

運用報告書（全体版）

■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 | 2011年9月30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対円で為替ヘッジを行います。 | |
| 主要投資対象 | りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド 日本円コース | 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 |
| | ライオンアジア・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（クラス1） | |
| | 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 | りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド 日本円コース | 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。 |
| | ライオンアジア・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（クラス1） | |
| | 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。 | |

りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド 日本円コース

第89期（決算日 2019年3月11日）
 第90期（決算日 2019年4月10日）
 第91期（決算日 2019年5月10日）
 第92期（決算日 2019年6月10日）
 第93期（決算日 2019年7月10日）
 第94期（決算日 2019年8月13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、「りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド 日本円コース」は、このたび第94期の決算を行いましたので、第89期～第94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



<https://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）

※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。

○最近30期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 (分配落) | 標準価額 | | | 債組入比 | 債券率 | 投資信託 組入比 | 純資産 総額 |
|------------------|---------------|------|----|-----------|------|-----|-------------|-----------|
| | | 税金 | 込配 | み金 期騰落 | | | | |
| | 円 | | 円 | | % | % | 百万円 | |
| 65期(2017年3月10日) | 8,187 | | 40 | | 0.0 | 0.7 | 96.0 | 726 |
| 66期(2017年4月10日) | 8,203 | | 40 | | 0.7 | 0.7 | 97.0 | 719 |
| 67期(2017年5月10日) | 8,187 | | 40 | | 0.3 | 0.9 | 96.2 | 705 |
| 68期(2017年6月12日) | 8,113 | | 40 | △0.4 | | 1.0 | 95.9 | 591 |
| 69期(2017年7月10日) | 8,056 | | 40 | △0.2 | | 1.0 | 96.8 | 580 |
| 70期(2017年8月10日) | 8,061 | | 40 | 0.6 | | 1.1 | 95.3 | 588 |
| 71期(2017年9月11日) | 8,070 | | 40 | 0.6 | | 0.9 | 95.3 | 600 |
| 72期(2017年10月10日) | 8,056 | | 40 | 0.3 | | 0.9 | 95.7 | 539 |
| 73期(2017年11月10日) | 8,054 | | 40 | 0.5 | | 1.0 | 96.0 | 525 |
| 74期(2017年12月11日) | 7,980 | | 40 | △0.4 | | 0.9 | 95.7 | 508 |
| 75期(2018年1月10日) | 7,958 | | 40 | 0.2 | | 0.9 | 96.3 | 492 |
| 76期(2018年2月13日) | 7,835 | | 40 | △1.0 | | 1.0 | 96.8 | 458 |
| 77期(2018年3月12日) | 7,791 | | 40 | △0.1 | | 1.0 | 97.0 | 454 |
| 78期(2018年4月10日) | 7,719 | | 30 | △0.5 | | 1.0 | 96.8 | 431 |
| 79期(2018年5月10日) | 7,537 | | 30 | △2.0 | | 1.0 | 96.4 | 413 |
| 80期(2018年6月11日) | 7,449 | | 30 | △0.8 | | 1.1 | 95.6 | 390 |
| 81期(2018年7月10日) | 7,206 | | 30 | △2.9 | | 1.1 | 97.4 | 370 |
| 82期(2018年8月10日) | 7,292 | | 30 | 1.6 | | 0.7 | 96.1 | 365 |
| 83期(2018年9月10日) | 7,234 | | 30 | △0.4 | | 0.5 | 95.9 | 362 |
| 84期(2018年10月10日) | 7,232 | | 30 | 0.4 | | 0.6 | 96.8 | 358 |
| 85期(2018年11月12日) | 7,135 | | 30 | △0.9 | | 0.7 | 96.8 | 352 |
| 86期(2018年12月10日) | 7,114 | | 30 | 0.1 | | — | 96.9 | 350 |
| 87期(2019年1月10日) | 7,121 | | 30 | 0.5 | | — | 96.0 | 345 |
| 88期(2019年2月12日) | 7,209 | | 30 | 1.7 | | — | 96.4 | 347 |
| 89期(2019年3月11日) | 7,249 | | 30 | 1.0 | | — | 97.2 | 337 |
| 90期(2019年4月10日) | 7,292 | | 30 | 1.0 | | — | 97.9 | 324 |
| 91期(2019年5月10日) | 7,292 | | 30 | 0.4 | | — | 97.1 | 320 |
| 92期(2019年6月10日) | 7,241 | | 30 | △0.3 | | — | 95.0 | 304 |
| 93期(2019年7月10日) | 7,244 | | 30 | 0.5 | | — | 97.1 | 302 |
| 94期(2019年8月13日) | 7,129 | | 30 | △1.2 | | — | 97.4 | 296 |

(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)」および「ライオン 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)」および「ライオン 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。

