

■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	2010年4月28日から2019年11月7日までです。	
運用方針	米ドル建のハイイールド債を主要投資対象とする米ドル売り／円買いの為替取引（対円での「為替ヘッジ」）を行う、「ストラクチャル-米国ハイ・イールド・ボンド（I9シェアクラス、円）」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マネーパールファンド（適格機関投資家専用）」への投資も行います。対円での為替ヘッジを行います。	
主要運用対象	アムンディ・リそな米国ハイ・イールド債券ファンド（円コース）	ストラクチャル-米国ハイ・イールド・ボンド（I9シェアクラス、円） CAマネーパールファンド（適格機関投資家専用）
	ストラクチャル-米国ハイ・イールド・ボンド（I9シェアクラス、円）	米ドル建のハイイールド債
	CAマネーパールファンド（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12回、原則毎月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・リそな米国
 ハイ・イールド債券ファンド
 （円コース）

運用報告書（全体版）
 第13作成期

第72期	（決算日 2016年5月9日）
第73期	（決算日 2016年6月8日）
第74期	（決算日 2016年7月8日）
第75期	（決算日 2016年8月8日）
第76期	（決算日 2016年9月8日）
第77期	（決算日 2016年10月11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、作成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、よろしく申し上げます。

アムンディ・ジャパン株式会社

〒100-0011 東京都千代田区内幸町1丁目2番2号

お客様サポートライン 0120-202-900（フリーダイヤル）

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：<http://www.amundi.co.jp>

アムンディ・リそな米国ハイ・イールド債券ファンド（円コース）

■最近5作成期の運用実績

	決 算 期	基 準 価 額 (分配落)	騰 落 率			投 資 信 託 組 入 証 券 率	投 資 証 券 組 入 比 率	純資産総額
			税 分	込 配	み 金			
第9作成期		円		円	%	%	%	百万円
	48期 (2014年5月8日)	10,054		60	0.2	0.6	95.4	3,250
	49期 (2014年6月9日)	10,070		60	0.8	0.7	97.8	2,897
	50期 (2014年7月8日)	10,065		60	0.5	0.8	97.7	2,655
	51期 (2014年8月8日)	9,843		60	△1.6	0.5	98.0	2,492
	52期 (2014年9月8日)	9,894		60	1.1	0.5	97.9	2,369
第10作成期	53期 (2014年10月8日)	9,716		60	△1.2	0.6	97.9	2,127
	54期 (2014年11月10日)	9,740		60	0.9	0.6	97.8	2,120
	55期 (2014年12月8日)	9,526		60	△1.6	0.6	97.9	2,107
	56期 (2015年1月8日)	9,385		60	△0.9	0.6	97.8	2,062
	57期 (2015年2月9日)	9,497		60	1.8	0.7	97.8	1,919
	58期 (2015年3月9日)	9,488		60	0.5	0.7	97.8	1,747
第11作成期	59期 (2015年4月8日)	9,448		60	0.2	0.5	98.0	1,667
	60期 (2015年5月8日)	9,415		60	0.3	0.6	96.7	1,526
	61期 (2015年6月8日)	9,357		60	0.0	0.6	97.8	1,382
	62期 (2015年7月8日)	9,229		60	△0.7	0.7	97.8	1,227
	63期 (2015年8月10日)	9,068		60	△1.1	0.7	97.8	1,171
	64期 (2015年9月8日)	8,947		60	△0.7	0.7	97.7	1,174
第12作成期	65期 (2015年10月8日)	8,708		60	△2.0	0.8	97.7	1,112
	66期 (2015年11月9日)	8,684		60	0.4	0.8	97.7	1,072
	67期 (2015年12月8日)	8,274		60	△4.0	0.6	97.9	970
	68期 (2016年1月8日)	8,028		60	△2.2	0.6	97.9	932
	69期 (2016年2月8日)	7,740		60	△2.8	0.6	97.8	894
	70期 (2016年3月8日)	8,003		60	4.2	0.5	97.9	906
第13作成期	71期 (2016年4月8日)	8,084		60	1.8	0.5	98.0	908
	72期 (2016年5月9日)	8,201		60	2.2	0.1	98.3	916
	73期 (2016年6月8日)	8,278		60	1.7	0.1	98.3	927
	74期 (2016年7月8日)	8,252		60	0.4	0.1	98.4	915
	75期 (2016年8月8日)	8,382		60	2.3	0.1	98.4	938
	76期 (2016年9月8日)	8,457		60	1.6	0.1	98.3	938
	77期 (2016年10月11日)	8,463		60	0.8	0.1	98.4	946

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注2) 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。

アムンディ・リソな米国ハイ・イールド債券ファンド (円コース)

■ 当作成期中の基準価額等の推移

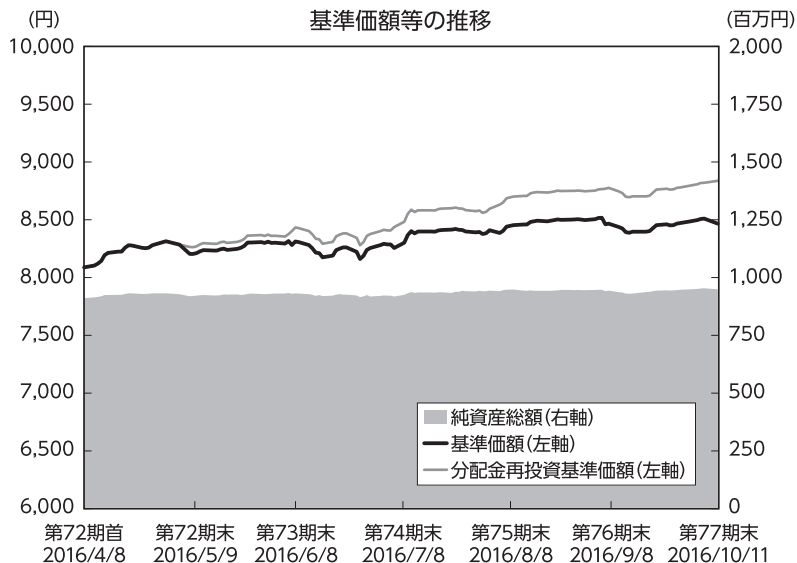
決算期	年 月 日	基準価額	騰 落 率	投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 比 率	投 資 証 券 組 入 比 率
第72期	(期 首)2016年4月8日	円 8,084	% —	% 0.5	% 98.0
	4月末	8,276	2.4	0.1	98.5
	(期 末)2016年5月9日	8,261	2.2	0.1	98.3
第73期	(期 首)2016年5月9日	8,201	—	0.1	98.3
	5月末	8,295	1.1	0.1	98.4
	(期 末)2016年6月8日	8,338	1.7	0.1	98.3
第74期	(期 首)2016年6月8日	8,278	—	0.1	98.3
	6月末	8,236	△0.5	0.1	98.4
	(期 末)2016年7月8日	8,312	0.4	0.1	98.4
第75期	(期 首)2016年7月8日	8,252	—	0.1	98.4
	7月末	8,396	1.7	0.1	97.4
	(期 末)2016年8月8日	8,442	2.3	0.1	98.4
第76期	(期 首)2016年8月8日	8,382	—	0.1	98.4
	8月末	8,501	1.4	0.1	98.4
	(期 末)2016年9月8日	8,517	1.6	0.1	98.3
第77期	(期 首)2016年9月8日	8,457	—	0.1	98.3
	9月末	8,468	0.1	0.1	98.4
	(期 末)2016年10月11日	8,523	0.8	0.1	98.4

(注) 期末基準価額は当該期の分配金込み、騰落率は各期首比です。

アムンディ・リそな米国ハイ・イールド債券ファンド（円コース）

【基準価額等の推移】

第72期首	8,084円
第77期末	8,463円
既払分配金 (税込み)	360円
騰落率	9.3% (分配金再投資ベース)



(注1) 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

(注2) 実際のファンドにおいては、分配金を再投資するかどうかについては、お客さま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るため、お客さまの損益の状況を示すものではありません。

(注3) 分配金再投資基準価額は、2016年4月8日の値を基準価額と同一となるように指数化しています。

【基準価額の主な変動要因】

上昇要因

- ① 当作成期を通じて、商品価格の上昇を背景に米国ハイイールド債券市場が上昇傾向にあったこと
- ② 世界的な低金利環境を背景に投資家の利回り追求の動きがみられたこと
- ③ 組入れたハイイールド債からインカムゲインを得たこと

