

マニユライフ・ 銀行貸付債権ファンド15-01 愛称：アメリカン・フロート15-01

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	単位型投信／海外／その他資産（貸付債権）
信託期間	2015年1月30日から2019年7月16日まで。
運用方針	投資信託証券への投資を通じて、主として米ドル建ての銀行貸付債権に投資を行い、安定的な金利収入の確保と信託財産の成長をめざして運用を行います。
主要投資対象	投資信託証券（外国籍投資信託証券および国内投資信託証券（親投資信託）を含みます。）を主要投資対象とします。 ・ケイマン籍外国投資信託「マニユライフ・インベストメンツ・トラスト・フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA」 ・親投資信託「マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド」
主な投資制限	①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 ②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
分配方針	毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。 ①分配対象額の範囲は、元本超過額または経費控除後の利子、配当等収益のいずれか多い額とします。 ②収益分配金額は、委託会社が基準価額の水準・市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合等には、収益分配を行わない場合があります。

運用報告書（全体版）

第3期（決算日 2015年9月15日）
第4期（決算日 2015年12月15日）

－受益者のみなさまへ－

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

さて、「マニユライフ・銀行貸付債権ファンド15-01愛称：アメリカン・フロート15-01」は、このたび、第4期の決算を行いました。ここに、第3期～第4期中の運用状況をご報告申し上げます。今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

 **Manulife Investments**

マニユライフ・インベストメンツ・ジャパン株式会社

東京都千代田区丸の内1-8-1 丸の内トラストタワーN館

お問い合わせ先

サポートダイヤル：03-6267-1901

受付時間：営業日の午前9時～午後5時

ホームページアドレス <http://www.mlij.co.jp/>

■設定来の運用実績

作成期	決算期	基準価額				受益者 利益回り	参考指数		株式 組入比率	債券 組入比率	投資信託 証券比率	元本 残存率
		(分配落)	税 込 配 金	期 中 騰 落 額	期 中 騰 落 率		騰 落 率	騰 落 率				
第1作成期	(設定日) 2015年1月30日	円 10,000	円 —	円 —	% —	% —	10,000	% —	% —	% —	% —	% 100.0
	1期(2015年3月16日)	10,120	—	120	1.2	9.5	10,158	1.6	—	0.0	101.4	100.0
	2期(2015年6月15日)	10,084	50	14	0.1	3.6	10,270	1.1	—	0.0	99.3	99.9
第2作成期	3期(2015年9月15日)	9,979	50	△55	△0.5	1.3	10,222	△0.5	—	0.0	99.3	98.9
	4期(2015年12月15日)	9,672	50	△257	△2.6	△2.0	9,912	△3.0	—	0.0	98.1	98.6

(注1) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注2) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しています。

(注3) 基準価額は1万口当たり、騰落率は分配金込みです。

(注4) 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。(以下「参考指数」といいます。)

当参考指数は、ファンドの設定日の前営業日を10,000として、委託会社が計算したものです。

(注5) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、「株式組入比率」、「債券組入比率」は実質比率を記載しております。

参考指数に関して

クレディ・スイス・レパレジッド・ローン・インデックス(配当込み/米ドルベース)は、クレディ・スイス証券が算出する、バンクローンの値動きを示す代表的な指数です。

■当作成期中の基準価額と市況等の推移

決算期	年 月 日	基準価額		参考指数		株式 組入比率	債券 組入比率	投資信託 証券比率
		騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率			
第3期	(期首) 2015年6月15日	円 10,084	% —	10,270	% —	% —	% 0.0	% 99.3
	6月末	10,072	△0.1	10,259	△0.1	—	0.0	99.1
	7月末	10,073	△0.1	10,272	0.0	—	0.0	100.6
	8月末	10,018	△0.7	10,197	△0.7	—	0.0	97.4
	(期末) 2015年9月15日	10,029	△0.5	10,222	△0.5	—	0.0	99.3
第4期	(期首) 2015年9月15日	9,979	—	10,222	—	—	0.0	99.3
	9月末	9,911	△0.7	10,142	△0.8	—	0.0	98.8
	10月末	9,879	△1.0	10,125	△0.9	—	0.0	100.5
	11月末	9,759	△2.2	10,030	△1.9	—	0.0	101.4
	(期末) 2015年12月15日	9,722	△2.6	9,912	△3.0	—	0.0	98.1

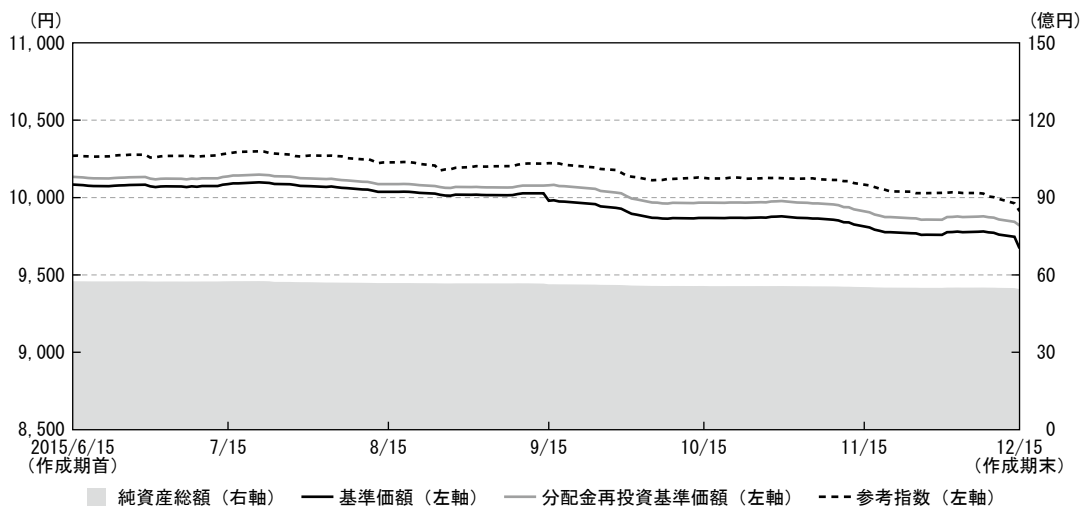
(注1) 騰落率は期首比です。(期末基準価額は税金・分配金を含みます。)

(注2) 基準価額は1万口当たりで表示しています。

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

運用経過

■ 基準価額等の推移（2015年6月16日から2015年12月15日まで）



作成期首：10,084円

作成期末：9,672円（既払分配金100円）

騰落率：△3.11%（分配金再投資ベース）

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資（複利運用）したものととして、委託会社が算出したもので、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。当ファンドは単位型投資信託ですので、実際には分配金は再投資されませんのでご注意ください。

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

■基準価額の主な変動要因

- ・ 7月下旬から8月にかけて、原油安や中国の人民元切り下げにより中国経済の悪化と世界経済への悪影響が懸念されるなか、投資ファンドからの資金流出やCLO（ローン担保証券）の発行減少などから売られました。
- ・ 9月中旬から10月初旬にかけて、中国経済の減速を示す指標の発表などから世界の経済成長やインフレ見通しが低下するなか、需給悪化が継続し価格は下落しました。
- ・ 11月以降、年内利上げ観測および需給の悪化や原油安によりエネルギーセクターが売られたことなどから、価格は下落しました。
- ・ 為替ヘッジを行い為替変動リスクを低減しました。

◆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	△2.24%
マニュライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	1.80%

■投資環境

[米国債券市況]

