

Aコース (為替ヘッジあり・毎月)

Bコース (為替ヘッジなし・毎月)

Cコース (為替ヘッジあり・年2回)

Dコース (為替ヘッジなし・年2回)

愛称：アメリカン・フロート

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／その他資産（貸付債権）
信託期間	2013年9月12日から無期限です。
運用方針	投資信託証券への投資を通じて、主として米ドル建ての銀行貸付債権に投資を行い、安定的な金利収入の確保と信託財産の成長をめざして運用を行います。
主要投資対象	投資信託証券（外国籍投資信託証券および国内投資信託証券（親投資信託を含みます。）を含みます。）を主要投資対象とします。 ・ケイマン籍外国投資信託「マニユライフ・インベストメンツ・トラスト・フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA」 ・親投資信託「マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド」
主な投資制限	①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 ②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ③同一銘柄の投資信託証券への投資割合には制限を設けません。
分配方針	毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。 ①分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 ②収益分配金額は、委託会社が基準価額の水準・市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合等には、分配を行わないことがあります。

運用報告書（全体版）

Aコース (為替ヘッジあり・毎月) /  
Bコース (為替ヘッジなし・毎月)

第103期 (決算日 2022年4月5日)

第104期 (決算日 2022年5月6日)

第105期 (決算日 2022年6月6日)

第106期 (決算日 2022年7月5日)

第107期 (決算日 2022年8月5日)

第108期 (決算日 2022年9月5日)

Cコース (為替ヘッジあり・年2回) /

Dコース (為替ヘッジなし・年2回)

第18期 (決算日 2022年9月5日)

－受益者のみなさまへ－

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

さて、「マニユライフ・変動高金利戦略ファンド Aコース (為替ヘッジあり・毎月) / Bコース (為替ヘッジなし・毎月)」は第108期、「マニユライフ・変動高金利戦略ファンド Cコース (為替ヘッジあり・年2回) / Dコース (為替ヘッジなし・年2回)」は第18期の決算を行いました。

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

マニユライフ・インベストメント・マネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-8-1 丸の内トラストタワーN館

お問い合わせ先

サポートダイヤル：03-6267-1901

受付時間：営業日の午前9時～午後5時

ホームページアドレス：www.manulifeim.co.jp/

## 【Aコース】

### ■最近5作成期の運用実績

作成期	決算期	基準価額			参考指数		株式組入比率	債券組入比率	投資信託証券比率	純資産総額
		(分配落)	税込分配金	期中騰落率		騰落率				
第14作成期	79期（2020年4月6日）	円 6,290	円 25	% △12.3		% △12.8	% —	% 0.0	% 102.5	百万円 851
	80期（2020年5月7日）	6,480	25	3.4	11,757	4.5	—	0.0	96.7	877
	81期（2020年6月5日）	6,747	25	4.5	12,355	5.1	—	0.0	100.2	909
	82期（2020年7月6日）	6,702	25	△0.3	12,388	0.3	—	0.0	99.2	890
	83期（2020年8月5日）	6,768	25	1.4	12,612	1.8	—	0.0	96.9	928
	84期（2020年9月7日）	6,856	25	1.7	12,866	2.0	—	0.0	99.2	926
第15作成期	85期（2020年10月5日）	6,786	25	△0.7	12,871	0.0	—	0.0	98.2	907
	86期（2020年11月5日）	6,788	25	0.4	12,931	0.5	—	0.0	96.5	900
	87期（2020年12月7日）	6,883	25	1.8	13,232	2.3	—	0.0	97.7	896
	88期（2021年1月5日）	6,900	25	0.6	13,361	1.0	—	0.0	96.9	886
	89期（2021年2月5日）	6,923	25	0.7	13,534	1.3	—	0.0	99.4	875
	90期（2021年3月5日）	6,913	25	0.2	13,597	0.5	—	0.0	99.4	790
第16作成期	91期（2021年4月5日）	6,874	25	△0.2	13,612	0.1	—	0.0	102.0	772
	92期（2021年5月6日）	6,861	25	0.2	13,679	0.5	—	0.0	98.8	762
	93期（2021年6月7日）	6,863	25	0.4	13,757	0.6	—	0.0	98.1	741
	94期（2021年7月5日）	6,843	25	0.1	13,809	0.4	—	0.0	100.9	732
	95期（2021年8月5日）	6,801	25	△0.2	13,805	△0.0	—	0.0	97.8	722
	96期（2021年9月6日）	6,797	25	0.3	13,885	0.6	—	0.0	98.2	716
第17作成期	97期（2021年10月5日）	6,799	25	0.4	13,967	0.6	—	0.0	97.0	702
	98期（2021年11月5日）	6,762	25	△0.2	14,004	0.3	—	0.0	101.1	691
	99期（2021年12月6日）	6,718	25	△0.3	13,983	△0.1	—	0.0	97.0	674
	100期（2022年1月5日）	6,717	25	0.4	14,083	0.7	—	0.0	100.5	616
	101期（2022年2月7日）	6,703	25	0.2	14,120	0.3	—	0.0	98.2	612
	102期（2022年3月7日）	6,625	25	△0.8	14,025	△0.7	—	0.0	98.7	604
第18作成期	103期（2022年4月5日）	6,606	25	0.1	14,086	0.4	—	0.0	98.8	599
	104期（2022年5月6日）	6,530	25	△0.8	14,024	△0.4	—	0.0	106.3	589
	105期（2022年6月6日）	6,380	25	△1.9	13,787	△1.7	—	0.0	99.2	569
	106期（2022年7月5日）	6,131	25	△3.5	13,420	△2.7	—	0.0	98.9	544
	107期（2022年8月5日）	6,189	25	1.4	13,764	2.6	—	0.0	98.7	546
	108期（2022年9月5日）	6,203	25	0.6	13,867	0.7	—	0.0	105.1	546

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

## ■ 当作成期中の基準価額と市況等の推移

決算期	年 月 日	基 準 価 額		参 考 指 数		株 式 組 入 比 率	債 券 組 入 比 率	投 資 信 託 証 券 比 率
		騰 落 率	騰 落 率					
第103期	(期 首) 2022年 3 月 7 日	円 6,625	% —	14,025	% —	% —	% 0.0	% 98.7
	3 月 末	6,618	△0.1	14,029	0.0	—	0.0	98.3
	(期 末) 2022年 4 月 5 日	6,631	0.1	14,086	0.4	—	0.0	98.8
第104期	(期 首) 2022年 4 月 5 日	6,606	—	14,086	—	—	0.0	98.8
	4 月 末	6,591	△0.2	14,089	0.0	—	0.0	104.4
	(期 末) 2022年 5 月 6 日	6,555	△0.8	14,024	△0.4	—	0.0	106.3
第105期	(期 首) 2022年 5 月 6 日	6,530	—	14,024	—	—	0.0	106.3
	5 月 末	6,350	△2.8	13,691	△2.4	—	0.0	96.7
	(期 末) 2022年 6 月 6 日	6,405	△1.9	13,787	△1.7	—	0.0	99.2
第106期	(期 首) 2022年 6 月 6 日	6,380	—	13,787	—	—	0.0	99.2
	6 月 末	6,196	△2.9	13,505	△2.0	—	0.0	98.8
	(期 末) 2022年 7 月 5 日	6,156	△3.5	13,420	△2.7	—	0.0	98.9
第107期	(期 首) 2022年 7 月 5 日	6,131	—	13,420	—	—	0.0	98.9
	7 月 末	6,210	1.3	13,679	1.9	—	0.0	98.4
	(期 末) 2022年 8 月 5 日	6,214	1.4	13,764	2.6	—	0.0	98.7
第108期	(期 首) 2022年 8 月 5 日	6,189	—	13,764	—	—	0.0	98.7
	8 月 末	6,237	0.8	13,903	1.0	—	0.0	103.3
	(期 末) 2022年 9 月 5 日	6,228	0.6	13,867	0.7	—	0.0	105.1

(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14作成期	79期（2020年4月6日）	6,867	60	△10.9	12,219	△11.6	—	0.0	97.5	2,955
	80期（2020年5月7日）	6,864	60	0.8	12,454	1.9	—	0.0	98.4	2,956
	81期（2020年6月5日）	7,301	60	7.2	13,435	7.9	—	0.0	97.5	3,148
	82期（2020年7月6日）	7,135	60	△1.5	13,293	△1.1	—	0.0	99.3	3,049
	83期（2020年8月5日）	7,037	60	△0.5	13,277	△0.1	—	0.0	97.6	2,969
	84期（2020年9月7日）	7,144	60	2.4	13,641	2.7	—	0.0	97.6	2,979
第15作成期	85期（2020年10月5日）	6,991	60	△1.3	13,548	△0.7	—	0.0	97.6	2,867
	86期（2020年11月5日）	6,876	60	△0.8	13,443	△0.8	—	0.0	97.5	2,776
	87期（2020年12月7日）	6,927	60	1.6	13,728	2.1	—	0.0	97.5	2,718
	88期（2021年1月5日）	6,854	60	△0.2	13,738	0.1	—	0.0	98.3	2,629
	89期（2021年2月5日）	6,999	60	3.0	14,238	3.6	—	0.0	97.7	2,663
	90期（2021年3月5日）	7,106	60	2.4	14,625	2.7	—	0.0	97.6	2,671
第16作成期	91期（2021年4月5日）	7,212	60	2.3	15,013	2.7	—	0.0	97.3	2,682
	92期（2021年5月6日）	7,083	60	△1.0	14,908	△0.7	—	0.0	97.5	2,608
	93期（2021年6月7日）	7,068	60	0.6	15,026	0.8	—	0.0	98.1	2,564
	94期（2021年7月5日）	7,113	60	1.5	15,301	1.8	—	0.0	96.9	2,584
	95期（2021年8月5日）	6,945	60	△1.5	15,090	△1.4	—	0.0	98.8	2,467
	96期（2021年9月6日）	6,918	60	0.5	15,202	0.7	—	0.0	97.4	2,458
第17作成期	97期（2021年10月5日）	6,950	60	1.3	15,441	1.6	—	0.0	99.0	2,454
	98期（2021年11月5日）	7,059	60	2.4	15,883	2.9	—	0.0	98.5	2,399
	99期（2021年12月6日）	6,938	60	△0.9	15,762	△0.8	—	0.0	98.1	2,299
	100期（2022年1月5日）	7,093	60	3.1	16,313	3.5	—	0.0	97.8	2,319
	101期（2022年2月7日）	6,990	60	△0.6	16,223	△0.6	—	0.0	98.5	2,252
	102期（2022年3月7日）	6,863	60	△1.0	16,080	△0.9	—	0.0	98.1	2,160
第18作成期	103期（2022年4月5日）	7,254	60	6.6	17,209	7.0	—	0.0	97.5	2,232
	104期（2022年5月6日）	7,594	60	5.5	18,246	6.0	—	0.0	97.8	2,304
	105期（2022年6月6日）	7,413	60	△1.6	17,982	△1.4	—	0.0	97.3	2,198
	106期（2022年7月5日）	7,391	60	0.5	18,212	1.3	—	0.0	99.0	2,108
	107期（2022年8月5日）	7,286	60	△0.6	18,250	0.2	—	0.0	97.2	2,091
	108期（2022年9月5日）	7,671	60	6.1	19,400	6.3	—	0.0	98.2	2,161

(注1) 基準価額は1万円当たり、騰落率は分配金込みです。

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

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

参考指数に関して

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

## ■ 当作成期中の基準価額と市況等の推移

決算期	年 月 日	基 準 価 額		参 考 指 数		株 式 組 入 比 率	債 券 組 入 比 率	投 資 信 託 証 券 比 率
		騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率			
第103期	(期 首) 2022年 3 月 7 日	円 6,863	% —	16,080	% —	% —	% 0.0	% 98.1
	3 月 末	7,289	6.2	17,116	6.4	—	0.0	98.2
	(期 末) 2022年 4 月 5 日	7,314	6.6	17,209	7.0	—	0.0	97.5
第104期	(期 首) 2022年 4 月 5 日	7,254	—	17,209	—	—	0.0	97.5
	4 月 末	7,598	4.7	18,097	5.2	—	0.0	96.6
	(期 末) 2022年 5 月 6 日	7,654	5.5	18,246	6.0	—	0.0	97.8
第105期	(期 首) 2022年 5 月 6 日	7,594	—	18,246	—	—	0.0	97.8
	5 月 末	7,264	△4.3	17,498	△4.1	—	0.0	96.6
	(期 末) 2022年 6 月 6 日	7,473	△1.6	17,982	△1.4	—	0.0	97.3
第106期	(期 首) 2022年 6 月 6 日	7,413	—	17,982	—	—	0.0	97.3
	6 月 末	7,524	1.5	18,400	2.3	—	0.0	98.1
	(期 末) 2022年 7 月 5 日	7,451	0.5	18,212	1.3	—	0.0	99.0
第107期	(期 首) 2022年 7 月 5 日	7,391	—	18,212	—	—	0.0	99.0
	7 月 末	7,418	0.4	18,354	0.8	—	0.0	96.6
	(期 末) 2022年 8 月 5 日	7,346	△0.6	18,250	0.2	—	0.0	97.2
第108期	(期 首) 2022年 8 月 5 日	7,286	—	18,250	—	—	0.0	97.2
	8 月 末	7,649	5.0	19,212	5.3	—	0.0	96.6
	(期 末) 2022年 9 月 5 日	7,731	6.1	19,400	6.3	—	0.0	98.2

(注1) 騰落率は期首比です。(期末基準価額は分配金を含みます。)

