

■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	2016年1月14日から2026年4月8日までです。	
運用方針	欧州のハイイールド債を主要投資対象とするユーロ売り／米ドル買いの為替取引を行う、「ストラクチャラ-欧州ハイ・イールド・ボンド (IH5シェアクラス、米ドル)」を主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保と中長期的な投資信託財産の成長を目指して運用を行います。なお、「CAマネーブルファンド (適格機関投資家専用)」への投資も行います。	
主要運用対象	アムンディ・欧州ハイ・イールド債券ファンド (米ドルコース) <年2回決算型>	ストラクチャラ-欧州ハイ・イールド・ボンド (IH5シェアクラス、米ドル) CAマネーブルファンド (適格機関投資家専用)
	ストラクチャラ-欧州ハイ・イールド・ボンド (IH5シェアクラス、米ドル)	欧州のハイイールド債
	CAマネーブルファンド (適格機関投資家専用)	本邦通貨表示の短期公社債
組入制限	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。原則として外貨建資産への直接投資は行いません。	
分配方針	毎決算時 (年2回、原則毎年4月および10月の各8日。休業日の場合は翌営業日) に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益と売買益 (評価益を含みます。) 等の全額とします。分配金額は、委託者が基準価額水準および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には分配を行わないこともあります。	

アムンディ・欧州
ハイ・イールド債券ファンド
(米ドルコース) <年2回決算型>

運用報告書 (全体版)

第20期 (決算日 2025年10月8日)

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚くお礼申し上げます。

当ファンドはこの度、上記の決算を行いました。ここに期中の運用状況についてご報告申し上げます。

今後とも一層のお引き立てを賜りますよう、よろしくご願い申し上げます。

アムンディ・ジャパン株式会社

〒105-0021 東京都港区東新橋1丁目9番2号

お客様サポートライン：050-4561-2500

受付は委託会社の営業日の午前9時から午後5時まで

ホームページアドレス：<https://www.amundi.co.jp/>

< 4964854・4969071 >

■最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額 (分 配 落)	税 分	込 配	み 金	期 騰 落	中 率	投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 証 比 率	投 資 証 券 組 入 証 比 率	純資産総額
16期 (2023年10月10日)	14,673			0		13.9	0.1	98.4	143
17期 (2024年4月8日)	16,485			0		12.3	0.1	97.9	158
18期 (2024年10月8日)	16,791			0		1.9	0.1	98.5	143
19期 (2025年4月8日)	16,729			0	△	0.4	0.1	98.5	107
20期 (2025年10月8日)	18,500			0		10.6	0.1	98.5	107

(注) 当ファンドは運用成果の目標基準となるベンチマークを設けておりません。また、当ファンドと適切に対比できる参考指数はありません。以下同じ。

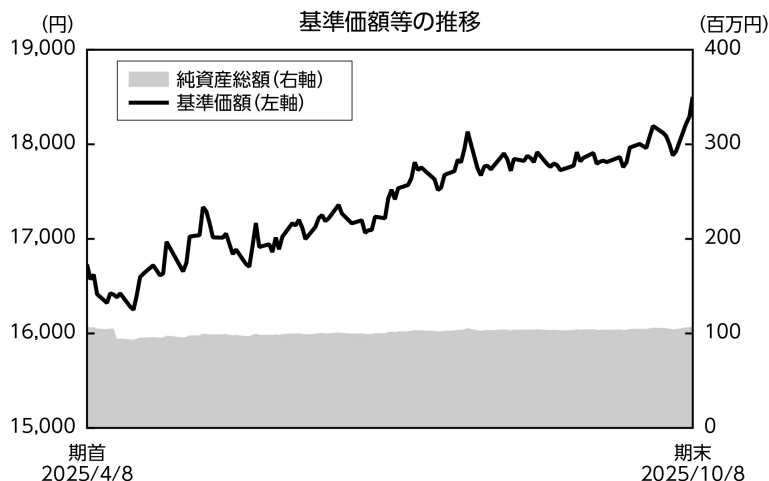
■当期中の基準価額等の推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率	投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 証 比 率	投 資 証 券 組 入 証 比 率
(期 首) 2025年4月8日	16,729	—		0.1
4月末	16,614	△ 0.7		0.1
5月末	16,914	1.1		0.1
6月末	17,196	2.8		0.1
7月末	17,951	7.3		0.1
8月末	17,726	6.0		0.1
9月末	18,086	8.1		0.1
(期 末) 2025年10月8日	18,500	10.6		0.1

(注) 騰落率は期首比です。

【基準価額等の推移】

第20期首	16,729円
第20期末	18,500円
既払分配金 (税込み)	0円
騰落率	10.6%



【基準価額の主な変動要因】

当ファンドの基準価額は、前期末比で上昇しました。

上昇要因

- ・ 4月初め、米国による関税発動を受け、クレジットスプレッド（国債との利回り格差）が大きく拡大したものの、当期を通じてじりじりとスプレッドが縮小したこと
- ・ 為替市場において、当期は米ドル高・円安となったこと
- ・ ユーロ売り／米ドル買いの為替取引により、プレミアム（金利差相当分の収益）を得たこと

下落要因

- ・ 欧州の大規模な財政政策を背景に国債利回りが上昇（債券価格は下落）したこと

【投資環境】

＜欧州ハイイールド債券市場＞

欧州ハイイールド債市場は4月から10月にかけて、強弱が入り混じりつつも、全体としては堅調に推移しました。4月初めには、市場は大きく下落しました。これは、米国による関税発動への懸念の高まりを背景にクレジットスプレッド（国債との利回り格差）が大幅に拡大したことに加え、欧州の大規模な財政政策を受けてドイツ国債利回りが上昇（債券価格は下落）したことが要因です。一方で、インフレ率は引き続き抑制されており、ECB（欧州中央銀行）は利下げを実施しました。4月後半には米国による90日間の関税停止発表を契機にリスク志向が回復し、市場は大きく反発しました。5月には米国の堅調な雇用増加やインフレ鈍化、貿易交渉の進展が好感され、スプレッドは縮小し、市場は力強く上昇しました。6月と7月も好調な企業収益や米国とEU（欧州連合）の貿易合意が支えとなり、緩やかな上昇が続きました。8月以降は、夏場でボラティリティ（価格変動性）が低水準で推移する中、控えめな動きとなりました。

