

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2023年7月31日までです。
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。

償還運用報告書（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115期 (決算日 2023年4月5日)
 第116期 (決算日 2023年5月8日)
 第117期 (決算日 2023年6月5日)
 第118期 (決算日 2023年7月5日)
 第119期 (償還日 2023年7月31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20期 (償還日 2023年7月31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) / 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、2023年7月31日をもって繰上償還となりました。
 ここに、運用経過と償還内容をご報告申し上げますとともに、ご愛顧に対し厚くお礼申し上げます。

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				
		円	円	%		%	%	%	%	百万円
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
第20作成期	115期（2023年4月5日）	6,033	25	△0.3	14,388	0.1	—	0.0	61.5	498
	116期（2023年5月8日）	6,009	25	0.0	14,465	0.5	—	0.0	76.5	413
	117期（2023年6月5日）	5,957	25	△0.4	14,500	0.2	—	0.0	41.8	400
	118期（2023年7月5日）	5,956	0	△0.0	14,810	2.1	—	0.0	—	371
	119期（2023年7月31日）	（償還時） 5,948.04	（償還価額）	△0.1	14,975	1.1	—	—	—	364

（注1）基準価額は1万円当たり、騰落率は分配金込みです。

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

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

参考指数に関して

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

■ 当作成期中の基準価額と市況等の推移

決算期	年 月 日	基 準 価 額		参 考 指 数		株 式 組 入 比 率	債 券 組 入 比 率	投 資 信 託 証 券 比 率
		円	騰 落 率		騰 落 率			
第115期	(期 首) 2023年 3 月 6 日	6,078	—	14,368	—	—	0.0	79.6
	3 月 末	6,043	△0.6	14,327	△0.3	—	0.0	61.0
	(期 末) 2023年 4 月 5 日	6,058	△0.3	14,388	0.1	—	0.0	61.5
第116期	(期 首) 2023年 4 月 5 日	6,033	—	14,388	—	—	0.0	61.5
	4 月 末	6,048	0.2	14,480	0.6	—	0.0	74.9
	(期 末) 2023年 5 月 8 日	6,034	0.0	14,465	0.5	—	0.0	76.5
第117期	(期 首) 2023年 5 月 8 日	6,009	—	14,465	—	—	0.0	76.5
	5 月 末	5,986	△0.4	14,469	0.0	—	0.0	41.4
	(期 末) 2023年 6 月 5 日	5,982	△0.4	14,500	0.2	—	0.0	41.8
第118期	(期 首) 2023年 6 月 5 日	5,957	—	14,500	—	—	0.0	41.8
	6 月 末	5,948	△0.2	14,773	1.9	—	0.0	45.6
	(期 末) 2023年 7 月 5 日	5,956	△0.0	14,810	2.1	—	0.0	—
第119期	(期 首) 2023年 7 月 5 日	5,956	—	14,810	—	—	0.0	—
	(償還時) 2023年 7 月 31 日	(償還価額) 5,948.04	△0.1	14,975	1.1	—	—	—

(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	
第20作成期	115期（2023年4月5日）	7,044	60	△1.9	18,869	△3.1	—	0.0	61.7	1,752	
	116期（2023年5月8日）	7,127	60	2.0	19,485	3.3	—	0.0	74.9	1,492	
	117期（2023年6月5日）	7,152	60	1.2	20,261	4.0	—	0.0	41.8	1,353	
	118期（2023年7月5日）	7,262	0	1.5	21,341	5.3	—	0.0	—	1,308	
		（償還時）	（償還価額）								
	119期（2023年7月31日）	7,253.21		△0.1	21,043	△1.4	—	—	—	1,256	

（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 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115期	(期 首) 2023年 3 月 6 日	7,243	—	19,467	—	—	0.0	76.9
	3 月 末	7,147	△1.3	19,069	△2.0	—	0.0	59.5
	(期 末) 2023年 4 月 5 日	7,104	△1.9	18,869	△3.1	—	0.0	61.7
第116期	(期 首) 2023年 4 月 5 日	7,044	—	18,869	—	—	0.0	61.7
	4 月 末	7,162	1.7	19,360	2.6	—	0.0	73.1
	(期 末) 2023年 5 月 8 日	7,187	2.0	19,485	3.3	—	0.0	74.9
第117期	(期 首) 2023年 5 月 8 日	7,127	—	19,485	—	—	0.0	74.9
	5 月 末	7,205	1.1	20,159	3.5	—	0.0	40.8
	(期 末) 2023年 6 月 5 日	7,212	1.2	20,261	4.0	—	0.0	41.8
第118期	(期 首) 2023年 6 月 5 日	7,152	—	20,261	—	—	0.0	41.8
	6 月 末	7,260	1.5	21,352	5.4	—	0.0	44.7
	(期 末) 2023年 7 月 5 日	7,262	1.5	21,341	5.3	—	0.0	—
第119期	(期 首) 2023年 7 月 5 日	7,262	—	21,341	—	—	0.0	—
	(償還時) 2023年 7 月 31 日	(償還価額) 7,253.21	△0.1	21,043	△1.4	—	—	—

(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
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。

(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
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
(償還時) 20期(2023年7月31日)	(償還価額) 9,589.21		△1.0	14,975	4.2	—	—	—	38

(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) 2023年3月6日	円 9,682	% —	14,368	% —	% —	% 0.2	% 78.1
3月末	9,626	△0.6	14,327	△0.3	—	0.2	62.0
4月末	9,670	△0.1	14,480	0.8	—	0.3	68.5
5月末	9,614	△0.7	14,469	0.7	—	0.3	33.8
6月末	9,594	△0.9	14,773	2.8	—	0.3	35.2
(償還時) 2023年7月31日	(償還価額) 9,589.21	△1.0	14,975	4.2	—	—	—

(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
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
(償還時) 20期(2023年7月31日)	(償還価額) 15,139.38		1.7	21,043	8.1	—	—	—	101

(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) 2023年3月6日	円 14,893	% —	円 19,467	% —	% —	% 0.1	% 77.3
3月末	14,695	△1.3	19,069	△2.0	—	0.1	60.5
4月末	14,835	△0.4	19,360	△0.6	—	0.1	63.1
5月末	14,989	0.6	20,159	3.6	—	0.1	29.9
6月末	15,157	1.8	21,352	9.7	—	0.1	32.1
(償還時) 2023年7月31日	(償還価額) 15,139.38	1.7	21,043	8.1	—	—	—

(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。

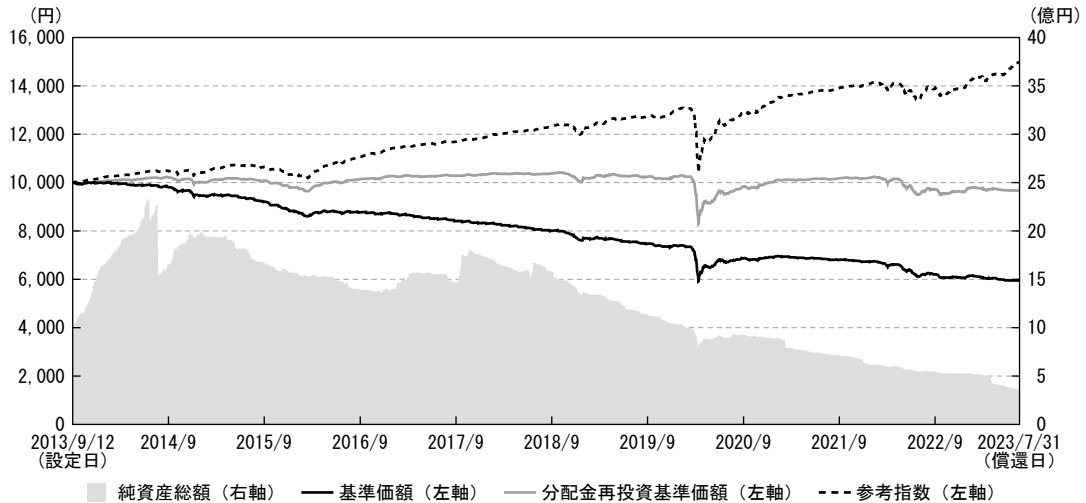
(注3) 当ファンドの参考指数は、クレディ・スイス・レバレッジド・ローン・インデックス（配当込み/円換算ベース/三菱UFJ銀行T M）です。当参考指数は、ファンドの設定日の前営業日を10,000として、委託会社が算出したものです。

(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

■設定以来の基準価額等の推移（2013年9月12日から2023年7月31日まで）

Aコース



※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。

前作成期までの運用状況（2013年9月12日～2023年3月6日）

■基準価額の主な変動要因

第1作成期（2013年9月12日～2014年3月5日）

当ファンドについては、為替ヘッジを行い、為替変動リスクを低減しました。

[主なプラス要因]

- ・投資先ファンドが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となりました。

[主なマイナス要因]

- ・大きくマイナスに寄与した要因はありませんでした。

◆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	1.8%
マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	1.6%

第2作成期（2014年3月6日～2014年9月5日）

当ファンドについては、為替ヘッジを行い、為替変動リスクを低減しました。

[主なプラス要因]

- ・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となりました。

[主なマイナス要因]

- ・大きくマイナスに寄与した要因はありませんでした。

◆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	2.0%
マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	0.9%

第3作成期（2014年9月6日～2015年3月5日）

- ・投資先ファンドの保有する銀行貸付債権の安定的な利息収入がプラス寄与しました。
- ・為替ヘッジを行い、為替リスクを低減しました。
- ・原油価格の下落などを受け、投資先ファンドが保有する銀行貸付債権が売られ、価格が低下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	△0.3%
マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	1.6%

第4作成期（2015年3月6日～2015年9月7日）

- ・投資先ファンドの保有する銀行貸付債権の安定的な利息収入がプラス寄与しました。
- ・為替ヘッジを行い、為替リスクを低減しました。
- ・ギリシャ債務問題や中国経済への懸念などがマイナス要因となり、投資先ファンドが保有する銀行貸付債権が売られ、価格が低下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	0.39%
マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	0.72%

第5作成期 (2015年9月8日～2016年3月7日)

- ・投資先ファンドの保有する銀行貸付債権の安定的な利息収入がプラス寄与しました。
- ・為替ヘッジを行い、為替リスクを低減しました。
- ・原油安、中国経済の減速と世界経済への悪影響への懸念や米国金利経済見通しへの不透明感などがマイナス要因となり、投資先ファンドが保有する銀行貸付債権が売られ、価格が低下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	△2.56%
マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	4.60%

第6作成期 (2016年3月8日～2016年9月5日)

- ・投資先ファンドの保有する銀行貸付債権の安定的な利息収入がプラス寄与しました。
- ・為替ヘッジを行い、為替リスクを低減しました。
- ・投資家心理の回復や、利息収入を求めた投資家の資金流入などにより、投資先ファンドが保有する銀行貸付債権の価格が上昇したことがプラス寄与しました。

◆当作成期間の組入ファンドの騰落率

組入ファンド	騰落率
マニユライフ・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	5.65%
マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	0.44%

第7作成期 (2016年9月6日～2017年3月6日)

- ・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。
- ・投資家心理の回復や、個人投資家の資金流入などにより、投資先ファンドが保有する銀行貸付債権の価格が上昇したことがプラス寄与しました。

◆当作成期間の組入ファンドの騰落率

組入ファンド	騰落率
マニユライフ・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	3.07%
マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	△1.26%

第8作成期（2017年3月7日～2017年9月5日）

- ・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。

◆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	1.4%
マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	0.7%

第9作成期（2017年9月6日～2018年3月5日）

- ・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	2.4%
マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	0.2%

第10作成期（2018年3月6日～2018年9月5日）

- ・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%

第11作成期（2018年9月6日～2019年3月5日）

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

◆当作成期間の組入ファンドの騰落率

組入ファンド	騰落率
マニユライフ・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	1.6%
マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	1.4%

第12作成期（2019年3月6日～2019年9月5日）

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

◆当作成期間の組入ファンドの騰落率

組入ファンド	騰落率
マニュライフ・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	1.5%
マニュライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	3.3%

第13作成期（2019年9月6日～2020年3月5日）

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

◆当作成期間の組入ファンドの騰落率

組入ファンド	騰落率
マニュライフ・インベストメンツ・トラスト・フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA	0.3%
マニュライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	△1.3%

第14作成期（2020年3月6日～2020年9月7日）

- ・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下落がマイナスに寄与しました。
- ・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	△1.7%
マニュライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	△1.6%

第15作成期（2020年9月8日～2021年3月5日）

- ・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に寄与しました。
- ・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	4.1%
マニュライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	△0.1%

第16作成期（2021年3月6日～2021年9月6日）

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

◆当作成期間の組入ファンドの騰落率

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

第17作成期（2021年9月7日～2022年3月7日）

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

◆当作成期間の組入ファンドの騰落率

組入ファンド	騰落率
マニュライフ・インベストメンツ・トラスト・フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA	0.5%
マニュライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	△1.1%

第18作成期（2022年3月8日～2022年9月5日）

- ・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下落がマイナス寄与しました。
- ・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	△2.8%
マニュライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	△1.7%

第19作成期（2022年9月6日～2023年3月6日）

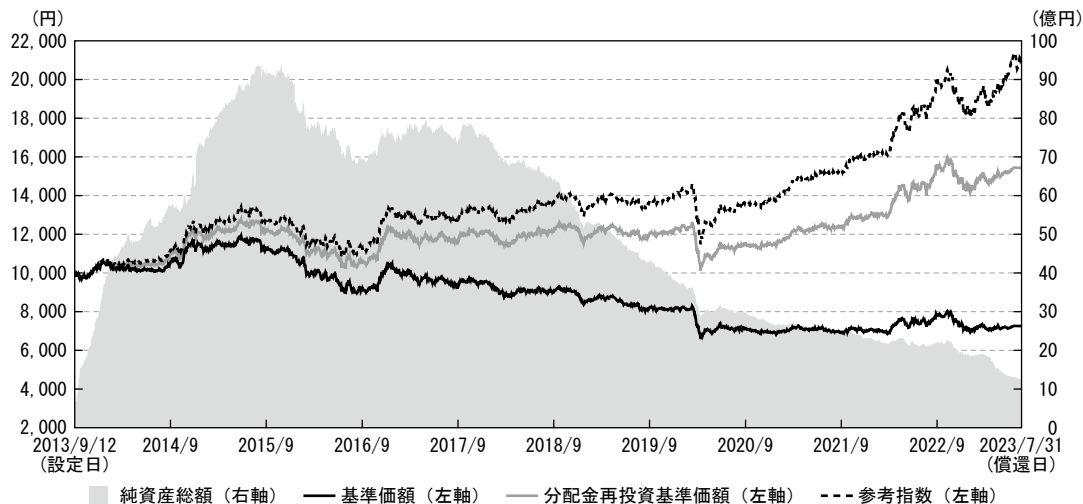
- ・投資先ファンドの保有する銀行貸付債権の安定的な利息収入がプラス寄与しました。
- ・銀行貸付債権の価格上昇がプラス寄与しました。
- ・為替ヘッジ取引にかかるコスト（ヘッジコスト）がマイナス寄与しました。

◆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%
マニュライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	△2.2%

■設定以来の基準価額等の推移（2013年9月12日から2023年7月31日まで）

Bコース



※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。

前作成期までの運用状況（2013年9月12日～2023年3月6日）

■基準価額の主な変動要因

第1作成期（2013年9月12日～2014年3月5日）

[主なプラス要因]

- ・投資先ファンドが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となりました。
- ・期を通じて、円が米ドルに対し下落（円安）したことがプラス寄与となりました。

[主なマイナス要因]

- ・大きくマイナスに寄与した要因はありませんでした。

◆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	1.8%
マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	1.6%

第2作成期（2014年3月6日～2014年9月5日）

[主なプラス要因]

- ・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となりました。
- ・通期で円が米ドルに対し下落したことがプラスに寄与しました。

[主なマイナス要因]

- ・大きくマイナスに寄与した要因はありませんでした。

◆当作成期間の組入ファンドの騰落率

組入ファンド	騰落率
マニュライフ・インベストメンツ・トラスト・フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA	2.0%
マニュライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	0.9%

第3作成期（2014年9月6日～2015年3月5日）

- ・投資先ファンドの保有する銀行貸付債権の安定的な利息収入がプラス寄与しました。
- ・円が米ドルに対し下落したことがプラス寄与しました。
- ・原油価格の下落などを受け、投資先ファンドが保有する銀行貸付債権が売られ、価格が低下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
マニュライフ・インベストメンツ・トラスト・フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA	△0.3%
マニュライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	1.6%

第4作成期（2015年3月6日～2015年9月7日）

- ・投資先ファンドの保有する銀行貸付債権の安定的な利息収入がプラス寄与しました。
- ・円が米ドルに対し上昇したことがマイナス寄与しました。
- ・ギリシャ債務問題や中国経済への懸念などがマイナス要因となり、投資先ファンドが保有する銀行貸付債権が売られ、価格が低下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
マニュライフ・インベストメンツ・トラスト・フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA	0.39%
マニュライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	0.72%

第5作成期（2015年9月8日～2016年3月7日）

- ・投資先ファンドの保有する銀行貸付債権の安定的な利息収入がプラス寄与しました。
- ・円が米ドルに対し上昇したことがマイナス寄与しました。
- ・原油安、中国経済の減速と世界経済への悪影響への懸念や米国金利経済見通しへの不透明感などがマイナス要因となり、投資先ファンドが保有する銀行貸付債権が売られ、価格が低下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	△2.56%
マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	4.60%

第6作成期（2016年3月8日～2016年9月5日）

- ・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。
- ・投資家心理の回復や、利息収入を求めた投資家の資金流入などにより、投資先ファンドが保有する銀行貸付債権の価格が上昇したことがプラス寄与しました。
- ・円が米ドルに対し上昇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	5.65%
マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	0.44%

第7作成期（2016年9月6日～2017年3月6日）

- ・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。
- ・投資家心理の回復や、個人投資家の資金流入などにより、投資先ファンドが保有する銀行貸付債権の価格が上昇したことがプラス寄与しました。
- ・円が米ドルに対し下落したことがプラス寄与しました。

◆当作成期間の組入ファンドの騰落率

組入ファンド	騰落率
マニユライフ・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	3.07%
マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	△1.26%

第8作成期 (2017年3月7日～2017年9月5日)

- ・投資先ファンドの保有する銀行貸付債権の安定的な利息収入がプラス寄与しました。
- ・円が米ドルに対し上昇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
マニュライフ・インベストメンツ・トラスト・フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA	1.4%
マニュライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	0.7%

第9作成期 (2017年9月6日～2018年3月5日)

- ・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。
- ・円が米ドルに対し上昇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	2.4%
マニュライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	0.2%

第10作成期 (2018年3月6日～2018年9月5日)

- ・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%
マニュライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	△0.5%

第11作成期 (2018年9月6日～2019年3月5日)

- ・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。

◆当作成期間の組入ファンドの騰落率

組入ファンド	騰落率
マニュライフ・インベストメンツ・トラスト・フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA	1.6%
マニュライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	1.4%

