

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)

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55期（決算日 2018年4月5日）
第56期（決算日 2018年5月7日）
第57期（決算日 2018年6月5日）
第58期（決算日 2018年7月5日）
第59期（決算日 2018年8月6日）
第60期（決算日 2018年9月5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10期（決算日 2018年9月5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60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10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。

 **Manulife Asset Management**

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/>

【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6作成期	31期 (2016年4月5日)	円 8,740	円 40	% 1.6		% 10,504	1.9	% —	% 0.0	% 96.6	百万円 1,524
	32期 (2016年5月6日)	8,789	40	1.0	10,706	1.9	—	0.0	95.1	1,524	
	33期 (2016年6月6日)	8,792	40	0.5	10,801	0.9	—	0.0	95.0	1,497	
	34期 (2016年7月5日)	8,719	40	△0.4	10,800	△0.0	—	0.0	98.6	1,470	
	35期 (2016年8月5日)	8,767	40	1.0	10,953	1.4	—	0.0	94.8	1,408	
	36期 (2016年9月5日)	8,757	40	0.3	11,040	0.8	—	0.0	100.2	1,393	
第7作成期	37期 (2016年10月5日)	8,742	40	0.3	11,136	0.9	—	0.0	100.0	1,388	
	38期 (2016年11月7日)	8,704	40	0.0	11,182	0.4	—	0.0	97.4	1,369	
	39期 (2016年12月5日)	8,695	40	0.4	11,272	0.8	—	0.0	98.3	1,364	
	40期 (2017年1月5日)	8,718	40	0.7	11,397	1.1	—	0.0	95.3	1,390	
	41期 (2017年2月6日)	8,650	40	△0.3	11,439	0.4	—	0.0	96.2	1,460	
	42期 (2017年3月6日)	8,658	40	0.6	11,525	0.8	—	0.0	98.3	1,487	
第8作成期	43期 (2017年4月5日)	8,589	40	△0.3	11,525	0.0	—	0.0	96.3	1,562	
	44期 (2017年5月8日)	8,539	40	△0.1	11,571	0.4	—	0.0	99.9	1,555	
	45期 (2017年6月5日)	8,514	40	0.2	11,615	0.4	—	0.0	94.5	1,563	
	46期 (2017年7月5日)	8,478	40	0.0	11,609	△0.1	—	0.0	101.5	1,548	
	47期 (2017年8月7日)	8,478	40	0.5	11,697	0.8	—	0.0	96.1	1,551	
	48期 (2017年9月5日)	8,410	40	△0.3	11,679	△0.2	—	0.0	97.5	1,466	
第9作成期	49期 (2017年10月5日)	8,373	40	0.0	11,740	0.5	—	0.0	100.8	1,749	
	50期 (2017年11月6日)	8,360	40	0.3	11,802	0.5	—	0.0	99.5	1,798	
	51期 (2017年12月5日)	8,313	40	△0.1	11,825	0.2	—	0.0	98.3	1,755	
	52期 (2018年1月5日)	8,292	40	0.2	11,886	0.5	—	0.0	99.4	1,725	
	53期 (2018年2月5日)	8,294	40	0.5	11,997	0.9	—	0.0	97.3	1,690	
	54期 (2018年3月5日)	8,230	40	△0.3	12,007	0.1	—	0.0	95.7	1,640	
第10作成期	55期 (2018年4月5日)	8,190	40	0.0	12,050	0.4	—	0.0	97.4	1,615	
	56期 (2018年5月7日)	8,164	40	0.2	12,110	0.5	—	0.0	100.1	1,578	
	57期 (2018年6月5日)	8,117	40	△0.1	12,144	0.3	—	0.0	98.6	1,583	
	58期 (2018年7月5日)	8,052	40	△0.3	12,157	0.1	—	0.0	99.3	1,671	
	59期 (2018年8月6日)	8,029	40	0.2	12,252	0.8	—	0.0	97.4	1,636	
	60期 (2018年9月5日)	7,995	40	0.1	12,303	0.4	—	0.0	97.2	1,583	

(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
		騰 落 率	騰 落 率					
第55期	(期 首) 2018年3月5日	円 8,230	% —	12,007	% —	% —	% 0.0	% 95.7
	3月末	8,229	△0.0	12,051	0.4	—	0.0	96.2
	(期 末) 2018年4月5日	8,230	0.0	12,050	0.4	—	0.0	97.4
第56期	(期 首) 2018年4月5日	8,190	—	12,050	—	—	0.0	97.4
	4月末	8,212	0.3	12,106	0.5	—	0.0	99.5
	(期 末) 2018年5月7日	8,204	0.2	12,110	0.5	—	0.0	100.1
第57期	(期 首) 2018年5月7日	8,164	—	12,110	—	—	0.0	100.1
	5月末	8,150	△0.2	12,130	0.2	—	0.0	99.3
	(期 末) 2018年6月5日	8,157	△0.1	12,144	0.3	—	0.0	98.6
第58期	(期 首) 2018年6月5日	8,117	—	12,144	—	—	0.0	98.6
	6月末	8,099	△0.2	12,142	△0.0	—	0.0	99.0
	(期 末) 2018年7月5日	8,092	△0.3	12,157	0.1	—	0.0	99.3
第59期	(期 首) 2018年7月5日	8,052	—	12,157	—	—	0.0	99.3
	7月末	8,066	0.2	12,242	0.7	—	0.0	96.4
	(期 末) 2018年8月6日	8,069	0.2	12,252	0.8	—	0.0	97.4
第60期	(期 首) 2018年8月6日	8,029	—	12,252	—	—	0.0	97.4
	8月末	8,035	0.1	12,293	0.3	—	0.0	96.3
	(期 末) 2018年9月5日	8,035	0.1	12,303	0.4	—	0.0	97.2

(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6作成期	31期（2016年4月5日）	円 9,897	円 60	% △0.6		% 11,622 △ 0.5	% —	% 0.0	% 98.5	百万円 7,720
	32期（2016年5月6日）	9,635	60	△2.0	11,461	△ 1.4	—	0.0	98.7	7,552
	33期（2016年6月6日）	9,557	60	△0.2	11,472	0.1	—	0.0	98.8	7,412
	34期（2016年7月5日）	9,104	60	△4.1	11,023	△ 3.9	—	0.0	98.6	7,051
	35期（2016年8月5日）	9,047	60	0.0	11,057	0.3	—	0.0	97.9	6,867
	36期（2016年9月5日）	9,262	60	3.0	11,437	3.4	—	0.0	98.7	7,028
第7作成期	37期（2016年10月5日）	9,141	60	△0.7	11,408	△ 0.3	—	0.0	98.9	6,974
	38期（2016年11月7日）	9,195	60	1.2	11,588	1.6	—	0.0	98.4	7,047
	39期（2016年12月5日）	10,026	60	9.7	12,788	10.4	—	0.0	98.5	7,520
	40期（2017年1月5日）	10,302	60	3.4	13,242	3.6	—	0.0	97.4	7,559
	41期（2017年2月6日）	9,865	60	△3.7	12,813	△ 3.2	—	0.0	97.7	7,399
	42期（2017年3月6日）	9,991	60	1.9	13,071	2.0	—	0.0	98.2	7,690
第8作成期	43期（2017年4月5日）	9,654	60	△2.8	12,726	△ 2.6	—	0.0	98.4	7,743
	44期（2017年5月8日）	9,760	60	1.7	13,004	2.2	—	0.0	97.9	7,846
	45期（2017年6月5日）	9,538	60	△1.7	12,793	△ 1.6	—	0.0	97.9	7,645
	46期（2017年7月5日）	9,714	60	2.5	13,085	2.3	—	0.0	98.9	7,766
	47期（2017年8月7日）	9,510	60	△1.5	12,905	△ 1.4	—	0.0	98.6	7,571
	48期（2017年9月5日）	9,345	60	△1.1	12,767	△ 1.1	—	0.0	98.2	7,429
第9作成期	49期（2017年10月5日）	9,564	60	3.0	13,202	3.4	—	0.0	97.7	7,820
	50期（2017年11月6日）	9,675	60	1.8	13,456	1.9	—	0.0	98.1	7,804
	51期（2017年12月5日）	9,464	60	△1.6	13,259	△ 1.5	—	0.0	98.2	7,550
	52期（2018年1月5日）	9,473	60	0.7	13,369	0.8	—	0.0	98.0	7,492
	53期（2018年2月5日）	9,233	60	△1.9	13,142	△ 1.7	—	0.0	98.2	7,175
	54期（2018年3月5日）	8,810	60	△3.9	12,633	△ 3.9	—	0.0	97.2	6,834
第10作成期	55期（2018年4月5日）	8,870	60	1.4	12,832	1.6	—	0.0	98.1	6,810
	56期（2018年5月7日）	9,014	60	2.3	13,151	2.5	—	0.0	98.1	6,824
	57期（2018年6月5日）	9,040	60	1.0	13,306	1.2	—	0.0	98.2	6,737
	58期（2018年7月5日）	9,010	60	0.3	13,382	0.6	—	0.0	98.5	6,626
	59期（2018年8月6日）	9,053	60	1.1	13,585	1.5	—	0.0	98.9	6,533
	60期（2018年9月5日）	9,039	60	0.5	13,677	0.7	—	0.0	97.4	6,421

