

アジア・ハイ・イールド債券 ファンド（毎月分配型） 円ヘッジコース

■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／債券 | |
| 信託期間 | 2012年1月25日から2021年8月10日まで | |
| 運用方針 | ①主として日本を除くアジア（オセアニアを含む）のハイ・イールド債券（米ドル建て等）を実質的な主要投資対象とし、インカムゲインの確保と信託財産の成長を目指します。 ②主要投資対象とする投資信託証券の組入れ外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジにより、為替変動リスクを低減する運用を行います。 | |
| 主要投資対象 | アジア・ハイ・イールド債券ファンド（毎月分配型）円ヘッジコース | 投資信託証券 |
| | 日興アジア・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（クラス1） | アジア地域の米ドル建てのハイ・イールド債券等 |
| | マネーパールマザーファンド | わが国の公社債等 |
| 主な組入制限 | アジア・ハイ・イールド債券ファンド（毎月分配型）円ヘッジコース | 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。デリバティブの直接利用は行いません。株式への直接投資は行いません。 |
| | 日興アジア・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（クラス1） | 有価証券の空売りは行いません。純資産総額の10%を超える借入れを行いません。投資信託証券への投資は行いません。 |
| | マネーパールマザーファンド | 株式への投資は、転換社債の転換及び転換社債型新株予約権付社債の新株予約権の行使により取得したものに限るものとし、投資割合は信託財産の純資産総額の5%以下とします。外貨建資産への投資は行いません。 |
| 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利子、配当収入と売買益（評価損益を含みます。）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水準、市場動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。 | |

※当ファンドが主要投資対象とする投資信託証券の正式名称については後掲「■主要投資対象の投資信託証券の概要」をご覧ください。

| | |
|----------|-------------|
| 第74期（決算日 | 2018年3月12日） |
| 第75期（決算日 | 2018年4月10日） |
| 第76期（決算日 | 2018年5月10日） |
| 第77期（決算日 | 2018年6月11日） |
| 第78期（決算日 | 2018年7月10日） |
| 第79期（決算日 | 2018年8月10日） |

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。
 さて、「アジア・ハイ・イールド債券ファンド（毎月分配型）円ヘッジコース」は、このたび第79期決算を行いましたので、第74期～第79期中の運用状況をご報告申し上げます。
 今後とも引き続きお引立て賜りますようお願い申し上げます。



損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント

東京都中央区日本橋二丁目2番16号 共立日本橋ビル



<http://www.sjnk-am.co.jp/>

お問い合わせ先



クライアントサービス第二部 0120-69-5432

（受付時間 営業日の午前9時～午後5時）

■最近5作成期の運用実績

| 作成期 | 決算期 | 基準価額 (分配落) | 標準価額 | | | 債券組入率 % | 投資信託組入率 % | 純資産額 百万円 |
|--------|-------------------|---------------|------|-----|------|------------|--------------|-------------|
| | | | 税金配 | 込金額 | 騰落率 | | | |
| 第10作成期 | 50期 (2016年3月10日) | 7,615 | 円 | 円 | % | 0.8 | 96.0 | 2,283 |
| | 51期 (2016年4月11日) | 7,699 | | 50 | 1.2 | 0.9 | 95.0 | 2,277 |
| | 52期 (2016年5月10日) | 7,710 | | 40 | 0.7 | 1.0 | 96.3 | 2,177 |
| | 53期 (2016年6月10日) | 7,767 | | 40 | 1.3 | 0.9 | 95.7 | 2,200 |
| | 54期 (2016年7月11日) | 7,802 | | 40 | 1.0 | 1.0 | 96.2 | 2,171 |
| 第11作成期 | 55期 (2016年8月10日) | 7,838 | | 40 | 1.0 | 0.9 | 93.5 | 2,271 |
| | 56期 (2016年9月12日) | 7,836 | | 40 | 0.5 | 0.9 | 94.8 | 2,291 |
| | 57期 (2016年10月11日) | 7,810 | | 40 | 0.2 | 0.9 | 97.6 | 2,190 |
| | 58期 (2016年11月10日) | 7,751 | | 40 | △0.2 | 1.0 | 95.7 | 2,167 |
| | 59期 (2016年12月12日) | 7,676 | | 40 | △0.5 | 0.9 | 96.1 | 2,110 |
| 第12作成期 | 60期 (2017年1月10日) | 7,670 | | 40 | 0.4 | 0.8 | 97.1 | 2,041 |
| | 61期 (2017年2月10日) | 7,691 | | 40 | 0.8 | 0.9 | 97.3 | 2,037 |
| | 62期 (2017年3月10日) | 7,655 | | 40 | 0.1 | 0.9 | 96.4 | 1,988 |
| | 63期 (2017年4月10日) | 7,669 | | 40 | 0.7 | 0.8 | 96.1 | 1,959 |
| | 64期 (2017年5月10日) | 7,652 | | 40 | 0.3 | 0.9 | 95.8 | 1,920 |
| 第13作成期 | 65期 (2017年6月12日) | 7,564 | | 40 | △0.6 | 0.9 | 96.2 | 1,886 |
| | 66期 (2017年7月10日) | 7,518 | | 30 | △0.2 | 0.8 | 96.6 | 1,822 |
| | 67期 (2017年8月10日) | 7,534 | | 30 | 0.6 | 0.9 | 97.1 | 1,769 |
| | 68期 (2017年9月11日) | 7,551 | | 30 | 0.6 | 0.9 | 96.9 | 1,711 |
| | 69期 (2017年10月10日) | 7,546 | | 30 | 0.3 | 0.8 | 96.1 | 1,633 |
| 第14作成期 | 70期 (2017年11月10日) | 7,556 | | 30 | 0.5 | 0.9 | 97.2 | 1,580 |
| | 71期 (2017年12月11日) | 7,495 | | 30 | △0.4 | 0.9 | 96.2 | 1,577 |
| | 72期 (2018年1月10日) | 7,484 | | 30 | 0.3 | 1.0 | 95.9 | 1,544 |
| | 73期 (2018年2月13日) | 7,385 | | 30 | △0.9 | 1.0 | 96.6 | 1,507 |
| | 74期 (2018年3月12日) | 7,356 | | 30 | 0.0 | 0.9 | 95.8 | 1,465 |
| 第14作成期 | 75期 (2018年4月10日) | 7,284 | | 30 | △0.6 | 0.8 | 95.8 | 1,447 |
| | 76期 (2018年5月10日) | 7,118 | | 30 | △1.9 | 0.9 | 97.0 | 1,393 |
| | 77期 (2018年6月11日) | 7,019 | | 30 | △1.0 | 0.9 | 96.5 | 1,310 |
| | 78期 (2018年7月10日) | 6,789 | | 30 | △2.8 | 0.9 | 97.5 | 1,251 |
| | 79期 (2018年8月10日) | 6,857 | | 30 | 1.4 | 0.9 | 96.6 | 1,246 |

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 基準価額及び分配金は1万円当たり（以下同じ）。

(注3) 債券組入比率はマネーブルマザーファンドへの投資割合に応じて算出された当ファンドベースの組入比率。

(注4) 投資信託証券組入比率は日興 アジア・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（クラス1）の組入比率。

(注5) 当ファンドは、日興 アジア・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（クラス1）への投資比率を可能な限り高位に保ちますが、本投資信託証券のコンセプトに適った指数等が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は記載しておりません。