期初、国債利回り（10年）は2.4%近辺でした。ギリシャ債務危機への懸念と米国の利上げ観測が並存するなか、2.1%台から2.5%近辺のレンジで推移しました。7月中旬から8月下旬にかけて、中国株式の急落や人民元切り下げによりリスク回避的な動きが強まったことから、2%割れとなる水準まで利回りは低下しました。その後は、原油など商品価格の下落によるインフレ期待の低下、中国の経済成長減速への懸念などによるリスク回避的な動きが利回り低下要因となる一方、中国人民銀行の追加緩和によるリスク回避の後退や米利上げ観測などが利回り上昇要因となりました。これらの要因が拮抗するなか、利回りは2%近辺から2.3%近辺でのレンジで推移しました。11月初、良好な雇用統計を受けて2.3%台へ上昇しました。11月中旬から期末にかけて、利回り上昇要因と低下要因が拮抗する基調は続いたものの、16日開催のFOMC（米連邦公開市場委員会）での利上げ観測が強まったことから2.1%台から2.3%台の推移となり、2.2%台で期末を迎えました。当作成期間、残存期間の短い2年債の利回りは、利上げ観測を受けて上昇しました。米ハイイールド債など格付けの低い債券の利回りは、中国人民銀行の追加緩和によるリスク回避の後退や堅調な企業業績などから低下する局面があったものの、商品価格の下落や中国の経済成長減速への懸念などによるリスク回避的な動きから上昇しました。銀行貸付債権は、中国経済の悪化や原油安に加え需給悪化が続くなか下落基調となりました。銀行貸付債権の基準金利である3ヵ月米ドルLIBOR（ロンドン銀行間取引金利）は、期初0.28%台でしたが、上昇傾向となり0.51%台で期末を迎えました。

[為替市況]

外国為替市場は、期初1米ドル123.5円ではじまり、123円から124円で推移しましたが、8月後半に中国の景気減速懸念などからリスク回避が強まったため円高となり10月まで120円前後で推移しました。11月以降米利上げ観測が強まるなか上昇し123円前後で推移しました。12月に入り原油安を受けてリスク回避姿勢が強まったことなどを背景に円が買われ、121.16円で期末を迎えました。

[日本債券市況]

当作成期間の10年国債利回りは、作成期初0.505%から作成期末0.295%となり利回り低下（価格は上昇）となりました。

■当該投資信託のポートフォリオ

[当ファンド]

当ファンドが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-フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA」といいます。）（米ドル建て）の組入比率は高位に維持しました。

[MIT-フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA]

当該投資信託証券を通じて主に変動金利の米ドル建て銀行貸付債権に投資を行い、安定的なインカムゲイン（金利収入）の確保をめざしました。

[マニュアル・日本債券インデックス・マザーファンド]

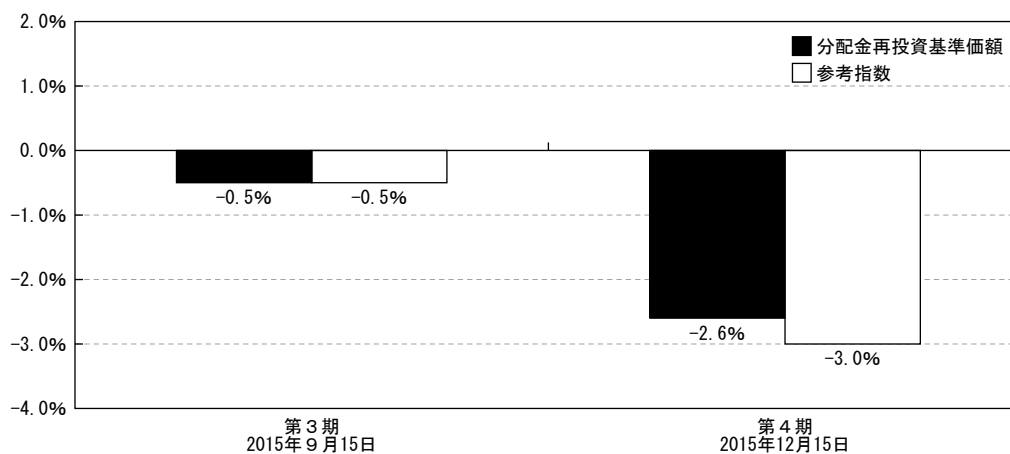
主に、NOMURA-BPI 総合に採用されている公社債に投資することにより、同インデックスの動きに連動する投資成果をめざして運用を行いました。

[資産構成比率]

組入れファンド・資産	比率 (%)
MIT-フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA	98.1
マニュアル・日本債券インデックス・マザーファンド	0.0
現預金等	1.9
合計	100.0

■当該投資信託のベンチマークとの差異

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



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

■今後の運用方針

[当ファンド]

当ファンドは、「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」（米ドル建て）の投資信託証券を主要投資対象とし、主に米ドル建ての銀行貸付債権に投資を行い、安定的な金利収入の確保と信託財産の成長をめざす方針です。

[MIT-フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA]

企業ファンダメンタルズは、依然として、多くの業種で歴史的に見て相対的に健全であると考えますが、一方で、利益成長に減速が見られます。2016年は、市場の価格変動性の上昇、米国債利回りの上昇や商品関連の企業を中心としたデフォルト率の上昇などがリスク要因となると予想します。こうしたなか、慎重な見通しを維持し、景気や資産価格の悪化から影響を受けにくいポートフォリオ構築に努めております。また、引き続き、企業ファンダメンタルズの分析に焦点を当てて、持続可能なビジネスモデルと豊富な流動性を有する企業の借入れる銀行貸付債権に投資する方針です。

[マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド]

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

■収益分配金について

当作成期間の収益分配は、分配方針に基づき第3期50円、第4期50円、合計100円とさせていただきます。留保益の運用については、元本部分と同一の運用を行います。

■ 1万円当たりの費用明細

項目	第3期～第4期		項目の概要
	(2015年6月16日～2015年12月15日)		
	金額	比率	
平均基準価額	9,952円	—	作成期間の平均基準価額（月末値の平均値）です。
(a) 信託報酬 （投信会社） （販売会社） （受託会社）	63円 (24) (38) (1)	0.634% (0.243) (0.378) (0.013)	(a) 信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率 なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含まず。 ・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 （株式） （新株予約権証券） （オプション証券等） （新株予約権付社債（転換社債）） （商品） （先物・オプション）	— — — — — —	— — — — — —	(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 （株式） （新株予約権証券） （オプション証券等） （新株予約権付社債（転換社債）） （公社債）	— — — — —	— — — — —	(d) 有価証券取引税＝作成期間の有価証券取引税÷作成期間の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(e) その他費用 （保管費用） （監査費用） （印刷）	2 (0) (1) (1)	0.017 (0.000) (0.007) (0.009)	(e) その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数 その他費用 ・保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 ・監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 ・印刷は、印刷会社等に支払う法定書類の作成等に係る費用
合計	65	0.651	

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

■売買及び取引の状況（2015年6月16日から2015年12月15日まで）
投資信託証券

決 算 期 銘 柄 名	第2作成期（第3期～第4期）			
	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外国（ケイマン諸島） 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	口 35,670	千米ドル 3,257	口 31,498	千米ドル 2,850

（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。

マザーファンド受益証券の設定、解約状況

当作成期において、設定および解約はありません。

■利害関係人との取引状況等（2015年6月16日から2015年12月15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

（2015年6月16日から2015年12月15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（2015年6月16日から2015年12月15日まで）

該当事項はありません。

■組入資産の明細（2015年12月15日現在）

(1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた外貨建ファンドの明細

決 算 期 銘 柄	第2作成期末（2015年12月15日現在）			
	口 数	評 価 額		組 入 比 率
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(ケイマン諸島) 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	口 499,674	千米ドル 44,141	千円 5,348,155	% 98.1
合 計	499,674	44,141	5,348,155	

(注1) 邦貨換算金額は、当作成期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 組入比率は、当作成期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

(注3) 口数・評価額の単位未満は切り捨てです。

(2) マザーファンド受益証券残高

項 目	第1作成期末 (2015年6月15日現在)	第2作成期末 (2015年12月15日現在)	
	口 数	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 87	千口 87	千円 100

(注) 口数・評価額の単位未満は切り捨てです。

■有価証券の貸付および借入の状況（2015年12月15日現在）

該当事項はありません。

■投資信託財産の構成

(2015年12月15日現在)

項 目	第2作成期（第4期）末	
	評 価 額	比 率
投 資 信 託 受 益 証 券	千円 5,348,155	% 97.3
マニュライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	100	0.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	148,324	2.7
投 資 信 託 財 産 総 額	5,496,579	100.0

(注1) 金額の単位未満は切り捨てております。

(注2) 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において、当作成期末における外貨建純資産（5,348,155千円）の投資信託財産総額（5,496,579千円）に対する比率は97.3%です。