第12作成期（2019年3月6日～2019年9月5日）

- ・投資先ファンドの保有する銀行貸付債権の安定的な利息収入がプラス寄与しました。
- ・円が米ドルに対し上昇（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	1.5%
マニュライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	3.3%

第13作成期（2019年9月6日～2020年3月5日）

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

◆当作成期間の組入ファンドの騰落率

組入ファンド	騰落率
マニュライフ・インベストメンツ・トラスト・フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA	0.3%
マニュライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	△1.3%

第14作成期（2020年3月6日～2020年9月7日）

- ・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下落がマイナスに寄与しました。
- ・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	△1.7%
マニュライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	△1.6%

第15作成期（2020年9月8日～2021年3月5日）

- ・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に寄与しました。
- ・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	4.1%
マニュライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	△0.1%

第16作成期（2021年3月6日～2021年9月6日）

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

◆当作成期間の組入ファンドの騰落率

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

第17作成期（2021年9月7日～2022年3月7日）

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

◆当作成期間の組入ファンドの騰落率

組入ファンド	騰落率
マニュライフ・インベストメンツ・トラスト・フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA	0.5%
マニュライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	△1.1%

第18作成期（2022年3月8日～2022年9月5日）

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

◆当作成期間の組入ファンドの騰落率

組入ファンド	騰落率
マニュライフ・インベストメンツ・トラスト・フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA	△2.8%
マニュライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	△1.7%

第19作成期（2022年9月6日～2023年3月6日）

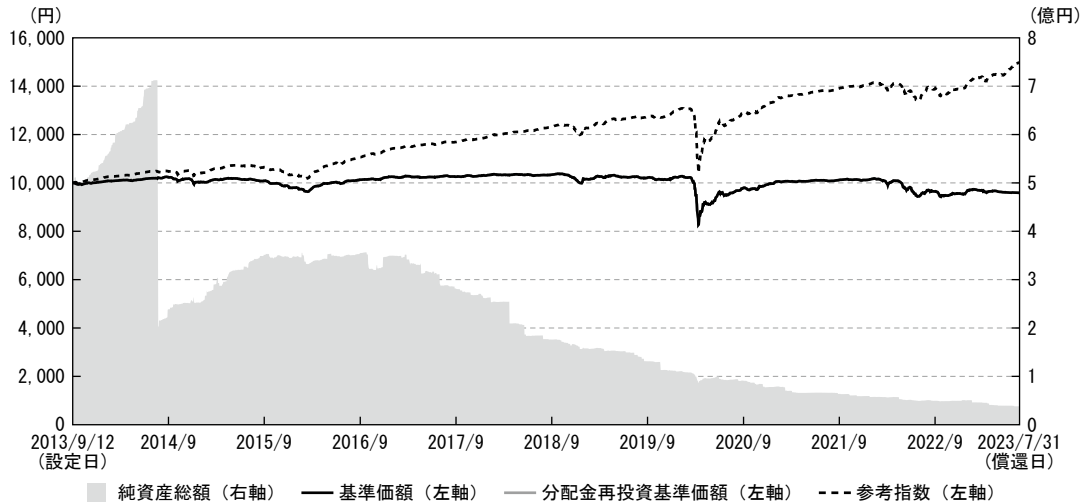
- ・投資先ファンドの保有する銀行貸付債権の安定的な利息収入がプラス寄与しました。
- ・銀行貸付債権の価格上昇がプラス寄与しました。
- ・円が米ドルに対し上昇（円高）したことがマイナス寄与しました。

◆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%
マニュライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	△2.2%

■設定以来の基準価額等の推移（2013年9月12日から2023年7月31日まで）

Cコース



※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。

前期までの運用状況（2013年9月12日～2023年3月6日）

■基準価額の主な変動要因

第1期（2013年9月12日～2014年3月5日）

当ファンドについては、為替ヘッジを行い、為替変動リスクを低減しました。

[主なプラス要因]

- ・投資先ファンドが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となりました。

[主なマイナス要因]

- ・大きくマイナスに寄与した要因はありませんでした。

◆当期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	1.8%
マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	1.6%

第2期（2014年3月6日～2014年9月5日）

当ファンドについては、為替ヘッジを行い、為替変動リスクを低減しました。

[主なプラス要因]

- ・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となりました。

[主なマイナス要因]

- ・大きくマイナスに寄与した要因はありませんでした。

◆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	2.0%
マニュライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	0.9%

第3期（2014年9月6日～2015年3月5日）

- ・投資先ファンドの保有する銀行貸付債権の安定的な利息収入がプラス寄与しました。
- ・為替ヘッジを行い、為替リスクを低減しました。
- ・原油価格の下落などを受け、投資先ファンドが保有する銀行貸付債権が売られ、価格が低下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
マニュライフ・インベストメンツ・トラスト・フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA	△0.3%
マニュライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	1.6%

第4期（2015年3月6日～2015年9月7日）

- ・投資先ファンドの保有する銀行貸付債権の安定的な利息収入がプラス寄与しました。
- ・為替ヘッジを行い、為替リスクを低減しました。
- ・ギリシャ債務問題や中国経済への懸念などがマイナス要因となり、投資先ファンドが保有する銀行貸付債権が売られ、価格が低下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
マニュライフ・インベストメンツ・トラスト・フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA	0.39%
マニュライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	0.72%

第5期（2015年9月8日～2016年3月7日）

- ・投資先ファンドの保有する銀行貸付債権の安定的な利息収入がプラス寄与しました。
- ・為替ヘッジを行い、為替リスクを低減しました。
- ・原油安、中国経済の減速と世界経済への悪影響への懸念や米国金利経済見通しへの不透明感などがマイナス要因となり、投資先ファンドが保有する銀行貸付債権が売られ、価格が低下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	△2.56%
マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	4.60%

第6期（2016年3月8日～2016年9月5日）

- ・投資先ファンドの保有する銀行貸付債権の安定的な利息収入がプラス寄与しました。
- ・為替ヘッジを行い、為替リスクを低減しました。
- ・投資家心理の回復や、利息収入を求めた投資家の資金流入などにより、投資先ファンドが保有する銀行貸付債権の価格が上昇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	5.65%
マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	0.44%

第7期（2016年9月6日～2017年3月6日）

- ・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。
- ・投資家心理の回復や、個人投資家の資金流入などにより、投資先ファンドが保有する銀行貸付債権の価格が上昇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	3.07%
マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	△1.26%

第8期（2017年3月7日～2017年9月5日）

・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。

◆当期間の組入ファンドの騰落率

組入ファンド	騰落率
マニユライフ・インベストメンツ・トラスト・フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA	1.4%
マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	0.7%

第9期（2017年9月6日～2018年3月5日）

・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	2.4%
マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	0.2%

第10期（2018年3月6日～2018年9月5日）

・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%

第11期（2018年9月6日～2019年3月5日）

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

◆当期間の組入ファンドの騰落率

組入ファンド	騰落率
マニユライフ・インベストメンツ・トラスト・フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA	1.6%
マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	1.4%

第12期（2019年3月6日～2019年9月5日）

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

◆当期間の組入ファンドの騰落率

組入ファンド	騰落率
マニュライフ・インベストメンツ・トラスト・フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA	1.5%
マニュライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	3.3%

第13期（2019年9月6日～2020年3月5日）

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

◆当期間の組入ファンドの騰落率

組入ファンド	騰落率
マニュライフ・インベストメンツ・トラスト・フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA	0.3%
マニュライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	△1.3%

第14期（2020年3月6日～2020年9月7日）

- ・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下落がマイナスに寄与しました。
- ・為替ヘッジ取引にかかるコスト（ヘッジコスト）がマイナス寄与しました。

◆当期間の組入ファンドの騰落率

組入ファンド	騰落率
マニュライフ・インベストメンツ・トラスト・フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA	△1.7%
マニュライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	△1.6%

第15期（2020年9月8日～2021年3月5日）

- ・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に寄与しました。
- ・為替ヘッジ取引にかかるコスト（ヘッジコスト）がマイナス寄与しました。

◆当期間の組入ファンドの騰落率

組入ファンド	騰落率
マニュライフ・インベストメンツ・トラスト・フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA	4.1%
マニュライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	△0.1%

第16期（2021年3月6日～2021年9月6日）

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

◆当期間の組入ファンドの騰落率

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

第17期（2021年9月7日～2022年3月7日）

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

◆当期間の組入ファンドの騰落率

組入ファンド	騰落率
マニユライフ・インベストメンツ・トラスト・フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA	0.5%
マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	△1.1%

第18期（2022年3月8日～2022年9月5日）

- ・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下落がマイナス寄与しました。
- ・為替ヘッジ取引にかかるコスト（ヘッジコスト）がマイナス寄与しました。

◆当期間の組入ファンドの騰落率

組入ファンド	騰落率
マニユライフ・インベストメンツ・トラスト・フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA	△2.8%
マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	△1.7%

第19期（2022年9月6日～2023年3月6日）

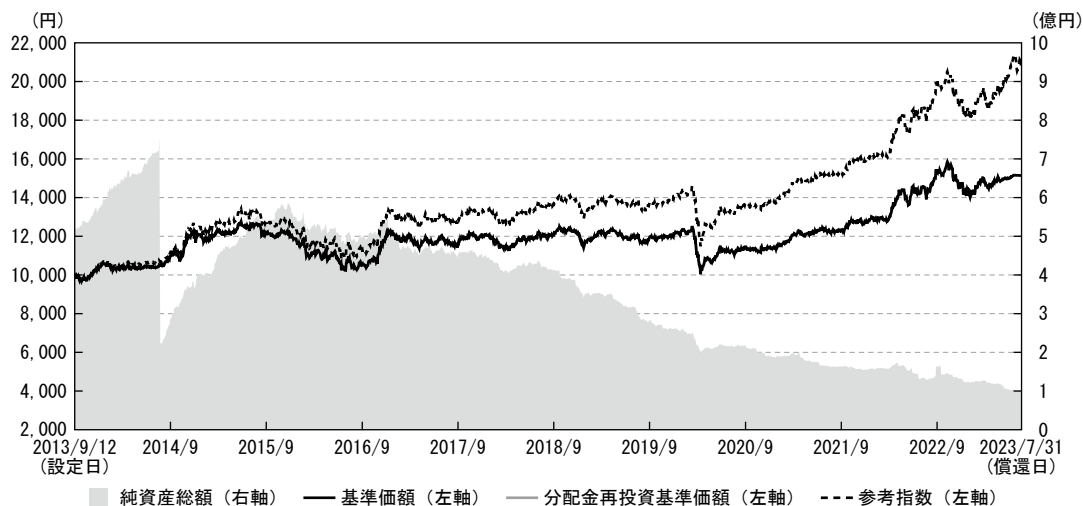
- ・投資先ファンドの保有する銀行貸付債権の安定的な利息収入がプラス寄与しました。
- ・銀行貸付債権の価格上昇がプラス寄与しました。
- ・為替ヘッジ取引にかかるコスト（ヘッジコスト）がマイナス寄与しました。

◆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%

■設定以来の基準価額等の推移（2013年9月12日から2023年7月31日まで）

Dコース



※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。

前期までの運用状況（2013年9月12日～2023年3月6日）

■基準価額の主な変動要因

第1期（2013年9月12日～2014年3月5日）

[主なプラス要因]

- ・投資先ファンドが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となりました。
- ・期を通じて、円が米ドルに対し下落（円安）したことがプラス寄与となりました。

[主なマイナス要因]

- ・大きくマイナスに寄与した要因はありませんでした。

◆当期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	1.8%
マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	1.6%

第2期（2014年3月6日～2014年9月5日）

[主なプラス要因]

- ・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となりました。
- ・通期で円が米ドルに対し下落したことがプラスに寄与しました。

[主なマイナス要因]

- ・大きくマイナスに寄与した要因はありませんでした。

◆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	2.0%
マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	0.9%

第3期（2014年9月6日～2015年3月5日）

- ・投資先ファンドの保有する銀行貸付債権の安定的な利息収入がプラス寄与しました。
- ・円が米ドルに対し下落したことがプラス寄与しました。
- ・原油価格の下落などを受け、投資先ファンドが保有する銀行貸付債権が売られ、価格が低下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	△0.3%
マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	1.6%

第4期（2015年3月6日～2015年9月7日）

- ・投資先ファンドの保有する銀行貸付債権の安定的な利息収入がプラス寄与しました。
- ・円が米ドルに対し上昇したことがマイナス寄与しました。
- ・ギリシャ債務問題や中国経済への懸念などがマイナス要因となり、投資先ファンドが保有する銀行貸付債権が売られ、価格が低下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	0.39%
マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	0.72%

第5期（2015年9月8日～2016年3月7日）

- ・投資先ファンドの保有する銀行貸付債権の安定的な利息収入がプラス寄与しました。
- ・円が米ドルに対し上昇したことがマイナス寄与しました。
- ・原油安、中国経済の減速と世界経済への悪影響への懸念や米国金利経済見通しへの不透明感などがマイナス要因となり、投資先ファンドが保有する銀行貸付債権が売られ、価格が低下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	△2.56%
マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	4.60%

第6期（2016年3月8日～2016年9月5日）

- ・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。
- ・投資家心理の回復や、利息収入を求めた投資家の資金流入などにより、投資先ファンドが保有する銀行貸付債権の価格が上昇したことがプラス寄与しました。
- ・円が米ドルに対し上昇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	5.65%
マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	0.44%

第7期（2016年9月6日～2017年3月6日）

- ・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。
- ・投資家心理の回復や、個人投資家の資金流入などにより、投資先ファンドが保有する銀行貸付債権の価格が上昇したことがプラス寄与しました。
- ・円が米ドルに対し下落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	3.07%
マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	△1.26%

第8期 (2017年3月7日～2017年9月5日)

- ・投資先ファンドの保有する銀行貸付債権の安定的な利息収入がプラス寄与しました。
- ・円が米ドルに対し上昇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	1.4%
マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	0.7%

第9期 (2017年9月6日～2018年3月5日)

- ・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。
- ・円が米ドルに対し上昇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	2.4%
マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	0.2%

第10期 (2018年3月6日～2018年9月5日)

- ・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%

第11期 (2018年9月6日～2019年3月5日)

- ・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。

◆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	1.6%
マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	1.4%

第12期（2019年3月6日～2019年9月5日）

- ・投資先ファンドの保有する銀行貸付債権の安定的な利息収入がプラス寄与しました。
- ・円が米ドルに対し上昇（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	1.5%
マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	3.3%

第13期（2019年9月6日～2020年3月5日）

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

◆当期間の組入ファンドの騰落率

組入ファンド	騰落率
マニユライフ・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	0.3%
マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	△1.3%

第14期（2020年3月6日～2020年9月7日）

- ・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下落がマイナスに寄与しました。
- ・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	△1.7%
マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	△1.6%

第15期（2020年9月8日～2021年3月5日）

- ・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に寄与しました。
- ・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	4.1%
マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	△0.1%

第16期（2021年3月6日～2021年9月6日）

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

◆当期間の組入ファンドの騰落率

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

第17期（2021年9月7日～2022年3月7日）

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

◆当期間の組入ファンドの騰落率

組入ファンド	騰落率
マニュライフ・インベストメンツ・トラスト・フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA	0.5%
マニュライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	△1.1%

第18期（2022年3月8日～2022年9月5日）

- ・投資先ファンドの保有する銀行貸付債権の安定的な利息収入がプラス寄与しました。
- ・円が米ドルに対し下落（円安）したことがプラス寄与しました。
- ・銀行貸付債権の価格下落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
マニュライフ・インベストメンツ・トラスト・フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA	△2.8%
マニュライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	△1.7%

第19期（2022年9月6日～2023年3月6日）

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

■投資環境

第1作成期／第1期（2013年9月12日～2014年3月5日）

期初、FRB（米連邦準備制度理事会）が懸念された量的金融緩和縮小を見送ったことや、米国の新年度予算審議の遅れなどから10月下旬にかけて米長期金利は10年国債で2.9%台から2.4%台へ低下しました。その後、米国経済の拡大を示す指標が多く発表され長期金利は上昇し、12月のFOMC（米連邦公開市場委員会）で1月の量的金融緩和縮小開始が決定された後、年末前後に3%台を付けました。1月は、寒波の影響で景気に対する慎重な見方が強まり、FRBが金融緩和を長期化させるとの期待が強まる一方、新興国に対する不安で長期金利は低下し、月末に2.5%台を付けました。2月に入り新興国不安は後退しましたが、下旬にウクライナ情勢が緊迫化し不透明感が強まり、2.7%近辺で期末を迎えました。

変動金利である銀行貸付債権は、米景気回復を背景に借入れ企業の財務内容が改善し信用力が向上したことから、堅調に推移しました。また、相対的に魅力的な利回り水準であることに加えて、長期金利上昇による悪影響が小さいことから投資家の資金流入傾向が続きました。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、期初の年利0.25%台から期末で年利0.23%台にやや低下しました。

外国為替市場は、期初に安全通貨として円を買う動きが強まり1ドル99円台から10月上旬にかけて96円台まで円が上昇（円高）しました。その後は日銀の金融緩和姿勢が強いことから年末には105円台まで下落（円安）しました。その後、1月に新興国不安を背景に円高基調となりましたが、2月に入り新興国不安が後退したことで円安傾向となりました。期末にかけては足元のウクライナ情勢緊迫化で横ばいとなり、102円台で期末を迎えました。

第2作成期／第2期（2014年3月6日～2014年9月5日）

期初は、ウクライナ情勢の緊迫化や中国の成長減速などが懸念されましたが、米景気回復期待でリスク回避姿勢が後退し、米10年国債利回りは2.7%台で推移しました。その後、FRB（米連邦準備制度理事会）が金融緩和姿勢を強めたことで、国債利回りは2.6%台へ低下しました。また、銀行貸付債権市場では割高感のある一部銘柄が売られました。5月は、FRBが金融緩和政策を維持するとの見方が強まったことや、ECB（欧州中央銀行）が追加的な金融緩和措置を実施するとの期待から国債利回りは更に低下し2.4%台となりました。6月は、ECBが追加的な金融緩和を発表し、FRBも超低金利の長期化を示唆しましたが、良好な経済指標発表を受けて国債利回りは上昇し、銀行貸付債権市場は上昇しました。7月は、ウクライナ情勢の緊迫化、ポルトガルの銀行危機、アルゼンチンの債務不履行問題などからリスク回避姿勢が強まりましたが、市場では堅調な景気指標を背景に、利上げ時期の前倒し観測が出て国債利回りは小幅上昇しました。銀行貸付債権市場は、FRBが同市場やハイ・イールド債の過熱感に対し懸念を示したことから調整しました。8月以降は、早期利上げ懸念が後退したことで、国債利回りは一時低下しましたが、その後、堅調な製造業景況指数などを背景に再び上昇し、2.45%近辺で期末を迎えました。銀行貸付債権市場は、8月中旬から需給悪化が緩和されたことで反発し期末を迎えました。

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、期を通じて年率0.23%近辺で横ばいの推移となりました。

