

マニユライフ・
銀行貸付債権ファンド15-07
愛称：アメリカン・フロート15-07

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | |
|--------|--|
| 商品分類 | 単位型投信／海外／その他資産（貸付債権） |
| 信託期間 | 2015年7月31日から2019年12月16日まで。 |
| 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。 |
| 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、元本超過額または経費控除後の利子、配当等収益のいずれか多い額とします。 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、収益分配を行わない場合があります。 |

運用報告書（全体版）

第13期（決算日 2018年9月18日）
第14期（決算日 2018年12月17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・銀行貸付債権ファンド15-07愛称：アメリカン・フロート15-07」は、このたび、第14期の決算を行いました。ここに、第13期～第14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・アセット・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 <http://www.mamj.co.jp/>

■設定以来の運用実績

| 作成期 | 決算期 | 基準価額 | | | | 受益者 利回り | 参考指数 | | 株式 組入比率 | 債券 組入比率 | 投資信託 証券比率 | 元本 残存率 |
|-------|---------------------|-------------|-----------|-----------|-----------|------------|--------|--------|------------|------------|--------------|------------|
| | | (分配落) | 税込 分配金 | 期中 騰落額 | 期中 騰落率 | | 騰落率 | 騰落率 | | | | |
| 第1作成期 | (設定日) 2015年7月31日 | 円 10,000 | 円 - | 円 - | % - | % - | 10,000 | % - | % - | % - | % - | % 100.0 |
| | 1期(2015年9月15日) | 9,957 | - | △43 | △0.4 | △3.3 | 9,954 | △0.5 | - | 0.0 | 99.2 | 99.6 |
| | 2期(2015年12月15日) | 9,649 | 50 | △258 | △2.6 | △8.0 | 9,652 | △3.0 | - | 0.0 | 98.1 | 99.1 |
| 第2作成期 | 3期(2016年3月15日) | 9,574 | 50 | △25 | △0.3 | △5.2 | 9,718 | 0.7 | - | 0.0 | 99.1 | 97.1 |
| | 4期(2016年6月15日) | 9,777 | 20 | 223 | 2.3 | △1.2 | 10,107 | 4.0 | - | 0.0 | 95.2 | 96.0 |
| 第3作成期 | 5期(2016年9月15日) | 9,870 | 20 | 113 | 1.2 | 0.1 | 10,342 | 2.3 | - | 0.0 | 99.4 | 94.5 |
| | 6期(2016年12月15日) | 9,946 | 20 | 96 | 1.0 | 0.8 | 10,597 | 2.5 | - | 0.0 | 104.5 | 93.3 |
| 第4作成期 | 7期(2017年3月15日) | 9,978 | 20 | 52 | 0.5 | 1.0 | 10,764 | 1.6 | - | 0.0 | 100.4 | 91.2 |
| | 8期(2017年6月15日) | 9,928 | 20 | △30 | △0.3 | 0.7 | 10,853 | 0.8 | - | 0.0 | 98.4 | 90.3 |
| 第5作成期 | 9期(2017年9月15日) | 9,923 | 20 | 15 | 0.2 | 0.7 | 10,927 | 0.7 | - | 0.0 | 99.0 | 87.4 |
| | 10期(2017年12月15日) | 9,943 | 20 | 40 | 0.4 | 0.8 | 11,058 | 1.2 | - | 0.0 | 98.7 | 86.3 |
| 第6作成期 | 11期(2018年3月15日) | 9,968 | 20 | 45 | 0.5 | 0.9 | 11,245 | 1.7 | - | 0.0 | 96.8 | 84.6 |
| | 12期(2018年6月15日) | 9,958 | 20 | 10 | 0.1 | 0.8 | 11,365 | 1.1 | - | 0.0 | 100.5 | 81.6 |
| 第7作成期 | 13期(2018年9月18日) | 9,945 | 20 | 7 | 0.1 | 0.8 | 11,529 | 1.4 | - | 0.0 | 98.3 | 79.6 |
| | 14期(2018年12月17日) | 9,697 | 20 | △228 | △2.3 | 0.1 | 11,340 | △1.6 | - | 0.0 | 98.9 | 78.6 |

(注1) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注2) 基準価額は1万円当たり、騰落率は分配金込みです。

(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。（以下「参考指数」といいます。）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。

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（配当込み/米ドルベース）は、クレディ・スイス証券が算出する、バンクローン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 | | | |
| 第13期 | (期 首) 2018年 6 月15日 | 円 | % | | % | % | % | % |
| | | 9,958 | — | 11,365 | — | — | 0.0 | 100.5 |
| | 6 月末 | 9,926 | △0.3 | 11,343 | △0.2 | — | 0.0 | 100.7 |
| | 7 月末 | 9,935 | △0.2 | 11,437 | 0.6 | — | 0.0 | 96.5 |
| | 8 月末 | 9,946 | △0.1 | 11,485 | 1.1 | — | 0.0 | 96.8 |
| | (期 末) 2018年 9 月18日 | 9,965 | 0.1 | 11,529 | 1.4 | — | 0.0 | 98.3 |
| 第14期 | (期 首) 2018年 9 月18日 | 9,945 | — | 11,529 | — | — | 0.0 | 98.3 |
| | 9 月末 | 9,966 | 0.2 | 11,562 | 0.3 | — | 0.0 | 100.0 |
| | 10 月末 | 9,941 | △0.0 | 11,565 | 0.3 | — | 0.0 | 98.5 |
| | 11 月末 | 9,824 | △1.2 | 11,477 | △0.5 | — | 0.0 | 99.2 |
| | (期 末) 2018年12月17日 | 9,717 | △2.3 | 11,340 | △1.6 | — | 0.0 | 98.9 |

(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。)

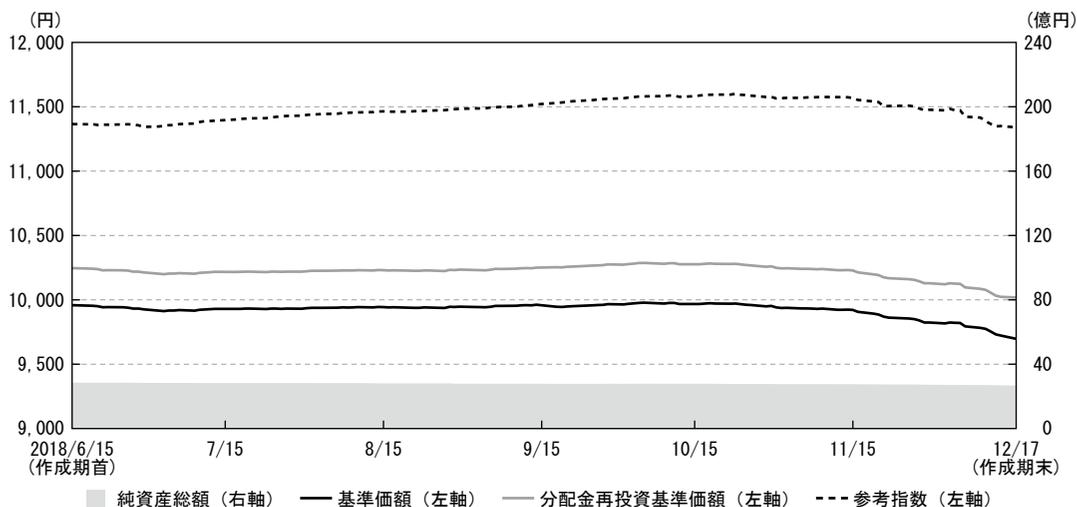
(注2) 基準価額は1万円当たりで表示しています。

(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。

運用経過

■基準価額等の推移（2018年6月16日から2018年12月17日まで）



作成期首：9,958円

作成期末：9,697円（既払分配金40円）

騰落率：△2.2%（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。当ファンドは単位型投資信託ですので、実際には分配金は再投資されませんのでご注意ください。

※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）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。

