

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109期（決算日 2022年10月5日）

第110期（決算日 2022年11月7日）

第111期（決算日 2022年12月5日）

第112期（決算日 2023年1月5日）

第113期（決算日 2023年2月6日）

第114期（決算日 2023年3月6日）

Cコース（為替ヘッジあり・年2回）／

Dコース（為替ヘッジなし・年2回）

第19期（決算日 2023年3月6日）

－受益者のみなさまへ－

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

さて、「マニユライフ・変動高金利戦略ファンド Aコース（為替ヘッジあり・毎月）／Bコース（為替ヘッジなし・毎月）」は第114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19期の決算を行いました。

ここに、各期中の運用状況をご報告申し上げます。今後とも一層のお引立てを賜りますようお願い申し上げます。

マニユライフ・インベストメント・マネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-8-1 丸の内トラストタワーN館

お問い合わせ先

サポートダイヤル：03-6267-1901

受付時間：営業日の午前9時～午後5時

ホームページアドレス：www.manulifeim.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15作成期	85期（2020年10月5日）	円 6,786	円 25	% △0.7		% 12,871	0.0	% —	0.0	% 98.2	百万円 907
	86期（2020年11月5日）	6,788	25	0.4	12,931	0.5	—	0.0	96.5	900	
	87期（2020年12月7日）	6,883	25	1.8	13,232	2.3	—	0.0	97.7	896	
	88期（2021年1月5日）	6,900	25	0.6	13,361	1.0	—	0.0	96.9	886	
	89期（2021年2月5日）	6,923	25	0.7	13,534	1.3	—	0.0	99.4	875	
	90期（2021年3月5日）	6,913	25	0.2	13,597	0.5	—	0.0	99.4	790	
第16作成期	91期（2021年4月5日）	6,874	25	△0.2	13,612	0.1	—	0.0	102.0	772	
	92期（2021年5月6日）	6,861	25	0.2	13,679	0.5	—	0.0	98.8	762	
	93期（2021年6月7日）	6,863	25	0.4	13,757	0.6	—	0.0	98.1	741	
	94期（2021年7月5日）	6,843	25	0.1	13,809	0.4	—	0.0	100.9	732	
	95期（2021年8月5日）	6,801	25	△0.2	13,805	△0.0	—	0.0	97.8	722	
	96期（2021年9月6日）	6,797	25	0.3	13,885	0.6	—	0.0	98.2	716	
第17作成期	97期（2021年10月5日）	6,799	25	0.4	13,967	0.6	—	0.0	97.0	702	
	98期（2021年11月5日）	6,762	25	△0.2	14,004	0.3	—	0.0	101.1	691	
	99期（2021年12月6日）	6,718	25	△0.3	13,983	△0.1	—	0.0	97.0	674	
	100期（2022年1月5日）	6,717	25	0.4	14,083	0.7	—	0.0	100.5	616	
	101期（2022年2月7日）	6,703	25	0.2	14,120	0.3	—	0.0	98.2	612	
	102期（2022年3月7日）	6,625	25	△0.8	14,025	△0.7	—	0.0	98.7	604	
第18作成期	103期（2022年4月5日）	6,606	25	0.1	14,086	0.4	—	0.0	98.8	599	
	104期（2022年5月6日）	6,530	25	△0.8	14,024	△0.4	—	0.0	106.3	589	
	105期（2022年6月6日）	6,380	25	△1.9	13,787	△1.7	—	0.0	99.2	569	
	106期（2022年7月5日）	6,131	25	△3.5	13,420	△2.7	—	0.0	98.9	544	
	107期（2022年8月5日）	6,189	25	1.4	13,764	2.6	—	0.0	98.7	546	
	108期（2022年9月5日）	6,203	25	0.6	13,867	0.7	—	0.0	105.1	546	
第19作成期	109期（2022年10月5日）	6,065	25	△1.8	13,682	△1.3	—	0.0	99.2	528	
	110期（2022年11月7日）	6,057	25	0.3	13,753	0.5	—	0.0	97.3	525	
	111期（2022年12月5日）	6,072	25	0.7	13,879	0.9	—	0.0	94.5	525	
	112期（2023年1月5日）	6,051	25	0.1	13,944	0.5	—	0.0	93.6	524	
	113期（2023年2月6日）	6,133	25	1.8	14,317	2.7	—	0.0	98.7	519	
	114期（2023年3月6日）	6,078	25	△0.5	14,368	0.4	—	0.0	79.6	512	

（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/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109期	(期 首) 2022年9月5日	円 6,203	% —	13,867	% —	% —	% 0.0	% 105.1
	9月末	6,076	△2.0	13,606	△1.9	—	0.0	99.3
	(期 末) 2022年10月5日	6,090	△1.8	13,682	△1.3	—	0.0	99.2
第110期	(期 首) 2022年10月5日	6,065	—	13,682	—	—	0.0	99.2
	10月末	6,070	0.1	13,694	0.1	—	0.0	97.2
	(期 末) 2022年11月7日	6,082	0.3	13,753	0.5	—	0.0	97.3
第111期	(期 首) 2022年11月7日	6,057	—	13,753	—	—	0.0	97.3
	11月末	6,093	0.6	13,861	0.8	—	0.0	90.7
	(期 末) 2022年12月5日	6,097	0.7	13,879	0.9	—	0.0	94.5
第112期	(期 首) 2022年12月5日	6,072	—	13,879	—	—	0.0	94.5
	12月末	6,065	△0.1	13,910	0.2	—	0.0	93.5
	(期 末) 2023年1月5日	6,076	0.1	13,944	0.5	—	0.0	93.6
第113期	(期 首) 2023年1月5日	6,051	—	13,944	—	—	0.0	93.6
	1月末	6,154	1.7	14,267	2.3	—	0.0	96.3
	(期 末) 2023年2月6日	6,158	1.8	14,317	2.7	—	0.0	98.7
第114期	(期 首) 2023年2月6日	6,133	—	14,317	—	—	0.0	98.7
	2月末	6,112	△0.3	14,356	0.3	—	0.0	79.3
	(期 末) 2023年3月6日	6,103	△0.5	14,368	0.4	—	0.0	79.6

(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				
		円	円	%		%	%	%	%	百万円
第15作成期	85期（2020年10月5日）	6,991	60	△1.3	13,548	△0.7	—	0.0	97.6	2,867
	86期（2020年11月5日）	6,876	60	△0.8	13,443	△0.8	—	0.0	97.5	2,776
	87期（2020年12月7日）	6,927	60	1.6	13,728	2.1	—	0.0	97.5	2,718
	88期（2021年1月5日）	6,854	60	△0.2	13,738	0.1	—	0.0	98.3	2,629
	89期（2021年2月5日）	6,999	60	3.0	14,238	3.6	—	0.0	97.7	2,663
	90期（2021年3月5日）	7,106	60	2.4	14,625	2.7	—	0.0	97.6	2,671
第16作成期	91期（2021年4月5日）	7,212	60	2.3	15,013	2.7	—	0.0	97.3	2,682
	92期（2021年5月6日）	7,083	60	△1.0	14,908	△0.7	—	0.0	97.5	2,608
	93期（2021年6月7日）	7,068	60	0.6	15,026	0.8	—	0.0	98.1	2,564
	94期（2021年7月5日）	7,113	60	1.5	15,301	1.8	—	0.0	96.9	2,584
	95期（2021年8月5日）	6,945	60	△1.5	15,090	△1.4	—	0.0	98.8	2,467
	96期（2021年9月6日）	6,918	60	0.5	15,202	0.7	—	0.0	97.4	2,458
第17作成期	97期（2021年10月5日）	6,950	60	1.3	15,441	1.6	—	0.0	99.0	2,454
	98期（2021年11月5日）	7,059	60	2.4	15,883	2.9	—	0.0	98.5	2,399
	99期（2021年12月6日）	6,938	60	△0.9	15,762	△0.8	—	0.0	98.1	2,299
	100期（2022年1月5日）	7,093	60	3.1	16,313	3.5	—	0.0	97.8	2,319
	101期（2022年2月7日）	6,990	60	△0.6	16,223	△0.6	—	0.0	98.5	2,252
	102期（2022年3月7日）	6,863	60	△1.0	16,080	△0.9	—	0.0	98.1	2,160
第18作成期	103期（2022年4月5日）	7,254	60	6.6	17,209	7.0	—	0.0	97.5	2,232
	104期（2022年5月6日）	7,594	60	5.5	18,246	6.0	—	0.0	97.8	2,304
	105期（2022年6月6日）	7,413	60	△1.6	17,982	△1.4	—	0.0	97.3	2,198
	106期（2022年7月5日）	7,391	60	0.5	18,212	1.3	—	0.0	99.0	2,108
	107期（2022年8月5日）	7,286	60	△0.6	18,250	0.2	—	0.0	97.2	2,091
	108期（2022年9月5日）	7,671	60	6.1	19,400	6.3	—	0.0	98.2	2,161
第19作成期	109期（2022年10月5日）	7,678	60	0.9	19,633	1.2	—	0.0	97.0	2,151
	110期（2022年11月7日）	7,826	60	2.7	20,157	2.7	—	0.0	97.4	2,179
	111期（2022年12月5日）	7,210	60	△7.1	18,640	△7.5	—	0.0	97.6	1,931
	112期（2023年1月5日）	7,050	60	△1.4	18,370	△1.5	—	0.0	97.5	1,873
	113期（2023年2月6日）	7,161	60	2.4	18,895	2.9	—	0.0	97.3	1,891
	114期（2023年3月6日）	7,243	60	2.0	19,467	3.0	—	0.0	76.9	1,893

（注1）基準価額は1万円当たり、騰落率は分配金込みです。

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

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

参考指数に関して

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

## ■ 当作成期中の基準価額と市況等の推移

決算期	年 月 日	基 準 価 額		参 考 指 数		株 式 組 入 比 率	債 券 組 入 比 率	投 資 信 託 証 券 比 率
		騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率			
第109期	(期 首) 2022年9月5日	円 7,671	% —	19,400	% —	% —	% 0.0	% 98.2
	9月末	7,762	1.2	19,639	1.2	—	0.0	96.6
	(期 末) 2022年10月5日	7,738	0.9	19,633	1.2	—	0.0	97.0
第110期	(期 首) 2022年10月5日	7,678	—	19,633	—	—	0.0	97.0
	10月末	7,926	3.2	20,238	3.1	—	0.0	97.4
	(期 末) 2022年11月7日	7,886	2.7	20,157	2.7	—	0.0	97.4
第111期	(期 首) 2022年11月7日	7,826	—	20,157	—	—	0.0	97.4
	11月末	7,474	△4.5	19,187	△4.8	—	0.0	96.7
	(期 末) 2022年12月5日	7,270	△7.1	18,640	△7.5	—	0.0	97.6
第112期	(期 首) 2022年12月5日	7,210	—	18,640	—	—	0.0	97.6
	12月末	7,118	△1.3	18,400	△1.3	—	0.0	98.3
	(期 末) 2023年1月5日	7,110	△1.4	18,370	△1.5	—	0.0	97.5
第113期	(期 首) 2023年1月5日	7,050	—	18,370	—	—	0.0	97.5
	1月末	7,109	0.8	18,555	1.0	—	0.0	96.6
	(期 末) 2023年2月6日	7,221	2.4	18,895	2.9	—	0.0	97.3
第114期	(期 首) 2023年2月6日	7,161	—	18,895	—	—	0.0	97.3
	2月末	7,325	2.3	19,510	3.3	—	0.0	76.2
	(期 末) 2023年3月6日	7,303	2.0	19,467	3.0	—	0.0	76.9

(注1) 騰落率は期首比です。(期末基準価額は分配金を含みます。)

(注2) 基準価額は1万円当たりで表示しています。

(注3) 当ファンドの参考指数は、クレディ・スイス・レバレッジド・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
15期(2021年3月5日)	10,063	0	3.0	13,597	5.7	—	0.2	99.2	69
16期(2021年9月6日)	10,109	0	0.5	13,885	2.1	—	0.2	97.0	65
17期(2022年3月7日)	10,072	0	△0.4	14,025	1.0	—	0.2	98.5	57
18期(2022年9月5日)	9,650	0	△4.2	13,867	△1.1	—	0.2	104.2	49
19期(2023年3月6日)	9,682	0	0.3	14,368	3.6	—	0.2	78.1	46