＜為替市場＞

当期、米ドル/円相場は147円台後半で始まり、5月にかけてリスクオフなどから一時的に円高に振れる局面があったものの、6月は一貫して米ドル高基調が優勢となり、7月後半にかけて150円近辺まで上昇しました。当期末にかけては自民党総裁選で高市氏が勝利したことで円安が進み、米ドル/円相場は152円台半ばで当期末を迎えました。

＜日本の短期国債市場＞

当期の短期国債市場では、TDB（国庫短期証券）3ヵ月物利回りが上昇しました。2025年1月に日銀が政策金利を0.5%へと引き上げたことやさらなる利上げ期待により、TDB 3ヵ月物利回りは0.35%近辺まで上昇して推移していましたが、その後も利上げ期待が続いたことで緩やかに上昇し、0.45%近辺まで上昇しました。

【ポートフォリオ】

＜当ファンド＞

当ファンドは、主として欧州のハイイールド債に投資しユーロの為替リスクを米ドルの為替リスクに変換した投資信託証券「ストラクチャラ-欧州ハイ・イールド・ボンド（IH5シェアクラス、米ドル）」を主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保と中長期的な投資信託財産の成長を目指して運用を行いました。当該投資信託証券への投資比率は高位を維持しました。なお、円建の国内籍投資信託「CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）」にも投資を行いました。

（アムンディ・ジャパン株式会社）

＜ストラクチュラ-欧州ハイ・イールド・ボンド（IH5シェアクラス、米ドル）＞

当ファンドは幅広いセクターの新発債に積極的に参加し、魅力的な銘柄を選別して投資しました。割高な発行体へのエクスポージャーは削減し、銀行やヘルスケアなど見通しの良好なセクターへの投資を拡大しました。当期、銀行や電気通信セクターをオーバーウェイトしたことがパフォーマンスにプラスに寄与しました。ベータ戦略や劣後金融債への配分と電気通信セクターにおける銘柄選定が好調で、代表的な指数であるICE BofA European Currency High Yield Constrained Indexを上回る成果を達成しましたが、一部景気循環セクターの影響で相対的なパフォーマンスはやや抑制されました。

(アムンディ・アセットマネジメント)

実質的なユーロ建資産に対し、ユーロ売り／米ドル買いの為替取引を行い、当期を通じて米ドルのエクスポージャーをおおむね100%に維持しました。

(アムンディ・ジャパン株式会社)

＜CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）＞

当期、主として12ヵ月以内に償還を迎える地方債や短期国債への投資により、安定した収益の確保を目指して運用を行いました。

(アムンディ・ジャパン株式会社)

【分配金】

収益分配金につきましては、基準価額水準および市況動向等を勘案した結果、見送りとさせていただきます（分配原資の内訳につきましては、後記の「分配金のお知らせ」をご覧ください）。なお、収益分配に充てず、信託財産内に留保した収益については、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

【今後の運用方針】

＜当ファンド＞

当ファンドが投資する「ストラクチュラ-欧州ハイ・イールド・ボンド（IH5シェアクラス、米ドル）」の組入比率を引き続き高位に保ちます。なお、「CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）」への投資も行います。

(アムンディ・ジャパン株式会社)

＜ストラクチュラ-欧州ハイ・イールド・ボンド（IH5シェアクラス、米ドル）＞

当ファンドは今後6ヵ月間、バランスの取れたポートフォリオの維持を優先し、経済的不透明感の中でも堅調さを示すセクターに重点を置く方針です。このアプローチには、高ベータ（市場全体の動きに比べ価格変動の度合いが高い）発行体へのエクスポージャーを選択的に引き上げつつ、地政学的動向にともなうリスクを慎重に管理することが含まれます。また、市場変動が生み出す投資機会を的確に捉えるため、積極的な銘柄選定が重要となると考えます。さらに、マクロ経済指標を継続的に注視し、市場環境の変化に応じて投資戦略を柔軟に調整することで、全体的な投資目標との整合性を確保していきます。

(アムンディ・アセットマネジメント)

今後もファンドの基本方針に従い、引き続き実質的なユーロ建資産に対し、ユーロ売り／米ドル買いの為替取引を継続いたします。

(アムンディ・ジャパン株式会社)

＜CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）＞

安全性重視の観点から、12ヵ月以内に償還を迎える債券への投資により安定的な運用を行います。

(アムンディ・ジャパン株式会社)

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	第 20 期 (2025年4月9日 ～2025年10月8日)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬 (投 信 会 社) (販 売 会 社) (受 託 会 社)	97円 (27) (67) (3)	0.557% (0.154) (0.386) (0.017)	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 委託した資金の運用の対価 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 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) そ の 他 費 用 (監 査 費 用) (印 刷 費 用)	13 (1) (12)	0.073 (0.005) (0.068)	その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 ファンドの法定開示資料の印刷に係る費用
合 計	110	0.630	

期中の平均基準価額は17,414円です。

(注1) 費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により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。