■基準価額の主な変動要因

- ・主要投資対象ファンドが保有する銀行貸付債権の安定的な金利収入がプラス寄与しました。
- ・主要投資対象ファンドが保有する銀行貸付債権の価格下落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 | △0.3% |
| マニュライフ・日本債券インデックス・マザーファンド | 0.05% |

■投資環境

[米国債券市況]

期初、10年国債利回りは2.9%台で始まり、6月末にかけて、米中貿易摩擦激化への懸念を背景に比較的安全資産とされる米国債に資金が流入したことから低下しました。7月には国債利回りが上昇する局面もありましたが、8月には、トルコリラの急落を受けて米国債に資金が流入し、2.8%台まで利回りは低下しました。9月から10月上旬にかけては、堅調な経済指標や米国の利上げを背景に国債利回りは3.2%台まで上昇しました。しかし、10月中旬以降、世界的な株安や原油安などを受けて国債利回りは低下し、11月初旬には堅調な経済指標から国債利回りが反発する局面もありましたが、11月中旬から期末にかけては原油安やF R B（米連邦準備制度理事会）高官による利上げサイクルの終了が近いことを示唆する発言、2年債と5年債の利回り逆転（逆イールド）などを受けて国債利回りの低下が進み、期初を下回る2.8%台で作成期末を迎えました。

銀行貸付債権は、11月以降に、F R Bの利上げサイクル早期終了の観測が強まったことなどを受けて、資金流出が見られたことなどから、トータルリターンベースでは期を通じて下落しました。銀行貸付債権の基準金利である3ヵ月米ドルL I B O R（ロンドン銀行間取引金利）は、期初2.3%台から期末には2.8%台へ上昇しました。

[日本債券市況]

当作成期間の10年国債利回りは、作成期初0.035%から作成期末0.030%となり利回り低下（価格は上昇）となりました。

■当該投資信託のポートフォリオ

当ファンド

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・フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA」（以下「M I T - フローティング・レート・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。

M I T - フローティング・レート・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

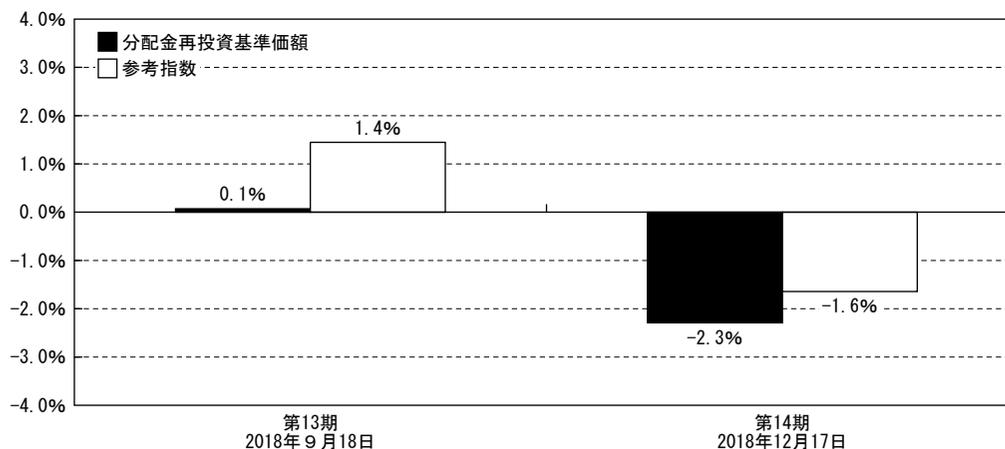
主に、N O M U R A - B P I 総合に採用されている公社債に投資することにより、同インデックスの動きに連動する投資成果をめざして運用を行いました。

[資産構成比率]

| 組入ファンド・資産 | 比率 |
|--------------------------------|--------|
| MIT-フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA | 98.9% |
| マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド | 0.0% |
| 現預金等 | 1.1% |
| 合計 | 100.0% |

■当該投資信託のベンチマークとの差異

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。



※当ファンドは単位型投資信託ですので、実際には分配金は再投資されませんのでご注意ください。

※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。

■収益分配金について

当作成期間の収益分配は、分配方針に基づき第13期20円、第14期20円、合計40円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。

■今後の運用方針

当ファンド

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。

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

米国経済や米国企業のファンダメンタルズは相対的に健全で、企業の倒産確率も低く抑えられています。税制改革により経済成長の加速や、個人消費および企業景況感が上昇することも期待されます。銀行貸付債権は、金利上昇局面で変動金利が有利であることや、比較的高い利回りを求める投資家の需要が見込まれることから、魅力的な投資先であると考えます。しかし企業の信用力改善による価格上昇がこれまで大きく進んできたことや、米国の貿易摩擦問題などにより市場での変動が一時的に高まる可能性があることから、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。

■ 1万口当たりの費用明細

| 項目 | 第13期～第14期 | | 項目の概要 |
|-------------|--------------------------|---------|---|
| | (2018年6月16日～2018年12月17日) | | |
| | 金額 | 比率 | |
| 平均基準価額 | 9,923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 | 64円 | 0.643% | (a) 信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率 |
| （投信会社） | (24) | (0.246) | ・委託した資金の運用の対価 |
| （販売会社） | (38) | (0.383) | ・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 |
| （受託会社） | (1) | (0.014) | ・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 | 3 | 0.033 | (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） | (0) | (0.001) | ・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） | (1) | (0.014) | ・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） | (2) | (0.017) | ・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） | (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 | 67 | 0.676 | |

* 作成期間の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は、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作成期間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（2018年6月16日から2018年12月17日まで）
投資信託証券

| 決 算 期 銘 柄 名 | 第 13 期 ～ 第 14 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 |
| | 11,518 | 959 | 30,599 | 2,560 |

（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（2018年6月16日から2018年12月17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。

マニユライフ・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
(2018年6月16日から2018年12月17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（2018年6月16日から2018年12月17日まで）

該当事項はありません。

■組入資産の明細（2018年12月17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 | 第 7 作 成 期 末 | | 組 入 比 率 |
|--|--------------|----------------|-----------------|-----------|
| | | 評 価 額 | | |
| | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| (ケイマン諸島) MITフロンティア・レート・インカム・ ファンド クラスA | 口 287,435 | 千米ドル 23,336 | 千円 2,648,034 | % 98.9 |
| 合 計 | 287,435 | 23,336 | 2,648,034 | |

(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 6 作 成 期 末 | 第 7 作 成 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 87 | 千口 87 | 千円 105 |

(注1) マザーファンドの2018年12月17日現在の受益権総口数は12,527,213千口です。

(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（2018年12月17日現在）

該当事項はありません。

■投資信託財産の構成

(2018年12月17日現在)

| 項 目 | 第 7 作 成 期 末 | |
|--------------------------|-----------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 投 資 信 託 受 益 証 券 | 千円 2,648,034 | % 98.0 |
| マニュアル・日本債券インデックス・マザーファンド | 105 | 0.0 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 55,136 | 2.0 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 2,703,275 | 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（2,648,034千円）の投資信託財産総額（2,703,275千円）に対する比率は98.0%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=113.47円です。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

| 項 目 | 第13期末 2018年9月18日 | 第14期末 2018年12月17日 |
|---------------------------------------|---------------------|----------------------|
| (A) 資 産 | 5,481,298,805円 | 5,380,853,724円 |
| コール・ローン等 | 74,091,152 | 55,007,056 |
| 投資信託受益証券(評価額) | 2,731,411,477 | 2,648,034,221 |
| 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) | 104,542 | 105,312 |
| 未 収 入 金 | 2,675,691,634 | 2,677,707,135 |
| (B) 負 債 | 2,702,985,942 | 2,704,439,198 |
| 未 払 金 | 2,686,275,900 | 2,688,795,450 |
| 未 払 収 益 分 配 金 | 5,587,332 | 5,520,262 |
| 未 払 解 約 金 | 1,490,800 | 1,129,781 |
| 未 払 信 託 報 酬 | 9,178,643 | 8,565,074 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 453,267 | 428,631 |
| (C) 純 資 産 総 額 (A - B) | 2,778,312,863 | 2,676,414,526 |
| 元 本 | 2,793,666,022 | 2,760,131,362 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | △ 15,353,159 | △ 83,716,836 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 2,793,666,022口 | 2,760,131,362口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 9,945円 | 9,697円 |