(注2) 基準価額は1万円当たりで表示しています。

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

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

## 【Cコース】

### ■最近5期の運用実績

決算期	基準価額			参考指数		株式組入比率	債券組入比率	投資信託証券比率	純資産総額
	(分配落)	税込分配金	期中騰落率	騰落率	騰落率				
	円	円	%		%	%	%	%	百万円
14期(2020年9月7日)	9,771	0	△2.9	12,866	△0.2	—	0.1	98.4	91
15期(2021年3月5日)	10,063	0	3.0	13,597	5.7	—	0.2	99.2	69
16期(2021年9月6日)	10,109	0	0.5	13,885	2.1	—	0.2	97.0	65
17期(2022年3月7日)	10,072	0	△0.4	14,025	1.0	—	0.2	98.5	57
18期(2022年9月5日)	9,650	0	△4.2	13,867	△1.1	—	0.2	104.2	49

(注1) 基準価額は1万口当たり、騰落率は分配金込みです。

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

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

参考指数に関して

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

### ■当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		参考指数		株式組入比率	債券組入比率	投資信託証券比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率			
(期首) 2022年3月7日	円	%		%	%	%	%
	10,072	—	14,025	—	—	0.2	98.5
3月末	10,060	△0.1	14,029	0.0	—	0.2	97.9
4月末	10,057	△0.1	14,089	0.5	—	0.2	103.4
5月末	9,727	△3.4	13,691	△2.4	—	0.2	95.5
6月末	9,529	△5.4	13,505	△3.7	—	0.2	98.4
7月末	9,588	△4.8	13,679	△2.5	—	0.2	98.1
8月末	9,668	△4.0	13,903	△0.9	—	0.2	102.4
(期末) 2022年9月5日	9,650	△4.2	13,867	△1.1	—	0.2	104.2

(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
	(分配額)	税込分配金	期中騰落率	騰落率	騰落率				
	円	円	%		%	%	%	%	百万円
14期(2020年9月7日)	11,444	0	△ 3.2	13,641	△ 1.3	—	0.1	98.6	218
15期(2021年3月5日)	11,989	0	4.8	14,625	7.2	—	0.1	98.0	196
16期(2021年9月6日)	12,277	0	2.4	15,202	3.9	—	0.1	96.9	163
17期(2022年3月7日)	12,806	0	4.3	16,080	5.8	—	0.1	98.4	157
18期(2022年9月5日)	15,038	0	17.4	19,400	20.6	—	0.1	96.7	138

(注1) 基準価額は1万円当たり、騰落率は分配金込みです。

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

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

参考指数に関して

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

### ■当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		参考指数		株式組入比率	債券組入比率	投資信託証券比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率			
(期首) 2022年3月7日	円	%		%	%	%	%
	12,806	—	16,080	—	—	0.1	98.4
3月末	13,603	6.2	17,116	6.4	—	0.1	98.4
4月末	14,296	11.6	18,097	12.5	—	0.1	97.3
5月末	13,782	7.6	17,498	8.8	—	0.1	97.1
6月末	14,404	12.5	18,400	14.4	—	0.1	98.1
7月末	14,307	11.7	18,354	14.1	—	0.1	98.8
8月末	14,879	16.2	19,212	19.5	—	0.1	98.5
(期末) 2022年9月5日	15,038	17.4	19,400	20.6	—	0.1	96.7

(注1) 騰落率は期首比です。（期末基準価額は分配金を含みます。）

(注2) 基準価額は1万円当たりで表示しています。

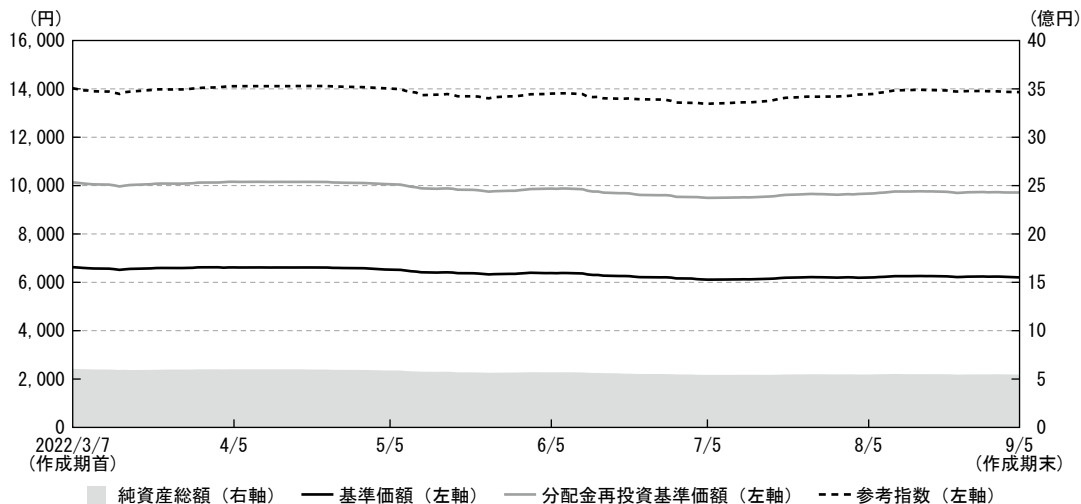
(注3) 当ファンドの参考指数は、クレディ・スイス・レパレジッド・ローン・インデックス（配当込み／円換算ベース／三菱UFJ銀行T T M）です。当参考指数は、ファンドの設定日の前営業日を10,000として、委託会社が算出したものです。

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

## 運用経過

### ■基準価額等の推移（2022年3月8日から2022年9月5日まで）

#### Aコース



作成期首：6,625円

作成期末：6,203円（既払分配金150円）

騰落率：△4.1%（分配金再投資ベース）

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

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

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

### ■基準価額の主な変動要因

- ・投資先ファンドの保有する銀行貸付債権の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。

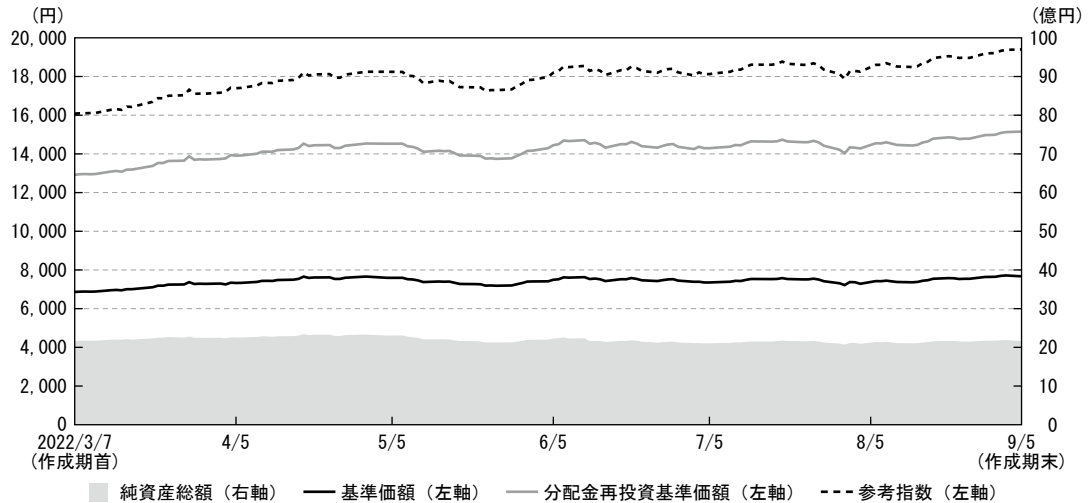
### ◆当作成期間の組入ファンドの騰落率

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	△2.8%
マニュアル・日本債券インデックス・マザーファンド	△1.7%



## ■基準価額等の推移 (2022年3月8日から2022年9月5日まで)

### Bコース



作成期首 : 6,863円

作成期末 : 7,671円 (既払分配金360円)

騰落率 : 17.3% (分配金再投資ベース)

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

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

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

### ■基準価額の主な変動要因

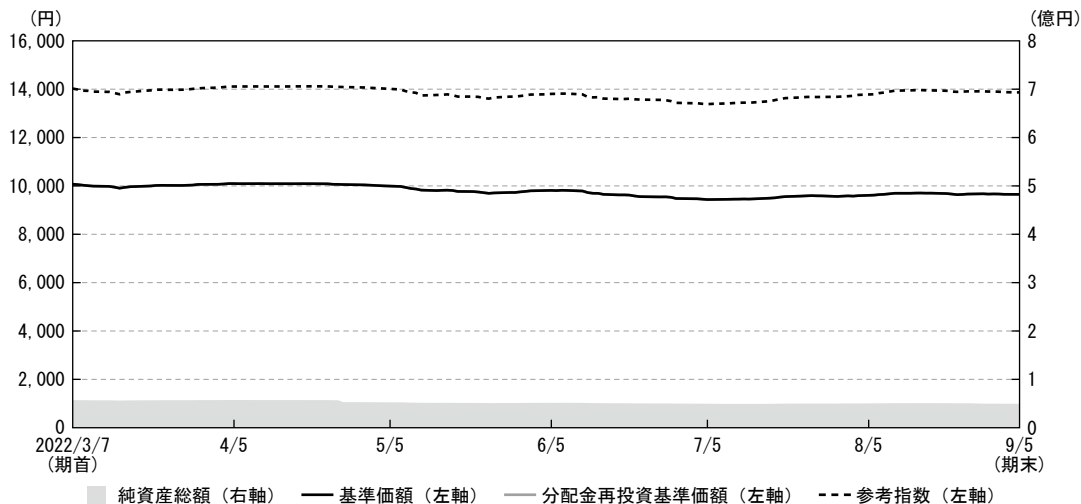
- ・投資先ファンドの保有する銀行貸付債権の安定的な利息収入がプラス寄与しました。
- ・円が米ドルに対し下落 (円安) したことがプラス寄与しました。
- ・銀行貸付債権の価格下落がマイナス寄与しました。

### ◆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	△2.8%
マニュアル・日本債券インデックス・マザーファンド	△1.7%

## ■基準価額等の推移（2022年3月8日から2022年9月5日まで）

### Cコース



期 首：10,072円

期 末：9,650円（既払分配金0円）

騰落率：△4.2%（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

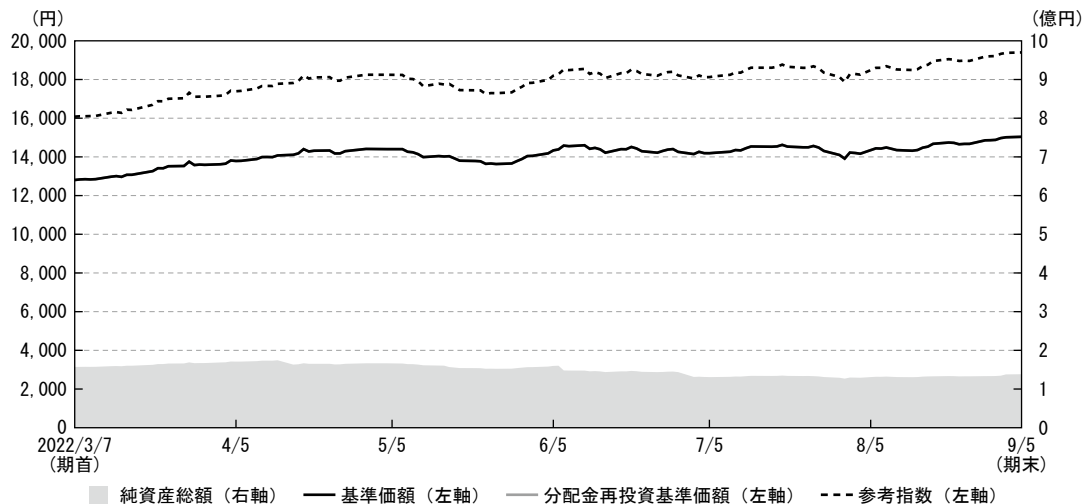
- ・投資先ファンドの保有する銀行貸付債権の安定的な利息収入がプラス寄与しました。
- ・銀行貸付債権の価格下落がマイナス寄与しました。
- ・為替ヘッジ取引にかかるコスト（ヘッジコスト）がマイナス寄与しました。

### ◆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%

## ■基準価額等の推移（2022年3月8日から2022年9月5日まで）

### Dコース



期首：12,806円

期末：15,038円（既払分配金0円）

騰落率：17.4%（分配金再投資ベース）

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

※当ファンドの参考指数は、クレディ・スイス・レバレッジド・ローン・インデックス（配当込み/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。
- ・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%

## ■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。

## ■当該投資信託のポートフォリオ

### 全コース共通

主要投資対象とするケイマン籍外国投資信託「マニユライフ・インベストメンツ・トラストーフローティング・レート・インカム・ファンド クラスA」（以下「MIT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）の組入比率は高位に維持しました。

Aコース、Cコースでは、円に対する米ドルの為替ヘッジ取引を活用し、為替リスクの低減を図っています。

### MITーフローティング・レート・インカム・ファンド クラスA

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

### マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド

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

### Aコース

組入ファンド・資産	比率
MITーフローティング・レート・インカム・ファンド クラスA	105.1%
マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	0.0%
現預金等	△5.1%
合計	100.0%

### Bコース

組入ファンド・資産	比率
MITーフローティング・レート・インカム・ファンド クラスA	98.2%
マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	0.0%
現預金等	1.8%
合計	100.0%

### Cコース

組入ファンド・資産	比率
MITーフローティング・レート・インカム・ファンド クラスA	104.2%
マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	0.2%
現預金等	△4.4%
合計	100.0%