(注2) 消費税は報告日の税率を採用しています。

(注3) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

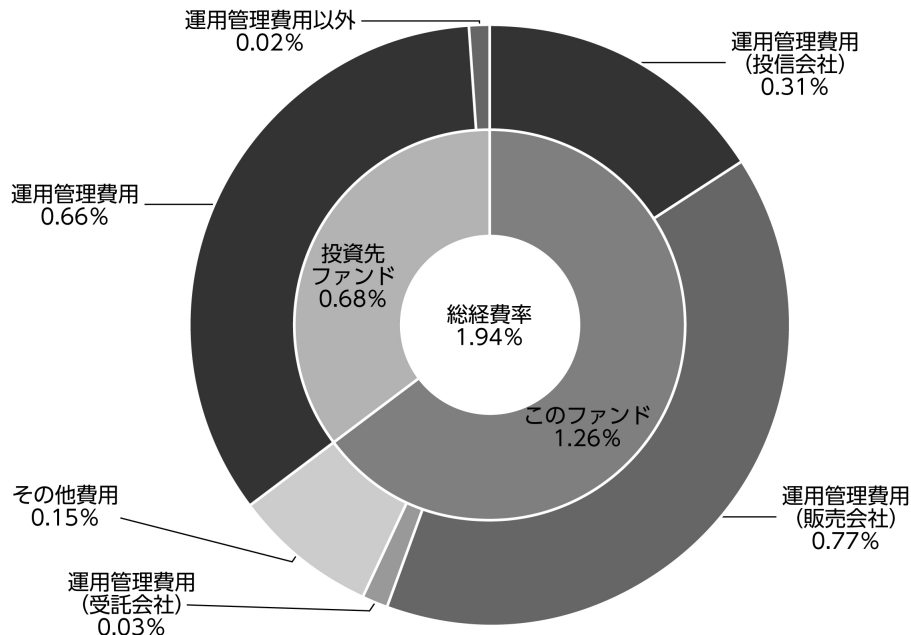
(注4) 各項目の費用は、このファンドが組入れている投資信託証券が支払った費用を含みません。

(注5) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

（参考情報）

●総経費率

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、売買委託手数料およ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1.94%です。



総経費率 (①+②+③)	1.94%
①このファンドの費用の比率	1.26%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.66%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.02%

(注1) ①の費用は、1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

(注4) 投資先ファンドとは、このファンドが組入れている投資信託証券です。

(注5) ①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注6) 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異なります。

アムンディ・欧州ハイ・イールド債券ファンド（米ドルコース）＜年2回決算型＞

■売買及び取引の状況（2025年4月9日から2025年10月8日まで）

投資信託受益証券、投資証券

		買 付		売 付	
		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
外国	(ルクセンブルク) ストラクチュラ-欧州ハイ・イールド・ボンド (IH5シェアクラス、米ドル)	1,800	千米ドル 56	2,400	千米ドル 75

(注1) 金額は受渡し代金です。

(注2) 単位未満は切捨てです。

■利害関係人との取引状況等（2025年4月9日から2025年10月8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（2025年10月8日現在）

(1) 国内（邦貨建）投資信託受益証券

銘	柄	期首（前期末）	当 期 末	
		口 数	口 数	評 価 額
		口	口	千円
CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）		79,389	79,389	79
合 計	口 数・金 額	79,389	79,389	79
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	1	<0.1%>

(注1) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。以下同じ。

(注2) 単位未満は切捨てです。以下同じ。

(2) 外国（外貨建）投資証券

銘	柄	期 首 (前期末)	当 期 末		
		口 数	口 数	評 価 額	
				外貨建金額	邦貨換算金額
		口	口	千米ドル	千円
(ルクセンブルク) ストラクチュラ-欧州ハイ・イールド・ボンド (IH5シェアクラス、米ドル)		22,923	22,323	697	106,219
合 計	口 数・金 額	22,923	22,323	697	106,219
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	1	—	<98.5%>

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

■投資信託財産の構成（2025年10月8日現在）

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投 資 信 託 受 益 証 券	79	0.1
投 資 証 券	106,219	97.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	2,215	2.0
投 資 信 託 財 産 総 額	108,513	100.0

(注1) 金額の単位未満は切捨てです。

(注2) 当期末における外貨建純資産(106,219千円)の投資信託財産総額(108,513千円)に対する比率は97.9%です。

(注3) 外貨建資産は、当期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2025年10月8日現在における邦貨換算レートは、1米ドル=152.31円です。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2025年10月8日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	108,513,255円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	2,213,713
投資信託受益証券(評価額)	79,706
投資証券(評価額)	106,219,815
未 収 利 息	21
(B) 負 債	640,134
未 払 解 約 金	1,633
未 払 信 託 報 酬	564,858
そ の 他 未 払 費 用	73,643
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	107,873,121
元 本	58,309,151
次 期 繰 越 損 益 金	49,563,970
(D) 受 益 権 総 口 数	58,309,151口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	18,500円

(注記事項)

期首元本額 64,021,531円

期中追加設定元本額 939,201円

期中一部解約元本額 6,651,581円

■損益の状況

当期（自2025年4月9日 至2025年10月8日）

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	7,822,192円
受 取 配 当 金	7,819,138
受 取 利 息	3,054
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	3,082,653
売 買 益	3,402,264
売 買 損	△ 319,611
(C) 信 託 報 酬 等	△ 638,501
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	10,266,344
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	25,845,031
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	13,452,595
(配 当 等 相 当 額)	(54,959,164)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△41,506,569)
(G) 計 (D+E+F)	49,563,970
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	49,563,970
追 加 信 託 差 損 益 金	13,452,595
(配 当 等 相 当 額)	(54,959,164)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△41,506,569)
分 配 準 備 積 立 金	71,483,270
繰 越 損 益 金	△35,371,895

(注1) (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) (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) (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。

■分配金のお知らせ

収益分配金につきましては、基準価額水準および市況動向等を勘案した結果、見送りとさせていただきます。

収益分配金に関する留意事項

- 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。
- 分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。
- 投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

【分配原資の内訳】

（単位：円・1万口当たり・税込み）

項 目	第20期
	(2025年4月9日～2025年10月8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	21,684

（注1）「対基準価額比率」は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なる点にご留意ください。

（注2）「当期の収益」「当期の収益以外」は小数点以下切捨てで算出しているため、合計が「当期分配金」と一致しない場合があります。

ストラクチュラ-欧州ハイ・イールド・ボンド
 決算日 2024年12月31日
 (計算期間：2024年1月1日～2024年12月31日)

作成時点において、入手可能な直前計算期間の年次報告書をもとに委託会社が翻訳・抜粋・作成しています。なお、開示情報につきましては各クラス別の情報がないため、全てのシェアクラスを含むファンド全体の情報を開示しています。

■費用の明細 (2024年1月1日～2024年12月31日)

項目	当期
	ユーロ
(a)運用報酬	1,245,807.17
(b)管理費用等	271,812.44
(c)その他の費用	157,307.24
合計	1,674,926.85