(注1) 当ファンドの設定元本額は3,507,269,499円、第13期首元本額は2,863,276,098円、当作成期末における元本残存率は78.6%です。

(注2) 1口当たり純資産額は、第13期0.9945円、第14期0.9697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13期末15,353,159円、第14期末83,716,836円です。

■損益の状況

| 項 目 | 第13期 自2018年6月16日 至2018年9月18日 | 第14期 自2018年9月19日 至2018年12月17日 |
|-------------------------|------------------------------------|-------------------------------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 49,894,296円 | 49,197,151円 |
| 受 取 配 当 金 | 49,894,296 | 49,197,151 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | △ 30,243,624 | △22,636,533 |
| 売 買 益 | 123,510,688 | 53,446,311 |
| 売 買 損 | △153,754,312 | △76,082,844 |
| (C) 有 価 証 券 評 価 差 損 益 | △ 8,237,342 | △80,732,350 |
| (D) 信 託 報 酬 等 | △ 9,771,866 | △ 9,066,154 |
| (E) 当 期 損 益 金 (A+B+C+D) | 1,641,464 | △63,237,886 |
| (F) 前 期 繰 越 損 益 金 | △ 11,967,235 | △15,353,159 |
| (G) 解 約 差 損 益 金 | 559,944 | 394,471 |
| (H) 計 (E+F+G) | △ 9,765,827 | △78,196,574 |
| (I) 収 益 分 配 金 | △ 5,587,332 | △ 5,520,262 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (H+I) | △ 15,353,159 | △83,716,836 |

(注1) 損益の状況の中で(D)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2) 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。

(注3) 収益分配金の計算過程は以下の通りです。

第13期 計算期間末における当ファンドの配当等収益額(49,894,296円)に親ファンドの配当等収益額(275円)を加えた配当等収益合計額(49,894,571円)から経費(9,771,866円)を控除した額(40,122,705円)に、期末の受益権口数(2,793,666,022口)を乗じて期中の平均受益権口数(2,824,780,567口)で除することにより分配可能額は(39,680,759円)(10,000口当たり142円)であり、うち5,587,332円を分配金額としております。

第14期 計算期間末における当ファンドの配当等収益額(49,197,151円)に親ファンドの配当等収益額(253円)を加えた配当等収益合計額(49,197,404円)から経費(9,066,154円)を控除した額(40,131,250円)に、期末の受益権口数(2,760,131,362口)を乗じて期中の平均受益権口数(2,775,109,444口)で除することにより分配可能額は(39,914,649円)(10,000口当たり144円)であり、うち5,520,262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 13 期 | 第 14 期 |
|-------------------|--------|--------|
| 1 万 口 当 た り 分 配 金 | 20円 | 20円 |

- ・分配金は税込みです。
- ・分配金は、税金を差し引いた後、決算日から起算して5営業日までに販売会社より支払いが開始されます。

課税上の取り扱い

- ・20.315%（所得税および復興特別所得税15.315%、地方税5%）の税率による源泉徴収が行われます。
- ・個人受益者の源泉徴収時の税率であり、課税方法等により異なる場合があります。
- ・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。

※課税上の取り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。

<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 | マニュライフ・アセット・マネジメント（HK）リミテッド |
| 投資顧問会社 | マニュライフ・アセット・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・リターンを獲得をめざします。 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 | 4.96% |
| 直接利回り | 5.10% |
| 最終利回り | 6.23% |
| 平均デュレーション | 0.13年 |
| 残存年数 | 5.26年 |
| 平均格付け | B+ |

※現地の2018年6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140銘柄）

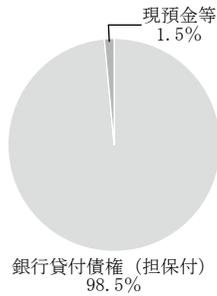
| | 銘柄名 | 組入比率 |
|----|--------------------------------|-------|
| 1 | セーブル・インターナショナル・ファイナンス | 1.24% |
| 2 | ナビスター・インク | 1.22% |
| 3 | ラックススペース・ホスティング | 1.19% |
| 4 | ウーバー・テクノロジーズ | 1.18% |
| 5 | ツイン・リバー・マネジメント・グループ | 1.16% |
| 6 | ゲイツ・グローバル | 1.16% |
| 7 | マグローヒル・グローバル・エデュケーション・ホールディングス | 1.15% |
| 8 | テンポ・アクイジション | 1.14% |
| 9 | ステーション・カジノズ | 1.13% |
| 10 | WP CPPホールディングス | 1.11% |

※現地の2018年6月最終営業日のデータです。

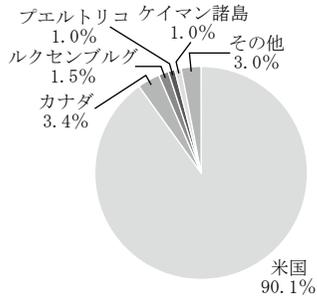
※組入比率は純資産総額に対する比率です。

※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。

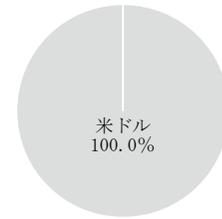
○資産別配分



○国・地域別配分



○通貨別配分



※現地の2018年6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ーフローティング・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

(2018年1月1日から2018年6月30日まで)
(単位：米ドル)

| | |
|--------------|----------------|
| マネジメントフィー | 395,649 |
| カストディーフィー等 | 49,456 |
| トラスティーフィー | 5,952 |
| 監査報酬等 | 23,871 |
| 評価手数料 | 12,500 |
| 取引手数料 | 1,818 |
| 年間権限費用 | 1,846 |
| 会計及びその他専門家費用 | 1,488 |
| その他費用 | 9,183 |
| 費用合計 | 501,763 |

