

■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 | 2022年6月24日から2024年12月19日までです。 | |
| 運用方針 | マザーファンド受益証券への投資を通じて、主に中国の政府、政府機関または企業等が発行する人民元建てまたは米ドル建て等の債券に投資を行い、インカム収益の確保と信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行います。 | |
| 主な投資対象 | ベビード ファンド | 主としてマニユライフ・中国債券戦略マザーファンド(以下「マザーファンド」といいます。)の受益証券を投資対象とします。 |
| | マザー ファンド | 主に中国の政府、政府機関、または企業等が発行する人民元建てまたは米ドル建て等の債券を投資対象とします。 |
| マザーファンドの 運用方法 | 主に中国の政府、政府機関または企業等が発行する人民元建てまたは米ドル建て等の債券に投資を行い、インカム収益の確保と投資信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行います。 | |
| 主な投資制限 | ベビード ファンド | ①債券への実質投資割合には制限を設けません。 ②外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。 ③<Aコース(米ドル売り円買い)>実質組入外貨建資産については、原則として米ドル売り円買いの為替予約取引を行い、米ドルと円のための為替変動リスクの低減を図ります。 <Bコース(為替ヘッジなし)>実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。 ④実質組入米ドル建資産については、原則として人民元に対して為替ヘッジを行います。 |
| | マザー ファンド | ①債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米ドル建債券への投資割合は信託財産の純資産総額の30%を上限とします。 |
| 分配方針 | 毎決算時(原則毎年6月20日。ただし、休業日の場合は翌営業日とします。第1期決算日は2023年6月20日。)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。 | |

マニユライフ・ 中国債券インカム・ファンド Aコース(米ドル売り円買い) ／Bコース(為替ヘッジなし)

償還運用報告書(全体版)

第3期(償還日 2024年12月19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・中国債券インカム・ファンド Aコース(米ドル売り円買い)／Bコース(為替ヘッジなし)」は、2024年12月19日をもちまして繰上償還となりました。
ここに、運用経過と償還内容をご報告申し上げますとともに、ご愛顧に対し厚くお礼申し上げます。

マニユライフ・インベストメント・マネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-8-1 丸の内トラストタワーN館

お問い合わせ先

サポートダイヤル：03-6267-1901

受付時間：営業日の午前9時～午後5時

ホームページアドレス：www.manulifeim.co.jp/

【Aコース (米ドル売り円買い)】

■設定以来の運用実績

| 決 算 期 | 基 準 価 額 (分配落) | 税 分 配 込 金 期 騰 落 中 率 | | | 債 券 組 入 比 率 | 債 券 先 物 比 率 | 純 資 産 総 額 |
|-----------------------------|--------------------|---------------------|--------|---------|-------------|-------------|--------------|
| | | 税 分 配 | 込 金 | 騰 落 中 率 | | | |
| (設 定 日) 2022年6月24日 | 円 10,000 | | 円 - | % - | % - | % - | 百万円 3,101 |
| 1期 (2023年6月20日) | 9,207 | | 0 | △7.9 | 94.9 | - | 2,855 |
| 2期 (2024年6月20日) | 8,839 | | 0 | △4.0 | 97.2 | - | 2,741 |
| (償 還 時) 3期 (2024年12月19日) | (償還価額) 8,769.73 | | | △0.8 | - | - | 2,719 |

(注1) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注2) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しています。

(注3) 基準価額は1万円当たり、騰落率は分配金込みで表示しています。

(注4) 当ファンドの値動きと比較する適切な指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は設定しておりません。

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

(注6) 債券先物比率は「買建比率」－「売建比率」で算出しています。

■当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | 騰 落 率 | | | 債 券 組 入 比 率 | 債 券 先 物 比 率 |
|----------------------|--------------------|--------|--------|-----------|-------------|-------------|
| | | 騰 落 率 | 騰 落 率 | 騰 落 率 | | |
| (期 首) 2024年6月20日 | 円 8,839 | % - | % - | % 97.2 | % - | |
| 6月末 | 8,818 | △0.2 | | 98.3 | - | |
| 7月末 | 8,894 | 0.6 | | 94.9 | - | |
| 8月末 | 9,030 | 2.2 | | 90.6 | - | |
| 9月末 | 9,175 | 3.8 | | 90.8 | - | |
| 10月末 | 8,942 | 1.2 | | 100.6 | - | |
| 11月末 | 8,776 | △0.7 | | - | - | |
| (償還時) 2024年12月19日 | (償還価額) 8,769.73 | △0.8 | | - | - | |

(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) 当ファンドの値動きと比較する適切な指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は設定しておりません。