○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 | 騰 落 率 | | 債 組 入 比 | 券 率 | 投 資 信 託 組 入 比 | 証 券 率 |
|-------|---------------------|------------|--------|--|---------|-----|---------------|-------|
| | | | | | | | | |
| 第89期 | (期 首) 2019年2月12日 | 円 7,209 | % — | | % — | | % 96.4 | |
| | 2月末 | 7,245 | 0.5 | | — | | 98.3 | |
| | (期 末) 2019年3月11日 | 7,279 | 1.0 | | — | | 97.2 | |
| 第90期 | (期 首) 2019年3月11日 | 7,249 | — | | — | | 97.2 | |
| | 3月末 | 7,333 | 1.2 | | — | | 96.2 | |
| | (期 末) 2019年4月10日 | 7,322 | 1.0 | | — | | 97.9 | |
| 第91期 | (期 首) 2019年4月10日 | 7,292 | — | | — | | 97.9 | |
| | 4月末 | 7,315 | 0.3 | | — | | 96.4 | |
| | (期 末) 2019年5月10日 | 7,322 | 0.4 | | — | | 97.1 | |
| 第92期 | (期 首) 2019年5月10日 | 7,292 | — | | — | | 97.1 | |
| | 5月末 | 7,280 | △0.2 | | — | | 96.0 | |
| | (期 末) 2019年6月10日 | 7,271 | △0.3 | | — | | 95.0 | |
| 第93期 | (期 首) 2019年6月10日 | 7,241 | — | | — | | 95.0 | |
| | 6月末 | 7,248 | 0.1 | | — | | 95.9 | |
| | (期 末) 2019年7月10日 | 7,274 | 0.5 | | — | | 97.1 | |
| 第94期 | (期 首) 2019年7月10日 | 7,244 | — | | — | | 97.1 | |
| | 7月末 | 7,207 | △0.5 | | — | | 97.4 | |
| | (期 末) 2019年8月13日 | 7,159 | △1.2 | | — | | 97.4 | |

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

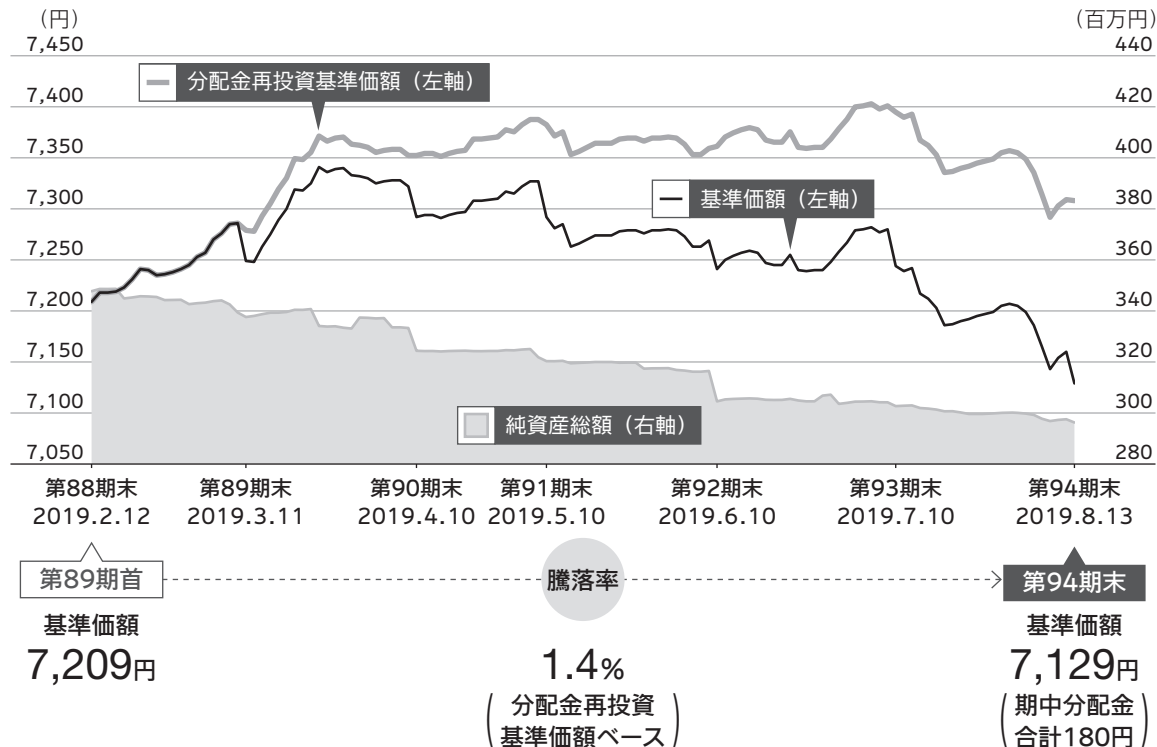
(注2) 債券組入比率はマネーパルマザーファンドへの投資割合に応じて算出された当ファンドベースの組入比率。