■第74期～第79期の基準価額と市況等の推移

| 決算期 | 年 月 日 | 基 準 価 額 | | 債 券 組 入 比 率 | 投 資 信 託 証 券 組 入 比 率 |
|------|------------------|---------|-------|-------------|---------------------|
| | | 円 | 騰 落 率 | | |
| 第74期 | (期 首) 2018年2月13日 | 7,385 | — | 1.0 | 96.6 |
| | 2月末 | 7,402 | 0.2 | 1.0 | 97.6 |
| | (期 末) 2018年3月12日 | 7,386 | 0.0 | 0.9 | 95.8 |
| 第75期 | (期 首) 2018年3月12日 | 7,356 | — | 0.9 | 95.8 |
| | 3月末 | 7,304 | △0.7 | 0.8 | 95.9 |
| | (期 末) 2018年4月10日 | 7,314 | △0.6 | 0.8 | 95.8 |
| 第76期 | (期 首) 2018年4月10日 | 7,284 | — | 0.8 | 95.8 |
| | 4月末 | 7,225 | △0.8 | 0.8 | 96.4 |
| | (期 末) 2018年5月10日 | 7,148 | △1.9 | 0.9 | 97.0 |
| 第77期 | (期 首) 2018年5月10日 | 7,118 | — | 0.9 | 97.0 |
| | 5月末 | 7,118 | 0.0 | 0.8 | 97.8 |
| | (期 末) 2018年6月11日 | 7,049 | △1.0 | 0.9 | 96.5 |
| 第78期 | (期 首) 2018年6月11日 | 7,019 | — | 0.9 | 96.5 |
| | 6月末 | 6,950 | △1.0 | 0.8 | 97.4 |
| | (期 末) 2018年7月10日 | 6,819 | △2.8 | 0.9 | 97.5 |
| 第79期 | (期 首) 2018年7月10日 | 6,789 | — | 0.9 | 97.5 |
| | 7月末 | 6,884 | 1.4 | 0.8 | 96.7 |
| | (期 末) 2018年8月10日 | 6,887 | 1.4 | 0.9 | 96.6 |

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

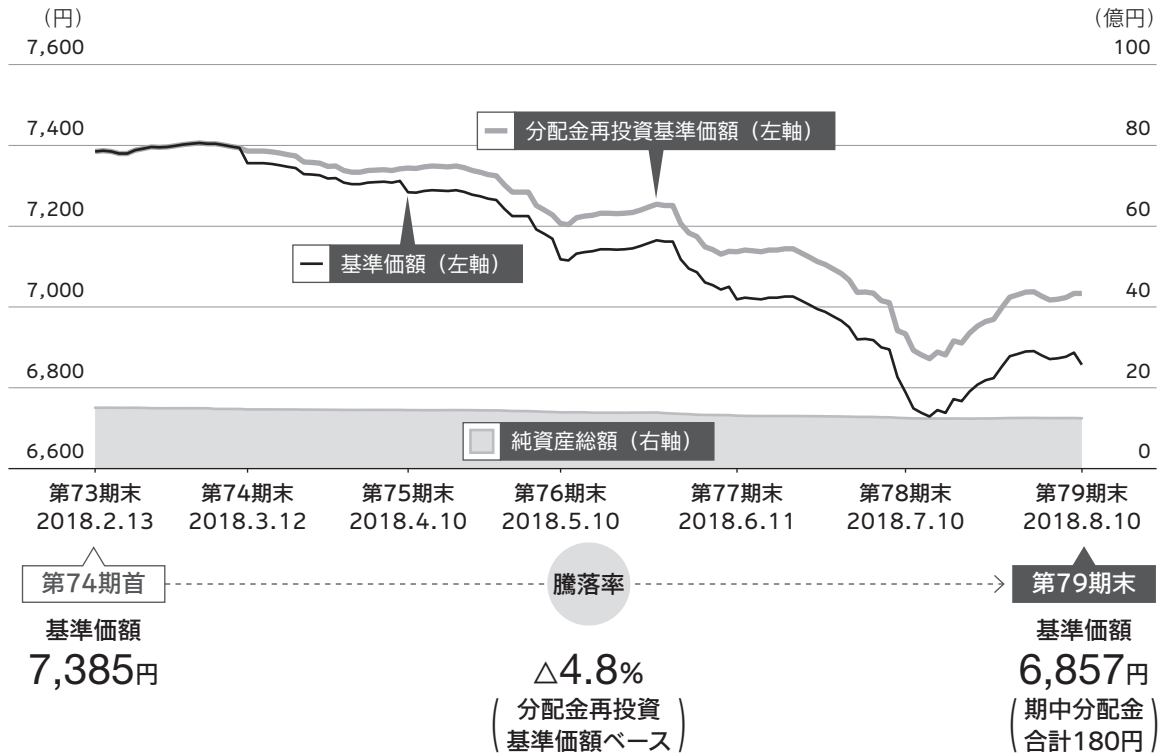
(注2) 債券組入比率はマネープールマザーファンドへの投資割合に応じて算出された当ファンドベースの組入比率。

(注3) 投資信託証券組入比率は日興 アジア・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（クラス1）の組入比率。

(注4) 当ファンドは、日興 アジア・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（クラス1）への投資比率を可能な限り高位に保ちますが、本投資信託証券のコンセプトに適った指数等が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は記載しておりません。

運用経過

● 基準価額の推移



- 分配金再投資基準価額の推移は、2018年2月13日の基準価額をもとに委託会社にて指数化したものを使用しております。
- 分配金再投資基準価額は、収益分配金（税引前）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- 当ファンドは、日興 アジア・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（クラス1）への投資比率を可能な限り高位に保ちますが、本投資信託証券のコンセプトに適った指数等が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は記載しておりません。

● 基準価額の主な変動要因

アジア・ハイ・イールド債券ファンド（毎月分配型） 円ヘッジコース

主要投資対象である「日興アジア・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（クラス1）」は、債券部分がマイナスに寄与し、分配金再投資基準価額の騰落率はマイナスとなりました。

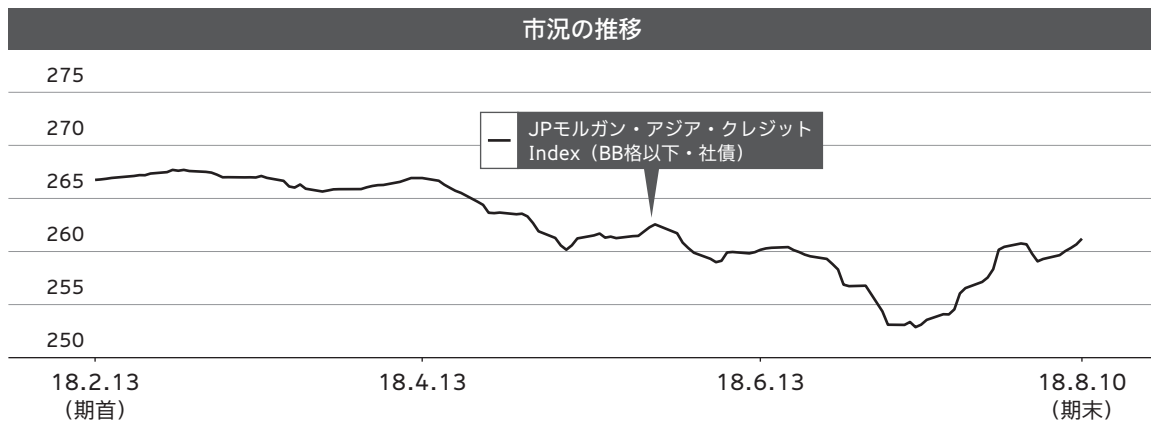
- 本報告書では、ベビーファンドとマザーファンドを下記の様に統一して表記しています。

