

■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 | 2011年1月31日から2021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/資源国通貨(ブラジルレアル、豪ドル、南アフリカランド) 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 (I11シェアクラス、資源国通貨)」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 (資源国通貨コース) | ストラクチャラ-欧州ハイ・イールド・ボンド (I11シェアクラス、資源国通貨) CAマネーパブルファンド (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 (I11シェアクラス、資源国通貨) | 欧州のハイイールド債 |
| | CAマネーパブルファンド (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・欧州
 ハイ・イールド債券ファンド
 (資源国通貨コース)

運用報告書 (全体版)
 第12作成期

| | |
|------|-------------------|
| 第64期 | (決算日 2016年5月9日) |
| 第65期 | (決算日 2016年6月8日) |
| 第66期 | (決算日 2016年7月8日) |
| 第67期 | (決算日 2016年8月8日) |
| 第68期 | (決算日 2016年9月8日) |
| 第69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・欧州ハイ・イールド債券ファンド（資源国通貨コース）

■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8作成期 | | 円 | | 円 | | % | % | 百万円 |
| | 40期 (2014年5月8日) | 7,244 | | 115 | | 0.1 | 0.4 | 6,397 |
| | 41期 (2014年6月9日) | 7,253 | | 115 | | 1.7 | 0.4 | 6,734 |
| | 42期 (2014年7月8日) | 7,117 | | 115 | △ | 0.3 | 0.5 | 7,065 |
| | 43期 (2014年8月8日) | 6,889 | | 115 | △ | 1.6 | 0.5 | 7,407 |
| | 44期 (2014年9月8日) | 7,154 | | 115 | | 5.5 | 0.4 | 7,935 |
| 第9作成期 | 45期 (2014年10月8日) | 6,856 | | 115 | △ | 2.6 | 0.5 | 8,020 |
| | 46期 (2014年11月10日) | 6,997 | | 115 | | 3.7 | 0.5 | 8,212 |
| | 47期 (2014年12月8日) | 7,214 | | 115 | | 4.7 | 0.5 | 8,396 |
| | 48期 (2015年1月8日) | 6,748 | | 115 | △ | 4.9 | 0.5 | 7,959 |
| | 49期 (2015年2月9日) | 6,693 | | 115 | | 0.9 | 0.5 | 7,986 |
| | 50期 (2015年3月9日) | 6,528 | | 100 | △ | 1.0 | 0.5 | 7,758 |
| 第10作成期 | 51期 (2015年4月8日) | 6,380 | | 100 | △ | 0.7 | 0.5 | 7,433 |
| | 52期 (2015年5月8日) | 6,300 | | 100 | | 0.3 | 0.5 | 7,188 |
| | 53期 (2015年6月8日) | 6,290 | | 100 | | 1.4 | 0.5 | 7,231 |
| | 54期 (2015年7月8日) | 5,930 | | 100 | △ | 4.1 | 0.6 | 6,511 |
| | 55期 (2015年8月10日) | 5,811 | | 100 | △ | 0.3 | 0.6 | 6,239 |
| | 56期 (2015年9月8日) | 5,002 | | 100 | △ | 12.2 | 0.7 | 5,195 |
| 第11作成期 | 57期 (2015年10月8日) | 5,062 | | 80 | | 2.8 | 0.7 | 5,200 |
| | 58期 (2015年11月9日) | 5,072 | | 80 | | 1.8 | 0.8 | 5,085 |
| | 59期 (2015年12月8日) | 5,064 | | 80 | | 1.4 | 0.6 | 4,892 |
| | 60期 (2016年1月8日) | 4,426 | | 80 | △ | 11.0 | 0.7 | 4,091 |
| | 61期 (2016年2月8日) | 4,331 | | 40 | △ | 1.2 | 0.7 | 3,892 |
| | 62期 (2016年3月8日) | 4,440 | | 40 | | 3.4 | 0.5 | 3,866 |
| 第12作成期 | 63期 (2016年4月8日) | 4,333 | | 40 | △ | 1.5 | 0.5 | 3,580 |
| | 64期 (2016年5月9日) | 4,356 | | 40 | | 1.5 | 0.1 | 3,548 |
| | 65期 (2016年6月8日) | 4,466 | | 40 | | 3.4 | 0.1 | 3,537 |
| | 66期 (2016年7月8日) | 4,218 | | 40 | △ | 4.7 | 0.1 | 3,237 |
| | 67期 (2016年8月8日) | 4,516 | | 40 | | 8.0 | 0.1 | 3,361 |
| | 68期 (2016年9月8日) | 4,535 | | 40 | | 1.3 | 0.1 | 3,213 |
| | 69期 (2016年10月11日) | 4,579 | | 40 | | 1.9 | 0.1 | 3,115 |