下落要因

- ① 2016年6月に英国のEU（欧州連合）離脱の是非を問う国民投票に向けて不安が増大し、リスクオフの動きが強まったこと

【投資環境】

<米国ハイイールド債券市場>

当作成期の米国ハイイールド債券市場は、商品価格の上昇、世界的な景気後退に対する懸念の後退、主要中央銀行の金融緩和政策の継続等を受け、上昇して始まりました。6月になると英国のEU（欧州連合）離脱の是非を問う国民投票に向けて不安が増大し、リスク資産は一時大きく売られました。エネルギーなど商品価格に落ち着きが見られたことから比較的短期間で反発しました。また、英国の国民投票の結果が欧州および世界経済に与える影響への不透明感が和らいだこと、FRB（米連邦準備理事会）の利上げ観測が遠のいたこと、4-6月期の企業決算が市場予想より良好であったこと、世界的な低金利環境を背景に相対的に高い利回りのハイイールド債に対する需要が強まったことも相場の上昇を後押ししました。新規発行は年初の不振から回復して増加していますが、投資資金も流入しています。このような良好な環境下、当作成期の米国ハイイールド債券市場は二桁の上昇（米ドルベース）となりました。

格付別では、格付が低めの銘柄が高めの銘柄を大きく上回るリターンとなりました。当作成期後半は、投資適格から投機的格付に格下げされる企業も減少しています。過去12カ月の発行額面ベースのハイイールド債のデフォルト（債務不履行）率は前作成期末の水準から若干上昇し、3.54%となりました。

<日本の短期国債市場>

当作成期の日本の短期国債市場では、日銀の強力な金融緩和策を背景に非常に低い利回りで推移しました。日銀によるマイナス金利政策のもと、TDB（国庫短期証券）3ヵ月物の利回りは-0.47%近辺で始まりました。TDBの需給が緩み、一時-0.20%近辺まで上昇しましたが、日銀のさらなる追加金融緩和が期待される中で再び低下し、-0.31%近辺で当作成期末を迎えました。

【ポートフォリオ】

<当ファンド>

当ファンドは、円建の外国籍投資信託「ストラクチャラ-米国ハイ・イールド・ボンド（I9シェアクラス、円）」と、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）」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信託財産の成長を目指して運用を行いました。当ファンドは「ストラクチャラ-米国ハイ・イールド・ボンド（I9シェアクラス、円）」に90%以上投資することを基本としていることから、この運用の基本方針に従い、当作成期初より当該投資信託を高位に組み入れました。

（アムンディ・ジャパン株式会社）

<ストラクチャラ-米国ハイ・イールド・ボンド（I9シェアクラス、円）>

当作成期末のポートフォリオにおいては、ゲーム、テクノロジー、化学といったセクターに割安感があると考え、参考指数（BoFAメリルリンチ・USハイイールド・コンストレインド・インデックス）に比べオーバーウェイトとしています。一方、金属／鉱業、油田サービス、金融サービスといったセクターについては、今後の厳しい事業見通しや割高感から、アンダーウェイトとしています。参考指数と比べて、ポートフォリオのデュレーションは短く、利回りは低くなっています。一方、スプレッド（国債との利回り差）は参考指数に比べやや拡大しています。

（J.P.モルガン・インベストメント・マネージメント・インク）

米ドル建資産に対し、米ドル売り／円買いの為替ヘッジを行い、当作成期を通じておおむねフルヘッジを維持しました。

（アムンディ・ジャパン株式会社）

アムンディ・リそな米国ハイ・イールド債券ファンド（円コース）

＜CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）＞

当作成期、主として6ヵ月以内に償還を迎える国債、政府保証債、地方債への投資により、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、分配を行いました（各期の分配金額および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「ストラクチャラ-米国ハイ・イールド・ボンド（I9シェアクラス、円）」の組入比率を引き続き高位に保ちます。

（アムンディ・ジャパン株式会社）

＜ストラクチャラ-米国ハイ・イールド・ボンド（I9シェアクラス、円）＞

最近の経済指標を見る限り、世界経済は緩やかな成長が継続していることを示しており、企業収益も穏やかに回復してきています。ハイイールド債の大半の発行体はキャッシュ・フローを順調に伸ばし、借り入れを抑制していると考えます。スプレッドの水準は、現在および今後のデフォルト率の推移を考慮すると、適正もしくはまだ縮小の余地があると思われます。一方、商品市況のボラティリティ（価格変動性）は引き続きハイイールド債市場に影響するとみております。また、短期的な需給関係は引き続き世界の経済見通しと高い相関関係にあるとみており、スプレッドやパフォーマンスにも影響を与える可能性が考えられます。新規発行は最近増加してきましたが、市場のボラティリティが高いことから、年初来の新規発行額は依然として前年を下回ります。当ファンドは、現在のセクター配分や、ファンダメンタルおよび個別銘柄分析に基づいた投資方針を通じて引き続き魅力的な投資機会の発掘を行ってまいります

（J.P.モルガン・インベストメント・マネージメント・インク）

今後もファンドの基本方針に従い、引き続き米ドル建資産に対し、米ドル売り／円買いの為替ヘッジを継続いたします。

（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、6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）

アムンディ・リそな米国ハイ・イールド債券ファンド（円コース）

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	第72期～第77期 (2016年4月9日 ～2016年10月11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)	40円 (16) (23) (1)	0.484% (0.193) (0.275) (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) (そ の 他)	0 (0) (0)	0.005 (0.005) (0.000)	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 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	40	0.489	

期中の平均基準価額は8,362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（マザーファンドを除く。）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。

■ 当作成期中の売買及び取引の状況（2016年4月9日から2016年10月11日まで）

投資信託受益証券、投資証券

決 算 期		第 72 期 ～ 第 77 期			
		買 付		売 付	
		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
国内	CAマネーパールファンド（適格機関投資家専用）	—	—	3,572,846	3,600
外国	(ルクセンブルク) ストラクチュラ-米国ハイ・イールド・ボンド (19シエアクラス、円)	5,000	41,011	5,000	40,980

- (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（2016年4月9日から2016年10月11日まで）

当作成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。

アムンディ・リそな米国ハイ・イールド債券ファンド（円コース）

■組入資産の明細（2016年10月11日現在）

(1) 国内（邦貨建）投資信託受益証券

銘	柄	第12作成期末 (第71期末)	第13作成期末（第77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）		4,634,596	1,061,750	1,069
合計	口数・金額	4,634,596	1,061,750	1,069
	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) 評価額の単位未満は切捨てです。以下同じ。

(2) 外国（邦貨建）投資証券

銘	柄	第12作成期末 (第71期末)	第13作成期末（第77期末）	
		口数	口数	評価額
		口	口	千円
(ルクセンブルク) ストラクチャル-米国ハイ・イールド・ボンド (I9シェアクラス、円)		111,800	111,800	931,070
合計	口数・金額	111,800	111,800	931,070
	銘柄数<比率>	1	1	<98.4%>

■投資信託財産の構成（2016年10月11日現在）

項目	第13作成期末（第77期末）	
	評価額	比率
投資信託受益証券	千円 1,069	% 0.1
投資証券	931,070	97.6
コール・ローン等、その他	21,705	2.3
投資信託財産総額	953,844	100.0

(注) 金額の単位未満は切捨てです。

アムンディ・リそな米国ハイ・イールド債券ファンド（円コース）

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

	(2016年5月9日)	(2016年6月8日)	(2016年7月8日)	(2016年8月8日)	(2016年9月8日)	(2016年10月11日)現在
項 目	第 72 期 末	第 73 期 末	第 74 期 末	第 75 期 末	第 76 期 末	第 77 期 末
(A) 資 産	924,080,410円	936,162,905円	923,178,657円	946,192,691円	946,202,782円	953,844,068円
コール・ローン等	21,979,197	23,364,299	21,046,657	21,724,391	22,723,706	21,704,592
投資信託受益証券(評価額)	1,069,713	1,069,606	1,069,500	1,069,500	1,069,076	1,069,076
投 資 証 券(評価額)	901,031,500	911,729,000	901,062,500	923,398,800	922,410,000	931,070,400
(B) 負 債	7,460,121	9,083,585	7,402,202	7,504,865	7,460,766	7,565,428
未 払 金	—	1,626,000	—	—	—	—
未 払 収 益 分 配 金	6,706,385	6,719,629	6,658,768	6,719,601	6,659,752	6,708,746
未 払 信 託 報 酬	745,614	722,027	719,741	753,436	760,962	807,901
未 払 利 息	62	67	57	52	56	53
そ の 他 未 払 費 用	8,060	15,862	23,636	31,776	39,996	48,728
(C) 純 資 産 総 額 (A－B)	916,620,289	927,079,320	915,776,455	938,687,826	938,742,016	946,278,640
元 本	1,117,730,952	1,119,938,316	1,109,794,820	1,119,933,526	1,109,958,738	1,118,124,498
次 期 繰 越 損 益 金	△ 201,110,663	△ 192,858,996	△ 194,018,365	△ 181,245,700	△ 171,216,722	△ 171,845,858
(D) 受 益 権 総 口 数	1,117,730,952口	1,119,938,316口	1,109,794,820口	1,119,933,526口	1,109,958,738口	1,118,124,498口
1万口当たり基準価額(C/D)	8,201円	8,278円	8,252円	8,382円	8,457円	8,463円