 ベビーファンド  マザーファンド  ファンド・オブ・ファンズ

● 投資環境

当期のアジア・ハイ・イールド債券市場は下落しました。

米国の金利上昇等を背景に投資家のリスク回避姿勢が強まる中、期初から緩やかな下落基調が続きました。米中貿易摩擦の激化に対する警戒感が強まったことに加えて、FRB（米連邦準備理事会）の利上げペースが加速するとの観測が広がり、米国10年国債利回りが3%を上回る水準まで上昇したこと等を受けて、アジア・ハイ・イールド債券市場はさらに下落する展開となりました。7月に入ると、世界的な貿易戦争激化への警戒感が後退し、新興国市場への資金回帰が進んだことから、アジア・ハイ・イールド債券市場は期末にかけて上昇しました。



(出所：Bloomberg)

● 当該投資信託のポートフォリオ

期を通じて、「日興 アジア・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（クラス1）」の投資比率を高位に維持しました。

日興 アジア・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（クラス1）

アジア・ハイ・イールド債券利回りが上昇（価格は下落）し、スプレッドも拡大したことから、債券部分はマイナスに寄与しました。

マネープールマザーファンド

安全性、流動性が高く、利回りがプラスの短期社債を中心に運用することで、ポートフォリオ全体の利回りをわずかながらもプラスに維持しました。

● 当該投資信託のベンチマークとの差異

当ファンドは、日興 アジア・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（クラス1）の投資比率を可能な限り高位に保ちますが、本投資信託証券のコンセプトに適った指数等が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は記載しておりません。

● 分配金

収益分配金については、基準価額の水準等を勘案し、合計180円の分配を行いました。なお、収益分配に充てなかった収益は、信託財産に留保し、運用の基本方針に基づいて引き続き元本と同一の運用を行います。

分配原資の内訳

（単位：円、1万口当たり・税引前）

| 項目 | 第74期 | 第75期 | 第76期 | 第77期 | 第78期 | 第79期 |
|--------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
| | 2018.2.14 } 2018.3.12 | 2018.3.13 } 2018.4.10 | 2018.4.11 } 2018.5.10 | 2018.5.11 } 2018.6.11 | 2018.6.12 } 2018.7.10 | 2018.7.11 } 2018.8.10 |
| 当期分配金 | 30 | 30 | 30 | 30 | 30 | 30 |
| （対基準価額比率） | 0.41% | 0.41% | 0.42% | 0.43% | 0.44% | 0.44% |
| 当期の収益 | 30 | 30 | 30 | 30 | 30 | 30 |
| 当期の収益以外 | — | — | — | — | — | — |
| 翌期繰越分配対象額 | 2,095 | 2,106 | 2,117 | 2,128 | 2,140 | 2,155 |

注1. 「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2. 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（税引前）に合致しない場合があります。

注3. 当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税引前）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。

決算期毎にインカム収入[※]を中心に分配を行うことを目指すファンドです。

※ インカム収入とは、債券の利子収入等をいいます。

- ・ファンドに蓄積された過去の運用成果（分配原資）を加味する場合があります。
- ・投資対象資産や為替の値動き等により基準価額が下落した場合でも、原則として、インカム収入相当については、分配を行います。

● 今後の運用方針

アジア・ハイ・イールド債券ファンド（毎月分配型） 円ヘッジコース

今後も、「日興 アジア・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（クラス1）」の投資比率を高位に保つことにより、信託財産の中長期的な成長を目指します。

日興 アジア・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（クラス1）

足元、アジア・ハイ・イールド市場は上昇に転じましたが、引き続き米中貿易戦争の激化等が市場の懸念材料となっており、当面は変動性の高い相場展開が続く見込みです。アジア各国の経済環境は引き続き良好な状況が続いており、企業の財務基盤も健全な状況にあることから、中長期的にはアジア・ハイ・イールド債券市場は底堅い推移を予想しており、アジア・ハイ・イールド債券市場への旺盛な投資需要は今後も継続する見込みです。運用においては、市場動向を注視しながら引き続きクレジットの質を重視した運用を継続する方針です。

マネープールマザーファンド

安全性、流動性が高く、残存期間の短い公社債を中心に運用を行う方針です。

● 1万口当たりの費用明細

期中の1万口当たりの費用の割合は **0.484%** です。

| 項目 | 第74期～第79期 2018.2.14～2018.8.10 | | 項目の概要 |
|-----------|----------------------------------|--------------|--|
| | 金額 | 比率 | |
| (a) 信託報酬 | 34円 | 0.483% | (a)信託報酬＝各期中の平均基準価額×信託報酬率（年率）× $\frac{\text{各期の日数}}{\text{年間の日数}}$ 期中の平均基準価額は7,144円です。 |
| （投信会社） | (13) | (0.184) | ファンドの運用の対価 |
| （販売会社） | (20) | (0.284) | 購入後の情報提供、運用報告書等各种書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価 |
| （受託会社） | (1) | (0.015) | 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行等の対価 |
| (b) その他費用 | 0 | 0.001 | (b)その他費用＝ $\frac{\text{各期中のその他費用}}{\text{各期中の平均受益権口数}}$ |
| （監査費用） | (0) | (0.001) | 監査法人に支払うファンドの監査にかかる費用 |
| （その他） | (0) | (0.000) | 信託事務の処理にかかるその他の費用等 |
| 合計 | 35 | 0.484 | |

注1. 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、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、その他費用は、このファンドが組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。

注2. 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

注3. 比率欄は「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。

注4. 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。

■ 売買及び取引の状況

○ 投資信託証券

(2018年2月14日から2018年8月10日まで)

| | | 第 74 期 ~ 第 79 期 | | | |
|---------------|---------------------------------|-----------------|-----|----------|---------|
| | | 買 付 | | 売 付 | |
| | | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| 外国 邦貨 建 | NikkoAM Asia Investment Series- | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| | NikkoAM AsiaHighYieldBondFund I | — | — | 301.0063 | 133,000 |
| | | (—) | (—) | (—) | (—) |

(注1) 金額は受渡代金。

(注2) 買付()内は分割割当、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 売付()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注4) 金額の単位未満は切捨て。

○ 親投資信託受益証券の設定、解約状況

(2018年2月14日から2018年8月10日まで)

| | | 第 74 期 ~ 第 79 期 | | | |
|---------------|--|-----------------|-----|-------|-------|
| | | 設 定 | | 解 約 | |
| | | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| マネープールマザーファンド | | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| | | — | — | 1,993 | 2,000 |

(注1) 単位未満は切捨て。

(注2) 金額は受渡代金。

■ 利害関係人との取引状況 (2018年2月14日から2018年8月10日まで)

