907	2049/12/20	
第66回利付国債 (30年)		0.4	20,000	18,594	2050/3/20	
第68回利付国債 (30年)		0.6	40,000	39,211	2050/9/20	
第65回利付国債 (20年)		1.9	20,000	21,151	2023/12/20	

決 算 期 銘 柄 名	当 期			末	
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日	
国債証券	%	千円	千円		
第68回利付国債 (20年)	2.2	53,000	56,819	2024/3/20	
第74回利付国債 (20年)	2.1	35,000	37,983	2024/12/20	
第78回利付国債 (20年)	1.9	54,000	58,719	2025/6/20	
第81回利付国債 (20年)	2.0	100,000	109,712	2025/9/20	
第82回利付国債 (20年)	2.1	20,000	22,034	2025/9/20	
第83回利付国債 (20年)	2.1	100,000	110,702	2025/12/20	
第84回利付国債 (20年)	2.0	100,000	110,215	2025/12/20	
第90回利付国債 (20年)	2.2	100,000	112,806	2026/9/20	
第91回利付国債 (20年)	2.3	100,000	113,368	2026/9/20	
第92回利付国債 (20年)	2.1	50,000	56,380	2026/12/20	
第94回利付国債 (20年)	2.1	70,000	79,286	2027/3/20	
第95回利付国債 (20年)	2.3	200,000	230,110	2027/6/20	
第100回利付国債 (20年)	2.2	140,000	162,346	2028/3/20	
第121回利付国債 (20年)	1.9	100,000	117,491	2030/9/20	
第124回利付国債 (20年)	2.0	80,000	95,090	2030/12/20	
第125回利付国債 (20年)	2.2	100,000	121,214	2031/3/20	
第127回利付国債 (20年)	1.9	100,000	118,212	2031/3/20	
第129回利付国債 (20年)	1.8	20,000	23,491	2031/6/20	
第133回利付国債 (20年)	1.8	50,000	59,021	2031/12/20	
第139回利付国債 (20年)	1.6	100,000	116,362	2032/6/20	
第141回利付国債 (20年)	1.7	100,000	117,964	2032/12/20	
第144回利付国債 (20年)	1.5	80,000	92,656	2033/3/20	
第145回利付国債 (20年)	1.7	50,000	59,210	2033/6/20	
第147回利付国債 (20年)	1.6	50,000	58,800	2033/12/20	
第148回利付国債 (20年)	1.5	350,000	407,767	2034/3/20	
第154回利付国債 (20年)	1.2	50,000	56,567	2035/9/20	
第157回利付国債 (20年)	0.2	150,000	147,475	2036/6/20	
第158回利付国債 (20年)	0.5	100,000	102,673	2036/9/20	
第164回利付国債 (20年)	0.5	50,000	50,962	2038/3/20	
第174回利付国債 (20年)	0.4	30,000	29,570	2040/9/20	
第175回利付国債 (20年)	0.5	30,000	30,135	2040/12/20	
小 計		8,993,000	10,027,639		
地方債証券					
第13回東京都公募公債	1.93	100,000	126,411	2042/3/19	
第792回東京都公募公債	0.05	200,000	198,542	2029/3/19	
平成28年度第2回静岡県公募公債	0.08	100,000	100,025	2026/3/19	
第155回共同発行市場公募地方債	0.22	100,000	101,004	2026/2/25	
第161回共同発行市場公募地方債	0.06	100,000	99,917	2026/8/25	

決 算 期 銘 柄 名	当 期			末
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券	%	千円	千円	
第19回公営企業債券	2.37	100,000	113,212	2026/12/18
第44回地方公共団体金融機構債券	0.791	100,000	101,511	2023/1/27
小 計		800,000	840,622	
特殊債券（除く金融債）				
第103回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.155	100,000	100,646	2027/12/17
第190回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.605	249,000	252,388	2023/5/31
第88回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.06	100,000	100,073	2023/3/20
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	11,963	12,294	2042/5/10
第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.25	11,249	11,459	2037/5/10
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.67	27,782	29,354	2046/7/10
第75回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.26	38,259	40,125	2048/8/10
第50回東日本高速道路株式会社債	0.08	100,000	100,105	2023/6/20
小 計		638,253	646,446	
金融債券				
第318回信金中金債	0.04	100,000	100,003	2021/5/27
小 計		100,000	100,003	
普通社債券（含む投資法人債券）				
第389回中国電力株式会社社債	0.3	100,000	100,668	2026/4/24
第81回三菱商事株式会社無担保社債	1.518	100,000	110,996	2032/6/25
第80回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	0.07	100,000	99,915	2022/10/24
第45回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.321	100,000	117,127	2029/6/19
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	0.69	100,000	101,220	2023/3/20
小 計		500,000	529,926	
合 計		11,031,253	12,144,637	