(注記事項)

作成期首元本額	1,123,857,965円
作成期中追加設定元本額	67,172,509円
作成期中一部解約元本額	72,905,976円

アムンディ・リそな米国ハイ・イールド債券ファンド（円コース）

■損益の状況

第72期 自2016年4月9日 至2016年5月9日 第75期 自2016年7月9日 至2016年8月8日
 第73期 自2016年5月10日 至2016年6月8日 第76期 自2016年8月9日 至2016年9月8日
 第74期 自2016年6月9日 至2016年7月8日 第77期 自2016年9月9日 至2016年10月11日

項 目	第 72 期	第 73 期	第 74 期	第 75 期	第 76 期	第 77 期
(A) 配 当 等 收 益	7,803,997円	7,778,081円	7,761,629円	7,811,675円	7,754,740円	7,796,534円
受 取 配 当 金	7,805,000	7,779,541	7,763,000	7,813,142	7,756,000	7,798,000
支 払 利 息	△ 1,003	△ 1,460	△ 1,371	△ 1,467	△ 1,260	△ 1,466
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	12,736,120	8,212,061	△ 3,257,446	13,974,568	8,046,739	398,363
売 買 益	12,865,001	8,271,268	54,086	14,081,831	8,149,500	403,891
売 買 損	△ 128,881	△ 59,207	△ 3,311,532	△ 107,263	△ 102,761	△ 5,528
(C) 信 託 報 酬 等	△ 753,674	△ 729,829	△ 727,636	△ 761,576	△ 769,182	△ 816,633
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	19,786,443	15,260,313	3,776,547	21,024,667	15,032,297	7,378,264
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△196,722,823	△181,673,989	△170,364,308	△172,025,667	△155,599,082	△145,653,297
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 17,467,898	△ 19,725,691	△ 20,771,836	△ 23,525,099	△ 23,990,185	△ 26,862,079
(配 当 等 相 当 額)	(88,022,034)	(88,399,679)	(87,689,246)	(88,724,133)	(87,996,989)	(88,918,775)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△105,489,932)	(△108,125,370)	(△108,461,082)	(△112,249,232)	(△111,987,174)	(△115,780,854)
(G) 計 (D+E+F)	△194,404,278	△186,139,367	△187,359,597	△174,526,099	△164,556,970	△165,137,112
(H) 收 益 分 配 金	△ 6,706,385	△ 6,719,629	△ 6,658,768	△ 6,719,601	△ 6,659,752	△ 6,708,746
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	△201,110,663	△192,858,996	△194,018,365	△181,245,700	△171,216,722	△171,845,858
追 加 信 託 差 損 益 金	△ 17,467,898	△ 19,725,691	△ 20,771,836	△ 23,525,099	△ 23,990,185	△ 26,862,079
(配 当 等 相 当 額)	(88,022,034)	(88,399,679)	(87,689,246)	(88,724,133)	(87,996,989)	(88,918,775)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△105,489,932)	(△108,125,370)	(△108,461,082)	(△112,249,232)	(△111,987,174)	(△115,780,854)
分 配 準 備 積 立 金	12,543,204	13,118,644	13,299,386	14,027,606	14,564,837	14,729,914
繰 越 損 益 金	△196,185,969	△186,251,949	△186,545,915	△171,748,207	△161,791,374	△159,713,693

(注1) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は各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。

分配金の計算過程

第72期計算期間末における費用控除後の配当等収益(7,517,676円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(88,022,034円)および分配準備積立金(11,731,913円)より分配対象収益は107,271,623円(10,000口当たり959円)であり、うち6,706,385円(10,000口当たり60円)を分配金額としております。

第73期計算期間末における費用控除後の配当等収益(7,423,092円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(88,399,679円)および分配準備積立金(12,415,181円)より分配対象収益は108,237,952円(10,000口当たり966円)であり、うち6,719,629円(10,000口当たり60円)を分配金額としております。

第74期計算期間末における費用控除後の配当等収益(7,033,993円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(87,689,246円)および分配準備積立金(12,924,161円)より分配対象収益は107,647,400円(10,000口当たり969円)であり、うち6,658,768円(10,000口当たり60円)を分配金額としております。

第75期計算期間末における費用控除後の配当等収益(7,538,574円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(88,724,133円)および分配準備積立金(13,208,633円)より分配対象収益は109,471,340円(10,000口当たり977円)であり、うち6,719,601円(10,000口当たり60円)を分配金額としております。

第76期計算期間末における費用控除後の配当等収益(7,377,225円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(87,996,989円)および分配準備積立金(13,847,364円)より分配対象収益は109,221,578円(10,000口当たり983円)であり、うち6,659,752円(10,000口当たり60円)を分配金額としております。

第77期計算期間末における費用控除後の配当等収益(7,019,589円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(88,918,775円)および分配準備積立金(14,419,071円)より分配対象収益は110,357,435円(10,000口当たり986円)であり、うち6,708,746円(10,000口当たり60円)を分配金額としております。

アムンディ・リそな米国ハイ・イールド債券ファンド（円コース）

■分配金のお知らせ

決 算 期	第72期	第73期	第74期	第75期	第76期	第77期
1万口当たりの分配金（税込み）	60円	60円	60円	60円	60円	60円

◇分配金をお支払いする場合

分配金は各決算日から起算して5営業日目までにお支払いを開始しております。

◇分配金を再投資する場合

お手取り分配金は、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いたしました。

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72期	第73期	第74期	第75期	第76期	第77期
	(2016年4月9日 ～2016年5月9日)	(2016年5月10日 ～2016年6月8日)	(2016年6月9日 ～2016年7月8日)	(2016年7月9日 ～2016年8月8日)	(2016年8月9日 ～2016年9月8日)	(2016年9月9日 ～2016年10月11日)
当期分配金	60	60	60	60	60	60
（対基準価額比率）	(0.726%)	(0.720%)	(0.722%)	(0.711%)	(0.704%)	(0.704%)
当期の収益	60	60	60	60	60	60
当期の収益以外	—	—	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額	899	906	909	917	923	926

（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。

ストラクチャラ-米国ハイ・イールド・ボンド

< 1. 補足情報 >

「ストラクチャラ-米国ハイ・イールド・ボンド（I 9 シェアクラス、円）」は、「ストラクチャラ-米国ハイ・イールド・ボンド」にて他のクラスと合わせた合同運用が行われています。

「ストラクチャラ-米国ハイ・イールド・ボンド」の決算日（毎年12月31日）と当ファンドの決算日が異なっておりますので、以下2016年10月10日現在における「ストラクチャラ-米国ハイ・イールド・ボンド」の補足情報を記載しております。