当ファンド及びマザーファンドにおける第74期～第79期中の利害関係人との取引はございません。

■組入資産の明細

○投資信託証券（邦貨建）

（2018年8月10日現在）

| 銘 | 柄 | 期首(第73期末) | 第 79 期 | | 末 |
|--|-------------|-------------|-------------|-----------|------|
| | | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | 比 率 |
| | | 千口 | 千口 | 千円 | % |
| NikkoAM Asia Investment Series-NikkoAM AsiaHighYieldBondFund I | | 3,156.09101 | 2,855.08471 | 1,204,680 | 96.6 |
| 合 計 | 口 数、金 額 | 3,156.09101 | 2,855.08471 | 1,204,680 | — |
| | 銘 柄 数 <比 率> | 1銘柄<96.6%> | 1銘柄<96.6%> | — | — |

（注1）合計欄の〈 〉内は、純資産総額に対する評価額の比率。

（注2）評価額の単位未満は切捨て。

○親投資信託残高

（2018年8月10日現在）

| | 期 首(第73期末) | 第 79 期 | | 末 |
|---------------|------------|--------|--------|--------|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | 額 |
| | 千口 | 千口 | 千円 | 千円 |
| マネープールマザーファンド | 16,753 | 14,759 | 14,806 | 14,806 |

（注1）単位未満は切捨て。

（注2）当ファンドは、第79期末において、直接投資をする株式及び新株予約権証券の組入れはございません。

■投資信託財産の構成

（2018年8月10日現在）

| 項 目 | 第 79 期 | | 末 |
|--------------------------|-----------|-------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 | 率 |
| | 千円 | | % |
| 投 資 信 託 証 券 | 1,204,680 | 96.0 | 96.0 |
| マ ネ ー プ ール マ ザ ー フ ァ ン ド | 14,806 | 1.2 | 1.2 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等、そ の 他 | 35,895 | 2.9 | 2.9 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 1,255,382 | 100.0 | 100.0 |

（注）評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2018年3月12日現在) (2018年4月10日現在) (2018年5月10日現在) (2018年6月11日現在) (2018年7月10日現在) (2018年8月10日現在)

| 項目 | 第74期末 | 第75期末 | 第76期末 | 第77期末 | 第78期末 | 第79期末 |
|-----------------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|
| a 資産 | 1,491,713,253円 | 1,455,869,767円 | 1,411,310,042円 | 1,328,578,738円 | 1,262,922,002円 | 1,255,382,691円 |
| コール・ローン等 | 73,842,506 | 54,437,600 | 44,670,482 | 49,587,530 | 28,651,038 | 35,895,734 |
| 投資信託証券(評価額) | 1,403,066,894 | 1,386,625,362 | 1,351,831,279 | 1,264,182,927 | 1,219,461,207 | 1,204,680,152 |
| マネーブルマザー ファンド(評価額) | 14,803,853 | 14,806,805 | 14,808,281 | 14,808,281 | 14,809,757 | 14,806,805 |
| b 負債 | 26,604,577 | 7,872,832 | 17,904,070 | 18,167,733 | 11,779,494 | 8,691,892 |
| 未払収益分配金 | 5,975,459 | 5,964,101 | 5,872,622 | 5,600,967 | 5,528,772 | 5,454,384 |
| 未払解約金 | 19,528,213 | 750,959 | 10,853,875 | 11,370,239 | 5,228,278 | 2,183,616 |
| 未払信託報酬 | 1,098,524 | 1,151,344 | 1,171,981 | 1,192,686 | 1,019,473 | 1,051,445 |
| その他未払費用 | 2,381 | 6,428 | 5,592 | 3,841 | 2,971 | 2,447 |
| c 純資産総額(a-b) | 1,465,108,676 | 1,447,996,935 | 1,393,405,972 | 1,310,411,005 | 1,251,142,508 | 1,246,690,799 |
| 元本 | 1,991,819,775 | 1,988,033,854 | 1,957,540,719 | 1,866,989,259 | 1,842,924,039 | 1,818,128,037 |
| 次期繰越損益金 | △ 526,711,099 | △ 540,036,919 | △ 564,134,747 | △ 556,578,254 | △ 591,781,531 | △ 571,437,238 |
| d 受益権総口数 | 1,991,819,775口 | 1,988,033,854口 | 1,957,540,719口 | 1,866,989,259口 | 1,842,924,039口 | 1,818,128,037口 |
| 1万口当たり基準価額(c/d) | 7,356円 | 7,284円 | 7,118円 | 7,019円 | 6,789円 | 6,857円 |

(注1) 期末における1口当たりの純資産総額

第74期0.7356円、第75期0.7284円、第76期0.7118円、第77期0.7019円、第78期0.6789円、第79期0.6857円

(注2) 期末における元本の欠損金額

第74期526,711,099円、第75期540,036,919円、第76期564,134,747円、第77期556,578,254円、第78期591,781,531円、第79期571,437,238円

■損益の状況

自2018年2月14日 自2018年3月13日 自2018年4月11日 自2018年5月11日 自2018年6月12日 自2018年7月11日
至2018年3月12日 至2018年4月10日 至2018年5月10日 至2018年6月11日 至2018年7月10日 至2018年8月10日

| 項目 | 第74期 | 第75期 | 第76期 | 第77期 | 第78期 | 第79期 |
|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|
| a 配当等収益 | 12,240,774円 | 9,201,490円 | 9,148,923円 | 8,683,577円 | 8,742,675円 | 8,551,096円 |
| 受取配当金 | 12,243,358 | 9,201,779 | 9,151,145 | 8,685,800 | 8,744,886 | 8,553,239 |
| 受取利息 | 26 | — | 5 | 51 | 14 | 8 |
| 支払利息 | △ 2,610 | △ 289 | △ 2,227 | △ 2,274 | △ 2,225 | △ 2,151 |
| b 有価証券売買損益 | △ 11,082,367 | △ 16,417,368 | △ 34,552,746 | △ 20,628,730 | △ 44,625,419 | 10,274,025 |
| 売買益 | 155,011 | 22,493 | 235,802 | 311,019 | 93,805 | 10,365,579 |
| 売買損 | △ 11,237,378 | △ 16,439,861 | △ 34,788,548 | △ 20,939,749 | △ 44,719,224 | △ 91,554 |
| c 信託報酬等 | △ 1,100,905 | △ 1,157,772 | △ 1,176,338 | △ 1,196,527 | △ 1,021,820 | △ 1,053,892 |
| d 当期損益金(a+b+c) | 57,502 | △ 8,373,650 | △ 26,580,161 | △ 13,141,680 | △ 36,904,564 | 17,771,229 |
| e 前期繰越損益金 | △ 418,794,298 | △ 423,254,007 | △ 429,571,462 | △ 438,636,313 | △ 450,231,613 | △ 484,366,176 |
| f 追加信託差損益金 | △ 101,998,844 | △ 102,445,161 | △ 102,110,502 | △ 99,199,294 | △ 99,116,582 | △ 99,387,907 |
| (配当等相当額) | (156,962,693) | (157,054,513) | (155,383,814) | (149,218,297) | (147,941,656) | (146,757,183) |
| (売買損益相当額) | (△258,961,537) | (△259,499,674) | (△257,494,316) | (△248,417,591) | (△247,058,238) | (△246,145,090) |
| g 合計(d+e+f) | △ 520,735,640 | △ 534,072,818 | △ 558,262,125 | △ 550,977,287 | △ 586,252,759 | △ 565,982,854 |
| h 収益分配金 | △ 5,975,459 | △ 5,964,101 | △ 5,872,622 | △ 5,600,967 | △ 5,528,772 | △ 5,454,384 |
| 次期繰越損益金(g+h) | △ 526,711,099 | △ 540,036,919 | △ 564,134,747 | △ 556,578,254 | △ 591,781,531 | △ 571,437,238 |
| 追加信託差損益金 | △ 101,998,844 | △ 102,445,161 | △ 102,110,502 | △ 99,199,294 | △ 99,116,582 | △ 99,387,907 |
| (配当等相当額) | (156,962,698) | (157,054,521) | (155,383,829) | (149,218,321) | (147,941,668) | (146,757,201) |
| (売買損益相当額) | (△258,961,542) | (△259,499,682) | (△257,494,331) | (△248,417,615) | (△247,058,250) | (△246,145,108) |
| 分配準備積立金 | 260,460,664 | 261,679,563 | 259,117,771 | 248,206,348 | 246,620,664 | 245,184,782 |
| 繰越損益金 | △ 685,172,919 | △ 699,271,321 | △ 721,142,016 | △ 705,585,308 | △ 739,285,613 | △ 717,234,113 |

