

マニユライフ・アジア経済圏・ 小型成長株ファンド 愛称：グローイング・アジア

■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／株式
信託期間	2013年7月31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、主に日本を除くアジア・オセアニア各国・地域の小型株式に分散投資を行い、信託財産の長期的な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。 ・ルクセンブルグ籍外国投資法人「マニユライフ・グローバル・ファンドーアジア・スモール・キャップ・エクイティ・ファンド」 ・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株式への直接投資は行いません。 ②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ③投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 ④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、収益分配を行わないことがあります。

運用報告書（全体版）

第32期（決算日 2021年9月10日）
第33期（決算日 2021年12月10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・アジア経済圏・小型成長株ファンド（愛称：グローイング・アジア）」は、このたび、第33期の決算を行いました。ここに、第32期～第33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/

■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	純資産額
		(分配落)	税込分配金	期中騰落率	期中騰落率	期中騰落率				
第13作成期	24期 (2019年9月10日)	円	円	%		%	%	%	%	百万円
	25期 (2019年12月10日)	7,869	0	△ 0.1	12,858	△ 1.6	—	0.0	97.9	762
第14作成期	26期 (2020年3月10日)	8,116	0	3.1	13,218	2.8	—	0.0	95.4	728
	27期 (2020年6月10日)	6,989	0	△13.9	11,337	△14.2	—	0.0	96.7	577
第15作成期	28期 (2020年9月10日)	7,950	0	13.8	12,992	14.6	—	0.0	96.2	647
	29期 (2020年12月10日)	8,841	0	11.2	14,179	9.1	—	0.0	97.7	680
第16作成期	30期 (2021年3月10日)	9,620	0	8.8	16,184	14.1	—	0.0	94.1	705
	31期 (2021年6月10日)	10,444	400	12.7	18,203	12.5	—	0.0	91.6	680
第17作成期	32期 (2021年9月10日)	10,727	1,000	12.3	20,414	12.1	—	0.0	92.8	667
	33期 (2021年12月10日)	10,739	0	0.1	20,688	1.3	—	0.0	93.0	679
		10,706	400	3.4	21,307	3.0	—	0.0	88.5	652

(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、MSCI AC アジア・パシフィック (除く日本) スモール・キャップ・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。

■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32期	(期首) 2021年6月10日	円	%		%	%	%	%
	6月末	10,727	—	20,414	—	—	0.0	92.8
	7月末	11,122	3.7	20,621	1.0	—	0.0	93.6
	8月末	11,015	2.7	20,437	0.1	—	0.0	94.2
	(期末) 2021年9月10日	10,634	△0.9	20,537	0.6	—	0.0	94.1
第33期	(期首) 2021年9月10日	10,739	0.1	20,688	1.3	—	0.0	93.0
	9月末	10,739	—	20,688	—	—	0.0	93.0
	10月末	10,631	△1.0	20,561	△0.6	—	0.0	94.5
	11月末	10,966	2.1	21,580	4.3	—	0.0	95.1
	(期末) 2021年12月10日	10,992	2.4	20,883	0.9	—	0.0	93.9
		11,106	3.4	21,307	3.0	—	0.0	88.5

(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。)

