

アジア・ハイ・イールド債券 ファンド（毎月分配型） 通貨セレクト・プレミアムコース 〈愛称〉アジハイ・トリプルストラテジー

第18期（決算日 2016年9月12日）
 第19期（決算日 2016年10月11日）
 第20期（決算日 2016年11月10日）
 第21期（決算日 2016年12月12日）
 第22期（決算日 2017年1月10日）
 最終期（償還日 2017年1月27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）通貨セレクト・プレミアムコース」は、信託約款の規定に基づき、2017年1月27日をもって繰上償還いたしました。ここに謹んで設定以来の運用状況と償還の内容をご報告申し上げます。
 今後とも当社商品につき引き続きお引立て賜りますようお願い申し上げます。

■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	2015年2月27日から2017年1月27日まで(当初、2021年8月10日まで)	
運用方針	①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原則、相対的に流動性、金利水準が高い通貨を選択し、当該通貨を通じた為替取引を行う「通貨セレクト戦略」を活用し、プレミアム収入（金利差相当分の収益）の獲得を目指します。 ③「通貨オプション・プレミアム（カバードコール）戦略」の活用により、オプションのプレミアム収入の獲得を目指します。	
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）通貨セレクト・プレミアムコース	投資信託証券
	ライオンアジア・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（クラス6）	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）
	マネーボ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）通貨セレクト・プレミアムコース	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。
	ライオンアジア・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（クラス6）	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。 ＜有価証券の発行者等に関するエクスポージャー＞ 債券部分：1発行体10%以内 ＜取引の相手方に対するエクスポージャー＞ 為替取引及び通貨カバード・コール部分の合計：評価ベースで10%以内
	マネーボ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等を勘案して決定します。ただし、必ず分配を行うものではありません。	

※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。



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）

■ 設定以来の運用実績

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
			税金配込	騰落中率			
第1作成期	(設定日) 2015年2月27日	円 10,000	円 —	% —	% —	% —	百万円 100
	1期 (2015年4月10日)	10,003	0	0.0	0.8	92.2	141
	2期 (2015年5月11日)	9,827	0	△1.8	0.9	100.2	135
	3期 (2015年6月10日)	9,602	0	△2.3	1.0	92.6	133
	4期 (2015年7月10日)	9,442	0	△1.7	0.9	92.6	130
第2作成期	5期 (2015年8月10日)	9,707	0	2.8	0.9	93.2	135
	6期 (2015年9月10日)	9,082	0	△6.4	0.9	94.0	126
	7期 (2015年10月13日)	9,188	0	1.2	0.9	94.1	126
	8期 (2015年11月10日)	9,381	0	2.1	0.7	95.3	129
	9期 (2015年12月10日)	9,417	0	0.4	0.8	94.7	129
第3作成期	10期 (2016年1月12日)	8,906	0	△5.4	0.9	92.9	122
	11期 (2016年2月10日)	8,957	0	0.6	0.8	94.0	123
	12期 (2016年3月10日)	9,037	0	0.9	0.8	93.4	124
	13期 (2016年4月11日)	8,959	0	△0.9	0.9	93.6	123
	14期 (2016年5月10日)	9,016	0	0.6	1.0	95.4	124
最終作成期	15期 (2016年6月10日)	9,179	0	1.8	0.9	94.6	126
	16期 (2016年7月11日)	8,891	0	△3.1	0.9	93.5	122
	17期 (2016年8月10日)	9,496	0	6.8	0.8	95.2	129
	18期 (2016年9月12日)	9,393	0	△1.1	0.9	94.5	128
	19期 (2016年10月11日)	9,530	0	1.5	0.9	95.3	130
20期 (2016年11月10日)	9,271	0	△2.7	0.9	94.3	126	
21期 (2016年12月12日)	9,791	0	5.6	0.9	96.1	133	
22期 (2017年1月10日)	9,998	0	2.1	0.8	96.7	132	
	(償還日) 2017年1月27日	(償還価額) 10,024.71		0.3	—	—	131

(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ライオン アジア・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（クラス6）の組入比率。

(注5) 当ファンドは、ライオン アジア・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（クラス6）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18期～最終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
		騰 落 率	騰 落 率		
第18期	(期 首) 2016年 8月10日	円	%	%	%
	8月末	9,496	—	0.8	95.2
	(期 末) 2016年 9月12日	9,387	△1.1	0.9	95.3
第19期	(期 首) 2016年 9月12日	9,393	△1.1	0.9	94.5
	9月末	9,393	—	0.9	94.5
	(期 末) 2016年10月11日	9,316	△0.8	0.9	96.2
第20期	(期 首) 2016年10月11日	9,530	1.5	0.9	95.3
	10月末	9,530	—	0.9	95.3
	(期 末) 2016年11月10日	9,446	△0.9	0.9	95.4
第21期	(期 首) 2016年11月10日	9,271	△2.7	0.9	94.3
	11月末	9,271	—	0.9	94.3
	(期 末) 2016年12月12日	9,590	3.4	0.9	96.1
第22期	(期 首) 2016年12月12日	9,791	5.6	0.9	96.1
	12月末	9,791	—	0.9	96.1
	(期 末) 2017年 1月10日	9,871	0.8	0.8	96.6
最終期	(期 首) 2017年 1月10日	9,998	2.1	0.8	96.7
	(償還日) 2017年 1月27日	(償還価額) 10,024.71	—	0.8	96.7
			0.3	—	—