■有価証券明細表 2018年6月30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 (%) |
|--|--------------|--------------|----------|
| AIR CANADA 10/06/2023 | 1,084,802.50 | 1,086,947.60 | 0.57 |
| ACADIA HEALTHCARE CO INC 02/11/2022 | 1,521,352.05 | 1,523,915.82 | 0.80 |
| ANCESTRY.COM OPERATIONS INC 10/19/2023 | 1,134,877.50 | 1,132,661.35 | 0.60 |
| ACRISURE LLC 11/22/2023 | 992,500.00 | 999,487.24 | 0.53 |
| ACRISURE LLC 11/22/2023 | 1,435,000.00 | 1,422,443.75 | 0.75 |
| ANCHOR GLASS CONTAINER 12/07/2024 | 538,000.00 | 357,571.52 | 0.19 |
| AIR MEDICAL GROUP HOLDINGS 04/28/2022 | 1,900,770.94 | 1,850,573.15 | 0.98 |
| ASP AMC MERGER SUB 04/13/2024 | 619,363.65 | 593,049.45 | 0.31 |
| ALBERTSON'S LLC 12/21/2022 | 1,965,187.11 | 1,947,073.97 | 1.03 |
| ALPHA 3 BV 01/25/2024 | 1,822,884.26 | 1,826,708.36 | 0.96 |
| ALTRAN TECHNOLOGIES SA 02/01/2025 | 1,346,625.00 | 1,335,045.37 | 0.70 |
| APERGY CORP 04/19/2025 | 550,000.00 | 551,394.00 | 0.29 |
| IRB HOLDING CORP 01/19/2025 | 658,350.00 | 659,083.25 | 0.35 |
| AVAYA INC 12/15/2024 | 1,641,750.00 | 1,644,509.43 | 0.87 |
| BAKERCORP TL B 1L USD 2/7/2020 | 1,051,517.32 | 1,046,111.26 | 0.55 |
| 1011778 BC ULC 02/16/2024 | 945,406.04 | 940,614.07 | 0.50 |
| TWIN RIVER MANAGEMENT GROUP 07/10/2020 | 2,196,873.10 | 2,196,223.12 | 1.16 |
| BUILDERS FIRSTSOURCE INC 02/29/2024 | 1,761,491.34 | 1,759,811.50 | 0.93 |
| BRAND ENERGY & INFRASTRUCTU 06/16/2024 | 1,227,600.00 | 1,228,815.85 | 0.65 |
| BWAY CORP 04/03/2024 | 990,000.00 | 984,269.33 | 0.52 |
| CAMELOT FINANCE LP 10/03/2023 | 1,080,859.81 | 1,076,857.23 | 0.57 |
| CARESTREAM HEALT TL B 1L USD 6/7/2019 | 708,597.39 | 708,312.91 | 0.37 |
| CHEMOURS CO 03/26/2025 | 1,579,050.46 | 1,557,676.26 | 0.82 |
| COGECO COMMUNICATIONS US 08/11/2024 | 1,940,000.00 | 1,927,037.40 | 1.02 |
| CROWN AMERICAS LLC 01/19/2025 | 700,000.00 | 706,497.04 | 0.37 |
| CHESAPEAKE ENERGY CORP 08/23/2021 | 1,350,000.00 | 1,411,753.02 | 0.75 |
| ARTERRA WINES CANADA INC 12/15/2023 | 1,184,992.41 | 1,179,427.43 | 0.62 |
| CENGAGE LEARNING INC 06/07/2023 | 2,282,494.08 | 2,096,556.78 | 1.11 |
| CONSOLIDATED COMMUNICATIONS 10/05/2023 | 1,144,207.10 | 1,126,418.50 | 0.59 |
| USI INC/NY 05/16/2024 | 1,463,937.50 | 1,454,489.76 | 0.77 |
| CONSOLIDATED CONTAINER CO 05/22/2024 | 1,101,688.88 | 1,099,781.94 | 0.58 |
| WP CPP HOLDINGS LLC 04/25/2025 | 2,100,000.00 | 2,111,745.96 | 1.11 |
| WP CPP HOLDINGS LLC 04/30/2026 | 700,000.00 | 700,648.68 | 0.37 |
| COMMUNICATIONS SALES & LEAS 10/24/2022 | 1,740,319.58 | 1,660,322.26 | 0.88 |
| CENTURYLINK INC 01/31/2025 | 2,049,700.00 | 2,006,695.42 | 1.06 |
| CATALANT PHARMA SOLUTION 05/20/2024 | 1,801,036.80 | 1,798,931.94 | 0.95 |
| PROJECT DEEP BLUE HOLDIN 01/11/2026 | 400,000.00 | 401,257.97 | 0.21 |
| CSC HOLDINGS LLC 01/12/2026 | 1,393,000.00 | 1,390,022.55 | 0.73 |
| SABLE INTL FINANCE LTD 02/06/2026 | 2,350,000.00 | 2,349,076.12 | 1.24 |
| CHS/COMMUNITY HEALTH SYS IN 12/31/2019 | 952,111.71 | 954,530.13 | 0.50 |
| SOPHIA LP 09/30/2022 | 1,507,491.83 | 1,500,422.05 | 0.79 |
| DHX MEDIA LTD 12/22/2023 | 1,762,200.00 | 1,758,542.84 | 0.93 |
| DIGICEL INTL FINANCE LTD 05/10/2024 | 1,588,001.90 | 1,529,899.74 | 0.81 |
| DONCASTERS FIN TL B 1L USD 4/9/2020 | 2,041,388.82 | 1,969,969.06 | 1.04 |
| DONCASTERS GROUP TL 2L USD 10/10/2020 | 1,000,000.00 | 934,338.02 | 0.49 |
| EDELMAN FINANCIAL CENTER 06/26/2025 | 1,400,000.00 | 1,397,382.00 | 0.74 |
| ENGLITY CORP 08/12/2023 | 1,014,337.17 | 1,011,910.40 | 0.53 |
| ENERGY TRANSFER EQUITY 02/02/2024 | 1,679,116.30 | 1,663,705.13 | 0.88 |
| EVERI PAYMENTS INC 05/09/2024 | 1,683,000.00 | 1,680,665.63 | 0.89 |
| FIRST DATA CORPORATION 04/26/2024 | 1,756,934.89 | 1,746,519.51 | 0.92 |
| FREEDOM MORTGAGE CORP 02/23/2022 | 1,462,264.16 | 1,467,316.38 | 0.77 |
| FRONTIER COMMUNICATIONS 06/15/2024 | 1,757,250.00 | 1,735,310.73 | 0.92 |
| FTS INTL INC TL 1L USD 4/16/2021 | 659,256.16 | 660,878.05 | 0.35 |
| GATES GLOBAL LLC 03/31/2024 | 2,196,233.03 | 2,193,317.45 | 1.16 |
| GARDNER DENVER INC 07/30/2024 | 1,617,592.49 | 1,617,429.24 | 0.85 |
| GOODYEAR TIRE & RUBBER 03/07/2025 | 1,506,666.66 | 1,510,056.66 | 0.80 |
| GTT COMMUNICATIONS INC 04/27/2025 | 1,500,000.00 | 1,479,625.08 | 0.78 |