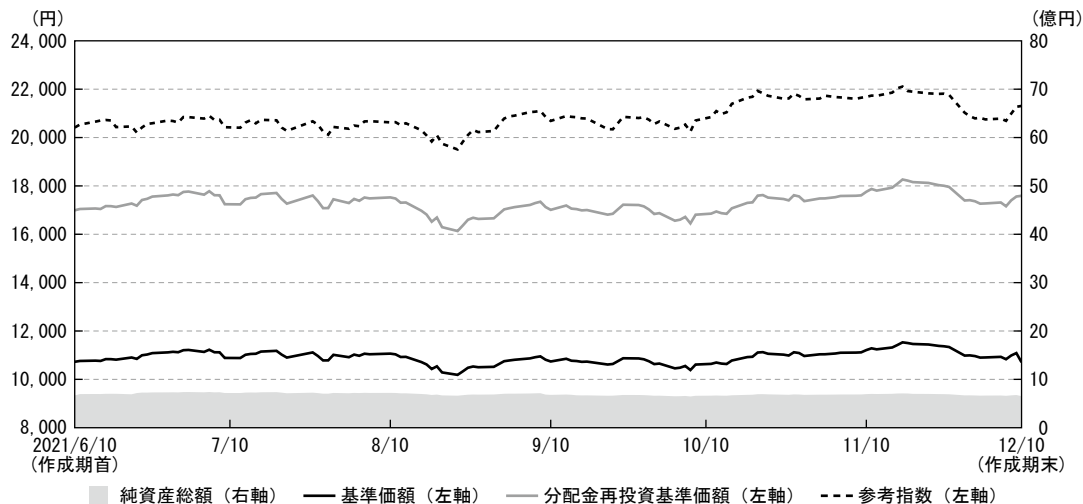
(注2) 基準価額は1万口当たりで表示しています。

(注3) 当ファンドの参考指数は、MSCI AC アジア・パシフィック (除く日本) スモール・キャップ・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6月11日から2021年12月10日まで）



作成期首：10,727円

作成期末：10,706円（既払分配金400円）

騰落率： 3.5%（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、MSCI AC アジア・パシフィック（除く日本）スモール・キャップ・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

- ・組入れ銘柄のうち、インド、台湾、韓国、タイなどの銘柄の上昇がプラス寄与しました。
- ・組入れ銘柄のうち、中国、シンガポールなどの銘柄の下落がマイナス寄与しました。
- ・米ドルが円に対して上昇（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
マニユライフ・グローバル・ファンドーアジア・スモール・キャップ・エクイティ・ファンド	0.9%
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%

■投資環境

[アジア・オセアニア小型株式市況]

当作成期間のアジア・オセアニア小型株式は小幅上昇しました。期初から7月下旬にかけては新型コロナウイルス変異株の感染拡大の影響が懸念された東南アジア諸国を中心に軟調に推移しました。また、中国でも当局によるIT企業、教育産業、不動産業界への規制が懸念され軟調に推移しました。その後、東南アジア諸国やインドでは、新型コロナウイルスのワクチン接種が進み、景気回復期待が高まったことなどを背景に堅調に推移した一方、中国では景気減速懸念、不動産大手の経営不安の高まり、電力不足などを背景に投資家心理が悪化し、引き続き軟調に推移しました。11月以降、欧州での新型コロナの感染再拡大や新たな変異株（オミクロン株）の出現を受けて各国で株式市場が下落しました。国別では、当作成期間においてインド、台湾、フィリピンなどが上昇した一方、中国、香港などが下落しました。

[為替市況]

外国為替市場では、米ドルは対円で上昇（円安）しました。期初1米ドル109円台で始まった後、新型コロナウイルスの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を背景に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9月下旬には109円台まで円高米ドル安が進みました。9月下旬から11月下旬にかけては米長期金利の上昇などを背景に115円台まで円安ドル高が進みましたが、その後、欧州での新型コロナウイルス感染再拡大や南アフリカで新たな変異株が発見されたことなどをを受けて円が買い戻され、当期末には113円台となりました。

[日本債券市況]

当作成期間の10年国債利回りは、作成期初0.045%から作成期末0.050%となり利回り上昇（価格は下落）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ルクセンブルグ籍外国投資法人「マニユライフ・グローバル・ファンドーアジア・スモール・キャップ・エクイティ・ファンド」（以下「MGFアジア・スモール・キャップ・エクイティ・ファンド」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。

MGFアジア・スモール・キャップ・エクイティ・ファンド

当該投資信託証券を通じて主に日本を除くアジア・オセアニア各国・地域の小型株式に分散投資を行い割安で成長の期待できる銘柄に投資を行い、値上がり益の獲得をめざしました。

マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド

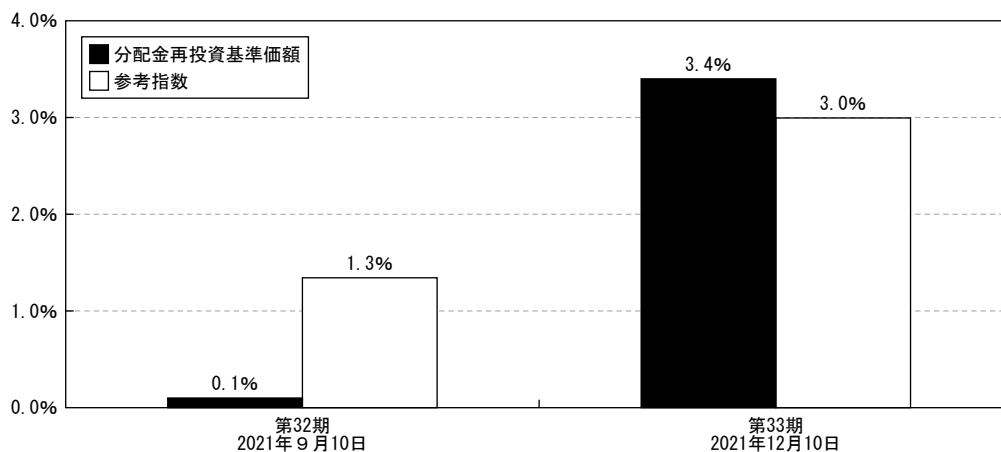
NOMURA-BPI総合に採用されている公社債に投資することにより、同インデックスの動きに連動する投資成果をめざして運用を行いました。

[資産構成比率]

組入ファンド・資産	比率
MG Fアジア・スモール・キャップ・エクイティ・ファンド クラス I	88.5%
マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	0.02%
現預金等	11.4%
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。



※当ファンドの参考指数は、MSC I AC アジア・パシフィック（除く日本）スモール・キャップ・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32期は0円、第33期は400円、合計400円（1万円当たり、税引前）とさせていただきます。留保益の運用については、特に制限を設けず運用の基本方針に基づき運用を行います。

[分配原資の内訳]

(1万円当たり、税引前)

	第32期		第33期	
	自 2021年6月11日 至 2021年9月10日		自 2021年9月11日 至 2021年12月10日	
当期分配金 (円)	—		400	
(対基準価額比率) (%)	—		3.602	
当期の収益 (円)	—		239	
当期の収益以外 (円)	—		160	
翌期繰越分配対象額 (円)	1,428		1,392	

(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

当ファンド

当ファンドは、「MGFアジア・スモール・キャップ・エクイティ・ファンド」(米ドル建て)の投資証券を主要投資対象とし、主に日本を除くアジア・オセアニア各国・地域の小型株式に投資を行い、長期的な信託財産の成長をめざして運用を行います。また、今後も当該投資証券への投資を通じて、リスク管理を徹底しつつ、割安で成長の期待できる銘柄に投資を行い、値上がり益の獲得をめざす方針です。

MGFアジア・スモール・キャップ・エクイティ・ファンド

各国で新型コロナウイルスのワクチン接種が進む中、国によって感染状況、経済再開・正常化の状況は異なっています。また、各国において財政支出・金融緩和政策が実施されていますが、政策の規模に応じて、経済回復のスピードや中期的なインフレへの影響度は異なると思われます。

このような中、当ファンドでは、新型コロナウイルスワクチンの普及状況、変異株の感染状況、株価バリュエーションなどに注目し、急速に変化する株式市場の動きに適切に対応しつつも、引き続き個別企業のビジネス内容、経営陣、当該企業の持つ国内外でのビジネス機会など個別企業のファンダメンタルズの分析に注力していく方針です。