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

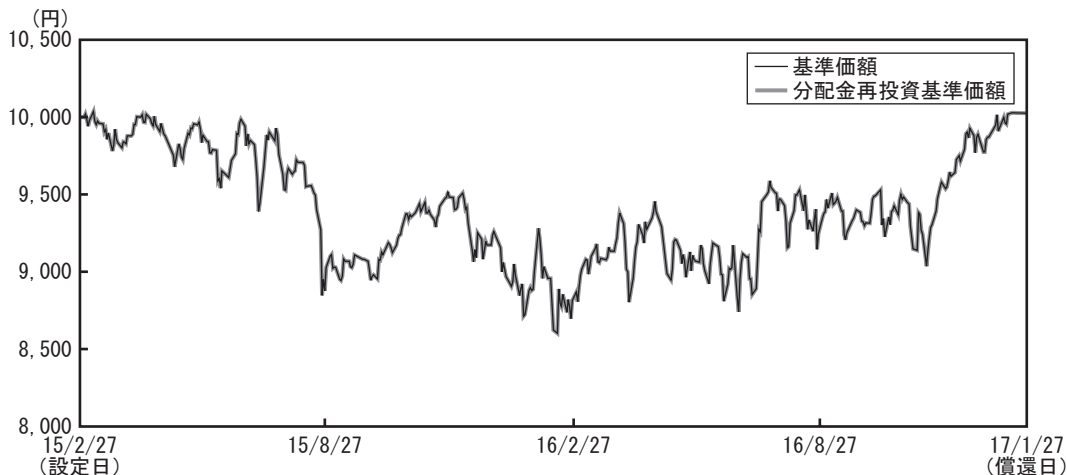
(注2) 債券組入比率はマネープールマザーファンドへの投資割合に応じて算出された当ファンドベースの組入比率。

(注3) 投資信託証券組入比率はライオン アジア・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（クラス6）の組入比率。

(注4) 当ファンドは、ライオン アジア・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（クラス6）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。

設定以来の運用経過（2015年2月27日（設定日）～2017年1月27日（償還日））

■ 基準価額の推移



設定日：10,000円

償還日：10,024円71銭（期中分配金合計0円）

騰落率：0.2%（分配金再投資基準価額ベース）

- ・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、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、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、ライオン アジア・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（クラス6）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いません。

■ 基準価額の主な変動要因

設定来の基準価額の騰落率は、0.2%の上昇となりました。

主要投資対象である「ライオン アジア・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（クラス6）」は、債券部分がプラス寄与した一方、為替部分がマイナス寄与し、基準価額の騰落率はほぼ横ばいとなりました。

■投資環境

アジア・ハイ・イールド債市場は、ファンド設定以降、概ね上昇基調で推移しました。

中国やインドネシアなどアジア各国中央銀行による継続的な金融緩和を背景に、アジア・ハイ・イールド債市場は、ファンド設定当初から堅調に推移しました。ギリシャ問題の再燃や中国の景気鈍化懸念等を受けて市場参加者のリスク回避姿勢が強まり、2015年半ばにかけて下落しましたが、各国中央銀行による低金利政策等を背景に主要国の国債利回りが過去最低水準で推移する中、相対的に高い利回り水準にあるアジア・ハイ・イールド債市場への資金流入傾向が続き、再び上昇基調となりました。2016年には、英国のEU（欧州連合）離脱を巡る国民投票でEU離脱が支持されたことや、11月の米国大統領選挙において予想外にトランプ氏が勝利したこと等を受けて下落する局面もありましたが、2017年に入ると、アジア・ハイ・イールド債市場は再び上昇する展開となりました。

為替市場は、通期では、円高新興国通貨安となりました。

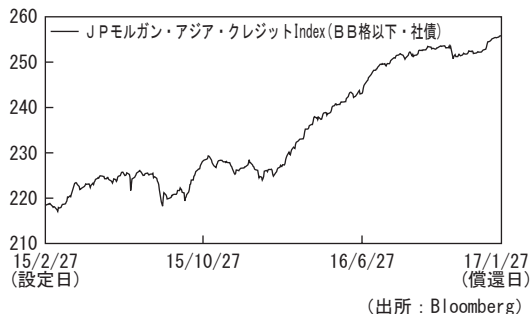
2015年は8月から9月にかけては、中国景気や原油安への懸念から、市場のリスク回避的な動きが強まり、新興国通貨は円に対して大きく売られました。その後は、米国の利上げ観測を巡る思惑により、相場が変動しました。利上げ観測が後退した10月には、新興国通貨の下落は一服しましたが、利上げ観測が高まった12月にかけては、新興国通貨が再び売られる展開となりました。

2016年は1月から3月にかけては、株式市場が軟調な展開となったことを受けて、市場のリスク回避的な動きが強まり、円高新興国通貨安となりました。4月に入り、日本の為替介入のハードルが高いとの見方が広がったことや、日銀が金融政策決定会合で追加緩和を見送ったことなどから、円は買われました。その後も6月の決定会合でも追加緩和が見送られ、7月の決定会合においても、日銀の追加緩和策がETFの買入れ額増大にとどまったことから、円の堅調地合いが続きしました。

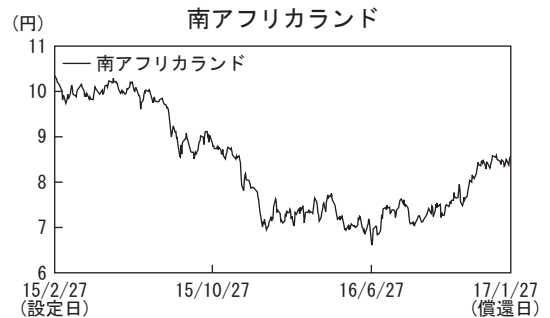
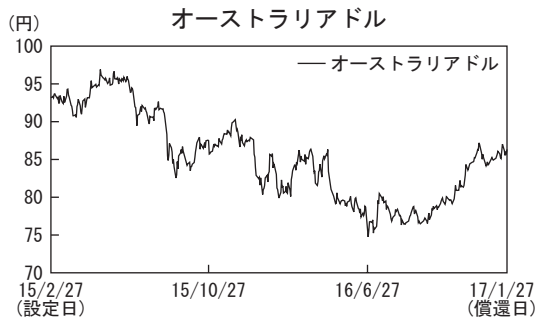
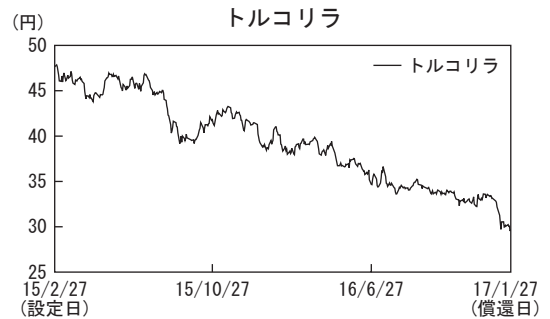
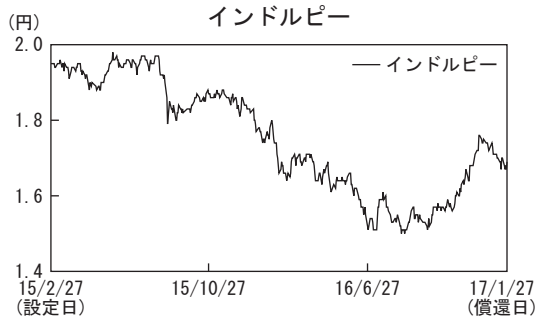
その後は、11月上旬に米国大統領選でトランプ氏が勝利し、米国金利が大幅に上昇したことから、ドル高が急速に進み、新興国通貨と円がともに売られる展開となりました。円は2016年の年初以降大幅に買われていた反動から特に下落幅が大きくなり、期末にかけては、対円では新興国通貨高が進みました。