| 銘柄名 | 数量 | 評価額(米ドル) | 投資比率 (%) |
|---|--------------|--------------|----------|
| GARDA WORLD SECURITY CORP 05/26/2024 | 1,394,793.20 | 1,399,328.79 | 0.74 |
| GETTY IMAGES INC TL B 1L USD 10/19 | 398,944.59 | 384,650.41 | 0.20 |
| HARGRAY MERGER SUB CORP 03/24/2024 | 519,750.00 | 517,948.02 | 0.27 |
| HILTON WORLDWIDE FINANCE 10/25/2023 | 1,809,541.80 | 1,809,940.21 | 0.96 |
| IBC CAPITAL LTD 06/08/2023 | 1,571,062.50 | 1,572,685.49 | 0.83 |
| IBC CAPITAL LTD 09/09/2022 | 275,000.00 | 275,641.79 | 0.15 |
| INTELSAT JACKSON HLDG 11/27/2023 | 2,000,000.00 | 1,994,720.64 | 1.05 |
| GREATBATCH LTD 10/27/2022 | 1,584,948.14 | 1,591,332.95 | 0.84 |
| JD POWER & ASSOCIATES 09/07/2023 | 1,016,663.08 | 1,018,643.73 | 0.54 |
| KINDRED HEALTHCA TL B 1L USD 4/9/21 | 1,923,959.91 | 1,947,615.30 | 1.03 |
| GENTIVA HEALTH SERVICES 06/21/2025 | 750,000.00 | 744,375.00 | 0.39 |
| GENTIVA HEALTH SERVICES 06/21/2026 | 900,000.00 | 909,000.00 | 0.48 |
| GENTIVA HEALTH SERVICES 06/21/2025 | 500,000.00 | 496,250.00 | 0.26 |
| KLOECKNER PENTAPLAST OF AME 06/29/2022 | 863,475.00 | 825,328.76 | 0.44 |
| LIBERTY CABLEVIS TL 1L USD 1/7/22 | 1,930,000.00 | 1,889,171.00 | 1.00 |
| LIONS GATE CAPITAL HOLD 03/20/2025 | 872,812.50 | 868,657.88 | 0.46 |
| LSC COMMUNICATIONS INC 09/30/2022 | 1,945,377.02 | 1,944,991.57 | 1.03 |
| LSF9 ATLANTIS HOLDINGS L 04/21/2023 | 1,535,625.00 | 1,525,644.31 | 0.81 |
| MCGRAW-HILL GLOBAL ED 0 5/2/22 | 2,224,419.41 | 2,173,276.73 | 1.15 |
| MEREDITH CORP 01/31/2025 | 1,995,000.00 | 1,993,070.77 | 1.05 |
| MEDALLION MIDLAND ACQ 10/30/2024 | 1,492,500.00 | 1,478,018.06 | 0.78 |
| NATIONAL MENTOR HOLDINGS INC 01/31/2021 | 1,925,493.86 | 1,923,060.71 | 1.01 |
| METRO-GOLDWYN-MAYER INC 06/28/2026 | 500,000.00 | 495,000.00 | 0.26 |
| MILL US ACQUISITION LLC TL B 1L USD7/20 | 679,316.22 | 667,516.17 | 0.35 |
| MPH ACQUISITION HOLDINGS 06/07/2023 | 883,573.47 | 878,159.34 | 0.46 |
| MALLINCKRODT INTERNATIONAL 09/24/2024 | 1,570,166.16 | 1,557,211.41 | 0.82 |
| ALMONDE INC 06/16/2024 | 1,399,425.00 | 1,380,379.64 | 0.73 |
| MATCH GROUP INC 11/16/2022 | 1,505,560.90 | 1,513,699.50 | 0.80 |
| MICRON TECHNOLOGY INC 04/26/2022 | 1,843,472.26 | 1,846,631.77 | 0.97 |
| NAVISTAR INC 11/06/2024 | 2,307,217.50 | 2,313,938.46 | 1.22 |
| NEP/NCP HOLDCO INC 07/21/2022 | 961,512.41 | 962,830.21 | 0.51 |
| NEW ARCLIN US HOLDINGS 02/09/2025 | 1,139,000.00 | 1,151,091.40 | 0.61 |
| NEW ARCLIN US HOLDINGS 02/14/2024 | 1,270,400.00 | 1,270,811.78 | 0.67 |
| NEIMAN MARCUS GROUP LTD LLC 10/25/2020 | 2,323,690.89 | 2,064,378.26 | 1.09 |
| AERIAL MERGER SUB INC 06/30/2025 | 554,845.97 | 532,652.13 | 0.28 |
| NAB HOLDINGS LLC 06/30/2024 | 1,488,768.75 | 1,478,982.11 | 0.78 |
| MACDERMID INC 06/07/2023 | 678,895.38 | 679,087.48 | 0.36 |
| MACDERMID INC 06/07/2020 | 753,964.55 | 752,747.04 | 0.40 |
| PATRIOT COAL TL EXIT 1L USD 12/18/18 | 1,288,712.32 | 6,701.30 | 0.00 |
| PISCES MIDCO INC 03/29/2025 | 2,000,000.00 | 2,018,454.44 | 1.07 |
| POST HOLDINGS INC 05/24/2024 | 1,435,500.00 | 1,426,805.67 | 0.75 |
| PROJECT ALPHA INTERMEDIA 04/26/2024 | 1,089,000.00 | 1,095,965.10 | 0.58 |
| QUORUM HEALTH CORP 04/12/2022 | 1,618,794.89 | 1,645,086.23 | 0.87 |
| RACKSPACE HOSTING INC 11/03/2023 | 2,281,700.67 | 2,250,006.92 | 1.19 |
| RP CROWN PARENT LLC 10/12/2023 | 785,045.00 | 778,387.10 | 0.41 |
| REVLON CONSUMER PRODUCTS CO 09/07/2023 | 1,282,162.50 | 987,663.57 | 0.52 |
| REYNOLDS GROUP HOLDINGS 02/05/2023 | 1,853,219.19 | 1,848,047.02 | 0.98 |
| SPRINT COMMUNICATIONS 02/02/2024 | 1,325,643.94 | 1,318,799.57 | 0.70 |
| SINCLAIR TELEVISION GROU 12/12/2024 | 1,885,000.00 | 1,876,762.55 | 0.99 |
| SELECT MEDICAL CORP 03/06/2025 | 1,481,250.00 | 1,477,941.81 | 0.78 |
| SCIENTIFIC GAMES INTERNATIO 08/14/2024 | 1,507,434.47 | 1,496,856.15 | 0.79 |
| SOUTHEAST POWERGEN LLC 12/2/2021 | 1,500,364.06 | 1,384,552.63 | 0.73 |
| SS&C TECHNOLOGIES INC 04/16/2025 | 1,038,235.99 | 1,037,919.54 | 0.55 |
| SS&C EUROPEAN HOLDINGS SARL 04/16/2025 | 392,778.37 | 392,658.65 | 0.21 |
| STATION CASINOS LLC 06/08/2023 | 2,145,783.75 | 2,136,204.01 | 1.13 |
| ISTAR FINANCIAL INC 06/19/2023 | 1,500,000.00 | 1,494,375.00 | 0.79 |
| MORAN FOODS LLC 12/05/2023 | 1,226,325.00 | 958,617.81 | 0.51 |
| SUPERVALU INC 06/08/2024 | 741,105.65 | 740,965.40 | 0.39 |
| SUPERVALU INC 06/08/2024 | 444,559.52 | 444,475.38 | 0.23 |

| 銘柄名 | 数量 | 評価額(米ドル) | 投資比率 (%) |
|---|--------------|----------------|----------|
| TRANSDIGM INC 06/09/2023 | 1,911,387.24 | 1,898,007.53 | 1.00 |
| TEMPO ACQUISITION LLC 05/01/2024 | 2,163,150.00 | 2,152,946.37 | 1.14 |
| US TELEPACIFIC CORP 05/02/2023 | 1,422,449.70 | 1,397,254.51 | 0.74 |
| TERRAFORM AP ACQUISITION HOL 06/26/2022 | 1,707,700.54 | 1,710,459.85 | 0.90 |
| TEAM HEALTH HOLDINGS INC 02/06/2024 | 1,488,693.48 | 1,429,546.32 | 0.75 |
| TOWER AUTOMOTIVE HOLDING 03/06/2024 | 1,148,087.90 | 1,152,360.11 | 0.61 |
| TRIBUNE MEDIA CO 01/27/2024 | 1,483,784.54 | 1,480,494.95 | 0.78 |
| TRIBUNE MEDIA CO 12/27/2020 | 119,048.19 | 119,065.03 | 0.06 |
| TRONOX BLOCKED BORROWER 09/22/2024 | 732,181.17 | 731,656.17 | 0.39 |
| TRONOX FINANCE LLC 09/22/2024 | 1,689,648.83 | 1,688,437.30 | 0.89 |
| TRAVEL LEADERS GROUP LLC 01/25/2024 | 987,525.00 | 1,001,318.07 | 0.53 |
| TRINSEO MATERIALS OPERATING 09/06/2024 | 1,945,300.00 | 1,940,392.82 | 1.02 |
| UBER TECHNOLOGIES INC 03/22/2025 | 2,230,000.00 | 2,244,674.57 | 1.18 |
| ULTRA RESOURCES INC 04/12/2024 | 1,165,000.00 | 1,073,216.98 | 0.57 |
| HOYA MIDCO LLC 06/27/2024 | 990,000.00 | 981,645.14 | 0.52 |
| VALEANT PHARMACEUTICALS 05/28/2025 | 1,559,171.67 | 1,558,083.94 | 0.82 |
| WESTERN DIGITAL CORP 04/29/2023 | 1,355,645.67 | 1,354,240.57 | 0.71 |
| JAZZ ACQUISITION TL 1L USD 6/19/21 | 1,447,290.93 | 1,411,577.78 | 0.75 |
| WINDSTREAM SERVICES LLC 02/08/2024 | 1,218,685.15 | 1,070,261.19 | 0.56 |
| WIDEOPENWEST FINANCE LLC 08/19/2023 | 1,839,037.86 | 1,746,971.60 | 0.92 |
| WEST CORP 10/10/2024 | 1,030,000.00 | 1,021,307.58 | 0.54 |
| OLYMPUS MERGER SUB INC 10/03/2024 | 1,447,832.17 | 1,441,807.07 | 0.76 |
| UFC HOLDINGS LLC 08/18/2023 | 991,895.00 | 991,941.85 | 0.52 |
| UFC HOLDINGS LLC 08/18/2024 | 750,000.00 | 754,149.72 | 0.40 |
| 有価証券 合計 | | 186,659,168.35 | 98.52 |
| その他資産 | | 2,807,586.09 | 1.48 |
| 純資産総額 | | 189,466,754.44 | 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9期