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32期～第33期		項目の概要
	(2021年6月11日～2021年12月10日)		
	金額	比率	
平均基準価額	10,893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	84円	0.769%	(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）	(34)	(0.314)	・委託した資金の運用の対価
（販売会社）	(48)	(0.441)	・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）	(2)	(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	12	0.111	(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)	(0.004)	・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）	(5)	(0.048)	・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）	(6)	(0.058)	・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)	(0.002)	・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	0.880	

* 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まず。

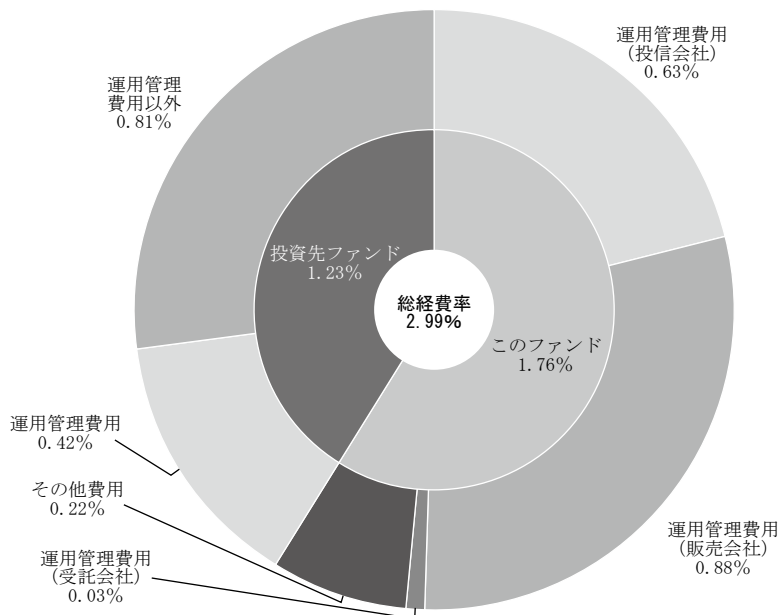
* 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

* 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。

(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2.99%です。



総経費率 (①+②+③)	2.99%
①このファンドの費用の比率	1.76%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.42%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.81%

- *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6月11日から2021年12月10日まで)
 投資信託証券

決 算 期 銘 柄 名	第32期～第33期			
	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外国 (ルクセンブルグ) MGFアジア・スモール・キャップ・エクイティ・ファンド クラスI	口	千米ドル	口	千米ドル
	236,864	521	511,214	1,116

(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6月11日から2021年12月10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
 (2021年6月11日から2021年12月10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6月11日から2021年12月10日まで)
 該当事項はありません。

■組入資産の明細（2021年12月10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	第17作成期末			
	口 数	評 価 額		組 入 比 率
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(ルクセンブルグ) MG Fアジア・スモール・キャップ・ エクイティ・ファンド クラス I	口 2,326,299	千米ドル 5,095	千円 578,163	% 88.5
合 計	2,326,299	5,095	578,163	

(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) 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 16 作 成 期 末	第17作成期末	
	口 数	口 数	評 価 額
マニユライフ・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 112

(注1) マザーファンドの2021年12月10日現在の受益権総口数は9,266,566千口です。

(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12月10日現在）

該当事項はありません。

■投資信託財産の構成

(2021年12月10日現在)

項 目	第17作成期末	
	評 価 額	比 率
投 資 証 券	千円 578,163	% 84.9
マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	112	0.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	102,602	15.1
投 資 信 託 財 産 総 額	680,877	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（607,137千円）の投資信託財産総額（680,877千円）に対する比率は89.2%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32期末 2021年9月10日	第33期末 2021年12月10日
(A) 資 産	733,949,460円	680,877,784円
コール・ローン等	43,270,162	102,167,276
投資証券(評価額)	631,577,513	578,163,034
マニユライフ・ 日本債券インデックス・ マザーファンド(評価額)	112,096	112,014
未 収 入 金	58,536,303	—
その他未収収益	453,386	435,460
(B) 負 債	54,654,182	27,918,076
未 払 金	29,200,735	—
未払収益分配金	—	24,395,559
未払解約金	22,337,860	561,811
未払信託報酬	2,746,619	2,595,464
その他未払費用	368,968	365,242
(C) 純資産総額(A-B)	679,295,278	652,959,708
元 本	632,576,939	609,888,990
次期繰越損益金	46,718,339	43,070,718
(D) 受 益 権 総 口 数	632,576,939口	609,888,990口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,739円	10,706円