通期では、対象となる10通貨は、いずれも対円で下落しました。

市況の推移

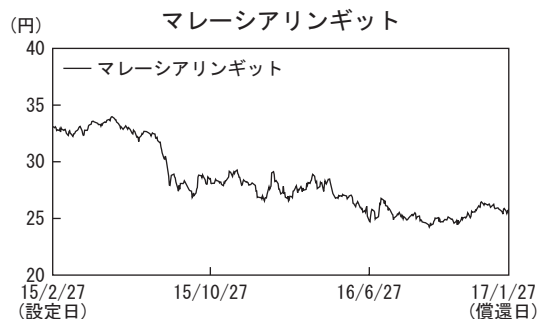
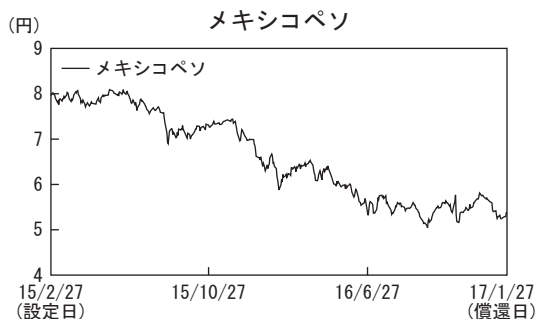
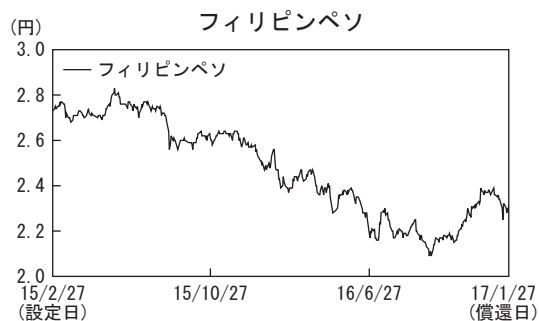
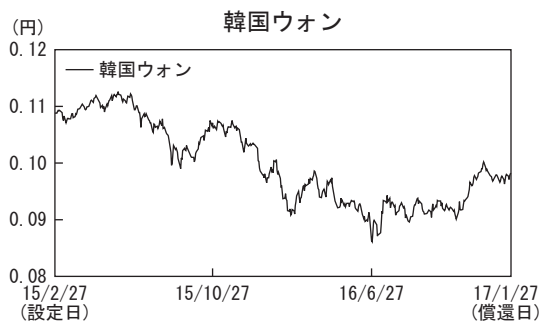


参考為替レートの推移（対円）



(出所：Bloombergおよび投資信託協会)

(注) 為替レートは対顧客電信売買相場の仲値を使用しております。



(出所：Bloombergおよび投資信託協会)

(注) 為替レートは対顧客電信売買相場の仲値を使用しております。

■当該投資信託のポートフォリオ

期を通じて、「ライオン アジア・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（クラス6）」の投資比率を高位に維持した後、2017年1月16日に全売却しました。

（ライオン アジア・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（クラス6））（2015年2月27日～2017年1月16日）

アジア・ハイ・イールド債券利回りが低下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。

通貨選択については、各通貨の騰落率、利回りやオプションプレミアムの推移、各国の経済状況や政治状況等を勘案して行いました。

（マネープールマザーファンド）（2015年2月27日～2017年1月16日）

安全性、流動性の高い残存期間1年未満の公社債を中心に運用を行いました。

残存期間を1年未満のプラス利回りの公社債で運用することで、ポートフォリオ全体の利回りを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

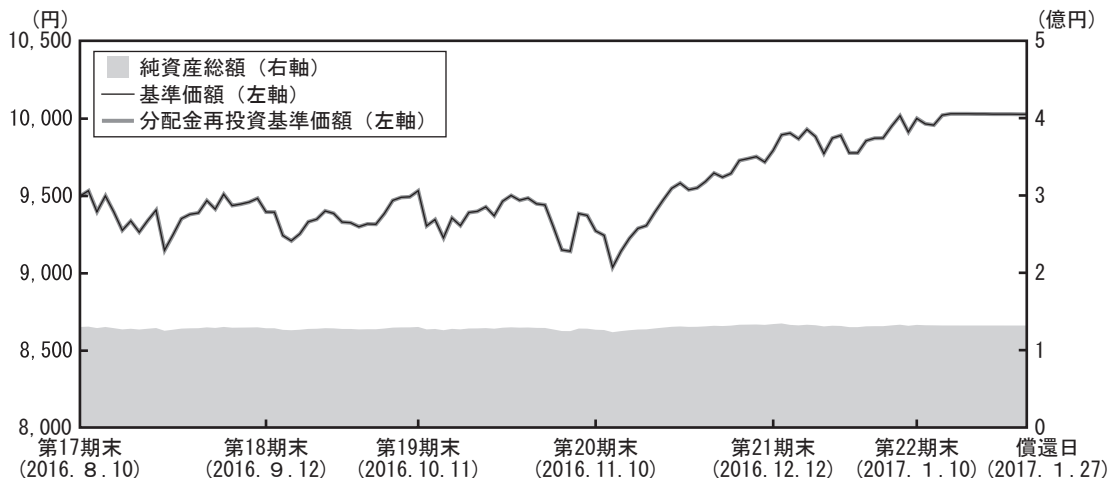
当ファンドは、ライオン アジア・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（クラス6）の投資比率を可能な限り高位に保ちますが、本投資信託のコンセプトに適った指数等が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は記載しておりません。