(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) 2022年9月5日	円	%		%	%	%	%
	9,650	—	13,867	—	—	0.2	104.2
9月末	9,448	△2.1	13,606	△1.9	—	0.2	97.8
10月末	9,475	△1.8	13,694	△1.2	—	0.2	96.4
11月末	9,550	△1.0	13,861	△0.0	—	0.2	90.8
12月末	9,541	△1.1	13,910	0.3	—	0.2	93.1
2023年1月末	9,724	0.8	14,267	2.9	—	0.2	96.4
2月末	9,696	0.5	14,356	3.5	—	0.2	78.3
(期末) 2023年3月6日	9,682	0.3	14,368	3.6	—	0.2	78.1

(注1) 騰落率は期首比です。（期末基準価額は分配金を含みます。）

(注2) 基準価額は1万口当たりで表示しています。

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

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

## 【Dコース】

### ■最近5期の運用実績

決算期	基準価額			参考指数		株式組入比率	債券組入比率	投資信託証券比率	純資産総額
	(分配額)	税込分配金	期中騰落率	騰落率	騰落率				
	円	円	%		%	%	%	%	百万円
15期(2021年3月5日)	11,989	0	4.8	14,625	7.2	—	0.1	98.0	196
16期(2021年9月6日)	12,277	0	2.4	15,202	3.9	—	0.1	96.9	163
17期(2022年3月7日)	12,806	0	4.3	16,080	5.8	—	0.1	98.4	157
18期(2022年9月5日)	15,038	0	17.4	19,400	20.6	—	0.1	96.7	138
19期(2023年3月6日)	14,893	0	△1.0	19,467	0.3	—	0.1	77.3	126

(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) 2022年9月5日	円	%		%	%	%	%
	15,038	—	19,400	—	—	0.1	96.7
9月末	15,195	1.0	19,639	1.2	—	0.1	96.5
10月末	15,637	4.0	20,238	4.3	—	0.1	97.7
11月末	14,859	△1.2	19,187	△1.1	—	0.1	97.9
12月末	14,266	△5.1	18,400	△5.2	—	0.1	97.4
2023年1月末	14,368	△4.5	18,555	△4.4	—	0.1	97.3
2月末	14,939	△0.7	19,510	0.6	—	0.1	77.8
(期末) 2023年3月6日	14,893	△1.0	19,467	0.3	—	0.1	77.3

(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。

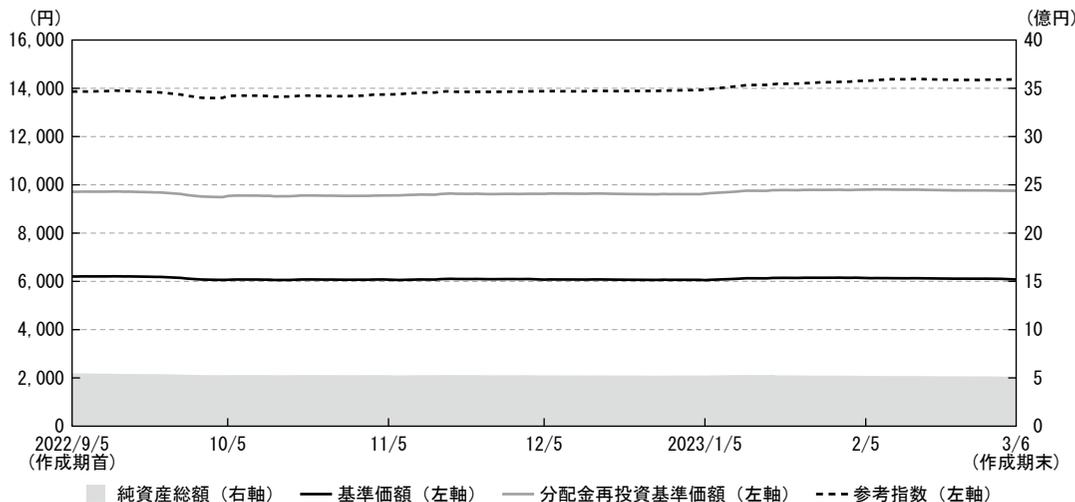
(注3) 当ファンドの参考指数は、クレディ・スイス・レバレッジド・ローン・インデックス（配当込み／円換算ベース／三菱UFJ銀行T M）です。当参考指数は、ファンドの設定日の前営業日を10,000として、委託会社が算出したものです。

(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（2022年9月6日から2023年3月6日まで）

#### Aコース



作成期首：6,203円

作成期末：6,078円（既払分配金150円）

騰落率：0.4%（分配金再投資ベース）

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

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

※分配金を再投資するかどうかについては、お客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益状況を示すものではありません。

### ■基準価額の主な変動要因

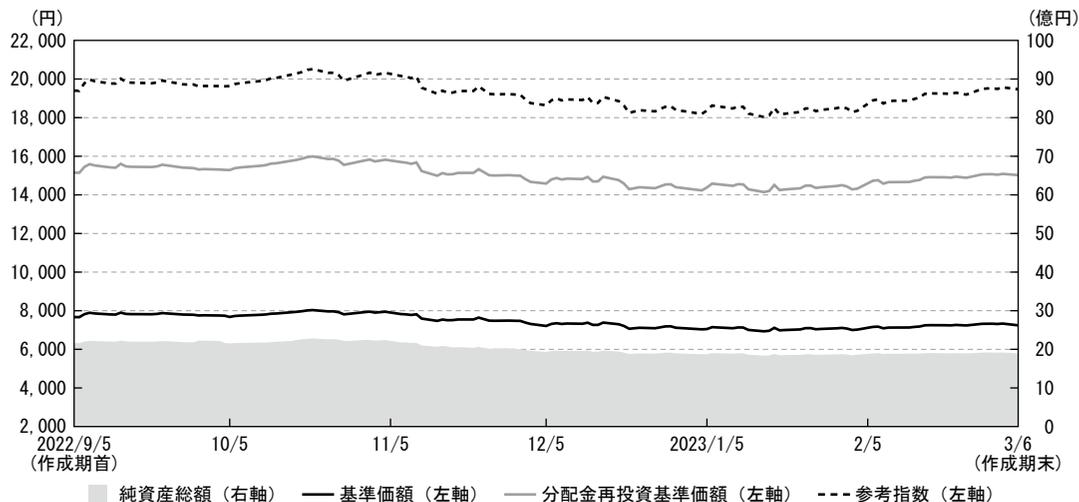
- ・投資先ファンドの保有する銀行貸付債権の安定的な利息収入がプラス寄与しました。
- ・銀行貸付債権の価格上昇がプラス寄与しました。
- ・為替ヘッジ取引にかかるコスト（ヘッジコスト）がマイナス寄与しました。

### ◆当作成期間の組入ファンドの騰落率

組入ファンド	騰落率
マニュアル・インベストメンツ・トラスト・フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA	3.5%
マニュアル・日本債券インデックス・マザーファンド	△2.2%

## ■基準価額等の推移（2022年9月6日から2023年3月6日まで）

### Bコース



作成期首：7,671円

作成期末：7,243円（既払分配金360円）

騰落率：△0.9%（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

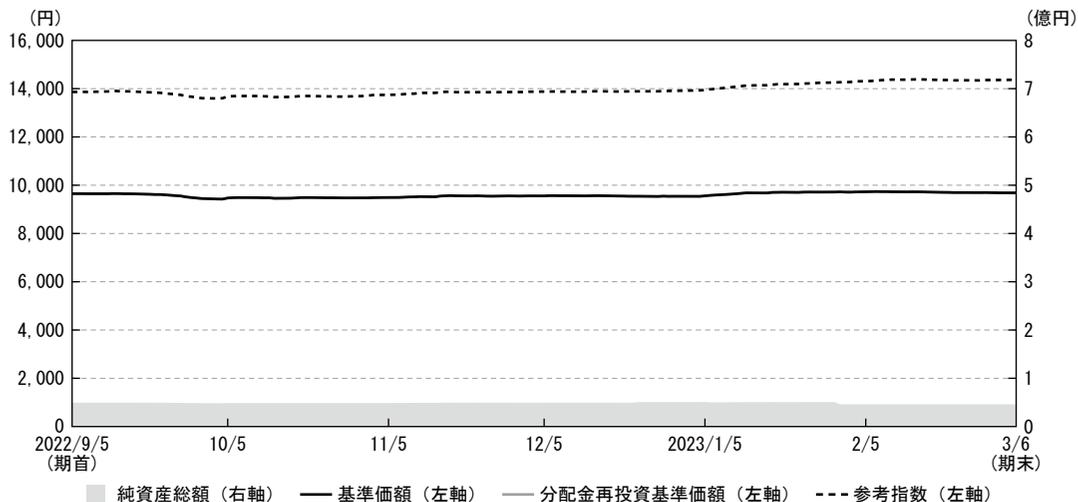
- ・投資先ファンドの保有する銀行貸付債権の安定的な利息収入がプラス寄与しました。
- ・銀行貸付債権の価格上昇がプラス寄与しました。
- ・円が米ドルに対し上昇（円高）したことがマイナス寄与しました。

### ◆当作成期間の組入ファンドの騰落率

組入ファンド	騰落率
マニュアル・インベストメンツ・トラスト・フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA	3.5%
マニュアル・日本債券インデックス・マザーファンド	△2.2%

## ■基準価額等の推移 (2022年9月6日から2023年3月6日まで)

### Cコース



期 首 : 9,650円

期 末 : 9,682円 (既払分配金0円)

騰落率 : 0.3% (分配金再投資ベース)

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

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

※分配金を再投資するかどうかについては、お客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益状況を示すものではありません。

### ■基準価額の主な変動要因

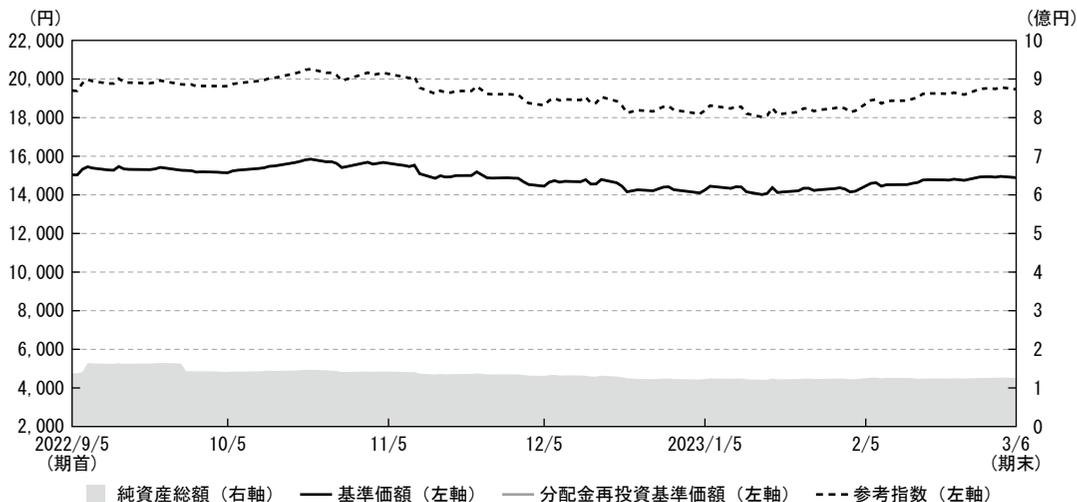
- ・投資先ファンドの保有する銀行貸付債権の安定的な利息収入がプラス寄与しました。
- ・銀行貸付債権の価格上昇がプラス寄与しました。
- ・為替ヘッジ取引にかかるコスト (ヘッジコスト) がマイナス寄与しました。

### ◆当期間の組入ファンドの騰落率

組入ファンド	騰落率
マンユライフ・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	3.5%
マンユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	△2.2%

## ■基準価額等の推移（2022年9月6日から2023年3月6日まで）

### Dコース



期首：15,038円

期末：14,893円（既払分配金0円）

騰落率：△1.0%（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TTM）です。当参考指数は、ファンドの設定日の前営業日を10,000として、委託会社が算出したものです。