(注1) 当ファンドの第32期首元本額は621,888,005円、第32～33期中追加設定元本額は76,332,383円、第32～33期中一部解約元本額は88,331,398円です。

(注2) 1口当たり純資産額は、第32期1.0739円、第33期1.0706円です。

■損益の状況

項 目	第32期 自 2021年6月11日 至 2021年9月10日	第33期 自 2021年9月11日 至 2021年12月10日
(A) 配 当 等 収 益	1,120,184円	1,081,227円
受 取 利 息	△ 152,999	△ 20,604
そ の 他 収 益 金	1,273,183	1,101,831
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	1,927,410	24,132,577
売 買 益	3,109,918	26,876,312
売 買 損	△ 1,182,508	△ 2,743,735
(C) 信 託 報 酬 等	△ 3,125,553	△ 2,983,559
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	△ 77,959	22,230,245
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	81,065,565	77,321,576
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△34,269,267	△32,085,544
(配当等相当額)	(9,269,357)	(9,780,223)
(売買損益相当額)	(△43,538,624)	(△41,865,767)
(G) 計 (D+E+F)	46,718,339	67,466,277
(H) 収 益 分 配 金	0	△24,395,559
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	46,718,339	43,070,718
追 加 信 託 差 損 益 金	△34,269,267	△41,865,724
(配当等相当額)	(9,269,359)	(43)
(売買損益相当額)	(△43,538,626)	(△41,865,767)
分 配 準 備 積 立 金	81,065,565	84,936,442
繰 越 損 益 金	△ 77,959	—

(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32期 計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(9,269,359円)および分配準備積立金(81,065,565円)より分配対象収益は90,334,924円(10,000口当たり1,428円)ですが、当計算期間に分配した金額はありません。

第33期 計算期間末における費用控除後の配当等収益(953,501円)、費用控除後の有価証券等損益額(21,202,387円)、信託約款に規定する収益調整金(9,780,223円)および分配準備積立金(77,395,933円)より分配対象収益は109,332,044円(10,000口当たり1,792円)であり、うち24,395,559円(10,000口当たり400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 32 期	第 33 期
1 万 口 当 た り 分 配 金	0円	400円

- ・分配金は税込みです。
- ・分配金を再投資する場合、お手取り分配金は、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。

<参考情報>

MG Fアジア・スモール・キャップ・エクイティ・ファンド

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用会社	マニユライフ・インベストメント・マネジメント（HK）リミテッド
管理会社	マニユライフ・インベストメント・マネジメント（アイルランド）リミテッド
信託期間	無期限です。
主要投資対象	日本を除くアジア・オセアニア各国・地域の小型株式を主要投資対象とします。
運用方針	①主として日本を除くアジア・オセアニア各国・地域の小型株式に投資を行います。それらの株式の発行企業が発行する新株予約権証券や債券等に投資する場合があります。また、ADR、GDR、EDRへの投資も可能とします。 ②定性・定量両面における徹底した企業分析に基づいて、割安で成長の見込まれるアジア・オセアニアの小型株式を厳選し、分散投資を行います。 ③継続的に企業調査やモニタリングを行うことによりリスク管理を徹底します。 ④市場の混乱時等には、一時的に短期金融資産や現金等の比率が大きくなる場合があります。
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。

■投資対象とする投資信託証券の資産の状況

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「MGFアジア・スモール・キャップ・エクイティ・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7月1日から2021年6月30日まで)