(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・欧州ハイ・イールド債券ファンド（資源国通貨コース）

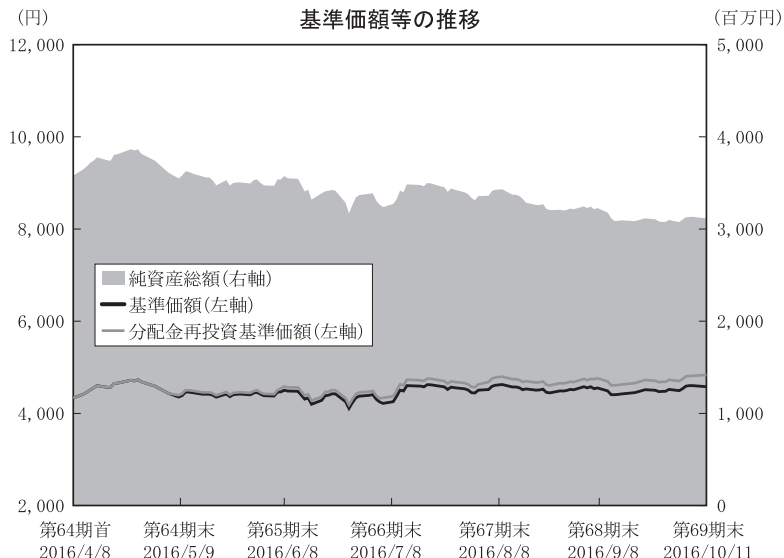
■ 当作成期中の基準価額等の推移

| 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64期 | (期 首)2016年4月8日 | 円 4,333 | % — | % 0.5 | % 97.8 |
| | 4月末 | 4,684 | 8.1 | 0.1 | 98.5 |
| | (期 末)2016年5月9日 | 4,396 | 1.5 | 0.1 | 98.3 |
| 第65期 | (期 首)2016年5月9日 | 4,356 | — | 0.1 | 98.3 |
| | 5月末 | 4,443 | 2.0 | 0.1 | 98.3 |
| | (期 末)2016年6月8日 | 4,506 | 3.4 | 0.1 | 98.4 |
| 第66期 | (期 首)2016年6月8日 | 4,466 | — | 0.1 | 98.4 |
| | 6月末 | 4,337 | △2.9 | 0.1 | 98.5 |
| | (期 末)2016年7月8日 | 4,258 | △4.7 | 0.1 | 98.4 |
| 第67期 | (期 首)2016年7月8日 | 4,218 | — | 0.1 | 98.4 |
| | 7月末 | 4,556 | 8.0 | 0.1 | 98.5 |
| | (期 末)2016年8月8日 | 4,556 | 8.0 | 0.1 | 98.4 |
| 第68期 | (期 首)2016年8月8日 | 4,516 | — | 0.1 | 98.4 |
| | 8月末 | 4,498 | △0.4 | 0.1 | 98.5 |
| | (期 末)2016年9月8日 | 4,575 | 1.3 | 0.1 | 98.4 |
| 第69期 | (期 首)2016年9月8日 | 4,535 | — | 0.1 | 98.4 |
| | 9月末 | 4,520 | △0.3 | 0.1 | 98.5 |
| | (期 末)2016年10月11日 | 4,619 | 1.9 | 0.1 | 97.7 |

(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。

【基準価額等の推移】

| | |
|----------------|----------------------|
| 第64期首 | 4,333円 |
| 第69期末 | 4,579円 |
| 既払分配金 (税込み) | 240円 |
| 騰落率 | 11.5% (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原油価格の回復を背景に、当作成期を通じて、エネルギーと素材セクターがそのけん引役となりハイイールド債市場が上昇傾向にあったこと
- ②3月上旬に行われたECB（欧州中央銀行）の追加金融緩和策により、投資家の利回り追求の動きが継続したこと
- 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
- ④為替市場において、当作成期は資源国通貨高・円安となったこと
- ⑤ユーロ売り／資源国通貨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