（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
		円	騰 落 率		騰 落 率			
第55期	(期 首) 2018年 3 月 5 日	8,810	—	12,633	—	—	0.0	97.2
	3 月 末	8,879	0.8	12,762	1.0	—	0.0	97.2
	(期 末) 2018年 4 月 5 日	8,930	1.4	12,832	1.6	—	0.0	98.1
第56期	(期 首) 2018年 4 月 5 日	8,870	—	12,832	—	—	0.0	98.1
	4 月 末	9,107	2.7	13,196	2.8	—	0.0	97.4
	(期 末) 2018年 5 月 7 日	9,074	2.3	13,151	2.5	—	0.0	98.1
第57期	(期 首) 2018年 5 月 7 日	9,014	—	13,151	—	—	0.0	98.1
	5 月 末	8,991	△0.3	13,143	△0.1	—	0.0	97.4
	(期 末) 2018年 6 月 5 日	9,100	1.0	13,306	1.2	—	0.0	98.2
第58期	(期 首) 2018年 6 月 5 日	9,040	—	13,306	—	—	0.0	98.2
	6 月 末	9,082	0.5	13,379	0.5	—	0.0	97.8
	(期 末) 2018年 7 月 5 日	9,070	0.3	13,382	0.6	—	0.0	98.5
第59期	(期 首) 2018年 7 月 5 日	9,010	—	13,382	—	—	0.0	98.5
	7 月 末	9,088	0.9	13,546	1.2	—	0.0	98.0
	(期 末) 2018年 8 月 6 日	9,113	1.1	13,585	1.5	—	0.0	98.9
第60期	(期 首) 2018年 8 月 6 日	9,053	—	13,585	—	—	0.0	98.9
	8 月 末	9,060	0.1	13,609	0.2	—	0.0	98.0
	(期 末) 2018年 9 月 5 日	9,099	0.5	13,677	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
6期(2016年9月5日)	10,115	0	4.1	11,040	7.1	—	0.0	99.5	352
7期(2017年3月6日)	10,274	0	1.6	11,525	4.4	—	0.0	98.1	351
8期(2017年9月5日)	10,261	0	△0.1	11,679	1.3	—	0.0	97.7	285
9期(2018年3月5日)	10,327	0	0.6	12,007	2.8	—	0.0	94.7	254
10期(2018年9月5日)	10,328	0	0.0	12,303	2.5	—	0.1	96.4	176

(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) 2018年3月5日	円	%		%	%	%	%
	10,327	—	12,007	—	—	0.0	94.7
3月末	10,324	△0.0	12,051	0.4	—	0.0	95.6
4月末	10,356	0.3	12,106	0.8	—	0.1	98.8
5月末	10,329	0.0	12,130	1.0	—	0.1	99.0
6月末	10,313	△0.1	12,142	1.1	—	0.1	100.2
7月末	10,319	△0.1	12,242	2.0	—	0.1	96.0
8月末	10,329	0.0	12,293	2.4	—	0.1	95.7
(期末) 2018年9月5日	10,328	0.0	12,303	2.5	—	0.1	96.4

(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
	(分配落)	税込分配金	期中騰落率	騰落率	騰落率				
	円	円	%		%	%	%	%	百万円
6期(2016年9月5日)	10,693	0	△4.0	11,437	△2.1	—	0.0	98.4	503
7期(2017年3月6日)	11,948	0	11.7	13,071	14.3	—	0.0	98.5	473
8期(2017年9月5日)	11,596	0	△2.9	12,767	△2.3	—	0.0	98.2	452
9期(2018年3月5日)	11,347	0	△2.1	12,633	△1.0	—	0.0	97.3	406
10期(2018年9月5日)	12,105	0	6.7	13,677	8.3	—	0.0	96.7	415

(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) 2018年3月5日	円	%		%	%	%	%
	11,347	—	12,633	—	—	0.0	97.3
3月末	11,437	0.8	12,762	1.0	—	0.0	97.3
4月末	11,806	4.0	13,196	4.5	—	0.0	97.4
5月末	11,732	3.4	13,143	4.0	—	0.0	97.6
6月末	11,927	5.1	13,379	5.9	—	0.0	97.6
7月末	12,010	5.8	13,546	7.2	—	0.0	97.0
8月末	12,053	6.2	13,609	7.7	—	0.0	96.6
(期末) 2018年9月5日	12,105	6.7	13,677	8.3	—	0.0	96.7

(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。

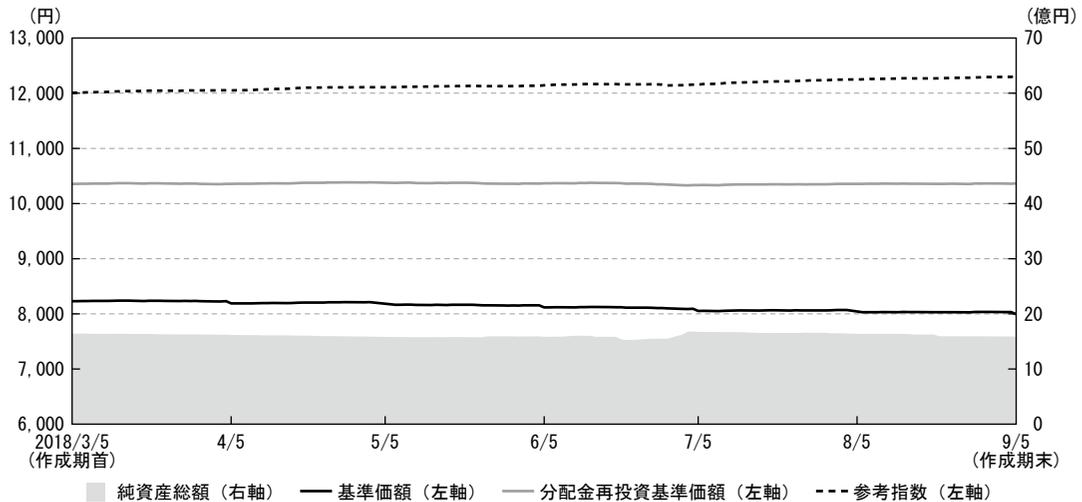
(注3) 当ファンドの参考指数は、クレディ・スイス・レパレジッド・ローン・インデックス（配当込み/円換算ベース/三菱UFJ銀行T T M）です。当参考指数は、ファンドの設定日の前営業日を10,000として、委託会社が算出したものです。

(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（2018年3月6日から2018年9月5日まで）

Aコース



作成期首：8,230円

作成期末：7,995円（既払分配金240円）

騰落率：0.1%（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

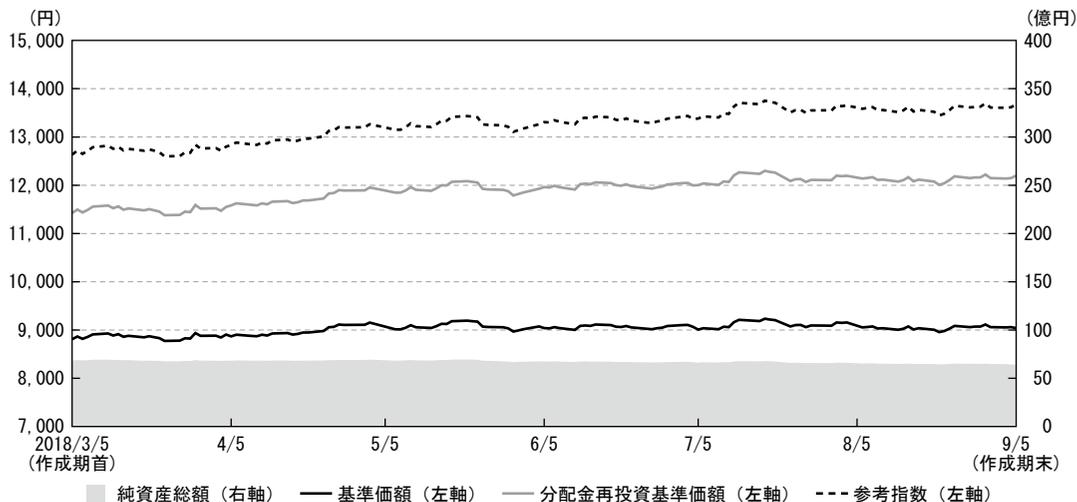
- ・投資先ファンドの保有する銀行貸付債権の価格上昇および安定的な利息収入がプラス寄与しました。

◆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・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	1.9%
マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	△0.5%