(単位：米ドル)

マネジメントフィー	2,300,644
管理会社費用	21,284
アドミニストレーションフィー	99,612
カストディーフィー	97,277
税金	1,737,107
印刷費用等	4,348
弁護士及びその他専門家費用	57,561
監査費用	17,746
取締役報酬及び経費	4,691
銀行手数料	1,316
その他費用	18,496
費用合計	4,360,082

■有価証券明細表 2021年6月30日

数量	銘柄名	購入価額 (米ドル)	評価額 (米ドル)	投資比率 (%)
Transferable securities and money market instruments admitted to an official exchange listing ⁽¹⁾				
Equities				
Australia				
358,149	ALS Limited	2,458,636	3,503,865	2.25
61,258	Amcor plc	644,513	695,357	0.45
613,922	Bapcor Limited	2,732,082	3,915,057	2.53
279,934	IPH Limited	1,309,802	1,638,160	1.06
742,438	Reliance Worldwide Corp. Limited	2,257,438	2,929,894	1.89
131,396	Seven Group Holdings Limited	1,862,960	2,006,100	1.30
702,255	Star Entertainment Group Limited	2,160,494	1,944,139	1.26
		13,425,925	16,632,572	10.74
Bermuda				
2,324,100	Sunpower Group Limited	1,535,979	1,495,348	0.97
		1,535,979	1,495,348	0.97
Cayman Islands				
1,258,000	Ak Medical Holdings Limited	2,111,925	2,219,145	1.44
3,086,000	Cathay Media and Education Group Inc.	1,878,583	2,145,724	1.39
581,000	EC Healthcare	897,655	1,045,846	0.68
2,902,000	Frontage Holdings Corp.	1,615,620	3,082,732	1.99
204,000	Ginko International Company Limited	1,639,850	1,947,589	1.25
324,000	Gourmet Master Company Limited	1,862,231	1,982,691	1.28
1,841,500	HKBN Limited	2,690,205	2,228,866	1.44
250,030	iClick Interactive Asia Group Limited	1,638,916	2,702,824	1.75
54,168	I-Mab	989,562	4,385,983	2.83
624,000	Jinxin Fertility Group Limited	1,209,046	1,574,798	1.02
2,177,000	KWG Living Group Holdings Limited	1,979,076	2,791,914	1.80
736,000	Minth Group Limited	2,285,490	3,496,943	2.26
44,000	Parade Technologies Limited	891,641	2,187,198	1.41
311,500	Zhongsheng Group Holdings Limited	668,549	2,591,045	1.67
		22,358,349	34,383,298	22.21
China				
605,400	Petpal Pet Nutrition Technology Company Limited – A	2,147,494	2,085,564	1.34
374,991	Shenzhen Topband Company Limited	901,192	1,044,018	0.67
5,000	Silergy Corp.	446,567	680,134	0.44
		3,495,253	3,809,716	2.45
Hong Kong				
466,000	Hua Hong Semiconductor Limited	1,146,722	2,574,113	1.67
1,634,000	Towngas China Company Limited	1,166,781	1,207,670	0.78
		2,313,503	3,781,783	2.45