- ①主要中央銀行の金融政策や英国の国民投票を控えた5月上旬に、投資家の様子見姿勢から欧州ハイイールド債市場が調整したこと
- ②6月下旬に英国が国民投票でEU（欧州連合）離脱の選択をし、投資家のリスク回避的行動がみられたこと

【投資環境】

＜欧州ハイイールド債券市場＞

当作成期の欧州ハイイールド債市場は、3月にECB（欧州中央銀行）が決定した社債購入プログラムを含む大規模な追加金融緩和策を受けて堅調となっていた流れを引き継ぎ、上昇傾向で始まりました。社債購入プログラムは投資適格社債が対象ではあったものの、低金利環境における投資家利回りの追及の動きが加速し、欧州ハイイールド債にとってもプラス要因となりました。ところが6月下旬に英国においてEU（欧州連合）離脱の是非を問う国民投票の結果が判明すると、金融市場は大きく混乱し、英ポンドが急落、ドイツ10年物国債利回りがマイナスになると共に、周縁国国債が乱高下しました。それでも主要中央銀行による金融政策対応を受け、ボラティリティ（価格変動性）はその後数日の間に低下しました。また、EU離脱に向けた不透明感の中、8月にBOE（英国中央銀行）が英国経済の下支えを目的として新たな景気刺激策を発表したことは市場にとりプラス要因となりました。加えて、原油価格の回復はエネルギーセクターを中心にハイイールド債市場の下支え要因となりました。このような状況下、当作成期間の欧州ハイイールド債市場は、プラスのリターンとなりました。セクター別では、エネルギーセクターが10%を超える良好なリターンとなるなど、多くのセクターがプラスのリターンを記録しました。一方、公益事業や不動産セクターのリターンはマイナスとなりました。

＜為替市場＞

当作成期初、資源国通貨（ブラジルレアル、豪ドル、南アフリカランド）の対円相場は、それぞれ29円付近、81円付近、7.1円付近で始まりました。ブラジルレアルは、米国利上げ時期をめぐる憶測、英国のEU離脱決定、新政権による経済改革が期待される中、前下院議長の議員資格剥奪などの政治不安等、内外の要因を受けて上下に振れる展開となりました。豪ドルは、反発して開始した後、急落しました。軟調に推移した後、英国のEU離脱の国民投票の結果を受けて一気に円が買われました。市場が落ち着きを取り戻すと豪ドルは反発し、その後は一進一退となりました。南アフリカランドは、反発して開始した後、急落しました。ズマ大統領やゴードン財務相に絡む政治的な混乱や、米国の大手格付会社の格下げリスク、経済成長率の見通しの下方修正などが重しとなった一方で、リスク選好が高まる局面では高金利通貨である南アフリカランドが選好されました。ブラジルレアルは対円で上昇、豪ドルは対円で下落、南アフリカランドは上昇となり、当作成期末は、ブラジルレアル32円付近、豪ドル79円付近、南アフリカランド7.5円付近で迎えました。

＜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、日銀の更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、欧州のハイイールド債を主要投資対象とする円建の外国籍投資信託「ストラクチャル-欧州ハイ・イールド・ボンド（I11シェアクラス、資源国通貨）」と、円建の国内籍投資信託「CAマネーブルーファンド（適格機関投資家専用）」を投資対象とし、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。ファンドは「ストラクチャル-欧州ハイ・イールド・ボンド（I11シェアクラス、資源国通貨）」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）

＜ストラクチャル-欧州ハイ・イールド・ボンド（I11シェアクラス、資源国通貨）＞

当作成期は、ECBによる投資適格社債の購入プログラム導入により、投資家がハイイールド債の中では格付の高いBB+格債とBB格債への投資を拡大したため、割高となったこれらの債券のウェイトを若干削減しました。銘柄固有のリスクは依然として高いため、引き続き個別銘柄選択を重視した運用を継続しました。パフォーマンスについては、当ファンドは金融セクターに対して強気にみており、金融劣後債等への投資を行っていますが、当作成期は金融セクターが弱含んだ影響を受けてこのポジションがマイナス要因に働きました。また、現金等の比率を高め維持していたこともパフォーマンスにとりややマイナス要因となりました。