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

(注5) 債券先物比率は「買建比率」－「売建比率」で算出しています。

【Bコース (為替ヘッジなし)】

■設定以来の運用実績

| 決 算 期 | 基 準 価 額 (分配落) | 税 分 配 込 金 期 騰 落 中 率 | | 債 券 組 入 比 率 | 債 券 先 物 比 率 | 純 資 産 総 額 |
|----------------------------|---------------------|---------------------|-----------|-------------|-------------|------------|
| | | 税 分 配 | 込 金 期 騰 落 | | | |
| (設 定 日) 2022年6月24日 | 円 10,000 | | 円 - | % - | % - | 百万円 107 |
| 1期(2023年6月20日) | 10,127 | | 0 | 92.8 | - | 195 |
| 2期(2024年6月20日) | 11,274 | | 100 | 95.8 | - | 191 |
| (償 還 時) 3期(2024年12月19日) | (償還価額) 11,107.12 | | | △ 1.5 | - | 124 |

- (注1) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。
- (注2) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しています。
- (注3) 基準価額は1万口当たり、騰落率は分配金込みで表示しています。
- (注4) 当ファンドの値動きと比較する適切な指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は設定しておりません。
- (注5) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、「債券組入比率」および「債券先物比率」は実質比率を記載しております。
- (注6) 債券先物比率は「買建比率」－「売建比率」で算出しています。

■当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | 騰 落 率 | | 債 券 組 入 比 率 | 債 券 先 物 比 率 |
|----------------------|---------------------|-------|--------|-------------|-------------|
| | | 騰 落 | 率 | | |
| (期 首) 2024年6月20日 | 円 11,274 | | % - | % 95.8 | % - |
| 6月末 | 11,459 | | 1.6 | 95.1 | - |
| 7月末 | 11,016 | | △2.3 | 96.4 | - |
| 8月末 | 10,702 | | △5.1 | 96.2 | - |
| 9月末 | 10,775 | | △4.4 | 92.9 | - |
| 10月末 | 11,319 | | 0.4 | 95.5 | - |
| 11月末 | 11,115 | | △1.4 | - | - |
| (償還時) 2024年12月19日 | (償還価額) 11,107.12 | | △1.5 | - | - |

- (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) 当ファンドの値動きと比較する適切な指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は設定しておりません。
- (注4) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、「債券組入比率」および「債券先物比率」は実質比率を記載しております。
- (注5) 債券先物比率は「買建比率」－「売建比率」で算出しています。

運用経過

■設定以来の基準価額等の推移 (2022年6月24日から2024年12月19日まで)

Aコース (米ドル売り円買い)



※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。

※当ファンドの値動きと比較する適切な指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は設定しておりません。

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

前期までの運用状況 (2022年6月24日～2024年6月20日)

■基準価額の主な変動要因

第1期 (2022年6月24日～2023年6月20日)

- ・安定的な利息収入がプラス寄与しました。
- ・米ドル売り円買いの為替予約取引は、米国金利の上昇による取引コストがマイナス寄与しました。

第2期 (2023年6月21日～2024年6月20日)

- ・安定的な利息収入がプラス寄与しました。
- ・中国国債の利回りが低下したことがプラス寄与しました。
- ・米ドル売り円買いの為替予約取引は、米国金利の上昇による取引コストがマイナス寄与しました。

■設定以来の基準価額等の推移 (2022年6月24日から2024年12月19日まで)

Bコース (為替ヘッジなし)



※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。

※当ファンドの値動きと比較する適切な指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は設定しておりません。

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

前期までの運用状況 (2022年6月24日～2024年6月20日)

■基準価額の主な変動要因

第1期 (2022年6月24日～2023年6月20日)

- ・安定的な利息収入がプラス寄与しました。
- ・人民元が対円で下落（円高）したことがマイナス寄与しました。

第2期 (2023年6月21日～2024年6月20日)

- ・安定的な利息収入がプラス寄与しました。
- ・中国国債の利回りが低下したことがプラス寄与しました。
- ・人民元が対円で上昇（円安）したことがプラス寄与しました。

■投資環境

第1期(2022年6月24日～2023年6月20日)

[中国債券市況]

全コース共通

当期間の中国債券市場は上昇しました。安定的な利息収入に加え、国債債券利回りの低下や信用スプレッドの縮小などがプラス寄与しました。

[為替市況]

Bコース(為替ヘッジなし)

人民元は対円・対米ドルで下落(円高人民元安・米ドル高人民元安)しました。

第2期(2023年6月21日～2024年6月20日)

[中国債券市況]