決算日 2018年2月15日

(計算期間：2017年2月16日～2018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 |
|----------------|--------|-----|---------------|-----|------------|------------|--------------|-----------|
| | 騰落率 | 騰落率 | (ベンチマーク) | 騰落率 | | | | |
| 5期(2014年2月17日) | 円 | % | | % | % | % | % | 百万円 |
| | 11,112 | 2.4 | 11,134 | 2.5 | — | 99.1 | — | 24,850 |
| 6期(2015年2月16日) | 11,318 | 1.9 | 11,344 | 1.9 | — | 98.5 | — | 22,080 |
| 7期(2016年2月15日) | 11,738 | 3.7 | 11,767 | 3.7 | — | 99.1 | — | 20,370 |
| 8期(2017年2月15日) | 11,851 | 1.0 | 11,880 | 1.0 | — | 98.5 | — | 20,091 |
| 9期(2018年2月15日) | 11,967 | 1.0 | 11,996 | 1.0 | — | 98.7 | — | 17,683 |

(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、委託会社が計算したものです。

※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 |
|--------------------|--------|-----|---------------|-----|------------|------------|--------------|
| | 騰落率 | 騰落率 | (ベンチマーク) | 騰落率 | | | |
| (期首) 2017年2月15日 | 円 | % | | % | % | % | % |
| | 11,851 | — | 11,880 | — | — | 98.5 | — |
| 2月末 | 11,911 | 0.5 | 11,942 | 0.5 | — | 98.5 | — |
| 3月末 | 11,898 | 0.4 | 11,929 | 0.4 | — | 99.3 | — |
| 4月末 | 11,957 | 0.9 | 11,987 | 0.9 | — | 98.9 | — |
| 5月末 | 11,935 | 0.7 | 11,962 | 0.7 | — | 98.6 | — |
| 6月末 | 11,902 | 0.4 | 11,931 | 0.4 | — | 98.8 | — |
| 7月末 | 11,906 | 0.5 | 11,930 | 0.4 | — | 99.0 | — |
| 8月末 | 11,969 | 1.0 | 11,995 | 1.0 | — | 99.0 | — |
| 9月末 | 11,927 | 0.6 | 11,953 | 0.6 | — | 99.1 | — |
| 10月末 | 11,926 | 0.6 | 11,953 | 0.6 | — | 98.9 | — |
| 11月末 | 11,956 | 0.9 | 11,984 | 0.9 | — | 98.6 | — |
| 12月末 | 11,963 | 0.9 | 11,992 | 0.9 | — | 99.1 | — |
| 2018年1月末 | 11,943 | 0.8 | 11,972 | 0.8 | — | 99.0 | — |
| (期末) 2018年2月15日 | 11,967 | 1.0 | 11,996 | 1.0 | — | 98.7 | — |

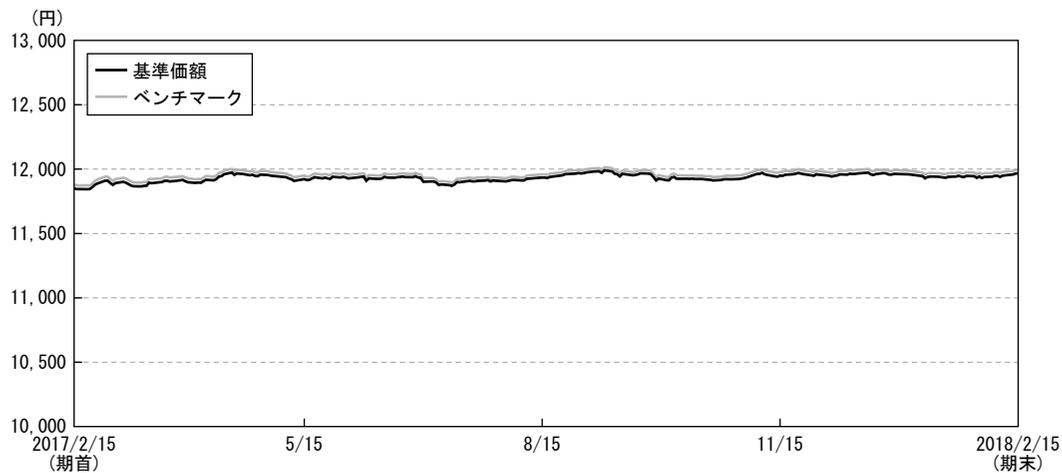
(注1) 騰落率は期首比です。

(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、委託会社が計算したものです。

運用経過

■基準価額等の推移（2017年2月16日から2018年2月15日まで）



期 首：11,851円

期 末：11,967円

騰 落 率： 1.0%

※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、委託会社が計算したものです。

■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、日本銀行の長短金利操作付き量的・質的金融緩和政策のもと、低位で安定した動きとなりました。米国の利上げ、欧州の量的緩和縮小への動きを背景としたグローバルな金利上昇、日本銀行の国債買い入れ減額、出口戦略への思惑などから、10年国債利回りは、7月に0.105%まで上昇しました。しかし、日本銀行が国債指値オペ等、金利の抑制姿勢を示したことに加え、地政学リスクの高まりなどもあって、9月には、10年国債利回りはマイナス圏まで低下しました。その後、米10年国債利回りが2.5%を超えて上昇する中、10年国債利回りも、再び0.1%に近づく局面もありましたが、日本銀行が、現状の金融政策を維持する姿勢を示したこと、黒田総裁の再任の可能性が高まったこと等から、落ち着いた動きとなりました。こうした中、10年国債利回りは、期末には0.06%（2月15日）となり、前期末（0.09%）に比べ、やや低下しました。

■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。期末時点での債券組入比率は98.7%でした。

■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0.98%の上昇となりました。同期間におけるベンチマーク（NOMURA-BPI総合）の騰落率は0.97%の上昇となり、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を0.01%上回りました。

■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 |
|-----------|-------------------------|---------|--|
| | (2017年2月16日～2018年2月15日) | | |
| | 金額 | 比率 | |
| 平均基準価額 | 11,932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（2017年2月16日から2018年2月15日まで）

公社債

| | | 買付額 | 売付額 |
|----------------|----------------|---------------|----------------------|
| 国 内 | 国債証券 | 千円 165,545 | 千円 1,888,743 |
| | 地方債証券 | — | 254,958 |
| | 特殊債証券 | 200,000 | 633,578 (24,460) |
| | 社債券（投資法人債券を含む） | 99,829 | — |

(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（2017年2月16日から2018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 (2018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 | 12,933,000 (340,000) | 14,494,795 (417,965) | 82.0 (2.4) | — (—) | 59.2 (2.4) | 18.1 (—) | 4.7 (—) |
| 地 方 債 証 券 | 1,100,000 (1,100,000) | 1,142,877 (1,142,877) | 6.5 (6.5) | — (—) | 2.9 (2.9) | 3.5 (3.5) | — (—) |
| 特 殊 債 証 券 (除 く 金 融 債) | 777,394 (777,394) | 793,220 (793,220) | 4.5 (4.5) | — (—) | 2.8 (2.8) | — (—) | 1.7 (1.7) |
| 金 融 債 証 券 | 100,000 (100,000) | 99,838 (99,838) | 0.6 (0.6) | — (—) | — (—) | 0.6 (0.6) | — (—) |
| 普 通 社 債 証 券 (含 む 投 資 法 人 債 証 券) | 900,000 (900,000) | 920,364 (920,364) | 5.2 (5.2) | — (—) | 1.8 (1.8) | 1.7 (1.7) | 1.7 (1.7) |
| 合 計 | 15,810,394 (3,217,394) | 17,451,095 (3,374,264) | 98.7 (19.1) | — (—) | 66.7 (9.9) | 23.9 (5.8) | 8.1 (3.4) |