■有価証券明細（評価額上位30銘柄）

（2016年10月10日現在）

銘柄		利率	額面金額/株数	評価額	償還年月日	
		%	米ドル	円		
アメリカ	債券	SPRINT CORP 7.875 14-23 15/09S	7.875	8,110,000.00	849,510,168	2023/9/15
		CAESARS OP/CORP (DEFAULT) 13-20 15/02S	9	7,515,000.00	805,608,744	2020/2/15
		MGM RESORT 7.75 12-22 15/03S	7.75	6,050,000.00	730,285,501	2022/3/15
		FIRST DATA CORPORA 5.75 15-24 15/01S	5.75	5,610,000.00	601,392,555	2024/1/15
		HARRAHS OPERATING (DEFAULT) LT09-17 01/06S	11.25	5,470,000.00	579,302,603	2017/6/1
		HCA INC 7.50 11-22 15/02S	7.5	4,840,000.00	576,052,151	2022/2/15
		VPII ESCROW CORP 144A 7.50 13-21 15/07S	7.5	4,940,000.00	495,670,989	2021/7/15
		RADIO SYST CORP 144A 8.375 12-19 01/11S	8.375	4,565,000.00	494,983,186	2019/11/1
		INTELSAT 7.25 10-20 15/10S	7.25	5,905,000.00	493,875,258	2020/10/15
		HCA INC 5.375 15-25 01/02S	5.375	4,575,000.00	492,217,411	2025/2/1
カナダ アメリカ ルクセンブルク アメリカ	債券	SPRINT CAP CORP 8.75 02-32 15/03S	8.75	4,430,000.00	473,382,276	2032/3/15
		DISH DBS CORP 5.875 15-24 15/11S	5.875	4,425,000.00	459,465,063	2024/11/15
		CCO HLDGS LLC/CAP 5.875 16-24 01/04S	5.875	4,045,000.00	450,382,832	2024/4/1
		CLEAR CHANNEL WORLDW 7.625 12-20 15/03S	7.625	3,995,000.00	411,713,115	2020/3/15
		REICHHOLD CAYMAN EQUITY	—	5,835.00	385,581,666	—
		CLEAR CHANNEL 6.50 13-22 15/11S	6.5	3,400,000.00	368,001,886	2022/11/15
		TENET HEALTHCARE CORP 8.125 13-22 01/04S	8.125	3,365,000.00	349,732,218	2022/4/1
		REGENCY AGENCY 5.50 12-23 15/04S	5.5	3,235,000.00	347,525,275	2023/4/15
		REICHHOLD HLDG INTL 12.00 15-17 31/03Q	12	3,305,478.99	342,364,904	2017/3/31
		ARGOS MERGER 144A 7.125 15-23 15/03S	7.125	2,990,000.00	326,443,360	2023/3/15
カナダ アメリカ	株式	CLEAR CHANNEL WORLDW 6.50 13-22 15/11S	6.5	3,055,000.00	320,376,818	2022/11/15
		QUEBECOR MEDIA INC 5.75 13-23 15/01S	5.75	2,843,000.00	311,395,313	2023/1/15
		BELDEN INC 5.50 12-22 01/09S	5.5	2,830,000.00	306,307,452	2022/9/1
		JACK COOPER HOLDIN 9.25 16-20 01/06S	9.25	4,375,000.00	305,869,848	2020/6/1
		ALBEA BEAUTY HLDG 144A 8.375 12-19 01/11S	8.375	2,790,000.00	303,061,671	2019/11/1
		BANK OF AMERICA CORP FL.R 08-XX 30/01S	8	2,785,000.00	294,035,050	2049/1/30
		WYNN LAS VEGAS 5.50 15-25 01/03S	5.5	2,800,000.00	293,429,147	2025/3/1
		HCA 5.875 15-26 15/02S	5.875	2,660,000.00	293,180,608	2026/2/15
		VRX ESCROW 144A 5.875 15-23 15/05S	5.875	3,195,000.00	285,420,264	2023/5/15
		SABINE PASS 6.25 14-22 15/03S	6.25	2,475,000.00	282,623,739	2022/3/15

ストラクチャラ-米国ハイ・イールド・ボンド

■外国為替先物契約（I 9 シェアクラス、円）

(2016年10月10日現在)

売 建	契 約 額	買 建	契 約 額	満 期 日	評 価 損 益
					日本円
米ドル	9,058,889.25	日本円	907,000,000	2016/11/4	△30,533,389
米ドル	174,900.60	日本円	18,000,000	2016/11/4	△ 100,615
				合計	△30,634,004

CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）

< 2. 補足情報 >

「CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）」の決算日（2016年2月15日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、以下2016年10月11日現在における「CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）」の補足情報を掲載しております。

■主要な売買銘柄（2016年2月16日から2016年10月11日まで）

公社債

買		付		売		付	
銘	柄	金	額	銘	柄	金	額
			千円				千円
第591回	国庫短期証券	500,071					
第303回	大阪府公募公債（10年）	509,911					
第189回	政府保証預金保険機構債	500,269					

(注1) 金額は受渡し代金です。経過利子分は含まれておりません。

(注2) 単位未満は切捨てです。

(注3) 国内の現先取引によるものは含まれておりません。

■組入資産の明細（2016年10月11日現在）

公社債

(A) 公社債種類別

国内（邦貨建）公社債

区 分	2016 年 10 月 11 日 現 在						
	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
地 方 債 証 券	千円 500,000	千円 506,865	% 62.4	% —	% —	% —	% 62.4
合 計	500,000	506,865	62.4	—	—	—	62.4

(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入手しております。

(B) 公社債銘柄別

国内（邦貨建）公社債

種 類	銘 柄	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地 方 債 証 券	第303回大阪府公募公債（10年）	% 1.93	千円 500,000	千円 506,865	2017/6/28
合 計			500,000	506,865	

(注) 額面・評価額の単位未満は切捨てです。

ストラクチュラ-米国ハイ・イールド・ボンド

決算日 2015年12月31日
 (計算期間：2015年1月1日～2015年12月31日)

「ストラクチュラ-米国ハイ・イールド・ボンド (I 9 シェアクラス、円)」は、「ストラクチュラ-米国ハイ・イールド・ボンド」にて既存の他のクラスと合わせた合同運用が行われておりません。

「ストラクチュラ-米国ハイ・イールド・ボンド」は毎年12月31日を決算日としており、当該運用報告書の作成時点において入手可能な2015年12月31日を基準日とするデータおよび年次報告書(監査済み)に基づき、委託会社が抜粋・翻訳・作成したものです。

開示情報につきましては、各クラス別のものがないので、「ストラクチュラ-米国ハイ・イールド・ボンド」を掲載しております。

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	ルクセンブルク籍会社型投資信託	
投資方針	米ドル建のハイイールド債を主要投資対象とし、インカムゲインの確保に加え、中長期的なキャピタルゲインの獲得を目指して運用を行います。	
ファンドの関係法人	投資顧問会社	アムンディ・ジャパン株式会社
	副投資顧問会社	J.P.モルガン・インベストメント・マネージメント・インク
	管理会社	アムンディ・ルクセンブルク・エス・エー
	保管銀行・管理事務代行会社	CACEIS・バンク・ルクセンブルク・エス・エー
費用	運用報酬等	純資産総額に対し年率0.73%
申込手数料	ありません。	

ストラクチャ-米国ハイ・イールド・ボンド

■費用の明細

項目	当期
	円
(a) 運用報酬	476,478,644
(b) 管理費用等	144,644,067
(c) その他の費用	12,388,120
合計	633,510,831

■純資産計算書

2015年12月31日現在

項目	当期末
	円
資産合計	56,162,475,561
有価証券	52,240,938,487
預金	1,317,601,499
未収利息	1,073,486,482
有価証券売却未収入金	724,336,487
為替予約取引評価勘定	466,871,026
為替未収入金	339,241,580
負債合計	2,021,421,369
借入金	28,258,618
未払配当金	880,134,400
未払解約金	339,241,580
有価証券買付未払金	339,241,580
未払運用報酬	86,108,363
未払管理費用	8,103,392
未払税	1,375,530
為替未払金	338,949,614
その他の負債	8,292
純資産	54,141,054,192

■有価証券明細

(1) 公社債

(2015年12月31日現在)