全コース共通

当期間の中国債券市場は上昇しました。安定的な利息収入に加え、中国国債の利回りが低下したことなどがプラス寄与しました。

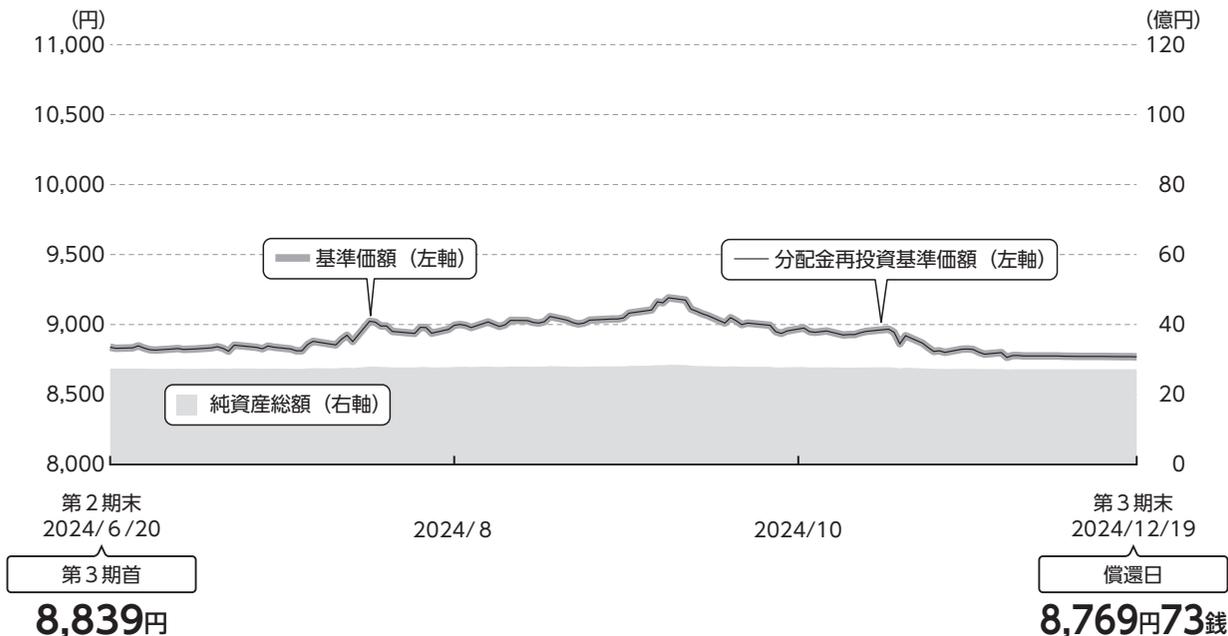
[為替市況]

Bコース(為替ヘッジなし)

人民元は対円で上昇(円安人民元高)しました。

基準価額等の推移 (2024年6月21日から2024年12月19日まで)

■ Aコース (米ドル売り円買い)



※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、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。

※当ファンドの値動きと比較する適切な指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は設定しておりません。

※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。

| | |
|--------------------|-------|
| 既払分配金 | —円 |
| 騰落率 (分配金再投資ベース) | △0.8% |

基準価額の主な変動要因

上昇要因

- ・ 安定的な利息収入がプラス寄与しました。
- ・ 中国国債の利回りが低下したことがプラス寄与しました。

下落要因

- ・ 米ドル売り円買いの為替予約取引は、取引コストがマイナス寄与しました。

基準価額等の推移 (2024年6月21日から2024年12月19日まで)

■ Bコース (為替ヘッジなし)



第3期首
11,274円

第3期末
2024/12/19
償還日
11,107円12銭

※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、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。

※当ファンドの値動きと比較する適切な指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は設定していません。

※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。

| | |
|--------------------|-------|
| 既払分配金 | —円 |
| 騰落率 (分配金再投資ベース) | △1.5% |

基準価額の主な変動要因

上昇要因

- ・ 安定的な利息収入がプラス寄与しました。
- ・ 中国国債の利回りが低下したことがプラス寄与しました。

下落要因

- ・ 人民元が対円で下落（円高人民元安）したことがマイナス寄与しました。

投資環境

中国債券市況

■ 全コース共通

当期間の中国債券市場は上昇しました。安定的な利息収入に加え、中国国債の利回りが低下したことなどがプラス寄与しました。

為替市況

■ Bコース (為替ヘッジなし)

人民元は対円で下落(円高人民元安)しました。

当該投資信託のポートフォリオ

全コース共通

繰上償還に向けて、主要投資対象とする「マニユライフ・中国債券戦略マザーファンド」受益証券を売却し、現金化を行いました。

マニユライフ・中国債券戦略マザーファンド

繰上償還に向けて組入資産の現金化を行いました。

当該投資信託のベンチマークとの差異

当ファンドは運用の目標となるベンチマークおよび参考指数を設けておりません。

収益分配金について

■ Aコース (米ドル売り円買い)

該当事項はありません。

■ Bコース (為替ヘッジなし)

該当事項はありません。

今後の運用方針

全コース共通

該当事項はありません。

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

■ Aコース (米ドル売り円買い)

1万口当たりの費用明細

| 項目 | 当期 | | 項目の概要 |
|-------------|--------------------------|---------|---|
| | (2024年6月21日～2024年12月19日) | | |
| | 金額 | 比率 | |
| 平均基準価額 | 8,939円 | — | 期中の平均基準価額 (月末値の平均値) です。 |
| (a) 信託報酬 | 51円 | 0.565% | (a) 信託報酬 = 期中の平均基準価額 × 信託報酬率 |
| (投信会社) | (25) | (0.274) | 委託した資金の運用の対価 |
| (販売会社) | (25) | (0.274) | 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 |
| (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 | 5 | 0.058 | (e) その他費用 = 期中のその他費用 ÷ 期中の平均受益権口数 |
| (保管費用) | (2) | (0.027) | 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 |
| (印刷) | (2) | (0.025) | 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) | (0) | (0.005) | 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 | 56 | 0.623 | |