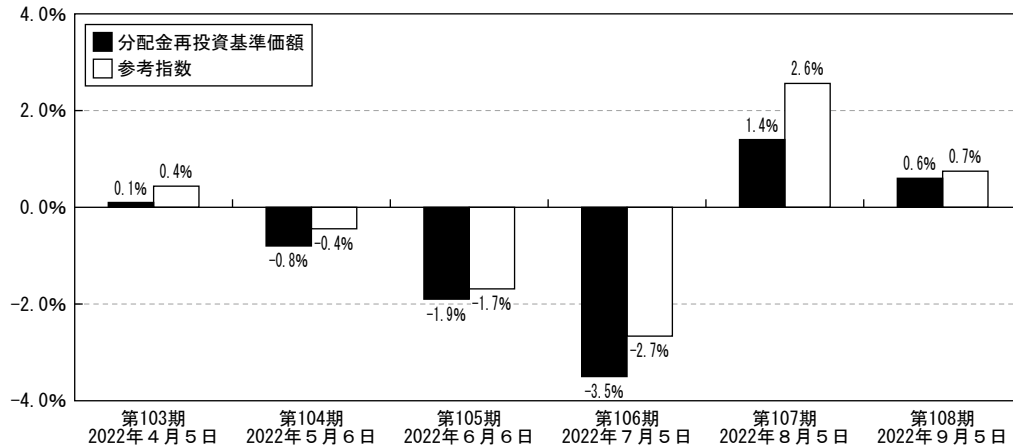
### Dコース

組入ファンド・資産	比率
MITーフローティング・レート・インカム・ファンド クラスA	96.7%
マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	0.1%
現預金等	3.2%
合計	100.0%

## ■当該投資信託のベンチマークとの差異

### Aコース

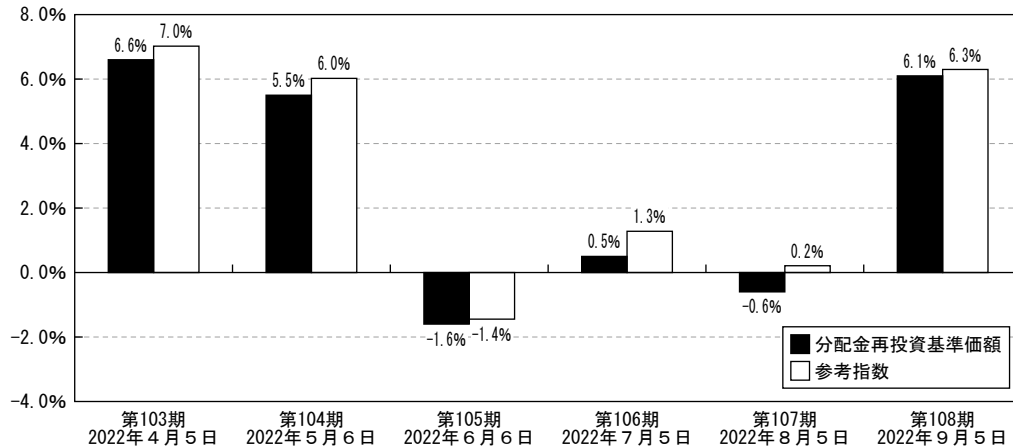
当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率の対比です。



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

### Bコース

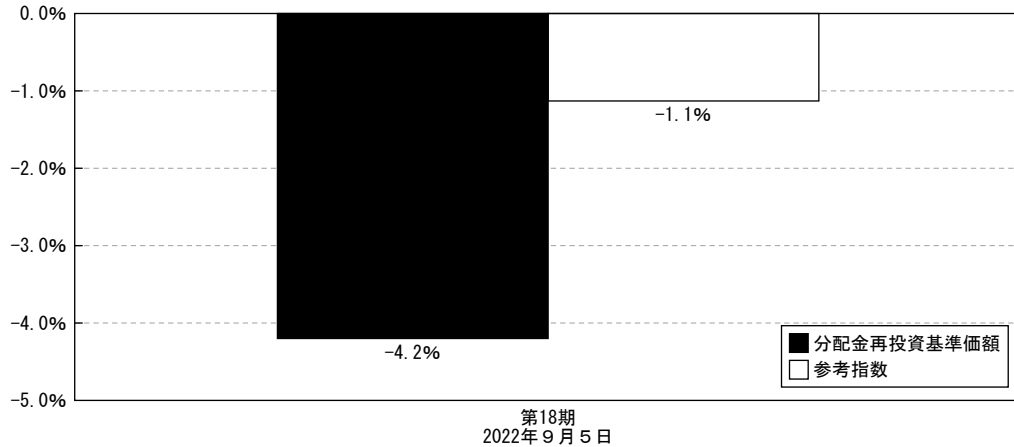
当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率の対比です。



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

## Cコース

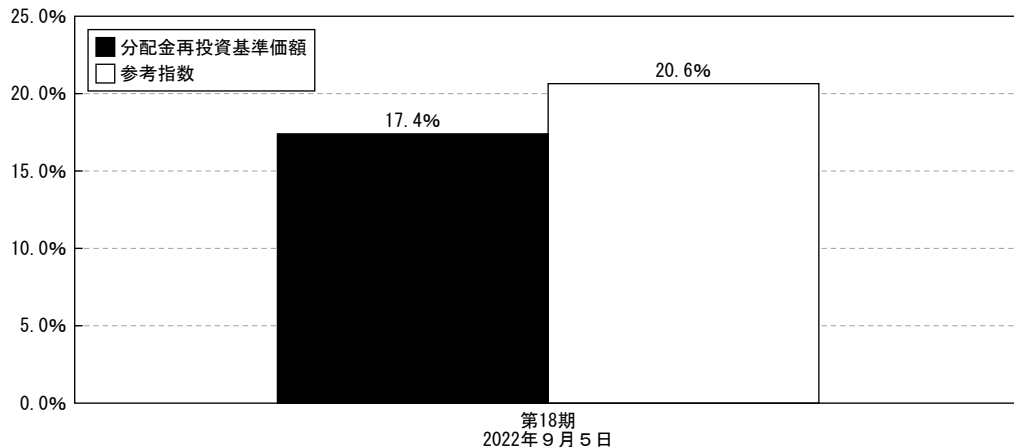
当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率の対比です。



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

## Dコース

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



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

## ■収益分配金について

### Aコース

当作成期間の収益分配は、分配方針に基づき第103期～第108期は25円、合計150円（1万口当たり、税引前）とさせていただきます。留保益の運用については、元本部分と同一の運用を行います。

#### [分配原資の内訳]

（1万口当たり、税引前）

	第103期	第104期	第105期	第106期	第107期	第108期
	自 2022年3月8日 至 2022年4月5日	自 2022年4月6日 至 2022年5月6日	自 2022年5月7日 至 2022年6月6日	自 2022年6月7日 至 2022年7月5日	自 2022年7月6日 至 2022年8月5日	自 2022年8月6日 至 2022年9月5日
当期分配金 (円)	25	25	25	25	25	25
(対基準価額比率) (%)	0.377	0.381	0.390	0.406	0.402	0.401
当期の収益 (円)	23	24	24	23	23	23
当期の収益以外 (円)	1	0	0	1	1	1
翌期繰越分配対象額 (円)	368	380	389	399	412	425

(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103期～第108期は60円、合計360円（1万口当たり、税引前）とさせていただきます。留保益の運用については、元本部分と同一の運用を行います。

#### [分配原資の内訳]

（1万口当たり、税引前）

	第103期	第104期	第105期	第106期	第107期	第108期
	自 2022年3月8日 至 2022年4月5日	自 2022年4月6日 至 2022年5月6日	自 2022年5月7日 至 2022年6月6日	自 2022年6月7日 至 2022年7月5日	自 2022年7月6日 至 2022年8月5日	自 2022年8月6日 至 2022年9月5日
当期分配金 (円)	60	60	60	60	60	60
(対基準価額比率) (%)	0.820	0.784	0.803	0.805	0.817	0.776
当期の収益 (円)	45	47	39	42	40	50
当期の収益以外 (円)	14	12	20	17	19	9
翌期繰越分配対象額 (円)	796	785	765	748	729	720

(注1) 当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注2) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

(注3) 円未満は切り捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。



## Cコース

基準価額水準・市況動向等を勘案した結果、分配金のお支払いは見送りとさせていただきます。  
なお、収益分配に充てず、信託財産内に留保した利益については、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

### [分配原資の内訳]

(1万口当たり、税引前)

		第18期	
		自 2022年 3月 8日 至 2022年 9月 5日	
当期分配金	(円)	—	
(対基準価額比率)	(%)	—	
当期の収益	(円)	—	
当期の収益以外	(円)	—	
翌期繰越分配対象額	(円)	4,948	

(注1) 当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注2) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。  
また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

(注3) 円未満は切り捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。

## Dコース

基準価額水準・市況動向等を勘案した結果、分配金のお支払いは見送りとさせていただきます。  
なお、収益分配に充てず、信託財産内に留保した利益については、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

### [分配原資の内訳]

(1万口当たり、税引前)

		第18期	
		自 2022年 3月 8日 至 2022年 9月 5日	
当期分配金	(円)	—	
(対基準価額比率)	(%)	—	
当期の収益	(円)	—	
当期の収益以外	(円)	—	
翌期繰越分配対象額	(円)	7,117	

(注1) 当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注2) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。  
また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

(注3) 円未満は切り捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。

## ■今後の運用方針

### 全コース共通

主要投資対象とする「MIT-フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA」（米ドル建て）の投資信託証券への投資を通じて、主に米ドル建ての銀行貸付債権に投資を行い、安定的な金利収入の確保と信託財産の成長をめざす方針です。

また、Aコース、Cコースでは、為替変動リスクに対しては、円に対する米ドルの為替ヘッジ取引を活用し、リスクの低減を図る方針です。

### MIT-フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA

市場では、新型コロナウイルスの感染状況、経済再開の動向のほかインフレ率の上昇や主要国の金融引き締め規模やペース、ウクライナ情勢などをめぐり、高いボラティリティ（価格変動性）が続くと思われます。引き続き事態の進展には注視が必要と考えますが、相対的に高い利回りが期待できる銀行貸付債権の魅力は高いと考えます。今後も想定される米国の利上げについては、変動金利である銀行貸付債権にはプラス材料と考えられます。デフォルト率は、今後緩やかに上昇すると想定されるものの、引き続き低水準で推移すると考えられます。銀行貸付債権への投資では、信用力の分析や慎重な個別銘柄の選択を行うことによって、信用力の悪化を回避することが重要になると考えます。当ファンドは、引き続き企業調査を重視し、投資魅力の高いと考えられる銀行貸付債権への投資を行ってまいります。

### マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド

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

## 【Aコース】

### ■ 1万口当たりの費用明細

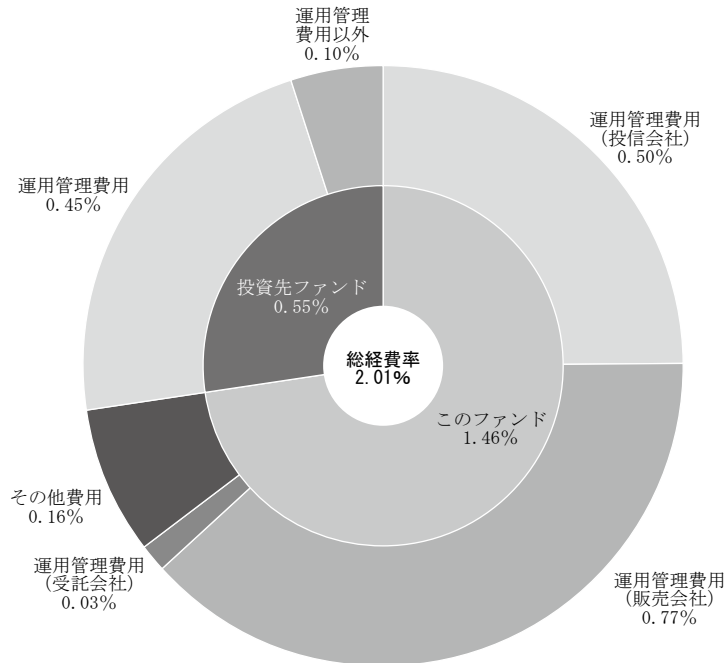
項目	第103期～第108期		項目の概要
	(2022年3月8日～2022年9月5日)		
	金額	比率	
平均基準価額	6,367円	—	作成期間の平均基準価額（月末値の平均値）です。
(a) 信託報酬 （投信会社） （販売会社） （受託会社）	41円 (16) (24) ( 1)	0.644% (0.247) (0.384) (0.014)	(a) 信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率 ・委託した資金の運用の対価 ・交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価 ・運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 募集手数料	—	—	
(c) 売買委託手数料	—	—	(c) 売買委託手数料＝作成期間の売買委託手数料÷作成期間の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(d) 有価証券取引税	—	—	(d) 有価証券取引税＝作成期間の有価証券取引税÷作成期間の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(e) その他費用 （保管費用） （監査費用） （印刷） （その他）	5 ( 0) ( 1) ( 3) ( 0)	0.080 (0.004) (0.021) (0.053) (0.001)	(e) その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数 その他費用 ・保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 ・監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 ・印刷は、印刷会社等に支払う法定書類の作成等に係る費用 ・その他は、信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	46	0.724	

- \* 作成期間の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。  
\* 各項目毎に円未満は四捨五入してあります。  
\* 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。  
\* 各項目の費用は、このファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。  
\* 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額を作成期間の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

（参考情報）

■ 総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は2.01%です。



総経費率 (①+②+③)	2.01%
①このファンドの費用の比率	1.46%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.45%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.10%

- \*①の費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。
- \*各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。
- \*各比率は、年率換算した値です。
- \*投資先ファンドとは、このファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）です。
- \*①の費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。
- \*①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。
- \*上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

■ 売買及び取引の状況 (2022年3月8日から2022年9月5日まで)  
投資信託証券

決 算 期 銘 柄 名	第 103 期 ~ 第 108 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
	3,124	207	14,634	995

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) 口数・金額の単位未満は切り捨てです。

親投資信託受益証券の設定、解約状況

当作成期において、設定および解約はありません。

■ 利害関係人との取引状況等 (2022年3月8日から2022年9月5日まで)  
期中の利害関係人との取引状況

当ファンド

当作成期中における利害関係人との取引等はありません。

マニュライフ・日本債券インデックス・マザーファンド

当作成期中における利害関係人との取引等はありません。

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

■ 第一種金融商品取引業又は第二種金融商品取引業を兼業している委託会社の自己の取引状況  
(2022年3月8日から2022年9月5日まで)