(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 | 決 算 期 | 当 期 | | 末 | | |
|----------------|-------|-----|-----|---------|---------|------------|
| | | 名 | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| | | | % | 千円 | 千円 | |
| 国債証券 | | | % | 千円 | 千円 | |
| 第122回利付国債(5年) | | | 0.1 | 200,000 | 200,862 | 2019/12/20 |
| 第123回利付国債(5年) | | | 0.1 | 800,000 | 803,832 | 2020/3/20 |
| 第1回利付国債(40年) | | | 2.4 | 120,000 | 171,541 | 2048/3/20 |
| 第6回利付国債(40年) | | | 1.9 | 50,000 | 65,695 | 2053/3/20 |
| 第7回利付国債(40年) | | | 1.7 | 20,000 | 25,074 | 2054/3/20 |
| 第300回利付国債(10年) | | | 1.5 | 110,000 | 111,967 | 2019/3/20 |
| 第305回利付国債(10年) | | | 1.3 | 400,000 | 410,584 | 2019/12/20 |
| 第309回利付国債(10年) | | | 1.1 | 480,000 | 493,747 | 2020/6/20 |
| 第310回利付国債(10年) | | | 1.0 | 100,000 | 102,902 | 2020/9/20 |
| 第312回利付国債(10年) | | | 1.2 | 210,000 | 217,879 | 2020/12/20 |
| 第314回利付国債(10年) | | | 1.1 | 100,000 | 103,770 | 2021/3/20 |
| 第315回利付国債(10年) | | | 1.2 | 100,000 | 104,415 | 2021/6/20 |
| 第316回利付国債(10年) | | | 1.1 | 100,000 | 104,080 | 2021/6/20 |
| 第317回利付国債(10年) | | | 1.1 | 200,000 | 208,744 | 2021/9/20 |
| 第319回利付国債(10年) | | | 1.1 | 200,000 | 209,354 | 2021/12/20 |
| 第321回利付国債(10年) | | | 1.0 | 100,000 | 104,548 | 2022/3/20 |

| 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322回利付国債 (10年) | 0.9 | 50,000 | 52,069 | 2022/3/20 |
| 第324回利付国債 (10年) | 0.8 | 120,000 | 124,724 | 2022/6/20 |
| 第325回利付国債 (10年) | 0.8 | 100,000 | 104,120 | 2022/9/20 |
| 第326回利付国債 (10年) | 0.7 | 300,000 | 311,655 | 2022/12/20 |
| 第328回利付国債 (10年) | 0.6 | 100,000 | 103,547 | 2023/3/20 |
| 第331回利付国債 (10年) | 0.6 | 200,000 | 207,626 | 2023/9/20 |
| 第332回利付国債 (10年) | 0.6 | 400,000 | 415,696 | 2023/12/20 |
| 第333回利付国債 (10年) | 0.6 | 300,000 | 312,081 | 2024/3/20 |
| 第334回利付国債 (10年) | 0.6 | 300,000 | 312,483 | 2024/6/20 |
| 第335回利付国債 (10年) | 0.5 | 200,000 | 207,264 | 2024/9/20 |
| 第336回利付国債 (10年) | 0.5 | 100,000 | 103,735 | 2024/12/20 |
| 第339回利付国債 (10年) | 0.4 | 200,000 | 206,318 | 2025/6/20 |
| 第340回利付国債 (10年) | 0.4 | 150,000 | 154,783 | 2025/9/20 |
| 第344回利付国債 (10年) | 0.1 | 100,000 | 100,685 | 2026/9/20 |
| 第345回利付国債 (10年) | 0.1 | 200,000 | 201,322 | 2026/12/20 |
| 第346回利付国債 (10年) | 0.1 | 70,000 | 70,411 | 2027/3/20 |
| 第2回利付国債 (30年) | 2.4 | 400,000 | 506,412 | 2030/2/20 |
| 第6回利付国債 (30年) | 2.4 | 41,000 | 52,929 | 2031/11/20 |
| 第12回利付国債 (30年) | 2.1 | 130,000 | 164,713 | 2033/9/20 |
| 第15回利付国債 (30年) | 2.5 | 50,000 | 66,761 | 2034/6/20 |
| 第18回利付国債 (30年) | 2.3 | 110,000 | 143,987 | 2035/3/20 |
| 第21回利付国債 (30年) | 2.3 | 100,000 | 131,407 | 2035/12/20 |
| 第25回利付国債 (30年) | 2.3 | 120,000 | 158,541 | 2036/12/20 |
| 第28回利付国債 (30年) | 2.5 | 120,000 | 163,942 | 2038/3/20 |
| 第29回利付国債 (30年) | 2.4 | 190,000 | 256,893 | 2038/9/20 |
| 第32回利付国債 (30年) | 2.3 | 50,000 | 67,227 | 2040/3/20 |
| 第34回利付国債 (30年) | 2.2 | 90,000 | 119,920 | 2041/3/20 |
| 第35回利付国債 (30年) | 2.0 | 150,000 | 193,786 | 2041/9/20 |
| 第36回利付国債 (30年) | 2.0 | 50,000 | 64,727 | 2042/3/20 |
| 第37回利付国債 (30年) | 1.9 | 100,000 | 127,577 | 2042/9/20 |
| 第38回利付国債 (30年) | 1.8 | 150,000 | 188,212 | 2043/3/20 |
| 第39回利付国債 (30年) | 1.9 | 50,000 | 63,941 | 2043/6/20 |
| 第40回利付国債 (30年) | 1.8 | 50,000 | 62,819 | 2043/9/20 |
| 第41回利付国債 (30年) | 1.7 | 50,000 | 61,680 | 2043/12/20 |
| 第44回利付国債 (30年) | 1.7 | 50,000 | 61,760 | 2044/9/20 |
| 第45回利付国債 (30年) | 1.5 | 50,000 | 59,371 | 2044/12/20 |
| 第46回利付国債 (30年) | 1.5 | 50,000 | 59,376 | 2045/3/20 |
| 第48回利付国債 (30年) | 1.4 | 50,000 | 58,159 | 2045/9/20 |
| 第49回利付国債 (30年) | 1.4 | 100,000 | 116,306 | 2045/12/20 |
| 第51回利付国債 (30年) | 0.3 | 100,000 | 88,247 | 2046/6/20 |