■基準価額等の推移（2018年3月6日から2018年9月5日まで）

Bコース



作成期首：8,810円

作成期末：9,039円（既払分配金360円）

騰落率：6.8%（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

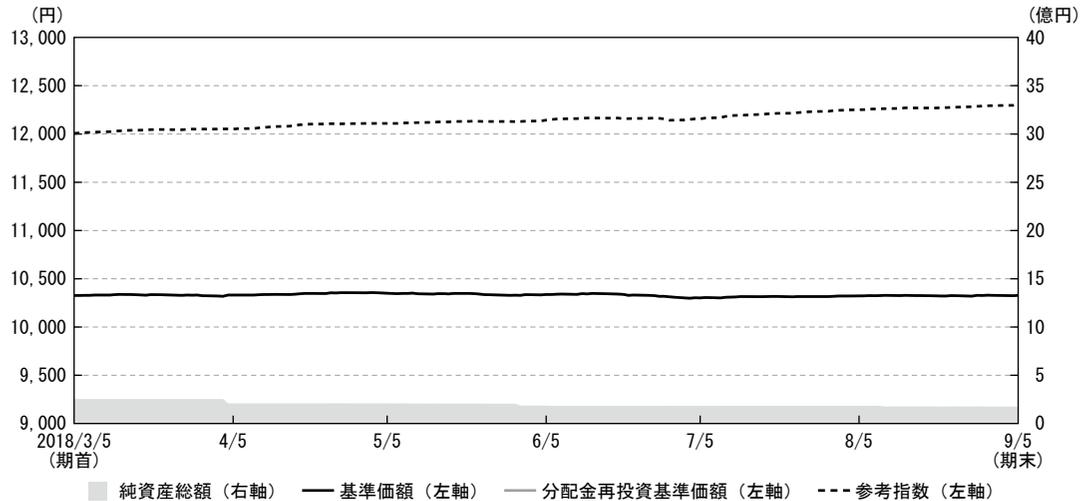
- ・投資先ファンドの保有する銀行貸付債権の価格上昇および安定的な利息収入がプラス寄与しました。
- ・円が米ドルに対し下落（円安）したことがプラス寄与しました。

◆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	1.9%
マニュアル・日本債券インデックス・マザーファンド	△0.5%

■基準価額等の推移（2018年3月6日から2018年9月5日まで）

Cコース



期 首：10,327円

期 末：10,328円（既払分配金0円）

騰落率： 0.01%（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/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

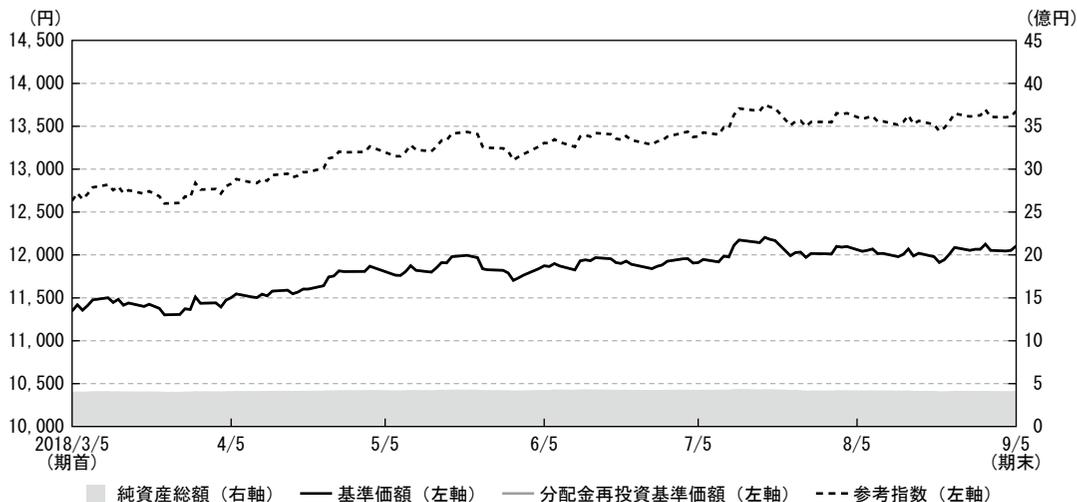
- ・投資先ファンドの保有する銀行貸付債権の価格上昇および安定的な利息収入がプラス寄与しました。

◆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	1.9%
マニュアル・日本債券インデックス・マザーファンド	△0.5%

■基準価額等の推移 (2018年3月6日から2018年9月5日まで)

Dコース



期首：11,347円

期末：12,105円 (既払分配金0円)

騰落率：6.7% (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 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価格上昇および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	1.9%
マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	△0.5%

■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2.8%台で始まった後、米中貿易摩擦への懸念から2.7%台に低下しましたが、4月から5月中旬にかけては、原油高によるインフレ圧力の高まりや堅調な米経済指標に加え、米政権の減税政策や財政支出拡大を背景に国債発行による需給悪化懸念が強まったことから、国債利回りは3.1%台に上昇しました。5月下旬は欧州の政局不安を受けて安全資産とされる米国債に資金が流入したことから、国債利回りは2.7%台まで低下しましたが、6月上旬には政局不安の後退や堅調な米国経済指標を受けて反発しました。その後は、米中貿易摩擦激化への懸念や、8月のトルコリラ急落を受けて新興国からの資金流出が加速したことが国債利回りの低下要因となった一方、欧州委員長と米大統領の会談でEU（欧州連合）と米国が関税引き下げに向けた協力を合意したことや、米国とメキシコのNAFTA（北米自由貿易協定）再交渉での合意などが国債利回りの上昇要因となり、米10年国債利回りは一進一退で推移し、期初をわずかに上回る2.8%台で期を終えました。銀行貸付債権は、堅調な企業業績などを背景に価格が上昇したほか、安定的な利息収入がプラス寄与し、トータルリターンベースでは期を通じて上昇しました。銀行貸付債権の基準金利である3ヵ月米ドルLIBOR（ロンドン銀行間貸出金利）は、期初年率2.02%台から期末には2.32%台へ上昇しました。

[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1米ドル105円台で始まった後、米中の貿易摩擦懸念から一時104円台となりましたが、4月から5月中旬にかけては米国債利回りの上昇を背景に円安米ドル高が進みました。5月下旬は欧州政局不安を受けて一時円高米ドル安となる局面もありましたが、6月以降は欧州政局不安の後退や堅調な米国経済指標、米朝首脳会談を経て朝鮮半島の非核化への期待が高まったことなどから、再び円安米ドル高基調となりました。7月半ばには、米中貿易摩擦懸念の高まりを受けて、資金退避先として一時米ドルが選好されたことなどから、113円台となる局面もありましたが、その後は資金退避先として再び円が選好されたことや、トルコリラ急落を受けて円が買われ、当作成期末には111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0.04%から作成期末0.11%となり利回りは上昇（価格は下落）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	97.2%
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	2.8%
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	96.4%
マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	0.1%
現預金等	3.5%
合計	100.0%

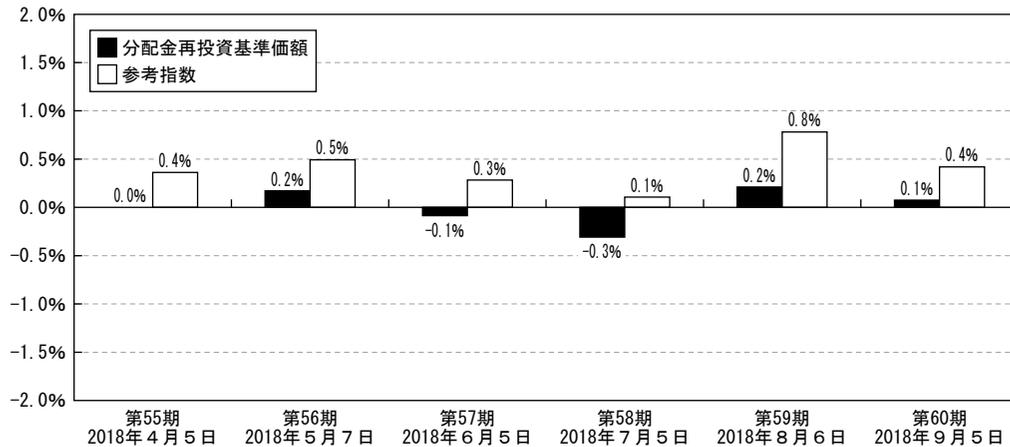
Dコース

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	96.7%
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	3.3%
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

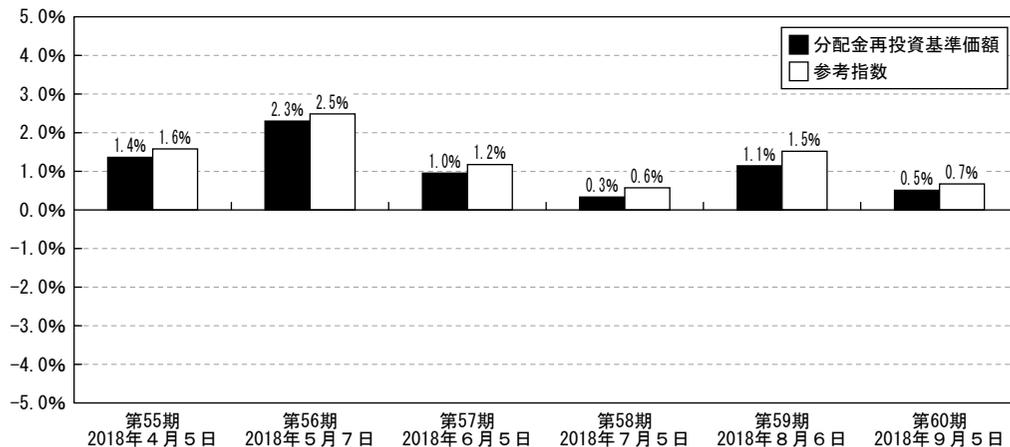
当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率の対比です。