該当事項はありません。

■ 自社による当ファンドの設定・解約状況 (2022年3月8日から2022年9月5日まで)  
該当事項はありません。

## ■組入資産の明細（2022年9月5日現在）

### (1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた外貨建ファンドの明細

決 算 期		第 18 作 成 期 末			
銘 柄	口 数	評 価 額		組 入 比 率	
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
(ケイマン諸島)	口	千米ドル	千円	%	
MIT-フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA	62,772	4,090	574,154	105.1	
合 計	62,772	4,090	574,154		

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

(注2) 組入比率は、当作成期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

(注3) 口数・評価額の単位未満は切り捨てです。

### (2) 親投資信託残高

項 目	第 17 作 成 期 末		第 18 作 成 期 末	
	口 数	口 数	口 数	評 価 額
マネーライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	千口	千口	千口	千円
	91	91	91	108

(注1) マザーファンドの2022年9月5日現在の受益権総口数は8,172,134口です。

(注2) 口数・評価額の単位未満は切り捨てです。

## ■有価証券の貸付及び借入の状況（2022年9月5日現在）

該当事項はありません。

## ■投資信託財産の構成

(2022年9月5日現在)

項 目	第 18 作 成 期 末	
	評 価 額	比 率
投 資 信 託 受 益 証 券	千円	%
	574,154	97.7
マネーライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	108	0.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	13,394	2.3
投 資 信 託 財 産 総 額	587,656	100.0

(注1) 金額の単位未満は切り捨てております。

(注2) 当作成期末における外貨建純資産（574,183千円）の投資信託財産総額（587,656千円）に対する比率は97.7%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=140.35円です。

## ■資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第103期末 2022年4月5日	第104期末 2022年5月6日	第105期末 2022年6月6日	第106期末 2022年7月5日	第107期末 2022年8月5日	第108期末 2022年9月5日
<b>(A) 資 産</b>	<b>1,286,811,918円</b>	<b>1,318,466,615円</b>	<b>1,231,384,905円</b>	<b>1,176,731,042円</b>	<b>1,085,889,912円</b>	<b>1,110,493,241円</b>
コール・ローン等	16,308,979	10,360,922	10,416,111	14,200,191	23,334,825	13,393,548
投資信託受益証券(評価額)	591,962,941	626,124,029	564,680,563	538,227,012	539,608,990	574,154,355
マニュアル・日本債券 インデックス・ マザーファンド(評価額)	109,557	109,099	109,200	108,249	109,264	108,505
未 収 入 金	678,430,441	681,872,565	656,179,031	624,195,590	522,836,833	522,836,833
<b>(B) 負 債</b>	<b>687,702,057</b>	<b>729,204,091</b>	<b>661,974,130</b>	<b>632,418,241</b>	<b>539,142,396</b>	<b>564,051,097</b>
未 払 金	684,751,612	726,217,576	658,761,444	628,940,726	535,038,289	561,132,248
未払収益分配金	2,267,462	2,256,103	2,231,210	2,219,394	2,208,386	2,202,461
未 払 解 約 金	—	—	278,080	615,485	1,223,017	39,675
未払信託報酬	614,005	656,653	629,756	573,909	599,238	602,908
その他未払費用	68,978	73,759	73,640	68,727	73,466	73,805
<b>(C) 純資産総額(A－B)</b>	<b>599,109,861</b>	<b>589,262,524</b>	<b>569,410,775</b>	<b>544,312,801</b>	<b>546,747,516</b>	<b>546,442,144</b>
元 本	906,985,011	902,441,256	892,484,271	887,757,947	883,354,435	880,984,589
次期繰越損益金	△ 307,875,150	△ 313,178,732	△ 323,073,496	△ 343,445,146	△ 336,606,919	△ 334,542,445
<b>(D) 受 益 権 総 口 数</b>	<b>906,985,011口</b>	<b>902,441,256口</b>	<b>892,484,271口</b>	<b>887,757,947口</b>	<b>883,354,435口</b>	<b>880,984,589口</b>
1万口当たり基準価額(C/D)	6.606円	6.530円	6.380円	6.131円	6.189円	6.203円

(注1) 当ファンドの第103期首元本額は911,909,014円、第103～108期中追加設定元本額は16,124,045円、第103～108期中一部解約元本額は47,048,470円です。

(注2) 1口当たり純資産額は、第103期0.6606円、第104期0.6530円、第105期0.6380円、第106期0.6131円、第107期0.6189円、第108期0.6203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103期末307,875,150円、第104期末313,178,732円、第105期末323,073,496円、第106期末343,445,146円、第107期末336,606,919円、第108期末334,542,445円です。

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

## ■損益の状況

項 目	第103期	第104期	第105期	第106期	第107期	第108期
	自 2022年3月8日 至 2022年4月5日	自 2022年4月6日 至 2022年5月6日	自 2022年5月7日 至 2022年6月6日	自 2022年6月7日 至 2022年7月5日	自 2022年7月6日 至 2022年8月5日	自 2022年8月6日 至 2022年9月5日
(A) 配 当 等 収 益	3,805,842円	4,079,440円	3,764,955円	3,730,228円	3,669,326円	3,937,137円
受 取 配 当 金	3,805,853	4,079,440	3,766,431	3,736,154	3,675,853	3,937,370
受 取 利 息	△ 11	—	△ 1,476	△ 5,926	△ 6,527	△ 233
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 2,598,959	△ 7,945,163	△ 14,178,594	△ 22,918,329	4,331,612	92,595
売 買 益	43,212,140	41,890,055	54,354,062	28,188,222	26,436,512	30,609,498
売 買 損	△ 45,811,099	△ 49,835,218	△ 68,532,656	△ 51,106,551	△ 22,104,900	△ 30,516,903
(C) 信 託 報 酬 等	△ 689,952	△ 731,723	△ 706,414	△ 645,796	△ 672,489	△ 683,319
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	516,931	△ 4,597,446	△ 11,120,053	△ 19,833,897	7,328,449	3,346,413
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△190,606,047	△191,021,177	△195,327,507	△206,667,002	△226,553,076	△219,910,580
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△115,518,572	△115,304,006	△114,394,726	△114,724,853	△115,173,906	△115,775,817
(配 当 等 相 当 額)	( 121,678)	( 42,596)	( 54,662)	( 143,265)	( 141,237)	( 139,257)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△115,640,250)	(△115,346,602)	(△114,449,388)	(△114,868,118)	(△115,315,143)	(△115,915,074)
(G) 計 (D+E+F)	△305,607,688	△310,922,629	△320,842,286	△341,225,752	△334,398,533	△332,339,984
(H) 収 益 分 配 金	△ 2,267,462	△ 2,256,103	△ 2,231,210	△ 2,219,394	△ 2,208,386	△ 2,202,461
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	△307,875,150	△313,178,732	△323,073,496	△343,445,146	△336,606,919	△334,542,445
追 加 信 託 差 損 益 金	△115,640,108	△115,346,421	△114,449,167	△114,867,782	△115,314,360	△115,915,013
(配 当 等 相 当 額)	( 121,678)	( 42,596)	( 54,662)	( 143,265)	( 141,237)	( 139,257)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△115,640,250)	(△115,346,602)	(△114,449,388)	(△114,868,118)	(△115,315,143)	(△115,915,074)
分 配 準 備 積 立 金	33,403,222	34,334,829	34,798,423	35,491,417	36,480,532	37,465,685
繰 越 損 益 金	△225,638,264	△232,167,140	△243,422,752	△264,068,781	△257,773,091	△256,093,117

(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103期 計算期間末における費用控除後の配当等収益(3,115,980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(121,678円)および分配準備積立金(32,433,168円)より分配対象収益は35,670,826円(10,000口当たり393円)であり、うち2,267,462円(10,000口当たり25円)を分配金額としております。

第104期 計算期間末における費用控除後の配当等収益(3,347,811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(42,596円)および分配準備積立金(33,200,706円)より分配対象収益は36,591,113円(10,000口当たり405円)であり、うち2,256,103円(10,000口当たり25円)を分配金額としております。

第105期 計算期間末における費用控除後の配当等収益(3,058,636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(54,662円)および分配準備積立金(33,916,556円)より分配対象収益は37,029,854円(10,000口当たり414円)であり、うち2,231,210円(10,000口当たり25円)を分配金額としております。

第106期 計算期間末における費用控除後の配当等収益(3,084,520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(143,265円)および分配準備積立金(34,483,362円)より分配対象収益は37,711,147円(10,000口当たり424円)であり、うち2,219,394円(10,000口当たり25円)を分配金額としております。

第107期 計算期間末における費用控除後の配当等収益(3,361,017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(141,237円)および分配準備積立金(35,187,447円)より分配対象収益は38,689,701円(10,000口当たり437円)であり、うち2,208,386円(10,000口当たり25円)を分配金額としております。

第108期 計算期間末における費用控除後の配当等収益(3,269,630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(139,257円)および分配準備積立金(36,259,320円)より分配対象収益は39,668,207円(10,000口当たり450円)であり、うち2,202,461円(10,000口当たり25円)を分配金額としております。

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



## ■分配金のお知らせ

決算期	第103期	第104期	第105期	第106期	第107期	第108期
1万口当たり分配金	25円	25円	25円	25円	25円	25円

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

### <課税上の取り扱い>

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

※税法が改正された場合等は、上記内容が変更になる場合があります。

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

## お知らせ

### ◆約款変更

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。

## 【Bコース】

### ■ 1万口当たりの費用明細

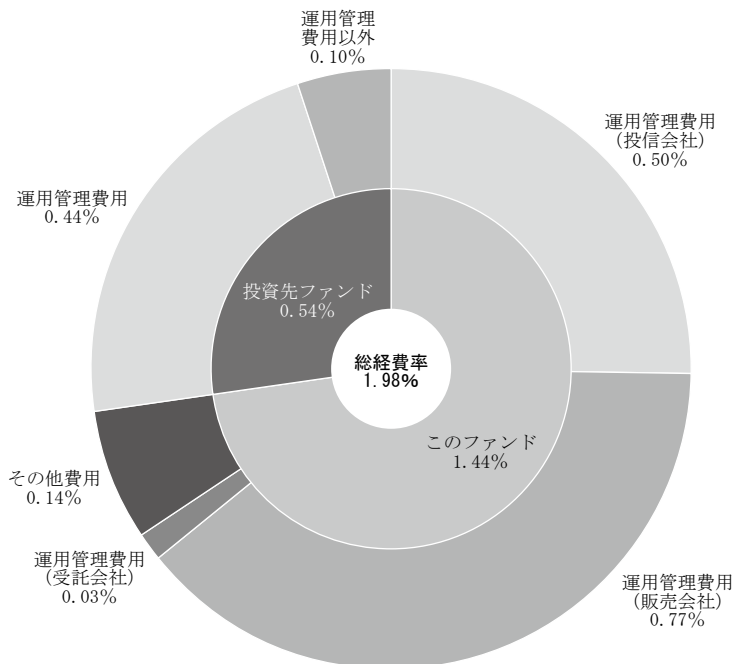
項目	第103期～第108期		項目の概要
	(2022年3月8日～2022年9月5日)		
	金額	比率	
平均基準価額	7,457円	—	作成期間の平均基準価額（月末値の平均値）です。
(a) 信託報酬 （投信会社） （販売会社） （受託会社）	48円 (18) (29) ( 1)	0.644% (0.247) (0.384) (0.014)	(a) 信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率 ・委託した資金の運用の対価 ・交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価 ・運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 募集手数料	—	—	
(c) 売買委託手数料	—	—	(c) 売買委託手数料＝作成期間の売買委託手数料÷作成期間の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(d) 有価証券取引税	—	—	(d) 有価証券取引税＝作成期間の有価証券取引税÷作成期間の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(e) その他費用 （保管費用） （監査費用） （印刷） （その他）	5 ( 0) ( 1) ( 4) ( 0)	0.069 (0.001) (0.018) (0.049) (0.001)	(e) その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数 その他費用 ・保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 ・監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 ・印刷は、印刷会社等に支払う法定書類の作成等に係る費用 ・その他は、信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	53	0.713	

- \* 作成期間の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。  
\* 各項目毎に円未満は四捨五入してあります。  
\* 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。  
\* 各項目の費用は、このファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。  
\* 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額を作成期間の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

（参考情報）

■ 総経費率

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



総経費率 (①+②+③)	1.98%
①このファンドの費用の比率	1.44%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.44%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.10%

- \*①の費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。
- \*各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。
- \*各比率は、年率換算した値です。
- \*投資先ファンドとは、このファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）です。
- \*①の費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。
- \*①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。
- \*上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

■売買及び取引の状況（2022年3月8日から2022年9月5日まで）  
投資信託証券

決 算 期 銘 柄 名	第 103 期 ～ 第 108 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
	9,978	664	41,799	2,812

（注1）金額は受渡代金です。

（注2）口数・金額の単位未満は切り捨てです。

親投資信託受益証券の設定、解約状況

当作成期において、設定および解約はありません。

■利害関係人との取引状況等（2022年3月8日から2022年9月5日まで）

期中の利害関係人との取引状況

当ファンド

当作成期中における利害関係人との取引等はありません。

マネーライフ・日本債券インデックス・マザーファンド

当作成期中における利害関係人との取引等はありません。

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

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

（2022年3月8日から2022年9月5日まで）

該当事項はありません。

■自社による当ファンドの設定・解約状況（2022年3月8日から2022年9月5日まで）

該当事項はありません。

## ■組入資産の明細（2022年9月5日現在）

### (1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた外貨建ファンドの明細

決 算 期		第 18 作 成 期 末			
銘 柄	口 数	評 価 額		組 入 比 率	
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
(ケイマン諸島)	口	千米ドル	千円	%	
MIT-フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA	232,075	15,124	2,122,703	98.2	
合 計	232,075	15,124	2,122,703		