（アムンディ アセットマネジメント）

アムンディ・欧州ハイ・イールド債券ファンド（資源国通貨コース）

実質的なユーロ建資産の3分の1ずつに対し、それぞれユーロ売り／ブラジルレアル買い、ユーロ売り／豪ドル買い、ユーロ売り／南アフリカランド買いの為替取引を行い、当作成期を通じて資源国通貨（ブラジルレアル、豪ドル、南アフリカランド）合計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-欧州ハイ・イールド・ボンド（I11シェアクラス、資源国通貨）」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-欧州ハイ・イールド・ボンド（I11シェアクラス、資源国通貨）>

英国のEU離脱によるマクロ経済的影響、欧州（特にイタリア）の銀行セクターの健全性、米国の大統領選挙等、今後も市場の波乱要因が数多く存在します。しかし、主要中央銀行はより一層の金融緩和の用意があることを示唆しており、ユーロ圏債券市場の45%以上はマイナスの利回りとなっています。このため、欧州ハイイールド債には依然として投資妙味が存在します。また欧州企業のファンダメンタルズ（基礎的条件）は堅調で、デフォルト（債務不履行）率は低位にとどまると予想され、引き続き投資家による利回り追求から恩恵を受けるとみられます。従って、当ファンドはこの資産クラスに対する楽観的な見方を維持します。ただし、銘柄固有のリスクは高い状態が続くとみられるため、パフォーマンスにおいては銘柄選択が重要な要素となるでしょう。当ファンドは引き続き、劣後債や低格付社債を対象に、選別的な形で利回りを追求する方針です。また、分散投資を徹底しつつ、流動性を重視し、市場の押し目を活用いたします。

（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の3分の1ずつに対し、それぞれユーロ売り／ブラジルレアル買い、ユーロ売り／豪ドル買い、ユーロ売り／南アフリカランド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、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）

■ 1万口当たりの費用明細

| 項 目 | 第64期～第69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) | 25円 (7) (17) (1) | 0.556% (0.154) (0.385) (0.016) | 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) (そ の 他) | 1 (0) (1) (0) | 0.026 (0.005) (0.020) (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 ファンドの法定開示資料の印刷に係る費用 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 | 26 | 0.582 | |

期中の平均基準価額は4,506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 64 期 ～ 第 69 期 | | | |
|-------|---|-----------------|-------|------------|---------|
| | | 買 付 | | 売 付 | |
| | | 口 数 | 買 付 額 | 口 数 | 売 付 額 |
| 国内 | CAマネープールファンド（適格機関投資家専用） | 口 | 千円 | 口 | 千円 |
| | | — | — | 14,886,859 | 15,000 |
| 外国 | (ルクセンブルク) ストラクチャラ-欧州ハイ・イールド・ボンド (I11シェアクラス、資源国通貨) | 口 | 千円 | 口 | 千円 |
| | | — | — | 149,400 | 665,692 |

- (注1) 金額は受渡し代金です。
 (注2) 単位未満は切捨てです。

アムンディ・欧州ハイ・イールド債券ファンド（資源国通貨コース）

■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。

■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11作成期末 (第63期末) | 第12作成期末（第69期末） | |
|------------------------|---------|--------------------|----------------|--------|
| | | 口数 | 口数 | 評価額 |
| | | 口 | 口 | 千円 |
| CAマネーブルファンド（適格機関投資家専用） | | 18,566,990 | 3,680,131 | 3,705 |
| 合計 | 口数・金額 | 18,566,990 | 3,680,131 | 3,705 |
| | 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11作成期末 (第63期末) | 第12作成期末（第69期末） | |
|--|---------|--------------------|----------------|-----------|
| | | 口数 | 口数 | 評価額 |
| | | 口 | 口 | 千円 |
| (ルクセンブルク) ストラクチャラ-欧州ハイ・イールド・ボンド (I IIシエアクラス、資源国通貨) | | 808,800 | 659,400 | 3,043,131 |
| 合計 | 口数・金額 | 808,800 | 659,400 | 3,043,131 |
| | 銘柄数〈比率〉 | 1 | 1 | <97.7%〉 |