※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

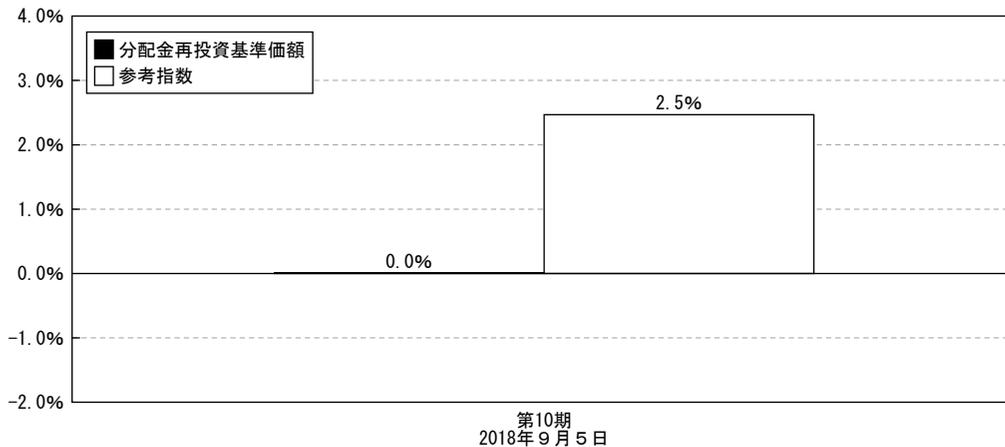
当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率の対比です。



※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

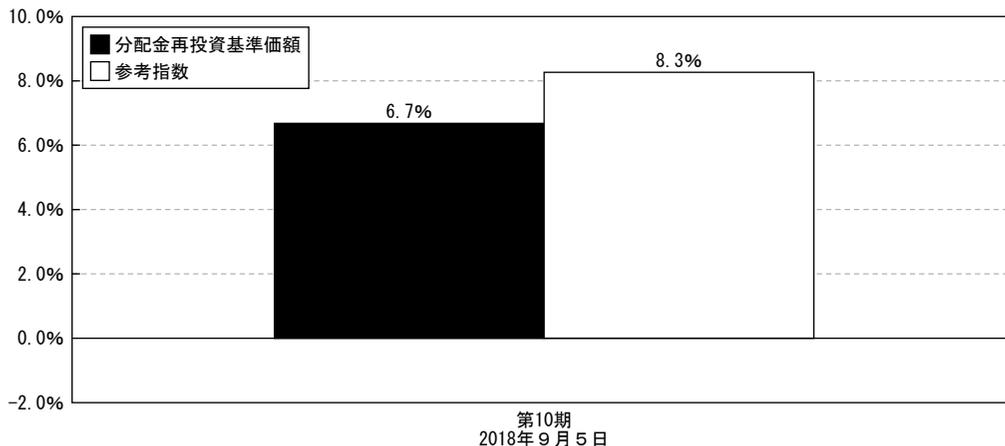
当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率の対比です。



※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55期～第60期は40円、合計240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55期	第56期	第57期	第58期	第59期	第60期
	自 2018年3月6日 至 2018年4月5日	自 2018年4月6日 至 2018年5月7日	自 2018年5月8日 至 2018年6月5日	自 2018年6月6日 至 2018年7月5日	自 2018年7月6日 至 2018年8月6日	自 2018年8月7日 至 2018年9月5日
当期分配金 (円)	40	40	40	40	40	40
(対基準価額比率) (%)	0.486	0.488	0.490	0.494	0.496	0.498
当期の収益 (円)	37	37	38	29	36	36
当期の収益以外 (円)	2	2	1	10	3	3
翌期繰越分配対象額 (円)	67	65	64	63	59	57

(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55期～第60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55期	第56期	第57期	第58期	第59期	第60期
	自 2018年3月6日 至 2018年4月5日	自 2018年4月6日 至 2018年5月7日	自 2018年5月8日 至 2018年6月5日	自 2018年6月6日 至 2018年7月5日	自 2018年7月6日 至 2018年8月6日	自 2018年8月7日 至 2018年9月5日
当期分配金 (円)	60	60	60	60	60	60
(対基準価額比率) (%)	0.672	0.661	0.659	0.662	0.658	0.659
当期の収益 (円)	47	49	45	42	47	43
当期の収益以外 (円)	12	10	14	17	12	16
翌期繰越分配対象額 (円)	1,744	1,734	1,722	1,705	1,693	1,677

(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10期	
		自 2018年3月6日 至 2018年9月5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)	2,622	

(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10期	
		自 2018年3月6日 至 2018年9月5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)	4,113	

(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

米国経済や米国企業のファンダメンタルズは健全で、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。

【Aコース】

■ 1万口当たりの費用明細

項目	第55期～第60期		項目の概要
	(2018年3月6日～2018年9月5日)		
	金額	比率	
平均基準価額	8,131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）	52円 (20) (31) (1)	0.640% (0.245) (0.381) (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）	4 (0) (2) (2) (0)	0.055 (0.001) (0.024) (0.028) (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	56	0.695	

- * 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。

■ 売買及び取引の状況 (2018年3月6日から2018年9月5日まで)
投資信託証券

決 算 期 銘 柄 名	第 55 期 ~ 第 60 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 21,201	口	千米ドル 31,105
		1,777		2,620

(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3月6日から2018年9月5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3月6日から2018年9月5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3月6日から2018年9月5日まで)
該当事項はありません。

■組入資産の明細（2018年9月5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 10 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	165,215	13,800	1,539,025	97.2	
合 計	165,215	13,800	1,539,025		

(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 9 作 成 期 末		第 10 作 成 期 末	
	口 数	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	千口	千口	千円
	91	91	91	109

(注1) マザーファンドの2018年9月5日現在の受益権総口数は13,347,233千口です。

(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9月5日現在）

該当事項はありません。

■投資信託財産の構成

(2018年9月5日現在)

項 目	第 10 作 成 期 末	
	評 価 額	比 率
投 資 信 託 受 益 証 券	千円	%
	1,539,025	96.5
マネーライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	109	0.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	55,509	3.5
投 資 信 託 財 産 総 額	1,594,643	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（1,539,036千円）の投資信託財産総額（1,594,643千円）に対する比率は96.5%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=111.52円です。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第55期末 2018年4月5日	第56期末 2018年5月7日	第57期末 2018年6月5日	第58期末 2018年7月5日	第59期末 2018年8月6日	第60期末 2018年9月5日
(A) 資 産	3,214,573,722円	3,201,711,935円	3,199,041,891円	3,634,448,721円	3,384,569,156円	3,109,637,413円
コール・ローン等	45,503,049	42,266,046	51,208,535	180,769,314	32,681,181	37,437,125
投資信託受益証券(評価額)	1,573,998,285	1,580,112,890	1,562,013,307	1,659,748,097	1,593,726,538	1,539,025,052
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)	109,849	109,877	109,849	110,197	109,237	109,237
未 収 入 金	1,594,962,539	1,579,223,122	1,585,710,200	1,793,821,113	1,758,052,200	1,533,065,999
(B) 負 債	1,598,660,493	1,622,764,656	1,615,115,456	1,962,650,877	1,748,321,095	1,526,110,133
未 払 金	1,588,862,736	1,608,511,529	1,604,655,510	1,949,625,448	1,734,522,657	1,516,364,375
未払収益分配金	7,892,197	7,736,393	7,805,683	8,305,366	8,151,354	7,922,859
未 払 解 約 金	—	4,584,232	921,189	2,931,216	3,649,390	—
未払信託報酬	1,760,404	1,782,779	1,596,660	1,645,441	1,846,465	1,682,776
その他未払費用	145,156	149,723	136,414	143,406	151,229	140,123
(C) 純資産総額(A－B)	1,615,913,229	1,578,947,279	1,583,926,435	1,671,797,844	1,636,248,061	1,583,527,280
元 本	1,973,049,426	1,934,098,283	1,951,420,872	2,076,341,559	2,037,838,550	1,980,714,927
次期繰越損益金	△ 357,136,197	△ 355,151,004	△ 367,494,437	△ 404,543,715	△ 401,590,489	△ 397,187,647
(D) 受 益 権 総 口 数	1,973,049,426口	1,934,098,283口	1,951,420,872口	2,076,341,559口	2,037,838,550口	1,980,714,927口
1万口当たり基準価額(C/D)	8,190円	8,164円	8,117円	8,052円	8,029円	7,995円

(注1) 当ファンドの第55期首元本額は1,992,946,870円、第55～60期中追加設定元本額は283,949,539円、第55～60期中一部解約元本額は296,181,482円です。