(注3) 外貨建資産は、当作成期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、当作成期末における邦貨換算レートは、1米ドル=121.16円です。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第3期末 (2015年9月15日)	第4期末 (2015年12月15日)
(A) 資 産	11,349,571,701円	11,101,478,649円
コール・ローン等	75,694,968	75,535,243
投資信託受益証券(評価額)	5,595,423,715	5,348,155,210
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)	99,948	100,776
未 収 入 金	5,678,353,050	5,677,687,400
未 収 利 息	20	20
(B) 負 債	5,712,877,878	5,652,257,800
未 払 金	5,656,003,000	5,606,108,400
未 払 収 益 分 配 金	28,242,415	28,170,311
未 払 解 約 金	10,007,000	-
未 払 信 託 報 酬	18,155,987	17,514,716
そ の 他 未 払 費 用	469,476	464,373
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	5,636,693,823	5,449,220,849
元 本	5,648,483,105	5,634,062,232
次 期 繰 越 損 益 金	△ 11,789,282	△ 184,841,383
(D) 受 益 権 総 口 数	5,648,483,105口	5,634,062,232口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,979円	9,672円

(注1) 当ファンドの設定元本額は5,711,012,372円、第3期首元本額は5,706,777,318円、当作成期末における元本残存率は98.6%です。

(注2) 1口当たり純資産額は、第3期0.9979円、第4期0.9672円です。

(注3) 貸借対照表の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は、第3期11,789,282円、第4期184,841,383円です。

(注4) 未払信託報酬(消費税相当額を含む)の内訳は以下の通りです。

	第3期	第4期
未払受託者報酬	386,300円	372,659円
未払委託者報酬	17,769,687円	17,142,057円

■損益の状況

項 目	第3期 [自2015年6月16日 至2015年9月15日]	第4期 [自2015年9月16日 至2015年12月15日]
(A) 配 当 等 収 益	89,862,836円	92,451,158円
受 取 配 当 金	89,862,041	92,450,598
受 取 利 息	795	560
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 9,794,362	△ 17,441,989
売 買 益	193,775,059	151,700,064
売 買 損	△203,569,421	△169,142,053
(C) 有 価 証 券 評 価 差 損 益	△ 92,630,150	△202,096,086
(D) 信 託 報 酬 等	△ 18,705,527	△ 18,012,325
(E) 当 期 損 益 金 (A + B + C + D)	△ 31,267,203	△145,099,242
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	48,014,370	△ 11,789,282
(G) 解 約 差 損 益 金	△ 294,034	217,452
(H) 計 (E + F + G)	16,453,133	△156,671,072
(I) 収 益 分 配 金	△ 28,242,415	△ 28,170,311
次 期 繰 越 損 益 金 (H + I)	△ 11,789,282	△184,841,383

(注1) 損益の状況の中で(D)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注2) 損益の状況の中で(G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

(注3) 信託報酬(消費税相当額を含む)の内訳は以下の通りです。

	第3期	第4期
受託者報酬	387,869円	373,037円
委託者報酬	17,842,075円	17,159,595円

(注4) マザーファンドの投資信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として、マザーファンドの純資産総額に対して年率0.1%の額を委託者報酬の中から支弁しております。

(注5) 収益分配金の計算過程は以下の通りです。

	第3期計算期間末	第4期計算期間末
A 配当等収益額	89,862,836円	92,451,158円
B 親ファンドの配当等収益額	284円	275円
C 配当等収益合計額	89,863,120円	92,451,433円
D 経費	18,705,527円	18,012,325円
E 配当等収益合計額から経費を控除した額	71,157,593円	74,439,108円
F 期末の受益権口数	5,648,483,105口	5,634,062,232口
G 期中の平均受益権口数	5,674,951,807口	5,638,482,217口
H 分配可能額	70,825,704円	74,380,755円
I 10,000口当たり分配金	50円	50円

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

■過去6ヶ月の分配金のお知らせ

決 算 期	第 3 期 (2015年9月15日)	第 4 期 (2015年12月15日)
1 万 口 当 たり 分 配 金 (税 込 み)	50円	50円

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

課税上の取り扱い

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

※税法が改正された場合等は、上記内容が変更になる場合があります。

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

お知らせ

◆約款変更

該当事項はありません。

◆運用体制の変更

該当事項はありません。

<参考情報>

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

■当ファンドの仕組みは次の通りです

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

■投資対象とする投資信託証券の資産の状況

以下は、マニユライフ・銀行貸付債権ファンド15-01（以下「当ファンド」といいます。）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。

◆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

○ポートフォリオ特性

	特性値
平均クーポン	4.58%
直接利回り	4.69%
最終利回り	4.88%
平均デュレーション	0.14年
残存年数	5.01年
平均格付け	BB-

※現地の2015年6月最終営業日のデータです。

※特性値は純資産総額から現預金等を除いて計算しています。

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

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

○組入上位10銘柄

（組入銘柄数146銘柄）

	銘柄名	組入比率
1	ドンカスターズ・ファイナンス	1.39%
2	コミュニティ・ヘルス・システムズ	1.20%
3	サウスイースト・パワーゼン	1.20%
4	インテルサット・ジャクソン・ホールディングス	1.19%
5	BEエアロスペース	1.14%
6	ゲイツ・グローバル	1.13%
7	ガードナー・デンバー	1.11%
8	メディア・ゼネラル	1.11%
9	キネティック・コンセプツ	1.10%
10	ワイドオープンウェスト	1.10%

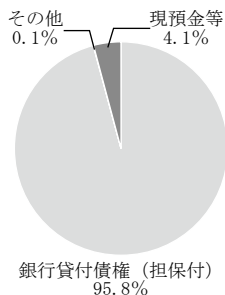
※現地の2015年6月最終営業日のデータです。

※組入比率は純資産総額に対する比率です。

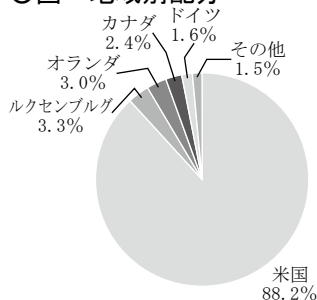
※個別の銘柄の取引を推奨するものではありません。

また上記銘柄について将来の組入れを保証するものではありません。

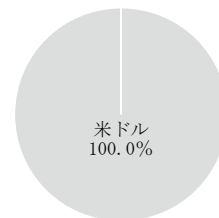
○資産別配分



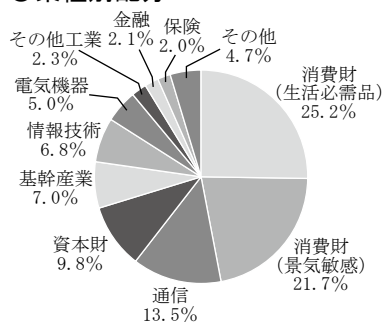
○国・地域別配分



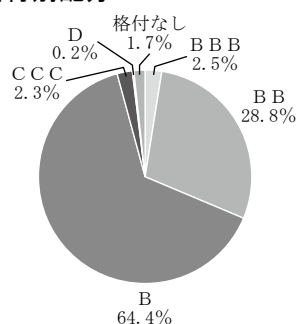
○通貨別配分



○業種別配分



○格付別配分



※現地の2015年6月最終営業日のデータです。

※資産別配分および通貨別配分は純資産総額に対する比率です。また、国・地域別、業種別、格付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。

※業種別配分の業種名は、パークレイズの業種区分に準じて分類していますが、一部当社の判断に基づいて分類することがあります。

※格付別配分の数値は、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より算出したものです。

※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」の情報（未監査）を委託会社が抜粋・翻訳したものを記載しております。

■貸借対照表

(2015年6月30日現在)
(単位：アメリカ・ドル)

資産	
有価証券（評価額）	200,781,709
利付証券に係る未収利息	1,527,822
預金利息	19
追加設定に係る未収入金	910,000
有価証券の売却に係る未収入金	8,702,977
現金及び預金	14,233,041
資産合計	226,155,568
負債	
有価証券買付に係る未払金	17,232,928
その他	133,841
負債合計	17,366,769
純資産総額	208,788,799
発行済み受益証券口数	
Class A	2,249,618.91
1口当たりの純資産額	
Class A	92.81

■費用の明細

(2015年1月1日から2015年6月30日まで)
(単位：アメリカ・ドル)