アムンディ・欧州ハイ・イールド債券ファンド（資源国通貨コース）

■投資信託財産の構成（2016年10月11日現在）

| 項 目 | 第 12 作 成 期 末 (第 69 期 末) | |
|-------------------------|-------------------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 投 資 信 託 受 益 証 券 | 3,705 | 0.1 |
| 投 資 証 券 | 3,043,131 | 96.7 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 99,550 | 3.2 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 3,146,386 | 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

| 項 目 | (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 |
|--------------------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|-----------------|
| | 第 64 期 末 | 第 65 期 末 | 第 66 期 末 | 第 67 期 末 | 第 68 期 末 | 第 69 期 末 |
| (A) 資 産 | 3,584,740,491円 | 3,572,954,568円 | 3,274,784,556円 | 3,400,327,767円 | 3,245,510,261円 | 3,146,386,540円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 92,160,760 | 87,036,605 | 84,203,061 | 83,215,672 | 78,952,738 | 77,157,017 |
| 投資信託受益証券(評価額) | 3,707,731 | 3,707,363 | 3,706,995 | 3,706,995 | 3,705,523 | 3,705,523 |
| 投資証券(評価額) | 3,488,872,000 | 3,482,210,600 | 3,184,767,000 | 3,308,477,100 | 3,162,852,000 | 3,043,131,000 |
| 未 収 入 金 | - | - | 2,107,500 | 4,928,000 | - | 22,393,000 |
| (B) 負 債 | 36,525,029 | 35,142,863 | 37,220,881 | 39,148,615 | 32,116,059 | 31,160,531 |
| 未 払 収 益 分 配 金 | 32,584,441 | 31,689,905 | 30,698,905 | 29,771,076 | 28,343,544 | 27,213,188 |
| 未 払 解 約 金 | 323,365 | 999 | 3,045,406 | 5,649,589 | 5,098 | 59 |
| 未 払 信 託 報 酬 | 3,469,041 | 3,162,481 | 3,046,894 | 3,153,362 | 3,048,884 | 3,076,969 |
| 未 払 利 息 | 263 | 250 | 230 | 202 | 194 | 190 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 147,919 | 289,228 | 429,446 | 574,386 | 718,339 | 870,125 |
| (C) 純 資 産 総 額 (A-B) | 3,548,215,462 | 3,537,811,705 | 3,237,563,675 | 3,361,179,152 | 3,213,394,202 | 3,115,226,009 |
| 元 本 | 8,146,110,305 | 7,922,476,385 | 7,674,726,287 | 7,442,769,007 | 7,085,886,221 | 6,803,297,032 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | △4,597,894,843 | △4,384,664,680 | △4,437,162,612 | △4,081,589,855 | △3,872,492,019 | △3,688,071,023 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 8,146,110,305口 | 7,922,476,385口 | 7,674,726,287口 | 7,442,769,007口 | 7,085,886,221口 | 6,803,297,032口 |
| 1 万 口 当 たり 基 準 価 額 (C/D) | 4,356円 | 4,466円 | 4,218円 | 4,516円 | 4,535円 | 4,579円 |

(注記事項)

| | |
|-------------|----------------|
| 作成期首元本額 | 8,261,340,618円 |
| 作成期中追加設定元本額 | 132,463,232円 |
| 作成期中一部解約元本額 | 1,590,506,818円 |

アムンディ・欧州ハイ・イールド債券ファンド（資源国通貨コース）

■損益の状況

第64期 自2016年4月9日 至2016年5月9日 第67期 自2016年7月9日 至2016年8月8日
 第65期 自2016年5月10日 至2016年6月8日 第68期 自2016年8月9日 至2016年9月8日
 第66期 自2016年6月9日 至2016年7月8日 第69期 自2016年9月9日 至2016年10月11日