数量	銘柄名	購入価額 (米ドル)	評価額 (米ドル)	投資比率 (%)
India				
50,720	ABB India Limited	953,687	1,233,892	0.80
64,081	Apl Apollo Tubes Limited	1,152,966	1,404,694	0.91
189,840	Container Corp..	1,471,572	1,783,661	1.15
45,182	Dalmia Bharat Limited	699,673	1,149,590	0.74
1,501,378	Federal Bank Limited	1,026,066	1,759,380	1.14
16,728	Gujarat Fluorochemicals Limited	250,328	261,417	0.17
93,602	Kajaria Ceramics Limited	871,844	1,234,072	0.80
116,243	Macrotech Developers Limited	1,084,128	1,069,183	0.69
131,581	Max Financial Services Limited	1,533,253	1,877,216	1.21
33,408	PI Industries Limited	1,017,816	1,308,141	0.84
56,863	Piramal Enterprises Limited	1,297,116	1,834,745	1.18
170,429	Sobha Limited	1,100,349	1,080,095	0.70
51,057	Solara Active Pharma Sciences	854,721	1,157,084	0.75
5,432	SRF Limited	403,749	531,724	0.34
42,986	Supreme Industries Limited	1,182,425	1,251,716	0.81
		14,899,693	18,936,610	12.23
Indonesia				
3,637,054	Bank Jago Tbk PT	1,838,826	3,417,799	2.21
28,707,700	Sarana Meditama Metropolitan Tbk PT	1,159,566	1,267,181	0.82
29,007,500	Sumber Alfaria Trijaya Tbk PT	1,836,682	2,500,809	1.62
		4,835,074	7,185,789	4.65
Malaysia				
2,245,200	Greotech Technology Bhd	2,795,342	3,077,249	1.99
		2,795,342	3,077,249	1.99
Mauritius				
4,222,800	Golden Agri-Resources Limited	924,096	722,437	0.47
		924,096	722,437	0.47
Philippines				
3,089,500	Century Pacific Food Inc.	1,107,582	1,481,021	0.96
		1,107,582	1,481,021	0.96
Republic of Korea (South)				
13,211	AfreecaTV Company Limited	960,007	1,396,001	0.90
10,070	CJ Corp.	900,407	956,790	0.62
13,628	Cosmax Inc.	1,569,626	1,585,282	1.02
54,783	D&C Media Company Limited	1,159,096	2,159,892	1.40
31,603	Dio Corp.	1,075,083	1,163,204	0.75
44,159	Doosan Fuel Cell Company Limited	1,810,400	1,960,615	1.27
8,435	Ecopro Bm Company Limited	1,394,062	1,588,653	1.03
35,050	Gs Retail Company Limited	1,219,071	1,202,931	0.78
28,305	Hana Materials Inc.	1,074,390	1,161,203	0.75
25,434	Mcnex Company Limited	1,255,257	1,070,523	0.69
47,077	Nature Holdings Company Limited	1,884,219	3,101,815	2.00
177,480	Nice Information Service Company Limited	2,150,119	3,955,726	2.56
3,541	SK Materials Company Limited	554,004	1,107,121	0.72
168,716	Vitrocell Company Limited	1,215,041	2,389,571	1.53
		18,220,782	24,799,327	16.02

数量	銘柄名	購入価額 (米ドル)	評価額 (米ドル)	投資比率 (%)
Singapore				
753,400	iFAST Corp. Limited	1,972,184	4,567,248	2.95
241,100	Nanofilm Technologies International Limited	959,255	984,557	0.64
		2,931,439	5,551,805	3.59
Taiwan				
163,000	Eclat Textile Company Limited	2,112,153	3,837,753	2.48
130,000	Foxsemicon Integrated Technology Inc.	1,159,169	1,112,800	0.72
433,000	Global PMX Company Limited	2,319,991	2,937,212	1.89
113,000	Hiwin Technologies Corp.	1,568,338	1,601,995	1.04
349,000	Kinsus Interconnect Technology Corp.	1,578,866	1,691,004	1.09
1,017,000	Macronix International	1,508,889	1,668,102	1.08
105,000	Merida Industry Company Limited	1,277,017	1,179,558	0.76
76,000	Realtek Semiconductor Corp.	1,313,585	1,377,497	0.89
279,000	Sinbon Electronics Company Limited	1,821,769	2,743,724	1.78
193,000	Sitronix Technology Corp.	1,900,543	2,168,139	1.40
198,000	Wisdom Marine Lines Company Limited	334,260	785,259	0.51
87,000	Yageo Corp.	1,524,521	1,732,997	1.12
		18,419,101	22,836,040	14.76
Thailand				
1,100,000	Central Plaza Hotel pcl – NVDR	938,134	1,132,596	0.73
480,300	Com7 pcl	925,435	1,045,262	0.68
1,475,900	JMT Network Services pcl	2,120,811	2,003,156	1.29
1,411,700	RS pcl	843,832	1,008,664	0.65
		4,828,212	5,189,678	3.35
Equities Total		112,090,330	149,882,673	96.84
Warrants Equity				
Thailand				
402,340	Rs pcl – Wts	0	54,231	0.04
		0	54,231	0.04
Warrants Equity Total		0	54,231	0.04
Total Transferable securities and money market instruments admitted to an official exchange listing ⁽¹⁾		112,090,330	149,936,904	96.88