収益	
利付証券に係る利息	4,629,359
預金利息	5,022
投資有価証券にかかる実現損益	△2,573,418
投資有価証券にかかる未実現評価損益	2,335,641
雑収入	118,392
収益合計	4,514,996
費用	
マネジメントフィー	△401,750
カスタディーフィー等	△50,419
事務手数料	△5,952
監査報酬等	△17,009
評価手数料	△12,400
取引手数料	△7,388
年間権限費用	△1,220
会計及びその他専門家費用	△1,988
その他費用	△29,622
費用合計	△527,748
当期純利益	3,987,248

■有価証券明細表 2015年6月30日

銀行貸付債権（米ドル建）

銘柄名	数量	評価額(米ドル)	投資比率(%)
ACADIA HEALTHCARE TERM B TERM LOAN USD-LIBOR BBA 3M + 350BPS	1,610,963	1,621,703	0.78
ALERE TERM B TERM LOAN USD-LIBOR USD-LIBOR BBA 3M +325BPS 17/06/2022	2,000,000	2,005,000	0.96
ALLISON TRANSMISSION TERM B4 TERM LOAN USD-LIBOR BBA 3M +250BPS	1,550,000	1,554,844	0.74
ALTICE FINANCING SA TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M+450BPS	1,983,718	2,006,863	0.96
ALTICE FINANCING TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +425BPS	1,000,000	1,006,250	0.48
AMAYA GAMING TERM LOAN USA-LIBOR-BBA 3M +400BPS	1,992,494	1,992,079	0.95
AMERICAN ENERGY MARCELLUS TERM LOAN USD- LIBOR- BBA 3M	1,080,000	841,860	0.40
ANCESTRY.COM INC TERM B1 USD-LIBOR-BBA 3M +350BPS	1,972,018	1,977,934	0.95
ASPECT SOFTWARE TERM TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +525BPS	1,374,827	1,373,074	0.66
ASURION LLC TERM B1 TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +375BPS 24/05/2019	1,098,847	1,102,128	0.53
AVAST SOFTWARE TERM TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M+400BPS	1,039,769	1,043,235	0.50
AVAYA INC 1L TERM B6 TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +550BPS 31/03/2018	1,631,527	1,625,554	0.78
B/E AREOSPACE TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +325BPS	2,344,125	2,360,241	1.13
BAKERCORP TERM TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +300BPS	1,084,549	1,048,624	0.50
BORGATA TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +575BPS 15/08/2018	1,233,682	1,247,121	0.60
BRAND ENERGY TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +375BPS	1,486,237	1,457,210	0.70
CALPINE TERM DD TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +300 BPS	1,787,936	1,788,774	0.86
CAPITAL SAFETY TERM TERM LOAN US-LIBOR-BBA 3M +300BPS 01/04/2021	1,993,090	1,991,014	0.95
CARECORE NATIONAL TERM TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +450BPS 06/03/2021	298,493	299,985	0.14
CARESTREAM HEALTH INC TRANCHE B TERM LOAN USD-LIBOR BBA 3M +400BPS	1,329,741	1,331,641	0.64
CATALENT PHARMA SOLUTION INC TRANCHE B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA	1,589,245	1,594,211	0.76
CATALINA MARKETING TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +350BPS 09/04/2021	664,975	600,140	0.29
CHARTER COMMUNICATIONS TERM F TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +225BPS	1,100,000	1,087,969	0.52
CHC HELICOPTER (REG) 9.25% 15/10/2020	170,000	124,100	0.06
CLEAR CHANNEL COMMUNICATION TERM E TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +750BPS	500,000	469,687	0.22
CLEAR CHANNEL COMMUNICATIONS INC TRANCHE TERM D-EXT TERM LOAN	1,250,000	1,157,291	0.55
COMMUNICATIONS SALES & LEASING INC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M	1,800,000	1,766,624	0.85
COMMUNITY HEALTH TERM G TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +275BPS 31/12/2019	2,493,562	2,495,121	1.20
CONCORDIA HEALTHCARE TERM B TERM LOAN USD-LIBOR BBA 3M + 375BPS	650,000	655,281	0.31
CONSOLIDATED CONTAINER CO LLC TRANCHE B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA	740,750	726,861	0.35
CONSOLIDATED PRECISION PRODUCTS (TERM) TERM LOAN USD-LIBOR-BBA	2,299,090	2,300,961	1.10
CONVATEC INC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR BBA 3M +325BPS 09/06/2020	550,000	550,344	0.26
CSM BAKERY TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +375BPS 03/07/2020	1,893,433	1,894,616	0.91
DELL INC TRANCHE TERM B2 TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +325BPS 29/04/2020	1,988,706	1,990,659	0.95
DELTA AIR LINES TRANCHE B1 TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +275BPS	1,496,173	1,494,187	0.72
DJO TERM B TERM LOAN USD-LIBOR BBA 3M +325BPS 16/06/2020	1,000,000	1,003,000	0.48
DONCASTERS GROUP LTD TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M + 350BPS	2,908,415	2,901,144	1.39
EASTMAN KODAK CO TRANCHE EXIT TERM LOAN USD-LIBOR-BBA +625BPS	1,730,596	1,735,269	0.83
EDDIE BAUER EVERHO TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +525BPS 22/04/2020	178,650	160,562	0.08
ENDO INTERNATIONAL TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +300BPS 24/06/2022	1,020,000	1,023,825	0.49
ENERGY TRANSFER EQUITY TERM TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +325BPS	1,965,706	1,969,392	0.94
EXGEN TEXAS POWER TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M 18/09/2021	1,990,830	1,971,752	0.94
FIRST DATA TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +400BPS	2,167,000	2,175,295	1.04
FMG RESOURCES AUG 2006 TRANCHE B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +325BPS	1,182,261	1,052,582	0.50
FOUR SEASONS HOLDINGS INC TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +275BPS	1,685,509	1,686,037	0.81
FREESCALE TERM B4 TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +325BPS 01/03/2020	1,496,212	1,499,953	0.72
FTS INTERNATIONAL TERM TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M 16/04/2021	630,909	510,511	0.24
GARDNER DENVER (TERM) TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +325BPS	2,384,402	2,333,137	1.12
GATES TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +325 BPS 03/07/2021	2,390,494	2,357,837	1.13
GOODPACK TERM TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +375 BPS	1,000,000	981,875	0.47