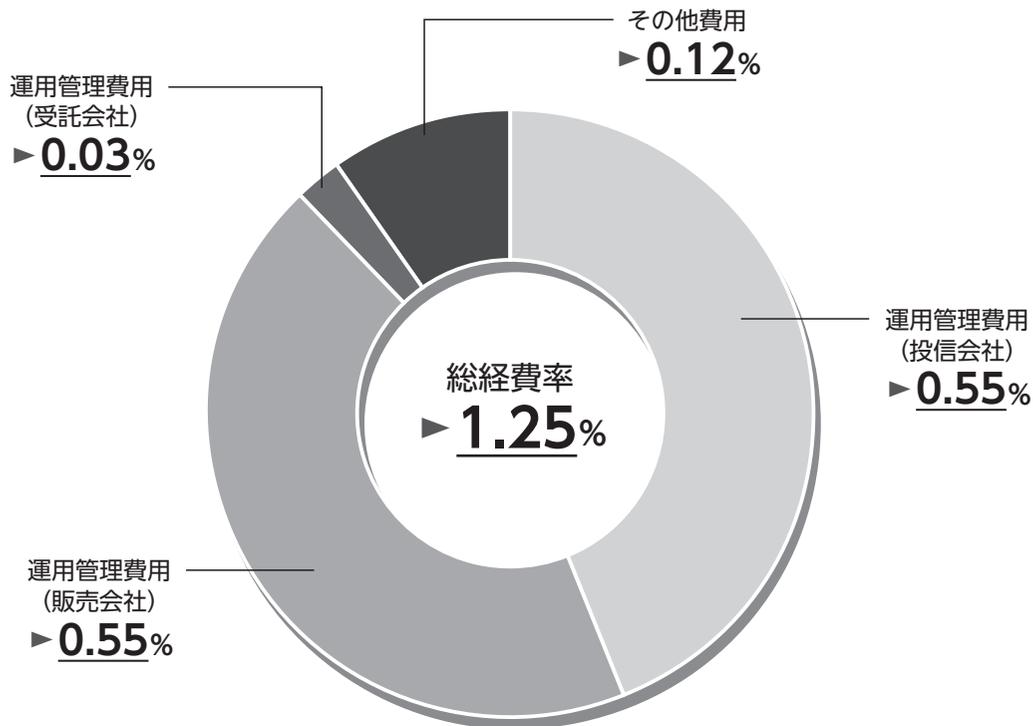
* 期中の費用 (消費税のかかるものは消費税を含む) は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

* 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



*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。

*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。

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は1.25%**です。

■**売買及び取引の状況** (2024年6月21日から2024年12月19日まで)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

| | 設 定 | | 解 約 | |
|---------------------|---------|---------|-----------|-----------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| マニュアル・中国債券戦略マザーファンド | 109,786 | 123,105 | 2,492,889 | 2,881,172 |

(注) 単位未満は切り捨てております。

■**利害関係人との取引状況等** (2024年6月21日から2024年12月19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。

マニュアル・中国債券戦略マザーファンド

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取引状況**

(2024年6月21日から2024年12月19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** (2024年6月21日から2024年12月19日まで)

該当事項はありません。

■**組入資産の明細** (2024年12月19日現在)

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

親投資信託残高

| 項 目 | 期 首 (前 期 末) | |
|---------------------|---------------|-----------|
| | 口 数 | 評 価 額 |
| | 千口 | 千円 |
| マニュアル・中国債券戦略マザーファンド | 2,383,102 | 2,780,127 |

(注) 口数・評価額の単位未満は切り捨てております。

■有価証券の貸付及び借入の状況 (2024年12月19日現在)

該当事項はありません。

■投資信託財産の構成

(2024年12月19日現在)

| 項 目 | 償 還 時 | |
|------------------------|-----------------|------------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等、 そ の 他 | 千円 2,735,876 | % 100.0 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 2,735,876 | 100.0 |

(注) 金額の単位未満は切り捨てております。

■資産、負債、元本及び償還価額の状況

| 項 目 | 償 還 時 2024年12月19日 |
|--------------------|----------------------|
| (A) 資 産 | 2,735,876,375円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 2,735,868,130 |
| 未 収 利 息 | 8,245 |
| (B) 負 債 | 16,314,507 |
| 未 払 信 託 報 酬 | 15,627,093 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 687,414 |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 2,719,561,868 |
| 元 本 | 3,101,077,073 |
| 償 還 差 損 金 | △ 381,515,205 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 3,101,077,073口 |
| 1万口当たり償還価額(C/D) | 8,769円73銭 |

(注1) 当ファンドの期首元本額は3,101,060,500円、期中追加設定元本額は147,707円、期中一部解約元本額は131,134円です。

(注2) 1口当たり純資産額は0.876973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381,515,205円です。