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

(注2) 組入比率は、当作成期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

(注3) 口数・評価額の単位未満は切り捨てです。

### (2) 親投資信託残高

項 目	第17作成期末	第18作成期末	
	口 数	口 数	評 価 額
マネーライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	千口 91	千口 91	千円 108

(注1) マザーファンドの2022年9月5日現在の受益権総口数は8,172,134千口です。

(注2) 口数・評価額の単位未満は切り捨てです。

## ■有価証券の貸付及び借入の状況（2022年9月5日現在）

該当事項はありません。

## ■投資信託財産の構成

(2022年9月5日現在)

項 目	第 18 作 成 期 末	
	評 価 額	比 率
投 資 信 託 受 益 証 券	千円 2,122,703	% 96.5
マネーライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	108	0.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	77,900	3.5
投 資 信 託 財 産 総 額	2,200,711	100.0

(注1) 金額の単位未満は切り捨てております。

(注2) 当作成期末における外貨建純資産（2,122,754千円）の投資信託財産総額（2,200,711千円）に対する比率は96.5%です。

(注3) 外貨建資産は、当作成期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、当作成期末における邦貨換算レートは、1米ドル=140.35円です。

## ■資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第103期末 2022年4月5日	第104期末 2022年5月6日	第105期末 2022年6月6日	第106期末 2022年7月5日	第107期末 2022年8月5日	第108期末 2022年9月5日
<b>(A) 資 産</b>	<b>2,300,965,397円</b>	<b>2,339,586,394円</b>	<b>2,219,931,769円</b>	<b>2,131,149,529円</b>	<b>2,114,035,444円</b>	<b>2,200,711,558円</b>
コール・ローン等	44,054,208	85,423,732	80,948,162	43,631,168	81,393,094	77,899,264
投資信託受益証券(評価額)	2,175,471,809	2,254,053,563	2,138,874,407	2,087,410,112	2,032,533,086	2,122,703,789
マニュアル・日本債券 インデックス・ マザーファンド(評価額)	109,557	109,099	109,200	108,249	109,264	108,505
未 収 入 金	81,329,823	—	—	—	—	—
<b>(B) 負 債</b>	<b>68,627,751</b>	<b>35,466,327</b>	<b>21,776,075</b>	<b>22,241,687</b>	<b>23,011,150</b>	<b>38,931,864</b>
未 払 金	40,688,426	—	—	—	—	—
未払収益分配金	18,463,590	18,204,929	17,792,323	17,120,940	17,220,501	16,909,574
未 払 解 約 金	6,957,910	14,483,840	1,315,901	2,653,326	3,194,818	19,412,836
未 払 信 託 報 酬	2,278,806	2,521,423	2,410,836	2,227,380	2,341,950	2,352,976
その他未払費用	239,019	256,135	257,015	240,041	253,881	256,478
<b>(C) 純資産総額(A－B)</b>	<b>2,232,337,646</b>	<b>2,304,120,067</b>	<b>2,198,155,694</b>	<b>2,108,907,842</b>	<b>2,091,024,294</b>	<b>2,161,779,694</b>
元 本	3,077,265,132	3,034,154,923	2,965,387,170	2,853,490,157	2,870,083,657	2,818,262,421
次期繰越損益金	△ 844,927,486	△ 730,034,856	△ 767,231,476	△ 744,582,315	△ 779,059,363	△ 656,482,727
<b>(D) 受 益 権 総 口 数</b>	<b>3,077,265,132口</b>	<b>3,034,154,923口</b>	<b>2,965,387,170口</b>	<b>2,853,490,157口</b>	<b>2,870,083,657口</b>	<b>2,818,262,421口</b>
1万口当たり基準価額(C/D)	7,254円	7,594円	7,413円	7,391円	7,286円	7,671円

(注1) 当ファンドの第103期首元本額は3,148,564,023円、第103～108期中追加設定元本額は270,461,306円、第103～108期中一部解約元本額は600,762,908円です。

(注2) 1口当たり純資産額は、第103期0.7254円、第104期0.7594円、第105期0.7413円、第106期0.7391円、第107期0.7286円、第108期0.7671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103期末844,927,486円、第104期末730,034,856円、第105期末767,231,476円、第106期末744,582,315円、第107期末779,059,363円、第108期末656,482,727円です。

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

## ■損益の状況

項 目	第103期	第104期	第105期	第106期	第107期	第108期
	自 2022年3月8日 至 2022年4月5日	自 2022年4月6日 至 2022年5月6日	自 2022年5月7日 至 2022年6月6日	自 2022年6月7日 至 2022年7月5日	自 2022年7月6日 至 2022年8月5日	自 2022年8月6日 至 2022年9月5日
(A) 配 当 等 収 益	14,408,647円	14,862,643円	14,528,103円	14,458,042円	14,194,271円	14,646,696円
受 取 配 当 金	14,465,675	14,888,950	14,547,002	14,489,955	14,230,420	14,680,282
受 取 利 息	△ 57,028	△ 26,307	△ 18,899	△ 31,913	△ 36,149	△ 33,586
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	126,464,020	107,904,888	△ 47,131,135	△ 1,799,243	△ 24,928,522	112,797,827
売 買 益	135,792,331	138,457,824	6,453,483	83,574,092	21,942,833	113,089,807
売 買 損	△ 9,328,311	△ 30,552,936	△ 53,584,618	△ 85,373,335	△ 46,871,355	△ 291,980
(C) 信 託 報 酬 等	△ 2,522,219	△ 2,779,951	△ 2,668,922	△ 2,469,456	△ 2,602,010	△ 2,611,435
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	138,350,448	119,987,580	△ 35,271,954	10,189,343	△ 13,336,261	124,833,088
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△419,342,090	△287,961,932	△175,232,145	△211,885,966	△211,769,371	△231,153,196
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△545,472,254	△543,855,575	△538,935,054	△525,764,752	△536,733,230	△533,253,045
(配 当 等 相 当 額)	( 2,666,276)	( 3,853,686)	( 3,727,888)	( 4,103,288)	( 4,206,897)	( 2,304,999)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△548,138,530)	(△547,709,261)	(△542,662,942)	(△529,868,040)	(△540,940,127)	(△535,558,044)
(G) 計 (D+E+F)	△826,463,896	△711,829,927	△749,439,153	△727,461,375	△761,838,862	△639,573,153
(H) 収 益 分 配 金	△ 18,463,590	△ 18,204,929	△ 17,792,323	△ 17,120,940	△ 17,220,501	△ 16,909,574
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	△844,927,486	△730,034,856	△767,231,476	△744,582,315	△779,059,363	△656,482,727
追 加 信 託 差 損 益 金	△548,137,165	△547,708,952	△542,662,546	△529,865,217	△540,937,902	△535,555,565
(配 当 等 相 当 額)	( 1,365)	( 309)	( 396)	( 2,823)	( 2,225)	( 2,479)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△548,138,530)	(△547,709,261)	(△542,662,942)	(△529,868,040)	(△540,940,127)	(△535,558,044)
分 配 準 備 積 立 金	245,152,239	238,213,398	227,115,852	213,633,527	209,374,405	203,153,465
繰 越 損 益 金	△541,942,560	△420,539,302	△451,684,782	△428,350,625	△447,495,866	△324,080,627

(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103期 計算期間末における費用控除後の配当等収益 (14,150,713円)、費用控除後の有価証券等損益額 (0円)、信託約款に規定する収益調整金 (2,666,276円) および分配準備積立金 (246,800,205円) より分配対象収益は263,617,194円 (10,000口当たり856円) であり、うち18,463,590円 (10,000口当たり60円) を分配金額としております。

第104期 計算期間末における費用控除後の配当等収益 (14,526,085円)、費用控除後の有価証券等損益額 (0円)、信託約款に規定する収益調整金 (3,853,686円) および分配準備積立金 (238,038,865円) より分配対象収益は256,418,636円 (10,000口当たり845円) であり、うち18,204,929円 (10,000口当たり60円) を分配金額としております。

第105期 計算期間末における費用控除後の配当等収益 (11,859,276円)、費用控除後の有価証券等損益額 (0円)、信託約款に規定する収益調整金 (3,727,888円) および分配準備積立金 (229,321,407円) より分配対象収益は244,908,571円 (10,000口当たり825円) であり、うち17,792,323円 (10,000口当たり60円) を分配金額としております。

第106期 計算期間末における費用控除後の配当等収益 (11,988,674円)、費用控除後の有価証券等損益額 (0円)、信託約款に規定する収益調整金 (4,103,288円) および分配準備積立金 (214,665,328円) より分配対象収益は230,757,290円 (10,000口当たり808円) であり、うち17,120,940円 (10,000口当たり60円) を分配金額としております。

第107期 計算期間末における費用控除後の配当等収益 (11,592,356円)、費用控除後の有価証券等損益額 (0円)、信託約款に規定する収益調整金 (4,206,897円) および分配準備積立金 (210,797,878円) より分配対象収益は226,597,131円 (10,000口当たり789円) であり、うち17,220,501円 (10,000口当たり60円) を分配金額としております。

第108期 計算期間末における費用控除後の配当等収益 (14,346,737円)、費用控除後の有価証券等損益額 (0円)、信託約款に規定する収益調整金 (2,304,999円) および分配準備積立金 (203,413,782円) より分配対象収益は220,065,518円 (10,000口当たり780円) であり、うち16,909,574円 (10,000口当たり60円) を分配金額としております。

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

## ■分配金のお知らせ

決算期	第103期	第104期	第105期	第106期	第107期	第108期
1万口当たり分配金	60円	60円	60円	60円	60円	60円

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

### <課税上の取り扱い>

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

※税法が改正された場合等は、上記内容が変更になる場合があります。

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

## お知らせ

### ◆約款変更

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。



## 【Cコース】

### ■ 1万円当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2022年3月8日～2022年9月5日)		
	金額	比率	
平均基準価額	9,771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）	63円 (24) (38) ( 1)	0.644% (0.247) (0.384) (0.014)	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 ・委託した資金の運用の対価 ・交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価 ・運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 募集手数料	—	—	
(c) 売買委託手数料	—	—	(c) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(d) 有価証券取引税	—	—	(d) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(e) その他費用 （保管費用） （監査費用） （その他）	14 ( 3) (11) ( 0)	0.143 (0.031) (0.110) (0.002)	(e) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 その他費用 ・保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 ・監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 ・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	77	0.787	

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

\* 各項目毎に円未満は四捨五入してあります。

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

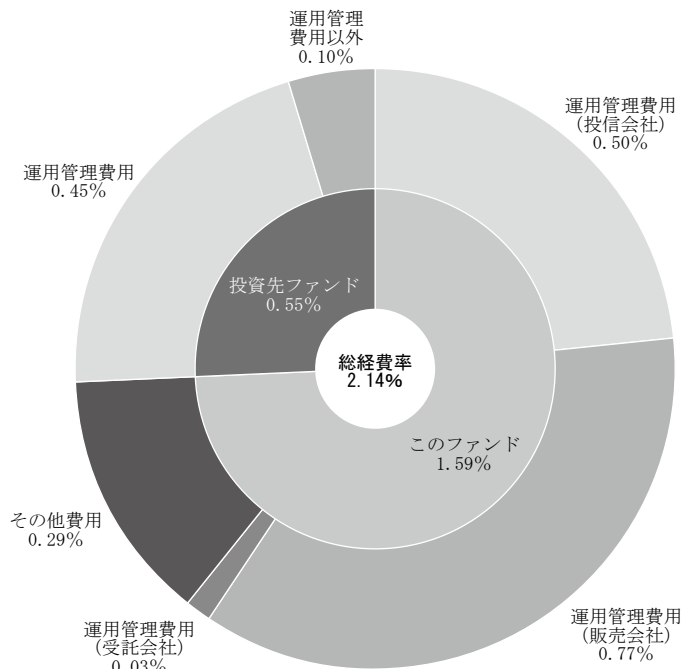
\* 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

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

（参考情報）

■ 総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は2.14%です。



総経費率 (①+②+③)	2.14%
①このファンドの費用の比率	1.59%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.45%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.10%

- \*①の費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。
- \*各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。
- \*各比率は、年率換算した値です。
- \*投資先ファンドとは、このファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）です。
- \*①の費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。
- \*①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。
- \*上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

**■売買及び取引の状況（2022年3月8日から2022年9月5日まで）**  
**投資信託証券**

銘 柄 名	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外国（ケイマン諸島） MIT-フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA	口 379	千米ドル 25	口 1,747	千米ドル 119

（注1）金額は受渡代金です。

（注2）口数・金額の単位未満は切り捨てです。

**親投資信託受益証券の設定、解約状況**

当期において、設定および解約はありません。

**■利害関係人との取引状況等（2022年3月8日から2022年9月5日まで）**

**期中の利害関係人との取引状況**

**当ファンド**

当期中における利害関係人との取引等はありません。

**マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド**

当期中における利害関係人との取引等はありません。

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

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

（2022年3月8日から2022年9月5日まで）

該当事項はありません。

**■自社による当ファンドの設定・解約状況（2022年3月8日から2022年9月5日まで）**

該当事項はありません。

## ■組入資産の明細（2022年9月5日現在）

### (1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた外貨建ファンドの明細

決 算 期 銘 柄	当 期 末			組 入 比 率
	口 数	評 価 額		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(ケイマン諸島)		千米ドル	千円	%
MIT-フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA	5,629	366	51,487	104.2
合 計	5,629	366	51,487	

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

(注2) 組入比率は、当期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

(注3) 口数・評価額の単位未満は切り捨てです。

### (2) 親投資信託残高

項 目	期首（前期末）	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
マニュアル・日本債券インデックス・マザーファンド	千口 91	千口 91	千円 108