(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)」および「ライオン 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)」および「ライオン 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、2019年2月12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）」および「ライオン 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

りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド 日本円コース

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)」および「ライオン アジア・ハイ・イールド・ボンド・ファンド (クラス1)」は、債券部分がプラスに寄与し、分配金再投資基準価額の騰落率はプラスとなりました。

● 本報告書では、ベビーファンド、マザーファンド及びファンド・オブ・ファンズ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

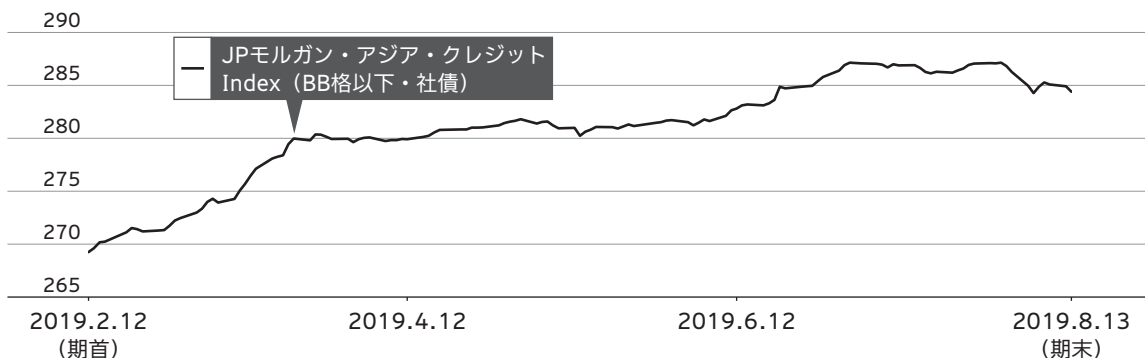
● 投資環境

当期のアジア・ハイ・イールド債券市場は上昇しました。

期初から2019年3月下旬にかけては、米国での利上げ観測の後退や、グローバルな景気鈍化への懸念から米国利回りが低下したことなどから、アジア・ハイ・イールド債券市場は上昇しました。

その後は、米国や欧州で金融緩和への期待が高まったことに加えて、米中通商協議進展への期待などからクレジットスプレッドが縮小基調で推移し堅調な推移となりました。

市況の推移



(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）」および「ライオンアジア・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低下（価格は上昇）したことに加えて、クーポン収入等が貢献し、債券部分はプラスに寄与しました。

ライオン 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低下（価格は上昇）したことに加えて、クーポン収入等が貢献し、債券部分はプラスに寄与しました。

マネープールマザーファンド

コール等の短期金融資産による運用を行っております。

● 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）」および「ライオンアジア・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89期 | 第90期 | 第91期 | 第92期 | 第93期 | 第94期 |
|-----------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
| | 2019.2.13 } 2019.3.11 | 2019.3.12 } 2019.4.10 | 2019.4.11 } 2019.5.10 | 2019.5.11 } 2019.6.10 | 2019.6.11 } 2019.7.10 | 2019.7.11 } 2019.8.13 |
| 当期分配金 | 30 | 30 | 30 | 30 | 30 | 30 |
| (対基準価額比率) | 0.412% | 0.410% | 0.410% | 0.413% | 0.412% | 0.419% |
| 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 | 3,170 | 3,186 | 3,200 | 3,214 | 3,228 | 3,242 |

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、為替取引によるプレミアム（金利差相当分の収益）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

りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド 日本円コース

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）」および「ライオン 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）

米中通商協議を巡る不透明感は依然として金融市場の重石となっていますが、FRB（米連邦準備理事会）など主要国の中央銀行は金融政策についてハト派的なスタンスを強めておりアジア・ハイ・イールド債券市場のサポート要因になると考えます。中国では政府による積極的な景気下支えは継続される見込みです。総じて、アジア各国の経済基盤は引き続き堅調であり、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います。

ライオン アジア・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（クラス1）

米中通商協議の先行きについては引き続き不透明な状況が続いており、当面はクレジットスプレッドの縮小が見込みづらい環境が続くと考えます。一方で、FRBやECB（欧州中央銀行）など中央銀行の金融緩和スタンスが強まっており、アジア・ハイ・イールド債券市場にとってはポジティブな材料です。

マネープールマザーファンド

安全性、流動性の高いコール等の短期金融資産による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 **0.496%** です。

| 項目 | 第89期～第94期 2019.2.13～2019.8.13 | | 項目の概要 |
|-----------|----------------------------------|--------------|--|
| | 金額 | 比率 | |
| (a) 信託報酬 | 36円 | 0.495% | (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7,271円です。 |
| （投信会社） | (15) | (0.210) | ファンドの運用の対価 |
| （販売会社） | (20) | (0.269) | 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) | (0.016) | 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 | 36 | 0.496 | |