| 項 目 | 第 64 期 | 第 65 期 | 第 66 期 | 第 67 期 | 第 68 期 | 第 69 期 |
|-----------------------|------------------|------------------|------------------|------------------|------------------|------------------|
| (A) 配 当 等 收 益 | 32,021,447円 | 31,112,030円 | 30,151,602円 | 29,187,254円 | 27,763,078円 | 26,622,555円 |
| 受 取 配 当 金 | 32,025,483 | 31,117,602 | 30,156,596 | 29,192,173 | 27,767,599 | 26,627,653 |
| 支 払 利 息 | △ 4,036 | △ 5,572 | △ 4,994 | △ 4,919 | △ 4,521 | △ 5,098 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 21,959,226 | 90,714,143 | △ 185,956,817 | 225,232,151 | 17,024,460 | 33,692,077 |
| 売 買 益 | 25,167,052 | 92,128,303 | 3,711,414 | 229,960,060 | 18,546,039 | 35,977,548 |
| 売 買 損 | △ 3,207,826 | △ 1,414,160 | △ 189,668,231 | △ 4,727,909 | △ 1,521,579 | △ 2,285,471 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △ 3,616,960 | △ 3,303,790 | △ 3,187,607 | △ 3,298,302 | △ 3,192,837 | △ 3,228,755 |
| (D) 当 期 損 益 金 (A+B+C) | 50,363,713 | 118,522,383 | △ 158,992,822 | 251,121,103 | 41,594,701 | 57,085,877 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | △2,205,219,152 | △2,116,616,572 | △1,960,058,450 | △2,075,663,626 | △1,760,179,059 | △1,670,727,005 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | △2,410,454,963 | △2,354,880,586 | △2,287,412,435 | △2,227,276,256 | △2,125,564,117 | △2,047,216,707 |
| (配 当 等 相 当 額) | (1,078,321,388) | (1,047,486,051) | (1,013,731,145) | (979,861,105) | (932,290,319) | (893,034,258) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (△3,488,776,351) | (△3,402,366,637) | (△3,301,143,580) | (△3,207,137,361) | (△3,057,854,436) | (△2,940,250,965) |
| (G) 計 (D+E+F) | △4,565,310,402 | △4,352,974,775 | △4,406,463,707 | △4,051,818,779 | △3,844,148,475 | △3,660,857,835 |
| (H) 收 益 分 配 金 | △ 32,584,441 | △ 31,689,905 | △ 30,698,905 | △ 29,771,076 | △ 28,343,544 | △ 27,213,188 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (G+H) | △4,597,894,843 | △4,384,664,680 | △4,437,162,612 | △4,081,589,855 | △3,872,492,019 | △3,688,071,023 |
| 追 加 信 託 差 損 益 金 | △2,412,401,884 | △2,356,298,709 | △2,291,150,027 | △2,228,243,816 | △2,128,065,434 | △2,047,216,707 |
| (配 当 等 相 当 額) | (1,076,374,467) | (1,046,067,928) | (1,009,993,553) | (978,893,545) | (929,789,002) | (893,034,258) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (△3,488,776,351) | (△3,402,366,637) | (△3,301,143,580) | (△3,207,137,361) | (△3,057,854,436) | (△2,940,250,965) |
| 分 配 準 備 積 立 金 | 163,029,018 | 157,972,197 | 152,764,471 | 147,822,531 | 140,478,250 | 132,650,299 |
| 繰 越 損 益 金 | △2,348,521,977 | △2,186,338,168 | △2,298,777,056 | △2,001,168,570 | △1,884,904,835 | △1,773,504,615 |

(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64期計算期間末における費用控除後の配当等収益(29,875,866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(1,078,321,388円)および分配準備積立金(163,790,672円)より分配対象収益は1,271,987,926円(10,000口当たり1,561円)であり、うち32,584,441円(10,000口当たり40円)を分配金額としております。

第65期計算期間末における費用控除後の配当等収益(30,268,242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(1,047,486,051円)および分配準備積立金(157,975,737円)より分配対象収益は1,235,730,030円(10,000口当たり1,559円)であり、うち31,689,905円(10,000口当たり40円)を分配金額としております。

第66期計算期間末における費用控除後の配当等収益(26,963,995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(1,013,731,145円)および分配準備積立金(152,761,789円)より分配対象収益は1,193,456,929円(10,000口当たり1,555円)であり、うち30,698,905円(10,000口当たり40円)を分配金額としております。

第67期計算期間末における費用控除後の配当等収益(28,808,939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(979,861,105円)および分配準備積立金(147,817,108円)より分配対象収益は1,156,487,152円(10,000口当たり1,553円)であり、うち29,771,076円(10,000口当たり40円)を分配金額としております。

第68期計算期間末における費用控除後の配当等収益(25,783,838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(932,290,319円)および分配準備積立金(140,536,639円)より分配対象収益は1,098,610,796円(10,000口当たり1,550円)であり、うち28,343,544円(10,000口当たり40円)を分配金額としております。

第69期計算期間末における費用控除後の配当等収益(25,197,383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(893,034,258円)および分配準備積立金(134,666,104円)より分配対象収益は1,052,897,745円(10,000口当たり1,547円)であり、うち27,213,188円(10,000口当たり40円)を分配金額としております。