■分配金

基準価額の水準等を勘案し、全運用期間を通じて無分配としました。

最終作成期の運用経過（2016年8月11日～2017年1月27日（償還日））

■基準価額の推移



第18期首：9,496円
 償還時：10,024円71銭（期中分配金合計0円）
 騰落率：5.6%（分配金再投資基準価額ベース）

- ・分配金再投資基準価額の推移は、2016年8月10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、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、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、ライオン アジア・ハイ・イールド・債券・ファンド（クラス6）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

主要投資対象である「ライオンアジア・ハイ・イールド・債券・ファンド（クラス6）」は、主に債券部分がプラスに寄与し、基準価額の騰落率はプラスとなりました。

■投資環境

当期のアジア・ハイ・イールド債市場は上昇しました。

米国や欧州など主要国の国債利回りが低水準で推移する中、アジア・ハイ・イールド債市場は期初から堅調に推移しました。11月の米国大統領選挙では、予想外にトランプ氏が勝利し、同氏の掲げる財政刺激策への期待やインフレ観測が高まり、米国国債が急落する中、アジア・ハイ・イールド債市場も急落する展開となりました。1月に入ると、アジア・ハイ・イールド債市場への旺盛な投資需要を背景に再び上昇基調へと転じ、前期末比では上昇して期を終えました。

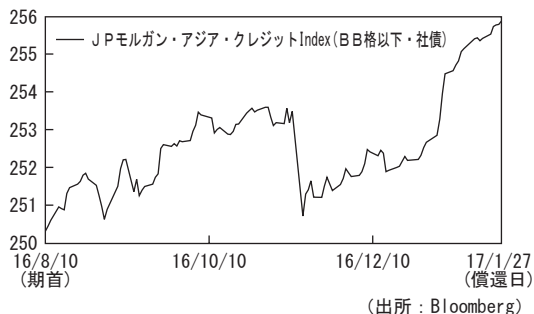
新興国の為替市場は概ね円に対して堅調に推移しました。

8月から10月末にかけては、概ね横ばい圏で方向感に欠ける動きとなりました。

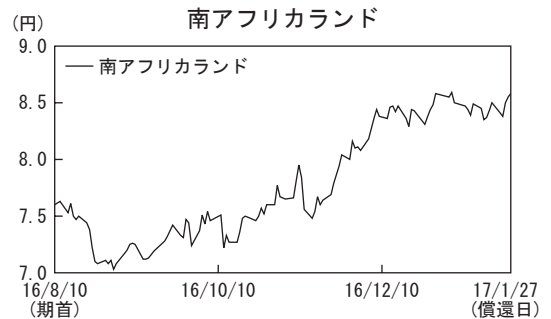
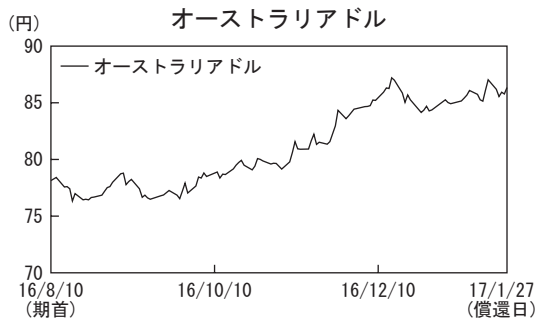
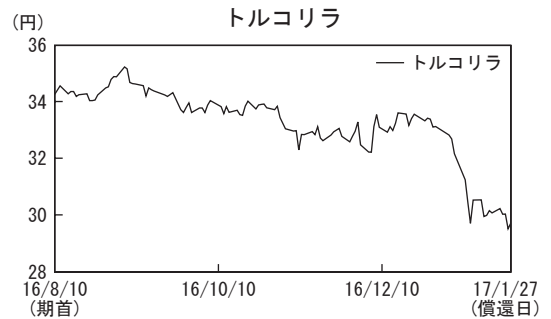
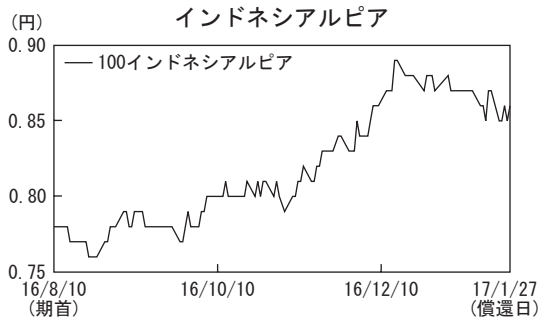
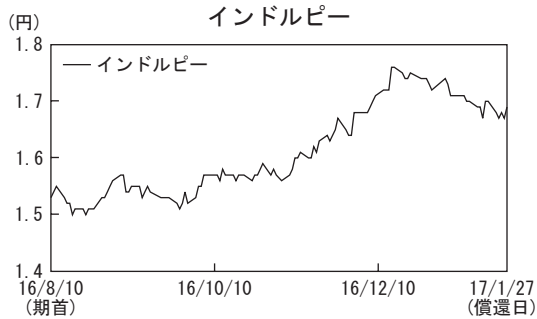
その後、11月上旬に米国大統領選でトランプ氏が勝利し、米国金利が大幅に上昇したことから、ドル高が急速に進み、新興国通貨と円がともに売られる展開となりました。円は2016年の年初以降大幅に買われていた反動から特に下落幅が大きくなり、対円では新興国通貨高が進みました。