■損益の状況

| 項 目 | 当 期 自 2024年 6 月 21 日 至 2024年 12 月 19 日 |
|----------------------|--|
| (A) 配 当 等 収 益 | 8,245円 |
| 受 取 利 息 | 8,245 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | △ 5,234,365 |
| 売 買 益 | 175,360,791 |
| 売 買 損 | △180,595,156 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △ 16,385,908 |
| (D) 当 期 損 益 金(A+B+C) | △ 21,612,028 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | △359,886,760 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | △ 16,417 |
| (配 当 等 相 当 額) | (5,313) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (△ 21,730) |
| 償 還 差 損 金(D+E+F) | △381,515,205 |

(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。

■投資信託財産運用総括表

| 信託期間 | 投資信託契約締結日 | 2022年6月24日 | | 投資信託契約終了時の状況 | |
|----------|----------------|----------------|------------|--------------|----------------|
| | 投資信託契約終了日 | 2024年12月19日 | | 資産総額 | 2,735,876,375円 |
| 区分 | 投資信託契約締結当初 | 投資信託契約終了時 | 差引増減又は追加信託 | 負債総額 | 16,314,507円 |
| 受益権口数 | 3,101,000,000口 | 3,101,077,073口 | 77,073口 | 純資産総額 | 2,719,561,868円 |
| | | | | 受益権口数 | 3,101,077,073口 |
| 元本額 | 3,101,000,000円 | 3,101,077,073円 | 77,073円 | 1万口当たり償還金 | 8,769.73円 |
| 毎計算期末の状況 | | | | | |
| 計算期 | 元本額 | 純資産総額 | 基準価額 | 1万口当たり分配金 | |
| | | | | 金額 | 分配率 |
| 第1期 | 3,101,049,343円 | 2,855,281,983円 | 9,207円 | 0円 | 0.0000% |
| 第2期 | 3,101,060,500 | 2,741,157,002 | 8,839 | 0 | 0.0000 |

■償還金のお知らせ

| | |
|-----------|-----------|
| 1万口当たり償還金 | 8,769円73銭 |
|-----------|-----------|

<課税上の取り扱い>

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

※税法が改正された場合等は、上記内容が変更になる場合があります。

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

お知らせ

約款変更

該当事項はありません。

運用体制の変更

該当事項はありません。

■ Bコース (為替ヘッジなし)

1万口当たりの費用明細

| 項目 | 当期 | | 項目の概要 |
|-------------|--------------------------|---------|---|
| | (2024年6月21日～2024年12月19日) | | |
| | 金額 | 比率 | |
| 平均基準価額 | 11,064円 | — | 期中の平均基準価額 (月末値の平均値) です。 |
| (a) 信託報酬 | 63円 | 0.565% | (a) 信託報酬 = 期中の平均基準価額 × 信託報酬率 |
| (投信会社) | (30) | (0.274) | 委託した資金の運用の対価 |
| (販売会社) | (30) | (0.274) | 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 |
| (受託会社) | (2) | (0.016) | 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 | 7 | 0.063 | (e) その他費用 = 期中のその他費用 ÷ 期中の平均受益権口数 |
| (保管費用) | (3) | (0.025) | 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 |
| (印刷) | (4) | (0.034) | 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) | (1) | (0.005) | 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 | 70 | 0.628 | |

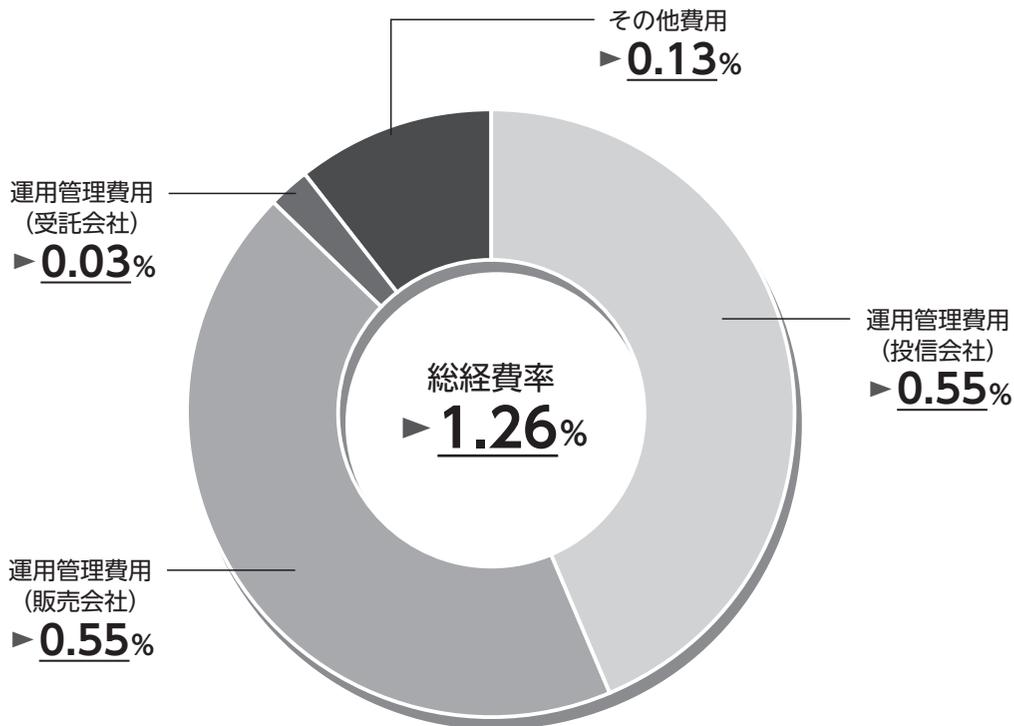
* 期中の費用 (消費税のかかるものは消費税を含む) は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