銘柄名	数量	評価額(米ドル)	投資比率(%)
GOODYEAR (TERM) TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +375BPS 30/04/2019	833,333	835,937	0.40
HAWAIIAN TELCOM COMMUNICATIONS INC TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +400BPS	738,470	741,854	0.36
HCA INCORPORATION TERM B4 TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +275BPS 01/05/2018	1,246,835	1,248,221	0.60
HILLMAN TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +350BPS	1,488,750	1,501,777	0.72
HILTON WORLDWIDE FINANCE LLC TRANCHE B TERM LOAN	1,484,211	1,485,859	0.71
HJ HEINZ CO B2 TERM LOAN USD-LIBOR- BBA 3M+250BPS 05/06/2020	1,915,359	1,917,989	0.92
HOUGHTON MIFFLIN TERM B TERM LOAN USD-LIBOR BBA 3M + 300BPS	1,250,000	1,246,094	0.60
HUDSON'S BAY CO TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +375BPS 04/11/2020	1,421,622	1,427,334	0.68
IASIS TERM B2 TERM LOAN USD-LIBOR- BBA 3M +325BPS 03/05/2018	1,487,335	1,491,286	0.71
INEOS TERM B TERM LOAN USD-LIBOR BBA 3M + 325BPS 12/03/2022	650,000	647,156	0.31
INTELSAT TERM B2 TERM LOAN USD- LIBOR-BBA 3M +275BPS 30/06/2019	2,500,000	2,485,417	1.19
JC PENNEY CORP INC TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +400BPS 20/06/2019	1,843,625	1,843,395	0.88
JC PENNEY CORP INC TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +500BPS 22/05/2018	1,978,699	1,976,226	0.95
KEY SAFETY TERM TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +375BPS 29/08/2021	1,891,747	1,901,798	0.91
KIK CUSTOM PRODUCTS TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M+425BPS	982,522	986,206	0.47
KINDRED HEALTHCARE TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +300BPS 09/04/2021	1,788,994	1,794,014	0.86
KINETIC CONCEPTS TERM D1 TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M+350BPS 04/05/2018	2,286,693	2,298,483	1.10
LA FRONTERA GENERATION LLC TRANCHE B TERM LOAN USD-LIBOR BBA	2,240,280	2,232,345	1.07
LANDS' END TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M 04/04/2021	700,219	671,043	0.32
LAUREATE TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +375BPS 16/06/2018	1,100,000	1,031,250	0.49
LEVEL 3 TERM BIII TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +300BPS 01/08/2019	1,100,000	1,100,171	0.53
LIBERTY CABLEVISION TERM TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +350BPS 26/12/2021	905,000	898,590	0.43
MACDERMID INC LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +300BPS 07/06/2020	1,481,193	1,490,451	0.71
MALLINCKRODT TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +275BPS 19/03/2021	1,738,098	1,733,074	0.83
MAUSER TERM TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +350BPS 30/06/2021	1,293,500	1,292,961	0.62
MAUSER TERM TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +725BPS 31/07/2022	500,000	495,625	0.24
MEDIA GENERAL INC TERM B2 TERM LOAN USA-LIBOR-BBA 3M +325BPS	2,448,560	2,457,742	1.18
MOHEGAN TRIBAL GAMING AUTHORITY TERM B TERM LOAN	1,983,709	1,977,758	0.95
MULTIPLAN TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M 31/03/2021	1,858,086	1,851,408	0.89
NATIONAL MENTOR HOLDINGS INC TERM B1 TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M	1,990,850	1,990,850	0.95
NAVISTAR INC 1L TERM B LOAN USD-LIBOR 450BPS 17/08/2017	1,300,000	1,304,062	0.62
NEIMAN MARCUS TERM LOAN USD-LIBOR BBA 3M +325BPS	1,850,000	1,841,906	0.88
NEP/NCP HOLDCO TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +325BPS 22/01/2020	993,753	980,089	0.47
NINE WEST HOLDINGS TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +375BPS 08/10/2019	312,500	274,219	0.13
NORANDA ALUMINUM ACQUISITION CORP TRANCHE B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA	1,478,442	1,241,891	0.59
NPC INTERNATIONAL TERM B USD-LIBOR-BBA3M +300BPS	1,486,385	1,479,882	0.71
NTELOS INC TRANCHE B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M+475BPS 09/11/2019	479,794	422,219	0.20
OCWEN FINANCIAL CORP TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +375BPS 15/01/2018	1,949,621	1,945,661	0.93
ONE CALL MEDICAL TERM TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +400BPS 27/11/2020	1,732,234	1,710,581	0.82
ORTHO-CLINICAL DIAGNOSTICS TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +375BPS	1,540,869	1,512,834	0.72
OTTER BOX TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +475BPS 30/06/2020	1,927,700	1,931,917	0.93
PABST TERM TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +475BPS 05/11/2021	487,342	490,388	0.23
PAR PHARMACEUTICAL TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +300BPS	1,282,050	1,282,451	0.61
PAR PHARMACEUTICAL TERM B3 TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +325BPS	658,350	653,824	0.31
PARAGON OFFSHORE TERM LOAN USD-LIBOR-BBA +275BPS	1,194,000	921,410	0.44
PATHEON TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +325BPS 11/03/2021	2,178,562	2,168,447	1.04
PATRIOT COAL CORP TERM EXIT TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +800BPS	1,288,712	563,812	0.27
PAYLESS TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +400BPS 11/03/2021	842,741	804,554	0.39
PERFORMANCE FOOD GROUP (TERM) TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +525BPS	493,719	496,187	0.24
PETSMART INC TERM B TERM LOAN USD- LIBOR-BBA 3M +325BPS 10/03/2022	1,700,000	1,700,289	0.81
PHARMEDIUM HEALTHCARE TERM TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +325BPS	94,556	93,886	0.04
PHILLIPS MEDISIZE TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +375BPS	794,000	794,496	0.38

銘柄名	数量	評価額(米ドル)	投資比率(%)
PLATFORM SPECIALITY TERM B2 TERM TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +375BPS	997,500	1,002,754	0.48
PLY GEM INDUSTRIES TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +300BPS 30/01/2021	1,185,531	1,180,493	0.57
POST HOLDINGS INC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +300BPS 02/06/2021	1,663,025	1,656,789	0.79
PQ TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +300BPS	1,493,642	1,494,015	0.72
RITE AID CORP TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +475BPS 21/08/2020	1,500,000	1,516,249	0.73
RIVERBED TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +500BPS 25/02/2022	1,600,000	1,617,000	0.77
ROYAL ADHESIVES AND SEALANTS TERM TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +350BPS	750,000	752,812	0.36
RUE21 TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +462.5BPS	1,478,471	1,358,345	0.65
SBA COMMUNICATIONS TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA3M +250BPS	1,493,731	1,482,736	0.71
SCHAEFFLER TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +350BPS 15/05/2020	1,600,000	1,611,000	0.77
SCIENTIFIC GAMES TERM B1 TERM LOAN USD 3M +500BPS 18/10/2020	1,992,437	1,994,928	0.96
SHEARER'S FOODS TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +350BPS	671,625	670,785	0.32
SOURCEHOV TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +675BPS	993,750	921,703	0.44
SOUTHEAST POWERGEN TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +350BPS 02/12/2021	2,493,750	2,510,895	1.20
SPECTRUM BRANDS TERM TERM LOAN USD-LIBOR BBA 3M +300BPS	1,250,000	1,253,906	0.60
SRAM TERM TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +300BPS	1,315,152	1,315,152	0.63
STAPLES INC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +275BPS 24/04/2021	1,500,000	1,500,000	0.72
STATION CASINOS TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +325BPS 01/03/2020	1,895,916	1,897,270	0.91
SUN PRODUCTS CORP TRACHE B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M+425BPS	937,999	912,204	0.44
SUPERVALU INC TRANCHE B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +350BPS 21/03/2019	1,472,092	1,477,194	0.71
SURGERY PARTNERS TERM TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +425BPS 03/11/2020	1,895,250	1,890,512	0.91
SYNCREON GROUP (TERM B) TERM LOAN USD-LIBOR-BBA3M (+425 BPS)	2,500	2,262	—
TOWER AUTOMOTIVE TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +300BPS 23/04/2020	1,873,279	1,874,060	0.90
TRANSDIGM TERM D TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +300BPS	1,955,734	1,943,053	0.93
TRIBUNE TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +300BPS	1,475,209	1,473,365	0.71
TRINSEO TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +325BPS 28/10/2021	400,000	396,250	0.19
TRONOX PIGMENTS TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +300BPS 19/03/2020	2,034,162	2,035,434	0.97
TWIN RIVER TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +425BPS 10/07/2020	1,784,749	1,786,980	0.86
TXU TERM DIP TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +275BPS	1,429,703	1,435,958	0.69
UNIVISION COMMUNICATIONS INC TRANCHE C1 TERM LOAN USD-LIBOR-BBA	1,492,140	1,484,472	0.71
UNIVISION COMMUNICATIONS TERM C3 TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +300BPS	1,984,309	1,975,937	0.95
USI TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +325BPS 27/12/2019	993,709	995,572	0.48
UTEX INDUSTRIES INC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +400BPS	1,341,119	1,245,285	0.60
VALEANT PHARMA TERM BF1 TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +325BPS 13/03/2022	1,210,000	1,210,000	0.58
VALEANT PHARMACEUTICALS TERM BE TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +300BPS	2,151,107	2,146,536	1.03
VERINT SYSTEMS TERM B TERM LOAN USD-LIBOR- BBA 3M +275BPS	974,742	975,351	0.47
WALTER INVESTMENT MANAGEMENT TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +375BPS	1,361,310	1,289,273	0.62
WARNER MUSIC (TERM B) TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +275BPS	48	—	—
WEATHER CHANNEL TERM TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +600BPS 26/06/2020	800,000	748,666	0.36
WENCOR GROUP TERM TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +350BPS	1,845,615	1,834,080	0.88
WEST TERM B10 TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +250BPS 30/06/2018	750,000	748,906	0.36
WIDEPENWEST FINANCE LLC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +350BPS	2,292,323	2,293,756	1.10
ZINGO BV TERM B3 TERM LOAN USD-LIBOR- BBA 3M +275BPS	497,023	492,674	0.24
ZINGO BV TERM TERM B2 TERM LOAN USD-LIBOR- BBA 3M +275BPS	468,961	464,858	0.22
ZINGO BV TERM TERM B2 USD-LIBOR- BBA 3M +275BPS	302,207	299,563	0.14
有価証券 合計		200,781,709	96.16
その他資産		8,007,090	3.84
純資産総額		208,788,799	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6期