通期では、対象となる10通貨のうち、トルコリラ、メキシコペソ以外は、いずれも対円で上昇しました。

市況の推移

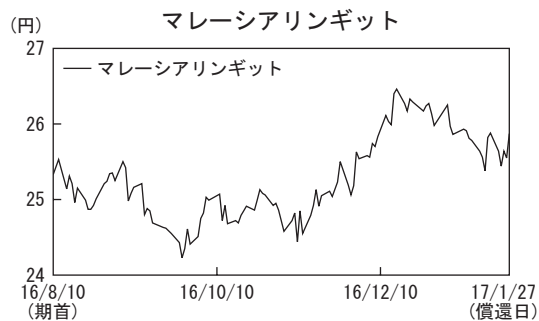
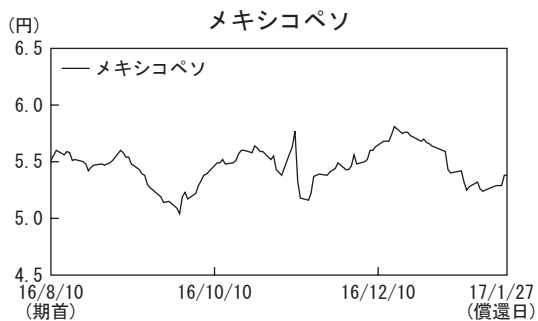
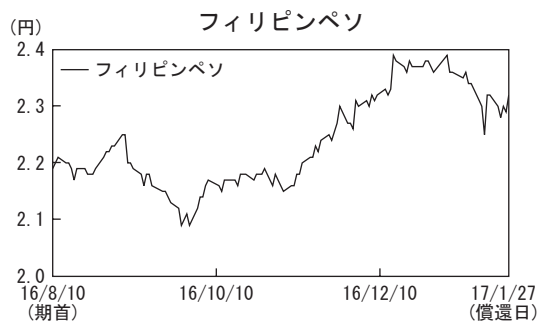
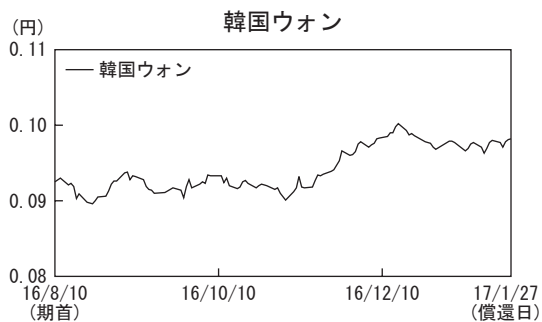


参考為替レートの推移（対円）



(出所：Bloombergおよび投資信託協会)

(注) 為替レートは対顧客電信売買相場の仲値を使用しております。



(出所：Bloombergおよび投資信託協会)

(注) 為替レートは対顧客電信売買相場の仲値を使用しております。

■当該投資信託のポートフォリオ

期を通じて、「ライオン アジア・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（クラス6）」の投資比率を高位に維持した後、2017年1月16日に全売却しました。

（ライオン アジア・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（クラス6））（2016年8月11日～2017年1月16日）

アジア・ハイ・イールド債券利回りが上昇（価格は下落）した一方、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。

通貨選択については、各通貨の騰落率、利回りやオプションプレミアムの推移、各国の経済状況や政治状況等を勘案して行いました。

8月末はブラジルレアルとオーストラリアドル、9月末は南アフリカランドと韓国ウォン、10月末はブラジルレアルとインドネシアルピア、11月末はオーストラリアドルと南アフリカランド、12月末は引き続きオーストラリアドルと南アフリカランドの通貨をそれぞれ選択しました。

（マネープールマザーファンド）（2016年8月11日～2017年1月16日）

安全性、流動性の高い残存期間1年未満の公社債を中心に運用を行いました。

残存期間を1年未満のプラス利回りの公社債で運用することで、ポートフォリオ全体の利回りを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、ライオン アジア・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（クラス6）の投資比率を可能な限り高位に保ちますが、本投資信託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、分配を行いませんでした。

<分配原資の内訳>

（単位：円、1万口当たり・税引前）

項目	第18期	第19期	第20期	第21期	第22期
	2016年8月11日 ～2016年9月12日	2016年9月13日 ～2016年10月11日	2016年10月12日 ～2016年11月10日	2016年11月11日 ～2016年12月12日	2016年12月13日 ～2017年1月10日
当期分配金	－	－	－	－	－
（対基準価額比率）	－%	－%	－%	－%	－%
当期の収益	－	－	－	－	－
当期の収益以外	－	－	－	－	－
翌期繰越分配対象額	2,200	2,288	2,373	2,374	2,374

（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。

<償還を迎えて>

当ファンドは、2017年1月27日をもちまして信託期間を終了し、繰上償還とさせていただきますこととなりました。受益者の皆様のご愛顧に心より御礼を申し上げます。誠にありがとうございました。

■ 1万口当たりの費用明細

項目	第18期～最終期		項目の概要
	(2016年8月11日～2017年1月27日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	44円	0.460%	(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9,584円です。
（投信会社）	(17)	(0.175)	ファンドの運用の対価
（販売会社）	(26)	(0.270)	購入後の情報提供、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	44	0.460	

(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

(2016年8月11日から2017年1月27日まで)

		第 18 期 ~ 最 終 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外国 (邦貨建)	Lion Global Investors Asian High Yield Bond Fund Class 6 (JPY)	千口	千円	千口	千円
		4.753	4,000	143.047 (-)	131,753 (-)

(注1) 金額は受渡代金。

(注2) 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3) 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

(2016年8月11日から2017年1月27日まで)

		第 18 期 ~ 最 終 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
		-	-	1,297	1,301

(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 (2016年8月11日から2017年1月27日まで)

当ファンド及びマザーファンドにおける第18期～最終期中の利害関係人との取引はございません。

■自社による当ファンドの設定・解約状況

期首残高(元本)	当期設定元本	当期解約元本	期末残高(元本)	取 引 の 理 由
万円 12,045	万円 -	万円 -	万円 12,045	当初運用時における取得

■組入資産の明細

○投資信託証券（邦貨建）

（2017年1月27日現在）

銘	柄	期首(第17期末)	償 還 時		
		口 数	口 数	評 価 額	比 率
Lion Global Investors Asian High Yield Bond Fund Class 6 (JPY)		千口 138.294	千口 —	千円 —	% —
合 計	口 数、金 額 銘 柄 数 <比 率>	138.294	—	—	—
		1銘柄<95.2%>	—<—>	—	—