(注2) 1口当たり純資産額は、第55期0.8190円、第56期0.8164円、第57期0.8117円、第58期0.8052円、第59期0.8029円、第60期0.7995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55期末357,136,197円、第56期末355,151,004円、第57期末367,494,437円、第58期末404,543,715円、第59期末401,590,489円、第60期末397,187,647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55期	第56期	第57期	第58期	第59期	第60期
	自 2018年3月6日 至 2018年4月5日	自 2018年4月6日 至 2018年5月7日	自 2018年5月8日 至 2018年6月5日	自 2018年6月6日 至 2018年7月5日	自 2018年7月6日 至 2018年8月6日	自 2018年8月7日 至 2018年9月5日
(A) 配 当 等 収 益	9,341,010円	9,252,568円	9,395,021円	8,991,209円	9,396,385円	9,152,216円
受 取 配 当 金	9,352,681	9,261,116	9,417,231	9,015,411	9,462,710	9,157,547
受 取 利 息	△ 11,671	△ 8,548	△ 22,210	△ 24,202	△ 66,325	△ 5,331
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 7,529,374	△ 4,696,550	△ 9,015,026	△ 12,193,606	△ 3,854,707	△ 6,335,034
売 買 益	19,017,977	32,644,883	43,530,174	7,807,388	71,167,721	23,228,694
売 買 損	△ 26,547,351	△ 37,341,433	△ 52,545,200	△ 20,000,994	△ 75,022,428	△ 29,563,728
(C) 信 託 報 酬 等	△ 1,907,749	△ 1,934,463	△ 1,734,502	△ 1,790,916	△ 2,001,337	△ 1,827,863
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	△ 96,113	△ 2,621,555	△ 1,354,507	△ 4,993,313	△ 3,540,341	989,319
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△171,014,435	△175,197,664	△178,837,044	△177,329,106	△184,054,312	△182,986,415
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△178,133,452	△174,838,502	△179,497,203	△213,915,930	△212,925,164	△207,267,692
(配 当 等 相 当 額)	(21,297)	(16,626)	(230,283)	(2,204,898)	(59,455)	(16,874)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△178,154,749)	(△174,855,128)	(△179,727,486)	(△216,120,828)	(△212,984,619)	(△207,284,566)
(G) 計 (D+E+F)	△349,244,000	△347,414,611	△359,688,754	△396,238,349	△393,439,135	△389,264,788
(H) 収 益 分 配 金	△ 7,892,197	△ 7,736,393	△ 7,805,683	△ 8,305,366	△ 8,151,354	△ 7,922,859
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	△357,136,197	△355,151,004	△367,494,437	△404,543,715	△401,590,489	△397,187,647
追 加 信 託 差 損 益 金	△178,153,182	△174,853,975	△179,727,471	△216,118,929	△212,984,262	△207,283,538
(配 当 等 相 当 額)	(1,567)	(1,153)	(15)	(1,900)	(357)	(1,028)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△178,154,749)	(△174,855,128)	(△179,727,486)	(△216,120,829)	(△212,984,619)	(△207,284,566)
分 配 準 備 積 立 金	13,236,411	12,606,826	12,610,704	13,155,968	12,213,015	11,350,681
繰 越 損 益 金	△192,219,426	△192,903,855	△200,377,670	△201,580,754	△200,819,242	△201,254,790

(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55期 計算期間末における費用控除後の配当等収益(7,433,360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(21,297円)および分配準備積立金(13,675,518円)より分配対象収益は21,130,175円(10,000口当たり107円)であり、うち7,892,197円(10,000口当たり40円)を分配金額としております。

第56期 計算期間末における費用控除後の配当等収益(7,318,204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(16,626円)および分配準備積立金(13,009,542円)より分配対象収益は20,344,372円(10,000口当たり105円)であり、うち7,736,393円(10,000口当たり40円)を分配金額としております。

第57期 計算期間末における費用控除後の配当等収益(7,660,610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(230,283円)および分配準備積立金(12,525,509円)より分配対象収益は20,416,402円(10,000口当たり104円)であり、うち7,805,683円(10,000口当たり40円)を分配金額としております。

第58期 計算期間末における費用控除後の配当等収益(7,200,385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(2,204,899円)および分配準備積立金(12,057,950円)より分配対象収益は21,463,234円(10,000口当たり103円)であり、うち8,305,366円(10,000口当たり40円)を分配金額としております。

第59期 計算期間末における費用控除後の配当等収益(7,395,145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(59,455円)および分配準備積立金(12,910,126円)より分配対象収益は20,364,726円(10,000口当たり99円)であり、うち8,151,354円(10,000口当たり40円)を分配金額としております。

第60期 計算期間末における費用控除後の配当等収益(7,324,443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(16,874円)および分配準備積立金(11,933,251円)より分配対象収益は19,274,568円(10,000口当たり97円)であり、うち7,922,859円(10,000口当たり40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55期	第56期	第57期	第58期	第59期	第60期
1万口当たり分配金	40円	40円	40円	40円	40円	40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55期～第60期		項目の概要
	(2018年3月6日～2018年9月5日)		
	金額	比率	
平均基準価額	9,034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）	58円 (22) (34) (1)	0.640% (0.245) (0.381) (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）	3 (0) (1) (3) (0)	0.038 (0.000) (0.006) (0.031) (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	61	0.678	

- * 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。

■売買及び取引の状況（2018年3月6日から2018年9月5日まで）
投資信託証券

決 算 期 銘 柄 名	第 55 期 ～ 第 60 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
	25,347	2,130	94,976	8,000

（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3月6日から2018年9月5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
（2018年3月6日から2018年9月5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3月6日から2018年9月5日まで）
該当事項はありません。

■組入資産の明細（2018年9月5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 10 作 成 期 末 評 価 額		組 入 比 率
		外 貨 建 金 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	671,629	千米ドル 56,101	千円 6,256,409	% 97.4
合 計	671,629	56,101	6,256,409	

(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 9 作 成 期 末	第 10 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 109

(注1) マザーファンドの2018年9月5日現在の受益権総口数は13,347,233千口です。

(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9月5日現在）

該当事項はありません。

■投資信託財産の構成

(2018年9月5日現在)

項 目	第 10 作 成 期 末	
	評 価 額	比 率
投 資 信 託 受 益 証 券	千円 6,256,409	% 96.1
マネーライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	109	0.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	256,205	3.9
投 資 信 託 財 産 総 額	6,512,723	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（6,379,105千円）の投資信託財産総額（6,512,723千円）に対する比率は97.9%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=111.52円です。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第55期末 2018年4月5日	第56期末 2018年5月7日	第57期末 2018年6月5日	第58期末 2018年7月5日	第59期末 2018年8月6日	第60期末 2018年9月5日
(A) 資 産	6,867,720,931円	6,884,877,214円	6,803,253,601円	6,686,914,120円	6,594,632,916円	6,634,905,167円
コール・ローン等	188,596,224	188,200,076	188,231,710	157,771,522	133,518,576	133,533,322
投資信託受益証券(評価額)	6,679,014,858	6,696,567,261	6,614,912,042	6,529,032,401	6,461,005,103	6,256,409,319
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)	109,849	109,877	109,849	110,197	109,237	109,237
未 収 入 金	—	—	—	—	—	244,853,289
(B) 負 債	57,574,099	60,633,499	65,384,508	60,091,009	61,166,252	213,693,184
未 払 金	—	—	—	—	—	122,650,000
未払収益分配金	46,063,884	45,423,344	44,722,732	44,127,941	43,300,058	42,622,546
未払解約金	3,700,796	7,129,441	13,370,112	8,556,271	10,010,887	41,228,430
未払信託報酬	7,378,014	7,636,719	6,888,282	6,991,914	7,414,523	6,778,393
その他未払費用	431,405	443,995	403,382	414,883	440,784	413,815
(C) 純資産総額(A-B)	6,810,146,832	6,824,243,715	6,737,869,093	6,626,823,111	6,533,466,664	6,421,211,983
元 本	7,677,314,067	7,570,557,476	7,453,788,812	7,354,656,840	7,216,676,386	7,103,757,724
次期繰越損益金	△ 867,167,235	△ 746,313,761	△ 715,919,719	△ 727,833,729	△ 683,209,722	△ 682,545,741
(D) 受 益 権 総 口 数	7,677,314,067口	7,570,557,476口	7,453,788,812口	7,354,656,840口	7,216,676,386口	7,103,757,724口
1万口当たり基準価額(C/D)	8.870円	9.014円	9.040円	9.010円	9.053円	9.039円

(注1) 当ファンドの第55期首元本額は7,758,044,844円、第55～60期中追加設定元本額は286,804,980円、第55～60期中一部解約元本額は941,092,100円です。