| 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52回利付国債 (30年) | 0.5 | 50,000 | 46,618 | 2046/9/20 |
| 第53回利付国債 (30年) | 0.6 | 100,000 | 95,650 | 2046/12/20 |
| 第43回利付国債 (20年) | 2.9 | 100,000 | 104,833 | 2019/9/20 |
| 第47回利付国債 (20年) | 2.2 | 150,000 | 159,048 | 2020/9/21 |
| 第65回利付国債 (20年) | 1.9 | 20,000 | 22,301 | 2023/12/20 |
| 第68回利付国債 (20年) | 2.2 | 53,000 | 60,290 | 2024/3/20 |
| 第72回利付国債 (20年) | 2.1 | 220,000 | 251,077 | 2024/9/20 |
| 第74回利付国債 (20年) | 2.1 | 35,000 | 40,131 | 2024/12/20 |
| 第76回利付国債 (20年) | 1.9 | 100,000 | 113,732 | 2025/3/20 |
| 第78回利付国債 (20年) | 1.9 | 54,000 | 61,635 | 2025/6/20 |
| 第81回利付国債 (20年) | 2.0 | 100,000 | 115,298 | 2025/9/20 |
| 第82回利付国債 (20年) | 2.1 | 20,000 | 23,211 | 2025/9/20 |
| 第83回利付国債 (20年) | 2.1 | 100,000 | 116,494 | 2025/12/20 |
| 第84回利付国債 (20年) | 2.0 | 100,000 | 115,711 | 2025/12/20 |
| 第90回利付国債 (20年) | 2.2 | 100,000 | 118,680 | 2026/9/20 |
| 第91回利付国債 (20年) | 2.3 | 100,000 | 119,536 | 2026/9/20 |
| 第92回利付国債 (20年) | 2.1 | 50,000 | 59,143 | 2026/12/20 |
| 第94回利付国債 (20年) | 2.1 | 70,000 | 83,082 | 2027/3/20 |
| 第95回利付国債 (20年) | 2.3 | 200,000 | 242,020 | 2027/6/20 |
| 第100回利付国債 (20年) | 2.2 | 140,000 | 169,930 | 2028/3/20 |
| 第108回利付国債 (20年) | 1.9 | 340,000 | 405,586 | 2028/12/20 |
| 第121回利付国債 (20年) | 1.9 | 100,000 | 121,313 | 2030/9/20 |
| 第124回利付国債 (20年) | 2.0 | 80,000 | 98,200 | 2030/12/20 |
| 第125回利付国債 (20年) | 2.2 | 100,000 | 125,652 | 2031/3/20 |
| 第127回利付国債 (20年) | 1.9 | 100,000 | 121,823 | 2031/3/20 |
| 第129回利付国債 (20年) | 1.8 | 20,000 | 24,155 | 2031/6/20 |
| 第133回利付国債 (20年) | 1.8 | 50,000 | 60,523 | 2031/12/20 |
| 第134回利付国債 (20年) | 1.8 | 150,000 | 181,869 | 2032/3/20 |
| 第136回利付国債 (20年) | 1.6 | 70,000 | 82,965 | 2032/3/20 |
| 第139回利付国債 (20年) | 1.6 | 100,000 | 118,678 | 2032/6/20 |
| 第141回利付国債 (20年) | 1.7 | 180,000 | 216,554 | 2032/12/20 |
| 第142回利付国債 (20年) | 1.8 | 100,000 | 121,733 | 2032/12/20 |
| 第144回利付国債 (20年) | 1.5 | 150,000 | 176,221 | 2033/3/20 |
| 第145回利付国債 (20年) | 1.7 | 150,000 | 180,780 | 2033/6/20 |
| 第147回利付国債 (20年) | 1.6 | 50,000 | 59,599 | 2033/12/20 |
| 第148回利付国債 (20年) | 1.5 | 350,000 | 411,897 | 2034/3/20 |
| 第154回利付国債 (20年) | 1.2 | 100,000 | 112,679 | 2035/9/20 |
| 第157回利付国債 (20年) | 0.2 | 200,000 | 189,924 | 2036/6/20 |
| 第158回利付国債 (20年) | 0.5 | 100,000 | 100,000 | 2036/9/20 |
| 小 計 | | 12,933,000 | 14,494,795 | |

| 決 算 銘 | 期 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13回東京都公募公債 | | 1.93 | 100,000 | 123,070 | 2042/3/19 |
| 平成28年度第2回静岡県公募公債 | | 0.08 | 200,000 | 198,864 | 2026/3/19 |
| 第155回共同発行市場公募地方債 | | 0.22 | 100,000 | 100,578 | 2026/2/25 |
| 第161回共同発行市場公募地方債 | | 0.06 | 100,000 | 99,075 | 2026/8/25 |
| 第37回地方公共団体金融機構債券 | | 0.852 | 200,000 | 206,938 | 2022/6/28 |
| 第40回地方公共団体金融機構債券 | | 0.825 | 200,000 | 207,090 | 2022/9/28 |
| 第44回地方公共団体金融機構債券 | | 0.791 | 200,000 | 207,262 | 2023/1/27 |
| 小 計 | | | 1,100,000 | 1,142,877 | |
| 特殊債券（除く金融債） | | | | | |
| 第9回政府保証地方公共団体金融機構債券 | | 0.32 | 200,000 | 200,844 | 2019/4/25 |
| 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 | 256,895 | 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 | 99,873 | 2023/3/20 |
| 第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 2.13 | 17,836 | 18,784 | 2042/5/10 |
| 第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | | 2.25 | 16,194 | 17,149 | 2037/5/10 |
| 第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.67 | 40,304 | 42,671 | 2046/7/10 |
| 第75回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.26 | 54,060 | 56,692 | 2048/8/10 |
| 第57回中日本高速道路株式会社社債 | | 0.294 | 100,000 | 100,310 | 2019/3/20 |
| 小 計 | | | 777,394 | 793,220 | |
| 金融債券 | | | | | |
| 第318回信金中金債 | | 0.04 | 100,000 | 99,838 | 2021/5/27 |
| 小 計 | | | 100,000 | 99,838 | |
| 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 | 99,582 | 2026/4/24 |
| 第1回明治安田生命2014基金特定目的会社債 | | 0.51 | 100,000 | 100,421 | 2019/8/7 |
| 第81回三菱商事株式会社無担保社債 | | 1.518 | 100,000 | 111,240 | 2032/6/25 |
| 第30回株式会社ホンダファイナンス無担保社債 | | 0.26 | 100,000 | 100,136 | 2019/6/20 |
| 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 | 99,813 | 2022/10/24 |
| 第55回小田急電鉄株式会社無担保社債 | | 1.367 | 100,000 | 103,433 | 2020/12/17 |
| 第69回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債 | | 1.222 | 100,000 | 102,907 | 2020/7/22 |
| 第63回日本電信電話株式会社電信電話債券 | | 0.69 | 100,000 | 102,546 | 2023/3/20 |
| 第8回オーストラリア・コモンウェルス銀行円貨社債 | | 0.407 | 100,000 | 100,286 | 2019/5/2 |
| 小 計 | | | 900,000 | 920,364 | |
| 合 計 | | | 15,810,394 | 17,451,095 | |

(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（2018年2月15日現在）

該当事項はありません。

■投資信託財産の構成 (2018年2月15日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|-------------------------|------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 公 社 債 | 17,451,095 | 98.6 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 246,632 | 1.4 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 17,697,727 | 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 2018年2月15日 |
|--------------------|---------------------|
| (A) 資 産 | 17,697,727,572円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 188,674,737 |
| 公 社 債(評価額) | 17,451,095,000 |
| 未 収 利 息 | 57,951,315 |
| 前 払 費 用 | 6,520 |
| (B) 負 債 | 14,688,593 |
| 未 払 解 約 金 | 14,681,012 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 7,581 |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 17,683,038,979 |
| 元 本 | 14,776,802,570 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 2,906,236,409 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 14,776,802,570口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 11,967円 |

(注1) 当親ファンドの期首元本額は16,953,091,514円、期中追加設定元本額は632,579,699円、期中一部解約元本額は2,808,868,643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) | 7,757,632,368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) | 6,635,560,559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) | 302,263,377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) | 79,819,086円 |
| マニユライフ・アジア・オセアニア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 2017年2月16日 至 2018年2月15日 |
|----------------------|-------------------------------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 201,471,086円 |
| 受 取 利 息 | 201,471,086 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | △ 12,638,691 |
| 売 買 益 | 85,840,896 |
| 売 買 損 | △ 98,479,587 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △ 167,100 |
| (D) 当 期 損 益 金(A+B+C) | 188,665,295 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | 3,138,582,200 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 122,104,632 |
| (G) 解 約 差 損 益 金 | △ 543,115,718 |
| (H) 計 (D+E+F+G) | 2,906,236,409 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(H) | 2,906,236,409 |

(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・フレキシブル戦略ファンド Aコース (為替ヘッジあり・毎月) | 90,400円 |
| マニユライフ・フレキシブル戦略ファンド Bコース (為替ヘッジなし・毎月) | 90,400円 |
| マニユライフ・フレキシブル戦略ファンド Cコース (為替ヘッジあり・年2回) | 90,400円 |
| マニユライフ・フレキシブル戦略ファンド Dコース (為替ヘッジなし・年2回) | 90,400円 |
| マニユライフ・銀行貸付債権ファンド (為替ヘッジあり・繰上償還条項付) 14-06 | 89,446円 |
| マニユライフ・銀行貸付債権ファンド14-07 | 89,302円 |
| マニユライフ・銀行貸付債権ファンド15-07 | 87,520円 |
| マニユライフ・銀行貸付債権ファンド15-01 | 87,215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 (為替ヘッジあり) <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 (為替ヘッジなし) <ラップ> | 10,000円 |

(注3) 1口当たり純資産額は1,1967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

該当事項はありません。

◆運用体制の変更

投資信託運用部を廃止し、投資信託財産に係る運用業務を債券運用部・株式運用部に移管しました。
(2017年10月1日)