(注1) マザーファンドの2022年9月5日現在の受益権総口数は8,172,134千口です。

(注2) 口数・評価額の単位未満は切り捨てです。

## ■有価証券の貸付及び借入の状況（2022年9月5日現在）

該当事項はありません。

## ■投資信託財産の構成

(2022年9月5日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投 資 信 託 受 益 証 券	51,487	96.1
マニュアル・日本債券インデックス・マザーファンド	108	0.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,963	3.7
投 資 信 託 財 産 総 額	53,558	100.0

(注1) 金額の単位未満は切り捨てております。

(注2) 当期末における外貨建純資産（51,491千円）の投資信託財産総額（53,558千円）に対する比率は96.1%です。

(注3) 外貨建資産は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、当期末における邦貨換算レートは、1米ドル=140.35円です。

## ■資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	当 期 末 2022年9月5日
(A) 資 産	101,776,993円
コール・ローン等	1,962,569
投資信託受益証券(評価額)	51,487,727
マネーライフ・日本債券インデックス・マザーファンド(評価額)	108,505
未 収 入 金	48,218,192
(B) 負 債	52,348,485
未 払 金	51,751,512
未 払 解 約 金	201,464
未 払 信 託 報 酬	338,206
そ の 他 未 払 費 用	57,303
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	49,428,508
元 本	51,222,629
次 期 繰 越 損 益 金	△ 1,794,121
(D) 受 益 権 総 口 数	51,222,629口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,650円

- (注1) 当ファンドの期首元本額は56,662,767円、期中追加設定元本額は855,470円、期中一部解約元本額は6,295,608円です。  
(注2) 1口当たり純資産額は0.9650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1,794,121円です。

## ■損益の状況

項 目	当 期 自 2022年3月8日 至 2022年9月5日
(A) 配 当 等 収 益	2,143,074円
受 取 配 当 金	2,142,489
受 取 利 息	585
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 3,880,648
売 買 益	13,531,384
売 買 損	△17,412,032
(C) 信 託 報 酬 等	△ 412,410
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△ 2,149,984
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 122,072
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	477,935
(配 当 等 相 当 額)	( 6,194,461)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 5,716,526)
(G) 計 (D+E+F)	△ 1,794,121
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	△ 1,794,121
追 加 信 託 差 損 益 金	477,935
(配 当 等 相 当 額)	( 6,194,461)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 5,716,526)
分 配 準 備 積 立 金	19,151,769
繰 越 損 益 金	△21,423,825

- (注1) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。  
(注2) 損益の状況の中で(C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。  
(注3) 損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。  
(注4) 収益分配金の計算過程は以下の通りです。  
計算期間末における費用控除後の配当等収益 (1,731,203円)、費用控除後の有価証券等損益額 (0円)、信託約款に規定する収益調整金 (6,194,461円) および分配準備積立金 (17,420,566円) より分配対象収益は25,346,230円 (10,000口当たり4,948円) ですが、当期に分配した金額はありません。

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

## お知らせ

### ◆約款変更

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。

## 【Dコース】

### ■ 1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2022年3月8日～2022年9月5日)		
	金額	比率	
平均基準価額	14,211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）	92円 ( 35) ( 55) ( 2)	0.644% (0.247) (0.384) (0.014)	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 ・委託した資金の運用の対価 ・交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価 ・運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 募集手数料	—	—	
(c) 売買委託手数料	—	—	(c) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(d) 有価証券取引税	—	—	(d) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(e) その他費用 （保管費用） （監査費用） （印刷） （その他）	16 ( 1) ( 11) ( 4) ( 0)	0.111 (0.005) (0.081) (0.025) (0.001)	(e) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 その他費用 ・保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 ・監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 ・印刷は、印刷会社等に支払う法定書類の作成等に係る費用 ・その他は、信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	108	0.755	

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

\* 各項目毎に円未満は四捨五入してあります。

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

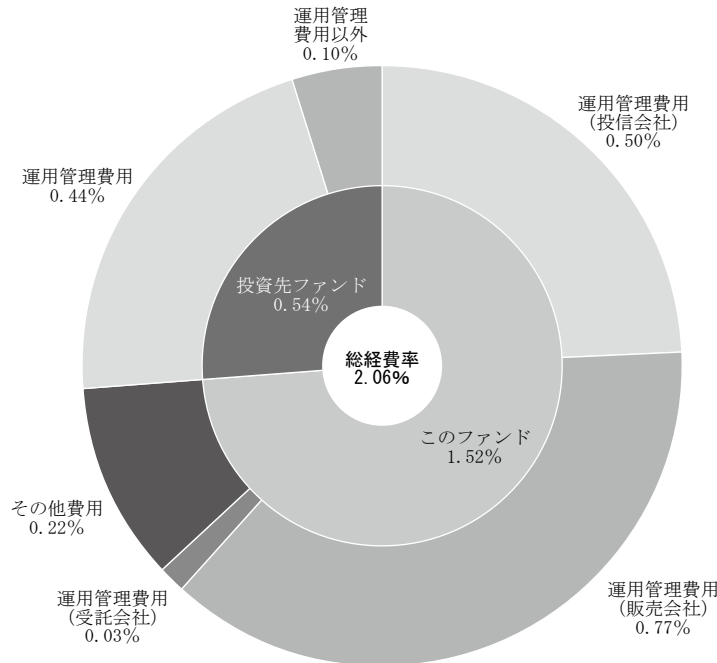
\* 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

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

（参考情報）

■ 総経費率

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



総経費率 (①+②+③)	2.06%
①このファンドの費用の比率	1.52%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.44%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.10%

- \*①の費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。
- \*各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。
- \*各比率は、年率換算した値です。
- \*投資先ファンドとは、このファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）です。
- \*①の費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。
- \*①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。
- \*上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

**■売買及び取引の状況（2022年3月8日から2022年9月5日まで）**  
**投資信託証券**

銘 柄 名	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外国（ケイマン諸島） MIT-フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA	口 750	千米ドル 49	口 5,372	千米ドル 360

（注1）金額は受渡代金です。

（注2）口数・金額の単位未満は切り捨てです。

**親投資信託受益証券の設定、解約状況**

当期において、設定および解約はありません。

**■利害関係人との取引状況等（2022年3月8日から2022年9月5日まで）**

**期中の利害関係人との取引状況**

**当ファンド**

当期中における利害関係人との取引等はありません。

**マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド**

当期中における利害関係人との取引等はありません。

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

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

（2022年3月8日から2022年9月5日まで）

該当事項はありません。

**■自社による当ファンドの設定・解約状況（2022年3月8日から2022年9月5日まで）**

該当事項はありません。



## ■組入資産の明細（2022年9月5日現在）

### (1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた外貨建ファンドの明細

決 算 期 銘 柄	当 期 末			組 入 比 率
	口 数	評 価 額		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(ケイマン諸島) MIT-フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA	口 14,621	千米ドル 952	千円 133,734	% 96.7
合 計	14,621	952	133,734	

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

(注2) 組入比率は、当期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

(注3) 口数・評価額の単位未満は切り捨てです。

### (2) 親投資信託残高

項 目	期首（前期末）	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
マネーライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	千口 91	千口 91	千円 108

(注1) マザーファンドの2022年9月5日現在の受益権総口数は8,172,134千口です。

(注2) 口数・評価額の単位未満は切り捨てです。

## ■有価証券の貸付及び借入の状況（2022年9月5日現在）

該当事項はありません。

## ■投資信託財産の構成

(2022年9月5日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投 資 信 託 受 益 証 券	千円 133,734	% 95.5
マネーライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	108	0.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	6,239	4.4
投 資 信 託 財 産 総 額	140,081	100.0

(注1) 金額の単位未満は切り捨てております。

(注2) 当期末における外貨建純資産（133,041千円）の投資信託財産総額（140,081千円）に対する比率は95.0%です。

(注3) 外貨建資産は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、当期末における邦貨換算レートは、1米ドル=140.35円です。

## ■資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	当 期 末 2022年9月5日
(A) 資 産	140,781,780円
コール・ローン等	6,237,289
投資信託受益証券(評価額)	133,734,406
マネーライフ・日本債券インデックス・マザーファンド(評価額)	108,505
未 収 入 金	701,580
(B) 負 債	2,525,821
未 払 金	1,401,646
未 払 解 約 金	246
未 払 信 託 報 酬	965,594
そ の 他 未 払 費 用	158,335
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	138,255,959
元 本	91,939,492
次 期 繰 越 損 益 金	46,316,467
(D) 受 益 権 総 口 数	91,939,492口
1万口当たり基準価額(C/D)	15,038円

(注1) 当ファンドの期首元本額は122,671,443円、期中追加設定元本額は5,634,791円、期中一部解約元本額は36,366,742円です。

(注2) 1口当たり純資産額は1,5038円です。

## ■損益の状況

項 目	当 期 自 2022年3月8日 至 2022年9月5日
(A) 配 当 等 収 益	5,349,835円
受 取 配 当 金	△228,536,531
受 取 利 息	233,886,366
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	15,441,940
売 買 益	26,752,557
売 買 損	△ 11,310,617
(C) 信 託 報 酬 等	△ 1,132,524
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	19,659,251
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	11,747,027
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	14,910,189
(配 当 等 相 当 額)	( 22,951,585)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 8,041,396)
(G) 計 (D+E+F)	46,316,467
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	46,316,467
追 加 信 託 差 損 益 金	14,910,189
(配 当 等 相 当 額)	( 22,951,585)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 8,041,396)
分 配 準 備 積 立 金	42,489,186
繰 越 損 益 金	△ 11,082,908

(注1) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) 損益の状況の中で(C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) 損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注4) 収益分配金の計算過程は以下の通りです。  
計算期間末における費用控除後の配当等収益(5,058,922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(22,951,585円)および分配準備積立金(37,430,264円)より分配対象収益は65,440,771円(10,000口当たり7,117円)ですが、当期に分配した金額はありません。

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

## お知らせ

### ◆約款変更

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。

## <参考情報>

### ■組入投資信託証券の概要

#### MIT-フローティング・レート・インカム・ファンド クラスA

管 理 会 社	マネュライフ・インベストメント・マネジメント（HK）リミテッド
投資顧問会社	マネュライフ・インベストメント・マネジメント（US）LLC（実質的な運用を行います。）
信 託 期 間	無期限です。
運 用 方 針	①主に変動金利の米ドル建て銀行貸付債権に分散投資を行い、金利収入の確保と魅力的なリスク調整後トータル・リターン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	3.91%
直接利回り	3.94%
最終利回り	3.99%
平均デュレーション	0.51年
残存年数	4.88年
平均格付け	BB-

※現地の2021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110銘柄）

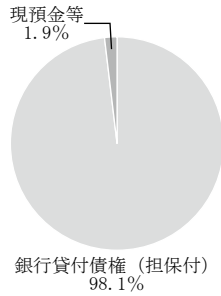
	銘柄名	組入比率
1	アメリカン航空	1.57%
2	アルティス・フランス	1.48%
3	スカイマイルズ I P	1.40%
4	バートゥサ	1.38%
5	プロジェクト・アルファ・インターメディアート	1.38%
6	テンポ・アクイジション	1.37%
7	グリフォルス・ワールドワイド・オペレーションズ	1.36%
8	クオラム・ヘルス	1.34%
9	A P Xグループ	1.31%
10	ジャーニー・パーソナルケア・コーポレーション	1.30%

※現地の2021年12月最終営業日のデータです。

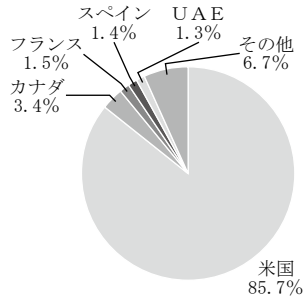
※組入比率は純資産総額に対する比率です。

※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。

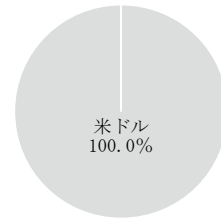
### ○資産別配分



### ○国・地域別配分



### ○通貨別配分



※現地の2021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「M I T - フローティング・レート・インカム・ファンド」の情報を委託会社が抜粋・一部翻訳したものを記載しております。

## ■費用の明細

(2021年1月1日から2021年12月31日まで)

(単位: 米ドル)

マネジメントフィー	126,336
カストディーフィー等	15,972
トラスティーフィー	12,000
監査報酬等	35,488
評価手数料	25,000
取引手数料	3,630
年間権限費用	1,349
会計及びその他専門家費用	5,205
その他費用	23,022
<b>費用合計</b>	<b>248,002</b>

■有価証券明細表 2021年12月31日

銀行貸付債権 (米ドル建)