決算日 2015年2月16日

(計算期間：2014年2月18日～2015年2月16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。
委託会社等	委託会社：マニユライフ・インベストメンツ・ジャパン株式会社 運用権限の委託先：マニユライフ・アセット・マネジメント株式会社
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目指して運用を行います。 ②公社債の組入比率は原則として高位を維持します。 ③資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。
投資制限	①債券への投資割合は、制限を設けません。 ②外貨建資産への投資は行いません。

■最近5期の運用実績■

決算期	基準価額		NOMURA-BPI総合*		株式 組入比率	債券 組入比率	投資信託 証券比率	純資産 総額
	期 騰 落 率	騰 落 率	(ベンチマーク) 騰 落 率	騰 落 率				
2期(2011年2月15日)	円	%		%	%	%	%	百万円
	10,297	1.4	10,321	1.5	—	99.1	—	23,170
3期(2012年2月15日)	10,622	3.2	10,644	3.1	—	98.7	—	22,716
4期(2013年2月15日)	10,847	2.1	10,866	2.1	—	98.3	—	23,884
5期(2014年2月17日)	11,112	2.4	11,134	2.5	—	99.1	—	24,850
6期(2015年2月16日)	11,318	1.9	11,344	1.9	—	98.5	—	22,080

(注1) 基準価額は1万円当たりで表示しています。

(注2) 当ファンドのベンチマークはNOMURA-BPI総合(以下「ベンチマーク」といいます。)です。当ベンチマークは、ファンドの設定日の前営業日を10,000として、委託会社が計算したものです。

※ベンチマークに関して

NOMURA-BPI総合とは、野村證券株式会社の金融工学等研究部門が発表しているわが国の債券市場全体の動向を反映する投資収益指数(パフォーマンス)で、一定の組入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。NOMURA-BPI総合は、同社の知的財産であり、同指数に関する一切の権利は同社に帰属します。野村證券株式会社は、当該指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、当ファンドの運用成果等に関して一切責任を負うものではありません。

■当期中の基準価額と市況等の推移■

年月日	基準価額		NOMURA-BPI総合		株式 組入比率	債券 組入比率	投資信託 証券比率
	騰 落 率	騰 落 率	(ベンチマーク) 騰 落 率	騰 落 率			
(期首) 2014年2月17日	円	%		%	%	%	%
	11,112	—	11,134	—	—	99.1	—
2月末	11,121	0.1	11,145	0.1	—	98.7	—
3月末	11,095	△0.2	11,119	△0.1	—	99.0	—
4月末	11,110	△0.0	11,135	0.0	—	98.6	—
5月末	11,143	0.3	11,169	0.3	—	98.4	—
6月末	11,176	0.6	11,201	0.6	—	98.8	—
7月末	11,194	0.7	11,220	0.8	—	99.2	—
8月末	11,230	1.1	11,256	1.1	—	98.6	—
9月末	11,238	1.1	11,264	1.2	—	99.2	—
10月末	11,291	1.6	11,317	1.6	—	98.7	—
11月末	11,356	2.2	11,384	2.2	—	98.8	—
12月末	11,471	3.2	11,502	3.3	—	98.8	—
2015年1月末	11,475	3.3	11,506	3.3	—	98.6	—
(期末) 2015年2月16日	11,318	1.9	11,344	1.9	—	98.5	—

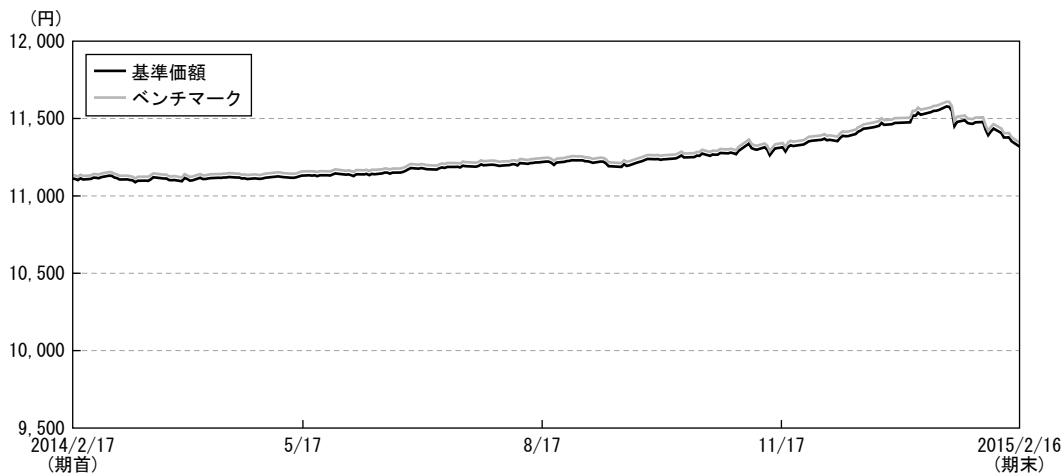
(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 基準価額は1万円当たりで表示しています。

(注3) 当ファンドのベンチマークはNOMURA-BPI総合です。当ベンチマークは、ファンドの設定日の前営業日を10,000として、委託会社が計算したものです。

■運用経過（2014年2月18日から2015年2月16日まで）

<基準価額の推移>



期 首：11,112円
 期 末：11,318円
 騰 落 率： 1.9%

※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。
 ※当ファンドのベンチマークは、NOMURA-BPI総合です。

<基準価額の主な変動要因>

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

<投資環境>

- 国内債券市場は、期首から2015年1月中旬にかけて上昇基調で推移しました。その後やや値を戻す展開となりましたが、期末では前期末比で堅調な結果となりました。前期末0.60%であった10年国債利回りは、日銀の追加緩和、国債買入れ増額による良好な需給環境等を背景に低下基調で推移しました。また米国以外の主要国中央銀行による利下げが相次ぎ、世界的に金利が低下する中、1月20日には一時的に0.195%まで低下しました。その後、1月22日の国債入札が不調に終わったことも相まって金利は上昇し、期末は0.44%となりました。

<当該投資信託のポートフォリオ>

当ファンドは、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目指して運用を行いました。期末時点での債券組入比率は98.5%でした。

<当該投資信託のベンチマークとの差異>

当ファンドの、当期の基準価額の騰落率は1.85%の上昇となりました。同期間におけるベンチマーク（NOMURA-BPI 総合）の騰落率は1.89%の上昇となり、ベンチマークに沿った運用を行った結果、基準価額はベンチマークを0.03%下回りました。

■今後の運用方針

当ファンドの運用の基本方針に従い、今後もNOMURA-BPI 総合に採用されている公社債に投資することにより、当該インデックスの動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

■ 1万口(元本10,000円)当たりの費用の明細■

該当事項ありません。

■ 当期中の売買及び取引の状況 ■ (2014年2月18日から2015年2月16日まで)

公社債

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国	国 債 証 券	2,882,333	5,371,033
	地 方 債 証 券	407,242	505,464
	特 殊 債 券	100,000	403,638 (25,348)
内	社債券(投資法人債券を含む)	399,667	402,657 (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。

■ 主要な売買銘柄 ■ (2014年2月18日から2015年2月16日まで)

公社債

買 付		売 付	
銘	柄 金 額	銘	柄 金 額
		千円	
第340回利付国債(2年)	600,132	第271回利付国債(10年)	758,857
第148回利付国債(20年)	351,749	第50回利付国債(20年)	510,878
第334回利付国債(10年)	302,309	第35回利付国債(20年)	378,731
第122回利付国債(5年)	300,756	第100回利付国債(20年)	348,816
第339回利付国債(2年)	300,069	第277回利付国債(10年)	325,750
第333回利付国債(10年)	299,383	第320回利付国債(10年)	316,410
第37回地方公共団体金融機構債券	204,316	第616回東京都公募公債	302,514
第44回地方公共団体金融機構債券	202,926	第16回日本政策投資銀行債券	300,964
第335回利付国債(10年)	200,736	第268回利付国債(10年)	279,138
第336回利付国債(10年)	152,574	第43回利付国債(20年)	230,056