■純資産計算書 (2024年12月31日現在)

項目	当期末
	ユーロ
資産合計	221,145,318.22
有価証券	213,183,272.24
預金	3,501,899.08
未収利息	3,099,017.59
スワップ未収利息	20,563.89
為替予約取引評価勘定	36,522.46
スワップ取引評価勘定	1,303,257.78
為替未収入金	785.18
負債合計	2,944,835.85
借入金	10.70
未払配当金	2,167,998.52
未払解約金	647,878.63
未払運用報酬	101,330.34
未払管理費用	22,108.44
未払税	5,509.22
純資産	218,200,482.37

■ 有価証券明細 (2024年12月31日現在)

数量	評価額 ユーロ	数量	評価額 ユーロ
債券	200,351,413.55		
オーストリア	597,499.89	1,780,000 KAPLA 3.375% 15-12-26	1,768,326.27
600,000 SAPPY PAPIER 3.625% 15-03-28	597,499.89	400,000 LOXAM SAS 3.75% 15-07-26	398,856.17
ベルギー	3,122,402.03	1,000,000 LOXAM SAS 6.375% 15-05-28 EMTN	1,043,616.48
700,000 AZELIS FINANCE NV 4.75% 25-09-29	721,843.28	300,000 LOXAM SAS 6.375% 31-05-29	316,574.58
700,000 AZELIS FINANCE NV 5.75% 15-03-28	723,607.97	800,000 OPMOBILITY 4.875% 13-03-29	825,923.97
600,000 BELFIUS SANV 6.125% PERP	602,575.33	400,000 PAPREC 3.5% 01-07-28	396,038.66
400,000 KBC GROUPE 6.25% PERP	412,978.29	280,000 PAPREC 6.5% 17-11-27	296,316.72
600,000 KBC GROUPE 8.0% PERP	661,397.16	700,000 PICARD GROUPE 6.375% 01-07-29	729,632.34
デンマーク	1,789,672.86	300,000 RCI BANQUE 2.625% 18-02-30	299,132.80
800,000 ORSTED 5.125% PERP	831,382.58	400,000 REXEL 5.25% 15-09-30	421,051.90
900,000 TDC NET AS 5.618% 06-02-30	958,290.28	1,000,000 ROQUETTE FRERES 5.494% PERP	1,020,619.08
フィンランド	637,283.59	800,000 SECHE ENVIRONNEMENT 2.25% 15-11-28	751,957.61
600,000 HUHTAMAKI OYJ 5.125% 24-11-28	637,283.59	900,000 SPCM 2.625% 01-02-29	865,954.80
フランス	32,961,949.01	400,000 TEREOS FINANCE GROUPE I 7.25% 15-04-28	418,208.48
600,000 ACCOR 4.875% PERP	609,768.94	400,000 VALEO 5.375% 28-05-27 EMTN	416,810.32
600,000 AFFLELOU SAS 4.25% 19-05-26	600,716.82	500,000 VALEO 5.875% 12-04-29 EMTN	533,798.06
950,000 AFFLELOU SAS 6.0% 25-07-29	993,921.02	700,000 VEOLIA ENVIRONNEMENT 2.5% PERP	655,207.68
500,000 AIR FR KLM 8.125% 31-05-28	563,582.31	400,000 VIRIDIEN 7.75% 01-04-27	399,665.72
400,000 ALSTOM 5.868% PERP	420,048.18	ドイツ	20,140,347.95
300,000 BANIJAY ENTERTAINMENT SASU 7.0% 01-05-29	317,074.12	800,000 BAYER 5.5% 13-09-54	800,970.13
850,000 BANIJAY GROUP SAS 6.5% 01-03-26	852,053.82	1,200,000 BAYER 7.0% 25-09-83	1,267,100.74
300,000 BERTRAND FRANCHISE FINANCE SAS 6.5% 18-07-30	314,352.00	500,000 CHEPLAPHARM ARZNEIMITTEL 4.375% 15-01-28	464,068.62
1,288,000 CA 6.7% PERP	1,194,199.13	720,000 CHEPLAPHARM ARZNEIMITTEL 7.5% 15-05-30	710,637.87
800,000 CAB SELAS 3.375% 01-02-28	743,727.86	500,000 COMMERZBANK AKTIENGESELLSCHAFT 1.375% 29-12-31	480,114.68
900,000 CHROME BIDCO SAS 3.5% 31-05-28	742,553.86	1,000,000 COMMERZBANK AKTIENGESELLSCHAFT 6.125% PERP	1,010,823.97
400,000 CONSTELLIUM SE 3.125% 15-07-29	380,449.00	500,000 COMMERZBANK AKTIENGESELLSCHAFT 6.5% 06-12-32	535,695.28
500,000 CROWN EU HLD 5.0% 15-05-28	528,037.78	400,000 COMMERZBANK AKTIENGESELLSCHAFT 7.875% PERP	439,602.13
600,000 EDF 5.125% PERP EMTN	612,860.14	1,000,000 CT INVESTMENT 6.375% 15-04-30	1,045,940.23
600,000 EDF 5.625% PERP EMTN	621,208.65	800,000 DEUTSCHE BK 4.625% PERP	744,908.26
1,800,000 EDF 7.5% PERP EMTN	1,989,096.84	800,000 DEUTSCHE BK 8.125% PERP	840,197.43
1,400,000 ELECTRICITE DE 3.375% 20-XX 15/09A	1,308,458.28	710,000 FRESSNAPF HOLDING SE 5.25% 31-10-31	732,787.79
500,000 FNAC DARTY 6.0% 01-04-29	525,290.73	1,000,000 GRUENENTHAL 3.625% 15-11-26	1,000,540.44
200,000 FONCIA MANAGEMENT SASU 3.375% 31-03-28	164,118.17	1,000,000 GRUENENTHAL 4.125% 15-05-28	1,004,821.98
300,000 FONCIA MANAGEMENT SASU 7.75% 31-03-28	272,057.06	200,000 HT TROPLAST 9.375% 15-07-28	212,104.89
1,000,000 FORVIA 3.75% 15-06-28	975,284.58	1,300,000 IHO VERWALTUNGS 6.75% 15-11-29	1,331,845.23
1,000,000 FORVIA 5.5% 15-06-31	1,000,089.88	900,000 NIDDA HEALTHCARE HOLDING AG 7.0% 21-02-30	948,480.41
800,000 GOLDSTORY SAS 6.75% 01-02-30	837,510.82	200,000 NOVELIS SHEET INGOT 3.375% 15-04-29	192,531.56
190,000 ILIAD HOLDING SAS 5.375% 15-04-30	195,586.09	580,000 ONE HOTELS 7.75% 02-04-31	626,226.26
1,900,000 ILIAD HOLDING SAS 5.625% 15-10-28	1,949,031.34	400,000 PROGROUPE AG 5.125% 15-04-29	394,090.35
2,200,000 ILIAD HOLDING SAS 6.875% 15-04-31	2,366,387.76	400,000 SCHAEFFLER AG 4.5% 14-08-26	407,794.70
600,000 IM GROUP SAS 8.0% 01-03-28	326,792.19	880,000 TECHEM VERWALTUNGSGESELLSCHAFT 675 MBH 5.375% 15-07-29	911,266.49
		500,000 TECHEM VERWALTUNGSGESELLSCHAFT 675 MBH 5.375% 15-07-29	518,028.30