外国為替市場は、期初1ドル102.24円ではじまりましたが、4月初旬にかけてリスク回避姿勢が後退し安全通貨である円が104円近辺まで下落（円安）しました。その後は、米国の超低金利が長期化するとの期待から米ドルが弱含み、1ドル101円台から102円台前半を中心に推移しました。7月中旬以降は、米国の景気拡大や早期利上げ期待に米ドル高傾向となり、105.57円で期末を迎えました。

第3作成期／第3期（2014年9月6日～2015年3月5日）

[米国債券／銀行貸付債権市況]

全コース共通

期初、米国での早期利上げ観測が強まったことから米長期国債利回りは上昇しましたが、10月中旬にかけてIMF（国際通貨基金）による世界の経済成長予測の下方修正や、インフレ期待の低下を受け利回りは低下傾向となりました。その後、景気の改善期待などからリスク回避の動きが緩和され利回りは上昇しましたが、11月中旬に、日本の7－9月期GDP成長率が予想を下回ったことや、ECB（欧州中央銀行）の追加緩和への期待などで利回りは再び低下傾向となりました。12月に入り堅調な景気指標の発表や、FOMC（米連邦公開市場委員会）の声明などから利上げ警戒感が強まったことで利回りが上昇する局面もありましたが、1月に入り、ECBが量的緩和プログラムの導入を決定するなど欧州をはじめ多くの国で金融緩和措置がとられ利回りは低下しました。足元では、良好な雇用統計やFRB（米連邦準備制度理事会）の利上げへの警戒感から、利回りは上昇傾向にあります。

このような環境下、銀行貸付債権は10月末の量的緩和終了を前に景気見通しへの不透明感が強まったことや、地政学リスクの高まりから、9月から10月中旬にかけて下落基調となりました。その後、上昇に転じましたが、11月下旬に原油価格が大幅に下落したことやギリシャでの政治的混乱の拡大などから、エネルギーセクターや比較的格付けの低い銀行貸付債権を中心に売られました。2月以降は、堅調な企業業績の発表や原油価格に下げ止まりが見られたことから銀行貸付債権が買われ、上昇傾向のなか期末を迎えました。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、年率0.23%から0.26%台へ小幅上昇し期末を迎えました。

[為替市況]

Bコース／Dコース

外国為替市場は、期初1米ドル105.57円ではじまりました。日銀が10月末に追加金融緩和を実施し、日本の7－9月期GDPがマイナス成長となる一方で、米国で2015年中に利上げが実施されるとの見方が強まり、12月上旬にかけて1米ドル122円目前まで急速に円安が進みました。その後、急激な原油安やギリシャ政局不安を受けて、安全通貨である円が買い戻されました。2月以降は、米長期金利が上昇傾向となるなか円安基調となり、1米ドル119.80円で期末を迎えました。

[日本債券市況]

全コース共通

当作成期間の10年国債利回りは、作成期初0.535%から作成期末0.400%となり利回りは低下（価格は上昇）しました。

第4作成期／第4期（2015年3月6日～2015年9月7日）

[米国債券／銀行貸付債権市況]

全コース共通

期初、ECB（欧州中央銀行）が量的緩和を開始したことや米国経済指標の悪化によりFRB（米連邦準備制度理事会）の早期利上げ観測が後退したことから、米10年国債利回りは2%台から1.8%台まで低下しました。4月下旬にかけて、欧州でインフレ指標が改善したことや割高感から欧州、米国などの国債利回りが急上昇し2%台を回復しました。6月に入り、米国の景気見通しが改善したことで、利回りは一時2.5%近辺まで上昇しましたが、後半からギリシャ債務問題が緊迫化したことから7月初旬には2.1%台へ低下しました。7月中旬にギリシャ債務問題を巡る混乱は終息しましたが、中国株式市場の急落や、IMF（国際通貨基金）による世界の成長見通しの下方修正などにより世界的に株安となったことや原油安によるインフレ期待の低下などから債券利回りは低下傾向となりました。8月に入ると中国の人民元切り下げや製造業関連の指標の悪化などを受けて中国経済の失速と世界経済への悪影響が懸念されて一段と低下し、一時1.9%台まで低下しました。しかしながら、25日に中国が政策金利と預金準備率の引き下げを実施すると、リスク回避的な動きが後退し2.1%台へ上昇し、期末を迎えました。

このような環境下、銀行貸付債権の価格は、5月までは景気見通しの改善を背景に上昇傾向となりましたが、6月以降は、ギリシャ情勢の緊迫化を受けて軟調となり、7月中旬から8月末にかけて中国経済減速への懸念によりリスク回避的な動きが強まる中下落しました。8月末から中国の政策金利や預金準備率の引き下げによりリスク回避的な動きが後退したため、下げ幅を縮めて期末を迎えました。期を通して、トータルリターンはプラスとなりました。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0.26%から期末には0.33%台へ上昇しました。

[為替市況]

Bコース／Dコース

外国為替市場は、期初1米ドル119.80円ではじまりました。堅調な米景気指標発表などから米利上げ観測が強まり、6月初旬に125円台まで円安が進みました。その後、ギリシャ債務問題の緊迫化や中国株急落や中国経済への懸念などから安全通貨としての円が買われ、8月下旬には一時116円台を付けました。しかしながら、中国の追加金融緩和を受けてリスク回避的な動きが後退する中円安に転じ、期初とほぼ同水準の1米ドル119.07円で期末を迎えました。

[日本債券市況]

全コース共通

当作成期間の10年国債利回りは、作成期初0.400%から作成期末0.365%となり利回りは低下（価格は上昇）しました。

第5作成期／第5期（2015年9月8日～2016年3月7日）

[米国債券／銀行貸付債権市況]

全コース共通

期初、中国経済の失速と世界経済への悪影響が懸念される中、10月中旬にかけて、米10年国債利回りは2.1%台から1.9%台まで低下しました。10月中旬以降12月まで、中国発の世界経済減速や原油安によるインフレ見通しの低下などの利回り低下要因とFRB（米連邦準備制度理事会）の利上げ懸念という上昇要因が拮抗する中、2.0%程度から2.3%台でのレンジで推移しました。1月以降、中国の景気減速への懸念が強まりリスク回避的な動きが強まったこと、株安や原油安によりインフレ見通しが低下したことなどから利回りは低下基調となり2月中旬には1.6%台を付けました。中旬以降、堅調な米経済指標の発表、中国人民銀行が預金準備率を引き下げるなど主要中銀が市場の混乱に対抗する姿勢を示したことやサウジ、ロシアなどによる原油価格の安定化に向けた動きが強まったことなどにより、リスク回避の動きは後退しました。期末にかけて利回りは上昇し、1.9%近辺で期末を迎えました。このような環境下、2月にかけて銀行貸付債権の価格は、エネルギーや金属・鉱業関連企業の債権を中心に下落基調となりました。期末にかけてリスク回避の後退する中、原油価格や株価の反発を受けて上昇に転じ、下げ幅を若干縮めて期末を迎えました。期を通して、トータルリターンはマイナスとなりました。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、米国の利上げ観測が強まる中、12月にFRBが政策金利であるフェデラルファンド金利の誘導目標を年0～0.25%から0.25%～0.50%に引き上げたことから、期初年率0.33%から期末には0.63%台へ上昇しました。

[為替市況]

Bコース／Dコース

外国為替市場は、期初1米ドル119.07円で始まりしました。堅調な米景気指標発表などから米利上げ観測が強まり、11月から12月中旬にかけて123円台まで円安が進みました。その後、原油安などでリスク回避の動きが強まったことや日銀の追加緩和への期待が後退したことで、安全通貨である円は1月中旬にかけて116円台まで買われました。1月末に日銀がマイナス金利を導入し、一時122円近辺まで円安が進みましたが続きませんでした。2月に入り、原油安や世界的な株安に加え米利上げ観測が後退したことから再び円が買われ一時110円台を付けました。その後は米経済指標の改善などにより112円から114円程度でのレンジの動きとなり1米ドル113.70円で期末を迎えました。

[日本債券市況]

全コース共通

当作成期間の10年国債利回りは、作成期初0.365%から作成期末-0.045%となり利回りは低下（価格は上昇）しました。

第6作成期／第6期（2016年3月8日～2016年9月5日）

[米国債券／銀行貸付債権市況]

全コース共通

米10年国債利回りは、期初に1.8%台で始まった後、5月にかけて原油高などが利回り上昇要因となりましたが、米国の利上げペース鈍化を示唆するFRB（米連邦準備制度理事会）議長のコメントや利息収入を求めた投資家の資金流入などを受けて、緩やかに低下しました。6月には、軟調な米雇用統計や、英国国民投票でEU（欧州連合）離脱支持派が過半数を占めたことなどを受けて米10年国債利回りは大きく低下し、7月初旬には1.3%台まで低下しました。しかし、7月上旬に投資家の過度のリスク回避姿勢が後退したことから米10年国債利回りは反転し、その後は堅調な米雇用統計、FRB当局者の利上げに前向きな発言などを背景に徐々に上昇が続き、1.6%台で期を終えました。銀行貸付債権の価格は、原油高などを受けて投資家心理が回復したことや、利息収入を求めた投資家の資金流入などにより上昇しました。特に、堅調な資源価格の推移を背景に、エネルギーや金属・鉱業関連企業の債権の価格が上昇しました。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0.63%台から期末には0.83%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上昇（円高）しました。期初1米ドル113.70円で始まった後、3月末のFRB議長による米国の利上げペース鈍化を示唆するコメント、4月末の日銀の追加金融緩和見送りを受けて円高が進みました。さらに6月には、EU離脱を支持する英国国民投票の結果を受けて、投資家のリスク回避姿勢が強まり、大きく円高が進みました。その後は、7月末の日銀の追加金融緩和が予想よりも小規模であったことなどが円高要因となった一方、FRB当局者の利上げに前向きなコメントなどが米ドル高要因となって円相場は一進一退の推移となり、103.93円で期末を迎えました。

[日本債券市況]

全コース共通

当作成期間の10年国債利回りは、作成期初-0.045%から作成期末-0.025%となり利回りは上昇（価格は下落）しました。

第7作成期／第7期（2016年9月6日～2017年3月6日）

[米国債券／銀行貸付債権市況]

全コース共通

米10年国債利回りは、期初に1.6%台で始まった後、2016年10月にかけて堅調な経済指標などを背景にF R B（米連邦準備制度理事会）による年内の利上げ観測が強まり、徐々に上昇しました。11月に、米大統領選でトランプ氏が勝利すると、公約に掲げていた財政拡大、減税などの政策や、インフレ率上昇への期待が高まり、10年国債利回りが大きく上昇した後、12月にはF O M C（米連邦公開市場委員会）での利上げや、2017年の利上げペースが速まるとの見方から、10年国債利回りは2.5%超まで上昇しました。しかし、その後は、3月利上げ観測や景気対策への期待などが利回り上昇要因となる一方、政策実現性や欧州政治への不透明感が重石となり、10年国債利回りは一進一退で推移し、2.4%台で期を終えました。銀行貸付債権の価格は、原油価格安定化や株高などによる投資家心理の回復、トランプ政権の政策への期待のほか、個人投資家の資金流入などにより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L I B O R（ロンドン銀行間貸出金利）は、期初年率0.83%台から期末には1.10%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103円台で始まった後、2016年9月にF O M Cでの利上げ見送りから円高が進みましたが、10月には年内利上げ観測の強まりから徐々に米ドルが買われました。11月から12月にかけては、米大統領選でのトランプ氏勝利やF O M Cでの利上げに加え、2017年の利上げペースが速まるとの見方から大幅に円安米ドル高が進み、一時117円超となりました。しかし、2017年1月以降は、トランプ新大統領の米ドル高牽制発言や米国保護主義への懸念、欧州政治の不透明感などから円が買われ、当作成期末には113円台となりました。

[日本債券市況]

全コース共通

当作成期間の10年国債利回りは、作成期初－0.025%から作成期末0.07%となり利回りは上昇（価格は下落）しました。

第8作成期／第8期（2017年3月7日～2017年9月5日）

[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2.4%台で始まった後、3月の利上げ観測を背景に2.6%台まで上昇しました。3月月央のFOMC（米連邦公開市場委員会）では予想通り利上げが実施されましたが、利上げペース加速の見方が後退したことから10年国債利回りは低下し、4月中旬にかけて米政権の政策実行力への懸念や地政学リスクの高まりを背景に2.1%台まで利回りが低下しました。4月下旬から5月上旬には、仏大統領選の結果、欧州の政治リスク懸念が後退し、10年国債利回りが上昇しましたが、5月中旬から6月中旬にかけては、経済指標の軟化や米大統領とロシアの不透明な関係への懸念などから利回りは再び低下しました。6月末にはECB（欧州中央銀行）総裁やBOE（イングランド銀行）総裁が金融引き締めの可能性を示したことから10年国債利回りは上昇しましたが、7月以降は、インフレ率の低迷や経済指標の鈍化などを受けて年内利上げ観測が後退したことや地政学リスクの高まりなどにより10年国債利回りは低下し、2.1%台で期を終えました。銀行貸付債権は、地政学リスクや軟調な原油価格などが価格上昇の重しとなりましたが、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1.10%台から期末には1.31%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上昇（円高）しました。期初1米ドル113円台で始まった後、3月FOMCの利上げ観測を背景に米ドルが115円台まで上昇しましたが、利上げ実施以降4月中旬にかけては利上げペース加速の見方が後退したことや、米政権の政策実行力への不透明感が高まったことにより米ドルが108円台まで下落しました。その後は、仏大統領選を経て欧州政治リスクが後退したことなどが米ドル高要因となりましたが、インフレ率の低迷などを背景に年内利上げ観測が後退したことや、米政権政策実行力への不透明感、北朝鮮をめぐる地政学リスクの高まりなどが米ドル安要因となり、当作成期末には109円台となりました。

[日本債券市況]

全コース共通

当作成期間の10年国債利回りは、作成期初0.07%から作成期末-0.005%となり利回りは低下（価格は上昇）しました。

第9作成期／第9期（2017年9月6日～2018年3月5日）

[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2.1%台で始まった後、9月のFOMC（米連邦公開市場委員会）を受けて年内の利上げ観測が高まったことやFRB（米連邦準備制度理事会）議長が年内利上げに前向きな姿勢を示したことなどから上昇し、10月には税制改革への期待などを背景に続伸しました。11月から12月上旬にかけては、税制改革への期待などが利回り上昇要因となった一方、低インフレへの懸念が利回り低下要因となり、米10年国債利回りはほぼ横ばいで推移しました。その後は、12月のFOMCでの利上げや、大型減税を含む税制改革法案の成立などから米10年国債利回りは上昇し、2018年1月も、税制改革による景気拡大期待、原油高、欧州の金融政策の早期正常化への観測などを背景に米10年国債利回りは大きく上昇しました。2月以降も、堅調な雇用統計に加え、FOMC議事録が今後の利上げ継続を示唆する内容であったことなどから、米10年国債利回りの上昇が続き、2.8%台で期を終えました。銀行貸付債権は、堅調な原油価格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1.31%台から期末には2.03%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上昇（円高）しました。期初1米ドル109円台で始まった後、11月上旬にかけて、年内の米国追加利上げ観測の高まりや、衆議院選挙の与党圧勝により日本の金融緩和政策に当面変更がないとの見方などにより114円台まで円安米ドル高が進みました。しかし、その後は、米国の物価上昇率鈍化の懸念などから米ドルが反落し、1月の日銀国債買い入れオペ（公開市場操作）の減額や、2月の世界的な株安を受けた投資家のリスク回避姿勢の強まり、さらに3月には米国の保護主義的な通商政策による米景気の先行き不透明感の高まりなどにより円高米ドル安が進み、当作成期末には105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-0.005%から作成期末0.04%となり利回りは上昇（価格は下落）しました。

第10作成期／第10期（2018年3月6日～2018年9月5日）

[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。

第11作成期／第11期（2018年9月6日～2019年3月5日）

[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、2018年10月上旬にかけて、堅調な米経済指標や9月末のFOMC（米連邦公開市場委員会）での利上げなどを背景に3.2%台まで上昇しました。しかし、その後は世界的な景気減速懸念が広がったほか、原油安、世界的な株安、FRB（米連邦準備制度理事会）高官による利上げサイクルの終了が近いことを示唆する発言などを受けて、国債利回りが低下し、2019年1月初旬には2.5%台となりました。1月中旬以降は、堅調な経済指標や米中貿易協議の進展で貿易摩擦が解消に向かうとの期待が高まったことなどが国債利回りの上昇要因になった一方、FRBの追加利上げに対する慎重な姿勢などが国債利回りの低下要因となり、2.6～2.7%台の範囲内で推移し、2.7%台で期を終えました。銀行貸付債権は、11月から12月に世界経済の減速懸念などから投資家のリスク回避姿勢が強まり下落しましたが、1月以降は減速懸念の後退や株高などにより投資家心理が改善して上昇したほか、安定的な利息収入がプラス寄与したことから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2.32%台から期末には2.60%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小幅に下落（円安）しました。期初1米ドル111円台で始まった後、米国長期金利の上昇などを背景に2018年10月上旬にかけて114円台まで円安米ドル高が進みました。その後、12月前半まで一進一退で推移しましたが、12月から2019年1月初旬にかけて、世界的な景気減速懸念や米国長期金利の低下などから1米ドル107円台まで円が急上昇しました。しかし、1月中旬以降は、景気減速懸念の後退や、米中貿易摩擦の緩和への期待、さらに日銀総裁が追加緩和の可能性に言及したことなどから円安米ドル高が進行し、当作成期末には期初をわずかに上回る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0.11%から作成期末0.01%となり利回りは低下（価格は上昇）しました。

第12作成期／第12期（2019年3月6日～2019年9月5日）

[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2.7%台で始まった後、3月にFRB（米連邦準備制度理事会）の金融緩和姿勢が強まったほか、長期金利が短期金利を下回る逆イールドが見られたことで米国の景気後退入りが懸念され、国債利回りが2.3%台まで低下しました。4月には米中の堅調な経済指標などを受けて国債利回りが上昇しましたが、5月から7月初旬にかけて、米中貿易摩擦の激化への懸念、FRBが年内に利下げするとの見方などを背景に国債利回りは1.9%台まで低下しました。7月末には、FOMC（米連邦公開市場委員会）にて約10年半ぶりとなる利下げが決定され、さらに8月に米大統領が中国製品に対する第4弾となる制裁関税を表明すると、投資家心理が悪化し、国債利回りが低下しました。また、約12年ぶりに2年物国債と10年物国債の利回りが逆転し、景気後退が懸念されたことも、国債利回りの更なる低下要因となり、1.4%台で期を終えました。銀行貸付債権は、利下げ局面で変動金利の特徴が嫌気されたことなどが重しとなりましたが、安定的な利息収入がプラス寄与したことなどからトータルリターンベースでは期を通じて上昇しました。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2.60%台から期末には2.11%台へ低下しました。

[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1米ドル111円台で始まった後、4月末までは概ね110円台から111円台の範囲内で推移した後、5月から6月末にかけて、米中貿易摩擦激化や世界的な景気減速への懸念、米国の利下げ観測の強まりなどから円が上昇しました。8月には、米国の中国製品に対する第4弾となる制裁関税の表明などを受けて、安全通貨とされる円を買う動きが強まったことや、米国の国債利回りの低下を背景として円高米ドル安が進行し、当作成期末には1米ドル106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0.01%から作成期末-0.27%となり利回りは低下（価格は上昇）しました。