銘柄		通貨	額面金額	評価額	銘柄		通貨	額面金額	評価額
アイランド	ALLEGION PLC 5.875 15-23 15/09S	USD	240,000.00	29,556,480	CCO HOLDINGS 6.50 11-21 30/04S	USD	2,690,000.00	335,550,308	
	ARDAGH GLASS FIN 144A 9.125 10-20 15/10S	USD	4,075,000.00	504,908,154	CCO HOLDINGS 6.625 12-22 31/01S	USD	640,000.00	81,070,740	
	ARDAGH PACKAGING 144A 6.75 14-21 31/01S	USD	200,000.00	23,186,860	CCOH SAFARI LLC 5.75 15-26 15/02S	USD	865,000.00	104,835,582	
	ARDAGH PACKAGING 144A 7.00 13-20 15/11S	USD	409,411.76	49,311,747	CENTRAL GARDEN&PET 6.125 15-23 15/11S	USD	620,000.00	75,701,638	
	ENDO FIN/ENDO LTD/ 6.00 15-23 15/07S	USD	1,840,000.00	221,440,176	CENTURY LINK 6.75 13-23 01/12S	USD	1,760,000.00	199,479,699	
	JAMES HARDIE INTL F 5.875 15-23 15/02S	USD	745,000.00	91,860,263	CENTURYLINK 5.80 12-22 15/03S	USD	485,000.00	53,700,129	
アメリカ	21ST CENTURY ONCOLOGY 11.00 15-23 01/05S	USD	930,000.00	85,583,872	CHEMOURS CO 144A 6.625 15-23 15/05S	USD	1,375,000.00	118,265,014	
	ACCO BRANDS 6.75 13-20 30/04S	USD	450,000.00	56,149,191	CHEMOURS CO 144A 7.00 15-25 15/05S	USD	455,000.00	37,492,942	
	ADT CORP 3.50 13-22 15/07S	USD	2,075,000.00	225,180,075	CHESAPEAKE 6.125 12-22 15/07S	USD	2,730,000.00	311,061,421	
	ADT CORP 6.25 14-21 15/10S	USD	165,000.00	20,794,462	CHESAPEAKE ENERGY 8.00 15-22 15/12S	USD	1,518,000.00	89,477,821	
	ADVENT INTL 144A 8.125 12-20 01/10S	USD	4,175,000.00	526,087,590	CHESAPEAKE ENERGY FL R 14-19 15/04Q	USD	270,000.00	9,133,277	
	AIR MED MERGER 144A 6.375 15-23 15/06S	USD	1,250,000.00	133,828,178	CHINOS INTER A 144A 7.75 13-19 01/05S	USD	2,845,000.00	87,271,009	
	ALCATEL LUCENT 144A 6.75 13-20 15/11S	USD	65,000.00	8,288,325	CHIQUITA BRANDS 7.875 13-21 01/02S	USD	171,000.00	21,650,392	
	ALCATEL LUCENT USA 8.875 13-20 01/01S	USD	640,000.00	81,993,066	CINERMARK USA INC SUB 7.375 11-21 15/06S	USD	1,295,000.00	164,192,686	
	ALERE SUB 6.50 13-21 15/06S	USD	1,415,000.00	164,038,521	CIT GROUP INC 5.50 12-19 15/02S	USD	1,790,000.00	225,842,503	
	ALLEGION 5.75 14-21 01/10S	USD	1,295,000.00	159,676,565	CLAIRE S STORES 8.875 11-19 15/03S	USD	3,140,000.00	90,182,148	
	ALLY FINANCE 4.625 15-22 19/05S	USD	275,000.00	33,433,767	CLAIRE S STORES 144A 9.00 12-19 15/03S	USD	3,965,000.00	293,336,330	
	ALLY FINANCIAL 4.625 15-25 30/03S	USD	2,365,000.00	280,355,369	CLEAR CHANNEL 6.50 13-22 15/11S	USD	3,400,000.00	401,330,076	
	ALLY FINANCIAL 5.125 14-24 30/09S	USD	545,000.00	67,587,254	CLEAR CHANNEL COMM 9.00 11-21 01/03S	USD	1,850,000.00	153,389,647	
	ALLY FINANCIAL INC 5.75 15-25 20/11S	USD	610,000.00	74,049,904	CLEAR CHANNEL WORLDW 6.50 13-22 15/11S	USD	3,055,000.00	350,155,143	
	AMERICAN ENERGY 144A 7.125 14-20 01/08S	USD	850,000.00	39,877,790	CLEAR CHANNEL WORLDW 7.625 12-20 15/03S	USD	265,000.00	29,293,810	
	AMERICAN ENERGY 144A 7.375 14-21 01/11S	USD	1,120,000.00	53,892,156	CLEAR CHANNEL WORLDW 7.625 12-20 15/03S	USD	3,995,000.00	446,861,104	
	AMKOR TECHNOLOGY 6.375 12-22 01/10S	USD	1,250,000.00	20,653,748	CNH INDUSTRIAL 4.375 15-20 06/11S	USD	575,000.00	65,424,085	
	AMKOR TECHNOLOGY 6.625 11-21 01/06S	USD	2,085,000.00	250,085,186	COGENT COMM 144A 5.375 15-22 01/03S	USD	875,000.00	102,889,810	
	ANTERO RESOURCES 5.125 15-22 01/12S	USD	45,000.00	4,113,764	COGENT COMM FIN 144A 5.625 14-21 15/04S	USD	2,520,000.00	284,196,918	
	ANTERO RESOURCES 5.375 14-21 01/11S	USD	3,675,000.00	163,188,066	COMSCOPE INC 144A 5.00 14-21 15/06S	USD	360,000.00	41,790,480	
	ARGOS MERGER 144A 7.125 15-23 15/03S	USD	3,100,000.00	370,583,758	COMMUNICATIONS SALES 8.25 15-23 15/10S	USD	2,225,000.00	228,846,185	
	ASHLAND INC 4.75 13-22 15/08S	USD	1,485,000.00	174,847,363	CONSOL ENERGY 5.875 14-22 15/04S	USD	130,000.00	9,712,822	
	ASHTAD CAPITAL 144A 6.50 12-22 15/07S	USD	475,000.00	59,854,277	CORRECTION CORP OF AM 4.625 13-23 01/05S	USD	1,045,000.00	121,652,917	
	ASPECT SOFTWARE 10.625 11-17 15/05S	USD	3,395,000.00	335,910,231	CSI COMPRESSO LP 7.25 15-22 15/08S	USD	810,000.00	72,104,818	
	ASSOCIATED MATERIALS 9.125 11-17 01/11S	USD	953,000.00	80,248,789	DANA HOLDING CORP 5.50 14-24 15/12S	USD	495,000.00	58,411,669	
	ATWOOD OCEANICS 6.50 12-20 01/02U	USD	1,415,000.00	91,376,112	DANA HOLDINGS 6.00 13-23 15/09S	USD	1,245,000.00	152,665,261	
	AUDAET NORTH 144A 6.00 13-21 15/06S	USD	2,090,000.00	254,559,239	DAVITA HEALTHCARE 5.00 15-25 01/05S	USD	555,000.00	64,667,340	
	AVAYA -144 A- 7.00 11-19 01/04S	USD	1,915,000.00	171,621,857	DENBURY RESOURCE INC 4.625 13-23 15/07S	USD	360,000.00	13,845,424	
	AVIS BUDGET CAR 5.50 13-23 01/04S	USD	1,235,000.00	149,889,508	DENBURY RESOURCE SUB 5.50 14-22 01/05S	USD	2,685,000.00	111,684,192	
	BANK OF AMERICA CORP FL R 08-XX 30/01S	USD	3,335,000.00	409,135,259	DINEGY 7.375 15-22 01/11S	USD	1,715,000.00	180,499,104	
	BC MOUNTAIN FIN 144A 7.00 13-21 01/02	USD	1,010,000.00	95,072,139	DISH DBS CORP 5.00 12-23 15/03S	USD	1,495,000.00	156,181,129	
	BELDEN INC 5.50 12-22 01/09S	USD	2,830,000.00	330,221,781	DISH DBS CORP 5.875 12-22 15/07S	USD	3,105,000.00	348,983,421	
	BERRY PETROLEUM 6.375 12-22 15/09S	USD	525,000.00	15,788,718	DISH DBS CORP 5.875 15-24 15/11S	USD	4,400,000.00	469,921,317	
	BG FOODS INC 4.625 13-21 01/06S	USD	940,000.00	111,983,835	DISH DBS CORPORATION 6.75 11-21 01/06S	USD	1,275,000.00	155,221,229	
	BLACKBOARD 144A 7.75 13-19 15/11S	USD	1,140,000.00	119,651,413	DJO FINCO 144A 8.125 15-21 15/06S	USD	3,390,000.00	367,020,019	
	BLUE RACER MID 144A 6.125 14-22 15/11S	USD	1,280,000.00	107,399,368	DYNEGY 7.625 15-24 01/11S	USD	565,000.00	58,298,411	
	BREITBURN ENEGY WI 8.625 11-20 15/10	USD	2,580,000.00	65,200,656	ENERGIZER SPINCO INC 5.50 15-25 15/06S	USD	1,625,000.00	184,638,271	
	BUMBLE BEE 144A 9.00 10-17 15/12S	USD	1,988,000.00	243,182,040	ENTEGRIS 144A 6.00 14-22 01/04S	USD	825,000.00	100,980,127	
	CAESARS ENTERTAIN (DEFAULT) 12-20 15/02S	USD	1,240,000.00	115,976,401	EP ENERGY 9.375 12-20 01/05S	USD	2,480,000.00	188,321,809	
	CAESARS OP/CORP (DEFAULT) 13-20 15/02S	USD	10,390,000.00	965,520,684	EP ENERGY AS WHEN I 7.75 12-22 01/09S	USD	1,528,000.00	95,581,589	
	CALIFORNIA RES 144A 8.00 15-22 15/12S	USD	1,220,000.00	77,415,842	EQUINIX 5.875 15-26 15/01S	USD	365,000.00	45,260,468	
	CALIFORNIA RESOURCES 6.00 15-24 15/11S	USD	455,000.00	17,382,494	EV ENERGY 8.00 11-19 15/04S	USD	1,430,000.00	86,871,028	
	CAREFUSION 5.50 14-24 15/06S	USD	155,000.00	17,806,666	FGI 7.875 13-20 01/05S	USD	1,151,000.00	100,556,237	
	CCO HLDGS 144A 5.375 15-25 01/05S	USD	740,000.00	89,240,839	FIRST DATA 144A 5.375 15-23 15/08S	USD	2,765,000.00	336,357,577	
	CCO HLDGS LLC/CAP COR 5.125 15-23 01/05S	USD	1,555,000.00	186,864,171	FIRST DATA CORP (PIK) 8.75 10-22 15/01S	USD	2,234,000.00	280,496,343	