* 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



*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。

*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。

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は1.26%**です。

■**売買及び取引の状況** (2024年6月21日から2024年12月19日まで)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

| | 設 定 | | 解 約 | |
|---------------------|-----|-----|---------|---------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| マニュアル・中国債券戦略マザーファンド | 641 | 738 | 164,846 | 191,517 |

(注) 単位未満は切り捨てております。

■**利害関係人との取引状況等** (2024年6月21日から2024年12月19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。

マニュアル・中国債券戦略マザーファンド

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取引状況**

(2024年6月21日から2024年12月19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** (2024年6月21日から2024年12月19日まで)

該当事項はありません。

■**組入資産の明細** (2024年12月19日現在)

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

親投資信託残高

| 項 目 | 期 首 (前 期 末) | |
|---------------------|---------------|---------|
| | 口 数 | 評 価 額 |
| | 千口 | 千円 |
| マニュアル・中国債券戦略マザーファンド | 164,205 | 191,561 |

(注) 口数・評価額の単位未満は切り捨てております。

■有価証券の貸付及び借入の状況 (2024年12月19日現在)

該当事項はありません。

■投資信託財産の構成

(2024年12月19日現在)

| 項 目 | 償 還 時 | |
|------------------------|---------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等、 そ の 他 | 125,869 | 100.0 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 125,869 | 100.0 |

(注) 金額の単位未満は切り捨てております。

■資産、負債、元本及び償還価額の状況

| 項 目 | 償 還 時 2024年12月19日 |
|--------------------|----------------------|
| (A) 資 産 | 125,869,785円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 125,869,406 |
| 未 収 利 息 | 379 |
| (B) 負 債 | 1,068,945 |
| 未 払 信 託 報 酬 | 1,008,885 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 60,060 |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 124,800,840 |
| 元 本 | 112,361,124 |
| 償 還 差 益 金 | 12,439,716 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 112,361,124口 |
| 1万口当たり償還価額(C/D) | 11,107円12銭 |

(注1) 当ファンドの期首元本額は169,908,444円、期中追加設定元本額は664,124円、期中一部解約元本額は58,211,444円です。

(注2) 1口当たり純資産額は1.110712円です。

■損益の状況

| 項 目 | 当 期 自 2024年 6月21日 至 2024年12月19日 |
|----------------------|---------------------------------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 379円 |
| 受 取 利 息 | 379 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | △ 864,523 |
| 売 買 益 | 459,218 |
| 売 買 損 | △ 1,323,741 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △ 1,068,945 |
| (D) 当 期 損 益 金(A+B+C) | △ 1,933,089 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | 14,323,588 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 49,217 |
| (配 当 等 相 当 額) | (55,752) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (△ 6,535) |
| 償 還 差 益 金(D+E+F) | 12,439,716 |

(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。

■投資信託財産運用総括表

| 信託期間 | 投資信託契約締結日 | 2022年6月24日 | | 投資信託契約終了時の状況 | |
|----------|--------------|--------------|------------|--------------|--------------|
| | 投資信託契約終了日 | 2024年12月19日 | | 資産総額 | 125,869,785円 |
| 区分 | 投資信託契約締結当初 | 投資信託契約終了時 | 差引増減又は追加信託 | 負債総額 | 1,068,945円 |
| 受益権口数 | 107,008,878口 | 112,361,124口 | 5,352,246口 | 純資産総額 | 124,800,840円 |
| | | | | 受益権口数 | 112,361,124口 |
| 元本額 | 107,008,878円 | 112,361,124円 | 5,352,246円 | 1万口当たり償還金 | 11,107.12円 |
| 毎計算期末の状況 | | | | | |
| 計算期 | 元本額 | 純資産総額 | 基準価額 | 1万口当たり分配金 | |
| | | | | 金額 | 分配率 |
| 第1期 | 192,875,169円 | 195,316,620円 | 10,127円 | 0円 | 0.0000% |
| 第2期 | 169,908,444 | 191,561,932 | 11,274 | 100 | 1.0000 |

■償還金のお知らせ

| | |
|-----------|------------|
| 1万口当たり償還金 | 11,107円12銭 |
|-----------|------------|

<課税上の取り扱い>

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

※税法が改正された場合等は、上記内容が変更になる場合があります。

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

お知らせ

約款変更

該当事項はありません。

運用体制の変更

該当事項はありません。

マニユライフ・中国債券戦略マザーファンド

第3期

償還日 2024年12月18日

(計算期間：2024年6月21日から2024年12月18日まで)