※分配金を再投資するかどうかについては、お客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益状況を示すものではありません。

### ■基準価額の主な変動要因

- ・投資先ファンドの保有する銀行貸付債権の安定的な利息収入がプラス寄与しました。
- ・銀行貸付債権の価格上昇がプラス寄与しました。
- ・円が米ドルに対し上昇（円高）したことがマイナス寄与しました。

### ◆当期間の組入ファンドの騰落率

組入ファンド	騰落率
マニユライフ・インベストメンツ・トラスト・フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA	3.5%
マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	△2.2%

## ■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3.1%台で始まった後、インフレや堅調な経済指標などを受けて10月下旬にかけて4.2%台まで上昇しました。その後、インフレの鈍化や利上げによる景気後退懸念から1月中旬には3.3%台に低下しましたが、2月以降は堅調な雇用統計や米小売売上高、インフレの高止まりを示す指標などを受けて国債利回りは上昇し3.9%台で期を終えました。

銀行貸付債権は、安定的な利息収入などの一方、クレジットスプレッドの拡大などによる価格下落を背景にトータルリターンベースでは期を通じて下落しました。

[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上昇（円高）しました。期初に米ドルは140円台で始まり、米長期金利の上昇などを背景に10月下旬にかけて150円台まで円安米ドル高が進みました。その後、FRB（米連邦準備制度理事会）による利上げペースのスローダウン観測や日本銀行（中央銀行）の大規模金融緩和修正などが円買い要因となり1月中旬にかけて127円台まで円高米ドル安が進みました。その後、インフレ圧力の高止まりによるFRBの金融引き締め長期化観測などが米ドル買い要因となり、当期末には135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0.236%から作成期末0.506%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・トラストーフローティング・レート・インカム・ファンド クラスA」（以下「MIT-フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA」といいます。）（米ドル建て）の組入比率は高位に維持しました。

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-フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA

当該投資信託証券を通じて主に変動金利の米ドル建て銀行貸付債権に投資を行い、安定的なインカムゲイン（金利収入）の確保をめざし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-フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA	79.6%
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	20.3%
合計	100.0%

### Bコース

組入ファンド・資産	比率
MIT-フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA	76.9%
マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	0.0%
現預金等	23.1%
合計	100.0%

### Cコース

組入ファンド・資産	比率
MIT-フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA	78.1%
マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	0.2%
現預金等	21.7%
合計	100.0%

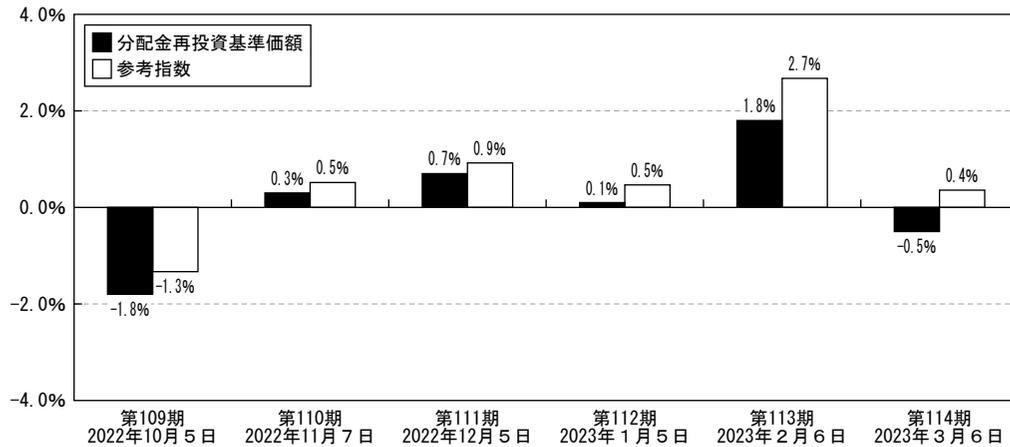
### Dコース

組入ファンド・資産	比率
MIT-フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA	77.3%
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	22.6%
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

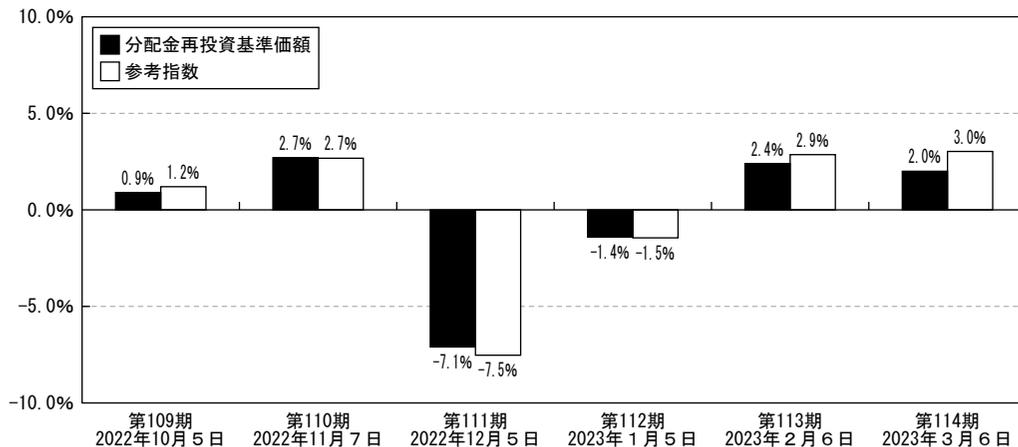
当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率の対比です。



※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

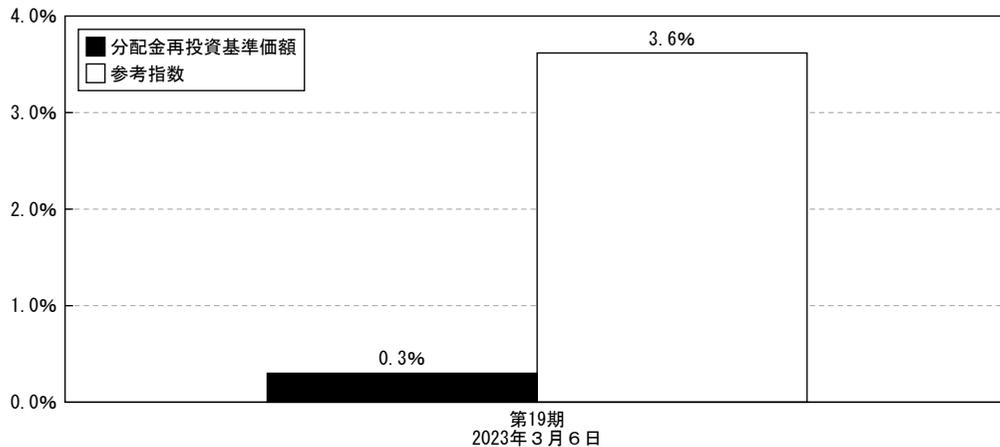
当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率の対比です。



※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

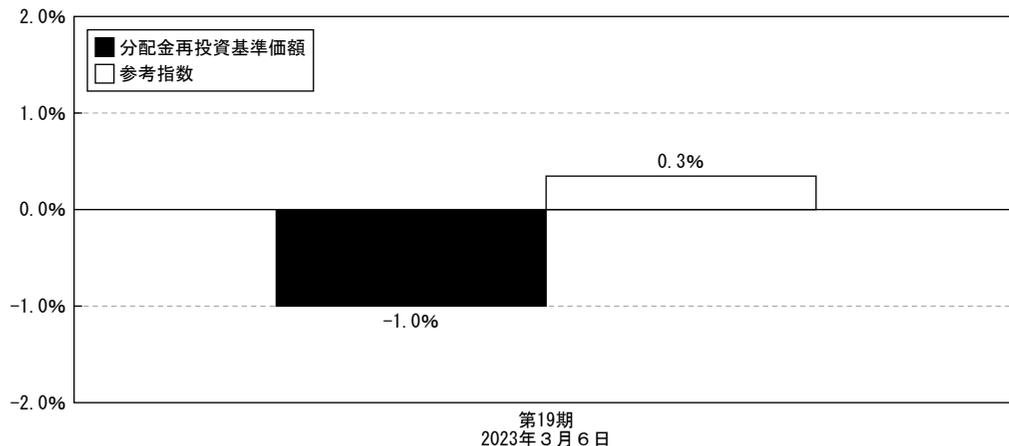
当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率の対比です。



※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。

### 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。

## ■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109期～第114期は25円、合計150円（1万口当たり、税引前）とさせていただきます。留保益の運用については、元本部分と同一の運用を行います。

#### [分配原資の内訳]

（1万口当たり、税引前）

	第109期	第110期	第111期	第112期	第113期	第114期
	自 2022年9月6日 至 2022年10月5日	自 2022年10月6日 至 2022年11月7日	自 2022年11月8日 至 2022年12月5日	自 2022年12月6日 至 2023年1月5日	自 2023年1月6日 至 2023年2月6日	自 2023年2月7日 至 2023年3月6日
当期分配金 (円)	25	25	25	25	25	25
(対基準価額比率) (%)	0.411	0.411	0.410	0.411	0.406	0.410
当期の収益 (円)	24	24	23	22	24	23
当期の収益以外 (円)	0	0	1	2	0	1
翌期繰越分配対象額 (円)	435	443	451	458	472	474

(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109期～第114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109期	第110期	第111期	第112期	第113期	第114期
	自 2022年9月6日 至 2022年10月5日	自 2022年10月6日 至 2022年11月7日	自 2022年11月8日 至 2022年12月5日	自 2022年12月6日 至 2023年1月5日	自 2023年1月6日 至 2023年2月6日	自 2023年2月7日 至 2023年3月6日
当期分配金 (円)	60	60	60	60	60	60
(対基準価額比率) (%)	0.775	0.761	0.825	0.844	0.831	0.822
当期の収益 (円)	23	33	41	39	45	36
当期の収益以外 (円)	36	26	18	20	14	23
翌期繰越分配対象額 (円)	708	699	682	662	648	625

(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19期	
		自 2022年 9月 6日 至 2023年 3月 6日	
当期分配金	(円)	—	
(対基準価額比率)	(%)	—	
当期の収益	(円)	—	
当期の収益以外	(円)	—	
翌期繰越分配対象額	(円)	5,237	

(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19期	
		自 2022年 9月 6日 至 2023年 3月 6日	
当期分配金	(円)	—	
(対基準価額比率)	(%)	—	
当期の収益	(円)	—	
当期の収益以外	(円)	—	
翌期繰越分配対象額	(円)	7,597	

(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

インフレは徐々に鎮静化に向かっており、利上げサイクルは終焉に近づきつつあると考えられ、年内の利下げを織り込む動きも見られます。ただし、FRBはインフレ抑制に粘り強く取り組む姿勢を示しており、堅調な経済指標の発表が続いていることなども考慮すると、政策金利が年内は高止まりし、利下げは来年にずれ込む可能性もあります。引き続き事態の進展には注視が必要と考えますが、相対的に高い利回りが期待できる銀行貸付債権の魅力は高いと考えます。デフォルト率は、今後緩やかに上昇すると想定されるものの、引き続き低水準で推移すると考えられます。銀行貸付債権への投資では、信用力の分析や慎重な個別銘柄の選択を行うことによって、信用力の悪化を回避することが重要になると考えます。当ファンドは、引き続き企業調査を重視し、投資魅力の高いと考えられる銀行貸付債権への投資を行ってまいります。

### マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド

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

## 【Aコース】

### ■ 1万円当たりの費用明細

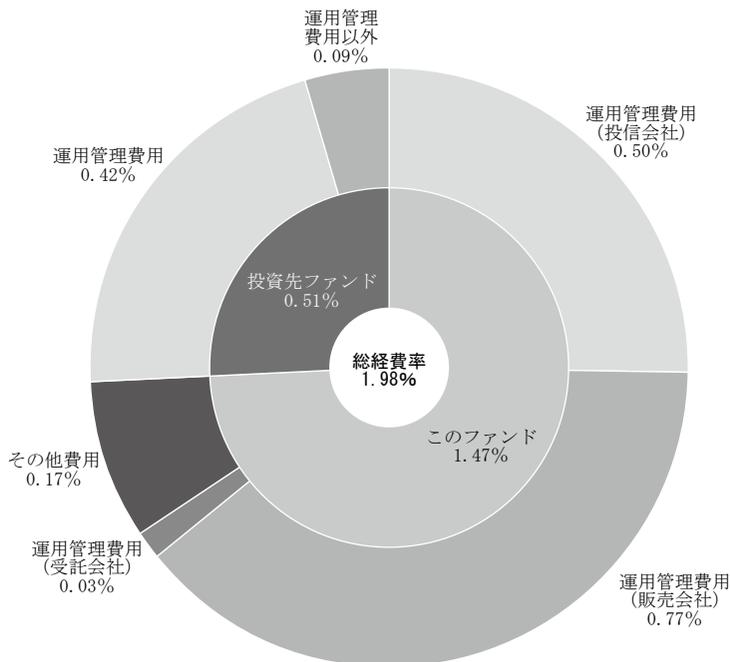
項目	第109期～第114期 (2022年9月6日～2023年3月6日)		項目の概要
	金額	比率	
	平均基準価額	6,095円	
(a) 信託報酬 （投信会社） （販売会社） （受託会社）	39円 (15) (23) ( 1)	0.644% (0.247) (0.384) (0.014)	(a) 信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率 ・委託した資金の運用の対価 ・交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価 ・運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 募集手数料	—	—	
(c) 売買委託手数料	—	—	(c) 売買委託手数料＝作成期間の売買委託手数料÷作成期間の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(d) 有価証券取引税	—	—	(d) 有価証券取引税＝作成期間の有価証券取引税÷作成期間の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(e) その他費用 （保管費用） （監査費用） （印刷） （その他）	5 ( 0) ( 1) ( 3) ( 0)	0.083 (0.003) (0.023) (0.055) (0.002)	(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	44	0.727	

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

（参考情報）

■ 総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.98%です。



総経費率 (①+②+③)	1.98%
①このファンドの費用の比率	1.47%
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	0.09%

- \*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 (2022年9月6日から2023年3月6日まで)  
投資信託証券

決 算 期 銘 柄 名	第 109 期 ~ 第 114 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
	8,296	534	24,688	1,605

(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 (2022年9月6日から2023年3月6日まで)

期中の利害関係人との取引状況

当ファンド

当作成期中における利害関係人との取引等はありません。

マニユライフ・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

(2022年9月6日から2023年3月6日まで)

該当事項はありません。

■ 自社による当ファンドの設定・解約状況 (2022年9月6日から2023年3月6日まで)

該当事項はありません。

## ■組入資産の明細（2023年3月6日現在）

### (1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた外貨建ファンドの明細

決 算 期 銘 柄	口 数	第 19 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	46,380	千米ドル 3,001	千円 407,934	% 79.6
合 計	46,380	3,001	407,934	

(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18作成期末	第19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 106

(注1) マザーファンドの2023年3月6日現在の受益権総口数は7,687,540千口です。

(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（2023年3月6日現在）

該当事項はありません。

## ■投資信託財産の構成

(2023年3月6日現在)

項 目	第 19 作 成 期 末	
	評 価 額	比 率
投 資 信 託 受 益 証 券	千円 407,934	% 76.1
マネーライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	106	0.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	127,792	23.9
投 資 信 託 財 産 総 額	535,832	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（407,964千円）の投資信託財産総額（535,832千円）に対する比率は76.1%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=135.92円です。

## ■資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第109期末 2022年10月5日	第110期末 2022年11月7日	第111期末 2022年12月5日	第112期末 2023年1月5日	第113期末 2023年2月6日	第114期末 2023年3月6日
<b>(A) 資 産</b>	<b>1,154,725,620円</b>	<b>1,087,599,759円</b>	<b>1,048,927,713円</b>	<b>1,008,250,991円</b>	<b>1,033,306,656円</b>	<b>1,158,981,832円</b>
コール・ローン等	8,391,023	12,360,176	48,964,119	14,566,044	15,714,278	125,248,948
投資信託受益証券(評価額)	524,170,056	511,202,845	496,973,004	490,695,957	513,186,692	407,934,710
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)	108,066	106,905	107,124	105,524	105,816	106,164
未 収 入 金	622,056,475	563,929,833	502,883,466	502,883,466	504,299,870	625,692,010
<b>(B) 負 債</b>	<b>626,241,737</b>	<b>562,050,758</b>	<b>523,181,132</b>	<b>483,918,208</b>	<b>513,369,608</b>	<b>646,718,671</b>
未 払 金	623,414,393	557,334,066	519,895,029	481,103,554	508,261,860	642,624,186
未払収益分配金	2,178,528	2,169,356	2,164,736	2,166,445	2,119,295	2,107,025
未払解約金	7,915	1,853,663	533,316	8	2,318,514	1,405,785
未払信託報酬	572,178	618,219	523,805	576,693	596,334	513,125
その他未払費用	68,723	75,454	64,246	71,508	73,605	68,550
<b>(C) 純資産総額(A-B)</b>	<b>528,483,883</b>	<b>525,549,001</b>	<b>525,746,581</b>	<b>524,332,783</b>	<b>519,937,048</b>	<b>512,263,161</b>
元 本	871,411,379	867,742,460	865,894,438	866,578,209	847,718,315	842,810,220
次期繰越損益金	△ 342,927,496	△ 342,193,459	△ 340,147,857	△ 342,245,426	△ 327,781,267	△ 330,547,059
<b>(D) 受 益 権 総 口 数</b>	<b>871,411,379口</b>	<b>867,742,460口</b>	<b>865,894,438口</b>	<b>866,578,209口</b>	<b>847,718,315口</b>	<b>842,810,220口</b>
1万口当たり基準価額(C/D)	6.065円	6.057円	6.072円	6.051円	6.133円	6.078円

(注1) 当ファンドの第109期首元本額は880,984,589円、第109～114期中追加設定元本額は12,535,118円、第109～114期中一部解約元本額は50,709,487円です。

(注2) 1口当たり純資産額は、第109期0.6065円、第110期0.6057円、第111期0.6072円、第112期0.6051円、第113期0.6133円、第114期0.6078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109期末342,927,496円、第110期末342,193,459円、第111期末340,147,857円、第112期末342,245,426円、第113期末327,781,267円、第114期末330,547,059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109期	第110期	第111期	第112期	第113期	第114期
	自 2022年9月6日 至 2022年10月5日	自 2022年10月6日 至 2022年11月7日	自 2022年11月8日 至 2022年12月5日	自 2022年12月6日 至 2023年1月5日	自 2023年1月6日 至 2023年2月6日	自 2023年2月7日 至 2023年3月6日
(A) 配 当 等 収 益	3,675,438円	3,573,511円	3,306,102円	3,420,657円	3,574,214円	2,809,734円
受 取 配 当 金	3,675,903	3,583,665	3,306,103	3,420,737	3,575,821	2,807,782
受 取 利 息	△ 465	△ 10,154	△ 1	△ 80	△ 1,607	1,952
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 12,881,320	△ 1,425,455	758,461	△ 2,433,989	6,207,585	△ 4,790,365
売 買 益	53,136,133	22,634,773	52,962,258	7,264,655	32,308,085	14,121,543
売 買 損	△ 66,017,453	△ 24,060,228	△ 52,203,797	△ 9,698,644	△ 26,100,500	△ 18,911,908
(C) 信 託 報 酬 等	△ 644,331	△ 693,549	△ 591,477	△ 651,388	△ 672,936	△ 581,388
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	△ 9,850,213	1,454,507	3,473,086	335,280	9,108,863	△ 2,562,019
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 215,885,784	△ 226,667,453	△ 226,225,218	△ 223,871,155	△ 220,175,517	△ 211,372,812
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 115,012,971	△ 114,811,157	△ 115,230,989	△ 116,543,106	△ 114,595,318	△ 114,505,203
(配 当 等 相 当 額)	( 61,781)	( 37,838)	( 110,143)	( 202,344)	( 70,654)	( 95,065)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 115,074,752)	(△ 114,848,995)	(△ 115,341,132)	(△ 116,745,450)	(△ 114,665,972)	(△ 114,600,268)
(G) 計 (D+E+F)	△ 340,748,968	△ 340,024,103	△ 337,983,121	△ 340,078,981	△ 325,661,972	△ 328,440,034
(H) 収 益 分 配 金	△ 2,178,528	△ 2,169,356	△ 2,164,736	△ 2,166,445	△ 2,119,295	△ 2,107,025
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	△ 342,927,496	△ 342,193,459	△ 340,147,857	△ 342,245,426	△ 327,781,267	△ 330,547,059
追 加 信 託 差 損 益 金	△ 115,073,970	△ 114,848,470	△ 115,340,958	△ 116,745,019	△ 114,665,678	△ 114,599,598
(配 当 等 相 当 額)	( 782)	( 525)	( 174)	( 431)	( 294)	( 670)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 115,074,752)	(△ 114,848,995)	(△ 115,341,132)	(△ 116,745,450)	(△ 114,665,972)	(△ 114,600,268)
分 配 準 備 積 立 金	37,924,746	38,481,224	39,067,254	39,714,441	40,079,265	39,976,918
繰 越 損 益 金	△ 265,778,272	△ 265,826,213	△ 263,874,153	△ 265,214,848	△ 253,194,854	△ 255,924,379

(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109期 計算期間末における費用控除後の配当等収益(3,031,196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(61,781円)および分配準備積立金(37,011,079円)より分配対象収益は40,104,056円(10,000口当たり460円)であり、うち2,178,528円(10,000口当たり25円)を分配金額としております。

第110期 計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,880,062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(37,838円)および分配準備積立金(37,733,205円)より分配対象収益は40,651,105円(10,000口当たり468円)であり、うち2,169,356円(10,000口当たり25円)を分配金額としております。

第111期 計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,825,080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(110,143円)および分配準備積立金(38,296,941円)より分配対象収益は41,232,164円(10,000口当たり476円)であり、うち2,164,736円(10,000口当たり25円)を分配金額としております。

第112期 計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,769,370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(202,344円)および分配準備積立金(38,909,603円)より分配対象収益は41,881,317円(10,000口当たり483円)であり、うち2,166,445円(10,000口当たり25円)を分配金額としております。

第113期 計算期間末における費用控除後の配当等収益(3,328,426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(70,654円)および分配準備積立金(38,799,774円)より分配対象収益は42,198,854円(10,000口当たり497円)であり、うち2,119,295円(10,000口当たり25円)を分配金額としております。

第114期 計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,228,435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(95,065円)および分配準備積立金(39,761,113円)より分配対象収益は42,084,613円(10,000口当たり499円)であり、うち2,107,025円(10,000口当たり25円)を分配金額としております。