ストラクチャ-米国ハイ・イールド・ボンド

銘柄		通貨	額面金額	評価額	銘柄		通貨	額面金額	評価額
FIRST DATA CORP	144A 7.00 15-23 01/12S	USD	1,560,000.00	188,116,201	MARIPOSA BORROW	144A 8.00 13-21 15/10S	USD	1,685,000.00	151,516,053
FIRST DATA CORPORA	5.75 15-24 15/01S	USD	7,135,000.00	852,940,360	MARIPOSA BORROW	144A 8.75 13-21 15/10S	USD	840,000.00	65,428,446
FRONTIER COMM	144A 10.50 15-22 15/09S	USD	690,000.00	82,210,860	MCGRAW GLB EDC FL R	14-21 01/04S	USD	1,205,000.00	154,861,721
FRONTIER COMM	144A 11.00 15-25 15/09S	USD	1,720,000.00	205,045,219	MEMORIAL PROD PART	7.625 13-21 01/05S	USD	1,845,000.00	67,692,999
GCI	6.75 11-21 01/06S	USD	425,000.00	52,124,361	MEMORIAL PROD PARTNER	6.875 15-22 01/08S	USD	575,000.00	20,405,037
GENERAL CABLE CORP FL R	14-22 01/10S	USD	2,890,000.00	269,430,707	MGM RESORT	5.25 13-20 31/03S	USD	2,425,000.00	290,367,629
GENERAL MOTORS	4.25 13-18 15/05S	USD	1,870,000.00	222,830,341	MGM RESORT	7.75 12-22 15/03S	USD	6,050,000.00	776,509,885
GENERAL MOTORS	4.875 14-23 02/10S	USD	840,000.00	103,355,724	MICRON TECHNOLOGY	5.50 14-25 01/02S	USD	165,000.00	17,399,943
GEO GROUP	6.625 11-21 15/02S	USD	3,780,000.00	469,079,517	MICRON TECHNOLOGY	5.875 15-22 15/02S	USD	165,000.00	19,450,707
GLYMBOREE	9.125 11-18 01/12S	USD	4,760,000.00	134,561,977	MICRON TECHNOLOGY	144A 5.25 15-24 15/01S	USD	1,565,000.00	166,140,917
GOODYEAR TIRE & RU	5.125 15-23 15/11	USD	645,000.00	79,548,648	MPLX LP	5.50 15-23 15/02S	USD	1,850,000.00	196,107,190
GREAT LAKES DREDGE	7.375 11-19 01/02S	USD	3,955,000.00	446,031,274	NEPTUNE FINCO	144A 10.125 15-23 15/01S	USD	675,000.00	85,157,576
HALCON RESOURCE	144A 13.00 15-22 15/02S	USD	2,433,000.00	102,437,200	NEPTUNE FINCO CORP	10.875 15-25 15/10S	USD	1,005,000.00	127,243,531
HARRIS OPERATING (DEFAULT) LT	09-17 01/06S	USD	5,470,000.00	491,042,652	NEXEO SOLUTION SUB	8.375 12-18 01/03S	USD	2,045,000.00	232,165,575
HCA	5.875 15-26 15/02S	USD	1,585,000.00	191,620,899	NEXSTAR BROADCASTING	6.125 15-22 29/02S	USD	715,000.00	84,720,755
HCA INC	5.375 15-25 01/02S	USD	4,120,000.00	490,168,553	NEXSTAR BROADCAST	6.875 13-20 15/11S	USD	1,345,000.00	165,388,652
HCA INC	7.50 11-22 15/02S	USD	7,645,000.00	1,021,405,864	NIELSEN FIN -144A-	5.00 14-22 15/04S	USD	1,710,000.00	203,904,521
HD SUPPLY	11.50 13-20 15/07S	USD	585,000.00	78,186,740	NORANDA ALUMINIUM	11.00 14-19 01/06S	USD	2,275,000.00	30,487,865
HEALTHSOUTH	144A 5.75 15-25 15/09S	USD	525,000.00	59,365,579	NRG ENERGY	7.875 11-21 15/05S	USD	1,190,000.00	133,462,577
HERTZ	5.875 12-20 15/10S	USD	2,435,000.00	303,826,582	NRG ENERGY INC	6.25 14-22 15/07S	USD	1,010,000.00	105,910,970
HERTZ	7.375 11-21 15/01S	USD	935,000.00	116,707,158	OASIS PETROLEUM	6.875 14-22 15/03S	USD	1,935,000.00	152,464,879
HEXION US FIN	6.625 12-20 15/04S	USD	4,790,000.00	450,886,681	OMEGA US SUB	144A 8.75 15-23 15/07S	USD	895,000.00	99,858,376
HEXION US FIN	8.875 10-18 01/02S	USD	1,250,000.00	108,023,399	OSHKOSH	5.375 15-25 01/03S	USD	515,000.00	61,332,401
HILLP / HILFIN	144A 7.25 12-20 01/10S	USD	2,560,000.00	312,382,035	OSHKOSH CORP	5.375 14-22 01/03S	USD	355,000.00	43,407,215
HMAN FINANCE	144A 6.375 14-22 15/07S	USD	1,430,000.00	142,993,153	PEABODY ENERGY	6.25 12-21 15/11S	USD	2,360,000.00	42,260,785
HRG GROUP	144A 7.75 15-22 15/01S	USD	315,000.00	37,750,824	PEABODY ENERGY	6.50 10-20 15/09S	USD	170,000.00	2,760,770
HUNTSMAN INTL	4.875 12-20 15/11S	USD	1,040,000.00	114,592,816	PLANTRONICS INC	5.50 15-23 31/05S	USD	980,000.00	117,490,508
IHEARTCOMMUNICATIO	10.625 15-23 15/03	USD	1,140,000.00	94,624,040	POST HOLDINGS	7.375 12-22 15/02S	USD	2,930,000.00	367,821,196
INFINITY ACQ LLC	144A 7.25 14-22 01/08S	USD	1,465,000.00	152,440,821	POST HOLDINGS	144A 6.00 14-22 15/12S	USD	150,000.00	17,773,585
INFOR SOFTWARE PIK	7.125 14-21 01/05S	USD	2,400,000.00	210,756,825	POST HOLDINGS	144A 7.75 15-24 15/03S	USD	645,000.00	81,857,734
INFOR US INC	6.50 15-22 15/05S	USD	3,460,000.00	354,828,122	POST HOLDINGS INC	8.00 15-25 15/07S	USD	910,000.00	116,447,055
INTL LEASE FINANCE	5.875 12-19 01/04S	USD	1,685,000.00	215,053,474	QWEST CAP FDG	7.75 01-31 15/02S	USD	2,295,000.00	233,912,455
INVENTIV HEALTH	10.00 15-18 15/08S	USD	1,133,000.00	135,612,755	RADIO SYST CORP	144A 8.375 12-19 01/11S	USD	4,565,000.00	570,769,284
INVENTIV HEALTH	10.00 15-18 15/08S	USD	769,000.00	88,344,040	RAIN CII CARBON	144A 8.00 10-18 01/12S	USD	935,000.00	97,572,771
INVENTIV HEALTH	144A 10.00 14-18 15/08	USD	1,654,756.00	189,603,564	RAIN CII CARBON	144A 8.25 12-21 15/01S	USD	125,000.00	11,803,947
INVENTIV HEALTH	144A 9.00 12-18 15/01S	USD	3,015,000.00	370,849,911	REGAL ENTERTAINMENT	5.75 14-22 15/03S	USD	1,100,000.00	133,907,092
ITALICS MERGER SUB	7.125 15-23 15/07S	USD	1,635,000.00	175,538,962	REGENCY AGENCY	5.50 12-23 15/04S	USD	3,235,000.00	355,103,297
JACK COOPER	144A 9.25 13-20 01/06S	USD	4,375,000.00	440,110,505	REICHHOLD	12.00 15-17 31/03Q	USD	1,270,000.00	152,774,640
JC PENNEY CO INC	6.375 07-36 15/10S	USD	2,129,000.00	161,027,928	REICHHOLD HLDG INTL	12.00 15-17 31/03Q	USD	3,114,370.18	374,643,134
JCH PARENT PIK	144A 10.50 14-19 15/03S	USD	1,534,037.00	115,566,276	REICHHOLD	144A 9.00 12-17 20/04S	USD	3,734,025.66	5
KINETICS CONCEPT	10.50 13-18 01/11S	USD	3,350,000.00	391,611,864	RENAISSANCE ACQ	144A 6.875 13-21 15/08S	USD	1,160,000.00	107,796,342
KRATOS DEF SEC	7.00 14-19 15/05S	USD	2,488,000.00	205,390,466	RENTECH NIT PART/FIN	6.50 13-21 15/04S	USD	985,000.00	115,824,529
LAREDO PETROLEUM INC	5.625 14-22 15/01S	USD	670,000.00	70,447,177	REYNOLDS GROUP	5.75 12-20 15/10S	USD	1,185,000.00	144,670,702
LEGACY RESERVES	6.625 13-21 01/12S	USD	115,000.00	2,905,124	REYNOLDS GROUP	9.875 12-19 15/08S	USD	4,493,000.00	544,976,831
LEGACY RESERVES	8.00 13-20 01/12S	USD	3,250,000.00	86,010,919	REYNOLDS GRP	9.00 12-19 15/04S	USD	4,395,000.00	519,962,422
LEVEL 3 COMMUNICATIONS	5.75 14-22 01/12S	USD	1,000,000.00	123,334,846	RPH HOTEL	5.00 15-23 15/04S	USD	495,000.00	60,141,481
LEVEL 3 FINANCING	5.625 15-23 01/02S	USD	385,000.00	47,517,725	RSP PERMIAN	6.875 15-22 01/10S	USD	570,000.00	63,082,693
LEVEL 3 FINANCING	5.375 15-24 15/01S	USD	660,000.00	79,919,494	SABINE PASS	5.625 14-23 15/04S	USD	100,000.00	10,481,784
LEVEL 3 FING	144A 5.375 15-25 01/05S	USD	525,000.00	62,996,983	SABINE PASS	5.75 14-24 15/05S	USD	1,410,000.00	148,882,086
LINN ENERGY	7.75 11-21 01/02S	USD	2,230,000.00	40,238,674	SABINE PASS	6.25 14-22 15/03S	USD	2,475,000.00	273,718,171
LINN ENERGY	8.625 11-20 15/04S	USD	310,000.00	6,619,232	SABRE INC	144A 5.25 15-23 15/11S	USD	585,000.00	70,020,708
LSB INDUSTRIES	7.75 14-19 01/08S	USD	3,380,000.00	343,574,526	SABRE INC	144A 5.375 15-23 15/04S	USD	1,095,000.00	131,723,015
LTF MERGER SUB INC	8.50 15-23 15/06S	USD	1,845,000.00	213,066,489	SALLY HOLDINGS/SAL	5.625 15-25 01/12S	USD	460,000.00	56,356,086
MAGNACHIP SEMI	6.625 13-21 15/07S	USD	2,120,000.00	181,068,021	SANCHEZ ENERGY	6.125 15-23 15/01S	USD	1,725,000.00	112,573,557