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | |
|--------|---|
| 運用方針 | <p>①主に中国の政府、政府機関または企業等が発行する人民元建てまたは米ドル建て等の債券に投資を行います。</p> <p>②マニユライフ・インベストメント・マネジメント（HK）リミテッドに運用の指図に関する権限を委託します。</p> <p>③外貨建資産については、原則として円に対して為替ヘッジを行いません。</p> <p>④米ドル建資産については、原則として中国人民幣元に対して為替ヘッジを行います。</p> |
| 主な投資対象 | 主に中国の政府、政府機関、または企業等が発行する人民元建てまたは米ドル建て等の債券を投資対象とします。 |
| 主な投資制限 | <p>①債券への投資割合には制限を設けません。</p> <p>②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>③米ドル建債券への投資割合は信託財産の純資産総額の30%を上限とします。</p> |

■設定以来の運用実績

| 決 算 期 | 基 準 価 額 | | 債 券 組入比率 | 債 券 先物比率 | 純 資 産 総 額 |
|------------------------------|---------------------|--------|-------------|-------------|--------------|
| | 期 騰 | 落 率 | | | |
| (設 定 日) 2022年4月5日 | 円 10,000 | % - | % - | % - | 百万円 0.1 |
| 1 期 (2023年6月20日) | 10,253 | 2.5 | 92.8 | - | 3,117 |
| 2 期 (2024年6月20日) | 11,666 | 13.8 | 95.8 | - | 2,971 |
| (償 還 時) 3 期 (2024年12月18日) | (償還価額) 11,553.06 | △ 1.0 | - | - | 2,861 |

(注1) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注2) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しています。

(注3) 基準価額は1万口当たりで表示しています。

(注4) 当ファンドの値動きと比較する適切な指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は設定しておりません。

(注5) 債券先物比率は「買建比率」-「売建比率」で算出しています。

■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 | 債 券 先物比率 |
|------------------------|---------------------|--------|-------------|-------------|
| | 騰 | 落 率 | | |
| (期 首) 2024年6月20日 | 円 11,666 | % - | % 95.8 | % - |
| 6 月 末 | 11,860 | 1.7 | 95.1 | - |
| 7 月 末 | 11,416 | △2.1 | 96.2 | - |
| 8 月 末 | 11,104 | △4.8 | 95.9 | - |
| 9 月 末 | 11,192 | △4.1 | 92.6 | - |
| 10 月 末 | 11,768 | 0.9 | 95.1 | - |
| 11 月 末 | 11,554 | △1.0 | - | - |
| (償 還 時) 2024年12月18日 | (償還価額) 11,553.06 | △1.0 | - | - |

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 基準価額は1万口当たりで表示しています。

(注3) 当ファンドの値動きと比較する適切な指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は設定しておりません。

(注4) 債券先物比率は「買建比率」-「売建比率」で算出しています。

運用経過

■設定以来の基準価額の推移 (2022年4月5日から2024年12月18日まで)



※当ファンドの値動きと比較する適切な指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は設定していません。

前期までの運用状況 (2022年4月5日～2024年6月20日)

■基準価額の主な変動要因

第1期 (2022年4月5日～2023年6月20日)

- ・安定的な利息収入がプラス寄与しました。
- ・人民元が対円で若干上昇 (円安) したことがプラス寄与しました。

第2期 (2023年6月21日～2024年6月20日)

- ・安定的な利息収入がプラス寄与しました。
- ・中国国債の利回りが低下したことがプラス寄与しました。
- ・人民元が対円で上昇 (円安) したことがプラス寄与しました。

■投資環境

第1期 (2022年4月5日～2023年6月20日)

[中国債券市況]

当期間の中国債券市場は上昇しました。安定的な利息収入に加え、国債債券利回りの低下や信用スプレッドの縮小などがプラス寄与しました。

[為替市況]

人民元は対円で若干上昇（円安人民元高）しました。

第2期 (2023年6月21日～2024年6月20日)

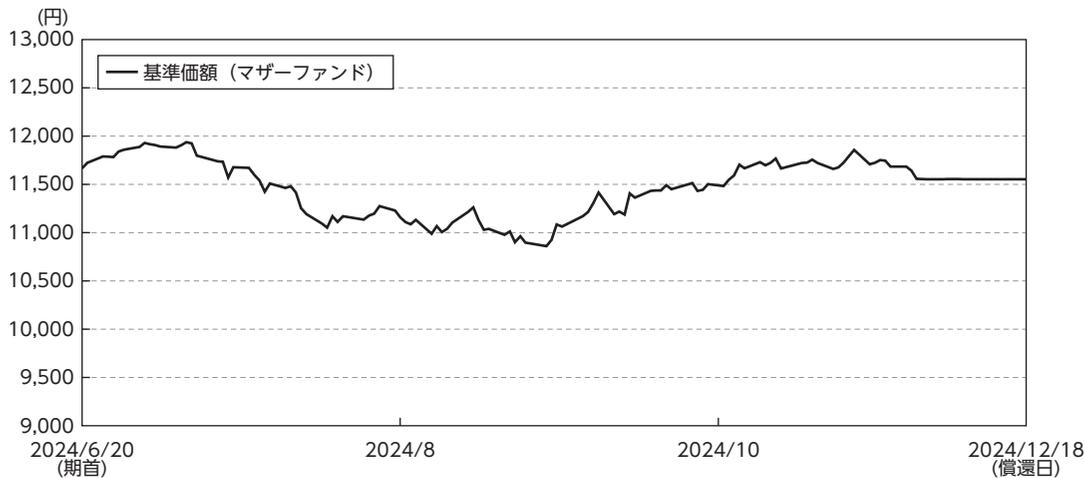
[中国債券市況]