第13作成期／第13期（2019年9月6日～2020年3月5日）

[米国債券／銀行貸付債権市況]

全コース共通

米10年国債利回りは期初に1.4%台で始まった後、9月および10月のFOMC（米連邦公開市場委員会）において利下げが決定され一時的な低下圧力がかかったものの、雇用統計など堅調な経済指標、米中貿易摩擦の緩和期待、12月の米中の貿易協議の第1段階合意などを受けて12月末には1.9%台まで上昇しました。2020年1月以降、新型コロナウイルスの感染拡大による世界経済への影響が懸念され、安全資産とされる米国国債を買う動きが強まったことや、FRB（米連邦準備制度理事会）による利下げへの期待が高まり、国債利回りは大きく低下し1.0%台で期を終えました。銀行貸付債権は、利下げ局面で変動金利の特徴が嫌気されたことや新型コロナウイルスの感染拡大による景気減速懸念などが重しとなりましたが、堅調な企業業績や安定的な利息収入がプラス寄与したことなどからトータルリターンベースでは期を通じて上昇しました。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2.11%台から期末には1.00%台へ低下しました。

[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106円台で始まった後、米中貿易摩擦の緩和期待を背景に12月の米中の貿易協議の第1段階合意に向けて徐々に円安米ドル高が進みました。2020年1月には、中東の地政学リスクや新型コロナウイルスの感染拡大に対する懸念から円が買われる局面もありましたが、2月下旬にかけて楽観ムードから再び円売り圧力が強まり112円台まで円安米ドル高が進みました。その後、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大による景気減速懸念から、リスク回避の円買いの動きが強まったことや米国国債利回りの低下を背景として円高米ドル安が進行し、当作成期末には1米ドル107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-0.27%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。

第14作成期／第14期（2020年3月6日～2020年9月7日）

[米国債券／銀行貸付債権市況]

全コース共通

米10年国債利回りは期初に1.0%台で始まった後、新型コロナウイルスの感染拡大による世界経済への影響が懸念され、安全資産とされる国債を買う動きが強まったことから急低下し0.5%台となりました。その後、2020年3月中旬には市場の落ち着きとともに一時的に1.1%台まで戻した後、世界経済停滞への懸念、FRB（米連邦準備制度理事会）による大規模金融緩和の長期継続姿勢、米中対立の激化懸念などを受けて低下し、8月上旬には0.5%台となりました。8月中旬以降は、FRBが雇用確保を重視するために一時的に2%超のインフレ率を容認する姿勢を示し、インフレ期待が高まったことなどを背景に米国債利回りは上昇し0.7%台で期を終えました。銀行貸付債権は、安定的な利息収入がプラス寄与しましたが、利下げ局面で変動金利の特徴が嫌気されたことや新型コロナウイルスの感染拡大による景気減速懸念などが重しとなりトータルリターンベースでは期を通じて小幅に下落しました。銀行貸付債権の基準金利である3ヵ月米ドルLIBOR（ロンドン銀行間貸出金利）は、期初年率1.00%台から期末には0.24%台へ低下しました。

[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107円台で始まり、新型コロナウイルスの感染拡大懸念から102円台まで急速に円高が進行した後、3月中旬には企業・金融機関による米ドル資金を確保する動きから111円台まで買い戻されました。その後、FRBによる大規模金融緩和の長期継続姿勢、米中対立の深刻化懸念、過去最大の落ち込みとなった米国の第2四半期GDP成長率などを受けて7月末には104円台まで円高米ドル安が進行しました。8月以降は、米国の景況感改善、雇用統計など堅調な経済指標、長期金利の上昇などを背景として米ドルが買い戻され、当作成期末に106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-0.11%から作成期末0.05%となり利回りは上昇（価格は下落）しました。

第15作成期／第15期（2020年9月8日～2021年3月5日）

[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0.7%台で始まった後、9月末にかけて株安や新型コロナウイルスの感染再拡大への懸念、米大統領選の不透明感などを背景に0.6%台に低下しました。

その後、12月末にかけては、新型コロナウイルスの感染拡大や欧州を中心に感染力の強い変異種の感染が拡大したことなどが低下要因となった一方、新型コロナウイルスワクチンの実用化期待、追加景気対策による景気回復期待や財政支出拡大への観測が強まったことなどが上昇要因となり、緩やかに上昇し0.9%台となりました。2021年に入り、堅調な経済指標などから経済の早期回復に期待が高まったほか、バイデン新政権の追加経済対策成立への期待も高まり、インフレ予想も強まったことから米国債利回りは上昇し1.5%台で期を終えました。銀行貸付債権は、安定的な利息収入や投資家心理が改善したことなどを背景にトータルリターンベースでは期を通じて上昇しました。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0.24%台から期末には0.17%台へ低下しました。

[為替市況]

Bコース／Dコース

外国為替市場では、円は米ドルに対して下落（円安）しました。期初に米ドルは106円台で始まり、新型コロナウイルスの感染拡大や米大統領選の先行き不透明感などに対する投資家のリスク回避姿勢の高まりなどを受けて、11月上旬には103円台まで円高米ドル安が進みました。その後、米大統領選挙結果を受けた不透明感の後退や新型コロナウイルスワクチンの実用化への期待の高まりなどが米ドル買い要因となりましたが、新型コロナウイルス感染拡大や米金融緩和の長期化観測などの米ドル売り要因を背景に円高ドル安が進み、2021年1月初旬には102円台となりました。期末にかけては、バイデン新政権の大型経済対策への期待が高まり、インフレ予想も強まったことから米国長期金利が1.5%台に上昇したことなどをを受けてドルが買い戻され、当期末には107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0.040%から作成期末0.096%となり利回りは上昇（価格は下落）しました。

第16作成期／第16期（2021年3月6日～2021年9月6日）

[米国債券／銀行貸付債権市況]

全コース共通

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

[為替市況]

Bコース／Dコース

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

[日本債券市況]

全コース共通

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

第17作成期／第17期（2021年9月7日～2022年3月7日）

[米国債券／銀行貸付債権市況]

全コース共通

米10年国債利回りは期初に1.3%台で始まった後、F R B（米連邦準備制度理事会）が利上げ開始時期の前倒しと量的金融緩和縮小の年内開始を示唆したことなどを受けて、2021年10月下旬には一時1.7%台まで上昇しました。その後、12月初旬にかけて欧州での新型コロナウイルス感染再拡大や新たな変異株（オミクロン株）が発見されたことなどを受けて1.3%台まで低下しましたが、物価上昇などによりF R Bが量的金融緩和縮小の加速を決定したことや利上げ時期の前倒し観測が高まったことなどを背景に、2022年2月中旬にかけて2.0%台まで上昇しました。その後、ウクライナ情勢の緊迫化により投資家心理が悪化し、国債利回りは低下し1.7%台で期を終えました。銀行貸付債権は、安定的な利息収入などを背景にトータルリターンベースでは期を通じて上昇しました。

[為替市況]

Bコース／Dコース

外国為替市場では、円は米ドルに対して下落（円安）しました。期初に米ドルは109円台で始まり、2021年11月下旬にかけては米長期金利の上昇などを背景に115円台まで円安米ドル高が進みましたが、12月初旬には欧州での新型コロナウイルス感染再拡大や新たな変異株が発見されたことなどを受けて112円台まで円が買い戻されました。その後、F R Bが量的金融緩和縮小の加速を決定し米長期金利が上昇したことや利上げ時期の前倒し観測が高まったことなどを背景に円安米ドル高が進み、当期末には115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0.051%から作成期末0.147%となり利回りは低下（価格は上昇）しました。

第18作成期／第18期（2022年3月8日～2022年9月5日）

[米国債券／銀行貸付債権市況]

全コース共通

米10年国債利回りは期初に1.7%台で始まった後、米国の堅調な雇用統計の発表や、金融引き締め
の長期化観測などを背景に国債利回りは上昇し3.1%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下落（円安）しました。期初に米ドルは115円台で始ま
り、米長期金利の上昇、3月以降、複数回にわたる計2.25%の利上げ、米国の堅調な雇用統計の発
表や、金融引き締め
の長期化観測などが米ドル買い要因となり、当期末には140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0.147%から作成期末0.236%となり利回りは上昇（価格は
下落）しました。

第19作成期／第19期（2022年9月6日～2023年3月6日）

[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。

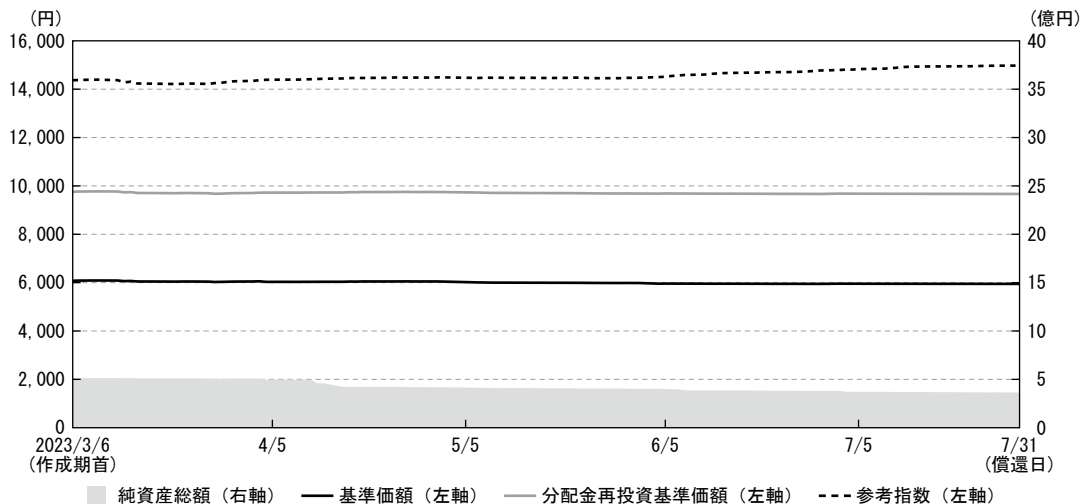
[日本債券市況]

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。

■基準価額等の推移（2023年3月7日から2023年7月31日まで）

Aコース



作成期首： 6,078円
償還日： 5,948円04銭（既払分配金75円）
騰落率： $\Delta 0.9\%$ （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/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

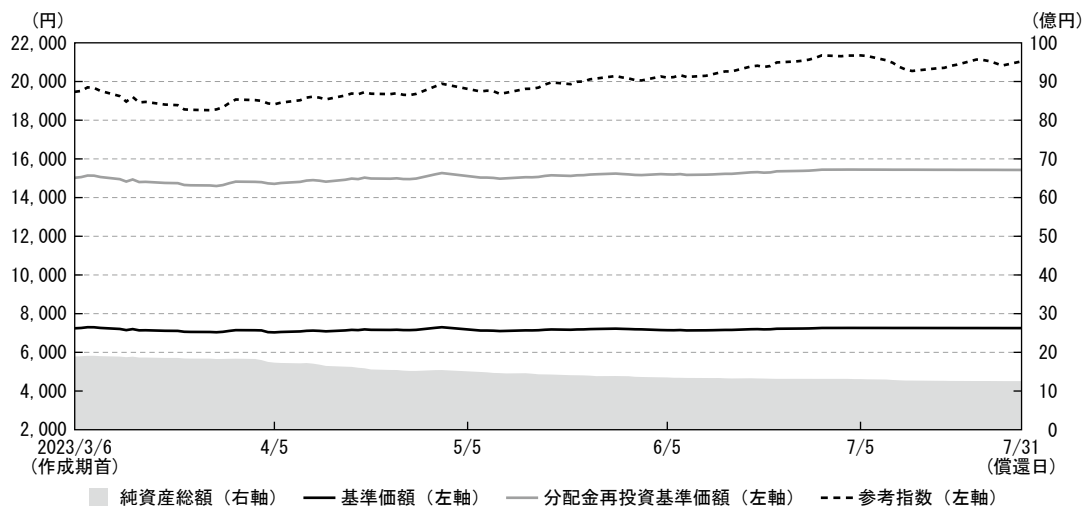
- ・投資先ファンドの保有する銀行貸付債権の安定的な利息収入がプラス寄与しました。
- ・銀行貸付債権の価格上昇がプラス寄与しました。
- ・為替ヘッジ取引にかかるコスト（ヘッジコスト）がマイナス寄与しました。

◆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	$\Delta 1.5\%$
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（2023年3月7日から2023年7月31日まで）

Bコース



作成期首： 7,243円

償還日：7,253円21銭（既払分配金180円）

騰落率： 2.7%（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 T M）です。当参考指数は、ファンドの設定日の前営業日を10,000として、委託会社が算出したものです。

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

■基準価額の主な変動要因

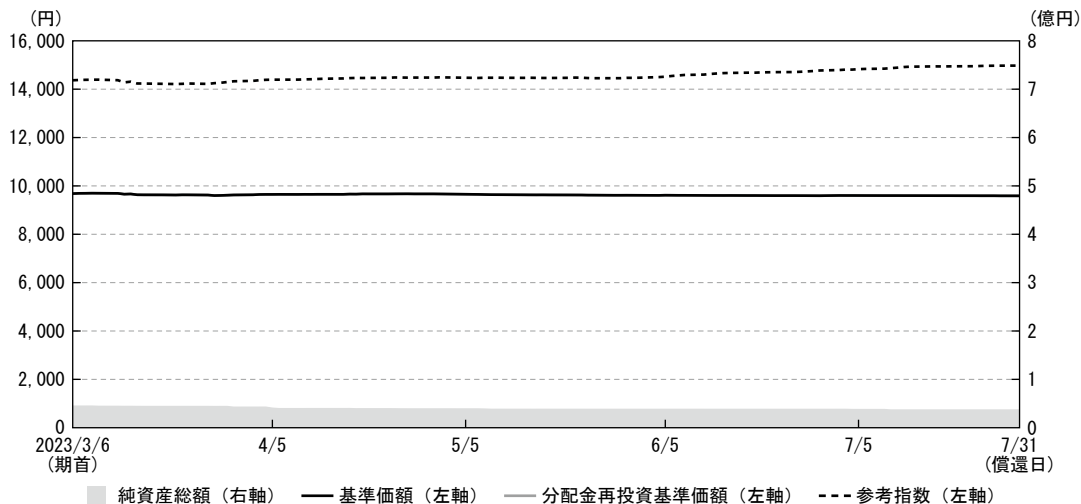
- ・投資先ファンドの保有する銀行貸付債権の安定的な利息収入がプラス寄与しました。
- ・銀行貸付債権の価格上昇がプラス寄与しました。
- ・円が米ドルに対し下落（円安）したことがプラス寄与しました。

◆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	△1.5%
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（2023年3月7日から2023年7月31日まで）

Cコース



期首： 9,682円
償還日： 9,589円21銭（既払分配金一元）
騰落率： $\Delta 1.0\%$ （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/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

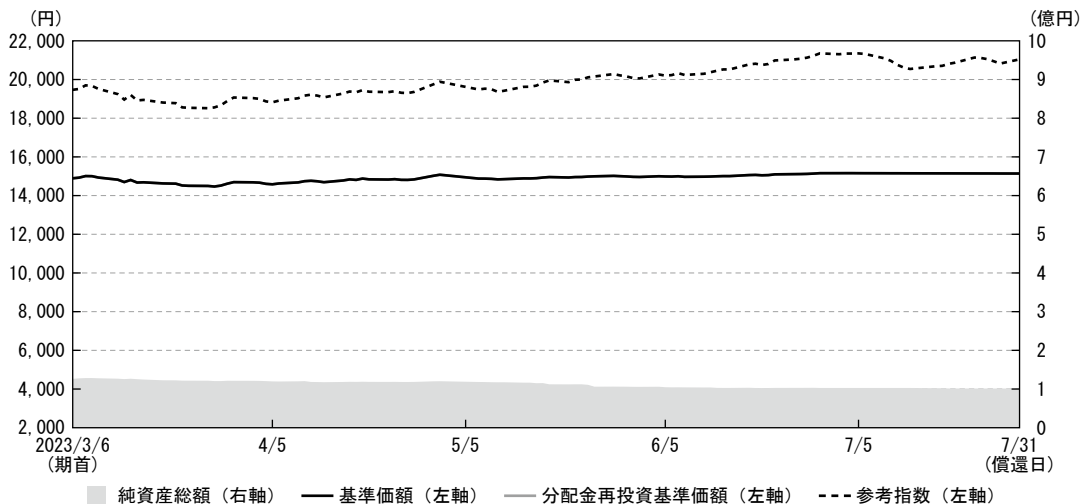
- ・投資先ファンドの保有する銀行貸付債権の安定的な利息収入がプラス寄与しました。
- ・銀行貸付債権の価格上昇がプラス寄与しました。
- ・為替ヘッジ取引にかかるコスト（ヘッジコスト）がマイナス寄与しました。

◆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	$\Delta 1.5\%$
マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	0.5%

■基準価額等の推移 (2023年3月7日から2023年7月31日まで)

Dコース



期首： 14,893円

償還日： 15,139円38銭 (既払分配金一元)

騰落率： 1.7% (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	△1.5%
マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	0.5%

■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3.9%台で始まった後、米国地方銀行の破綻を受けて投資家のリスク回避姿勢が強まったことや、インフレ鈍化の兆候を示す経済指標などを受けて、4月上旬にかけて3.3%台に低下しました。その後、米連邦政府の債務上限問題に加えて、追加利上げ観測の再燃や利上げ長期化観測の高まりなどから上昇し、3.9%台で期を終えました。

銀行貸付債権は、3月は投資家のリスク回避姿勢が強まったことなどから小幅下落しましたが、その後は、クレジットスプレッドの縮小による価格の上昇に加え、安定的な利息収入などを背景にトータルリターンベースでは期を通じて上昇しました。

[為替市況]

Bコース／Dコース

外国為替市場では、円は米ドルに対して下落（円安）しました。期初に米ドルは135円台で始まり、3月は米国地方銀行の破綻に対してF R B（米連邦準備制度理事会）が金融政策を緩和化するとの観測から米ドル安傾向となりました。その後は、日本銀行（中央銀行）が金融緩和政策を維持する一方で、米国の追加利上げ観測が再燃し、米長期金利の上昇に伴う日米金利差の拡大などから米ドル高が進み、当期末には140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0.506%から作成期末0.612%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

繰上償還に向けて、主要投資対象とする「ケイマン籍外国投資信託「マニユライフ・インベストメンツ・トラスト・フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA」（以下「MITーフローティング・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）」の受益証券を売却し、現金化を行いました。