ストラクチャラ-米国ハイ・イールド・ボンド

銘柄	通貨	額面金額	評価額
SANDRIDGE ENERGY 7.50 11-21 15/03S	USD	565,000.00	7,136,500
SERVICE CORP INTL 7.50 07-27 01/04S	USD	3,465,000.00	468,270,503
SINCLAIR TELE GRP 5.375 13-21 01/04S	USD	1,790,000.00	216,658,762
SINCLAIR TELE GRP 6.125 13-22 01/10S	USD	140,000.00	17,218,544
SIRIUS XM RADIO 144A 4.625 13-23 15/05S	USD	980,000.00	115,776,519
SIRIUS XM RADIO 144A 6.00 14-24 15/07S	USD	955,000.00	120,613,166
SIRIUS XM RADIO INC 5.75 13-21 01/08S	USD	1,650,000.00	204,770,826
SM ENERGY 6.125 15-22 15/11S	USD	300,000.00	26,885,931
SPRINT CAP CORP 8.75 02-32 15/03S	USD	8,250,000.00	761,246,255
SPRINT CORP 7.875 14-23 15/09S	USD	11,585,000.00	1,045,519,704
TARGA RESOURCES 144A 6.75 15-24 15/03S	USD	995,000.00	102,337,957
TARGA RESOURCES PA 4.125 14-19 15/11S	USD	725,000.00	72,823,581
TEGNA 144A 4.875 14-21 15/09S	USD	505,000.00	61,280,524
TEGNA 144A 5.50 14-24 15/09S	USD	505,000.00	61,128,652
TENET HEALTHCARE 6.75 15-23 15/06S	USD	1,495,000.00	166,426,671
TENET HEALTHCARE 8.00 11-20 01/08S	USD	2,580,000.00	310,230,726
TENET HEALTHCARE CORP 8.125 13-22 01/04S	USD	2,870,000.00	341,990,950
TEREX CORP 6.00 12-21 15/05S	USD	1,905,000.00	214,314,555
TEREX CORP 6.50 12-20 01/04S	USD	2,035,000.00	238,763,532
TESORO 5.875 13-20 01/10S	USD	1,932,000.00	224,696,238
TIME INC 144A 5.75 14-22 15/04S	USD	1,505,000.00	167,465,665
T-MOBILE USA 6.50 15-26 15/01S	USD	1,130,000.00	136,625,241
T-MOBILE USA INC 6.633 13-21 28/04S	USD	1,020,000.00	128,326,727
T-MOBILE USA INC 6.731 13-22 28/04S	USD	3,015,000.00	379,159,125
TRIUMPH GROUP INC 4.875 13-21 01/04S	USD	2,230,000.00	218,541,608
UCI 8.625 11-19 15/02S	USD	6,080,000.00	254,159,258
UNITED RENTALS 7.625 12-22 15/04S	USD	1,670,000.00	214,649,763
UNITED RENTALS NA 6.125 12-23 15/06S	USD	595,000.00	72,956,927
US COATING ACQ 144A 7.375 13-21 01/05S	USD	665,000.00	84,395,959
VALEANT PHARMA 144A 7.25 11-22 15/07S	USD	3,940,000.00	466,644,289
VALEANT PHARMA -144A- 6.75 11-21 15/08S	USD	2,560,000.00	298,149,886
VANGUARD NAT RES 7.875 12-20 01/04S	USD	1,560,000.00	53,222,306
VISTA OUTDOOR INC 5.875 15-23 01/10S	USD	720,000.00	89,319,031
WHITING PETROLEUM 5.75 13-21 15/03S	USD	2,380,000.00	213,544,132
WINDSTREAM GTD 7.75 11-21 01/10S	USD	7,115,000.00	673,652,320
WMG ACQUISITION 144A 5.625 14-22 15/04S	USD	405,000.00	47,623,283
WMG ACQUISITION 144A 6.00 12-21 15/01S	USD	981,000.00	118,746,946
WPX ENERGY 5.25 14-24 15/09S	USD	765,000.00	62,117,326
WPX ENERGY 8.25 15-23 01/08S	USD	1,720,000.00	168,629,519
WYNN LAS VEGAS 5.50 15-25 01/03S	USD	2,800,000.00	301,098,845