(注2) 1口当たり純資産額は、第55期0.8870円、第56期0.9014円、第57期0.9040円、第58期0.9010円、第59期0.9053円、第60期0.9039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55期末867,167,235円、第56期末746,313,761円、第57期末715,919,719円、第58期末727,833,729円、第59期末683,209,722円、第60期末682,545,741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55期	第56期	第57期	第58期	第59期	第60期
	自 2018年3月6日 至 2018年4月5日	自 2018年4月6日 至 2018年5月7日	自 2018年5月8日 至 2018年6月5日	自 2018年6月6日 至 2018年7月5日	自 2018年7月6日 至 2018年8月6日	自 2018年8月7日 至 2018年9月5日
(A) 配 当 等 収 益	39,401,924円	39,272,184円	39,742,628円	38,627,471円	38,140,227円	37,657,993円
受 取 配 当 金	39,557,312	39,335,930	39,841,379	38,739,073	38,362,048	37,956,976
受 取 利 息	△ 155,388	△ 63,746	△ 98,751	△ 111,602	△ 221,821	△ 298,983
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	60,909,097	122,614,226	30,792,590	△ 8,985,726	43,570,283	1,921,756
売 買 益	79,232,591	130,741,569	58,125,347	30,658,652	48,362,803	16,237,720
売 買 損	△ 18,323,494	△ 8,127,343	△ 27,332,757	△ 39,644,378	△ 4,792,520	△ 14,315,964
(C) 信 託 報 酬 等	△ 7,809,929	△ 8,080,115	△ 7,285,880	△ 7,406,837	△ 7,857,999	△ 7,195,364
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	92,501,092	153,806,295	63,249,338	22,234,908	73,852,511	32,384,385
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 86,172,021	△ 29,751,652	83,271,628	110,503,478	98,200,021	132,573,653
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 827,432,422	△ 824,945,060	△ 817,717,953	△ 816,444,174	△ 811,962,196	△ 804,881,233
(配 当 等 相 当 額)	(9,188,641)	(6,346,105)	(10,935,297)	(11,684,301)	(6,235,204)	(4,933,317)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 836,621,063)	(△ 831,291,165)	(△ 828,653,250)	(△ 828,128,475)	(△ 818,197,400)	(△ 809,814,550)
(G) 計 (D+E+F)	△ 821,103,351	△ 700,890,417	△ 671,196,987	△ 683,705,788	△ 639,909,664	△ 639,923,195
(H) 収 益 分 配 金	△ 46,063,884	△ 45,423,344	△ 44,722,732	△ 44,127,941	△ 43,300,058	△ 42,622,546
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	△ 867,167,235	△ 746,313,761	△ 715,919,719	△ 727,833,729	△ 683,209,722	△ 682,545,741
追 加 信 託 差 損 益 金	△ 836,614,490	△ 831,289,187	△ 828,652,661	△ 828,123,370	△ 818,190,188	△ 809,811,241
(配 当 等 相 当 額)	(6,573)	(1,978)	(589)	(5,105)	(7,212)	(3,309)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 836,621,063)	(△ 831,291,165)	(△ 828,653,250)	(△ 828,128,475)	(△ 818,197,400)	(△ 809,814,550)
分 配 準 備 積 立 金	1,339,378,816	1,312,898,764	1,284,018,597	1,254,377,005	1,222,320,601	1,191,642,724
繰 越 損 益 金	△ 1,369,931,561	△ 1,227,923,338	△ 1,171,285,655	△ 1,154,087,364	△ 1,087,340,135	△ 1,064,377,224

(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55期 計算期間末における費用控除後の配当等収益 (36,334,283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 (9,188,641円) および分配準備積立金 (1,339,926,349円) より分配対象収益は1,385,449,273円 (10,000口当たり1,804円) であり、うち46,063,884円 (10,000口当たり60円) を分配金額としております。

第56期 計算期間末における費用控除後の配当等収益 (37,312,047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 (6,346,105円) および分配準備積立金 (1,314,665,934円) より分配対象収益は1,358,324,086円 (10,000口当たり1,794円) であり、うち45,423,344円 (10,000口当たり60円) を分配金額としております。

第57期 計算期間末における費用控除後の配当等収益 (35,637,853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 (10,935,297円) および分配準備積立金 (1,282,168,768円) より分配対象収益は1,328,741,918円 (10,000口当たり1,782円) であり、うち44,722,732円 (10,000口当たり60円) を分配金額としております。

第58期 計算期間末における費用控除後の配当等収益 (31,220,725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 (11,684,301円) および分配準備積立金 (1,255,605,025円) より分配対象収益は1,298,510,051円 (10,000口当たり1,765円) であり、うち44,127,941円 (10,000口当たり60円) を分配金額としております。

第59期 計算期間末における費用控除後の配当等収益 (34,472,210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 (6,235,204円) および分配準備積立金 (1,224,920,457円) より分配対象収益は1,265,627,871円 (10,000口当たり1,753円) であり、うち43,300,058円 (10,000口当たり60円) を分配金額としております。

第60期 計算期間末における費用控除後の配当等収益 (30,812,414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 (4,933,317円) および分配準備積立金 (1,198,522,848円) より分配対象収益は1,234,268,579円 (10,000口当たり1,737円) であり、うち42,622,546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55期	第56期	第57期	第58期	第59期	第60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
	(2018年3月6日～2018年9月5日)		
	金額	比率	
平均基準価額	10,328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)	0.640% (0.245) (0.381) (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）	14 (1) (6) (7) (0)	0.139 (0.008) (0.060) (0.069) (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	80	0.779	

* 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。

■売買及び取引の状況（2018年3月6日から2018年9月5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
	763	64	9,384	792

（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（2018年3月6日から2018年9月5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

（2018年3月6日から2018年9月5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3月6日から2018年9月5日まで）

該当事項はありません。

■組入資産の明細（2018年9月5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	18,220	千米ドル 1,521	千円 169,729	% 96.4
合 計	18,220	1,521	169,729	

(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 109

(注1) マザーファンドの2018年9月5日現在の受益権総口数は13,347,233千口です。

(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9月5日現在）

該当事項はありません。

■投資信託財産の構成

（2018年9月5日現在）

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投 資 信 託 受 益 証 券	千円 169,729	% 95.2
マニュアル・日本債券インデックス・マザーファンド	109	0.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	8,372	4.7
投 資 信 託 財 産 総 額	178,210	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（169,731千円）の投資信託財産総額（178,210千円）に対する比率は95.2%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=111.52円です。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	当 期 末 2018年9月5日
(A) 資 産	345,037,846円
コール・ローン等	6,346,256
投資信託受益証券(評価額)	169,729,355
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)	109,237
未 収 入 金	168,852,998
(B) 負 債	169,020,361
未 払 金	166,970,731
未 払 解 約 金	499,515
未 払 信 託 報 酬	1,293,280
そ の 他 未 払 費 用	256,835
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	176,017,485
元 本	170,424,804
次 期 繰 越 損 益 金	5,592,681
(D) 受 益 権 総 口 数	170,424,804口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,328円

(注1) 当ファンドの期首元本額は246,013,438円、期中追加設定元本額は3,756,153円、期中一部解約元本額は79,344,787円です。

(注2) 1口当たり純資産額は1.0328円です。

■損益の状況

項 目	当 期 自 2018年3月6日 至 2018年9月5日
(A) 配 当 等 収 益	6,393,027円
受 取 配 当 金	5,945,746
受 取 利 息	447,281
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 4,932,934
売 買 益	14,015,147
売 買 損	△18,948,081
(C) 信 託 報 酬 等	△ 1,569,795
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△ 109,702
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	3,915,841
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	1,786,542
(配 当 等 相 当 額)	(13,958,004)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△12,171,462)
(G) 計 (D+E+F)	5,592,681
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	5,592,681
追 加 信 託 差 損 益 金	1,786,542
(配 当 等 相 当 額)	(13,958,004)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△12,171,462)
分 配 準 備 積 立 金	30,730,490
繰 越 損 益 金	△26,924,351

(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(4,823,735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(13,958,004円)および分配準備積立金(25,906,755円)より分配対象収益は44,688,494円(10,000口当たり2,622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
	(2018年3月6日～2018年9月5日)		
	金額	比率	
平均基準価額	11,827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）	76円 (29) (45) (2)	0.640% (0.245) (0.381) (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）	10 (0) (3) (6) (0)	0.085 (0.001) (0.028) (0.054) (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	86	0.725	

* 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。

■売買及び取引の状況（2018年3月6日から2018年9月5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 1,580	千米ドル 132	口 2,624	千米ドル 220

（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（2018年3月6日から2018年9月5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

（2018年3月6日から2018年9月5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3月6日から2018年9月5日まで）

該当事項はありません。

■組入資産の明細（2018年9月5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
		評 価 額 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	43,110	千米ドル 3,601	千円 401,586	% 96.7
合 計	43,110	3,601	401,586	

(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 109

(注1) マザーファンドの2018年9月5日現在の受益権総口数は13,347,233千口です。

(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9月5日現在）

該当事項はありません。

■投資信託財産の構成

(2018年9月5日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投 資 信 託 受 益 証 券	千円 401,586	% 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	109	0.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	16,816	4.0
投 資 信 託 財 産 総 額	418,511	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（401,587千円）の投資信託財産総額（418,511千円）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=111.52円です。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	当 期 末 2018年9月5日
(A) 資 産	418,511,000円
コール・ローン等	16,815,168
投資信託受益証券(評価額)	401,586,595
マネュライフ・日本債券インデックス・マザーファンド(評価額)	109,237
(B) 負 債	3,042,978
未払信託報酬	2,697,043
その他未払費用	345,935
(C) 純資産総額(A-B)	415,468,022
元 本	343,226,371
次期繰越損益金	72,241,651
(D) 受益権総口数	343,226,371口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,105円

(注1) 当ファンドの期首元本額は358,483,899円、期中追加設定元本額は10,678,878円、期中一部解約元本額は25,936,406円です。

(注2) 1口当たり純資産額は1.2105円です。

■損益の状況

項 目	当 期 自 2018年3月6日 至 2018年9月5日
(A) 配 当 等 収 益	14,199,027円
受 取 配 当 金	11,995,036
受 取 利 息	2,203,991
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	14,370,331
売 買 益	21,366,815
売 買 損	△ 6,996,484
(C) 信 託 報 酬 等	△ 3,053,912
(D) 当期損益金(A+B+C)	25,515,446
(E) 前期繰越損益金	381,191
(F) 追加信託差損益金	46,345,014
(配当等相当額)	(57,487,158)
(売買損益相当額)	(△11,142,144)
(G) 計 (D+E+F)	72,241,651
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	72,241,651
追加信託差損益金	46,345,014
(配当等相当額)	(57,487,158)
(売買損益相当額)	(△11,142,144)
分配準備積立金	83,686,633
繰越損益金	△57,789,996