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

(2019年2月13日～2019年8月13日)

投資信託証券

| 銘 柄 | | 第89期～第94期 | | | |
|--------|--|-----------|---------|--------------|--------------|
| | | 買 付 | | 売 付 | |
| | | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| 国 内 | NikkoAM Asia Investment Series-NikkoAM AsiaHighYieldBondFund I | 口 — | 千円 — | 口 108,361 | 千円 45,000 |
| | Lion Global Investors Asian High Yield Bond Fund Class 1 (JPY) | 8,182 | 5,000 | — | — |
| | 合 計 | 8,182 | 5,000 | 108,361 | 45,000 |

(注1) 金額は受渡代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2019年2月13日～2019年8月13日)

該当事項はございません。

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

(2019年8月13日現在)

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

| 銘 柄 | | 第88期末 | | 第94期末 | |
|--------|--|--------------|--------------|---------------|-----------|
| | | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | 比 率 |
| 国 内 | NikkoAM Asia Investment Series-NikkoAM AsiaHighYieldBondFund I | 口 597,777 | 口 489,416 | 千円 196,308 | % 66.3 |
| | Lion Global Investors Asian High Yield Bond Fund Class 1 (JPY) | 145,537 | 153,719 | 92,118 | 31.1 |
| | 合 計 | 743,314 | 643,135 | 288,426 | 97.4 |

(注) 単位未満は切捨て。

親投資信託残高

| 銘 柄 | | 第88期末 | | 第94期末 | |
|---------------|--|-------------|-------------|-------------|-------------|
| | | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | 評 価 額 |
| マネーパールマザーファンド | | 千口 3,244 | 千口 3,244 | 千円 3,253 | 千円 3,253 |

(注1) 単位未満は切捨て。

(注2) 当ファンドは、第94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

(2019年8月13日現在)

| 項 目 | 第94期末 | |
|---------------|---------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 投資信託受益証券 | 千円 288,426 | % 96.7 |
| マネーパールマザーファンド | 3,253 | 1.1 |
| コール・ローン等、その他 | 6,737 | 2.2 |
| 投資信託財産総額 | 298,416 | 100.0 |

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

| 項 目 | 第89期末 | 第90期末 | 第91期末 | 第92期末 | 第93期末 | 第94期末 |
|--------------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|
| | 2019年3月11日現在 | 2019年4月10日現在 | 2019年5月10日現在 | 2019年6月10日現在 | 2019年7月10日現在 | 2019年8月13日現在 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 |
| (A) 資産 | 344,510,458 | 337,208,941 | 325,116,956 | 316,772,042 | 304,521,586 | 298,416,579 |
| コール・ローン等 | 12,960,735 | 16,251,376 | 10,794,530 | 11,274,353 | 7,470,452 | 6,736,620 |
| 投資信託受益証券(評価額) | 328,294,740 | 317,702,907 | 311,068,092 | 289,243,680 | 293,797,449 | 288,426,599 |
| マネーパールマザーファンド(評価額) | 3,254,983 | 3,254,658 | 3,254,334 | 3,254,009 | 3,253,685 | 3,253,360 |
| 未収入金 | — | — | — | 13,000,000 | — | — |
| (B) 負債 | 6,888,906 | 12,821,919 | 4,796,212 | 12,213,799 | 1,821,974 | 2,143,543 |
| 未払収益分配金 | 1,397,275 | 1,334,486 | 1,317,890 | 1,261,798 | 1,253,512 | 1,246,739 |
| 未払解約金 | 5,237,678 | 11,212,142 | 3,213,155 | 10,682,936 | 319,330 | 619,180 |
| 未払信託報酬 | 253,304 | 274,343 | 264,165 | 268,192 | 248,582 | 277,018 |
| 未払利息 | 20 | 44 | 31 | 30 | 21 | 17 |
| その他未払費用 | 629 | 904 | 971 | 843 | 529 | 589 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 337,621,552 | 324,387,022 | 320,320,744 | 304,558,243 | 302,699,612 | 296,273,036 |
| 元本 | 465,758,398 | 444,828,901 | 439,296,911 | 420,599,353 | 417,837,657 | 415,579,860 |
| 次期繰越損益金 | △128,136,846 | △120,441,879 | △118,976,167 | △116,041,110 | △115,138,045 | △119,306,824 |
| (D) 受益権総口数 | 465,758,398口 | 444,828,901口 | 439,296,911口 | 420,599,353口 | 417,837,657口 | 415,579,860口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 7,249円 | 7,292円 | 7,292円 | 7,241円 | 7,244円 | 7,129円 |

(注1) 当作成期間(第89期~94期)における期首元本額482,363,380円、期中追加設定元本額12,591,642円、期中一部解約元本額79,375,162円