銘柄	通貨	額面金額	評価額
XPO LOGISTICS INC 6.50 15-22 15/06S	USD	1,635,000.00	183,160,402
ZAYO GROUP 6.00 15-23 01/04S	USD	1,160,000.00	132,565,081
ZEBRA TECHNO 7.25 15-22 15/10S	USD	1,785,000.00	225,462,888
ZF NA CAPITAL 4.75 15-25 29/04S	USD	2,210,000.00	254,417,640
ZF NA CAPITAL -144A- 4.50 15-22 29/04S	USD	675,000.00	79,435,474
ALGECO SCOTSMAN 144A 8.50 12-18 15/10S	USD	3,360,000.00	340,531,062
INTER GAME TECH 144A 6.50 15-25 15/02S	USD	2,525,000.00	268,814,196
INTL GAME TECH 144A 6.25 15-22 15/02S	USD	1,410,000.00	159,863,022
SENSATA TECH UK FI 6.25 15-26 15/02S	USD	1,410,000.00	177,248,655
CONSTELLIUM 144A 5.75 14-24 15/05S	USD	250,000.00	20,750,886
NXP BV 144A 5.75 13-23 15/03S	USD	960,000.00	119,813,812
BOMBARDIER 144A 7.50 15-25 15/03S	USD	540,000.00	45,552,706
BOMBARDIER 144A 7.75 10-20 15/03S	USD	1,670,000.00	163,978,614
MEG ENERGY 144A 6.375 12-23 30/01S	USD	1,940,000.00	163,360,599
MEG ENERGY 144A 7.00 13-24 31/03S	USD	1,035,000.00	89,643,828
QUEBECOR MEDIA INC 5.75 13-23 15/01S	USD	2,843,000.00	345,056,129
TRINIDAD DRILL -144A- 7.875 10-19 15/01S	USD	1,420,000.00	159,715,660
ULTRA PETROLEUM 144A 6.125 14-24 01/10S	USD	1,805,000.00	48,854,803
VPII ESCROW CORP 144A 7.50 13-21 15/07S	USD	5,940,000.00	713,873,425
VRX ESCROW 144A 5.875 15-23 15/05S	USD	1,285,000.00	138,589,406
VRX ESCROW 144A 6.125 15-25 15/04S	USD	160,000.00	17,322,478
AIRCASLE 5.125 14-21 15/03S	USD	335,000.00	41,575,489
AIRCASLE 7.625 12-20 15/04S	USD	230,000.00	31,312,257
NUMERICABLE 144A 6.00 14-22 15/05S	USD	1,660,000.00	193,601,147
NUMERICABLE 144A 6.25 14-24 15/05S	USD	945,000.00	110,268,404
ALBEA BEAUTY HLDG 144A 8.375 12-19 01/11S	USD	2,990,000.00	377,666,126
ALTICE FINANCE 144A 6.625 15-23 15/02S	USD	810,000.00	96,708,151
ALTICE FINANCE 144A 7.625 15-25 15/02S	USD	380,000.00	39,655,244
ALTICE FINANCE 144A 7.75 14-22 15/05S	USD	1,530,000.00	166,509,404
INEOS 144A 6.125 13-18 15/08S	USD	2,465,000.00	293,911,785
INEOS GRP 144A 5.875 14-19 01/02S	USD	1,235,000.00	144,786,324
INTELSAT 5.50 13-23 01/08S	USD	2,785,000.00	265,591,686
INTELSAT 6.625 12-22 15/12S	USD	1,340,000.00	103,656,631
INTELSAT 7.25 10-20 15/10S	USD	5,905,000.00	625,534,203
INTELSAT LUX 7.75 13-21 01/06S	USD	1,600,000.00	90,461,834
MALLINCKRODT FIN/S 5.625 15-23 15/10S	USD	775,000.00	89,499,474
MALLINCKRODT INTL FIN 5.50 15-25 15/04A	USD	425,000.00	47,290,969

(注) 通貨欄の表記は以下の通りです。

USD(米ドル)

(2) その他

銘柄	口数	現地通貨	評価額
アメリカ REICHHOLD CAYMAN EQUITY	5,835	USD	385,354,781.00

(注) 通貨欄の表記は以下の通りです。

USD(米ドル)

ストラクチャラ-米国ハイ・イールド・ボンド

■外国為替先物契約（I 9 シェアクラス、円）

(2015年12月31日現在)

					評価損益	
					日本円	
買 建	契約額	売 建	契約額	満 期 日		
米ドル	174,801.31	日本円	21,000,000	2016/1/27		17,105
米ドル	481,418.06	日本円	58,000,000	2016/1/27	△	117,060
米ドル	195,530.98	日本円	24,000,000	2016/1/27	△	490,479
米ドル	309,973.85	日本円	38,000,000	2016/1/27	△	730,526
米ドル	162,476.00	日本円	20,000,000	2016/1/27	△	464,820
米ドル	205,012.86	日本円	25,000,000	2016/1/27	△	350,432
米ドル	246,792.42	日本円	30,000,000	2016/1/27	△	327,098
					小計①	△ 2,463,310
					評価損益	
					日本円	
売 建	契約額	買 建	契約額	満 期 日		
米ドル	9,055,720.15	日本円	1,080,000,000.00	2016/1/27	△	8,807,733
米ドル	317,057.72	日本円	39,000,000.00	2016/1/27		878,802
米ドル	280,184.63	日本円	34,000,000.00	2016/1/27		312,211
					小計②	△ 7,616,720
					合計①+②	△10,080,030

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9期》

決算日：2016年2月15日

（計算期間：2015年2月17日～2016年2月15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。

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

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 比	純 資 産 額
		税 込 分 配	み 金 騰 落 中 率		
	円	円	%	%	百万円
5期（2012年2月15日）	10,068	0	0.0	84.3	1,007
6期（2013年2月15日）	10,072	0	0.0	77.0	1,882
7期（2014年2月17日）	10,076	0	0.0	79.5	3,458
8期（2015年2月16日）	10,077	0	0.0	79.2	5,683
9期（2016年2月15日）	10,077	0	0.0	66.6	4,511

（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。

CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）

■ 当期中の基準価額等の推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率		債 券 組 入 率
		騰 落	率	
(期 首) 2015年 2月16日	円 10,077	%	—	% 79.2
2月末	10,077	0.0		79.2
3月末	10,077	0.0		18.4
4月末	10,077	0.0		78.9
5月末	10,077	0.0		78.9
6月末	10,077	0.0		18.2
7月末	10,077	0.0		—
8月末	10,077	0.0		78.7
9月末	10,077	0.0		—
10月末	10,077	0.0		59.0
11月末	10,078	0.0		82.7
12月末	10,077	0.0		66.4
2016年 1月末	10,077	0.0		88.6
(期 末) 2016年 2月15日	10,077	0.0		66.6

(注) 騰落率は期首比です。

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	第9期 (2015年 2月17日 ～2016年 2月15日)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬 (投 信 会 社) (販 売 会 社) (受 託 会 社)	2円 (2) (0)	0.024% (0.019) (0.001)	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
合 計	2	0.024	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価

期中の平均基準価額は10,077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。

■ 期中の売買及び取引の状況（2015年 2月17日から2016年 2月15日まで）

公社債

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国 内	国 債 証 券	615,387,673	610,882,802 (6,000,000)

(注1) 金額は受渡し代金です。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 (2015年2月17日から2016年2月15日まで)
公社債

買 付		売 付	
銘	柄 金 額	銘	柄 金 額
	千円		千円
第336回利付国債(2年)	1,000,200		
第568回国庫短期証券	1,000,013		
第567回国庫短期証券	1,000,000		
第525回国庫短期証券	999,980	—	—
第521回国庫短期証券	999,965		
第522回国庫短期証券	999,965		
第582回国庫短期証券	500,029		

(注1) 金額は受渡し代金です。経過利子分は含まれておりません。

(注2) 国内の現先取引によるものは含まれておりません。

■利害関係人との取引状況等 (2015年2月17日から2016年2月15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 (2016年2月15日現在)

公社債

(A) 公社債種類別

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 B B 格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
	千円	千円	%	%	5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
					%	%	%
国 債 証 券	3,000,000	3,005,775	66.6	—	—	—	66.6
合 計	3,000,000	3,005,775	66.6	—	—	—	66.6

(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) 単位未满是切捨てです。

(注3) 一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おります。

(B) 公社債銘柄別

国内(邦貨建)公社債

種 類	銘	柄	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
			%	千円	千円	
国 債 証 券	第582回国庫短期証券		—	500,000	500,100	2016/4/18
	第583回国庫短期証券※		—	2,500,000	2,505,675	—
合 計				3,000,000	3,005,775	

(注1) 額面・評価額の単位未满是切捨てです。

(注2) ※印は現先で保有している債券です。

CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）

■投資信託財産の構成（2016年2月15日現在）

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公 社 債	3,005,775	66.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,506,957	33.4
投 資 信 託 財 産 総 額	4,512,732	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

2016年2月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	4,512,732,049円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,506,957,008
公 社 債(評価額)	3,005,775,000
未 収 利 息	41
(B) 負 債	1,190,554
未 払 信 託 報 酬	1,190,554
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	4,511,541,495
元 本	4,477,162,110
次 期 繰 越 損 益 金	34,379,385
(D) 受 益 権 総 口 数	4,477,162,110口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D)	10,077円

(注記事項)

期首元本額	5,639,658,154 円
期中追加設定元本額	175,776,533 円
期中一部解約元本額	1,338,272,577 円

■損益の状況

当期 自2015年2月17日 至2016年2月15日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	1,181,407円
受 取 利 息	1,181,407
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 69,771
売 買 益	137,246
売 買 損	△ 207,017
(C) 信 託 報 酬 等	△ 1,190,554
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△ 78,918
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	1,361,672
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	33,096,631
(配 当 等 相 当 額)	(22,331,388)
(売 買 損 益 相 当 額)	(10,765,243)
(G) 計 (D+E+F)	34,379,385
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	34,379,385
追 加 信 託 差 損 益 金	33,096,631
(配 当 等 相 当 額)	(22,331,388)
(売 買 損 益 相 当 額)	(10,765,243)
分 配 準 備 積 立 金	1,361,672
繰 越 損 益 金	△ 78,918

(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まず。

(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。

《お知らせ》

- 平成28年1月9日付で、信用リスク集中回避のため、投資制限の条文新設に伴い、投資信託約款に所要の変更を行いました。