(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(12,681,783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(57,487,158円)および分配準備積立金(71,004,850円)より分配対象収益は141,173,791円(10,000口当たり4,113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	マニュアル・アセット・マネジメント（HK）リミテッド
投資顧問会社	マニュアル・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	4.75%
直接利回り	4.86%
最終利回り	5.54%
平均デュレーション	0.14年
残存年数	5.27年
平均格付け	B+

※現地の2017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137銘柄）

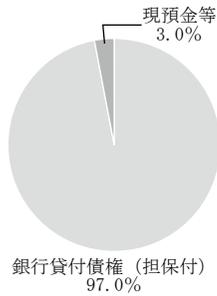
	銘柄名	組入比率
1	ドンカスターズ・ファイナンス	1.35%
2	タワー・オート・モーティブ・ホールディングス	1.22%
3	ツイン・リバー・マネジメント・グループ	1.20%
4	マイクロン・テクノロジー	1.17%
5	WP CPPホールディングス	1.16%
6	ナビスター・インク	1.15%
7	ラックススペース・ホスティング	1.15%
8	クォーラム・ヘルス	1.12%
9	ニーマン・マーカス・グループ	1.12%
10	キー・セイフティ・システムズ	1.12%

※現地の2017年12月最終営業日のデータです。

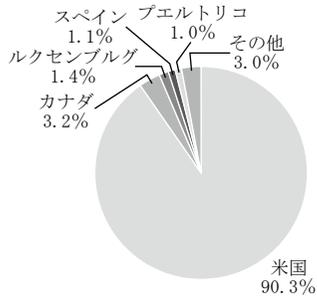
※組入比率は純資産総額に対する比率です。

※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。

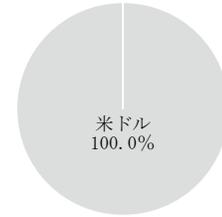
○資産別配分



○国・地域別配分



○通貨別配分



※現地の2017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「MI 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

(2017年1月1日から2017年12月31日まで)
(単位: 米ドル)

マネジメントフィー	847, 107
カストディアンフィー等	106, 788
トラスティアンフィー	12, 000
監査報酬等	44, 762
評価手数料	25, 000
取引手数料	4, 718
年間権限費用	1, 591
会計及びその他専門家費用	3, 500
その他費用	40, 859
費用合計	1, 086, 325

■有価証券明細表 2017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 (%)
AIR CANADA 10/06/2023	1,090,267.50	1,098,329.72	0.54
ACADIA HEALTHCARE CO INC 02/11/2022	1,545,716.50	1,554,008.90	0.77
ANCESTRY.COM OPERATIONS INC 10/19/2023	1,146,487.50	1,154,712.96	0.57
ACRISURE LLC 11/22/2023	997,500.00	1,011,089.93	0.50
ANCHOR GLASS CONTAINER 12/07/2024	538,000.00	545,363.16	0.27
AIR MEDICAL GROUP HOLDINGS 04/28/2022	1,910,322.56	1,910,396.94	0.94
ASP AMC MERGER SUB 04/13/2024	1,819,363.65	1,816,166.62	0.90
ALBERTSON'S LLC 12/21/2022	1,975,112.29	1,934,640.76	0.95
ALPHA 3 BV 01/25/2024	1,527,325.00	1,536,200.46	0.76
AVAYA HOLDINGS CORP	45,809.00	803,947.95	0.40
AVAYA INC 11/09/2024	1,650,000.00	1,625,528.33	0.80
BAKERCORP TL B 1L USD 2/7/2020	1,057,022.64	1,052,531.70	0.52
1011778 BC ULC 02/16/2024	950,203.02	949,996.18	0.47
BRED TECH TL 1L USD 8/29/2021	2,264,544.16	2,269,209.47	1.12
TWIN RIVER MANAGEMENT GROUP 07/10/2020	2,401,545.17	2,430,610.55	1.20
BUILDERS FIRSTSOURCE INC 02/29/2024	1,770,478.54	1,776,978.17	0.88
BRAND ENERGY & INFRASTRUCTU 06/16/2024	1,233,800.00	1,238,343.42	0.61
PEABODY ENERGY CORP 03/31/2022	713,609.50	723,052.28	0.36
BWAY CORP 04/03/2024	995,000.00	998,925.18	0.49
CAMELOT FINANCE LP 10/03/2023	1,086,304.95	1,092,563.77	0.54
CARESTREAM HEALT TL B 1L USD 6/7/2019	708,597.39	709,335.93	0.35
CBS RADIO INC 11/17/2024	585,000.00	589,916.37	0.29
CHEMOURS CO 05/12/2022	1,587,005.47	1,598,779.73	0.79
COGECO COMMUNICATIONS US 08/10/2024	1,940,000.00	1,934,548.60	0.95
CHESAPEAKE ENERGY CORP 08/23/2021	1,350,000.00	1,445,794.72	0.71
CHECKOUT HOLDING TL 1L USD 4/9/2021	338,480.99	267,119.86	0.13
CENGAGE LEARNING INC 06/07/2023	2,282,494.08	2,180,953.61	1.07
USI INC/NY 05/16/2024	1,471,312.50	1,468,827.63	0.72
CONSOLIDATED CONTAINER CO 05/22/2024	1,107,225.00	1,111,379.76	0.55
WP CPP HOLDINGS TL 2L USD 4/30/2021	724,300.00	727,052.51	0.36
WP CPP HOLDINGS LLC 12/28/2019	2,361,595.90	2,358,115.83	1.16
COMMUNICATIONS SALES & LEASI 10/24/2022	1,749,153.68	1,688,599.30	0.83
CENTURYLINK INC 01/31/2025	1,550,000.00	1,494,399.46	0.74
CATALENT PHARMA SOLUTION 05/20/2024	1,811,927.98	1,817,886.07	0.90
CORAL-US CO-BORROWER LLC 01/19/2025	995,000.00	995,887.95	0.49
CHS/COMMUNITY HEALTH SYS IN 12/31/2019	1,975,334.08	1,917,657.35	0.95
SOPHIA LP 09/30/2022	1,515,247.03	1,516,507.64	0.75
DELTA AIR LINES 08/18/2022	980,000.00	987,192.31	0.49
DHX MEDIA LTD 12/22/2023	1,771,100.00	1,774,098.92	0.87
DIGICEL INTL FINANCE LTD 05/10/2024	1,596,000.00	1,603,162.05	0.79
DONCASTERS FIN TL B 1L USD 4/9/2020	2,824,805.09	2,731,198.91	1.35
DONCASTERS GROUP TL 2L USD 10/10/2020	1,000,000.00	934,828.63	0.46
ENGLITY CORP 08/12/2023	1,072,044.12	1,081,855.88	0.53
ENERGY TRANSFER EQUITY 02/02/2024	1,679,116.30	1,673,486.29	0.82
EVERI PAYMENTS INC 05/09/2024	1,691,500.00	1,706,985.84	0.84
FIRST DATA CORPORATION 04/26/2024	1,756,934.89	1,758,178.94	0.87
FREEDOM MORTGAGE CORP 02/17/2022	1,481,132.08	1,507,087.60	0.74
FRONTIER COMMUNICATIONS 06/01/2024	1,766,125.00	1,691,847.66	0.83
FTS INTL INC TL 1L USD 4/16/2021	1,830,000.00	1,785,213.66	0.88
GATES GLOBAL LLC 03/31/2024	2,207,297.17	2,218,887.94	1.09
GARDNER DENVER INC 07/30/2024	1,764,001.17	1,770,847.00	0.87
GRIFOLS WORLDWIDE OPERAT 01/31/2025	2,084,250.00	2,088,067.50	1.03
GOODYEAR TIRE & RUBBER 04/30/2019	1,506,666.66	1,513,086.71	0.75
GTT COMMUNICATIONS INC 01/09/2024	1,772,100.00	1,781,680.41	0.88
GARDA WORLD SECURITY CORP 05/26/2024	1,401,837.60	1,413,337.60	0.70
HARGRAY MERGER SUB CORP 03/24/2024	522,375.00	523,357.46	0.26
HILTON WORLDWIDE FINANCE 10/25/2023	2,079,387.67	2,089,594.46	1.03