(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) 国内の現先取引によるものは含まれておりません。

■ 利害関係人との取引状況等 ■ (2014年2月18日から2015年2月16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■ (2015年2月16日現在)

国内(邦貨建)公社債

種類別開示

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	15,973,000 (690,000)	17,102,239 (729,555)	77.5 (3.3)	— (—)	50.6 (1.7)	17.1 (1.1)	9.8 (0.5)
地方債証券	1,450,000 (1,450,000)	1,509,555 (1,509,555)	6.8 (6.8)	— (—)	3.3 (3.3)	3.1 (3.1)	0.5 (0.5)
特殊債証券 (除く金融債)	1,459,574 (1,459,574)	1,510,825 (1,510,825)	6.8 (6.8)	— (—)	1.1 (1.1)	4.8 (4.8)	0.9 (0.9)
金融債証券	300,000 (300,000)	301,003 (301,003)	1.4 (1.4)	— (—)	— (—)	0.9 (0.9)	0.5 (0.5)
普通社債証券 (含む投資法人債券)	1,300,000 (1,300,000)	1,333,549 (1,333,549)	6.0 (6.0)	— (—)	1.9 (1.9)	2.8 (2.8)	1.4 (1.4)
合 計	20,482,574 (5,199,574)	21,757,172 (5,384,488)	98.5 (24.4)	— (—)	56.9 (8.0)	28.7 (12.8)	13.0 (3.7)

(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。

銘柄別開示

銘 柄	当 期			末	
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日	
	%	千円	千円		
国債証券					
第339回利付国債(2年)	0.1	300,000	300,258	2016/4/15	
第340回利付国債(2年)	0.1	600,000	600,516	2016/5/15	
第95回利付国債(5年)	0.6	100,000	100,627	2016/3/20	
第96回利付国債(5年)	0.5	100,000	100,519	2016/3/20	
第97回利付国債(5年)	0.4	100,000	100,500	2016/6/20	
第98回利付国債(5年)	0.3	100,000	100,366	2016/6/20	
第102回利付国債(5年)	0.3	200,000	200,972	2016/12/20	
第104回利付国債(5年)	0.2	200,000	200,644	2017/3/20	
第106回利付国債(5年)	0.2	300,000	301,122	2017/9/20	
第107回利付国債(5年)	0.2	230,000	230,910	2017/12/20	
第108回利付国債(5年)	0.1	300,000	300,339	2017/12/20	
第110回利付国債(5年)	0.3	200,000	201,444	2018/3/20	
第111回利付国債(5年)	0.4	250,000	252,575	2018/3/20	
第114回利付国債(5年)	0.3	200,000	201,572	2018/9/20	
第115回利付国債(5年)	0.2	150,000	150,643	2018/9/20	
第116回利付国債(5年)	0.2	100,000	100,420	2018/12/20	
第122回利付国債(5年)	0.1	300,000	299,421	2019/12/20	
第1回利付国債(40年)	2.4	120,000	144,838	2048/3/20	
第6回利付国債(40年)	1.9	50,000	53,676	2053/3/20	
第7回利付国債(40年)	1.7	20,000	20,309	2054/3/20	

決 算 銘 柄	期 名	当 期 末		
		利 率	額 面 金 額	評 価 額 償 還 年 月 日
国債証券		%	千円	千円
第279回利付国債 (10年)		2.0	230,000	234,912 2016/3/20
第280回利付国債 (10年)		1.9	130,000	133,250 2016/6/20
第282回利付国債 (10年)		1.7	130,000	133,441 2016/9/20
第284回利付国債 (10年)		1.7	150,000	154,581 2016/12/20
第289回利付国債 (10年)		1.5	230,000	239,409 2017/12/20
第297回利付国債 (10年)		1.4	210,000	220,472 2018/12/20
第300回利付国債 (10年)		1.5	510,000	538,917 2019/3/20
第305回利付国債 (10年)		1.3	400,000	422,284 2019/12/20
第309回利付国債 (10年)		1.1	480,000	504,393 2020/6/20
第310回利付国債 (10年)		1.0	100,000	104,766 2020/9/20
第312回利付国債 (10年)		1.2	210,000	222,883 2020/12/20
第314回利付国債 (10年)		1.1	100,000	105,789 2021/3/20
第315回利付国債 (10年)		1.2	100,000	106,588 2021/6/20
第316回利付国債 (10年)		1.1	100,000	105,960 2021/6/20
第317回利付国債 (10年)		1.1	200,000	212,044 2021/9/20
第319回利付国債 (10年)		1.1	100,000	106,104 2021/12/20
第321回利付国債 (10年)		1.0	100,000	105,402 2022/3/20
第322回利付国債 (10年)		0.9	50,000	52,352 2022/3/20
第324回利付国債 (10年)		0.8	120,000	124,753 2022/6/20
第325回利付国債 (10年)		0.8	300,000	311,820 2022/9/20
第326回利付国債 (10年)		0.7	400,000	412,564 2022/12/20
第328回利付国債 (10年)		0.6	200,000	204,572 2023/3/20
第331回利付国債 (10年)		0.6	200,000	204,166 2023/9/20
第332回利付国債 (10年)		0.6	200,000	203,934 2023/12/20
第333回利付国債 (10年)		0.6	300,000	305,526 2024/3/20
第334回利付国債 (10年)		0.6	300,000	305,259 2024/6/20
第335回利付国債 (10年)		0.5	200,000	201,474 2024/9/20
第336回利付国債 (10年)		0.5	150,000	150,847 2024/12/20
第2回利付国債 (30年)		2.4	400,000	485,416 2030/2/20
第6回利付国債 (30年)		2.4	41,000	49,556 2031/11/20
第12回利付国債 (30年)		2.1	130,000	149,368 2033/9/20
第15回利付国債 (30年)		2.5	50,000	60,580 2034/6/20
第18回利付国債 (30年)		2.3	110,000	129,058 2035/3/20
第21回利付国債 (30年)		2.3	100,000	117,356 2035/12/20
第25回利付国債 (30年)		2.3	120,000	140,768 2036/12/20
第28回利付国債 (30年)		2.5	120,000	145,308 2038/3/20
第29回利付国債 (30年)		2.4	190,000	226,907 2038/9/20
第32回利付国債 (30年)		2.3	50,000	58,955 2040/3/20
第34回利付国債 (30年)		2.2	90,000	104,253 2041/3/20
第35回利付国債 (30年)		2.0	150,000	167,274 2041/9/20
第36回利付国債 (30年)		2.0	50,000	55,726 2042/3/20
第37回利付国債 (30年)		1.9	100,000	109,081 2042/9/20
第38回利付国債 (30年)		1.8	150,000	160,156 2043/3/20
第39回利付国債 (30年)		1.9	50,000	54,464 2043/6/20