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

## ■分配金のお知らせ

決算期	第109期	第110期	第111期	第112期	第113期	第114期
1万口当たり分配金	25円	25円	25円	25円	25円	25円

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

### <課税上の取り扱い>

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

※税法が改正された場合等は、上記内容が変更になる場合があります。

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

## お知らせ

### ◆約款変更

該当事項はありません。

### ◆運用体制の変更

該当事項はありません。

## 【Bコース】

### ■ 1万円当たりの費用明細

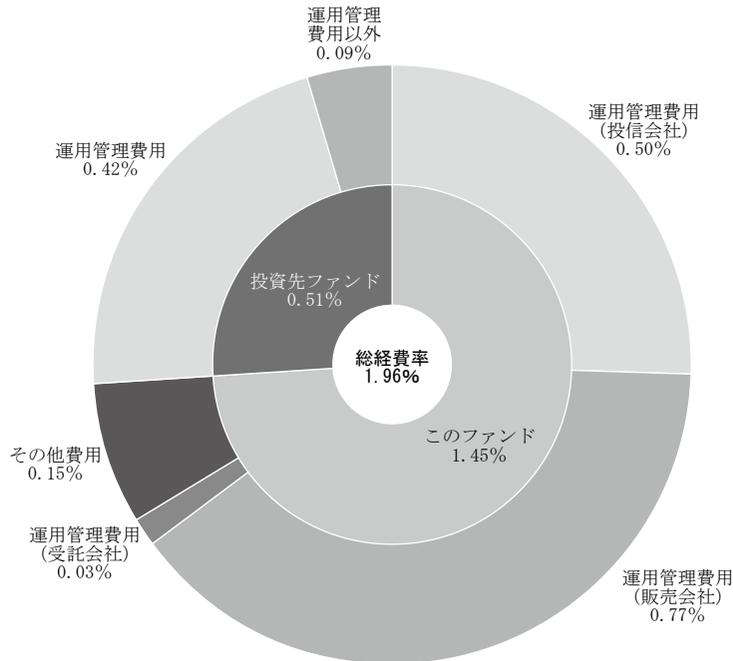
項目	第109期～第114期 (2022年9月6日～2023年3月6日)		項目の概要
	金額	比率	
	平均基準価額	7,452円	
(a) 信託報酬 （投信会社） （販売会社） （受託会社）	48円 (18) (29) ( 1)	0.644% (0.247) (0.384) (0.014)	(a) 信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率 ・委託した資金の運用の対価 ・交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価 ・運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 募集手数料	—	—	
(c) 売買委託手数料	—	—	(c) 売買委託手数料＝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）	6 ( 0) ( 1) ( 4) ( 0)	0.077 (0.002) (0.020) (0.054) (0.002)	(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	54	0.721	

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

（参考情報）

■ 総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.96%です。



総経費率 (①+②+③)	1.96%
①このファンドの費用の比率	1.45%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.42%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.09%

- \*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（2022年9月6日から2023年3月6日まで）  
投資信託証券

決 算 期 銘 柄 名	第 109 期 ～ 第 114 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
	15,494	991	82,041	5,312

（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（2022年9月6日から2023年3月6日まで）  
期中の利害関係人との取引状況

当ファンド

当作成期中における利害関係人との取引等はありません。

マネーライフ・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  
（2022年9月6日から2023年3月6日まで）

該当事項はありません。

■自社による当ファンドの設定・解約状況（2022年9月6日から2023年3月6日まで）  
該当事項はありません。

## ■組入資産の明細（2023年3月6日現在）

### (1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた外貨建ファンドの明細

決 算 期		第 19 作 成 期 末			
銘 柄	口 数	評 価 額		組 入 比 率	
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
(ケイマン諸島)		千米ドル	千円	%	
MIT-フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA	165,527	10,711	1,455,879	76.9	
合 計	165,527	10,711	1,455,879		

(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18作成期末	第19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 106

(注1) マザーファンドの2023年3月6日現在の受益権総口数は7,687,540千口です。

(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（2023年3月6日現在）

該当事項はありません。

## ■投資信託財産の構成

(2023年3月6日現在)

項 目	第 19 作 成 期 末	
	評 価 額	比 率
投 資 信 託 受 益 証 券	千円 1,455,879	% 76.0
マネーライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	106	0.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	458,991	24.0
投 資 信 託 財 産 総 額	1,914,976	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（1,455,932千円）の投資信託財産総額（1,914,976千円）に対する比率は76.0%です。

(注3) 外貨建資産は、当作成期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、当作成期末における邦貨換算レートは、1米ドル=135.92円です。

## ■資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第109期末 2022年10月 5 日	第110期末 2022年11月 7 日	第111期末 2022年12月 5 日	第112期末 2023年 1 月 5 日	第113期末 2023年 2 月 6 日	第114期末 2023年 3 月 6 日
<b>(A) 資 産</b>	<b>2,278,530,829円</b>	<b>2,281,430,259円</b>	<b>1,956,109,966円</b>	<b>1,931,578,895円</b>	<b>1,919,325,243円</b>	<b>1,914,976,239円</b>
コール・ローン等	85,656,513	57,889,123	71,252,243	35,819,389	77,917,840	458,990,525
投資信託受益証券(評価額)	2,087,681,831	2,123,077,927	1,884,750,599	1,825,922,969	1,841,301,587	1,455,879,550
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)	108,066	106,905	107,124	105,524	105,816	106,164
未 収 入 金	105,084,419	100,356,304	—	69,731,013	—	—
<b>(B) 負 債</b>	<b>126,668,529</b>	<b>102,161,761</b>	<b>24,801,054</b>	<b>58,321,205</b>	<b>27,743,105</b>	<b>21,928,413</b>
未 払 金	52,392,849	49,982,278	—	34,999,636	—	—
未払収益分配金	16,816,278	16,708,228	16,071,766	15,942,808	15,849,281	15,682,021
未払解約金	54,867,516	32,600,168	6,455,118	5,008,632	9,510,771	4,114,098
未払信託報酬	2,340,817	2,593,249	2,039,790	2,112,572	2,117,089	1,883,421
その他未払費用	251,069	277,838	234,380	257,557	265,964	248,873
<b>(C) 純資産総額(A－B)</b>	<b>2,151,862,300</b>	<b>2,179,268,498</b>	<b>1,931,308,912</b>	<b>1,873,257,690</b>	<b>1,891,582,138</b>	<b>1,893,047,826</b>
元 本	2,802,713,067	2,784,704,808	2,678,627,827	2,657,134,722	2,641,546,975	2,613,670,291
次期繰越損益金	△ 650,850,767	△ 605,436,310	△ 747,318,915	△ 783,877,032	△ 749,964,837	△ 720,622,465
<b>(D) 受 益 権 総 口 数</b>	<b>2,802,713,067口</b>	<b>2,784,704,808口</b>	<b>2,678,627,827口</b>	<b>2,657,134,722口</b>	<b>2,641,546,975口</b>	<b>2,613,670,291口</b>
1万口当たり基準価額(C/D)	7,678円	7,826円	7,210円	7,050円	7,161円	7,243円

(注1) 当ファンドの第109期首元本額は2,818,262,421円、第109～114期中追加設定元本額は394,274,735円、第109～114期中一部解約元本額は598,866,865円です。

(注2) 1口当たり純資産額は、第109期0.7678円、第110期0.7826円、第111期0.7210円、第112期0.7050円、第113期0.7161円、第114期0.7243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109期末650,850,767円、第110期末605,436,310円、第111期末747,318,915円、第112期末783,877,032円、第113期末749,964,837円、第114期末720,622,465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109期	第110期	第111期	第112期	第113期	第114期
	自 2022年9月6日 至 2022年10月5日	自 2022年10月6日 至 2022年11月7日	自 2022年11月8日 至 2022年12月5日	自 2022年12月6日 至 2023年1月5日	自 2023年1月6日 至 2023年2月6日	自 2023年2月7日 至 2023年3月6日
(A) 配 当 等 収 益	14,608,682円	14,845,033円	13,326,969円	12,939,296円	12,772,779円	10,013,707円
受 取 配 当 金	14,598,559	15,233,795	13,435,010	12,973,013	12,782,336	10,021,779
受 取 利 息	10,123	△ 388,762	△ 108,041	△ 33,717	△ 9,557	△ 8,072
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	5,022,624	43,530,485	△158,779,552	△ 37,234,878	34,718,143	29,045,386
売 買 益	53,547,152	43,938,373	12,403,600	△ 307,035	35,446,650	41,150,874
売 買 損	△ 48,524,528	△ 407,888	△171,183,152	△ 36,927,843	△ 728,507	△ 12,105,488
(C) 信 託 報 酬 等	△ 2,598,083	△ 2,869,437	△ 2,276,449	△ 2,375,853	△ 2,392,167	△ 2,137,548
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	17,033,223	55,506,081	△147,729,032	△ 26,671,435	45,098,755	36,921,545
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△114,348,313	△ 99,432,971	△ 50,143,517	△206,349,621	△241,031,934	△204,497,577
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△536,719,399	△544,801,192	△533,374,600	△534,913,168	△538,182,377	△537,364,412
(配 当 等 相 当 額)	( 10,108,459)	( 7,335,791)	( 3,410,193)	( 2,125,418)	( 3,142,169)	( 1,554,293)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△546,827,858)	(△552,136,983)	(△536,784,793)	(△537,038,586)	(△541,324,546)	(△538,918,705)
(G) 計 (D+E+F)	△634,034,489	△588,728,082	△731,247,149	△767,934,224	△734,115,556	△704,940,444
(H) 収 益 分 配 金	△ 16,816,278	△ 16,708,228	△ 16,071,766	△ 15,942,808	△ 15,849,281	△ 15,682,021
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	△650,850,767	△605,436,310	△747,318,915	△783,877,032	△749,964,837	△720,622,465
追 加 信 託 差 損 益 金	△546,825,982	△552,136,104	△536,784,493	△537,036,219	△541,323,176	△538,916,932
(配 当 等 相 当 額)	( 1,877)	( 880)	( 300)	( 2,367)	( 1,370)	( 1,773)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△546,827,859)	(△552,136,984)	(△536,784,793)	(△537,038,586)	(△541,324,546)	(△538,918,705)
分 配 準 備 積 立 金	198,527,362	194,914,363	182,710,086	175,945,027	171,348,953	163,402,108
繰 越 損 益 金	△302,552,147	△248,214,569	△393,244,508	△422,785,840	△379,990,614	△345,107,641

(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109期 計算期間末における費用控除後の配当等収益（12,675,278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（10,108,460円）および分配準備積立金（192,561,779円）より分配対象収益は215,345,517円（10,000口当たり768円）であり、うち16,816,278円（10,000口当たり60円）を分配金額としております。

第110期 計算期間末における費用控除後の配当等収益（14,115,435円）、費用控除後の有価証券等損益額（0円）、信託約款に規定する収益調整金（7,335,792円）および分配準備積立金（190,172,244円）より分配対象収益は211,623,471円（10,000口当たり759円）であり、うち16,708,228円（10,000口当たり60円）を分配金額としております。

第111期 計算期間末における費用控除後の配当等収益（11,050,605円）、費用控除後の有価証券等損益額（0円）、信託約款に規定する収益調整金（3,410,193円）および分配準備積立金（184,321,354円）より分配対象収益は198,782,152円（10,000口当たり742円）であり、うち16,071,766円（10,000口当たり60円）を分配金額としております。

第112期 計算期間末における費用控除後の配当等収益（10,563,543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（2,125,418円）および分配準備積立金（179,201,241円）より分配対象収益は191,890,202円（10,000口当たり722円）であり、うち15,942,808円（10,000口当たり60円）を分配金額としております。

第113期 計算期間末における費用控除後の配当等収益（12,129,389円）、費用控除後の有価証券等損益額（0円）、信託約款に規定する収益調整金（3,142,169円）および分配準備積立金（171,928,046円）より分配対象収益は187,199,604円（10,000口当たり708円）であり、うち15,849,281円（10,000口当たり60円）を分配金額としております。

第114期 計算期間末における費用控除後の配当等収益（9,465,729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（1,554,293円）および分配準備積立金（168,065,880円）より分配対象収益は179,085,902円（10,000口当たり685円）であり、うち15,682,021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109期	第110期	第111期	第112期	第113期	第114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】

### ■ 1万円当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2022年9月6日～2023年3月6日)		
	金額	比率	
平均基準価額	9,572円	—	期中の平均基準価額（月末値の平均値）です。
(a) 信託報酬	62円	0.644%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（投信会社）	(24)	(0.247)	・委託した資金の運用の対価
（販売会社）	(37)	(0.384)	・交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受託会社）	(1)	(0.014)	・運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 募集手数料	—	—	
(c) 売買委託手数料	—	—	(c) 売買委託手数料＝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	14	0.148	(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）	(4)	(0.043)	・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）	(10)	(0.103)	・監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（その他）	(0)	(0.003)	・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	76	0.792	