（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

（2017年1月27日現在）

	期 首(第17期末)	償 還 時		
	口 数	口 数	評 価 額	比 率
マネープールマザーファンド	千口 1,297	千口 —	千円 —	% —

（注）単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

（2017年1月27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 131,940	% 100.0
投 資 信 託 財 産 総 額	131,940	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

(2016年9月12日現在) (2016年10月11日現在) (2016年11月10日現在) (2016年12月12日現在) (2017年1月10日現在) (2017年1月27日現在)

項目	第18期末	第19期末	第20期末	第21期末	第22期末	償還時
a 資産	128,610,104円	130,121,353円	126,547,709円	133,897,395円	132,827,399円	131,940,625円
コール・ローン等	6,058,535	4,856,172	5,987,525	4,125,842	3,183,894	131,940,625
投資信託証券(評価額)	121,250,370	123,963,852	119,258,855	128,470,224	128,342,306	—
マネーブルマザー ファンド(評価額)	1,301,199	1,301,329	1,301,329	1,301,329	1,301,199	—
b 負債	260,151	101,096	104,423	144,930	123,397	65,691
未払解約金	144,443	—	—	32,014	19,187	—
未払信託報酬	115,470	100,854	104,175	112,683	103,951	64,662
未払利息	—	—	—	—	—	1,029
その他未払費用	238	242	248	233	259	—
c 純資産総額(a-b)	128,349,953	130,020,257	126,443,286	133,752,465	132,704,002	131,874,934
元本	136,649,496	136,425,915	136,391,514	136,611,491	132,729,313	131,549,850
次期繰越損益金	△ 8,299,543	△ 6,405,658	△ 9,948,228	△ 2,859,026	△ 25,311	—
償還差損益金	—	—	—	—	—	325,084
d 受益権総口数	136,649,496口	136,425,915口	136,391,514口	136,611,491口	132,729,313口	131,549,850口
1万口当たり基準価額(c/d)	9,393円	9,530円	9,271円	9,791円	9,998円	—
1万口当たり償還価額(c/d)	—	—	—	—	—	10,024円71銭

(注1) 期末における1口当たりの純資産総額

第18期0.9393円、第19期0.9530円、第20期0.9271円、第21期0.9791円、第22期0.9998円、償還時1.002471円

(注2) 期末における元本の欠損金額

第18期8,299,543円、第19期6,405,658円、第20期9,948,228円、第21期2,859,026円、第22期25,311円

■損益の状況

自2016年8月11日 自2016年9月13日 自2016年10月12日 自2016年11月11日 自2016年12月13日 自2017年1月11日
至2016年9月12日 至2016年10月11日 至2016年11月10日 至2016年12月12日 至2017年1月10日 至2017年1月27日

項目	第18期	第19期	第20期	第21期	第22期	最終期
a 配当等収益	1,243,006円	1,265,335円	1,265,280円	△ 325円	△ 226円	△ 3,854円
受取配当金	1,243,383	1,265,616	1,265,616	—	—	—
支払利息	△ 377	△ 281	△ 336	△ 325	△ 226	△ 3,854
b 有価証券売買損益	△ 2,538,765	715,677	△ 4,704,693	7,209,260	2,845,780	415,156
売買益	2,212	715,570	298	7,211,369	2,873,029	415,387
売買損	△ 2,540,977	107	△ 4,704,991	△ 2,109	△ 27,249	△ 231
c 信託報酬等	△ 115,708	△ 101,096	△ 104,390	△ 112,916	△ 104,210	△ 64,662
d 当期損益金(a+b+c)	△ 1,411,467	1,879,916	△ 3,543,803	7,096,019	2,741,344	346,640
e 前期繰越損益金	△ 6,006,331	△ 7,400,708	△ 5,517,795	△ 9,057,753	△ 1,894,845	842,504
f 追加信託差損益金	△ 881,745	△ 884,866	△ 886,630	△ 897,292	△ 871,810	△ 864,060
(配当等相当額)	(706,237)	(721,463)	(729,144)	(794,314)	(772,553)	(765,804)
(売買損益相当額)	(△ 1,587,982)	(△ 1,606,329)	(△ 1,615,774)	(△ 1,691,606)	(△ 1,644,363)	(△ 1,629,864)
g 合計(d+e+f)	△ 8,299,543	△ 6,405,658	△ 9,948,228	△ 2,859,026	△ 25,311	325,084
次期繰越損益金(g)	△ 8,299,543	△ 6,405,658	△ 9,948,228	△ 2,859,026	△ 25,311	325,084
追加信託差損益金	△ 881,745	△ 884,866	△ 886,630	△ 897,292	△ 871,810	—
(配当等相当額)	(706,237)	(721,463)	(729,144)	(794,314)	(772,553)	(—)
(売買損益相当額)	(△ 1,587,982)	(△ 1,606,329)	(△ 1,615,774)	(△ 1,691,606)	(△ 1,644,363)	(—)
分配準備積立金	29,365,753	30,503,614	31,649,877	31,637,393	30,749,098	—
繰越損益金	△ 36,783,551	△ 36,024,406	△ 40,711,475	△ 33,599,127	△ 29,902,599	—

(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18期～最終期）

第18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	136,887,773円
期中追加設定元本額	40,334円
期中一部解約元本額	278,611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（1,128,074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（706,237円）及び分配準備積立金（28,237,679円）を対象収益（30,071,990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、分配を行わないことに決定しました。

第19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	136,649,496円
期中追加設定元本額	75,902円
期中一部解約元本額	299,483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（1,201,358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（721,463円）及び分配準備積立金（29,302,256円）を対象収益（31,225,077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、分配を行わないことに決定しました。

第20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	136,425,915円
期中追加設定元本額	34,743円
期中一部解約元本額	69,144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（1,161,523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（729,144円）及び分配準備積立金（30,488,354円）を対象収益（32,379,021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、分配を行わないことに決定しました。

第21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	136,391,514円
期中追加設定元本額	275,855円
期中一部解約元本額	55,878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（328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（794,314円）及び分配準備積立金（31,637,065円）を対象収益（32,431,707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、分配を行わないことに決定しました。