数量	銘柄名	購入価額 (米ドル)	評価額 (米ドル)	投資比率 (%)
Other transferable securities and money market instruments ⁽²⁾				
Equities				
Cayman Islands				
1,065,600	China Metal Recycling Holdings Limited ^(a)	1,127,922	0	0.00
		1,127,922	0	0.00
	Equities Total	1,127,922	0	0.00
	Total Other transferable securities and money market instruments ⁽²⁾	1,127,922	0	0.00
	Portfolio of Investments	113,218,252	149,936,904	96.88
	Other Net Assets		4,833,041	3.12
	Net Assets		154,769,945	100.00

^(a) Defaulted/Fair Valued by the Board of Directors.

⁽¹⁾ All securities classified under this section are listed on a stock-exchange.

⁽²⁾ All securities classified under this section are unlisted.

The notes to the Financial Statements form an integral part of these financial statements.

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
	期 騰 落 率	騰 落 率	(ベンチマーク) 騰 落 率	騰 落 率				
8期(2017年2月15日)	円	%		%	%	%	%	百万円
	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
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
	騰 落 率	騰 落 率	(ベンチマーク) 騰 落 率	騰 落 率			
(期首) 2020年2月17日	円	%		%	%	%	%
	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	—

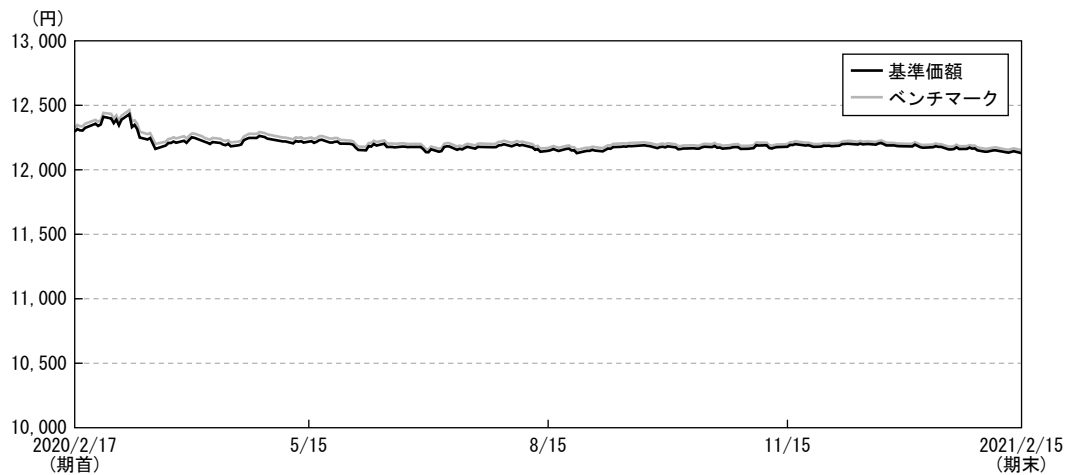
(注1) 騰落率は期首比です。

(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	千円 1,055,555	千円 1,590,804
	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	決 算 期	当 期		末		
		名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券			%	千円	千円	
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 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。

■投資信託財産の構成

(2021年2月15日現在)

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。