\* 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。

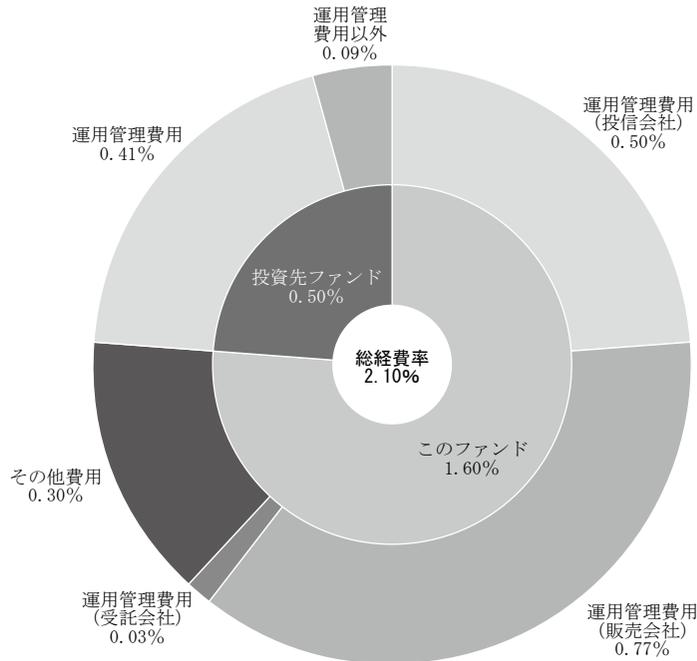
\* 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

\* 各比率は1万円当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

（参考情報）

■総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は2.10%です。



総経費率（①+②+③）	2.10%
①このファンドの費用の比率	1.60%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.41%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.09%

- \*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 (2022年9月6日から2023年3月6日まで)**  
**投資信託証券**

銘 柄 名	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外国 (ケイマン諸島) MIT-フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA	口 1,053	千米ドル 67	口 2,599	千米ドル 169

(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 (2022年9月6日から2023年3月6日まで)**

**期中の利害関係人との取引状況**

**当ファンド**

当期中における利害関係人との取引等はありません。

**マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド**

当期中における利害関係人との取引等はありません。

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

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

(2022年9月6日から2023年3月6日まで)

該当事項はありません。

**■ 自社による当ファンドの設定・解約状況 (2022年9月6日から2023年3月6日まで)**

該当事項はありません。

## ■組入資産の明細（2023年3月6日現在）

### (1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた外貨建ファンドの明細

決 算 期 銘 柄	当 期 末			組 入 比 率
	口 数	評 価 額		
		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	口 4,083	千米ドル 264	千円 35,914	% 78.1
合 計	4,083	264	35,914	

(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 106

(注1) マザーファンドの2023年3月6日現在の受益権総口数は7,687,540千口です。

(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（2023年3月6日現在）

該当事項はありません。

## ■投資信託財産の構成

(2023年3月6日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投 資 信 託 受 益 証 券	千円 35,914	% 74.5
マニュアル・日本債券インデックス・マザーファンド	106	0.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	12,201	25.3
投 資 信 託 財 産 総 額	48,221	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（35,918千円）の投資信託財産総額（48,221千円）に対する比率は74.5%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=135.92円です。

## ■資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	当 期 末 2023年3月6日
(A) 資 産	110,184,011円
コール・ローン等	11,798,675
投資信託受益証券(評価額)	35,914,626
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)	106,164
未 収 入 金	62,364,546
(B) 負 債	64,181,916
未 払 金	63,816,619
未 払 信 託 報 酬	315,070
そ の 他 未 払 費 用	50,227
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	46,002,095
元 本	47,510,948
次 期 繰 越 損 益 金	△ 1,508,853
(D) 受 益 権 総 口 数	47,510,948口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,682円

- (注1) 当ファンドの期首元本額は51,222,629円、期中追加設定元本額は2,343,981円、期中一部解約元本額は6,055,662円です。  
(注2) 1口当たり純資産額は0.9682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1,508,853円です。

## ■損益の状況

項 目	当 期 自 2022年9月6日 至 2023年3月6日
(A) 配 当 等 収 益	1,725,505円
受 取 配 当 金	1,725,366
受 取 利 息	139
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 1,173,940
売 買 益	9,774,650
売 買 損	△10,948,590
(C) 信 託 報 酬 等	△ 386,752
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	164,813
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 2,004,132
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	330,466
(配 当 等 相 当 額)	( 6,554,458)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 6,223,992)
(G) 計 (D+E+F)	△ 1,508,853
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	△ 1,508,853
追 加 信 託 差 損 益 金	330,466
(配 当 等 相 当 額)	( 6,554,459)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 6,223,993)
分 配 準 備 積 立 金	18,330,990
繰 越 損 益 金	△20,170,309

- (注1) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。  
(注2) 損益の状況の中で(C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。  
(注3) 損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。  
(注4) 収益分配金の計算過程は以下の通りです。  
計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,339,290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(6,554,459円)および分配準備積立金(16,991,700円)より分配対象収益は24,885,449円(10,000口当たり5,237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
	(2022年9月6日～2023年3月6日)		
	金額	比率	
平均基準価額	14,877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）	96円 （ 37） （ 57） （ 2）	0.644% (0.247) (0.384) (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）	19 （ 3） （ 14） （ 1） （ 0）	0.124 (0.021) (0.091) (0.009) (0.003)	(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	115	0.768	

\* 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

\* 各項目毎に円未満は四捨五入してあります。

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

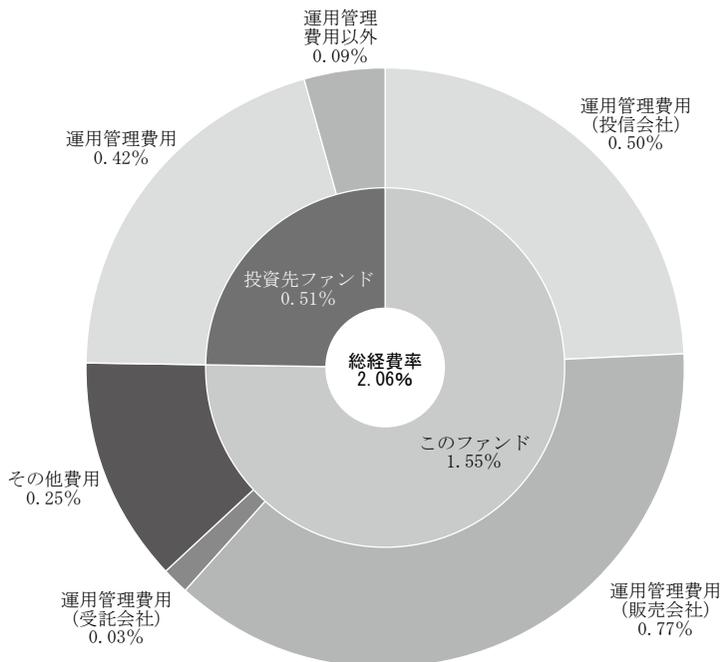
\* 各項目の費用は、このファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

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

（参考情報）

■総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は2.06%です。



総経費率（①+②+③）	2.06%
①このファンドの費用の比率	1.55%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.42%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.09%

- \*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（2022年9月6日から2023年3月6日まで）**  
**投資信託証券**

銘 柄 名	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外国（ケイマン諸島） MIT-フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA	口 3,013	千米ドル 195	口 6,533	千米ドル 422

（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（2022年9月6日から2023年3月6日まで）**

**期中の利害関係人との取引状況**

**当ファンド**

当期中における利害関係人との取引等はありません。

**マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド**

当期中における利害関係人との取引等はありません。

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

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

（2022年9月6日から2023年3月6日まで）

該当事項はありません。

**■自社による当ファンドの設定・解約状況（2022年9月6日から2023年3月6日まで）**

該当事項はありません。

## ■組入資産の明細（2023年3月6日現在）

### (1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた外貨建ファンドの明細

決 算 期 銘 柄	口 数	当 期 末		組 入 比 率
		評 価 額		
		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	11,101	千米ドル 718	千円 97,639	% 77.3
合 計	11,101	718	97,639	

(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 106

(注1) マザーファンドの2023年3月6日現在の受益権総口数は7,687,540千口です。

(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（2023年3月6日現在）

該当事項はありません。

## ■投資信託財産の構成

（2023年3月6日現在）

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投 資 信 託 受 益 証 券	千円 97,639	% 76.7
マネーライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	106	0.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	29,600	23.2
投 資 信 託 財 産 総 額	127,345	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（97,648千円）の投資信託財産総額（127,345千円）に対する比率は76.7%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=135.92円です。

## ■資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	当 期 末 2023年3月6日
(A) 資 産	127,345,923円
コール・ローン等	29,600,452
投資信託受益証券(評価額)	97,639,307
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)	106,164
(B) 負 債	1,031,861
未 払 解 約 金	25,105
未 払 信 託 報 酬	872,227
そ の 他 未 払 費 用	134,529
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	126,314,062
元 本	84,814,196
次 期 繰 越 損 益 金	41,499,866
(D) 受 益 権 総 口 数	84,814,196口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,893円

(注1) 当ファンドの期首元本額は91,939,492円、期中追加設定元本額は19,680,203円、期中一部解約元本額は26,805,499円です。

(注2) 1口当たり純資産額は1.4893円です。

## ■損益の状況

項 目	当 期 自 2022年9月6日 至 2023年3月6日
(A) 配 当 等 収 益	4,951,055円
受 取 配 当 金	4,951,055
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 5,583,891
売 買 益	323,886
売 買 損	△ 5,907,777
(C) 信 託 報 酬 等	△ 1,036,788
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△ 1,669,624
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	23,725,702
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	19,443,788
(配 当 等 相 当 額)	( 28,443,727)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 8,999,939)
(G) 計 (D+E+F)	41,499,866
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	41,499,866
追 加 信 託 差 損 益 金	19,443,788
(配 当 等 相 当 額)	( 28,443,729)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 8,999,941)
分 配 準 備 積 立 金	35,990,370
繰 越 損 益 金	△13,934,292

(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(3,914,804円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(28,443,729円)および分配準備積立金(32,075,566円)より分配対象収益は64,434,099円(10,000口当たり7,597円)ですが、当期に分配した金額はありません。

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

## お知らせ

### ◆約款変更

該当事項はありません。

### ◆運用体制の変更

該当事項はありません。

## <参考情報>

### ■組入投資信託証券の概要

#### MIT-フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA

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

### ■投資対象とする投資信託証券の資産の状況

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

#### MIT-フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA

##### ○ポートフォリオ特性

	特性値
平均クーポン	4.79%
直接利回り	5.26%
最終利回り	7.04%
平均デュレーション	-0.09年
残存年数	4.43年
平均格付け	BB

※現地の2022年6月最終営業日のデータです。

※特性値は純資産総額から現預金等を除いて計算しています。

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

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

##### ○組入上位10銘柄

（組入銘柄数96銘柄）

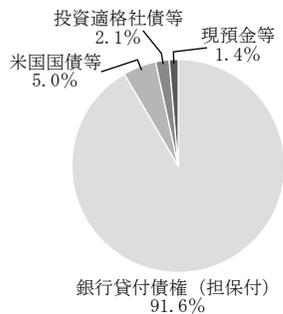
	銘柄名	組入比率
1	米国国債	5.04%
2	ゴールドマン・サックス・グループ	2.06%
3	アメリカン航空	1.88%
4	スカイマイルズ I P	1.70%
5	テンポ・アクイジション	1.68%
6	チェンジ・ヘルスケア・ホールディングス	1.64%
7	APコア・ホールディングス II	1.60%
8	US I インク・ニューヨーク	1.58%
9	セジック・クレイムス・マネジメント・サービス・インク	1.52%
10	エブリ・ホールディングス	1.48%

※現地の2022年6月最終営業日のデータです。

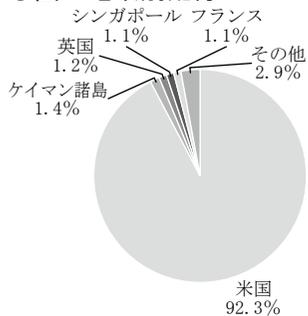
※組入比率は純資産総額に対する比率です。

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

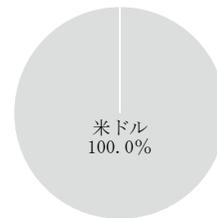
### ○資産別配分



### ○国・地域別配分



### ○通貨別配分



※現地の2022年6月最終営業日のデータです。

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

※各数値を四捨五入しているため、合計値が100%にならないことがあります。

当ファンドの運用報告書作成時点において、入手可能な直前計算期間の「M I T - 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