MITーフローティング・レート・インカム・ファンド クラスA

繰上償還に向けて組入資産の現金化を行いました。

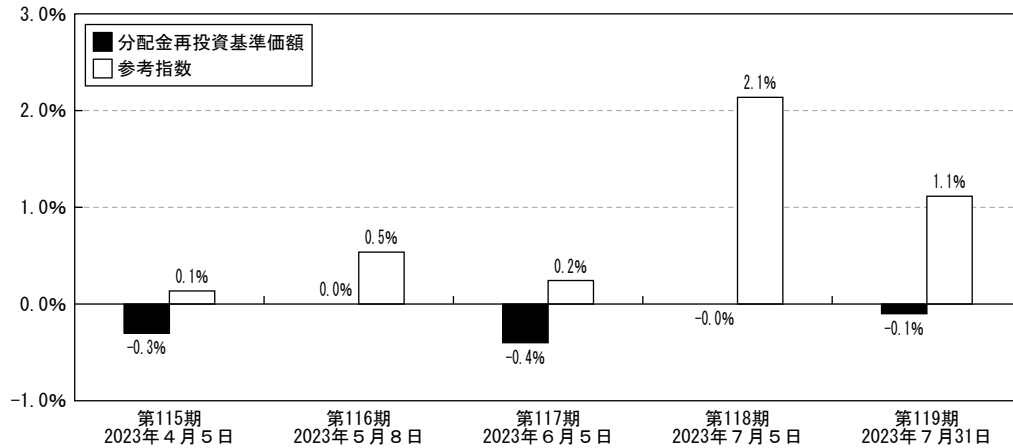
マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド

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。

■当該投資信託のベンチマークとの差異

Aコース

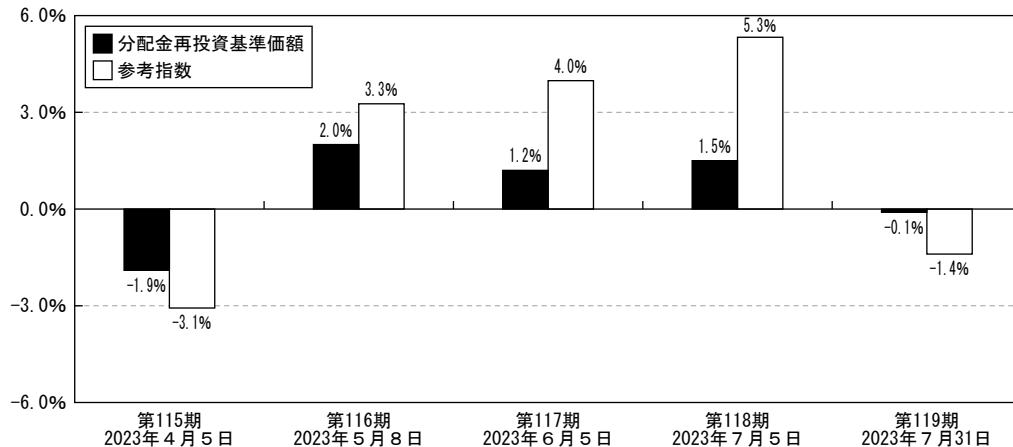
当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率の対比です。



※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

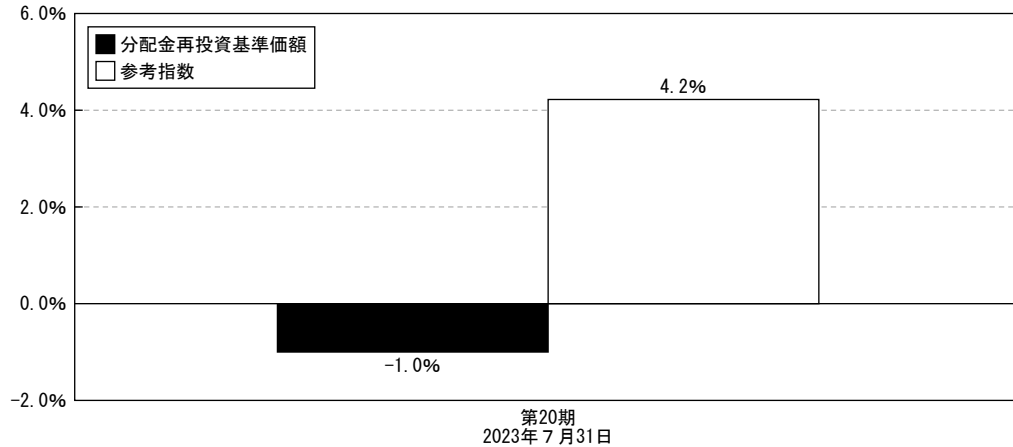
当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率の対比です。



※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

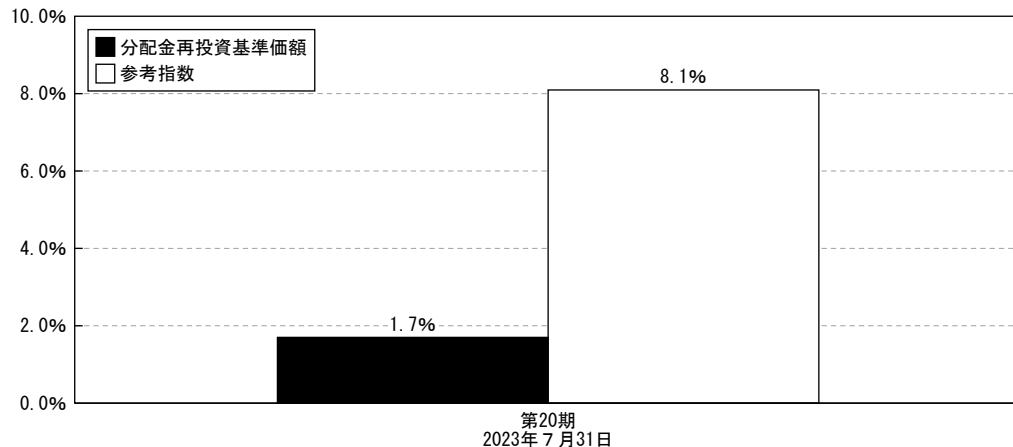
当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率の対比です。



※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115期～第117期は25円、合計75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した。

[分配原資の内訳]

（1万口当たり、税引前）

	第115期		第116期		第117期		第118期	
	自 2023年3月7日 至 2023年4月5日	自 2023年4月6日 至 2023年5月8日	自 2023年4月6日 至 2023年5月8日	自 2023年5月9日 至 2023年6月5日	自 2023年5月9日 至 2023年6月5日	自 2023年6月6日 至 2023年7月5日	自 2023年6月6日 至 2023年7月5日	
当期分配金 (円)	25	25	25	25	25	—	—	
(対基準価額比率) (%)	0.413	0.414	0.414	0.418	0.418	—	—	
当期の収益 (円)	17	22	22	10	10	—	—	
当期の収益以外 (円)	7	2	2	14	14	—	—	
翌期繰越分配対象額 (円)	467	467	467	453	453	—	—	

(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115期～第117期は60円、合計180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した。

[分配原資の内訳]

（1万口当たり、税引前）

	第115期		第116期		第117期		第118期	
	自 2023年3月7日 至 2023年4月5日	自 2023年4月6日 至 2023年5月8日	自 2023年4月6日 至 2023年5月8日	自 2023年5月9日 至 2023年6月5日	自 2023年5月9日 至 2023年6月5日	自 2023年6月6日 至 2023年7月5日	自 2023年6月6日 至 2023年7月5日	
当期分配金 (円)	60	60	60	60	60	—	—	
(対基準価額比率) (%)	0.845	0.835	0.835	0.832	0.832	—	—	
当期の収益 (円)	20	33	33	18	18	—	—	
当期の収益以外 (円)	39	26	26	41	41	—	—	
翌期繰越分配対象額 (円)	586	562	562	522	522	—	—	

(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した。

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した。

■今後の運用方針

全コース共通

該当事項はありません。

このたび繰上償還を迎えるにあたりまして、当ファンドへのご愛顧に心より感謝申し上げますとともに、今後とも弊社ファンドをご愛顧賜りますよう、お願い申し上げます。

【Aコース】

■ 1万口当たりの費用明細

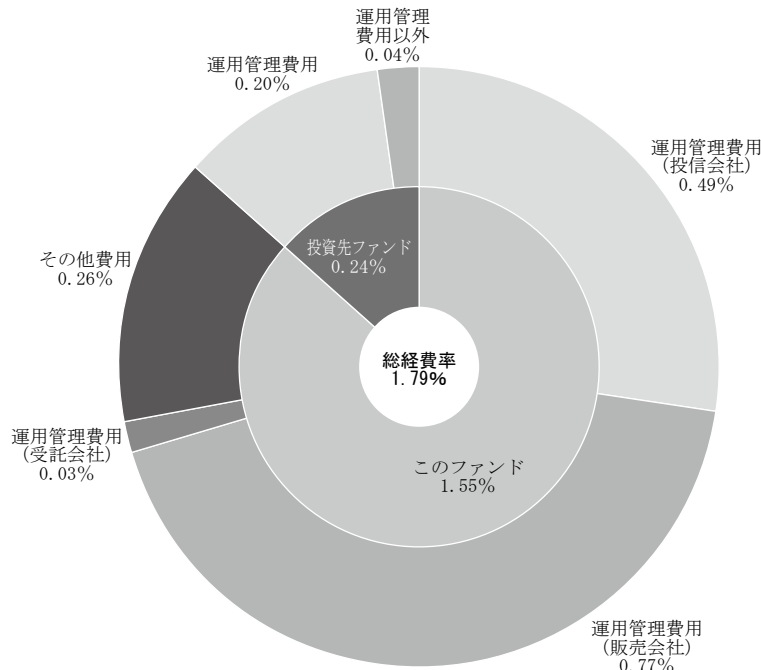
項目	第115期～第119期 (2023年3月7日～2023年7月31日)		項目の概要
	金額	比率	
	平均基準価額	6,006円	
(a) 信託報酬 （投信会社） （販売会社） （受託会社）	31円 (12) (19) (1)	0.519% (0.199) (0.309) (0.011)	(a) 信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率 ・委託した資金の運用の対価 ・交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価 ・運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 募集手数料	—	—	
(c) 売買委託手数料	—	—	(c) 売買委託手数料＝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） （印刷） （その他）	6 (0) (4) (1)	0.104 (0.007) (0.073) (0.024)	(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 ・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	37	0.623	

- * 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、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。
* 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額を作成期間の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

（参考情報）

■総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.79%です。



総経費率（①+②+③）	1.79%
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	0.20%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.04%

- *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（2023年3月7日から2023年7月31日まで）
投資信託証券

決 算 期 銘 柄 名	第 115 期 ～ 第 119 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
	639	40	47,020	3,020

(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

	第 115 期 ～ 第 119 期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	千口 —	千円 —	千口 91	千円 107

(注) 単位未満は切り捨てております。

■利害関係人との取引状況等（2023年3月7日から2023年7月31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
（2023年3月7日から2023年7月31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（2023年3月7日から2023年7月31日まで）

該当事項はありません。

■組入資産の明細（2023年7月31日現在）

償還時（第20作成期末）における有価証券の組入れはありません。第19作成期末の組入れは以下の通りでした。

親投資信託残高

項 目	第19作成期末	
	口 数	評 価 額
マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	千口 91	千円 106

（注）口数・評価額の単位未満は切り捨てております。

■有価証券の貸付及び借入の状況（2023年7月31日現在）

該当事項はありません。

■投資信託財産の構成

（2023年7月31日現在）

項 目	償還時	
	評 価 額	比 率
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	千円 364,970	% 100.0
投 資 信 託 財 産 総 額	364,970	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（償還）価額の状況

項 目	第115期末 2023年4月5日	第116期末 2023年5月8日	第117期末 2023年6月5日	第118期末 2023年7月5日	償還時 2023年7月31日
(A) 資 産	809,010,523円	741,060,722円	572,315,690円	559,560,092円	364,970,941円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	205,182,473	114,855,135	249,360,049	211,707,263	364,970,941
投資信託受益証券(評価額)	306,396,468	316,468,634	167,474,952	—	—
マニュライフ・日本債券 インデックス・ マザーファンド(評価額)	107,087	108,029	107,993	108,642	—
未 収 入 金	297,324,495	309,628,924	155,372,696	347,744,187	—
(B) 負 債	310,496,515	327,359,305	171,392,162	188,113,110	426,082
未 払 金	299,653,632	321,453,216	168,307,160	177,654,522	—
未 払 収 益 分 配 金	2,065,927	1,721,191	1,682,486	—	—
未 払 解 約 金	8,152,611	3,579,945	916,456	9,961,790	10
未 払 信 託 報 酬	540,002	516,969	402,511	408,661	339,104
そ の 他 未 払 費 用	84,343	87,984	83,549	88,137	86,968
(C) 純 資 産 総 額 (A－B)	498,514,008	413,701,417	400,923,528	371,446,982	364,544,859
元 本	826,371,030	688,476,665	672,994,410	623,686,084	612,881,944
次 期 繰 越 損 益 金	△327,857,022	△274,775,248	△272,070,882	△252,239,102	—
償 還 差 損 金	—	—	—	—	△248,337,085
(D) 受 益 権 総 口 数	826,371,030口	688,476,665口	672,994,410口	623,686,084口	612,881,944口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D)	6,033円	6,009円	5,957円	5,956円	—
1 万 口 当 た り 償 還 価 額 (C/D)	—	—	—	—	5,948円04銭

(注1) 当ファンドの第115期首元本額は842,810,220円、第115～119期中追加設定元本額は2,610,692円、第115～119期中一部解約元本額は232,538,968円です。

(注2) 1口当たり純資産額は、第115期0.6033円、第116期0.6009円、第117期0.5957円、第118期0.5956円、第119期0.594804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115期末327,857,022円、第116期末274,775,248円、第117期末272,070,882円、第118期末252,239,102円、償還時248,337,085円です。

■損益の状況

項 目	第115期	第116期	第117期	第118期	第119期
	自 2023年 3月 7日 至 2023年 4月 5日	自 2023年 4月 6日 至 2023年 5月 8日	自 2023年 5月 9日 至 2023年 6月 5日	自 2023年 6月 6日 至 2023年 7月 5日	自 2023年 7月 6日 至 2023年 7月 31日
(A) 配 当 等 収 益	2,103,767円	2,186,307円	1,175,466円	－円	－円
受 取 配 当 金	2,129,580	2,202,824	1,177,188	－	－
受 取 利 息	△ 25,813	△ 16,517	△ 1,722	－	－
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 3,185,908	△ 1,642,492	△ 2,496,183	345,249	△ 49,490
売 買 益	19,795,976	9,427,369	6,187,866	19,349,904	－
売 買 損	△ 22,981,884	△ 11,069,861	△ 8,684,049	△ 19,004,655	△ 49,490
(C) 信 託 報 酬 等	△ 629,003	△ 605,199	△ 489,342	△ 500,092	△ 429,986
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	△ 1,711,144	△ 61,384	△ 1,810,059	△ 154,843	△ 479,476
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△211,518,534	△179,018,089	△176,548,927	△166,643,924	△163,897,407
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△112,561,417	△ 93,974,584	△ 92,029,410	△ 85,440,335	△ 83,960,202
（配 当 等 相 当 額）	（ 37,196）	（ 29,773）	（ 24,948）	（ 22,160）	（ 21,775）
（売 買 損 益 相 当 額）	（△112,598,613）	（△ 94,004,357）	（△ 92,054,358）	（△ 85,462,495）	（△ 83,981,977）
(G) 計 (D+E+F)	△325,791,095	△273,054,057	△270,388,396	△252,239,102	－
(H) 収 益 分 配 金	△ 2,065,927	△ 1,721,191	△ 1,682,486	0	－
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	△327,857,022	△274,775,248	△272,070,882	△252,239,102	－
償 還 差 損 益 金 (D+E+F+H)	－	－	－	－	△248,337,085
追 加 信 託 差 損 益 金	△112,598,604	△ 94,004,188	△ 92,054,311	△ 85,440,335	－
（配 当 等 相 当 額）	（ 9）	（ 169）	（ 47）	（ 22,160）	（ －）
（売 買 損 益 相 当 額）	（△112,598,613）	（△ 94,004,357）	（△ 92,054,358）	（△ 85,462,495）	（ －）
分 配 準 備 積 立 金	38,626,419	32,194,771	30,492,494	28,289,012	－
繰 越 損 益 金	△253,884,837	△212,965,831	△210,509,065	△195,087,779	－

(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115期 計算期間末における費用控除後の配当等収益（1,474,863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（37,196円）および分配準備積立金（39,180,296円）より分配対象収益は40,692,355円（10,000口当たり492円）であり、うち2,065,927円（10,000口当たり25円）を分配金額としております。

第116期 計算期間末における費用控除後の配当等収益（1,581,216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（29,773円）および分配準備積立金（32,305,142円）より分配対象収益は33,916,131円（10,000口当たり492円）であり、うち1,721,191円（10,000口当たり25円）を分配金額としております。

第117期 計算期間末における費用控除後の配当等収益（686,215円）、費用控除後の有価証券等損益額（0円）、信託約款に規定する収益調整金（24,948円）および分配準備積立金（31,463,864円）より分配対象収益は32,175,027円（10,000口当たり478円）であり、うち1,682,486円（10,000口当たり25円）を分配金額としております。

第118期 計算期間末における費用控除後の配当等収益（0円）、費用控除後の有価証券等損益額（0円）、信託約款に規定する収益調整金（22,160円）および分配準備積立金（28,289,012円）より分配対象収益は28,311,172円（10,000口当たり453円）ですが、当計算期間に分配した金額はありません。

■投資信託財産運用総括表

信託期間	投資信託契約締結日	2013年9月12日		投資信託契約終了時の状況		
	投資信託契約終了日	2023年7月31日		資産総額	364,970,941円	
区分	投資信託契約締結当初	投資信託契約終了時	差引増減又は追加信託	負債総額	426,082円	
受益権口数	1,026,780,953口	612,881,944口	△413,899,009口	純資産総額	364,544,859円	
元本額	1,026,780,953円	612,881,944円	△413,899,009円	受益権口数	612,881,944口	
1万口当たり償還金						5,948.04円
毎計算期末の状況						
計算期	元本額	純資産総額	基準価額	1万口当たり分配金		
				金額	分配率	
第1期	1,126,552,483円	1,120,371,880円	9,945円	0円	0.0000%	
第2期	1,226,822,378	1,224,419,305	9,980	0	0.0000	
第3期	1,476,601,484	1,472,300,521	9,971	40	0.4000	
第4期	1,651,024,051	1,646,217,386	9,971	40	0.4000	
第5期	1,740,690,600	1,733,055,153	9,956	40	0.4000	
第6期	1,842,849,626	1,831,882,647	9,940	40	0.4000	
第7期	1,939,142,882	1,924,024,239	9,922	40	0.4000	
第8期	1,995,325,522	1,970,765,409	9,877	40	0.4000	
第9期	2,143,550,176	2,116,505,160	9,874	40	0.4000	
第10期	2,141,701,466	2,114,887,946	9,875	40	0.4000	
第11期	1,558,069,383	1,531,493,617	9,829	40	0.4000	
第12期	1,637,287,267	1,608,733,364	9,826	40	0.4000	
第13期	1,864,158,080	1,807,789,924	9,698	40	0.4000	
第14期	1,933,537,167	1,865,868,871	9,650	40	0.4000	
第15期	2,046,228,872	1,966,302,430	9,609	40	0.4000	
第16期	2,070,263,083	1,959,984,441	9,467	40	0.4000	
第17期	2,054,026,574	1,935,166,339	9,421	40	0.4000	
第18期	2,042,011,487	1,936,415,316	9,483	40	0.4000	
第19期	2,038,497,967	1,924,428,942	9,440	40	0.4000	
第20期	2,015,511,168	1,905,593,939	9,455	40	0.4000	
第21期	1,939,765,016	1,823,008,846	9,398	40	0.4000	
第22期	1,931,676,924	1,802,008,603	9,329	40	0.4000	
第23期	1,830,097,099	1,699,380,780	9,286	40	0.4000	
第24期	1,821,889,002	1,675,588,506	9,197	40	0.4000	
第25期	1,801,921,046	1,634,178,093	9,069	40	0.4000	
第26期	1,754,606,603	1,583,399,837	9,024	40	0.4000	
第27期	1,784,168,159	1,589,233,849	8,907	40	0.4000	
第28期	1,776,011,792	1,561,520,853	8,792	40	0.4000	
第29期	1,760,586,021	1,529,489,111	8,687	40	0.4000	
第30期	1,770,777,044	1,529,906,581	8,640	40	0.4000	
第31期	1,744,098,440	1,524,324,599	8,740	40	0.4000	
第32期	1,735,032,860	1,524,989,874	8,789	40	0.4000	
第33期	1,703,217,472	1,497,491,968	8,792	40	0.4000	
第34期	1,686,858,832	1,470,761,300	8,719	40	0.4000	
第35期	1,606,801,303	1,408,709,444	8,767	40	0.4000	