(注1) 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) 信託報酬等には、消費税相当額を含めて表示しております。

(注3) 追加信託差損益金とは、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。

注記事項（第74期～第79期）

第74期

- ・信託財産に係る期首元本額・期中追加設定元本額及び期中一部解約元本額

| | |
|-----------|----------------|
| 期首元本額 | 2,040,771,534円 |
| 期中追加設定元本額 | 2,236,354円 |
| 期中一部解約元本額 | 51,188,113円 |
- ・分配金の計算過程
 計算期間末に、経費控除後の配当等収益（11,148,901円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、収益調整金（156,962,698円）及び分配準備積立金（255,287,222円）を対象収益（423,398,821円）として、委託者が基準価額の水準、市況動向等を勘案した結果、配当等収益から5,975,459円（1万円当たり30円）を分配に充てることに決定しました。

第75期

- ・信託財産に係る期首元本額・期中追加設定元本額及び期中一部解約元本額

| | |
|-----------|----------------|
| 期首元本額 | 1,991,819,775円 |
| 期中追加設定元本額 | 2,990,952円 |
| 期中一部解約元本額 | 6,776,873円 |
- ・分配金の計算過程
 計算期間末に、経費控除後の配当等収益（8,053,288円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、収益調整金（157,054,521円）及び分配準備積立金（259,590,376円）を対象収益（424,698,185円）として、委託者が基準価額の水準、市況動向等を勘案した結果、配当等収益から5,964,101円（1万円当たり30円）を分配に充てることに決定しました。

第76期

- ・信託財産に係る期首元本額・期中追加設定元本額及び期中一部解約元本額

| | |
|-----------|----------------|
| 期首元本額 | 1,988,033,854円 |
| 期中追加設定元本額 | 5,670,756円 |
| 期中一部解約元本額 | 36,163,891円 |
- ・分配金の計算過程
 計算期間末に、経費控除後の配当等収益（7,982,346円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、収益調整金（155,383,829円）及び分配準備積立金（257,008,047円）を対象収益（420,374,222円）として、委託者が基準価額の水準、市況動向等を勘案した結果、配当等収益から5,872,622円（1万円当たり30円）を分配に充てることに決定しました。

第77期

- ・信託財産に係る期首元本額・期中追加設定元本額及び期中一部解約元本額

| | |
|-----------|----------------|
| 期首元本額 | 1,957,540,719円 |
| 期中追加設定元本額 | 7,983,785円 |
| 期中一部解約元本額 | 98,535,245円 |
- ・分配金の計算過程
 計算期間末に、経費控除後の配当等収益（7,497,046円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、収益調整金（149,218,321円）及び分配準備積立金（246,310,269円）を対象収益（403,025,636円）として、委託者が基準価額の水準、市況動向等を勘案した結果、配当等収益から5,600,967円（1万円当たり30円）を分配に充てることに決定しました。

第78期

- ・信託財産に係る期首元本額・期中追加設定元本額及び期中一部解約元本額

| | |
|-----------|----------------|
| 期首元本額 | 1,866,989,259円 |
| 期中追加設定元本額 | 4,900,495円 |
| 期中一部解約元本額 | 28,965,715円 |
- ・分配金の計算過程
 計算期間末に、経費控除後の配当等収益（7,728,578円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、収益調整金（147,941,668円）及び分配準備積立金（244,420,858円）を対象収益（400,091,104円）として、委託者が基準価額の水準、市況動向等を勘案した結果、配当等収益から5,528,772円（1万円当たり30円）を分配に充てることに決定しました。

第79期

- ・信託財産に係る期首元本額・期中追加設定元本額及び期中一部解約元本額

| | |
|-----------|----------------|
| 期首元本額 | 1,842,924,039円 |
| 期中追加設定元本額 | 6,074,948円 |
| 期中一部解約元本額 | 30,870,950円 |
- ・分配金の計算過程
 計算期間末に、経費控除後の配当等収益（8,081,082円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、収益調整金（146,757,201円）及び分配準備積立金（242,558,084円）を対象収益（397,396,367円）として、委託者が基準価額の水準、市況動向等を勘案した結果、配当等収益から5,454,384円（1万円当たり30円）を分配に充てることに決定しました。

マネープールマザーファンド：参考情報

当ファンド（アジア・ハイ・イールド債券ファンド（毎月分配型） 円ヘッジコース）が投資対象としている「マネープールマザーファンド」の計算期間と、当ファンドの計算期間とは異なります。本情報は、アジア・ハイ・イールド債券ファンド（毎月分配型） 円ヘッジコースの計算期間中におけるマザーファンドの状況を参考として掲載するものです。当該マザーファンドの直近決算の運用状況につきましては、後掲のマザーファンド運用報告書をご参照下さい。

■マネープールマザーファンドにおける主要な売買銘柄

○公社債

(2018年2月14日から2018年8月10日まで)

| 第 74 期 | | 第 79 期 | |
|-------------|---------|--------|-------|
| 買 付 | | 売 付 | |
| 銘 | 柄 金 額 | 銘 | 柄 金 額 |
| | 千円 | | 千円 |
| 7 東京三菱BK劣後 | 102,848 | | |
| 7 みずほコーポ劣後 | 102,269 | | |
| 1 森林総合研究所 | 100,734 | | |
| 17 大和証券G本社 | 100,409 | | |
| 1 日生2012基金 | 100,352 | — | — |
| 5 大日本住友製薬 | 100,190 | | |
| 27 富士電機 | 100,189 | | |
| 28 住友金属鉱山 | 100,179 | | |
| 41 鹿島建設 | 100,044 | | |
| 8 LIXILグループ | 100,001 | | |

(注1) 金額は受渡代金（経過利子分は含まれておりません）。

(注2) 単位未满是切捨て。

■組入資産の明細

下記は、マネープールマザーファンド（1,335,535千円）の内容です。

(1) 国内（邦貨建）公社債（種類別）

(2018年8月10日現在)

| 区 分 | 第 79 期 | | | | 末 | | |
|----------------------------|----------------------------|----------------------------|------------------|-----------------|-------------------|----------|------------------|
| | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 組 入 比 率 | うち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 | % | % | % | % | % |
| 特 殊 債 券 (除 く 金 融 債 券) | 100,000 (100,000) | 100,706 (100,706) | 7.5 (7.5) | — (—) | — (—) | — (—) | 7.5 (7.5) |
| 普 通 社 債 券 | 900,000 (900,000) | 905,626 (905,626) | 67.6 (67.6) | — (—) | — (—) | — (—) | 67.6 (67.6) |
| 合 計 | 1,000,000 (1,000,000) | 1,006,333 (1,006,333) | 75.1 (75.1) | — (—) | — (—) | — (—) | 75.1 (75.1) |