数量	評価額 ユーロ	数量	評価額 ユーロ
900,000 VERTICAL MID 4.375% 15-07-27	900,394.33	02-28	
1,300,000 ZF FINANCE 2.25% 03-05-28 EMTN	1,190,650.28	655,000 TELECOM ITALIA SPA EX OLIVETTI 7.875% 31-07-28	741,694.07
500,000 ZF FINANCE 2.75% 25-05-27 EMTN	477,282.20	800,000 TERNA RETE ELETTRICA NAZIONALE 4.75% PERP	826,961.12
1,000,000 ZF FINANCE 3.75% 21-09-28 EMTN	951,443.40	400,000 UNICREDIT 4.45% PERP EMTN	391,776.36
ギリシャ	3,897,593.49	800,000 UNICREDIT 6.5% PERP EMTN	834,030.34
1,100,000 ALPHA BANK 5.0% 12-05-30 EMTN	1,165,790.28	日本	3,265,618.77
600,000 ALPHA SERVICES AND 6.0% 13-09-34	648,889.53	1,200,000 RAKUTEN GROUP 4.25% PERP	1,125,024.50
500,000 EFG EURO BANK 6.25% 25-04-34	543,444.68	500,000 SOFTBANK GROUP 4.0% 19-09-29	496,185.70
600,000 NATL BANK OF GREECE 5.875% 28-06-35	650,797.26	1,600,000 SOFTBANK GROUP 5.0% 15-04-28	1,644,408.57
800,000 PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS SA 7.25% 17-04-34	888,671.74	ルクセンブルク	11,215,400.02
アイルランド	6,566,698.54	400,000 ACCORINVEST GROUP 6.375% 15-10-29	421,661.40
400,000 AIB GROUP 2.875% 30-05-31 EMTN	396,721.65	500,000 BK LC LUX FINCO1 SARL 5.25% 30-04-29	507,855.29
800,000 AIB GROUP 7.125% PERP	849,276.90	670,000 CIDRON AIDA FINCO SARL 5.0% 01-04-28	659,859.63
900,000 BK IRELAND GROUP 6.375% PERP	924,506.54	630,000 CIRSA FINANCE INTL SARL 10.375% 30-11-27	665,898.10
2,700,000 DOLYA HOLDCO 17 DAC 4.875% 15-07-28	3,051,098.97	1,400,000 CIRSA FINANCE INTL SARL 4.5% 15-03-27	1,398,367.82
700,000 EIRCOM FINANCE 5.75% 15-12-29	734,744.27	500,000 CIRSA FINANCE INTL SARL 6.5% 15-03-29	528,071.82
400,000 FLUTTER TREASURY DAC 5.0% 29-04-29	417,048.50	800,000 CPI PROPERTY GROUP 4.875% PERP	779,173.85
160,000 VIRGIN MEDIA O2 VENDOR FINANCING NOTES V 7.875% 15-03-32	193,301.71	368,000 CPI PROPERTY GROUP 6.0% 27-01-32	370,511.18
マン島	934,535.49	600,000 CPI PROPERTY GROUP 7.0% 07-05-29	639,339.99
900,000 PLAYTECH 5.875% 28-06-28	934,535.49	400,000 DANA FINANCING LUX SARL 8.5% 15-07-31	438,836.56
イタリア	22,060,612.76	700,000 EPHIOS SUBCO SA RL 7.875% 31-01-31	763,522.33
800,000 A2A EX AEM 5.0% PERP	827,204.28	740,000 HERENS MIDCO SARL 5.25% 15-05-29	614,734.11
700,000 ALMAVIVA THE ITALIAN INNOVATION 5.0% 30-10-30	713,332.74	500,000 MATTERHORN TELECOM 4.0% 15-11-27	500,397.92
2,000,000 BANCO BPM 3.25% 14-01-31 EMTN	1,994,795.04	1,100,000 PLT VII FINANCE SA RL 6.0% 15-06-31	1,159,646.54
1,000,000 BANCO BPM 5.0% 18-06-34 EMTN	1,035,384.87	1,230,000 ROSSINI SARL 6.75% 31-12-29	1,302,881.65
600,000 BANCO BPM 7.25% PERP	641,185.40	200,000 SES 2.875% PERP	188,225.32
500,000 BPER BANCA 3.875% 25-07-32	503,113.44	300,000 SES 5.5% 12-09-54	276,416.51
600,000 BPER BANCA 6.5% PERP	614,585.25	メキシコ	2,388,313.98
540,000 BUBBLES BID 6.5% 30-09-31	544,317.12	300,000 NEMAK SAB CV 2.25% 20-07-28	268,876.13
500,000 ENEL 6.375% PERP EMTN	537,098.86	2,300,000 PETROLEOS MEXICANOS 2.75% 21-04-27	2,119,437.85
500,000 ENEL 6.625% PERP EMTN	559,582.95	オランダ	29,525,680.47
1,400,000 INDUSTRIA MACCHINE 3.75% 15-01-28	1,380,072.08	500,000 ABERTIS FINANCE BV 2.625% PERP	485,495.05
500,000 INTE 2.925% 14-10-30 EMTN	480,363.70	800,000 ABERTIS FINANCE BV 4.87% PERP	820,354.06
400,000 INTE 5.5% PERP EMTN	404,444.49	600,000 ABN AMRO BK 6.375% PERP	617,397.38
200,000 INTE 6.375% PERP	207,847.78	1,600,000 COOPERATIEVE RABOBANK UA 4.875% PERP	1,573,261.35
1,150,000 INTE 9.125% PERP	1,329,405.86	800,000 DUFYR ONE BV 2.0% 15-02-27	779,625.58
450,000 INTL DESIGN GROUP 10.0% 15-11-28	487,447.03	1,100,000 DUFYR ONE BV 3.375% 15-04-28	1,095,555.14
900,000 LOTTOMATICA 5.375% 01-06-30	936,469.13	1,000,000 ENERGIZER GAMMA ACQ 3.5% 30-06-29	964,336.86
600,000 LOTTOMATICA 7.125% 01-06-28	631,265.77	600,000 KPN 4.875% PERP	623,642.49
1,000,000 NEXI 2.125% 30-04-29	954,108.45	300,000 KPN 6.0% PERP	319,320.44
1,700,000 OPTICS BID 2.375% 12-10-27	1,645,050.41	1,400,000 NATURGY FINANCE BV 2.374% PERP	1,362,419.34
586,000 OPTICS BID 6.875% 15-02-28	638,348.93	200,000 OI EUROPEAN GROUP BV 5.25% 01-06-29	204,493.00
945,000 OPTICS BID 7.875% 31-07-28	1,069,579.68	800,000 OI EUROPEAN GROUP BV 6.25% 15-05-28	830,972.89
700,000 SPACE4 GUALA CLOSURES 3.25% 15-06-28	678,439.44	480,000 QPARK HOLDING I BV 2.0% 01-03-27	470,322.52
414,000 TELECOM ITALIA SPA EX OLIVETTI 6.875% 15-	452,708.17	800,000 QPARK HOLDING I BV 5.125% 01-03-29	827,183.22
		700,000 SAIPEM FINANCE INTL BV 4.875% 30-05-30	739,114.58