(注2) 期末における1口当たりの純資産総額

第89期0.7249円、第90期0.7292円、第91期0.7292円、第92期0.7241円、第93期0.7244円、第94期0.7129円

(注3) 期末における元本の欠損金額

第89期128,136,846円、第90期120,441,879円、第91期118,976,167円、第92期116,041,110円、第93期115,138,045円、第94期119,306,824円

○損益の状況

| 項 目 | 第89期 | 第90期 | 第91期 | 第92期 | 第93期 | 第94期 |
|------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|
| | 2019年2月13日～ 2019年3月11日 | 2019年3月12日～ 2019年4月10日 | 2019年4月11日～ 2019年5月10日 | 2019年5月11日～ 2019年6月10日 | 2019年6月11日～ 2019年7月10日 | 2019年7月11日～ 2019年8月13日 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 |
| (A) 配当等収益 | 2,297,616 | 2,187,044 | 2,169,225 | 2,081,626 | 2,080,150 | 2,082,598 |
| 受取配当金 | 2,298,122 | 2,187,585 | 2,169,742 | 2,082,229 | 2,081,209 | 2,083,124 |
| 支払利息 | △ 506 | △ 541 | △ 517 | △ 603 | △ 1,059 | △ 526 |
| (B) 有価証券売買損益 | 1,172,302 | 1,256,188 | △ 631,486 | △ 2,720,338 | △ 449,831 | △ 5,355,305 |
| 売買益 | 1,221,209 | 1,405,046 | 5,849 | 101,700 | 1,107,936 | 14,897 |
| 売買損 | △ 48,907 | △ 148,858 | △ 637,335 | △ 2,822,038 | △ 1,557,767 | △ 5,370,202 |
| (C) 信託報酬等 | △ 253,933 | △ 275,247 | △ 265,043 | △ 268,760 | △ 249,111 | △ 277,607 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 3,215,985 | 3,167,985 | 1,272,696 | △ 907,472 | 1,381,208 | △ 3,550,314 |
| (E) 前期繰越損益金 | △102,910,930 | △ 95,119,867 | △ 91,984,497 | △ 87,950,983 | △ 88,748,569 | △ 88,020,247 |
| (F) 追加信託差損益金 | △ 27,044,626 | △ 27,155,511 | △ 26,946,476 | △ 25,920,857 | △ 26,517,172 | △ 26,489,524 |
| (配当等相当額) | (100,157,179) | (96,302,481) | (95,167,470) | (91,176,940) | (90,952,584) | (90,518,447) |
| (売買損益相当額) | (△127,201,805) | (△123,457,992) | (△122,113,946) | (△117,097,797) | (△117,469,756) | (△117,007,971) |
| (G) 計(D+E+F) | △126,739,571 | △119,107,393 | △117,658,277 | △114,779,312 | △113,884,533 | △118,060,085 |
| (H) 収益分配金 | △ 1,397,275 | △ 1,334,486 | △ 1,317,890 | △ 1,261,798 | △ 1,253,512 | △ 1,246,739 |
| 次期繰越損益金(G+H) | △128,136,846 | △120,441,879 | △118,976,167 | △116,041,110 | △115,138,045 | △119,306,824 |
| 追加信託差損益金 | △ 27,044,626 | △ 27,155,511 | △ 26,946,476 | △ 25,920,857 | △ 26,517,172 | △ 26,489,524 |
| (配当等相当額) | (100,157,179) | (96,302,480) | (95,167,470) | (91,176,940) | (90,952,583) | (90,518,447) |
| (売買損益相当額) | (△127,201,805) | (△123,457,991) | (△122,113,946) | (△117,097,797) | (△117,469,755) | (△117,007,971) |
| 分配準備積立金 | 47,494,410 | 45,446,959 | 45,418,230 | 44,016,785 | 43,944,704 | 44,214,037 |
| 繰越損益金 | △148,586,630 | △138,733,327 | △137,447,921 | △134,137,038 | △132,565,577 | △137,031,337 |

(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4) 分配金の計算過程(2019年2月13日～2019年8月13日)は以下の通りです。