(注1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注2) 額面金額、評価額の単位未满是切捨て。

(注3) () 内は非上場債で内書き。

(注4) 当マザーファンドは、当期末において、株式及び新株予約権証券の組入れはありません。

(2) 国内（邦貨建）公社債（銘柄別）

（2018年8月10日現在）

| 区分 | 銘柄 | 年 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
|---------------------|-----------------|---------|-----------|------------|------------|
| | | % | 千円 | 千円 | |
| 特 殊 債 券 (除く金融債券) | 1 森林総合研究所 | 2.0000 | 100,000 | 100,706 | 2018/12/20 |
| 種 別 小 計 | 1銘柄 | — | 100,000 | 100,706 | — |
| 普 通 社 債 券 | 28 住友金属鉱山 | 0.7700 | 100,000 | 100,047 | 2018/08/31 |
| | 64 アコム | 0.8800 | 100,000 | 100,048 | 2018/09/05 |
| | 5 大日本住友製薬 | 0.8210 | 100,000 | 100,058 | 2018/09/07 |
| | 455 東京電力 | 2.0750 | 100,000 | 100,395 | 2018/10/23 |
| | 6 オリエントコーポレーション | 0.3000 | 100,000 | 100,051 | 2019/01/22 |
| | 7 みずほコーポ劣後 | 2.5000 | 100,000 | 102,003 | 2019/06/03 |
| | 17 大和証券G本社 | 0.3980 | 100,000 | 100,303 | 2019/08/28 |
| | 8 LIXILグループ | 0.0010 | 100,000 | 99,906 | 2019/08/30 |
| 7 東京三菱BK劣後 | 2.1100 | 100,000 | 102,811 | 2019/12/20 | |
| 種 別 小 計 | 9銘柄 | — | 900,000 | 905,626 | — |
| 合 計 | 10銘柄 | — | 1,000,000 | 1,006,333 | — |

(注) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

■分配金のお知らせ

| | 第74期 | 第75期 | 第76期 | 第77期 | 第78期 | 第79期 |
|----------------|------|------|------|------|------|------|
| 1万口当たり分配金（税引前） | 30円 | 30円 | 30円 | 30円 | 30円 | 30円 |

<分配金をお支払いする場合>

- ・分配金は、原則として各決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始しています。

<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ています。

<課税上の取扱いについて>

- ・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。
- ・分配金落ち後の基準価額が個別元本と同額の場合または個別元本を上回っている場合は、分配金の全額が普通分配金となります。
- ・分配金落ち後の基準価額が個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となります。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、収益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。
- ・個人の受益者に対する課税
 税率は普通分配金について、20.315%（所得税及び復興特別所得税15.315%、並びに地方税5%）です。

※上記は源泉徴収時の税率であり、税率は課税方法等により異なる場合があります。

※少額投資非課税制度「愛称：N I S A（ニーサ）」をご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が5年間非課税となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

※法人の受益者に対する課税は、税率が異なります。

※上記内容は、税法が改正された場合等には変更になることがあります。

※課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家または税務署等にご確認ください。

<参考情報>組入れ投資信託証券の内容

■主要投資対象の投資信託証券の概要

| | |
|----------|---|
| 名称 | ■日興 アジア・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（クラス1） （Nikko AM Asia Limited Investment Series-Nikko AMアジア・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（クラス1）） |
| 形態 | ケイマン籍外国投資信託（円建て） |
| 運用の基本方針 | ①主として、アジア地域の米ドル建てのハイ・イールド債券等に投資します。 ②原則として米ドル等を日本円で為替ヘッジを行います。 |
| 主な投資制限 | ①有価証券の空売りは行いません。 ②純資産総額の10%を超える借入れを行いません。 ③投資信託証券への投資は行いません。 |
| 決算日 | 毎年12月31日 |
| 信託報酬等 | 純資産総額に対して年率0.77% ※年間最低報酬額等がかかる場合は、純資産総額等により年率換算で上記の信託報酬率を上回ることがあります。 ※上記のほか、投資信託証券の設立・開示に関する費用等（監査費用、弁護士費用等）、管理報酬、売買委託手数料、外国における資産の保管等に要する費用、信託財産に関する租税等がかかります。 |
| 申込・解約手数料 | ありません。 |
| 投資顧問会社 | 日興アセットマネジメント アジア リミテッド |

※当ファンドが主要投資対象とする投資信託証券の名称及びその運用会社の名称等は今後変更となる場合があります。

■包括利益計算書

(2017年1月1日から2017年12月31日まで)
アメリカドル

| | |
|---------------------------------------|--------------------|
| 収益 | |
| 純損益を通じて公正価値で測定される金融資産・負債に係る純利益／損失 (△) | 38,331,806 |
| 為替差損益 | △ 75,097 |
| その他収益 | — |
| 収益合計 | 38,256,709 |
| 費用 | |
| 支払利息 | △ 276 |
| 投資運用報酬 | △ 2,163,184 |
| 投資運用報酬 払戻料 | 161,362 |
| 管理報酬 | △ 126,420 |
| 監査報酬 | △ 46,872 |
| 保管報酬 | △ 50,477 |
| 名義書換費用 | △ 17,628 |
| 取引費用 | △ 8,273 |
| 受託者報酬 | △ 28,093 |
| その他営業費用 | △ 84,739 |
| 営業費用合計 | △ 2,364,600 |
| 税引前・分配前利益 (損失) | 35,892,109 |
| 税金 | — |
| 税引後・分配前利益 (損失) | 35,892,109 |
| 分配金 | △ 43,658,222 |
| 税引後・分配後利益 (損失) | △ 7,766,113 |
| 営業活動による償還可能受益証券の保有者に帰属する純資産の減少 | △ 7,766,113 |

主要投資対象のひとつである投資信託証券「Nikko AM Asia Limited Investment Series Nikko AM アジア・ハイ・イールド・ボンド・ファンド」の財務諸表を委託会社にて翻訳したものです。

■組入上位銘柄

(2017年12月31日現在)

| 銘柄名 | 国・地域 | クーポン | 償還日 | 純資産構成比 |
|---|---------|---------|------------|--------|
| Kwg Property Holding Limited 8.975% 14-jan-2019 | 中国 | 8.975% | 2019/01/14 | 2.5% |
| Huachen Energy Co. Ltd. 6.625% 18-may-2020 | 中国 | 6.625% | 2020/05/18 | 2.3% |
| Shui On Development (holding) Ltd. 9.625% 10-jun-2019 | 中国 | 9.625% | 2019/06/10 | 2.3% |
| China Scie Property Holdings Ltd. 10.0% 02-jul-2020 | 中国 | 10.000% | 2020/07/02 | 2.2% |
| Macquarie Bank Limited 6.125% Perp | オーストラリア | 6.125% | 永久債 | 2.1% |
| Chong Hing Bank Limited 6.5% Perp | 中国 | 6.500% | 永久債 | 2.1% |
| Golden Legacy Pte Ltd. 8.25% 07-jun-2021 | インドネシア | 8.250% | 2021/06/07 | 2.1% |
| Pb International Bv 7.625% 26-jan-2022 | インドネシア | 7.625% | 2022/01/26 | 2.0% |
| China Evergrande Group 8.75% 28-jun-2025 | 中国 | 8.750% | 2025/06/28 | 2.0% |
| Country Garden Holdings Co. Ltd. 7.25% 04-apr-2021 | 中国 | 7.250% | 2021/04/04 | 1.9% |