銘柄名	数量	評価額(米ドル)	投資比率(%)
IBC CAPITAL LTD 09/15/2021	1,251,709.80	1,253,700.47	0.62
IBC CAPITAL LTD 09/15/2022	525,000.00	515,801.58	0.25
IHEARTCOMMUNICATIONS TL E 1L USD7/30/19	600,000.00	448,533.66	0.22
INTELSAT JACKSON HLDG 11/27/2023	2,000,000.00	1,965,396.67	0.97
GREATBATCH LTD 10/27/2022	1,703,972.54	1,721,465.72	0.85
JD POWER & ASSOCIATES 09/07/2023	2,024,375.00	2,027,908.10	1.00
KINDRED HEALTHCA TL B 1L USD 4/9/21	1,928,952.94	1,955,194.17	0.96
EASTMAN KODAK CO TL EXIT 1L USD 9/3/19	980,864.27	839,278.07	0.41
KLOECKNER PENTAPLAST OF AME 06/29/2022	867,825.00	875,848.28	0.43
LIBERTY CABLEVIS TL 1L USD 1/7/22	1,930,000.00	1,887,073.76	0.93
LIONS GATE ENTERTAINMENT CO 12/08/2023	896,698.93	897,262.27	0.44
LSC COMMUNICATIONS INC 09/30/2022	2,114,540.24	2,117,118.03	1.04
LSF9 ATLANTIS HOLDINGS L 04/21/2023	1,555,312.50	1,566,794.83	0.77
MCGRAW-HILL GLOBAL ED 0 5/2/22	2,235,950.00	2,229,541.96	1.10
MEDALLION MIDLAND ACQ 10/31/2024	1,500,000.00	1,502,477.37	0.74
NATIONAL MENTOR HOLDINGS INC 01/31/2021	1,935,548.66	1,958,114.20	0.97
MILL US ACQUISITION LLC TL B 1L USD7/20	679,316.22	678,774.32	0.33
MPH ACQUISITION HOLDINGS 06/07/2023	924,423.62	926,070.13	0.46
MALLINCKRODT INTERNATIONAL 09/24/2024	1,796,483.56	1,792,980.94	0.88
MOHEGAN TRIBAL GAMING AUTHO 10/13/2023	1,138,500.00	1,147,753.71	0.57
ALMONDE INC 06/16/2024	1,406,475.00	1,412,226.97	0.70
MATCH GROUP INC 11/16/2022	1,505,560.90	1,522,546.59	0.75
MICRON TECHNOLOGY INC 04/26/2022	2,354,150.00	2,383,328.27	1.17
NAVISTAR INC 11/02/2024	2,313,000.00	2,327,684.87	1.15
NEP/NCP HOLDCO INC 07/21/2022	966,368.53	967,964.57	0.48
NEW ARCLIN US HOLDINGS 02/09/2024	1,273,600.00	1,283,782.78	0.63
NEW ARCLIN US HOLDINGS 02/09/2025	1,675,000.00	1,691,113.98	0.83
GATEWAY CASINOS & ENTERTAIN 02/14/2023	1,174,100.00	1,183,802.31	0.58
NEIMAN MARCUS GROUP LTD LLC 10/25/2020	2,785,825.05	2,277,362.95	1.12
AERIAL MERGER SUB INC 06/30/2025	555,000.00	567,706.41	0.28
NAB HOLDINGS LLC 06/30/2024	1,492,500.00	1,495,905.27	0.74
GOLDEN NUGGET 10/04/2023	980,225.57	987,358.24	0.49
MACDERMID INC 06/07/2023	678,895.38	682,378.61	0.34
MACDERMID INC 06/07/2020	1,753,964.55	1,764,784.91	0.87
PATRIOT COAL TL EXIT 1L USD 12/18/18	1,288,712.32	7,294.11	0.00
PETSMART INC 03/10/2022	2,146,221.83	1,711,763.93	0.84
PLY GEM INDS TL 1L USD 1/30/2021	297,951.34	299,930.06	0.15
POST HOLDINGS INC 05/24/2024	1,442,750.00	1,447,595.23	0.71
PARTY CITY HOLDINGS INC 08/19/2022	1,807,761.13	1,826,118.67	0.90
PROSPECT MEDICAL HOLDINGS 06/30/2022	1,477,500.00	1,529,327.14	0.75
PROJECT ALPHA INTERMEDIA 04/26/2024	1,094,500.00	1,074,607.87	0.53
QUORUM HEALTH CORP 04/12/2022	2,249,882.17	2,271,128.37	1.12
RITE AID CORP TL 2L USD 8/21/2020	1,500,000.00	1,505,420.00	0.74
RACKSPACE HOSTING INC 11/03/2023	2,293,224.41	2,327,303.87	1.15
RP CROWN PARENT LLC 10/12/2023	789,030.00	792,289.28	0.39
REVLON CONSUMER PRODUCTS CO 09/07/2023	1,288,687.50	954,572.59	0.47
REYNOLDS GROUP HOLDINGS 02/05/2023	1,862,626.41	1,871,026.69	0.92
RADIO ONE INC 04/05/2023	1,731,912.50	1,698,096.91	0.84
SPRINT COMMUNICATIONS 02/02/2024	2,084,250.00	2,083,403.27	1.03
SINCLAIR TELEVISION GROU 12/12/2024	1,885,000.00	1,881,475.05	0.93
SELECT MEDICAL CORP 03/06/2024	1,488,750.00	1,502,355.79	0.74
SCIENTIFIC GAMES INTERNATIO 08/14/2024	1,511,212.50	1,527,611.43	0.75
SOUTHEAST POWERGEN LLC 12/2/2021	1,503,491.27	1,440,228.11	0.71
STATION CASINOS LLC 06/08/2023	2,151,305.55	2,155,207.78	1.06
MORAN FOODS LLC 12/05/2023	1,232,550.00	975,268.43	0.48
SUPERVALU INC 06/08/2024	885,185.93	864,536.68	0.43
SUPERVALU INC 06/08/2024	530,987.50	518,600.86	0.26
TRANSDIGM INC 06/09/2023	1,920,992.20	1,923,822.72	0.95
TEMPO ACQUISITION LLC 05/01/2024	2,174,075.00	2,165,836.90	1.07

銘柄名	数量	評価額(米ドル)	投資比率 (%)
US TELEPACIFIC CORP 05/02/2023	1,481,111.22	1,415,287.36	0.70
TERRAFORM AP ACQUISITION HOL 06/26/2022	1,832,434.00	1,835,632.10	0.90
TENN MERGER SUB INC 01/12/2024	1,496,231.16	1,456,565.96	0.72
TOWER AUTOMOTIVE HOLDING 03/06/2024	2,460,483.28	2,473,789.49	1.22
TRIBUNE MEDIA CO 01/27/2024	1,483,784.54	1,485,284.28	0.73
TRIBUNE MEDIA CO 12/27/2020	119,048.19	119,143.52	0.06
TRINSEO MATERIALS OPERATING 08/17/2024	1,955,100.00	1,970,426.19	0.97
TRONOX BLOCKED BORROWER 09/22/2024	735,860.47	740,350.05	0.36
TRONOX FINANCE LLC 09/22/2024	1,698,139.53	1,708,500.08	0.84
TRAVEL LEADERS GROUP LLC 01/25/2024	992,512.50	1,006,084.28	0.50
ULTRA RESOURCES INC 04/12/2024	1,165,000.00	1,168,948.01	0.58
HOYA MIDCO LLC 06/27/2024	995,000.00	994,174.15	0.49
VALEANT PHARMACEUTICALS 04/01/2022	487,647.41	496,880.19	0.24
WESTERN DIGITAL CORP 04/29/2023	1,635,810.96	1,641,613.86	0.81
JAZZ ACQUISITION TL 1L USD 6/19/21	1,454,591.27	1,413,764.94	0.70
WINDSTREAM SERVICES LLC 02/08/2024	2,227,403.02	2,000,880.55	0.99
WINDSTREAM SERVICES LLC 09/30/2021	1,544,805.66	1,447,332.24	0.71
WIDOPENWEST FINANCE LLC 08/19/2023	1,848,302.54	1,832,173.69	0.90
OLYMPUS MERGER SUB INC 10/03/2024	1,455,107.69	1,464,837.75	0.72
UFC HOLDINGS LLC 08/18/2023	996,930.00	1,002,112.09	0.49
UFC HOLDINGS LLC 08/18/2024	750,000.00	761,570.45	0.38
有価証券 合計		197,624,562.48	97.40
その他資産		5,284,692.64	2.60
純資産総額		202,909,255.12	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
	期 騰 落 率	騰 落 率	(ベンチマーク) 期 騰 落 率	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	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	—

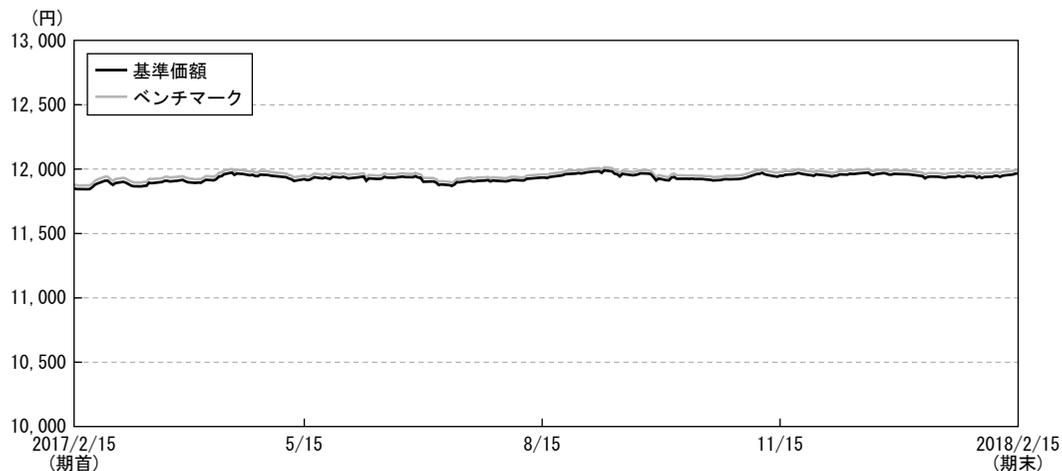
(注1) 騰落率は期首比です。

(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	算 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)