(注) 額面金額・評価額の単位未満は切り捨てです。

■有価証券の貸付及び借入の状況（2021年2月15日現在）  
該当事項はありません。

(2021年2月15日現在)

## ■投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公 社 債	12, 144, 637	99. 3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	89, 018	0. 7
投 資 信 託 財 産 総 額	12, 233, 655	100. 0

(注) 金額の単位未満は切り捨てております。

## ■資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	当 期 末 2021年2月15日
(A) 資 産	12, 233, 655, 147円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	49, 905, 015
公 社 債(評価額)	12, 144, 637, 455
未 収 利 息	38, 455, 618
前 払 費 用	657, 059
(B) 負 債	8, 605, 009
未 払 解 約 金	8, 601, 849
そ の 他 未 払 費 用	3, 160
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	12, 225, 050, 138
元 本	10, 079, 453, 877
次 期 繰 越 損 益 金	2, 145, 596, 261
(D) 受 益 権 総 口 数	10, 079, 453, 877口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C / D)	12, 129円

(注1) 当親ファンドの期首元本額は10,782,191,936円、期中追加設定元本額は1,152,811,328円、期中一部解約元本額は1,855,549,387円です。

(注2) 当親ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は以下の通りです。

マニユライフ・日本債券インデックスファンド(適格機関投資家専用)	3, 834, 939, 132円
マニユライフ・国際分散ファンド20(適格機関投資家専用)	5, 580, 855, 049円
マニユライフ・国際分散ファンド75(適格機関投資家専用)	550, 638, 060円
マニユライフ・国際分散ファンド50(適格機関投資家専用)	112, 209, 539円
マニユライフ・アジア経済圏・小型成長株ファンド	91, 845円
マニユライフ・変動高金利戦略ファンド Aコース(為替ヘッジあり・毎月)	91, 450円
マニユライフ・変動高金利戦略ファンド Bコース(為替ヘッジなし・毎月)	91, 450円

## ■損益の状況

項 目	当 期 自 2020年2月18日 至 2021年2月15日
(A) 配 当 等 収 益	126, 778, 502円
受 取 利 息	126, 778, 502
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 300, 334, 010
売 買 益	907, 800
売 買 損	△ 301, 241, 810
(C) 信 託 報 酬 等	△ 67, 633
(D) 当 期 損 益 金(A + B + C)	△ 173, 623, 141
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	2, 475, 165, 433
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	253, 550, 939
(G) 解 約 差 損 益 金	△ 409, 496, 970
(H) 計 (D + E + F + G)	2, 145, 596, 261
次 期 繰 越 損 益 金(H)	2, 145, 596, 261

(注1) 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2) 損益の状況の中で(C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) 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4) 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。

マニユライフ・変動高金利戦略ファンド Cコース (為替ヘッジあり・年2回)	91,450円
マニユライフ・変動高金利戦略ファンド Dコース (為替ヘッジなし・年2回)	91,450円
マニユライフ・米国投資適格債券戦略ファンド Aコース (為替ヘッジあり・毎月)	83,613円
マニユライフ・米国投資適格債券戦略ファンド Bコース (為替ヘッジなし・毎月)	83,613円
マニユライフ・米国投資適格債券戦略ファンド Cコース (為替ヘッジあり・年2回)	83,613円
マニユライフ・米国投資適格債券戦略ファンド Dコース (為替ヘッジなし・年2回)	83,613円
マニユライフ・ストラテジック・インカム・ファンド (為替ヘッジなし) <ラップ>	10,000円
マニユライフ・ストラテジック・インカム・ファンド (為替ヘッジあり) <ラップ>	10,000円

(注3) 1口当たり純資産額は1,2129円です。

※当ファンドは監査対象ではありません。

## お知らせ

### ◆約款変更

マニユライフ・アセット・マネジメント株式会社は、2020年4月1日付で商号をマニユライフ・インベストメント・マネジメント株式会社に変更しました。商号変更に伴い、信託約款に所要の変更を行いました。  
(2020年4月1日)

### ◆運用体制の変更

該当事項はありません。