計 算 期	元 本 額	純 資 産 総 額	基 準 価 額	1 万 口 当 たり 分 配 金	
				金 額	分 配 率
第36期	1,591,317,954円	1,393,558,035円	8,757円	40円	0.4000%
第37期	1,588,523,825	1,388,704,382	8,742	40	0.4000
第38期	1,573,395,592	1,369,477,306	8,704	40	0.4000
第39期	1,569,094,883	1,364,400,164	8,695	40	0.4000
第40期	1,594,555,866	1,390,061,113	8,718	40	0.4000
第41期	1,687,868,533	1,460,015,291	8,650	40	0.4000
第42期	1,717,824,031	1,487,271,410	8,658	40	0.4000
第43期	1,819,198,947	1,562,512,708	8,589	40	0.4000
第44期	1,821,402,618	1,555,354,933	8,539	40	0.4000
第45期	1,836,489,375	1,563,539,849	8,514	40	0.4000
第46期	1,826,863,256	1,548,852,818	8,478	40	0.4000
第47期	1,830,266,781	1,551,710,743	8,478	40	0.4000
第48期	1,744,225,883	1,466,832,719	8,410	40	0.4000
第49期	2,089,852,077	1,749,882,978	8,373	40	0.4000
第50期	2,151,519,332	1,798,638,301	8,360	40	0.4000
第51期	2,111,263,695	1,755,188,064	8,313	40	0.4000
第52期	2,080,844,806	1,725,339,667	8,292	40	0.4000
第53期	2,038,521,166	1,690,817,491	8,294	40	0.4000
第54期	1,992,946,870	1,640,247,908	8,230	40	0.4000
第55期	1,973,049,426	1,615,913,229	8,190	40	0.4000
第56期	1,934,098,283	1,578,947,279	8,164	40	0.4000
第57期	1,951,420,872	1,583,926,435	8,117	40	0.4000
第58期	2,076,341,559	1,671,797,844	8,052	40	0.4000
第59期	2,037,838,550	1,636,248,061	8,029	40	0.4000
第60期	1,980,714,927	1,583,527,280	7,995	40	0.4000
第61期	1,878,690,638	1,502,255,168	7,996	40	0.4000
第62期	1,873,959,898	1,484,382,010	7,921	40	0.4000
第63期	1,831,142,790	1,426,861,235	7,792	40	0.4000
第64期	1,765,293,218	1,343,073,795	7,608	40	0.4000
第65期	1,749,373,645	1,338,899,237	7,654	40	0.4000
第66期	1,735,881,768	1,338,747,955	7,712	40	0.4000
第67期	1,716,384,973	1,311,140,467	7,639	40	0.4000
第68期	1,665,376,605	1,275,872,884	7,661	40	0.4000
第69期	1,625,922,971	1,229,781,008	7,564	40	0.4000
第70期	1,573,752,565	1,185,700,216	7,534	25	0.2500
第71期	1,552,890,270	1,168,878,564	7,527	25	0.2500
第72期	1,525,070,284	1,138,069,119	7,462	25	0.2500
第73期	1,510,399,983	1,119,785,968	7,414	25	0.2500
第74期	1,473,168,028	1,084,540,323	7,362	25	0.2500
第75期	1,429,814,631	1,049,121,588	7,337	25	0.2500
第76期	1,397,885,434	1,030,287,978	7,370	25	0.2500
第77期	1,356,372,716	995,915,680	7,342	25	0.2500
第78期	1,355,222,800	976,071,772	7,202	25	0.2500

計 算 期	元 本 額	純 資 産 総 額	基 準 価 額	1 万 口 当 た り 分 配 金	
				金 額	分 配 率
第79期	1,353,502,748円	851,333,475円	6,290円	25円	0.2500%
第80期	1,353,624,450	877,108,105	6,480	25	0.2500
第81期	1,348,518,376	909,801,329	6,747	25	0.2500
第82期	1,328,749,235	890,577,512	6,702	25	0.2500
第83期	1,371,427,207	928,238,449	6,768	25	0.2500
第84期	1,350,939,679	926,154,325	6,856	25	0.2500
第85期	1,337,570,582	907,725,184	6,786	25	0.2500
第86期	1,327,068,743	900,825,573	6,788	25	0.2500
第87期	1,302,710,372	896,610,336	6,883	25	0.2500
第88期	1,285,409,390	886,951,308	6,900	25	0.2500
第89期	1,264,710,260	875,569,677	6,923	25	0.2500
第90期	1,143,278,661	790,326,929	6,913	25	0.2500
第91期	1,123,336,128	772,178,300	6,874	25	0.2500
第92期	1,112,042,756	762,993,174	6,861	25	0.2500
第93期	1,080,687,925	741,686,289	6,863	25	0.2500
第94期	1,070,856,294	732,744,482	6,843	25	0.2500
第95期	1,062,217,806	722,424,081	6,801	25	0.2500
第96期	1,053,957,456	716,369,236	6,797	25	0.2500
第97期	1,033,017,191	702,306,439	6,799	25	0.2500
第98期	1,022,343,057	691,260,729	6,762	25	0.2500
第99期	1,004,330,793	674,686,838	6,718	25	0.2500
第100期	918,505,680	616,916,306	6,717	25	0.2500
第101期	914,395,460	612,908,564	6,703	25	0.2500
第102期	911,909,014	604,120,505	6,625	25	0.2500
第103期	906,985,011	599,109,861	6,606	25	0.2500
第104期	902,441,256	589,262,524	6,530	25	0.2500
第105期	892,484,271	569,410,775	6,380	25	0.2500
第106期	887,757,947	544,312,801	6,131	25	0.2500
第107期	883,354,435	546,747,516	6,189	25	0.2500
第108期	880,984,589	546,442,144	6,203	25	0.2500
第109期	871,411,379	528,483,883	6,065	25	0.2500
第110期	867,742,460	525,549,001	6,057	25	0.2500
第111期	865,894,438	525,746,581	6,072	25	0.2500
第112期	866,578,209	524,332,783	6,051	25	0.2500
第113期	847,718,315	519,937,048	6,133	25	0.2500
第114期	842,810,220	512,263,161	6,078	25	0.2500
第115期	826,371,030	498,514,008	6,033	25	0.2500
第116期	688,476,665	413,701,417	6,009	25	0.2500
第117期	672,994,410	400,923,528	5,957	25	0.2500
第118期	623,686,084	371,446,982	5,956	0	0.0000

■分配金のお知らせ

決算期	第115期	第116期	第117期	第118期
1万口当たり分配金	25円	25円	25円	0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。

■償還金のお知らせ

1万口当たり償還金	5,948円04銭
-----------	-----------

<課税上の取り扱い>

- ・償還時の差益（償還価額から取得費用（申込手数料（税込）を含む）を控除した利益）については、譲渡所得とみなされ、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率により、申告分離課税が適用されます。
- ・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

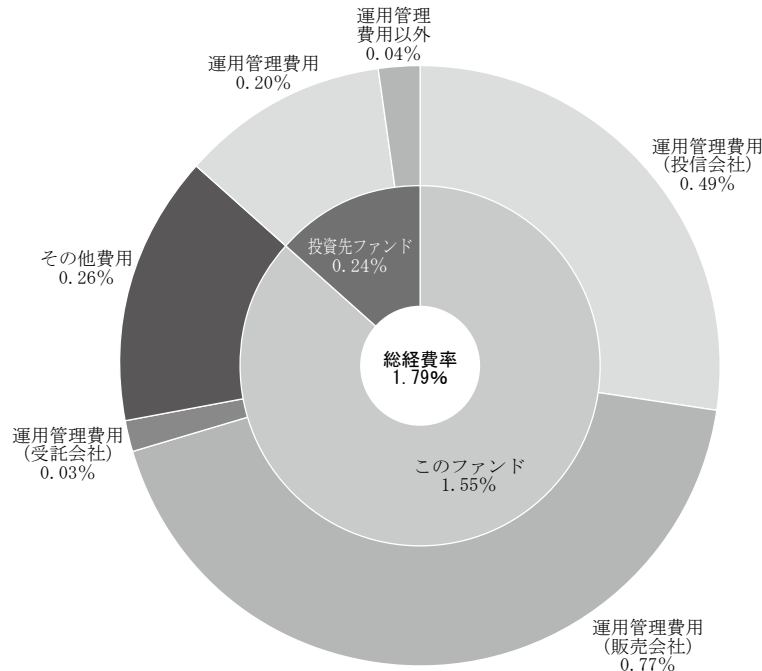
項目	第115期～第119期 (2023年3月7日～2023年7月31日)		項目の概要
	金額	比率	
	平均基準価額	7,193円	
(a) 信託報酬 （投信会社） （販売会社） （受託会社）	37円 (14) (22) (1)	0.519% (0.199) (0.309) (0.011)	(a) 信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率 ・委託した資金の運用の対価 ・交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価 ・運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 募集手数料	—	—	
(c) 売買委託手数料	—	—	(c) 売買委託手数料＝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） （印刷） （その他）	7 (0) (6) (2)	0.104 (0.002) (0.078) (0.024)	(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 ・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	0.623	

- * 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、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。
* 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額を作成期間の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

（参考情報）

■ 総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.79%です。



総経費率（①+②+③）	1.79%
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	0.20%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.04%

- *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（2023年3月7日から2023年7月31日まで）
投資信託証券

決 算 期 銘 柄 名	第 115 期 ～ 第 119 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
	2,239	143	167,766	10,779

（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

	第 115 期 ～ 第 119 期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	千口 —	千円 —	千口 91	千円 107

（注）単位未満は切り捨てております。

■利害関係人との取引状況等（2023年3月7日から2023年7月31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
 （2023年3月7日から2023年7月31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（2023年3月7日から2023年7月31日まで）

該当事項はありません。

■組入資産の明細（2023年7月31日現在）

償還時（第20作成期末）における有価証券の組入れはありません。第19作成期末の組入れは以下の通りでした。

親投資信託残高

項 目	第19作成期末	
	口 数	評 価 額
マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	千口 91	千円 106

（注）口数・評価額の単位未満は切り捨てております。

■有価証券の貸付及び借入の状況（2023年7月31日現在）

該当事項はありません。

■投資信託財産の構成

（2023年7月31日現在）

項 目	償還時	
	評 価 額	比 率
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	千円 1,259,807	% 100.0
投 資 信 託 財 産 総 額	1,259,807	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（償還）価額の状況

項 目	第115期末 2023年4月5日	第116期末 2023年5月8日	第117期末 2023年6月5日	第118期末 2023年7月5日	償還時 2023年7月31日
(A) 資 産	1,828,233,447円	2,097,363,539円	1,386,446,866円	1,904,486,949円	1,259,807,277円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	746,188,579	410,636,064	820,256,110	729,017,856	1,259,807,277
投資信託受益証券(評価額)	1,081,937,781	1,117,504,386	566,082,763	—	—
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)	107,087	108,029	107,993	108,642	—
未 収 入 金	—	569,115,060	—	1,175,360,451	—
(B) 負 債	75,661,523	604,900,791	32,517,285	596,207,726	3,103,201
未 払 金	—	569,624,347	—	587,598,287	—
未 払 収 益 分 配 金	14,928,718	12,564,715	11,358,191	—	—
未 払 解 約 金	58,444,078	20,507,992	19,447,594	6,880,138	1,611,020
未 払 信 託 報 酬	1,971,412	1,873,266	1,402,239	1,406,275	1,172,835
そ の 他 未 払 費 用	317,315	330,471	309,261	323,026	319,346
(C) 純 資 産 総 額 (A－B)	1,752,571,924	1,492,462,748	1,353,929,581	1,308,279,223	1,256,704,076
元 本	2,488,119,751	2,094,119,295	1,893,031,857	1,801,502,636	1,732,617,542
次 期 繰 越 損 益 金	△ 735,547,827	△ 601,656,547	△ 539,102,276	△ 493,223,413	—
償 還 差 損 金	—	—	—	—	△ 475,913,466
(D) 受 益 権 総 口 数	2,488,119,751口	2,094,119,295口	1,893,031,857口	1,801,502,636口	1,732,617,542口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D)	7,044円	7,127円	7,152円	7,262円	—
1 万 口 当 た り 償 還 価 額 (C/D)	—	—	—	—	7,253円21銭

(注1) 当ファンドの第115期首元本額は2,613,670,291円、第115～119期中追加設定元本額は37,038,514円、第115～119期中一部解約元本額は918,091,263円です。

(注2) 1口当たり純資産額は、第115期0.7044円、第116期0.7127円、第117期0.7152円、第118期0.7262円、第119期0.725321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115期末735,547,827円、第116期末601,656,547円、第117期末539,102,276円、第118期末493,223,413円、償還時475,913,466円です。

■損益の状況

項 目	第115期	第116期	第117期	第118期	第119期
	自 2023年3月7日 至 2023年4月5日	自 2023年4月6日 至 2023年5月8日	自 2023年5月9日 至 2023年6月5日	自 2023年6月6日 至 2023年7月5日	自 2023年7月6日 至 2023年7月31日
(A) 配 当 等 収 益	7,293,518円	7,629,790円	3,925,182円	－円	－円
受 取 配 当 金	7,519,911	7,778,545	3,979,022	－	－
受 取 利 息	△ 226,393	△ 148,755	△ 53,840	－	－
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 39,752,169	24,087,267	13,662,492	21,410,811	△ 156,401
売 買 益	1,530,108	26,586,287	20,332,881	21,417,148	11
売 買 損	△ 41,282,277	△ 2,499,020	△ 6,670,389	△ 6,337	△ 156,412
(C) 信 託 報 酬 等	△ 2,283,865	△ 2,195,653	△ 1,705,668	△ 1,723,938	△ 1,488,246
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	△ 34,742,516	29,521,404	15,882,006	19,686,823	△ 1,644,647
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△171,379,074	△184,058,722	△150,173,493	△137,903,066	△113,595,746
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△514,497,519	△434,554,514	△393,452,598	△375,007,170	△360,673,073
（配 当 等 相 当 額）	（ 1,267,602）	（ 315,828）	（ 243,839）	（ 239,755）	（ 234,767）
（売 買 損 益 相 当 額）	（△515,765,121）	（△434,870,342）	（△393,696,437）	（△375,246,925）	（△360,907,840）
(G) 計 (D+E+F)	△720,619,109	△589,091,832	△527,744,085	△493,223,413	－
(H) 収 益 分 配 金	△ 14,928,718	△ 12,564,715	△ 11,358,191	0	－
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	△735,547,827	△601,656,547	△539,102,276	△493,223,413	－
償 還 差 損 益 金 (D+E+F+H)	－	－	－	－	△475,913,466
追 加 信 託 差 損 益 金	△515,763,972	△434,868,632	△393,694,906	△375,007,170	－
（配 当 等 相 当 額）	（ 1,149）	（ 1,710）	（ 1,531）	（ 239,755）	（ －）
（売 買 損 益 相 当 額）	（△515,765,121）	（△434,870,342）	（△393,696,437）	（△375,246,925）	（ －）
分 配 準 備 積 立 金	145,830,773	117,724,599	98,862,022	93,967,223	－
繰 越 損 益 金	△365,614,628	△284,512,514	△244,269,392	△212,183,466	－

(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115期 計算期間末における費用控除後の配当等収益（5,009,750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（1,267,602円）および分配準備積立金（154,483,288円）より分配対象収益は160,760,640円（10,000口当たり646円）であり、うち14,928,718円（10,000口当たり60円）を分配金額としております。

第116期 計算期間末における費用控除後の配当等収益（7,101,621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（315,828円）および分配準備積立金（122,873,575円）より分配対象収益は130,291,024円（10,000口当たり622円）であり、うち12,564,715円（10,000口当たり60円）を分配金額としております。

第117期 計算期間末における費用控除後の配当等収益（3,544,566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（243,839円）および分配準備積立金（106,433,339円）より分配対象収益は110,221,744円（10,000口当たり582円）であり、うち11,358,191円（10,000口当たり60円）を分配金額としております。

第118期 計算期間末における費用控除後の配当等収益（97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（239,755円）および分配準備積立金（93,967,126円）より分配対象収益は94,206,978円（10,000口当たり522円）ですが、当計算期間に分配した金額はありません。

■投資信託財産運用総括表

信託期間	投資信託契約締結日	2013年9月12日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2023年7月31日		資産総額	1,259,807,277円
区分	投資信託契約締結当初	投資信託契約終了時	差引増減又は追加信託	負債総額	3,103,201円
受益権口数	675,322,466口	1,732,617,542口	1,057,295,076口	純資産総額	1,256,704,076円
元本額	675,322,466円	1,732,617,542円	1,057,295,076円	受益権口数	1,732,617,542口
元本額				1万口当たり償還金	7,253.21円
毎計算期末の状況					
計算期	元本額	純資産総額	基準価額	1万口当たり分配金	
				金額	分配率
第1期	1,602,772,758円	1,555,976,535円	9,708円	0円	0.0000%
第2期	2,077,958,794	2,052,048,963	9,875	0	0.0000
第3期	2,730,258,942	2,798,694,602	10,251	40	0.4000
第4期	3,561,869,916	3,731,747,295	10,477	40	0.4000
第5期	4,294,942,603	4,366,854,705	10,167	40	0.4000
第6期	4,497,458,361	4,595,964,965	10,219	40	0.4000
第7期	4,810,957,656	4,953,624,108	10,297	40	0.4000
第8期	4,761,682,544	4,809,539,773	10,101	40	0.4000
第9期	5,048,491,210	5,150,623,160	10,202	40	0.4000
第10期	5,139,745,887	5,222,697,504	10,161	40	0.4000
第11期	5,213,153,200	5,291,750,061	10,151	40	0.4000
第12期	5,528,399,264	5,768,471,499	10,434	40	0.4000
第13期	5,350,325,015	5,727,663,216	10,705	40	0.4000
第14期	5,427,459,471	5,990,381,146	11,037	40	0.4000
第15期	5,604,427,433	6,489,100,481	11,579	40	0.4000
第16期	6,403,890,707	7,343,873,174	11,468	40	0.4000
第17期	6,709,458,732	7,474,223,377	11,140	40	0.4000
第18期	6,880,595,051	7,885,421,764	11,460	40	0.4000
第19期	7,252,082,353	8,233,106,096	11,353	40	0.4000
第20期	7,404,623,421	8,447,283,148	11,408	40	0.4000
第21期	7,416,349,419	8,774,504,522	11,831	40	0.4000
第22期	7,654,684,982	8,862,080,655	11,577	40	0.4000
第23期	7,948,358,683	9,304,461,036	11,706	40	0.4000
第24期	8,184,610,319	9,108,344,837	11,129	40	0.4000
第25期	8,217,628,268	9,100,101,210	11,074	40	0.4000
第26期	8,286,114,600	9,253,507,897	11,167	40	0.4000
第27期	8,128,915,083	9,099,982,627	11,195	40	0.4000
第28期	7,762,846,478	8,305,442,284	10,699	60	0.6000
第29期	7,766,878,541	8,054,578,573	10,370	60	0.6000
第30期	7,787,473,443	7,802,884,233	10,020	60	0.6000
第31期	7,800,578,075	7,720,271,103	9,897	60	0.6000
第32期	7,839,026,598	7,552,640,811	9,635	60	0.6000
第33期	7,756,579,448	7,412,957,071	9,557	60	0.6000
第34期	7,744,978,927	7,051,318,738	9,104	60	0.6000
第35期	7,590,760,367	6,867,400,229	9,047	60	0.6000