第22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	136,611,491円
期中追加設定元本額	3,538円
期中一部解約元本額	3,885,716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（462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（772,553円）及び分配準備積立金（30,748,636円）を対象収益（31,521,651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、分配を行わないことに決定しました。

最終期

- ・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	132,729,313円
期中追加設定元本額	500円
期中一部解約元本額	1,179,963円

■投資信託財産運用総括表

信託期間	投資信託契約締結日	2015年2月27日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2017年1月27日		資産総額	131,940,625円
区分	投資信託契約締結当初	投資信託契約終了時	差引増減または追加信託	負債総額	65,691円
受益権口数	100,000,000口	131,549,850口	31,549,850口	純資産総額	131,874,934円
元本額	100,000,000円	131,549,850円	31,549,850円	受益権口数	131,549,850口
				1万円当たり償還金	10,024円71銭
毎計算期末の状況					
計算期	元本額	純資産総額	基準価額	1万円当たりの分配金	
				金額	分配率
	円	円	円	円	%
第1期	141,923,635	141,959,822	10,003	0	—
第2期	138,314,423	135,924,479	9,827	0	—
第3期	138,690,358	133,164,194	9,602	0	—
第4期	138,731,402	130,987,312	9,442	0	—
第5期	139,440,462	135,357,486	9,707	0	—
第6期	139,028,513	126,271,494	9,082	0	—
第7期	138,152,367	126,928,745	9,188	0	—
第8期	137,972,114	129,424,961	9,381	0	—
第9期	137,936,022	129,889,196	9,417	0	—
第10期	138,070,633	122,963,277	8,906	0	—
第11期	137,931,942	123,541,785	8,957	0	—
第12期	138,019,979	124,735,261	9,037	0	—
第13期	138,014,840	123,650,532	8,959	0	—
第14期	137,833,686	124,271,059	9,016	0	—
第15期	137,889,885	126,568,062	9,179	0	—
第16期	137,866,789	122,573,409	8,891	0	—
第17期	136,887,773	129,987,147	9,496	0	—
第18期	136,649,496	128,349,953	9,393	0	—
第19期	136,425,915	130,020,257	9,530	0	—
第20期	136,391,514	126,443,286	9,271	0	—
第21期	136,611,491	133,752,465	9,791	0	—
第22期	132,729,313	132,704,002	9,998	0	—

■償還金のお知らせ

1万円当たりの償還金（税引前）	10,024円71銭
-----------------	------------

<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	■ライオン アジア・ハイ・イールド・ボンド・ファンド (クラス6) (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6))
形態	ケイマン籍外国投資信託 (円建て)
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主として日本を除くアジア (オセアニアを含む) ※¹のハイ・イールド債券 (米ドル建て等) ※²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。 ※1 「中国・香港・インドネシア・インド・韓国・マレーシア・フィリピン・シンガポール・タイ・台湾・オーストラリア等」が主な投資対象国となります。 ※2 ハイ・イールド債券とは、格付機関によってBB格以下に格付される債券を表します。信用力が低いため、その見返りとして高い利回りとなる傾向があります。 ・相対的に流動性、金利水準が高い通貨 (セレクト通貨※³) を選択し、当該通貨を通じた為替取引を行う「通貨セレクト戦略」を活用し、プレミアム収入 (金利差相当分の収益) の獲得を目指します。 ※3 原則として流動性 (オプション含む) ・金利状況・ファンダメンタルズ等を総合的に勘案して、3～6通貨の選定を行います。必ずしも相対的に金利の高い上位通貨から選定されるとは限りません。セレクト通貨及び通貨数は定期的に見直しを行い、今後変更となる可能性があります。 ・また、セレクト通貨毎に保有金額の一部または全部にかかるコールオプション (対米ドル) を売却する「通貨オプション・プレミアム (カバードコール) 戦略」を活用し、オプションのプレミアム収入の獲得を目指します。 ・為替取引及び「通貨オプション・プレミアム (カバードコール) 戦略」については損保ジャパン日本興亜アセットマネジメントの助言に基づき、ライオングローバルインベスターズが取引を執行します。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> 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。 <有価証券の発行者等に関するエクスポージャー> ④債券部分：1発行体10%以内 <取引の相手方に対するエクスポージャー> ⑤為替取引及び通貨カバード・コール部分の合計：評価益ベースで10%以内
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%</p> <p>※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。</p> <p>※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> <p>※上記には、損保ジャパン日本興亜アセットマネジメントへの助言報酬0.05%が含まれます。</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
副投資顧問会社	<為替取引及び通貨オプション取引の助言> 損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社

※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

(2015年1月1日から2015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 (△)	△ 5,646,819
為替差損	△ 1,008,079
受取利息	1,083
その他収益	56,188
収益合計	△ 6,597,627

費用

投資運用報酬	1,852,506
管理報酬	115,430
監査報酬	34,346
保管報酬	32,846
名義書換費用	9,955
受託者報酬	51,250
その他営業費用	26,266
営業費用合計	2,122,599

営業損失 △ 8,720,226

分配金 △106,823,502

税引前・分配後損失 △115,543,728

税金 —

税引後・分配後損失 △115,543,728

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 △115,543,728

主要投資対象のひとつである投資信託証券「ライオン アジア・ハイ・イールド・ボンド・ファンド」の財務諸表の一部を委託会社にて抜粋・翻訳したものです。

■組入上位銘柄

(2015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
LOGAN PROPERTY HOLDINGS 9 3/4% Due 8/12/2017 JD8	中国	9.750%	2017/12/8	4.10%
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD 12 1/2% Due 16/10/2017 A016	中国	12.500%	2017/10/16	3.85%
COUNTRY GARDEN HLDG CO 7 1/2% Due 9/3/2020 MS9	中国	7.500%	2020/3/9	3.56%
CHINA SCE PROPERTY HOLDINGS 11 1/2% Due 14/11/2017 MN14	中国	11.500%	2017/11/14	3.41%
WEST CHINA CEMENT LTD 6 1/2% Due 11/9/2019 MS11	中国	6.500%	2019/9/11	3.29%
ROYAL CAPITAL BV 6 1/4% Due 29/5/2049 MN5	フィリピン	6.250%	2049/5/29	3.12%
KWG PROPERTY HOLDINGS LTD 13 1/4% Due 22/3/2017 MS22	中国	13.250%	2017/3/22	2.99%
WANDA PROPERTIES INTL CO 7 1/4% Due 29/1/2024 JJ29	中国	7.250%	2024/1/29	2.83%
LONGFOR PROPERTIES 6 7/8% Due 18/10/2019 A018	中国	6.875%	2019/10/18	2.73%
MODERNLAND OVERSEAS PTE 11% Due 25/10/2016 A025	インドネシア	11.000%	2016/10/25	2.51%