銘柄名	数量	評価額(米ドル)	投資比率 (%)
AADVANTAGE LOYALTY IP TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +475BPS 24/03/2028	400,000.00	415,250	1.56
ALTICE FRANCE SA TRANCHE B13 TERM LOAN USD-LIBOR-BBA +400 BPS	394,910.95	393,595	1.47
SKYMILES IP LTD TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +375BPS 16/09/2027	350,000.00	370,956	1.39
AUSTIN BIDCO INC TRANCHE B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +450BPS	369,075.00	370,459	1.39
PROJECT ALPHA INTERMEDIA TERM B TERM LOAN USD-LIBOR BBA 3M +400BPS	368,149.60	369,300	1.38
TEMPO ACQUISITION LLC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M+300BPS	366,200.30	366,642	1.37
GRIFOLS WORLDWIDE OPERAT TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M 200+	369,287.43	364,402	1.37
CHANGE HEALTHCARE HOLDINGS B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA +250 BPS	350,108.32	350,152	1.31
QUORUM HEALTH CORP TERM LOAN USD-LIBOR BBA 3M +825BPS 29/04/2025	357,997.30	349,942	1.31
APX GROUP INC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 33M+ 375BPS	350,000.00	349,854	1.31
JOURNEY PERSONAL CARE CO TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +425BPS 19/02/2028	349,125.00	348,689	1.31
GEMS MENASA CAYMAN LTD TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA +500BPS	339,134.98	340,901	1.28
USI INC/NY TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +300BPS 16/05/2024	342,873.24	340,802	1.28
SEDGWICK CMS INC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR BBA 3M + 325BPS	335,196.99	333,060	1.25
GARDA WORLD SECURITY CORP TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M+425BPS	329,791.38	329,585	1.23
AVAYA INC TERM B-EXT TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M 425BPS 15/12/2027	327,646.34	328,976	1.23
IBC CAPITAL LTD TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +375 BPS	324,509.24	322,400	1.21
EVERI PAYMENTS INC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M+250BPS 30/06/2028	319,501.35	319,327	1.20
EDELMAN FINANCIAL CENTER TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +375BPS	312,018.33	312,170	1.17
VICTORY CAPITAL HOLDINGS TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +225BPS	311,587.32	309,679	1.16
SELECT MEDICAL CORP TERM B TERM LOAN USD - LIBOR BBA 3M +250BPS	307,664.16	305,982	1.15
ARCHES BUYER INC TERM LOAN USD-LIBO R-BBA 3M +325BPS 06/12/2027	307,675.00	305,944	1.15
J&J VENTURES GAMING LLC TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M + 400BPS 07/04/202	300,000.00	301,875	1.13
LCPR LOAN FINANCING LLC TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +375BPS 31/12/2049	300,000.00	301,575	1.13
HILTON GRAND VAC BORROWER TERM B USD-LIBOR-BBA-3M +300BPS 20/05/2028	300,000.00	300,938	1.13
AP CORE HOLDINGS II LLC TRANCHE B2 TERM LOAN USD-LIBOR-BBA	300,000.00	300,563	1.13
INTELSAT TERM B2 TERM LOAN USD- LIBOR-BBA 3M +375BPS 27/11/2023	300,000.00	300,375	1.13
CORELOGIC INC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +350BPS 14/04/2028	300,000.00	300,000	1.12
GRAB HOLDINGS INC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +450BPS 29/01/2026	298,500.00	299,806	1.12
JELD-WEN INC TRANCHE B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M+ 225BPS 16/07/2028	299,250.00	299,437	1.12
RADIATE HOLDCO LLC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA3M 325BPS 25/09/2026	300,000.00	299,250	1.12
CNT HOLDINGS I CORP TRANCHE B TERM LOAN USD-LIBOR BBA 3M +375BPS	298,500.00	299,060	1.12
VALEANT PHARMACEUTICALS TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +300BPS	299,345.49	298,597	1.12
WILDBRAIN LTD TRANCHE B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +425BPS 18/03/2028	298,500.00	298,500	1.12
TRUCK HERO INC TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M + 375BPS	298,500.00	297,567	1.11
UBER TECHNOLOGIES INC TRANCHE B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +350BPS	297,054.58	297,495	1.11
VIRGIN MEDIA BRISTOL LLC TRANCHE N TERM LOAN USD-LIBOR-BBA +250 BPS	300,000.00	297,396	1.11
ZIGGO FINANCING PARTNERS TERM I TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +250BPS	300,000.00	297,188	1.11
CORAL-US CO-BORROWER LLC TERM B5 TERM LOAN USD-LIBOR BBA 3M +BPS	300,000.00	296,750	1.11
CAESARS RESORT COLLECTIO TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +350BPS	295,756.91	296,242	1.11
LIONS GATE CAPITAL HOLD TERM B TERM LOAN USD-LIBOR BBA 3M + 225BPS	298,487.01	295,801	1.11
MA FINANCECO LLC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +425BPS 05/06/2025	290,625.00	294,803	1.10
ORGANON & CO TRANCHE B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +300BPS 08/04/2028	289,250.00	290,154	1.09
SS&C TECHNOLOGIES INC TERM B5 TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M+ 175BPS	291,728.21	288,811	1.08
UNITED RENTALS NORTH AM TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +175BPS	282,869.95	284,385	1.07
ARCH COAL INC TERM LOAN TERM B USD-LIBOR-BBA-3M +500BPS 14/06/2026	291,015.23	283,780	1.06
TTF HOLDINGS LLC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +425BPS 26/03/2028	280,500.00	279,799	1.05
PCI GAMING AUTHORITY TERM LOAN USD-LIBOR-BBA +250 BPS 31/05/2026	277,596.15	276,729	1.04
ISTAR FINANCIAL INC TRANCHE B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +275BPS	273,785.81	273,786	1.03
WP CPP HOLDINGS LLC TERM B TERM LOAN-USD-LIBOR BBA 3M + 375BPS	283,705.32	272,712	1.02
JANE STREET GROUP LLC TRANCHE B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +275BPS	269,689.37	268,116	1.00
BWAY CORP TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +325BPS	270,005.58	266,872	1.00
COGECO COMMUNICATIONS US TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M+200BPS	266,614.84	265,115	0.99
WEST CORP TERM B1 TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M+350BPS	276,285.39	261,238	0.98
ALMONDE INC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M+350BPS 16/06/2024	259,224.10	258,368	0.97
CORNERSTONE BUILDING TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +325BPS	257,884.45	258,078	0.97
GATES GLOBAL LLC TERM LOAN USD-LIBO R-BBA 3M +275BPS 31/03/2027	252,685.76	252,528	0.95

銘柄名	数量	評価額(米ドル)	投資比率(%)
RAPTOR ACQUISITION CORP TRANCHE B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA +400BPS	250,000.00	250,625	0.94
UNIVISION COMMUNICATIONS TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +325BPS	250,000.00	250,156	0.94
HERTZ CORP/THE TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M 350BPS 1/06/2028	249,375.00	249,843	0.94
ALLIED UNIVERSAL HOLDCO LLC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +375BPS	250,000.00	249,323	0.93
ALPHA 3 BV TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +250BPS 05/03/2028	249,375.00	249,063	0.93
BASS PRO GROUP LLC TRANCHE B1 TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +375BPS	248,125.00	248,707	0.93
TRINSEO MATERIALS OPERATING TRANCHE B2 TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +250B	249,375.00	247,972	0.93
PLAYTIKA HOLDING CORP TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +275BPS	248,250.00	247,629	0.93
CARNIVAL CORP TERM B TERM LOAN-LIBO R-BBA 3M +300BPS 30/06/2025	248,740.56	246,875	0.93
JBS USA LUX SA TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +200BPS 01/05/2026	246,202.54	245,920	0.92
HOYA MIDCO LLC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +325BPS 03/02/2029	240,229.45	240,470	0.90
CSC HOLDINGS LLC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR BBA 3M+225BPS 15/01/2026	241,722.01	239,040	0.90
SCIENTIFIC GAMES INTERNATIO TERM B5 TERM LOAN USD 3M+275BPS 14/08/2024	236,470.29	235,923	0.88
SOTHEBY'S TERM B TERM LOAN USD-LIBO R BBA 3M +450BPS 15/01/2027	227,241.47	228,094	0.85
TRIDENT TPI HOLDINGS INC TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +400BPS 29/07/2028	223,906.83	223,907	0.84
CONSOLIDATED COMMUNICATIONS TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA-3M +350BPS	214,201.41	213,967	0.80
MOZART BORROWER LP TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA +325BPS 30/09/2028	210,000.00	210,000	0.79
NASCAR HOLDINGS INC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR BBA 3M +275BPS	202,840.43	202,777	0.76
DIRECTV FINANCING LLC TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +500BPS 22/07/2027	200,000.00	200,500	0.75
UNITED AIRLINES INC TRANCHE B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA +375BPS	199,000.00	200,244	0.75
CHARIOT BUYER LLC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA3M 350BPS 22/10/2028	200,000.00	200,000	0.75
MAMBA PURCHASER INC TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M + 375BPS 29/09/202	200,000.00	200,000	0.75
PACTIV EVERGREEN GROUP TRANCHE B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M + 350BPS	200,000.00	199,825	0.75
RH TRANCHE B TERM LOAN-LIBOR-BBA 3M + 250BPS 15/10/2028	200,000.00	199,625	0.75
TRANS UNION LLC TERM B6 TERM LOAN U SD-LIBOR-BBA3M 225 18/11/2028	200,000.00	199,625	0.75
ATHENAHEALTH INC TRANCHE B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +525BPS	199,000.00	199,124	0.75
CARNIVAL CORP TERM B TERM LOAN-LIBO R-BBA 3M +325BPS 08/10/2028	200,000.00	198,500	0.74
MATCH GROUP INC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M + 175BPS	200,000.00	197,809	0.74
US RENAL CARE INC TRANCHE B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +550BPS	200,000.00	195,750	0.73
ACRISURE LLC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +350BPS	197,043.36	195,237	0.73
CENTURYLINK INC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +225BPS	196,231.15	194,131	0.73
TEAM HEALTH HOLDINGS INC TERM B TERM LOAN USD LIBOR BBA 3M +275BPS	198,359.37	190,496	0.71
CANO HEALTH LLC TERM LOAN USD-LIBOR -BBA 3M +425BPS 23/11/2027	150,000.00	150,281	0.56
BELLA HOLDING CO LLC TERM LOAN USD- LIBOR-BBA 3M +375BPS 01/04/2028	150,000.00	150,094	0.56
AZALEA TOPCO INC TRANCHE B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA +375BPS 25/07/20	149,625.01	149,999	0.56
TALEN ENERGY SUPPLY LLC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +375BPS	150,000.00	134,344	0.50
AIR METHODS CORP TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +350BPS	140,338.59	133,556	0.50
PROJECT BOOST PURCHASER TRANCHE B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA +350BPS	107,730.00	107,307	0.40
ASCEND LEARNING LLC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR BBA 3M +350BPS	100,000.00	99,925	0.37
SUNSHINE SOFTWARE MERGER TRANCHE B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M + 375BPS	100,000.00	99,875	0.37
LIFE TIME INC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +475BPS	94,640.75	95,486	0.36
SYNAPTICS INC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M 225 20/10/2028	67,000.00	66,874	0.25
STANDARD INDUSTRIES INC TRANCHE B TERM B TERM LOAN 250BPS 06/08/2028	64,025.00	64,185	0.24
HERTZ CORP/THE TERM C TEARM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M 350BPS 14/06/2028	50,000.00	50,094	0.19
AP CORE HOLDINGS II LLC TERM B2 TER M LOAN USD-LIBOR-BBA3M 550 01/09/20	50,000.00	49,875	0.19
DOTDASH MEREDITH INC TERM B TERM LO AN USD-LIBOR-BBA3M 23/11/2028	49,000.00	49,123	0.18
KRATON POLYMERS US LLC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR BBA 3M +325BPS	35,000.00	35,088	0.13
TRIDENT TPI HOLDINGS INC TRANCHE DD TERM USD-LIBOR-BBA 3M+ 400BPS	31,759.82	31,800	0.12
CENGAGE LEARNING INC TERM B TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M+ 475BPS	31,000.00	31,122	0.12
J&J VENTURES GAMING LLC TERM LOAN USD-LIBOR-BBA 3M +400BPS 26/04/2028	10,000.00	10,025	0.04
有価証券 合計		26,211,966	98.22
その他資産		476,186	1.78
純資産総額		26,688,152	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13期

決算日 2022年2月15日

(計算期間：2021年2月16日から2022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
	円	騰落率	(ベンチマーク)	騰落率				
9期(2018年2月15日)	11,967	1.0	11,996	1.0	—	98.7	—	百万円 17,683
10期(2019年2月15日)	12,156	1.6	12,185	1.6	—	98.7	—	14,666
11期(2020年2月17日)	12,296	1.2	12,328	1.2	—	99.4	—	13,257
12期(2021年2月15日)	12,129	△1.4	12,152	△1.4	—	99.3	—	12,225
13期(2022年2月15日)	11,991	△1.1	12,010	△1.2	—	99.2	—	10,678

(注1) 基準価額は1万円当たりで表示しています。

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

※ベンチマークに関して

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

■当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		NOMURA-BPI総合*		株式 組入比率	債券 組入比率	投資信託 証券比率
	円	騰落率	(ベンチマーク)	騰落率			
(期首) 2021年2月15日	12,129	—	12,152	—	—	99.3	—
2月末	12,049	△0.7	12,073	△0.7	—	99.1	—
3月末	12,133	0.0	12,157	0.0	—	99.1	—
4月末	12,157	0.2	12,179	0.2	—	99.5	—
5月末	12,165	0.3	12,185	0.3	—	99.0	—
6月末	12,174	0.4	12,194	0.3	—	99.3	—
7月末	12,233	0.9	12,254	0.8	—	99.0	—
8月末	12,224	0.8	12,243	0.7	—	99.2	—
9月末	12,181	0.4	12,201	0.4	—	99.6	—
10月末	12,167	0.3	12,188	0.3	—	99.4	—
11月末	12,197	0.6	12,218	0.5	—	99.2	—
12月末	12,169	0.3	12,192	0.3	—	99.5	—
2022年1月末	12,084	△0.4	12,104	△0.4	—	99.2	—
(期末) 2022年2月15日	11,991	△1.1	12,010	△1.2	—	99.2	—