当期間の中国債券市場は上昇しました。安定的な利息収入に加え、中国国債の利回りが低下したことなどがプラス寄与しました。

[為替市況]

人民元は対円で上昇（円安人民元高）しました。

■基準価額の推移（2024年6月21日から2024年12月18日まで）



期 首： 11,666円
 償 還 日： 11,553円06銭
 騰 落 率： △1.0%

※当ファンドの値動きと比較する適切な指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は設定しておりません。

■基準価額の変動要因

上昇要因

- ・ 安定的な利息収入がプラス寄与しました。
- ・ 中国国債の利回りが低下したことがプラス寄与しました。

下落要因

- ・ 人民元が対円で下落（円高人民元安）したことがマイナス寄与しました。

■投資環境

[中国債券市況]

当期間の中国債券市場は上昇しました。安定的な利息収入に加え、中国国債の利回りが低下したことなどがプラス寄与しました。

[為替市況]

人民元は対円で下落（円高人民元安）しました。

■当該投資信託のポートフォリオ

繰上償還に向けて組入資産の現金化を行いました。

■今後の運用方針

該当事項はありません。

■ 1万口当たりの費用明細

| 項目 | 当期 | | 項目の概要 |
|---------------------|--------------------------|-------------------|--|
| | (2024年6月21日~2024年12月18日) | | |
| | 金額 | 比率 | |
| 平均基準価額 | 11,482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 （保管費用） | 5円 (5) | 0.047% (0.041) | (a) その他費用 = 期中のその他費用 ÷ 期中の平均受益権口数 ・ 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 |
| （その他） | (1) | (0.005) | ・ 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 | 5 | 0.047 | |

* 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（2024年6月21日から2024年12月18日まで）

公社債

| | | | 買付額 | 売付額 |
|----|--------------|---------------------|---------|---------|
| 外国 | 中国 オ フ シ ョ ア | | 千オフショア元 | 千オフショア元 |
| | | 国債証券 | 12,245 | 76,451 |
| | | 特殊債証券 | 5,882 | 59,081 |
| | | 社債証券 (投資法人債券を含む) | 8,098 | 23,194 |

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

■ 利害関係人との取引状況等（2024年6月21日から2024年12月18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（2024年12月18日現在）

償還時（期末）における有価証券の組入れはありません。

■ 有価証券の貸付及び借入の状況（2024年12月18日現在）

該当事項はありません。

■投資信託財産の構成

(2024年12月18日現在)

| 項 目 | 償 還 時 | |
|------------------------|-----------------|------------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等、 そ の 他 | 千円 2,861,737 | % 100.0 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 2,861,737 | 100.0 |

(注) 金額の単位未満は切り捨てております。

■資産、負債、元本及び償還価額の状況

| 項 目 | 償 還 時 2024年12月18日 |
|-----------------------------|----------------------|
| (A) 資 産 | 2,861,737,536円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 2,861,728,912 |
| 未 収 利 息 | 8,624 |
| (B) 純 資 産 総 額(A) | 2,861,737,536 |
| 元 本 | 2,477,038,344 |
| 償 還 差 益 金 | 384,699,192 |
| (C) 受 益 権 総 口 数 | 2,477,038,344口 |
| 1 万 口 当 た り 償 還 価 額 (B / C) | 11,553円06銭 |

(注1) 当親ファンドの期首元本額は2,547,308,045円、期中追加設定元本額は110,427,530円、期中一部解約元本額は180,697,231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。

中国債券インカム・ファンド Aコース (米ドル売り円買い)
2,368,089,378円

中国債券インカム・ファンド Bコース (為替ヘッジなし)
108,948,966円

(注3) 1口当たり純資産額は1.155306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。

■損益の状況

| 項 目 | 当 期 自 2024年 6 月21日 至 2024年12月18日 |
|---------------------------|--|
| (A) 配 当 等 収 益 | 34,790,124円 |
| 受 取 利 息 | 34,790,124 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | △ 56,144,261 |
| 売 買 益 | 32,103,421 |
| 売 買 損 | △ 88,247,682 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △ 1,372,117 |
| (D) 当 期 損 益 金 (A + B + C) | △ 22,726,254 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | 424,263,378 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 13,416,549 |
| (G) 解 約 差 損 益 金 | △ 30,254,481 |
| 償 還 差 益 金 (D + E + F + G) | 384,699,192 |

(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。