| 項 目 | 2019年2月13日～ 2019年3月11日 | 2019年3月12日～ 2019年4月10日 | 2019年4月11日～ 2019年5月10日 | 2019年5月11日～ 2019年6月10日 | 2019年6月11日～ 2019年7月10日 | 2019年7月11日～ 2019年8月13日 |
|---------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|
| a. 配当等収益(費用控除後) | 2,129,290円 | 2,012,074円 | 1,904,016円 | 1,812,598円 | 1,830,768円 | 1,804,693円 |
| b. 有価証券等損益額(費用控除後) | 0円 | 0円 | 0円 | 0円 | 0円 | 0円 |
| c. 信託約款に規定する収益調整金 | 100,157,179円 | 96,302,480円 | 95,167,470円 | 91,176,940円 | 90,952,583円 | 90,518,447円 |
| d. 信託約款に規定する分配準備積立金 | 46,762,395円 | 44,769,371円 | 44,832,104円 | 43,465,985円 | 43,367,448円 | 43,656,083円 |
| e. 分配対象収益(a+b+c+d) | 149,048,864円 | 143,083,925円 | 141,903,590円 | 136,455,523円 | 136,150,799円 | 135,979,223円 |
| f. 分配対象収益(1万口当たり) | 3,200円 | 3,216円 | 3,230円 | 3,244円 | 3,258円 | 3,272円 |
| g. 分配金 | 1,397,275円 | 1,334,486円 | 1,317,890円 | 1,261,798円 | 1,253,512円 | 1,246,739円 |
| h. 分配金(1万口当たり) | 30円 | 30円 | 30円 | 30円 | 30円 | 30円 |

○分配金のお知らせ

| | 第89期 | 第90期 | 第91期 | 第92期 | 第93期 | 第94期 |
|-----------------|------|------|------|------|------|------|
| 1 万口当たり分配金（税込み） | 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：NISA（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 (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

(2018年1月1日から2018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 (△) | △20,693,532 |
| 為替差損益 | △ 24,349 |
| その他収益 | — |
| 収益合計 | △20,717,881 |
| 費用 | |
| 支払利息 | △ 7,782 |
| 投資運用報酬 | △ 1,577,421 |
| 投資運用報酬 払戻料 | 89,455 |
| 管理報酬 | △ 91,857 |
| 監査報酬 | △ 43,639 |
| 保管報酬 | △ 56,578 |
| 名義書換費用 | — |
| 取引費用 | — |
| 受託者報酬 | △ 20,485 |
| その他営業費用 | △ 30,482 |
| 営業費用合計 | △ 1,738,789 |
| 税引前・分配前利益 (損失) | △22,456,670 |
| 税金 | — |
| 税引後・分配前利益 (損失) | △22,456,670 |
| 分配金 | △32,569,899 |
| 税引後・分配後利益 (損失) | △55,026,569 |
| 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 | △55,026,569 |

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

(2018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 GRP HLDGS 8.975% 14/01/19 REGS USD | 中国 | 8.975% | 2019/01/14 | 3.8% |
| CHINA SCE GRP PROPERTY HLDGS 10% 02/07/20 USD | 中国 | 10.000% | 2020/07/02 | 3.2% |
| EXPORT-IMPORT BANK KOREA FRN 01/11/2022 USD | 韓国 | 3.466% | 2022/11/01 | 3.0% |
| POWERLONG REAL ESTAT 5.95% 19/07/20 USD | 中国 | 5.950% | 2020/07/19 | 2.7% |
| SUNAC CHINA HLDGS 8.625% 27/07/20 USD | 中国 | 8.625% | 2020/07/27 | 2.5% |
| YANGO JUSTICE INTL 9.5% 23/09/19 USD | 中国 | 9.500% | 2019/09/23 | 2.5% |
| XINHU ZHONGBAO 6% 01/03/20 USD | 中国 | 6.000% | 2020/03/01 | 2.3% |
| CENTRAL CHINA REAL ESTATE 8% 28/01/20 REGS USD | 中国 | 8.000% | 2020/01/28 | 2.2% |
| VEDANTA RESOURCES 8.25% 07/06/21 REGS USD | インド | 8.250% | 2021/06/07 | 2.1% |
| CHINA SCE GRP PROPERTY HLDGS 7.45% 17/04/21 USD | 中国 | 7.450% | 2021/04/17 | 2.1% |

「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。

■主要投資対象の投資信託証券の概要

| | |
|----------|--|
| 名称 | <p>■ライオン アジア・ハイ・イールド・ボンド・ファンド (Lion Global Asian High Yield Bond Fund-Lion Global Investors アジ ア・ハイ・イールド・ボンド・ファンド クラス1)</p> |
| 形態 | ケイマン籍外国投資信託（円建て） |
| 運用の基本方針 | <p>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。</p> |
| 主な投資制限 | <p>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。</p> |
| 決算日 | 毎年12月31日 |
| 信託報酬等 | <p>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。</p> |
| 申込・解約手数料 | ありません。 |
| 投資顧問会社 | ライオングローバルインベスターズ |

※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

(2018年1月1日から2018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 (△) | △ 6,327,925 |
| 為替差損 | △ 41,652 |
| 受取利息 | 42,042 |
| その他収益 | 3,750 |
| 収益合計 | △ 6,323,785 |
| 費用 | |
| 投資運用報酬 | 331,168 |
| 管理報酬 | 20,491 |
| 監査報酬 | 32,632 |
| 保管報酬 | 9,743 |
| 名義書換費用 | 7,001 |
| 受託者報酬 | 12,000 |
| その他営業費用 | 13,787 |
| 営業費用合計 | 426,822 |
| 営業利益 | △ 6,750,607 |
| 分配金 | △ 8,238,970 |
| 税引前・分配後損失 | △14,989,577 |
| 税金 | — |
| 税引後・分配後損失 | △14,989,577 |
| 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 | △14,989,577 |