「日興 アジア・ハイ・イールド・ボンド・ファンド」の運用会社である日興アセットマネジメント アジア リミテッドが作成したデータを、委託会社にて翻訳したものです。

マネープールマザーファンド

運用報告書

第7期（決算日 2018年8月10日）

<計算期間 2017年8月11日～2018年8月10日>

マネープールマザーファンド第7期の運用状況をご報告申し上げます。

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | |
|--------|--|
| 信託期間 | 無期限 |
| 運用方針 | 安定した収益の確保を目指して運用を行います。 |
| 主要投資対象 | わが国の公社債等 |
| 主な組入制限 | 株式への投資は、転換社債の転換及び転換社債型新株予約権付社債の新株予約権の行使により取得した株券に限り、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 外貨建資産への投資は行いません。 |

■設定以来の運用実績

| 決 算 期 | 基 準 | 価 額 | | 債 組 入 比 | 券 率 | 純 資 産 額 |
|-----------------------|-------------|-------|--------|---------|--------|-----------|
| | | 期 騰 落 | 中 率 | | | |
| (設 定 日) 2011年9月30日 | 円 10,000 | | % — | | % — | 百万円 11 |
| 1期(2012年8月10日) | 10,006 | | 0.1 | | 73.6 | 299 |
| 2期(2013年8月12日) | 10,013 | | 0.1 | | 98.8 | 1,123 |
| 3期(2014年8月11日) | 10,019 | | 0.1 | | 94.6 | 2,008 |
| 4期(2015年8月10日) | 10,024 | | 0.0 | | 93.8 | 2,134 |
| 5期(2016年8月10日) | 10,027 | | 0.0 | | 84.1 | 1,549 |
| 6期(2017年8月10日) | 10,030 | | 0.0 | | 85.2 | 1,412 |
| 7期(2018年8月10日) | 10,032 | | 0.0 | | 75.1 | 1,339 |

(注1) 基準価額は1万円当たり（以下同じ）。

(注2) 当ファンドは、わが国の公社債等に投資を行い、安定した収益の確保を目指しますが、当ファンドのコンセプトに適った指数等が存在しないため、ベンチマーク及び参考指数は記載しておりません。

■当期中の基準価額と市況等の推移

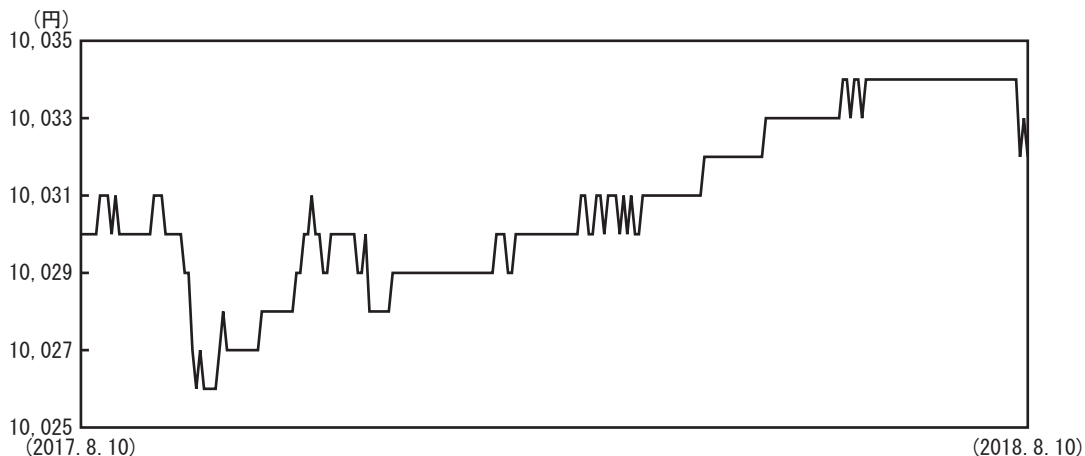
| 年 月 日 | 基 準 | 価 額 | | 債 券 組 入 比 率 |
|----------------------|--------|-----|------|-------------|
| | | 騰 | 落 率 | |
| (期 首) 2017年 8月10日 | 円 | | % | % |
| | 10,030 | | — | 85.2 |
| 8月末 | 10,030 | | 0.0 | 85.9 |
| 9月末 | 10,026 | | △0.0 | 78.9 |
| 10月末 | 10,028 | | △0.0 | 85.8 |
| 11月末 | 10,028 | | △0.0 | 85.7 |
| 12月末 | 10,029 | | △0.0 | 87.3 |
| 2018年 1月末 | 10,030 | | 0.0 | 72.5 |
| 2月末 | 10,031 | | 0.0 | 87.1 |
| 3月末 | 10,031 | | 0.0 | 81.0 |
| 4月末 | 10,032 | | 0.0 | 81.0 |
| 5月末 | 10,033 | | 0.0 | 73.6 |
| 6月末 | 10,034 | | 0.0 | 67.1 |
| 7月末 | 10,034 | | 0.0 | 67.4 |
| (期 末) 2018年 8月10日 | 10,032 | | 0.0 | 75.1 |

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) 当ファンドは、わが国の公社債等に投資を行い、安定した収益の確保を目指しますが、当ファンドのコンセプトに適った指数等が存在しないため、ベンチマーク及び参考指数は記載していません。

運用経過

■ 基準価額の推移



期首 : 10,030円
 期末 : 10,032円
 騰落率 : 0.0%

■ 基準価額の主な変動要因

保有するプラス利回りの短期社債の金利収入を主要因として、基準価額は小幅ながらプラスとなりました。

■投資環境

日銀によるマイナス金利政策のもと、短期の国債利回りは期を通じてマイナス圏内で推移しました。一方、格付がA格相当の短期社債利回りは、小幅プラスの水準で推移しました。

■当該投資信託のポートフォリオ

安全性、流動性が高く、利回りがプラスの短期社債を中心に運用することで、ポートフォリオ全体の利回りをわずかながらもプラスに維持しました。

■当該投資信託のベンチマークとの差異

当ファンドは、わが国の公社債等に投資を行い、安定した収益の確保を目指しますが、当ファンドのコンセプトに適った指数等が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は記載しておりません。

■今後の運用方針

安全性、流動性が高く、残存期間の短い公社債を中心に運用を行う方針です。

■ 1万口当たりの費用明細

(2017年8月11日から2018年8月10日まで)

| 項 目 | |
|----------------------|-----------|
| そ の 他 費 用 (そ の 他) | 0円 (0) |
| 合 計 | 0 |

(注) 1万口当たりの費用明細は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。なお、費用項目については9ページ(1万口当たりの費用明細の項目の概要)をご参照ください。