計 算 期	元 本 額	純 資 産 総 額	基 準 価 額	1 万 口 当 たり 分 配 金	
				金 額	分 配 率
第36期	7,589,283,231円	7,028,892,464円	9,262円	60円	0.6000%
第37期	7,630,151,552	6,974,523,419	9,141	60	0.6000
第38期	7,663,997,301	7,047,350,024	9,195	60	0.6000
第39期	7,501,474,202	7,520,999,133	10,026	60	0.6000
第40期	7,337,563,545	7,559,365,435	10,302	60	0.6000
第41期	7,500,514,841	7,399,184,205	9,865	60	0.6000
第42期	7,696,760,277	7,690,107,796	9,991	60	0.6000
第43期	8,020,409,781	7,743,082,669	9,654	60	0.6000
第44期	8,039,586,491	7,846,775,334	9,760	60	0.6000
第45期	8,016,067,254	7,645,650,219	9,538	60	0.6000
第46期	7,995,610,737	7,766,602,250	9,714	60	0.6000
第47期	7,961,704,598	7,571,536,662	9,510	60	0.6000
第48期	7,950,501,062	7,429,540,333	9,345	60	0.6000
第49期	8,177,825,790	7,820,981,726	9,564	60	0.6000
第50期	8,066,805,310	7,804,959,573	9,675	60	0.6000
第51期	7,978,671,277	7,550,974,219	9,464	60	0.6000
第52期	7,909,509,280	7,492,612,911	9,473	60	0.6000
第53期	7,770,972,116	7,175,320,153	9,233	60	0.6000
第54期	7,758,044,844	6,834,462,340	8,810	60	0.6000
第55期	7,677,314,067	6,810,146,832	8,870	60	0.6000
第56期	7,570,557,476	6,824,243,715	9,014	60	0.6000
第57期	7,453,788,812	6,737,869,093	9,040	60	0.6000
第58期	7,354,656,840	6,626,823,111	9,010	60	0.6000
第59期	7,216,676,386	6,533,466,664	9,053	60	0.6000
第60期	7,103,757,724	6,421,211,983	9,039	60	0.6000
第61期	6,760,406,021	6,254,162,178	9,251	60	0.6000
第62期	6,571,514,816	5,978,668,938	9,098	60	0.6000
第63期	6,282,344,839	5,610,383,262	8,930	60	0.6000
第64期	6,177,303,529	5,194,298,721	8,409	60	0.6000
第65期	6,137,289,808	5,266,283,767	8,581	60	0.6000
第66期	6,006,962,232	5,281,961,860	8,793	60	0.6000
第67期	5,863,311,118	5,107,416,076	8,711	60	0.6000
第68期	5,674,320,196	4,913,402,355	8,659	60	0.6000
第69期	5,615,281,928	4,694,465,321	8,360	60	0.6000
第70期	5,473,849,426	4,542,018,084	8,298	60	0.6000
第71期	5,383,577,923	4,393,536,985	8,161	60	0.6000
第72期	5,273,958,667	4,261,727,356	8,081	60	0.6000
第73期	5,133,681,402	4,126,762,061	8,039	60	0.6000
第74期	4,990,196,545	4,047,930,320	8,112	60	0.6000
第75期	4,765,727,997	3,848,724,958	8,076	60	0.6000
第76期	4,570,726,448	3,676,961,734	8,045	60	0.6000
第77期	4,439,194,637	3,591,642,549	8,091	60	0.6000
第78期	4,373,584,496	3,400,550,753	7,775	60	0.6000

計 算 期	元 本 額	純 資 産 総 額	基 準 価 額	1 万 口 当 た り 分 配 金	
				金 額	分 配 率
第79期	4,303,566,245円	2,955,391,939円	6,867円	60円	0.6000%
第80期	4,307,322,414	2,956,760,395	6,864	60	0.6000
第81期	4,312,760,495	3,148,785,379	7,301	60	0.6000
第82期	4,273,984,607	3,049,540,037	7,135	60	0.6000
第83期	4,219,157,193	2,969,113,483	7,037	60	0.6000
第84期	4,170,818,850	2,979,681,111	7,144	60	0.6000
第85期	4,101,936,976	2,867,744,416	6,991	60	0.6000
第86期	4,037,822,120	2,776,233,277	6,876	60	0.6000
第87期	3,924,296,458	2,718,367,853	6,927	60	0.6000
第88期	3,836,631,573	2,629,474,661	6,854	60	0.6000
第89期	3,805,483,380	2,663,494,397	6,999	60	0.6000
第90期	3,759,292,758	2,671,455,531	7,106	60	0.6000
第91期	3,719,943,189	2,682,797,021	7,212	60	0.6000
第92期	3,682,574,787	2,608,403,070	7,083	60	0.6000
第93期	3,627,832,188	2,564,033,207	7,068	60	0.6000
第94期	3,632,828,489	2,584,053,021	7,113	60	0.6000
第95期	3,552,961,616	2,467,405,145	6,945	60	0.6000
第96期	3,553,838,372	2,458,452,116	6,918	60	0.6000
第97期	3,531,738,198	2,454,644,112	6,950	60	0.6000
第98期	3,399,069,611	2,399,250,939	7,059	60	0.6000
第99期	3,314,592,228	2,299,707,718	6,938	60	0.6000
第100期	3,270,399,840	2,319,856,955	7,093	60	0.6000
第101期	3,221,892,100	2,252,201,285	6,990	60	0.6000
第102期	3,148,564,023	2,160,886,751	6,863	60	0.6000
第103期	3,077,265,132	2,232,337,646	7,254	60	0.6000
第104期	3,034,154,923	2,304,120,067	7,594	60	0.6000
第105期	2,965,387,170	2,198,155,694	7,413	60	0.6000
第106期	2,853,490,157	2,108,907,842	7,391	60	0.6000
第107期	2,870,083,657	2,091,024,294	7,286	60	0.6000
第108期	2,818,262,421	2,161,779,694	7,671	60	0.6000
第109期	2,802,713,067	2,151,862,300	7,678	60	0.6000
第110期	2,784,704,808	2,179,268,498	7,826	60	0.6000
第111期	2,678,627,827	1,931,308,912	7,210	60	0.6000
第112期	2,657,134,722	1,873,257,690	7,050	60	0.6000
第113期	2,641,546,975	1,891,582,138	7,161	60	0.6000
第114期	2,613,670,291	1,893,047,826	7,243	60	0.6000
第115期	2,488,119,751	1,752,571,924	7,044	60	0.6000
第116期	2,094,119,295	1,492,462,748	7,127	60	0.6000
第117期	1,893,031,857	1,353,929,581	7,152	60	0.6000
第118期	1,801,502,636	1,308,279,223	7,262	0	0.0000

■分配金のお知らせ

決算期	第115期	第116期	第117期	第118期
1万口当たり分配金	60円	60円	60円	0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。

■償還金のお知らせ

1万口当たり償還金	7,253円21銭
-----------	-----------

<課税上の取り扱い>

- ・償還時の差益（償還価額から取得費用（申込手数料（税込）を含む）を控除した利益）については、譲渡所得とみなされ、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率により、申告分離課税が適用されます。
- ・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
	(2023年3月7日～2023年7月31日)		
	金額	比率	
平均基準価額	9,626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）	50円 (19) (30) (1)	0.519% (0.199) (0.309) (0.011)	(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） （印刷） （その他）	18 (9) (7) (3)	0.188 (0.094) (0.068) (0.026)	(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 ・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	68	0.707	

* 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。

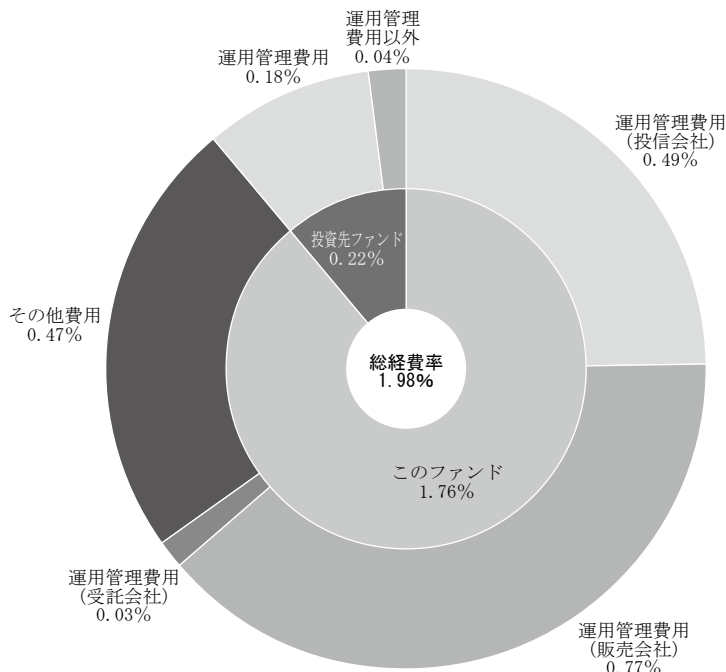
* 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

* 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	1.76%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.18%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.04%

- *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（2023年3月7日から2023年7月31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 55	千米ドル 3	口 4,138	千米ドル 265

(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

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	千口 —	千円 —	千口 91	千円 107

(注) 単位未満は切り捨てております。

■利害関係人との取引状況等（2023年3月7日から2023年7月31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

(2023年3月7日から2023年7月31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（2023年3月7日から2023年7月31日まで）

該当事項はありません。

■組入資産の明細 (2023年7月31日現在)

償還時 (期末) における有価証券の組入れはありません。期首 (前期末) の組入れは以下の通りでした。

親投資信託残高

項 目	期首 (前期末)	
	口 数	評 価 額
マニュライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	千口 91	千円 106

(注) 口数・評価額の単位未満は切り捨てております。

■有価証券の貸付及び借入の状況 (2023年7月31日現在)

該当事項はありません。

■投資信託財産の構成

(2023年7月31日現在)

項 目	償還時	
	評 価 額	比 率
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	千円 38,302	% 100.0
投 資 信 託 財 産 総 額	38,302	100.0

(注) 金額の単位未満は切り捨てております。

■資産、負債、元本及び償還価額の状況

項 目	償還時 2023年7月31日
(A) 資 産	38,302,230円
コール・ローン等	38,302,230
(B) 負 債	242,558
未払信託報酬	211,388
その他未払費用	31,170
(C) 純資産総額(A-B)	38,059,672
元 本	39,690,122
償還差損金	△ 1,630,450
(D) 受益権総口数	39,690,122口
1万口当たり償還価額(C/D)	9,589円21銭

- (注1) 当ファンドの期首元本額は47,510,948円、期中追加設定元本額は194,626円、期中一部解約元本額は8,015,452円です。
(注2) 1口当たり純資産額は0.958921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1,630,450円です。

■損益の状況

項 目	当 期 自 2023年3月7日 至 2023年7月31日
(A) 配 当 等 収 益	472,979円
受 取 配 当 金	490,412
受 取 利 息	△ 17,433
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 567,997
売 買 益	2,774,101
売 買 損	△3,342,098
(C) 信 託 報 酬 等	△ 287,934
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 382,952
(E) 前期繰越損益金	△1,515,657
(F) 追加信託差損益金	268,159
(配当等相当額)	(5,546,507)
(売買損益相当額)	(△5,278,348)
償還差損金(D+E+F)	△1,630,450

- (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。

■投資信託財産運用総括表

信託期間	投資信託契約締結日	2013年9月12日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2023年7月31日		資産総額	38,302,230円
区分	投資信託契約締結当初	投資信託契約終了時	差引増減又は追加信託	負債総額	242,558円
受益権口数	501,091,474口	39,690,122口	△461,401,352口	純資産総額	38,059,672円
				受益権口数	39,690,122口
元本額	501,091,474円	39,690,122円	△461,401,352円	1万円当たり償還金	9,589.21円
毎計算期末の状況					
計算期	元本額	純資産総額	基準価額	1万円当たり分配金	
				金額	分配率
第1期	598,971,561円	604,871,098円	10,098円	0円	0.0000%
第2期	215,961,723	221,403,960	10,252	0	0.0000
第3期	286,047,789	289,958,717	10,137	0	0.0000
第4期	346,139,666	348,772,110	10,076	0	0.0000
第5期	344,298,569	334,676,555	9,721	0	0.0000
第6期	348,701,296	352,708,826	10,115	0	0.0000
第7期	342,025,721	351,387,858	10,274	0	0.0000
第8期	278,360,654	285,623,189	10,261	0	0.0000
第9期	246,013,438	254,059,042	10,327	0	0.0000
第10期	170,424,804	176,017,485	10,328	0	0.0000
第11期	154,510,829	158,860,852	10,282	0	0.0000
第12期	128,585,352	131,232,217	10,206	0	0.0000
第13期	105,443,606	106,069,635	10,059	0	0.0000
第14期	93,392,792	91,252,470	9,771	0	0.0000
第15期	69,460,997	69,899,272	10,063	0	0.0000
第16期	64,841,082	65,550,166	10,109	0	0.0000
第17期	56,662,767	57,070,291	10,072	0	0.0000
第18期	51,222,629	49,428,508	9,650	0	0.0000
第19期	47,510,948	46,002,095	9,682	0	0.0000

■償還金のお知らせ

1万円当たり償還金	9,589円21銭
-----------	-----------

<課税上の取り扱い>

- ・償還時の差益（償還価額から取得費用（申込手数料（税込）を含む）を控除した利益）については、譲渡所得とみなされ、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率により、申告分離課税が適用されます。
- ・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。

【Dコース】

■ 1万円当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2023年3月7日～2023年7月31日)		
	金額	比率	
平均基準価額	14,919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）	77円 (30) (46) (2)	0.519% (0.199) (0.309) (0.011)	(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） （印刷） （その他）	17 (3) (10) (4)	0.115 (0.022) (0.067) (0.027)	(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 ・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	94	0.634	

* 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。

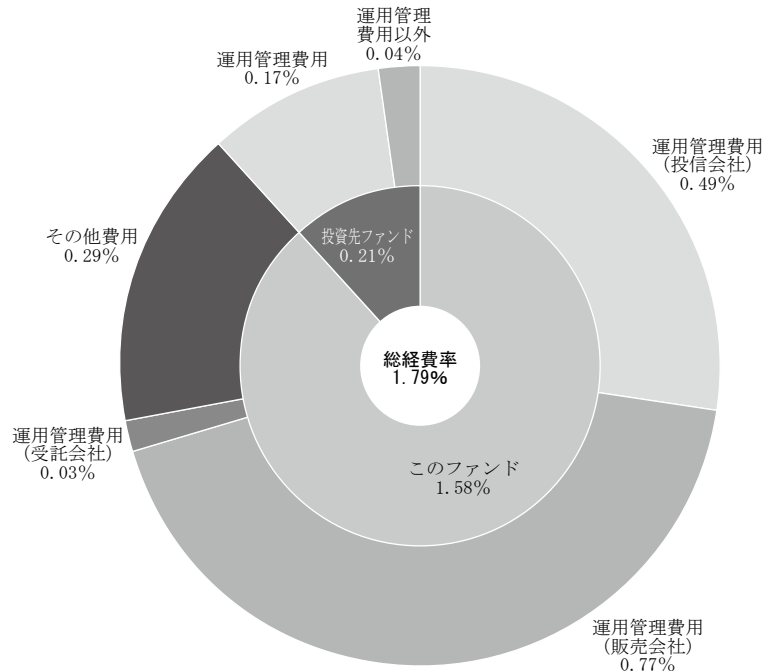
* 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

* 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1.79%です。



総経費率（①+②+③）	1.79%
①このファンドの費用の比率	1.58%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.17%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.04%

- *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（2023年3月7日から2023年7月31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 145	千米ドル 9	口 11,246	千米ドル 722

(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

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	千口 —	千円 —	千口 91	千円 107

(注) 単位未満は切り捨てております。

■利害関係人との取引状況等（2023年3月7日から2023年7月31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

(2023年3月7日から2023年7月31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（2023年3月7日から2023年7月31日まで）

該当事項はありません。

■組入資産の明細（2023年7月31日現在）

償還時（期末）における有価証券の組入れはありません。期首（前期末）の組入れは以下の通りでした。

親投資信託残高

項 目	期首（前期末）	
	口 数	評 価 額
マニュライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	千口 91	千円 106

（注）口数・評価額の単位未満は切り捨てております。

■有価証券の貸付及び借入の状況（2023年7月31日現在）

該当事項はありません。

■投資信託財産の構成

（2023年7月31日現在）

項 目	償還時	
	評 価 額	比 率
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	千円 102,068	% 100.0
投 資 信 託 財 産 総 額	102,068	100.0

（注）金額の単位未満は切り捨てております。

■資産、負債、元本及び償還価額の状況

項 目	償還時 2023年7月31日
(A) 資 産	102,068,332円
コール・ローン等	102,068,332
(B) 負 債	668,111
未払信託報酬	584,117
その他未払費用	83,994
(C) 純資産総額(A-B)	101,400,221
元 本	66,977,794
償還差益金	34,422,427
(D) 受益権総口数	66,977,794口
1万口当たり償還価額(C/D)	15,139円38銭

(注1) 当ファンドの期首元本額は84,814,196円、期中追加設定元本額は1,874,587円、期中一部解約元本額は19,710,989円です。

(注2) 1口当たり純資産額は1,513938円です。

■損益の状況

項 目	当 期 自 2023年3月7日 至 2023年7月31日
(A) 配 当 等 収 益	1,174,222円
受 取 配 当 金	1,189,947
受 取 利 息	△ 15,725
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	1,153,632
売 買 益	2,073,813
売 買 損	△ 920,181
(C) 信 託 報 酬 等	△ 713,597
(D) 当期損益金(A+B+C)	1,614,257
(E) 前期繰越損益金	17,079,905
(F) 追加信託差損益金	15,728,265
(配当等相当額)	(23,095,213)
(売買損益相当額)	(△ 7,366,948)
償還差益金(D+E+F)	34,422,427