数量	評価額 ユーロ	数量	評価額 ユーロ		
1,200,000	TELEFONICA EUROPE BV 6.75% PERP	1,348,058.65	500,000	NCG BAN 4.625% 11-12-36 EMTN	501,015.74
2,400,000	TELEFONICA EUROPE BV 7.125% PERP	2,646,671.02	800,000	NCG BAN 6.0% PERP	807,635.38
300,000	TENNET HOLDING BV 4.875% PERP	311,773.23	500,000	NEINOR HOMES 5.875% 15-02-30	522,563.40
2,400,000	TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV 3.75% 09-05-27	2,420,317.37		スウェーデン	5,981,744.73
700,000	TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV 4.375% 09-05-30	717,549.08	400,000	ASMODEE GROUP AB 5.75% 15-12-29	414,031.22
1,000,000	TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV 7.375% 15-09-29	1,153,204.99	720,000	ASSEMBLIN GROUP AB 6.25% 01-07-30	753,792.86
400,000	UNITED GROUP BV 4.0% 15-11-27	396,485.35	600,000	CASTELLUM AB 3.125% PERP	577,180.57
800,000	UNITED GROUP BV 5.25% 01-02-30	795,715.74	1,010,000	HEIMSTADEN BOSTAD AB 2.625% PERP	937,644.13
800,000	UNITED GROUP BV 6.5% 31-10-31	815,703.36	400,000	HEIMSTADEN BOSTAD AB 6.25% PERP	402,984.38
1,000,000	WINTERSHALL DEA FINANCE 2 BV 2.4985% PERP	970,149.65	800,000	VERISURE HOLDING AB 5.5% 15-05-30	834,122.17
900,000	WINTERSHALL DEA FINANCE 2 BV 3.0% PERP	837,653.63	500,000	VERISURE HOLDING AB 7.125% 01-02-28	519,676.20
700,000	WPAP TELECOM HOLDINGS III BV 5.5% 15-01- 30	698,126.28	800,000	VERISURE HOLDING AB 9.25% 15-10-27	840,439.51
700,000	WPAP TELECOM HOLDINGS IV BV 3.75% 15-01- 29	694,277.72	700,000	VERISURE MIDHOLDING AB 5.25% 15-02-29	701,873.69
300,000	ZF EUROPE FINANCE BV 4.75% 31-01-29	292,302.94		イギリス	23,341,714.14
800,000	ZF EUROPE FINANCE BV 6.125% 13-03-29	818,931.83	1,400,000	ALLWYN ENTERTAINMENT FINANCING UK 7.25% 30-04-30	1,500,553.25
2,400,000	ZIGGO BOND COMPANY BV 3.375% 28-02-30	2,190,067.87	500,000	AVIS BUDGET FINANCE 7.0% 28-02-29	525,089.55
700,000	ZIGGO BOND COMPANY BV 6.125% 15-11-32	705,197.86	300,000	AVIS BUDGET FINANCE 7.25% 31-07-30	315,643.03
	ノルウェー	884,085.15	800,000	BCP V MODULAR SERVICES FINANCE II 4.75% 30-11-28	787,538.45
800,000	VAR ENERGI A 7.862% 15-11-83	884,085.15	1,200,000	BELLIS ACQUISITION 8.125% 14-05-30	1,405,287.33
	ポーランド	1,560,799.61	900,000	BELRON UK FINANCE 4.625% 15-10-29	923,157.25
1,300,000	CANPACK SA EASTERN PA LAND INVEST HLDG 2.375% 01-11-27	1,267,529.89	790,000	BM EUROPEAN VALUE RETAIL 8.125% 15-11-30	1,020,128.11
300,000	INPOST 2.25% 15-07-27	293,269.72	500,000	BRITISH TEL 8.375% 20-12-83	647,723.95
	ポルトガル	3,583,715.25	300,000	CDR FIREFLY BID 8.625% 30-04-29	378,339.75
900,000	ENERGIAS DE PORTUGAL EDP 1.875% 02-08- 81	879,330.24	400,000	DEUCE FIN 5.5% 15-06-27	474,019.86
900,000	ENERGIAS DE PORTUGAL EDP 1.875% 14-03- 82	823,728.83	600,000	EC FINANCE 3.0% 15-10-26	572,480.57
500,000	ENERGIAS DE PORTUGAL EDP 4.75% 29-05-54	512,223.85	620,000	INEOS FINANCE 6.375% 15-04-29	651,665.86
1,300,000	ENERGIAS DE PORTUGAL EDP 5.943% 23-04- 83	1,368,432.33	680,000	INEOS QUATTRO FINANCE 2 6.75% 15-04-30	707,103.30
	スペイン	13,988,452.38	600,000	INEOS QUATTRO FINANCE 2 8.5% 15-03-29	643,725.05
1,200,000	BANCO DE BADELL 2.5% 15-04-31	1,189,794.29	937,000	IRON MOUNTAIN UK 3.875% 15-11-25	1,115,074.40
600,000	BANCO DE BADELL 5.125% 27-06-34	625,280.30	700,000	JERROLD FIN 7.875% 15-04-30	863,032.23
200,000	BANCO DE BADELL 5.75% PERP	201,253.46	1,000,000	NOMAD FOODS BOND 2.5% 24-06-28	960,696.73
1,000,000	BANCO DE BADELL 9.375% PERP	1,116,610.03	1,200,000	PINEWOOD FIN 6.0% 27-03-30	1,442,527.63
1,000,000	BANCO DE CREDITO SOCIAL 5.25% 27-11-31	1,017,000.75	960,000	PINNACLE BID 8.25% 11-10-28	1,020,023.49
1,000,000	BANCO SANTANDER ALL SPAIN BRANCH 7.0% PERP	1,059,650.85	800,000	PREMIER FOODS FINANCE 3.5% 15-10-26	945,946.00
600,000	BANKINTER 7.375% PERP	637,108.17	620,000	SHERWOOD FINANCING 7.625% 15-12-29	618,956.42
1,000,000	BBVA 6.875% PERP	1,049,730.69	300,000	SHERWOOD FINANCING 9.625% 15-12-29	362,802.47
600,000	CAIXABANK 5.25% PERP	603,143.34	400,000	SYNTHOMER 7.375% 02-05-29	418,933.40
1,000,000	CAIXABANK 8.25% PERP	1,108,880.14	600,000	TI AUTOMOTIVE FINANCE 3.75% 15-04-29	596,511.73
600,000	GRIFOLS ESCROW ISSUER 3.875% 15-10-28	543,426.58	400,000	VIRGIN MEDIA SECURED FINANCE 5.25% 15- 05-29	452,173.02
3,000,000	LORCA TELECOM BONDCO SAU 4.0% 18-09-27	3,005,359.26	1,500,000	VMED O2 UK FINANCING I 4.5% 15-07-31	1,555,064.22
			1,900,000	VODAFONE GROUP 3.0% 27-08-80	1,797,243.96
			600,000	ZEGONA FINANCE LC 6.75% 17-07-29	640,273.13
				アメリカ	11,907,293.44
			600,000	BELDEN 3.875% 15-03-28	602,478.69
			900,000	CARNIVAL CORPORATION 5.75% 15-01-30	977,076.33