■ 売買及び取引の状況

○ 公社債

(2017年8月11日から2018年8月10日まで)

| | | 買 付 額 | 売 付 額 |
|--------|---------|-----------|-------------|
| | | 千円 | 千円 |
| 国 内 | 特 殊 債 券 | 100,734 | (-) |
| | 社 債 券 | 1,612,294 | (1,900,000) |

(注1) 金額は受渡代金(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) () 内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

(注4) 単位未満は切捨て。

■ 主要な売買銘柄

○ 公社債

(2017年8月11日から2018年8月10日まで)

| 買 付 | | 売 付 | |
|---------------|---------|-----|-----|
| 銘 柄 | 金 額 | 銘 柄 | 金 額 |
| | | 千円 | |
| 7 東京三菱BK劣後 | 102,848 | | |
| 7 みずほコーポ劣後 | 102,269 | | |
| 455 東京電力 | 101,416 | | |
| 43 ソフトバンクグループ | 101,128 | | |
| 5-1 住友生命第5 | 101,005 | | |
| 64 アコム | 100,773 | - | - |
| 1 森林総合研究所 | 100,734 | | |
| 1 明治安田2013基 | 100,694 | | |
| 263 北海道電力 | 100,611 | | |
| 17 大和証券G本社 | 100,409 | | |

(注1) 金額は受渡代金(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) 単位未満は切捨て。

■ 利害関係人との取引状況 (2017年8月11日から2018年8月10日まで)

当ファンドにおける当期中の利害関係人との取引はございません。

■組入資産の明細

下記はマナープールのマザーファンド（1,335,535千円）の内容です。

(1) 国内（邦貨建）公社債（種類別）

(2018年8月10日現在)

| 区 分 | 当 期 | | | 末 | | | |
|---------------------|--------------------------|--------------------------|----------------|------------------|-------------------|----------|----------------|
| | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 組 入 比 率 | うちB/B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 | % | % | % | % | % |
| 特 殊 債 券 (除く金融債券) | 100,000 (100,000) | 100,706 (100,706) | 7.5 (7.5) | — (—) | — (—) | — (—) | 7.5 (7.5) |
| 普 通 社 債 券 | 900,000 (900,000) | 905,626 (905,626) | 67.6 (67.6) | — (—) | — (—) | — (—) | 67.6 (67.6) |
| 合 計 | 1,000,000 (1,000,000) | 1,006,333 (1,006,333) | 75.1 (75.1) | — (—) | — (—) | — (—) | 75.1 (75.1) |

(注1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

(注3) () 内は非上場債で内書き。

(注4) 当マザーファンドは、当期末において、株式及び新株予約権証券の組入れはありません。

(2) 国内（邦貨建）公社債（銘柄別）

(2018年8月10日現在)

| 区 分 | 銘 柄 | 年 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
|---------------------|------------------|--------|-----------|-----------|------------|
| 特 殊 債 券 (除く金融債券) | 1 森林総合研究所 | % | 千円 | 千円 | |
| | | 2.0000 | 100,000 | 100,706 | 2018/12/20 |
| 種 別 小 計 | 1銘柄 | — | 100,000 | 100,706 | — |
| 普 通 社 債 券 | 28 住友金属鉱山 | 0.7700 | 100,000 | 100,047 | 2018/08/31 |
| | 64 アコム | 0.8800 | 100,000 | 100,048 | 2018/09/05 |
| | 5 大日本住友製薬 | 0.8210 | 100,000 | 100,058 | 2018/09/07 |
| | 455 東京電力 | 2.0750 | 100,000 | 100,395 | 2018/10/23 |
| | 6 オリエンントコーポレーション | 0.3000 | 100,000 | 100,051 | 2019/01/22 |
| | 7 みずほコーポ劣後 | 2.5000 | 100,000 | 102,003 | 2019/06/03 |
| | 17 大和証券G本社 | 0.3980 | 100,000 | 100,303 | 2019/08/28 |
| | 8 LIXILグループ | 0.0010 | 100,000 | 99,906 | 2019/08/30 |
| | 7 東京三菱BK劣後 | 2.1100 | 100,000 | 102,811 | 2019/12/20 |
| 種 別 小 計 | 9銘柄 | — | 900,000 | 905,626 | — |
| 合 計 | 10銘柄 | — | 1,000,000 | 1,006,333 | — |

(注) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

(2018年8月10日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|-------------------------|-----------------|--------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 公 社 債 | 1,006,333 千円 | 61.2 % |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 636,782 | 38.8 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 1,643,115 | 100.0 |

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2018年8月10日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-------------------|----------------|
| a 資産 | 1,643,115,688円 |
| コール・ローン等 | 634,328,911 |
| 公社債(評価額) | 1,006,333,200 |
| 未収利息 | 1,531,886 |
| 前払費用 | 921,691 |
| b 負債 | 303,260,571 |
| 未払金 | 303,258,000 |
| その他未払費用 | 2,571 |
| c 純資産総額(a - b) | 1,339,855,117 |
| 元本 | 1,335,535,026 |
| 次期繰越損益金 | 4,320,091 |
| d 受益権総口数 | 1,335,535,026口 |
| 1万口当たり基準価額(c / d) | 10,032円 |

(注1) 信託財産に係る期首元本額1,407,888,487円、期中追加設定元本額15,595,993円、期中一部解約元本額87,949,454円

(注2) 期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託ごとの元本の内訳

| | |
|----------------------------------|----------------|
| りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンドアジア通貨コース | 130,866,563円 |
| りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド高金利通貨コース | 58,511,152円 |
| りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンドブラジルリアルコース | 90,134,508円 |
| りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド日本円コース | 3,244,277円 |
| アジアハイイールド債券ファンド(毎月分配型)為替ヘッジなしコース | 6,047,794円 |
| アジア・ハイ・イールド債券ファンド(毎月分配型)円ヘッジコース | 14,759,575円 |
| 日米4資産スマートバランス | 1,024,156,932円 |
| りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド米ドルコース | 2,856,955円 |
| 日米4資産スマートバランス(DC年金) | 4,957,270円 |

(注3) 期末における1口当たりの純資産総額 1.0032円

■お知らせ

○信用リスク集中回避のための投資制限に関する記載を追加するため、投資信託約款に所要の変更を行いました(2017年10月2日)。

○公告の方法を「日本経済新聞に掲載」から「電子公告」へ変更するため、投資信託約款に所要の変更を行いました(2018年1月15日)。

■損益の状況

(2017年8月11日から2018年8月10日まで)

| 項 目 | 当 期 |
|---------------------|-------------|
| a 配当等収益 | 10,751,764円 |
| 受取利息 | 10,975,273 |
| 支払利息 | △ 223,509 |
| b 有価証券売買損益 | △10,394,200 |
| 売買損 | △10,394,200 |
| c 信託報酬等 | △ 47,078 |
| d 当期損益金(a + b + c) | 310,486 |
| e 前期繰越損益金 | 4,236,144 |
| f 解約差損益金 | △ 270,546 |
| g 追加信託差損益金 | 44,007 |
| h 合計(d + e + f + g) | 4,320,091 |
| 次期繰越損益金(h) | 4,320,091 |

(注1) 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) 信託報酬等には、消費税相当額を含めて表示しております。

(注3) 解約差損益金とは、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4) 追加信託差損益金とは、信託の追加設定の際、追加設定した価額から元本を差し引いた差額分をいいます。