主要投資対象のひとつである投資信託証券「Lion Global Asian High Yield Bond Fund-Lion Global Investors 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

(2018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 |
|---|--------|--------|------------|--------|
| VEDANTA RESOURCES PLC 6.37% DUE 30/07/2022 | インド | 6.370% | 2022/7/30 | 5.7% |
| MOON WISE GLOBAL 9% DUE 31/12/2199 | 中国 | 9.000% | 永久債 | 4.9% |
| KWG GROUP HOLDINGS 8.97% DUE 14/01/2019 | 中国 | 8.970% | 2019/1/14 | 3.9% |
| POWERLONG REAL ESTATE 5.95% DUE 19/07/2020 | 中国 | 5.950% | 2020/7/19 | 3.5% |
| PB INTERNATIONAL BV 7.62% DUE 26/01/2022 | インドネシア | 7.620% | 2022/1/26 | 3.1% |
| MEDCO STRAITS SERV PTD 8.5% DUE 17/08/2022 | インドネシア | 8.500% | 2022/8/17 | 2.9% |
| SHIMAO PROPERTY HLDGS 8.37% DUE 10/02/2022 | 中国 | 8.370% | 2022/2/10 | 2.5% |
| CFLD CAYMAN INVESTMENT 6.5% DUE 21/12/2020 | 中国 | 6.500% | 2020/12/21 | 2.5% |
| CHINA CITIC BANK INTL LT 7.25% DUE 31/12/2199 | 香港 | 7.250% | 永久債 | 2.5% |
| YUZHOU PROPERTIES CO LTD 7.9% DUE 11/05/2021 | 中国 | 7.900% | 2021/5/11 | 2.4% |

「ライオン アジア・ハイ・イールド・ボンド・ファンド」の運用会社であるライオングローバルインベスターズ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8期（決算日 2019年8月13日）

＜計算期間 2018年8月11日～2019年8月13日＞

マネープールマザーファンドの第8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。 |

○最近5期の運用実績

| 決 算 期 | 基 準 価 額 | 期 騰 落 中 率 | | 債 組 入 比 率 | 純 資 産 額 |
|----------------|-------------|-----------|----------|-----------|--------------|
| | | 期 騰 落 | 中 率 | | |
| 4期(2015年8月10日) | 円 10,024 | | % 0.0 | % 93.8 | 百万円 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 |
| 8期(2019年8月13日) | 10,028 | | △0.0 | — | 248 |

(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 組 入 比 | 券 率 |
|---|-------|-------|--------|-----|------|---------|------|
| | | | | 騰 落 | 率 | | |
| | (期 首) | | 円 | | % | | % |
| | 2018年 | 8月10日 | 10,032 | | — | | 75.1 |
| | 8月末 | | 10,033 | | 0.0 | | 67.6 |
| | 9月末 | | 10,031 | | △0.0 | | 70.9 |
| | 10月末 | | 10,028 | | △0.0 | | 78.8 |
| | 11月末 | | 10,035 | | 0.0 | | — |
| | 12月末 | | 10,035 | | 0.0 | | — |
| | 2019年 | 1月末 | 10,034 | | 0.0 | | — |
| | 2月末 | | 10,033 | | 0.0 | | — |
| | 3月末 | | 10,032 | | 0.0 | | — |
| | 4月末 | | 10,031 | | △0.0 | | — |
| | 5月末 | | 10,030 | | △0.0 | | — |
| | 6月末 | | 10,030 | | △0.0 | | — |
| | 7月末 | | 10,029 | | △0.0 | | — |
| | (期 末) | | | | | | |
| | 2019年 | 8月13日 | 10,028 | | △0.0 | | — |