決 算 期	当 期	末		
銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第40回利付国債 (30年)	1.8	50,000	53,267	2043/9/20
第41回利付国債 (30年)	1.7	50,000	52,065	2043/12/20
第44回利付国債 (30年)	1.7	50,000	51,942	2044/9/20
第43回利付国債 (20年)	2.9	100,000	112,654	2019/9/20
第47回利付国債 (20年)	2.2	150,000	167,181	2020/9/21
第63回利付国債 (20年)	1.8	100,000	111,968	2023/6/20
第65回利付国債 (20年)	1.9	20,000	22,647	2023/12/20
第68回利付国債 (20年)	2.2	53,000	61,495	2024/3/20
第72回利付国債 (20年)	2.1	220,000	254,526	2024/9/20
第74回利付国債 (20年)	2.1	35,000	40,534	2024/12/20
第76回利付国債 (20年)	1.9	100,000	114,149	2025/3/20
第78回利付国債 (20年)	1.9	54,000	61,701	2025/6/20
第81回利付国債 (20年)	2.0	100,000	115,429	2025/9/20
第82回利付国債 (20年)	2.1	20,000	23,287	2025/9/20
第83回利付国債 (20年)	2.1	100,000	116,625	2025/12/20
第84回利付国債 (20年)	2.0	100,000	115,596	2025/12/20
第90回利付国債 (20年)	2.2	100,000	118,229	2026/9/20
第91回利付国債 (20年)	2.3	100,000	119,321	2026/9/20
第92回利付国債 (20年)	2.1	50,000	58,611	2026/12/20
第94回利付国債 (20年)	2.1	70,000	82,105	2027/3/20
第95回利付国債 (20年)	2.3	300,000	359,187	2027/6/20
第100回利付国債 (20年)	2.2	140,000	166,163	2028/3/20
第108回利付国債 (20年)	1.9	440,000	505,005	2028/12/20
第121回利付国債 (20年)	1.9	100,000	114,058	2030/9/20
第124回利付国債 (20年)	2.0	80,000	92,260	2030/12/20
第125回利付国債 (20年)	2.2	100,000	118,097	2031/3/20
第127回利付国債 (20年)	1.9	100,000	113,649	2031/3/20
第129回利付国債 (20年)	1.8	20,000	22,403	2031/6/20
第133回利付国債 (20年)	1.8	50,000	55,763	2031/12/20
第134回利付国債 (20年)	1.8	150,000	166,899	2032/3/20
第136回利付国債 (20年)	1.6	70,000	75,740	2032/3/20
第139回利付国債 (20年)	1.6	100,000	107,986	2032/6/20
第141回利付国債 (20年)	1.7	180,000	196,394	2032/12/20
第142回利付国債 (20年)	1.8	100,000	110,684	2032/12/20
第144回利付国債 (20年)	1.5	150,000	158,451	2033/3/20
第145回利付国債 (20年)	1.7	150,000	162,861	2033/6/20
第147回利付国債 (20年)	1.6	50,000	53,195	2033/12/20
第148回利付国債 (20年)	1.5	350,000	365,732	2034/3/20
小 計		15,973,000	17,102,239	
地方債証券				
第13回東京都公募公債	1.93	100,000	106,293	2042/3/19
第664回東京都公募公債	1.4	200,000	209,668	2018/12/20
第668回東京都公募公債	1.54	150,000	158,470	2019/3/20
第155回神奈川県公募公債	1.61	100,000	104,956	2018/6/20

決 算 期	当 期	末		
銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券	%	千円	千円	
平成23年度第2回愛知県公募公債	0.425	100,000	100,436	2016/5/24
第61回共同発行市場公募地方債	1.55	100,000	104,539	2018/4/25
平成20年度第4回横浜市公募公債	1.71	100,000	105,841	2018/11/16
第37回地方公共団体金融機構債券	0.852	200,000	206,982	2022/6/28
第40回地方公共団体金融機構債券	0.825	200,000	206,508	2022/9/28
第44回地方公共団体金融機構債券	0.791	200,000	205,862	2023/1/27
小 計		1,450,000	1,509,555	
特殊債券（除く金融債）				
第9回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.32	200,000	201,390	2019/4/25
第864回政府保証公営企業債券	1.9	100,000	102,459	2016/6/22
第877回政府保証公営企業債券	1.9	100,000	104,361	2017/7/18
第881回政府保証公営企業債券	1.5	130,000	135,358	2018/1/23
第36回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.9	200,000	208,478	2017/6/20
第52回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.6	100,000	104,539	2018/2/28
第29回日本政策投資銀行債券	1.86	100,000	103,158	2016/12/20
第35回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.65	200,000	209,122	2018/3/20
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	35,041	37,688	2042/5/10
第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.25	25,205	27,247	2037/5/10
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.67	77,902	82,351	2046/7/10
第75回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.26	91,426	94,392	2048/8/10
第57回中日本高速道路株式会社債	0.294	100,000	100,279	2019/3/20
小 計		1,459,574	1,510,825	
金融債券				
い第756号農林債	0.3	200,000	200,454	2018/5/25
第259回信金中金債	0.55	100,000	100,549	2016/6/27
小 計		300,000	301,003	
普通社債券（含む投資法人債券）				
第411回中部電力株式会社社債	3.125	100,000	106,348	2017/4/25
第7回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	0.258	100,000	100,165	2016/6/20
第11回パナソニック株式会社無担保社債	1.081	100,000	102,597	2018/3/20
第1回明治安田生命2014基金特定目的会社債	0.51	100,000	100,179	2019/8/7
第81回三菱商事株式会社無担保社債	1.518	100,000	103,533	2032/6/25
第54回株式会社三井住友銀行無担保社債	0.49	100,000	100,468	2016/7/20
第30回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	0.26	100,000	100,047	2019/6/20
第55回小田急電鉄株式会社無担保社債	1.367	100,000	106,137	2020/12/17
第69回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.222	100,000	105,062	2020/7/22
第23回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.14	100,000	106,192	2018/4/25
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	0.69	100,000	102,031	2023/3/20
第8回オーストラリア・コモンウェルス銀行円貨社債	0.407	100,000	100,434	2019/5/2
第4回ウォルマート・ストアーズ・インク円貨社債	0.94	100,000	100,356	2015/7/28
小 計		1,300,000	1,333,549	
合 計		20,482,574	21,757,172	

(注) 額面金額・評価額の単位未満は切り捨てです。

■投資信託財産の構成■ (2015年2月16日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公 社 債	21,757,172	98.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	366,142	1.7
投 資 信 託 財 産 総 額	22,123,314	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 (2015年2月16日)
(A) 資 産	22,123,314,675円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	289,958,965
公 社 債(評価額)	21,757,172,987
未 収 利 息	75,812,724
前 払 費 用	369,999
(B) 負 債	42,907,196
未 払 解 約 金	42,907,196
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	22,080,407,479
元 本	19,509,239,184
次 期 繰 越 損 益 金	2,571,168,295
(D) 受 益 権 総 口 数	19,509,239,184口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	11,318円

(注1) 当親ファンドの期首元本額は22,364,025,820円、期中追加設定元本額は1,048,286,630円、期中一部解約元本額は3,903,073,266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、マニュアル・日本債券インデックスファンド(適格機関投資家専用) 14,677,719,187円、マニュアル・国際分散ファンド20(適格機関投資家専用) 4,716,710,303円、マニュアル・国際分散ファンド75(適格機関投資家専用) 79,511,108円、マニュアル・国際分散ファンド50(適格機関投資家専用) 34,213,378円、マニュアル・アジア・オセアニア小型成長株ファンド91,845円、マニュアル・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、マニュアル・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、マニュアル・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、マニュアル・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、マニュアル・フレキシブル戦略ファンド Dコース(為替ヘッジなし・年2回) 90,400円、マニュアル・フレキシブル戦略ファンド Cコース(為替ヘッジあり・年2回) 90,400円、マニュアル・フレキシブル戦略ファンド Bコース(為替ヘッジなし・毎月) 90,400円、マニュアル・フレキシブル戦略ファンド Aコース(為替ヘッジあり・毎月) 90,400円、マニュアル・銀行貸付債権ファンド(為替ヘッジあり・繰上償還条項付) 14-06 89,446円、マニュアル・銀行貸付債権ファンド14-07 89,302円、マニュアル・銀行貸付債権ファンド15-01 87,215円です。

(注3) 1口当たり純資産額は1,1318円です。

※当ファンドは監査対象ではありません。

■損益の状況■

項 目	当 期 〔自2014年2月18日 至2015年2月16日〕
(A) 配 当 等 収 益	293,650,388円
受 取 利 息	293,650,388
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	161,593,261
売 買 益	244,259,206
売 買 損	△ 82,665,945
(C) 当 期 損 益 金(A+B)	455,243,649
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	2,486,198,545
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	130,415,726
(F) 解 約 差 損 益 金	△ 500,689,625
(G) 計 (C+D+E+F)	2,571,168,295
次 期 繰 越 損 益 金(G)	2,571,168,295

(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(E)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3) 損益の状況の中で(F)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。

お知らせ

◆約款変更

- ・実際の運用に合わせて、デリバティブ取引に関する記載を削除する変更を行いました。（変更日：2014年12月1日）
- ・信託契約の解約、変更等における書面決議の要件を緩和するため、信託約款に所要の変更を行いました。（変更日：2014年12月1日）
- ・信託契約の解約、変更等における書面決議手続きに関し、信託約款に所要の変更を行いました。（変更日：2014年12月1日）

◆運用体制の変更

該当事項はありません。