「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バ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5期（決算日 2016年8月10日）

＜計算期間 2015年8月11日～2016年8月10日＞

マネープールマザーファンド第5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

(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	率	
(期 首) 2015年8月10日	円	10,024	% —	% 93.8
8月末		10,024	0.0	92.0
9月末		10,025	0.0	81.8
10月末		10,025	0.0	72.9
11月末		10,025	0.0	69.1
12月末		10,022	△0.0	82.9
2016年1月末		10,025	0.0	79.5
2月末		10,025	0.0	74.6
3月末		10,025	0.0	75.5
4月末		10,028	0.0	91.1
5月末		10,029	0.0	87.6
6月末		10,031	0.1	75.1
7月末		10,028	0.0	77.6
(期 末) 2016年8月10日		10,027	0.0	84.1

(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おりません。

■投資環境

短期金利は当初0%を挟んだ極めて低位な水準で推移しました。その後、2016年1月末に日本銀行が追加金融緩和策として、付利金利のマイナス化を決定したことから、短期の国債金利は完全にマイナスとなり、以後マイナスが継続しています。

■当該投資信託のポートフォリオ

安全性、流動性の高い残存期間1年未満の社債を中心に運用を行い、ポートフォリオ全体の利回りを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、流動性の高い残存期間1年未満の公社債を中心とした運用を行う方針です。

■ 1万口当たりの費用明細

(2015年8月11日から2016年8月10日まで)

項	目	
そ	の	他
の	他	費
の	他	用
(そ	の	他)
合	計	0円
		(0)
		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14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

(2015年8月11日から2016年8月10日まで)

		買	付	額	売	付	額
国	国	債	証	券	千円	千円	—
				1,102,694	(2,000,000)		
	特	殊	債	券	—	(100,000)	
内	社	債	券	2,412,046	(2,100,000)		

(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

(2015年8月11日から2016年8月10日まで)

買		付	売		付
銘	柄	金	銘	柄	金
		額			額
		千円			千円
275	10年国債	702,226			
93	5年国債	400,468			
526	東京電力	101,551			
3	東日本旅客鉄道	101,496			
451	関西電力	101,263			
35	三井化学	101,176	—		—
4	フジメディアHD	100,954			
521	東京電力	100,855			
355	中国電力	100,696			
90	丸紅	100,486			

(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 (2015年8月11日から2016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

下記はマネープールマザーファンド（1,545,708千円）の内容です。

(1) 国内（邦貨建）公社債（種類別）

(2016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	%	%	%	%	%
普 通 社 債 券	1,300,000 (1,300,000)	1,303,110 (1,303,110)	84.1 (84.1)	— (—)	— (—)	— (—)	84.1 (84.1)
合 計	1,300,000 (1,300,000)	1,303,110 (1,303,110)	84.1 (84.1)	— (—)	— (—)	— (—)	84.1 (84.1)

(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）

(2016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	
普 通 社 債 券	355	中国電力	1.5200	100,000	100,056	2016/08/25
	23	GEキャピタル	0.4500	100,000	100,000	2016/09/20
	451	関西電力	1.8500	100,000	100,186	2016/09/20
	35	三井化学	2.0900	100,000	100,475	2016/11/07
	300	北陸電力	0.5000	100,000	100,129	2016/11/30
	3	興銀リース	0.2670	100,000	100,049	2016/12/02
	4	フジメディアHD	1.0660	100,000	100,337	2016/12/20
	25	日産フィナンシャル	0.2120	100,000	100,039	2016/12/20
	425	九州電力	0.2810	100,000	100,099	2017/02/24
	22	日新製鋼	0.3300	100,000	100,089	2017/03/10
	6	ノルデア・バンク	0.2880	100,000	100,082	2017/05/26
	526	東京電力	1.7800	100,000	101,199	2017/05/31
	90	丸紅	0.5200	100,000	100,363	2017/07/26
合 計		13銘柄	—	1,300,000	1,303,110	—

(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

(2016年8月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公 社 債	1,303,110	79.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	347,249	21.0
投 資 信 託 財 産 総 額	1,650,359	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

(2016年8月10日現在)

項 目	当 期 末
a 資産	1,650,359,641円
コール・ローン等	344,110,538
公社債(評価額)	1,303,110,600
未収利息	2,764,725
前払費用	373,778
b 負債	100,486,000
未払金	100,486,000
c 純資産総額(a-b)	1,549,873,641
元本	1,545,708,212
次期繰越損益金	4,165,429
d 受益権総口数	1,545,708,212口
1万口当たり基準価額(c/d)	10,027円

(注1) 信託財産に係る期首元本額2,129,643,308円、期中追加設定元本額3,082,412円、期中一部解約元本額587,017,508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	340,245,518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	74,464,092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	80,164,418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	7,231,419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	12,527,708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	23,732,956円
日米4資産スマートバランス	999,685,242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	6,049,055円
日米4資産スマートバランス(DC年金)	310,367円
アジア・ハイ・イールド債券(毎月分配型)通貨セレクト・プレミアムコース	1,297,437円

(注3) 期末における1口当たりの純資産総額 1.0027円

■損益の状況

(2015年8月11日から2016年8月10日まで)

項 目	当 期
a 配当等収益	14,437,780円
受取利息	14,502,623
支払利息	△ 64,843
b 有価証券売買損益	△13,806,500
売買損	△13,806,500
c 信託報酬等	△ 8,258
d 当期損益金(a+b+c)	623,022
e 前期繰越損益金	5,027,777
f 解約差損益金	△ 1,492,958
g 追加信託差損益金	7,588
h 合計(d+e+f+g)	4,165,429
次期繰越損益金(h)	4,165,429

(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、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。