(2022年1月1日から2022年6月30日まで)  
(単位: 米ドル)

マネジメントフィー	48,312
カストディーフィー等	6,039
トラスティーフィー	5,952
監査報酬等	17,838
評価手数料	12,400
取引手数料	1,718
年間権限費用	1,337
会計及びその他専門家費用	3,396
その他費用	8,699
<b>費用合計</b>	<b>105,691</b>

■有価証券明細表 2022年6月30日

銀行貸付債権(米ドル建)

銘柄名	数量	評価額(米ドル)	投資比率(%)
AADVANTAGE LOYALTY IP TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +475BPS 24/03/2028	400,000.00	382,800	1.85
TEMPO ACQUISITION LLC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M+300BPS	364,360.03	360,261	1.74
SKYMILES IP LTD TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +375BPS 16/09/2027	350,000.00	347,156	1.68
CHANGE HEALTHCARE HOLDINGS B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA +250 BPS	348,007.62	339,307	1.64
AP CORE HOLDINGS II LLC TRANCHE B2 TERM LOAN USD-LIBOR-BBA	350,000.00	329,875	1.59
USI INC/NTY TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +300BPS 16/05/2024	341,087.44	327,231	1.58
SEDGWICK CMS INC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR BBA 3M + 325BPS	333,473.61	313,465	1.51
EVERI PAYMENTS INC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M+250BPS 30/06/2028	317,903.85	305,108	1.47
VICTORY CAPITAL HOLDINGS TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +225BPS	311,587.32	299,757	1.45
SELECT MEDICAL CORP TERM B TERM LOAN USD - LIBOR BBA 3M +250BPS	307,664.16	294,845	1.42
IBC CAPITAL LTD TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +375 BPS	322,827.84	294,278	1.42
J&J VENTURES GAMING LLC TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M + 400BPS 07/04/202	308,450.00	292,256	1.41
LCPR LOAN FINANCING LLC TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +375BPS 31/12/2049	300,000.00	289,875	1.40
EDELMAN FINANCIAL CENTER TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +375BPS	310,454.33	286,782	1.39
UBER TECHNOLOGIES INC TRANCHE B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +350BPS	295,519.42	284,345	1.37
CNT HOLDINGS I CORP TRANCHE B TERM LOAN USD-LIBOR BBA 3M +375BPS	297,000.00	283,078	1.37
ARCHES BUYER INC TERM LOAN USD-LIBO R-BBA 3M +325BPS 06/12/2027	303,800.00	281,964	1.36
VIRGIN MEDIA BRISTOL LLC TRANCHE N TERM LOAN USD-LIBOR-BBA +250 BPS	300,000.00	281,719	1.36
UNITED RENTALS NORTH AM TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +175BPS	281,411.85	281,613	1.36
JOURNEY PERSONAL CARE CO TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +425BPS 19/02/2028	347,375.00	270,953	1.31
ORGANON & CO TRANCHE B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +300BPS 08/04/2028	279,250.00	269,244	1.30
CAESARS RESORT COLLECTIO TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +350BPS	270,573.32	261,864	1.27
TTF HOLDINGS LLC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +425BPS 26/03/2028	266,122.28	259,137	1.25
JANE STREET GROUP LLC TRANCHE B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +275BPS	268,330.73	258,185	1.25
CORELOGIC INC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +350BPS 14/04/2028	298,500.00	255,591	1.23
MA FINANCECO LLC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +425BPS 05/06/2025	267,486.30	254,446	1.23
BWAY CORP TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +325BPS	268,595.62	253,420	1.22
PCI GAMING AUTHORITY TERM LOAN USD-LIBOR-BBA +250 BPS 31/05/2026	262,614.57	252,767	1.22
AUSTIN BIDCO INC TRANCHE B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +450BPS	267,009.75	252,658	1.22
QUORUM HEALTH CORP TERM LOAN USD-LIBOR BBA 3M +825BPS 29/04/2025	357,997.30	250,598	1.21
QUASAR INTERMEDIATE HOLD TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA3M 425	276,000.00	246,503	1.19
AVAYA INC TERM B-EXT TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M 425BPS 15/12/2027	327,646.34	244,916	1.18
GATES GLOBAL LLC TERM LOAN USD-LIBO R-BBA 3M +275BPS 31/03/2027	251,412.78	238,999	1.15
ALPHA 3 BV TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +250BPS 05/03/2028	248,125.00	238,975	1.15
JBS USA LUX SA TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +200BPS 01/05/2026	245,569.63	237,896	1.15
TRINSEO MATERIALS OPERATING TRANCHE B2 TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +250B	248,125.00	234,943	1.14
HERTZ CORP/THE TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M 350BPS 14/06/2028	248,125.00	234,478	1.13
PLAYTIKA HOLDING CORP TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +275BPS	247,002.52	233,232	1.13
WEST CORP TERM B1 TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M+350BPS	271,360.68	231,900	1.12
RADIATE HOLDCO LLC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA3M 325BPS 25/09/2026	249,375.00	231,451	1.12
CARNIVAL CORP TERM B TERM LOAN-LIBO R-BBA 3M +300BPS 30/06/2025	247,481.12	231,024	1.12
ALLIED UNIVERSAL HOLDCO LLC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +375BPS	248,750.00	229,057	1.11
GRAB HOLDINGS INC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +450BPS 29/01/2026	247,000.00	226,931	1.10
CSC HOLDINGS LLC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR BBA 3M+225BPS 15/01/2026	240,479.23	223,846	1.08
BAUSCH + LOMB CORP TRACHE B TERM LOAN USD-LIBOR BBA 3M+325BPS	240,000.00	223,450	1.08
ALTICE FRANCE SA TRANCHE B13 TERM LOAN USD-LIBOR-BBA +400 BPS	243,262.93	222,586	1.08
SOTHEBY'S TERM B TERM LOAN USD-LIBO R BBA 3M +450BPS 15/01/2027	226,102.41	217,153	1.05
GARDA WORLD SECURITY CORP TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M+425BPS	229,791.38	217,009	1.05
HUNTER DOUGLAS INC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M+ 350BPS 09/02/2029	250,000.00	216,094	1.04
CORNERSTONE BUILDING TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +325BPS	256,588.55	214,091	1.03
HILTON GRAND VAC BORROWER TERM B USD-LIBOR-BBA-3M +300BPS 20/05/2028	223,687.97	212,084	1.02
TRIDENT TPI HOLDINGS INC TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +400BPS 29/07/2028	222,787.29	209,420	1.01
ARCH COAL INC TERM LOAN TERM B USD-LIBOR-BBA-3M +500BPS 14/06/2026	289,530.45	200,228	0.97
MOZART BORROWER LP TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA +325BPS 30/09/2028	210,000.00	195,150	0.94
MAMBA PURCHASER INC TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M + 375BPS 29/09/202	200,000.00	190,375	0.92
CONSOLIDATED COMMUNICATIONS TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA-3M +350BPS	214,201.41	190,238	0.92
MATCH GROUP INC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M + 175BPS	200,000.00	188,559	0.91
APX GROUP INC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 33M+ 375BPS	198,625.94	188,074	0.91
WINDSTREAM SERVICES II TERM B-EXIT TERM LOAN USD-LIBOR BBA 3M+ 625BPS	200,000.00	188,000	0.91
PACTIV EVERGREEN GROUP TRANCHE B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M + 350BPS	199,000.02	186,115	0.90
CARNIVAL CORP TERM B TERM LOAN-LIBO R-BBA 3M +325BPS 08/10/2028	199,500.00	186,034	0.90
UNITED AIRLINES INC TRANCHE B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA +375BPS	198,000.00	184,239	0.89
CHARIOT BUYER LLC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA3M 350BPS 22/10/2028	199,500.00	181,296	0.88
ACRISURE LLC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +350BPS	196,043.14	180,482	0.87
NASCAR HOLDINGS INC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR BBA 3M +275BPS	186,234.05	180,371	0.87
CENTURYLINK INC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +225BPS	195,232.51	179,899	0.87
DIRECTV FINANCING LLC TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +500BPS 22/07/2027	191,000.00	176,641	0.85
RH TRANCHE B TERM LOAN-LIBOR-BBA 3M + 250BPS 15/10/2028	199,000.00	175,618	0.85
CLYDESDALE ACQUISITION TRACHE TERM LOAN USD-LIBOR BBA 3M +425BPS	180,000.00	168,525	0.81
TRANS UNION LLC TERM B6 TERM LOAN U SD-LIBOR-BBA3M 225 18/1/2028	173,693.55	166,312	0.80
GRIFOLS WORLDWIDE OPERAT TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M 200+	169,287.43	160,373	0.77
BELLA HOLDING CO LLC TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +375BPS 01/04/2028	149,250.00	140,015	0.68
US RENAL CARE INC TRANCHE B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +500BPS	199,000.00	138,803	0.67
HOYA MIDCO LLC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +325BPS 03/02/2029	141,853.90	137,776	0.67
SS&C TECHNOLOGIES INC TRACHE B7 TERM LOAN USD-LIBOR BBA 3M+225BPS	138,888.89	132,552	0.64
VERICAST CORP TERM LOAN USD-LIBOR -BBA 3M+775BPS 16/06/2026	147,562.50	116,205	0.56
PROJECT BOOST PURCHASER TRANCHE B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA +350BPS	107,190.00	100,558	0.49

銘柄名	数量	評価額(米ドル)	投資比率 (%)
SS&C TECHNOLOGIES INC TRACHE B6 TERM LOAN USD-LIBOR BBA 3M+225BPS	101,307.19	96,850	0.47
LIFE TIME INC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +175BPS	96,654.20	94,117	0.45
ASCEND LEARNING LLC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR BBA 3M +350BPS	99,750.00	92,518	0.45
SUNSHINE SOFTWARE MERGER TRANCHE B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M + 375BPS	100,000.00	89,750	0.43
SYNAPTICS INC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M 225 20/10/2028	66,665.00	64,915	0.31
STANDARD INDUSTRIES INC TRANCHE B TERM B TERM LOAN 250BPS 06/08/2028	63,525.00	61,540	0.30
HERTZ CORP/THE TERM C TEARM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M 350BPS 14/06/2028	50,000.00	47,188	0.23
DOTDASH MEREDITH INC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA3M 23/11/2028	48,755.00	46,317	0.22
KRATON POLYMERS US LLC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR BBA 3M +325BPS	35,000.00	33,425	0.16
TRIDENT TPI HOLDINGS INC TRANCHE DD TERM USD-LIBOR-BBA 3M+ 400BPS	31,678.04	29,777	0.14
CENGAGE LEARNING INC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M+ 475BPS	30,845.00	27,930	0.13
CANO HEALTH LLC TERM TERM LOAN USD-LIBOR-BBA3M +400BPS 23/11/2027	1,746.24	1,610	0.01
RAPTOR ACQUISITION CORP TRANCHE B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA +400BPS	1,250.00	1,183	0.01
有価証券 合計		18,650,174	90.12
その他資産		2,045,545	9.88
総資産総額		20,695,719	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14期

決算日 2023年2月15日

(計算期間：2022年2月16日から2023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				
10期 (2019年2月15日)	円	%		%	%	%	%	百万円
	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
13期 (2022年2月15日)	11,991	△1.1	12,010	△1.2	—	99.2	—	10,678
14期 (2023年2月15日)	11,587	△3.4	11,596	△3.4	—	99.2	—	8,986

(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、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が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。同社は、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) 2022年2月15日	円	%		%	%	%	%
	11,991	—	12,010	—	—	99.2	—
2月末	12,027	0.3	12,043	0.3	—	99.2	—
3月末	11,994	0.0	12,009	△0.0	—	99.0	—
4月末	11,964	△0.2	11,980	△0.2	—	99.5	—
5月末	11,947	△0.4	11,962	△0.4	—	99.3	—
6月末	11,841	△1.3	11,853	△1.3	—	99.2	—
7月末	11,919	△0.6	11,931	△0.7	—	98.9	—
8月末	11,890	△0.8	11,903	△0.9	—	99.2	—
9月末	11,767	△1.9	11,775	△2.0	—	99.4	—
10月末	11,756	△2.0	11,764	△2.0	—	99.1	—
11月末	11,702	△2.4	11,703	△2.6	—	98.9	—
12月末	11,544	△3.7	11,554	△3.8	—	99.1	—
2023年1月末	11,513	△4.0	11,522	△4.1	—	99.0	—
(期末) 2023年2月15日	11,587	△3.4	11,596	△3.4	—	99.2	—

