

| ファンド名 | 回号 | 期待最終リターン | 早期償還 遅延予想 | 発現したリスク項目・備考 |
|---|----|----------|--------------|---|
| ペルー小口債務者支援プロジェクト (円建て、ソル建て) | 全号 | A | 遅遅 | コロナ渦の影響で債権回収に遅延 |
| 欧州3か国個人向けローン・ファンド (ハイイールド型、為替ヘッジあり/なし) | 全号 | E | 遅遅 | 債権回収の成績悪化 |
| 欧州3か国個人向けローン・ファンド (バランス型、為替ヘッジあり/なし) | 全号 | D | 遅遅 | 債権回収の成績悪化 |
| 欧州3か国個人向けローン・ファンド (リスク低減型、為替ヘッジなし) | 全号 | C | 遅遅 | 債権回収の成績悪化 |
| 北欧個人向けローン・ファンド (為替ヘッジあり/なし) | 全号 | B | 遅遅 | ・再投資案件の不足 ・債権回収の成績悪化 |
| 東欧金融事業者支援ファンド (ユーロ建て、メキシコペソ建て、円建て 為替ヘッジあり) | 全号 | A | | |
| マイクロローン事業者ファンド (ドル建て、ユーロ建て、円建て、 ロシアルーブル建て、ブラジルリアル建て) | 全号 | A | 遅 | 新型コロナウイルス感染症拡大に起因する返済条件の変更 |
| メキシコマイクロローン事業者ファンド (ドル建て、メキシコペソ建て) | 全号 | A | | |
| ユーラシア金融事業者ファンド | 全号 | A | | |
| ユーラシアオンライン金融事業者ファンド | 全号 | A | | |
| ニカラグア金融事業者支援ファンド | 全号 | E | 遅遅 | ・ニカラグアの政情不安による財務状況の悪化 ・接収済みの不動産担保を売却予定 |
| ペルー協同組合支援ファンド | 全号 | A | | |
| メキシコ女性起業家支援ファンド | 全号 | A | | |
| パキスタン太陽光事業者支援ファンド | 全号 | E | 遅遅 | 新型コロナウイルス感染症拡大等に起因する返済条件の変更 |
| メキシコ省エネ事業支援ファンド | 全号 | A | | |
| コスタリカ省エネ事業者支援ファンド | 全号 | A | | |
| メキシコ太陽光事業者支援ファンド | 全号 | E | 遅遅 | 資金需要者の株式資本調達不調で財務状況が悪化 |
| 東南アジア未電化地域支援プロジェクト | 全号 | E | 遅遅 | ミャンマーの政情不安による財務状況の悪化 |
| 欧州フィンテック事業者支援ファンド (ドル建て、ロシアルーブル建て、円建て) | 全号 | A | | |
| ユーラシア個人向け小口融資事業者支援ファンド (ユーロ建て、円建て) | 全号 | A | | |
| ブルガリア中小企業向けローンファンド | 全号 | A | | |
| ラスベガス商業施設再開発事業者支援ファンド | 全号 | E | 遅遅 | ・債務者の不動産処分により回収予定 ・回収のための法的処理等により費用増大 |
| シンガポール広告代理店ベンチャー企業支援ファンド (ドル建て、円建て、シンガポールドル建て) | 全号 | E | 遅遅 | ・2020年12月に一部弁済を受領し、債権残額を債務者の株式と交換 ・将来の株式譲渡価格に応じて回収額が変動する |
| 東アフリカ金融事業者支援ファンド (ドル建て、ケニアシリング建て、 ウガンダシリング建て、 タンザニアシリング建て) | 全号 | A | | |
| モンゴル金融事業者支援ファンド | 全号 | A | | |
| アフリカ未電化地域支援ファンド (ケニアシリング建て、ウガンダシリング建て、 ナイジェリアナイラ建て) | 全号 | A | | |
| リトアニアオンライン金融事業者支援ファンド | 全号 | A | | |

| | | | | |
|-------------------------------------|----|---|----|--|
| ナイジェリア未電化地域支援ファンド | 全号 | B | 遅 | 返済原資が現地銀行口座に確保されているものの、現地の国外送金規制で返済できず |
| インドネシア小水力発電支援ファンド | 全号 | C | 遅遅 | 小水力発電所は稼働を開始したものの、ファンドの返済用資金が自然災害による緊急補修のための費用に回ってしまった。 |
| 中東地域ソーラー事業者支援ファンド | 全号 | A | | |
| キルギスマイクロファイナンス事業者ファンド | 全号 | A | | |
| 中東地域IT商社支援ファンド | 全号 | D | 遅遅 | 半導体不足によるPC等の納入遅れによりメーカーへの預託金が回転せず、また新型コロナウイルスの影響で売掛金の回収も一部遅延があり資金不足となった。返済期日をいつまで延期するか交渉中。 |
| 米国セキュリティベンチャー事業者ファンド | 全号 | C | 遅遅 | 大口契約のキャンセルにより、返済期日を変更することで合意 |
| ロシア公共事業セクター金融事業者ファンド | 全号 | A | | |
| バルカン地域オンライン金融事業者ファンド (ユーロ建て、円建て) | 全号 | A | | |
| ペルー女性事業主向け協同組合支援ファンド | 全号 | A | | |
| 南部メキシコマイクロファイナンス支援ファンド | 全号 | A | | |

| ファンド名 | 回号 | 期待最終リターン | 早期償還遅延予想 | 発現したリスク項目・備考 |
|------------------|----|----------|----------|--------------|
| インドネシア中小企業支援ファンド | 1 | B | 遅 | 債権回収の成績悪化 |
| | 2 | B | 遅 | 同上 |
| | 3 | E | 遅 | 同上 |
| | 4 | E | 遅 | 同上 |
| | 5 | D | 遅 | 同上 |
| | 6 | A | | |

期待される 最終リターンの記号について

- A: ファンド販売と同等の水準を見込んでいる
- B: ファンド販売時よりも低下するがプラスの成績を見込む
- C: プラスの収益は見込むが最終損益がプラスマイナスゼロ近辺を見込む
- D: 最終損益がややマイナスを見込む
- E: 最終損益が相応のマイナスを見込む

早期償還・遅延予想の表記について

- 早: 運用期間がやや短くなることを見込む
- 早早: 運用期間が大幅に短くなることを見込む
- 遅: 運用期間がやや長くなることを見込む
- 遅遅: 運用期間が大幅に長くなることを見込む