数量	評価額 ユーロ
1,300,000 COTY 5.75% 15-09-28	1,357,224.20
700,000 ENCORE CAPITAL GROUP 4.25% 01-06-28	796,932.45
580,000 GTCR W DUTW2 MERGER SU 8.5% 15-01-31	751,753.15
600,000 INTL GAME TECHNOLOGY 2.375% 15-04-28	581,907.14
800,000 IQVIA 2.25% 15-01-28	770,541.25
400,000 IQVIA 2.875% 15-06-28	391,582.20
700,000 OLYMPUS WATER US HOLDING CORPORATION 9.625% 15-11-28	745,762.34
1,700,000 ORGANON CO ORGANON FOREIGN DEBT COI 2.875% 30-04-28	1,656,180.31
1,100,000 PANTHER BF AGGREGATOR 2 LP 4.375% 15-05-26	1,100,900.39
1,000,000 RAY FINANCING LLC 6.5% 15-07-31	1,049,140.89
500,000 SCIL IV LLC SCIL USA HOLDINGS LLC 9.5% 15-07-28	537,314.41
600,000 WMG ACQUISITION 2.75% 15-07-28	588,499.69
変動利付債	3,765,744.31
ドイツ	1,057,105.33
1,000,000 IHO VERWALTUNGS FL.R 15-05-28	1,057,105.33
イタリア	607,058.10
600,000 IRCA E3 FL.R 15-12-29	607,058.10
ルクセンブルク	968,793.33
1,100,000 CPI PROPERTY GROUP FL.R PERP	968,793.33
オランダ	397,842.81
400,000 ABERTIS FINANCE BV FL.R 20-XX 24/02A	397,842.81
スウェーデン	734,944.74
800,000 HEIMSTADEN BOSTAD AB FL.R PERP	734,944.74
投資証券	9,066,114.38
フランス	9,066,114.38
85 AMUNDI EURO LIQUIDITY SHT TERM SRI Z C	9,066,114.38
合計	213,183,272.24

■外国為替先物契約（IH5シェアクラス、米ドル）（2024年12月31日現在）

買 建	契 約 額	売 建	契 約 額	満 期 日	評 価 損 益
					ユーロ
米ドル	49,150,000.00	ユーロ	46,751,093.85	2025/2/4	653,512.05
ユーロ	948,122.80	米ドル	1,000,000.00	2025/2/4	△ 16,386.41
				合計	637,125.64