(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。

■投資信託財産運用総括表

信託期間	投資信託契約締結日	2013年9月12日			投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2023年7月31日			資産総額	102,068,332円
区分	投資信託契約締結当初	投資信託契約終了時	差引増減又は追加信託	負債総額	668,111円	
受益権口数	519,851,962口	66,977,794口	△452,874,168口	純資産総額	101,400,221円	
				受益権口数	66,977,794口	
元本額	519,851,962円	66,977,794円	△452,874,168円	1万口当たり償還金	15,139.38円	
毎計算期末の状況						
計算期	元本額	純資産総額	基準価額	1万口当たり分配金		
				金額	分配率	
第1期	617,258,703円	639,648,240円	10,363円	0円	0.0000%	
第2期	248,650,355	270,120,544	10,863	0	0.0000	
第3期	358,894,814	436,314,622	12,157	0	0.0000	
第4期	432,970,510	521,138,734	12,036	0	0.0000	
第5期	473,558,961	527,538,375	11,140	0	0.0000	
第6期	470,860,444	503,479,600	10,693	0	0.0000	
第7期	396,664,416	473,930,936	11,948	0	0.0000	
第8期	389,985,082	452,230,191	11,596	0	0.0000	
第9期	358,483,899	406,779,549	11,347	0	0.0000	
第10期	343,226,371	415,468,022	12,105	0	0.0000	
第11期	288,771,145	354,042,826	12,260	0	0.0000	
第12期	236,297,379	277,795,374	11,756	0	0.0000	
第13期	197,218,686	233,229,722	11,826	0	0.0000	
第14期	190,667,278	218,193,283	11,444	0	0.0000	
第15期	163,867,711	196,462,565	11,989	0	0.0000	
第16期	132,948,011	163,215,329	12,277	0	0.0000	
第17期	122,671,443	157,095,371	12,806	0	0.0000	
第18期	91,939,492	138,255,959	15,038	0	0.0000	
第19期	84,814,196	126,314,062	14,893	0	0.0000	

■償還金のお知らせ

1万口当たり償還金	15,139円38銭
-----------	------------

<課税上の取り扱い>

- ・償還時の差益（償還価額から取得費用（申込手数料（税込）を含む）を控除した利益）については、譲渡所得とみなされ、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率により、申告分離課税が適用されます。
- ・法人の場合は異なります。

※税法が改正された場合等は、上記内容が変更になる場合があります。

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

お知らせ

◆約款変更

該当事項はありません。

◆運用体制の変更

該当事項はありません。

<参考情報>

■組入投資信託証券の概要

MIT-フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA

管 理 会 社	マニュライフ・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	マニュライフ・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・リターンへの獲得をめざします。 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	7.72%
直接利回り	8.24%
最終利回り	9.37%
平均デュレーション	-0.03年
残存年数	4.47年
平均格付け	BB-

※現地の2022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95銘柄）

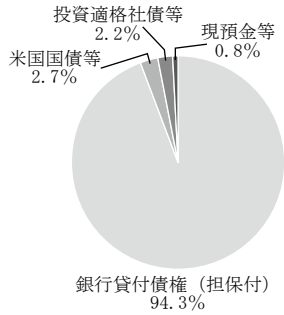
	銘柄名	組入比率
1	米国国債	2.73%
2	ゴールドマン・サックス・グループ	2.24%
3	アメリカン航空	2.13%
4	ウーバー・テクノロジーズ	2.08%
5	スカイマイルズ I P	1.91%
6	セジック・クレイムス・マネジメント・サービス・インク	1.69%
7	APコア・ホールディングス II	1.66%
8	エブリ・ホールディングス	1.65%
9	ビクトリー・キャピタル・ホールディングス	1.64%
10	パクティブ・エバグリーン	1.59%

※現地の2022年12月最終営業日のデータです。

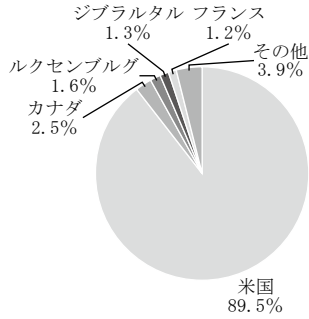
※組入比率は純資産総額に対する比率です。

※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。

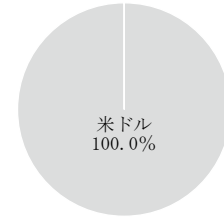
○資産別配分



○国・地域別配分



○通貨別配分



※現地の2022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「MIT-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12月31日まで)

(単位：米ドル)

マネジメントフィー	88,423
カストディーフィー等	11,110
トラスティーフィー	12,000
監査報酬等	38,387
評価手数料	24,900
取引手数料	2,972
年間権限費用	1,337
会計及びその他専門家費用	4,908
その他費用	18,120
費用合計	202,157

■有価証券明細表 2022年12月31日

銀行貸付種(米ドル建)

銘柄名	数量	評価額(米ドル)	投資比率(%)
CAMELOT US ACQUISITION LLC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR BBA 3M+300BPS	420,000.00	414,278	2.18
ADVANTAGE LOYALTY IP TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +475BPS 2403/2028	400,000.00	398,750	2.10
UBER TECHNOLOGIES INC TRANCHE B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +350BPS	393,984.26	394,231	2.07
SKYMILES IP LTD TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +375BPS 16/09/2027	350,000.00	357,347	1.88
SEDGWICK CDS INC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR BBA 3M + 325BPS	331,750.23	323,368	1.70
AP CORE HOLDINGS II LLC TRANCHE B2 TERM LOAN USD-LIBOR-BBA	350,000.00	316,094	1.66
EVERI PAYMENTS INC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M+250BPS 30/06/2028	316,306.35	314,198	1.65
VICTORY CAPITAL HOLDINGS TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M + 350BPS	309,658.70	308,240	1.62
FACTIV EVERGREEN GROUP TRANCHE B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M + 350BPS	307,722.95	304,501	1.60
SELECT MEDICAL CORP TERM B TERM LOAN USD-LIBOR BBA 3M +250BPS	307,664.16	302,713	1.59
DELTA 2 LUX SARL TERM B TERM LOAN USD LIBOR-BBA 3M+325BPS 15/01/2030	300,000.00	299,625	1.58
LCPR LOAN FINANCING LLC TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +375BPS 31/12/2049	300,000.00	297,844	1.57
AXALTA COATING SYSTEMS US H TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M+ 300BPS	300,000.00	296,438	1.56
VIRGIN MEDIA BRISTOL LLC TRANCHE N TERM LOAN USD-LIBOR-BBA +250 BPS	300,000.00	295,406	1.55
J&J VENTURES GAMING LLC TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M + 400BPS 07/04/202	306,900.00	294,240	1.55
EDELMAN FINANCIAL CENTER TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +375BPS	308,890.33	289,861	1.53
ARCHES BUYER INC TERM LOAN USD-LIBO R-BBA 3M +325BPS 06/12/2027	303,800.00	281,964	1.48
RH TRANCHE B TERM LOAN-LIBOR-BBA 3M + 250BPS 15/10/2028	297,748.11	274,487	1.44
MA FINANCECO LLC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +425BPS 05/06/2025	263,909.56	263,745	1.39
TEMPO ACQUISITION LLC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M+300BPS	262,533.67	261,987	1.38
BWAY CORP TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +325BPS	267,185.66	261,341	1.38
AUSTIN BIDCO INC TRANCHE B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +450BPS	265,661.21	257,359	1.35
QUORUM HEALTH CORP TERM LOAN USD-LIBOR BBA 3M +825BPS 29/04/2025	357,997.30	252,985	1.33
TTF HOLDINGS LLC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +425BPS 26/03/2028	253,829.92	250,974	1.32
ENTAIN HOLDINGS GIBRALTA TRANCHE B2 TERM LOAN (USD LIBOR BBA 3M+)	250,000.00	249,063	1.31
CORELOGIC INC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +350BPS 14/04/2028	297,000.00	247,809	1.30
GATES GLOBAL LLC TERM LOAN USD-LIBO R-BBA 3M +275BPS 31/03/2027	250,139.80	245,293	1.29
OPEN TEXT CORP TERM DD TERM LOAN USD LIBOR-BBA 3M+350BPS 25/08/2029	250,000.00	244,531	1.29
HERTZ CORP/THE TERM B TERM LOAN USD-LIBOR BBA 3M 350BPS 14/06/2028	246,875.00	242,863	1.28
CARNIVAL CORP TERM B TERM LOAN-LIBO R-BBA 3M +300BPS 30/06/2025	246,221.68	236,373	1.24
ALLIED UNIVERSAL HOLDCO LLC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +375BPS	247,500.00	235,403	1.24
PLAYTKA HOLDING CORP TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +275BPS	245,755.04	235,123	1.24
DIRECTV FINANCING LLC TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +500BPS 22/07/2027	240,552.28	234,369	1.23
CORNERSTONE BUILDING TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +325BPS	255,292.65	230,322	1.21
BAUSCH + LOMB CORP TRACHE B TERM LOAN USD-LIBOR BBA 3M+325BPS	239,400.00	228,627	1.20
ALTICE FRANCE SA TRANCHE B14 TERM LOAN USD-LIBOR-BBA +550 BPS	242,002.51	226,474	1.19
GARDA WORLD SECURITY CORP TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M+425BPS	229,791.38	224,334	1.18
HILTON GRAND VAC BORROWER TERM B USD-LIBOR-BBA-3M +300BPS 20/05/2028	222,563.91	221,312	1.16
HUNTER DOUGLAS INC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M+ 350BPS 09/02/2029	249,375.00	220,697	1.16
SOTHEBY'S TERM B TERM LOAN USD-LIBO R BBA 3M +450BPS 15/01/2027	224,963.35	220,089	1.16
TRIDENT TPI HOLDINGS INC TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +400BPS 29/07/2028	221,667.75	213,395	1.12
QUASAR INTERMEDIATE HOLD TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA3M 425	275,310.00	212,849	1.12
RADIATE HOLDCO LLC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA3M 325BPS 25/09/2026	248,125.00	202,842	1.07
ZOOMINFO LLC TERM B TERM LOAN USD LIBOR-BBA 3M+300BPS 01/02/2026	200,000.00	199,500	1.05
MOZART BORROWER LP TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA +325BPS 30/09/2028	208,950.00	198,907	1.05
MATCH GROUP INC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M + 175BPS	200,000.00	196,692	1.04
APX GROUP INC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M+ 375BPS	197,627.82	195,800	1.03
UNITED AIRLINES INC TRANCHE B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA +375BPS	197,000.00	194,948	1.03
VERTIV GROUP CORP TRANCHE B TERM LOAN USD LIBOR BBA +3M 275BPS	200,000.00	193,550	1.02
TK ELEVATOR MIDCO GMBH TRANCHE B TERM LOAN-USD LIBOR BBA +3M 350BPS	200,000.00	193,036	1.02
NCR CORP TERM B TERM LOAN USD LIBOR-BBA 3M+250BPS 28/08/2026	198,093.19	192,976	1.02
BAUSCH HEALTH COS INC TERM B TERM LOAN USD LIBOR-BBA 3M+ 325BPS	246,875.00	191,328	1.01
MAMBA PURCHASER INC TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M + 375BPS 29/09/202	199,000.00	190,294	1.00
CONSOLIDATED COMMUNICATIONS TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA-3M +350BPS	214,201.41	190,014	1.00
CNT HOLDINGS I CORP TRANCHE B TERM LOAN USD-LIBOR BBA 3M +375BPS	195,500.00	189,635	1.00
CARNIVAL CORP TERM B TERM LOAN-LIBO R-BBA 3M +325BPS 08/10/2028	198,500.00	186,259	0.98
CENTURYLINK INC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +225BPS	194,233.87	184,644	0.97
ACRISURE LLC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +350BPS	195,042.92	183,544	0.97
WINDSTREAM SERVICES II TERM B-EXIT TERM LOAN USD-LIBOR BBA 3M+ 625BPS	198,965.08	180,660	0.95
SYNAPTICS INC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M 225 20/10/2028	176,052.92	172,862	0.91
NASCAR HOLDINGS INC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR BBA 3M +275BPS	172,393.63	172,178	0.91
CLYDESDALE ACQUISITION TRACHE TERM LOAN USD-LIBOR BRA 3M +425BPS	179,550.00	171,470	0.90
TRANS UNION LLC TERM B6 TERM LOAN U SD-LIBOR-BBA3M 225 18/11/2028	172,693.55	171,182	0.90
GRIFOLS WORLDWIDE OPERAT TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M 200+	169,287.43	163,786	0.86
ARCH COAL INC TERM LOAN TERM B USD-LIBOR-BBA 3M +500BPS 14/06/2026	288,045.67	162,206	0.85
CAESARS RESORT COLLECTIO TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +350BPS	153,981.11	153,765	0.81
CIMPRESS USA INC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR BBA 3M+350BPS 17/05/2028	169,570.71	152,826	0.80
DOTDASH MEREDITH INC TERM B TERM LO AN USD-LIBOR-BBA3M 23/11/2028	173,195.14	150,680	0.79
WYNDHAM WORLDWIDE CORP TERM LOAN USD LIBOR-BBA 3M+400BPS 09/12/2029	150,000.00	146,344	0.77
BELLA HOLDING CO LLC TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +375BPS 01/04/2028	148,500.00	140,611	0.74
HOYA MIDCO LLC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +325BPS 03/02/2029	141,144.64	134,970	0.71
ORGANON & CO TRANCHE B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +300BPS 08/04/2028	129,250.00	128,281	0.68
SS&C TECHNOLOGIES INC TRACHE B7 TERM LOAN USD-LIBOR BBA 3M+225BPS	128,186.27	126,344	0.66
US RENAL CARE INC TRANCHE B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +550BPS	198,000.00	111,870	0.59
JOURNEY PERSONAL CARE CO TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +425BPS 19/02/2028	145,625.00	107,216	0.56
PROJECT BOOST PURCHASER TRANCHE B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA +350BPS	106,650.00	103,051	0.54
NORTONLIFLOCK INC TERM B TERM LOAN USD LIBOR-BBA 3M+200BPS 12/09/2029	100,000.00	98,563	0.52

銘柄名	数量	評価額(米ドル)	投資比率(%)
DAVITA INC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR BBA 3M+175BPS 12/08/2026	100,000.00	97,563	0.51
LIFE TIME INC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +175BPS	96,654.20	96,322	0.51
ASCEND LEARNING LLC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR BBA 3M +350BPS	99,250.00	94,078	0.50
SUNSHINE SOFTWARE MERGER TRANCHE B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M + 375BPS	99,500.00	89,053	0.47
SS&C TECHNOLOGIES INC TRACHE B6 TERM LOAN USD-LIBOR BBA 3M+225BPS	85,073.53	83,702	0.44
DELEK US HOLDINGS INC TERM B TERM LOAN USD LIBOR-BBA 3M+350BPS	75,984.80	73,135	0.38
STANDARD INDUSTRIES INC TRANCHE B TERM B TERM LOAN 250BPS 06/08/2028	63,025.00	62,355	0.33
SABRE GLBL INC TRANCHE B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +350BPS 17/12/2027	67,424.72	61,272	0.32
HERTZ CORP/THE TERM C TEARM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M 350BPS 14/06/2028	50,000.00	49,063	0.26
SABRE GLBL INC TRANCHE B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +350BPS 17/12/2027	42,297.50	38,570	0.20
KRATON POLYMERS US LLC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR BBA 3M +325BPS	34,825.00	34,607	0.18
TRIDENT TPI HOLDINGS INC TRANCHE DD TERM USD-LIBOR-BBA 3M+ 400BPS	31,578.85	30,400	0.16
CANO HEALTH LLC TERM TERM LOAN USD -LIBOR-BBA3M +400BPS 23/11/2027	1,737.48	1,397	0.01
RAPTOR ACQUISITION CORP TRANCHE B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA +400BPS	1,246.86	1,228	0.01
有価証券 合計		18,126,481	95.40
その他資産		874,521	4.60
総資産総額		19,001,002	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	—

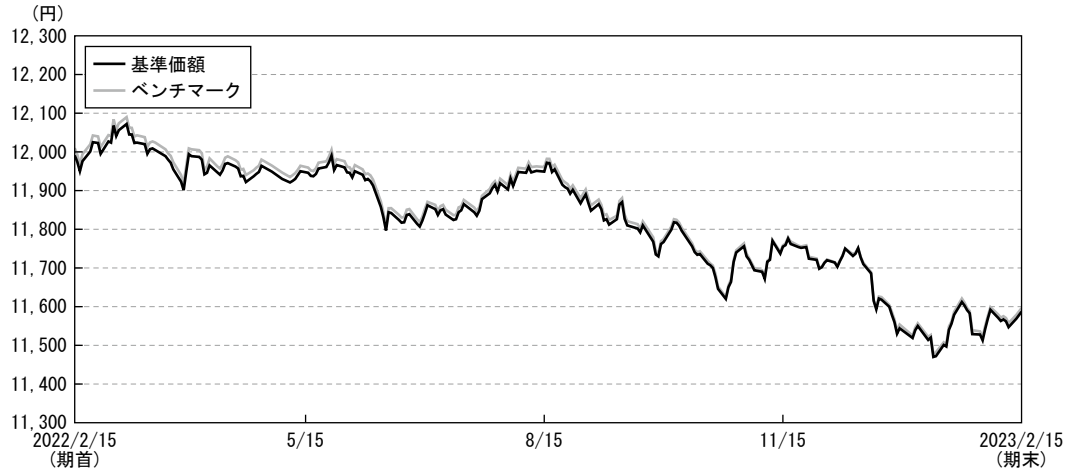
(注1) 騰落率は期首比です。

(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。

運用経過

■基準価額等の推移（2022年2月16日から2023年2月15日まで）



期 首 : 11,991円

期 末 : 11,587円

騰 落 率 : $\Delta 3.4\%$

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

■基準価額の主な変動要因

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

■投資環境

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	期		償 還 年 月 日
			利 率	額 面 金 額	
		名		評 価 額	
			%	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
第438回利付国債（2年）			0.005	100,000	100,130
第1回利付国債（40年）			2.4	120,000	144,560
第6回利付国債（40年）			1.9	50,000	55,059
第7回利付国債（40年）			1.7	20,000	21,048
第8回利付国債（40年）			1.4	20,000	19,545
第9回利付国債（40年）			0.4	30,000	21,468
第11回利付国債（40年）			0.8	50,000	40,555
第13回利付国債（40年）			0.5	50,000	36,065
第15回利付国債（40年）			1.0	50,000	41,879
第339回利付国債（10年）			0.4	200,000	202,108
第345回利付国債（10年）			0.1	200,000	200,190
第346回利付国債（10年）			0.1	70,000	69,971
第351回利付国債（10年）			0.1	280,000	277,785
第356回利付国債（10年）			0.1	230,000	226,147

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。

■投資信託財産の構成

(2023年2月15日現在)

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。