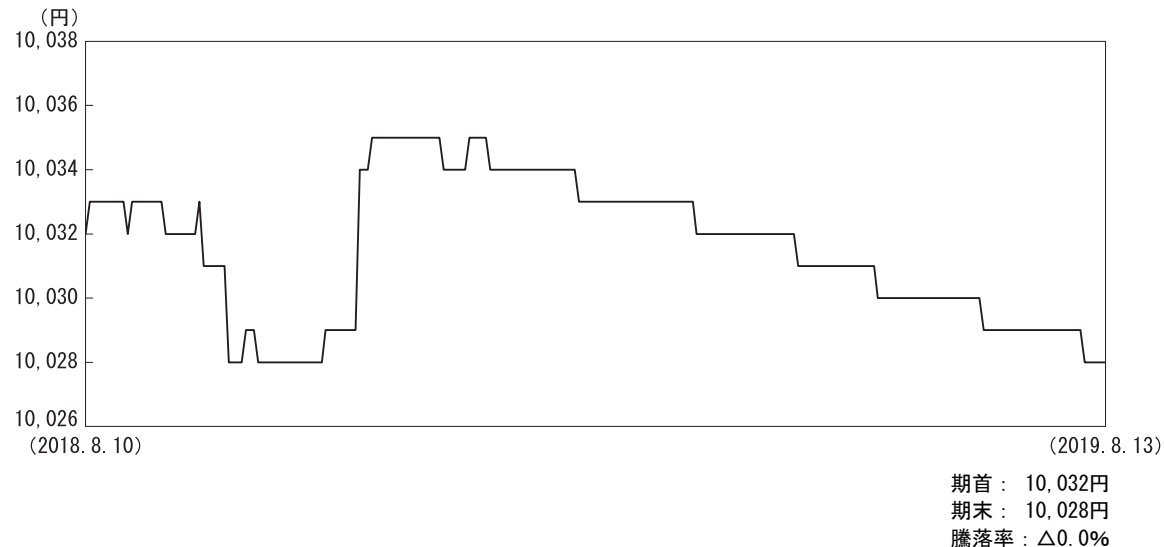
(注1) 騰落率は期首比。

(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おりません。

○運用経過

(2018年8月11日～2019年8月13日)

■基準価額の推移



■基準価額の主な変動要因

短期金融資産の利回りがマイナス圏で推移したことから、当期末の基準価額は期首の水準を小幅に下回りました。

■投資環境

日銀によるマイナス金利政策のもと、短期金融資産の利回りは期を通じてマイナス圏内で推移しました。

■当該投資信託のポートフォリオ

当ファンドは、期中の解約による純資産規模縮小に伴い、保有社債を全額売却しました。期末時点では、コール等の短期金融資産による運用を行っております。

■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、流動性の高いコール等の短期金融資産による運用を行う方針です。

○1万口当たりの費用明細

(2018年8月11日～2019年8月13日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|----------------------------|---------------|-----------------------|---|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) そ の 他 費 用 (そ の 他) | 円 2 (2) | % 0.020 (0.020) | (a)その他費用= $\frac{\text{期中のその他費用}}{\text{期中の平均受益権口数}}$ 信託事務の処理にかかるその他の費用等 |
| 合 計 | 2 | 0.020 | |
| 期中の平均基準価額は10,031円です。 | | | |

(注1) 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2) 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。

○売買及び取引の状況

(2018年8月11日～2019年8月13日)

公社債

| | | 買 付 額 | 売 付 額 |
|--------|-----------------|---------|----------------------|
| 国 内 | 特殊債券 | 千円 — | 千円 100,169 |
| | 社債券 (投資法人債券を含む) | 402,893 | 906,453 (400,000) |

(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 (投資法人債券を含む) には新株予約権付社債 (転換社債) は含まれておりません。

(注4) 単位未満は切捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2018年8月11日～2019年8月13日)

該当事項はございません。

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

(2019年8月13日現在)

2019年8月13日現在、有価証券等の組入れはございません。

○投資信託財産の構成

(2019年8月13日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|---------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| コール・ローン等、その他 | 248,417 | 100.0 |
| 投資信託財産総額 | 248,417 | 100.0 |

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2019年8月13日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------|--------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 248,417,526 |
| コール・ローン等 | 248,417,526 |
| (B) 負債 | 639 |
| 未払利息 | 639 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 248,416,887 |
| 元本 | 247,715,866 |
| 次期繰越損益金 | 701,021 |
| (D) 受益権総口数 | 247,715,866口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 10,028円 |

(注1) 信託財産に係る期首元本額1,335,535,026円、期中追加設定元本額3,039,991円、期中一部解約元本額1,090,859,151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 | 115,917,390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 | 38,572,960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 | 60,227,220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 | 5,050,983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 | 10,772,334円 |
| 日米4資産スマートバランス | 6,346,443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) | 4,727,304円 |

(注3) 期末における1口当たりの純資産総額 1.0028円

○損益の状況 (2018年8月11日～2019年8月13日)

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 2,778,456 |
| 受取利息 | 3,014,227 |
| 支払利息 | △ 235,771 |
| (B) 有価証券売買損益 | △2,604,200 |
| 売買益 | 71,000 |
| 売買損 | △2,675,200 |
| (C) 保管費用等 | △ 112,486 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 61,770 |
| (E) 前期繰越損益金 | 4,320,091 |
| (F) 追加信託差損益金 | 10,009 |
| (G) 解約差損益金 | △3,690,849 |
| (H) 計(D+E+F+G) | 701,021 |
| 次期繰越損益金(H) | 701,021 |

(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) 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。