C A マネープールファンド（適格機関投資家専用）

運用報告書

《第18期》

決算日：2025年2月17日

（計算期間：2024年2月16日～2025年2月17日）

当ファンドはこの度、上記の決算を行いました。ここに期中の運用状況についてご報告申し上げます。

■投資対象ファンドの概要

運用方針	主として本邦通貨表示の短期公社債に投資し、安定した収益の確保をめざして運用を行うとともに、あわせてコール・ローンなどで運用を行うことで流動性の確保を図ります。
主要運用対象	本邦通貨表示の短期公社債を主要投資対象とします。
組入制限	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			債券組入率	純資産総額
		税込み 分配金	期中 騰落率		
	円	円	%	%	百万円
14期（2021年2月15日）	10,042	0	△0.1	64.6	773
15期（2022年2月15日）	10,035	0	△0.1	70.8	552
16期（2023年2月15日）	10,027	0	△0.1	74.3	473
17期（2024年2月15日）	10,020	0	△0.1	70.8	495
18期（2025年2月17日）	10,022	0	0.0	75.8	421

（注）当ファンドは運用成果の目標基準となるベンチマークを設けておりません。また、当ファンドと適切に対比できる参考指数はありません。以下同じ。

■当期中の基準価額等の推移

年 月 日	基 準 価 額		債券組入 比 率
		騰 落 率	
(期 首) 2024年2月15日	円 10,020	% —	% 70.8
2月末	10,018	△0.0	70.8
3月末	10,017	△0.0	71.8
4月末	10,018	△0.0	67.8
5月末	10,016	△0.0	67.6
6月末	10,019	△0.0	70.8
7月末	10,017	△0.0	70.7
8月末	10,019	△0.0	65.7
9月末	10,022	0.0	73.2
10月末	10,022	0.0	70.4
11月末	10,018	△0.0	74.3
12月末	10,022	0.0	77.4
2025年1月末	10,021	0.0	77.9
(期 末) 2025年2月17日	10,022	0.0	75.8

(注) 騰落率は期首比です。

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	第 18 期 (2024年2月16日 ～2025年2月17日)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬 (投 信 会 社) (販 売 会 社) (受 託 会 社)	16円 (13) (1) (2)	0.158% (0.126) (0.008) (0.024)	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 委託した資金の運用の対価 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 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) そ の 他 費 用 (そ の 他)	0 (0)	0.002 (0.002)	その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 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	16	0.160	

期中の平均基準価額は10,019円です。

(注1) 費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により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。

(注2) 消費税は報告日の税率を採用しています。

(注3) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注4) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

■ 売買及び取引の状況（2024年2月16日から2025年2月17日まで）

公社債

		買 付 額	売 付 額
国 内		千円	千円
	国 債 証 券	149,556	9,968
	地 方 債 証 券	180,482	50,029 (300,000)

(注1) 金額は受渡し代金です。経過利子分は含まれていません。

(注2) 単位未満は切捨てです。

(注3) () 内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

■ 主要な売買銘柄（2024年2月16日から2025年2月17日まで）

公社債

買 付 額	売 付 額
銘 柄	銘 柄
金 額	金 額
千円	千円
第1263回国庫短期証券	第137回共同発行市場公募地方債
149,556	50,029
第146回共同発行市場公募地方債	第1263回国庫短期証券
100,320	9,968
第148回共同発行市場公募地方債	
80,162	

(注1) 金額は受渡し代金です。経過利子分は含まれていません。

(注2) 単位未満は切捨てです。

(注3) 国内の現先取引によるものは含まれていません。

■利害関係人との取引状況等（2024年2月16日から2025年2月17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（2025年2月17日現在）

公社債

A 債券種類別開示

国内（邦貨建）公社債

区 分	当 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	%	%	%	%	%
国 債 証 券	140,000	139,552	33.1	—	—	—	33.1
地 方 債 証 券	180,000	180,088	42.7	—	—	—	42.7
合 計	320,000	319,640	75.8	—	—	—	75.8

（注1）組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

（注2）単位未満は切捨てです。

（注3）—印は組入れなしです。

（注4）評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

B 個別銘柄開示

国内（邦貨建）公社債

種 類	銘 柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
国 債 証 券	第1263回国庫短期証券	%	千円	千円	2025/10/20
	小 計	—	140,000	139,552	
地 方 債 証 券	第146回共同発行市場公募地方債	0.553	100,000	100,037	2025/5/23
	第148回共同発行市場公募地方債	0.553	80,000	80,051	2025/7/25
	小 計		180,000	180,088	
	合 計		320,000	319,640	

（注）額面・評価額の単位未満は切捨てです。

■投資信託財産の構成（2025年2月17日現在）

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公 社 債	319,640	75.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	102,177	24.2
投 資 信 託 財 産 総 額	421,817	100.0

(注) 金額の単位未満は切捨てです。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

2025年2月17日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	421,817,536円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	101,696,269
公 社 債(評価額)	319,640,340
未 収 利 息	480,927
(B) 負 債	235,213
未 払 信 託 報 酬	229,273
そ の 他 未 払 費 用	5,940
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	421,582,323
元 本	420,645,270
次 期 繰 越 損 益 金	937,053
(D) 受 益 権 総 口 数	420,645,270口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D)	10,022円

(注記事項)

期首元本額	494,224,101円
期中追加設定元本額	139,957,498円
期中一部解約元本額	213,536,329円

■損益の状況

当期 自2024年2月16日 至2025年2月17日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	1,260,001円
受 取 利 息	1,267,483
支 払 利 息	△ 7,482
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 915,529
売 買 益	163,129
売 買 損	△ 1,078,658
(C) 信 託 報 酬 等	△ 238,192
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	106,280
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 632,666
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	1,463,439
(配 当 等 相 当 額)	(16,202,467)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△14,739,028)
(G) 計 (D+E+F)	937,053
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	937,053
追 加 信 託 差 損 益 金	1,463,439
(配 当 等 相 当 額)	(16,202,467)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△14,739,028)
分 配 準 備 積 立 金	5,300,016
繰 越 損 益 金	△ 5,826,402

(注1) (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) (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) (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。