(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。



## ■投資環境

10年国債利回りは、米国をはじめとしてインフレ長期化懸念や金融政策正常化シフトなどからグローバルに金利が上昇する中、日銀も追隨してハト派姿勢を後退させるとの思惑が強まったことなどから、2022年3月後半にかけてYCC（イールドカーブ・コントロール）政策の変動許容幅の上限である0.25%まで上昇しました。その後は、日銀が各種オペを通じて上昇を抑制する中、概ね横ばいで推移しました。12月以降は日銀の上限引き上げに伴い0.5%近辺まで上昇し、その後はボラティリティが高まる局面がありつつも2023年2月以降は0.5%近辺で概ね横ばいの展開となりました。こうした中、10年国債利回りは、期末には0.51%（2月15日）となり前期末（0.22%）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3.4%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3.4%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
	(2022年2月16日～2023年2月15日)		
	金額	比率	
平均基準価額	11,822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（2022年2月16日から2023年2月15日まで）

### 公社債

		買 付 額	売 付 額
国	国 債 証 券	千円 1,671,765	千円 2,588,477
	地 方 債 証 券	—	200,631
	特 殊 債 券	—	100,478 ( 27,188)
	内 社債券（投資法人債券を含む）	99,899	— ( 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（2022年2月16日から2023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（2023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	6,945,000 ( 270,000)	7,187,751 ( 302,094)	80.0 ( 3.4)	— (—)	59.4 ( 3.4)	17.2 ( —)	3.3 ( —)
地 方 債 証 券	600,000 ( 600,000)	611,565 ( 611,565)	6.8 ( 6.8)	— (—)	3.4 ( 3.4)	3.4 ( 3.4)	— ( —)
特 殊 債 証 券 (除 く 金 融 債)	498,866 ( 498,866)	500,280 ( 500,280)	5.6 ( 5.6)	— (—)	0.6 ( 0.6)	1.1 ( 1.1)	3.9 (3.9)
金 融 債 証 券	100,000 ( 100,000)	99,525 ( 99,525)	1.1 ( 1.1)	— (—)	— ( —)	1.1 ( 1.1)	— ( —)
普 通 社 債 証 券 (含 む 投 資 法 人 債 証 券)	500,000 ( 500,000)	515,573 ( 515,573)	5.7 ( 5.7)	— (—)	3.5 ( 3.5)	1.1 ( 1.1)	1.1 (1.1)
合 計	8,643,866 (1,968,866)	8,914,694 (2,029,038)	99.2 (22.6)	— (—)	66.9 (10.8)	24.0 ( 6.7)	8.3 (5.0)

(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428回利付国債（2年）			0.005	200,000	200,166	2023/9/1
第438回利付国債（2年）			0.005	100,000	100,130	2024/7/1
第1回利付国債（40年）			2.4	120,000	144,560	2048/3/20
第6回利付国債（40年）			1.9	50,000	55,059	2053/3/20
第7回利付国債（40年）			1.7	20,000	21,048	2054/3/20
第8回利付国債（40年）			1.4	20,000	19,545	2055/3/20
第9回利付国債（40年）			0.4	30,000	21,468	2056/3/20
第11回利付国債（40年）			0.8	50,000	40,555	2058/3/20
第13回利付国債（40年）			0.5	50,000	36,065	2060/3/20
第15回利付国債（40年）			1.0	50,000	41,879	2062/3/20
第339回利付国債（10年）			0.4	200,000	202,108	2025/6/20
第345回利付国債（10年）			0.1	200,000	200,190	2026/12/20
第346回利付国債（10年）			0.1	70,000	69,971	2027/3/20
第351回利付国債（10年）			0.1	280,000	277,785	2028/6/20
第356回利付国債（10年）			0.1	230,000	226,147	2029/9/20

決 算 銘 柄	期 名	当 期			末
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券		%	千円	千円	
第358回利付国債 (10年)		0.1	300,000	293,997	2030/3/20
第359回利付国債 (10年)		0.1	40,000	39,088	2030/6/20
第366回利付国債 (10年)		0.2	200,000	194,952	2032/3/20
第2回利付国債 (30年)		2.4	200,000	227,900	2030/2/20
第6回利付国債 (30年)		2.4	41,000	47,616	2031/11/20
第15回利付国債 (30年)		2.5	50,000	59,580	2034/6/20
第18回利付国債 (30年)		2.3	110,000	128,967	2035/3/20
第21回利付国債 (30年)		2.3	100,000	117,467	2035/12/20
第25回利付国債 (30年)		2.3	70,000	82,365	2036/12/20
第28回利付国債 (30年)		2.5	120,000	144,544	2038/3/20
第29回利付国債 (30年)		2.4	190,000	226,337	2038/9/20
第32回利付国債 (30年)		2.3	80,000	93,943	2040/3/20
第34回利付国債 (30年)		2.2	90,000	104,148	2041/3/20
第35回利付国債 (30年)		2.0	50,000	56,251	2041/9/20
第38回利付国債 (30年)		1.8	50,000	54,459	2043/3/20
第40回利付国債 (30年)		1.8	50,000	54,414	2043/9/20
第44回利付国債 (30年)		1.7	50,000	53,416	2044/9/20
第45回利付国債 (30年)		1.5	50,000	51,482	2044/12/20
第46回利付国債 (30年)		1.5	50,000	51,451	2045/3/20
第48回利付国債 (30年)		1.4	50,000	50,389	2045/9/20
第49回利付国債 (30年)		1.4	40,000	40,243	2045/12/20
第51回利付国債 (30年)		0.3	100,000	78,508	2046/6/20
第55回利付国債 (30年)		0.8	60,000	52,510	2047/6/20
第62回利付国債 (30年)		0.5	70,000	55,622	2049/3/20
第65回利付国債 (30年)		0.4	30,000	22,959	2049/12/20
第66回利付国債 (30年)		0.4	70,000	53,369	2050/3/20
第68回利付国債 (30年)		0.6	70,000	56,170	2050/9/20
第70回利付国債 (30年)		0.7	70,000	57,568	2051/3/20
第74回利付国債 (30年)		1.0	80,000	71,321	2052/3/20
第78回利付国債 (20年)		1.9	54,000	56,459	2025/6/20
第81回利付国債 (20年)		2.0	100,000	105,265	2025/9/20
第82回利付国債 (20年)		2.1	20,000	21,104	2025/9/20
第83回利付国債 (20年)		2.1	100,000	106,011	2025/12/20
第84回利付国債 (20年)		2.0	100,000	105,727	2025/12/20
第90回利付国債 (20年)		2.2	100,000	107,727	2026/9/20
第91回利付国債 (20年)		2.3	260,000	281,023	2026/9/20
第94回利付国債 (20年)		2.1	70,000	75,684	2027/3/20
第95回利付国債 (20年)		2.3	200,000	218,680	2027/6/20
第100回利付国債 (20年)		2.2	140,000	154,023	2028/3/20

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121回利付国債 (20年)	1.9	100,000	110,766	2030/9/20	
第124回利付国債 (20年)	2.0	80,000	89,323	2030/12/20	
第125回利付国債 (20年)	2.2	200,000	226,958	2031/3/20	
第127回利付国債 (20年)	1.9	100,000	111,098	2031/3/20	
第129回利付国債 (20年)	1.8	20,000	22,108	2031/6/20	
第133回利付国債 (20年)	1.8	80,000	88,880	2031/12/20	
第139回利付国債 (20年)	1.6	10,000	10,957	2032/6/20	
第141回利付国債 (20年)	1.7	100,000	110,478	2032/12/20	
第144回利付国債 (20年)	1.5	80,000	86,848	2033/3/20	
第145回利付国債 (20年)	1.7	50,000	55,273	2033/6/20	
第147回利付国債 (20年)	1.6	50,000	54,727	2033/12/20	
第148回利付国債 (20年)	1.5	220,000	238,352	2034/3/20	
第154回利付国債 (20年)	1.2	50,000	52,138	2035/9/20	
第157回利付国債 (20年)	0.2	80,000	72,939	2036/6/20	
第158回利付国債 (20年)	0.5	100,000	94,640	2036/9/20	
第164回利付国債 (20年)	0.5	50,000	46,297	2038/3/20	
第174回利付国債 (20年)	0.4	30,000	26,190	2040/9/20	
第175回利付国債 (20年)	0.5	70,000	61,979	2040/12/20	
第179回利付国債 (20年)	0.5	80,000	69,890	2041/12/20	
第182回利付国債 (20年)	1.1	50,000	48,476	2042/9/20	
小 計		6,945,000	7,187,751		
地方債証券					
第13回東京都公募公債	1.93	100,000	109,108	2042/3/19	
第792回東京都公募公債	0.05	200,000	194,910	2029/3/19	
平成28年度第2回静岡県公募公債	0.08	100,000	99,879	2026/3/19	
第161回共同発行市場公募地方債	0.06	100,000	99,649	2026/8/25	
第19回公営企業債券	2.37	100,000	108,019	2026/12/18	
小 計		600,000	611,565		
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	99,450	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	149,000	149,257	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	100,003	2023/3/20	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.67	19,146	19,886	2046/7/10	
第75回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.26	30,720	31,671	2048/8/10	
第50回東日本高速道路株式会社社債	0.08	100,000	100,012	2023/6/20	
小 計		498,866	500,280		
金融債券					
第377回信金中金債	0.04	100,000	99,525	2026/4/27	
小 計		100,000	99,525		

決 算 期 銘 柄 名	当 期			期 末	
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日	
普通社債券（含む投資法人債券）	%	千円	千円		
第389回中国電力株式会社社債	0.3	100,000	99,499	2026/4/24	
第81回三菱商事株式会社無担保社債	1.518	100,000	107,010	2032/6/25	
第81回三井不動産株式会社無担保社債	0.689	100,000	99,129	2032/7/14	
第45回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.321	100,000	109,874	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	100,061	2023/3/20	
小 計		500,000	515,573		
合 計		8,643,866	8,914,694		

(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（2023年2月15日現在）

該当事項はありません。

(2023年2月15日現在)

## ■投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 8,914,694	% 99.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	72,719	0.8
投 資 信 託 財 産 総 額	8,987,413	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 2023年2月15日
(A) 資 産	8,987,413,944円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	39,437,848
公 社 債(評価額)	8,914,694,799
未 収 利 息	31,765,341
前 払 費 用	1,515,956
(B) 負 債	870,206
未 払 解 約 金	867,849
そ の 他 未 払 費 用	2,357
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	8,986,543,738
元 本	7,756,030,494
次 期 繰 越 損 益 金	1,230,513,244
(D) 受 益 権 総 口 数	7,756,030,494口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,587円

(注1) 当親ファンドの期首元本額は8,905,980,044円、期中追加設定元本額は614,387,077円、期中一部解約元本額は1,764,336,627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)	2,763,370,796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)	4,262,690,244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)	613,937,038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)	115,220,319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 2022年2月16日 至 2023年2月15日
(A) 配 当 等 収 益	103,128,499円
受 取 利 息	103,128,499
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 433,085,641
売 買 益	1,129,600
売 買 損	△ 434,215,241
(C) 信 託 報 酬 等	△ 70,945
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△ 330,028,087
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	1,772,824,266
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	111,152,560
(G) 解 約 差 損 益 金	△ 323,435,495
(H) 計 (D+E+F+G)	1,230,513,244
次 期 繰 越 損 益 金(H)	1,230,513,244

(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。

マニュライフ・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
マニュライフ・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
マニュライフ・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
マニュライフ・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
マニュライフ・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
マニュライフ・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
マニュライフ・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
マニュライフ・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1,1587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

ホームページアドレスの変更に伴い、信託約款に所要の変更を行いました。

(2022年6月24日)

### ◆運用体制の変更

該当事項はありません。