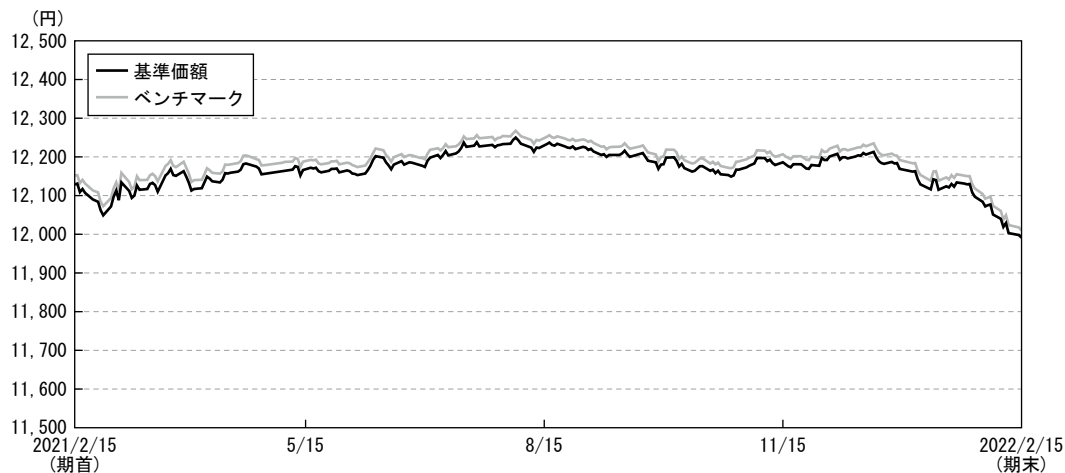
(注1) 騰落率は期首比です。

(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（2021年2月16日から2022年2月15日まで）



期 首：12,129円

期 末：11,991円

騰落率：△1.1%

※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、日銀の政策運営の見直しに対する不透明感から、2021年2月後半にかけて上昇しました。その後は日銀のイールドカーブ・コントロールを背景に上値が抑制される中、低下傾向で推移し、8月には一時0.01%まで低下しました。9月以降は米国のインフレ長期化懸念や金融政策正常化観測が高まる中、グローバルに金利が上昇する展開となりましたが、新型コロナウイルスの変異株拡大などを受けて低下する場面もありました。12月にFRB（米連邦準備制度理事会）が量的緩和策の縮小加速および終了時期の前倒しを決定すると、米国の早期利上げを織り込む動きからグローバルに金利には上昇圧力がかかりました。また米国をはじめとする各国中銀で金融政策正常化シフトが見られる中、日銀も追従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2月にかけて上昇する展開となりました。こうした中、10年国債利回りは、期末には0.22%（2月15日）となり前期末（0.08%）に比べ上昇しました。

## ■当該投資信託のポートフォリオ

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

## ■当該投資信託のベンチマークとの差異

当ファンドの、当期の基準価額の騰落率は1.1%の低下となりました。同期間におけるベンチマーク（NOMURA-BPI総合）の騰落率は1.2%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
	(2021年2月16日～2022年2月15日)		
	金額	比率	
平均基準価額	12,161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（2021年2月16日から2022年2月15日まで）

### 公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国	国債証券	598,393	1,901,517
内	特殊債証券	100,000	—
			(112,199)

(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。

## ■ 利害関係人との取引状況等（2021年2月16日から2022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（2022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	7,813,000 ( 270,000)	8,504,065 ( 320,837)	79.6 ( 3.0)	— (—)	58.6 ( 3.0)	20.1 ( —)	0.9 ( —)
地 方 債 証 券	800,000 ( 800,000)	832,777 ( 832,777)	7.8 ( 7.8)	— (—)	3.0 ( 3.0)	3.9 ( 3.9)	0.9 (0.9)
特 殊 債 証 券 (除 く 金 融 債)	626,054 ( 626,054)	631,036 ( 631,036)	5.9 ( 5.9)	— (—)	1.7 ( 1.7)	— ( —)	4.2 (4.2)
金 融 債 証 券	100,000 ( 100,000)	99,749 ( 99,749)	0.9 ( 0.9)	— (—)	— ( —)	0.9 ( 0.9)	— ( —)
普 通 社 債 証 券 (含 む 投 資 法 人 債 証 券)	500,000 ( 500,000)	525,262 ( 525,262)	4.9 ( 4.9)	— (—)	2.1 ( 2.1)	0.9 ( 0.9)	1.9 (1.9)
合 計	9,839,054 (2,296,054)	10,592,889 ( 2,409,662)	99.2 (22.6)	— (—)	65.4 ( 9.8)	25.8 ( 5.7)	8.0 (7.0)

(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	名	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1回利付国債(40年)		2.4	120,000	164,275	2048/3/20	
第6回利付国債(40年)		1.9	50,000	63,772	2053/3/20	
第7回利付国債(40年)		1.7	20,000	24,533	2054/3/20	
第8回利付国債(40年)		1.4	20,000	22,929	2055/3/20	
第9回利付国債(40年)		0.4	30,000	25,718	2056/3/20	
第11回利付国債(40年)		0.8	50,000	48,571	2058/3/20	
第13回利付国債(40年)		0.5	50,000	43,585	2060/3/20	
第332回利付国債(10年)		0.6	100,000	101,179	2023/12/20	
第333回利付国債(10年)		0.6	300,000	303,948	2024/3/20	
第334回利付国債(10年)		0.6	200,000	202,926	2024/6/20	
第335回利付国債(10年)		0.5	200,000	202,670	2024/9/20	
第336回利付国債(10年)		0.5	100,000	101,449	2024/12/20	
第339回利付国債(10年)		0.4	200,000	202,670	2025/6/20	
第340回利付国債(10年)		0.4	150,000	152,127	2025/9/20	
第344回利付国債(10年)		0.1	60,000	60,192	2026/9/20	

決 算 期	算 柄	期 名	当 期			
			利 率	額 面 金 額	評 価 額	末 償 還 年 月 日
国債証券			%	千円	千円	
第345回利付国債 (10年)			0.1	200,000	200,628	2026/12/20
第346回利付国債 (10年)			0.1	70,000	70,195	2027/3/20
第350回利付国債 (10年)			0.1	150,000	150,318	2028/3/20
第351回利付国債 (10年)			0.1	350,000	350,661	2028/6/20
第356回利付国債 (10年)			0.1	180,000	179,863	2029/9/20
第358回利付国債 (10年)			0.1	370,000	369,108	2030/3/20
第359回利付国債 (10年)			0.1	40,000	39,868	2030/6/20
第2回利付国債 (30年)			2.4	200,000	236,274	2030/2/20
第6回利付国債 (30年)			2.4	41,000	49,705	2031/11/20
第12回利付国債 (30年)			2.1	100,000	120,298	2033/9/20
第15回利付国債 (30年)			2.5	50,000	62,939	2034/6/20
第18回利付国債 (30年)			2.3	110,000	136,757	2035/3/20
第21回利付国債 (30年)			2.3	100,000	125,082	2035/12/20
第25回利付国債 (30年)			2.3	70,000	88,260	2036/12/20
第28回利付国債 (30年)			2.5	120,000	156,200	2038/3/20
第29回利付国債 (30年)			2.4	190,000	245,307	2038/9/20
第32回利付国債 (30年)			2.3	50,000	64,288	2040/3/20
第34回利付国債 (30年)			2.2	90,000	114,759	2041/3/20
第35回利付国債 (30年)			2.0	110,000	136,757	2041/9/20
第37回利付国債 (30年)			1.9	100,000	123,036	2042/9/20
第38回利付国債 (30年)			1.8	50,000	60,663	2043/3/20
第39回利付国債 (30年)			1.9	50,000	61,712	2043/6/20
第40回利付国債 (30年)			1.8	50,000	60,772	2043/9/20
第44回利付国債 (30年)			1.7	50,000	59,928	2044/9/20
第45回利付国債 (30年)			1.5	50,000	57,877	2044/12/20
第46回利付国債 (30年)			1.5	50,000	57,892	2045/3/20
第48回利付国債 (30年)			1.4	50,000	56,856	2045/9/20
第49回利付国債 (30年)			1.4	100,000	113,721	2045/12/20
第51回利付国債 (30年)			0.3	100,000	89,358	2046/6/20
第62回利付国債 (30年)			0.5	70,000	63,971	2049/3/20
第65回利付国債 (30年)			0.4	30,000	26,512	2049/12/20
第66回利付国債 (30年)			0.4	70,000	61,806	2050/3/20
第68回利付国債 (30年)			0.6	70,000	65,150	2050/9/20
第70回利付国債 (30年)			0.7	70,000	66,849	2051/3/20
第68回利付国債 (20年)			2.2	53,000	55,468	2024/3/20
第74回利付国債 (20年)			2.1	35,000	37,093	2024/12/20
第78回利付国債 (20年)			1.9	54,000	57,406	2025/6/20
第81回利付国債 (20年)			2.0	100,000	107,145	2025/9/20

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82回利付国債 (20年)	2.1	20,000	21,500	2025/9/20
第83回利付国債 (20年)	2.1	100,000	108,004	2025/12/20
第84回利付国債 (20年)	2.0	100,000	107,620	2025/12/20
第90回利付国債 (20年)	2.2	100,000	109,950	2026/9/20
第91回利付国債 (20年)	2.3	100,000	110,409	2026/9/20
第94回利付国債 (20年)	2.1	70,000	77,301	2027/3/20
第95回利付国債 (20年)	2.3	200,000	223,964	2027/6/20
第100回利付国債 (20年)	2.2	140,000	158,172	2028/3/20
第121回利付国債 (20年)	1.9	100,000	114,941	2030/9/20
第124回利付国債 (20年)	2.0	80,000	92,872	2030/12/20
第125回利付国債 (20年)	2.2	100,000	118,220	2031/3/20
第127回利付国債 (20年)	1.9	100,000	115,534	2031/3/20
第129回利付国債 (20年)	1.8	200,000	22,986	2031/6/20
第133回利付国債 (20年)	1.8	50,000	57,748	2031/12/20
第139回利付国債 (20年)	1.6	10,000	11,383	2032/6/20
第141回利付国債 (20年)	1.7	100,000	115,183	2032/12/20
第144回利付国債 (20年)	1.5	80,000	90,544	2033/3/20
第145回利付国債 (20年)	1.7	50,000	57,771	2033/6/20
第147回利付国債 (20年)	1.6	50,000	57,367	2033/12/20
第148回利付国債 (20年)	1.5	270,000	306,898	2034/3/20
第154回利付国債 (20年)	1.2	50,000	55,156	2035/9/20
第157回利付国債 (20年)	0.2	150,000	144,753	2036/6/20
第158回利付国債 (20年)	0.5	100,000	100,478	2036/9/20
第164回利付国債 (20年)	0.5	50,000	49,703	2038/3/20
第174回利付国債 (20年)	0.4	30,000	28,708	2040/9/20
第175回利付国債 (20年)	0.5	150,000	145,855	2040/12/20
小 計		7,813,000	8,504,065	
地方債証券				
第13回東京都公募公債	1.93	100,000	122,299	2042/3/19
第792回東京都公募公債	0.05	200,000	198,110	2029/3/19
平成28年度第2回静岡県公募公債	0.08	100,000	100,061	2026/3/19
第155回共同発行市場公募地方債	0.22	100,000	100,622	2026/2/25
第161回共同発行市場公募地方債	0.06	100,000	99,909	2026/8/25
第19回公営企業債券	2.37	100,000	111,036	2026/12/18
第44回地方公共団体金融機構債券	0.791	100,000	100,740	2023/1/27
小 計		800,000	832,777	
特殊債券 (除く金融債)				
第103回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.155	100,000	100,231	2027/12/17

決 算 期 銘 柄 名	当 期			末
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券（除く金融債）	%	千円	千円	
第190回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.605	249,000	250,999	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	100,054	2023/3/20
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	10,617	10,734	2042/5/10
第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.25	9,941	9,967	2037/5/10
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.67	22,225	23,220	2046/7/10
第75回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.26	34,271	35,764	2048/8/10
第50回東日本高速道路株式会社債	0.08	100,000	100,065	2023/6/20
小 計		626,054	631,036	
金融債券				
第377回信金中金債	0.04	100,000	99,749	2026/4/27
小 計		100,000	99,749	
普通社債券（含む投資法人債券）				
第389回中国電力株式会社社債	0.3	100,000	100,207	2026/4/24
第81回三菱商事株式会社無担保社債	1.518	100,000	110,285	2032/6/25
第80回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	0.07	100,000	99,996	2022/10/24
第45回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.321	100,000	114,104	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	100,670	2023/3/20
小 計		500,000	525,262	
合 計		9,839,054	10,592,889	

(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（2022年2月15日現在）

該当事項はありません。



(2022年2月15日現在)

## ■投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公 社 債	10,592,889	99.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	104,971	1.0
投 資 信 託 財 産 総 額	10,697,860	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 2022年2月15日
(A) 資 産	10,697,860,067円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	69,866,360
公 社 債(評価額)	10,592,889,810
未 収 利 息	35,047,897
前 払 費 用	56,000
(B) 負 債	19,055,757
未 払 解 約 金	19,053,633
そ の 他 未 払 費 用	2,124
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	10,678,804,310
元 本	8,905,980,044
次 期 繰 越 損 益 金	1,772,824,266
(D) 受 益 権 総 口 数	8,905,980,044口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,991円

(注1) 当親ファンドの期首元本額は10,079,453,877円、期中追加設定元本額は338,329,760円、期中一部解約元本額は1,511,803,593円です。

(注2) 当親ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は以下の通りです。

マニユライフ・日本債券インデックスファンド(適格機関投資家専用)	3,180,112,805円
マニユライフ・国際分散ファンド20(適格機関投資家専用)	5,001,975,605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)	607,394,487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)	115,685,050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 2021年2月16日 至 2022年2月15日
(A) 配 当 等 収 益	116,654,682円
受 取 利 息	116,654,682
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 236,425,045
売 買 益	1,839,900
売 買 損	△ 238,264,945
(C) 信 託 報 酬 等	△ 62,631
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△ 119,832,994
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	2,145,596,261
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	73,706,232
(G) 解 約 差 損 益 金	△ 326,645,233
(H) 計 (D+E+F+G)	1,772,824,266
次 期 繰 越 損 益 金(H)	1,772,824,266

(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1,1991円です。

※当ファンドは監査対象ではありません。

## お知らせ

### ◆約款変更

該当事項はありません。

### ◆運用体制の変更

該当事項はありません。