■分配金のお知らせ

| 決 算 期 | 第64期 | 第65期 | 第66期 | 第67期 | 第68期 | 第69期 |
|-----------------|------|------|------|------|------|------|
| 1万口当たりの分配金（税込み） | 40円 | 40円 | 40円 | 40円 | 40円 | 40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

お手持り分配金は、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64期 | 第65期 | 第66期 | 第67期 | 第68期 | 第69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 | 40 | 40 | 40 | 40 | 40 | 40 |
| （対基準価額比率） | (0.910%) | (0.888%) | (0.939%) | (0.878%) | (0.874%) | (0.866%) |
| 当期の収益 | 36 | 38 | 35 | 38 | 36 | 37 |
| 当期の収益以外 | 3 | 1 | 4 | 1 | 3 | 2 |
| 翌期繰越分配対象額 | 1,521 | 1,519 | 1,515 | 1,513 | 1,510 | 1,507 |

（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

< 1. 補足情報 >

「ストラクチュラ-欧州ハイ・イールド・ボンド (I 11 シェアクラス、資源国通貨)」は、「ストラクチュラ-欧州ハイ・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。

「ストラクチュラ-欧州ハイ・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「ストラクチュラ-欧州ハイ・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 | 口数/額面金額 | 評価額 | 償還年月日 |
|---------|--|-------|------------|----------------|------------|
| フランス | 投資証券 | | | | |
| | AMUNDI TRESO CT C 3D -C- CAP 3 DEC | — | 7,479,042 | 16,285,161,293 | — |
| | AMUNDI 3 M I (C) | — | 124,942 | 15,305,082,087 | — |
| 日本 | 債券 | | | | |
| | SOFTBANK GROUP CORP 4.75 15-25 30/07S | 4.75 | 25,800,000 | 3,303,821,760 | 2025/7/30 |
| ルクセンブルク | ALTICE REGS 7.25 14-22 15/05S | 7.25 | 26,540,000 | 3,254,529,061 | 2022/5/15 |
| イタリア | INTESA SANPAOLO SPA FL.R 08-XX 20/06A | 8.047 | 25,000,000 | 3,108,353,002 | 2049/6/29 |
| ルクセンブルク | FIAT FIN TRADE 6.75 13-19 14/10A | 6.75 | 23,500,000 | 3,103,065,619 | 2019/10/14 |
| | 英ボンド | | | | |
| イギリス | VERGIN MEDIA SECURED 6.00 13-21 15/04S | 6 | 22,981,500 | 3,061,674,603 | 2021/4/15 |
| | ユーロ | | | | |
| イタリア | ENEL SPA FL.R 13-74 10/01A | 6.5 | 24,300,000 | 3,055,577,621 | 2074/1/10 |
| ルクセンブルク | WIND ACQUI.FIN 4.00 14-20 15/07S | 4 | 25,300,000 | 2,977,047,347 | 2020/7/15 |
| イタリア | INTESA SAN PAOLO 6.625 13-23 13/09A | 6.625 | 21,788,000 | 2,971,471,497 | 2023/9/13 |
| ルクセンブルク | WIND ACQUI.FIN REGS 7.00 14-21 23/04S | 7 | 22,850,000 | 2,770,928,997 | 2021/4/23 |
| イタリア | UNICREDIT SPA REGS 6.95 12-22 31/10A | 6.95 | 20,750,000 | 2,711,862,200 | 2022/10/31 |
| ルクセンブルク | UNICREDIT FINANCE FL.R 09-XX 10/12A | 8.125 | 21,000,000 | 2,705,028,066 | 2049/12/10 |
| オランダ | UPC HOLDING REGS 6.375 12-22 15/09S | 6.375 | 20,800,000 | 2,553,075,902 | 2022/9/15 |
| フランス | NOVALIS SAS REGS 3.00 15-22 30/04S | 3 | 21,500,000 | 2,517,951,403 | 2022/4/30 |
| イギリス | INTER GAME TECH REGS 4.75 15-23 15/02S | 4.75 | 19,700,000 | 2,463,223,312 | 2023/2/15 |
| フランス | SOCIETE GENE SA SUB FL.R 09-XX 04/09A | 9.375 | 17,000,000 | 2,386,509,274 | 2049/9/4 |
| オランダ | LGE HOLDCO VI BV 7.125 14-24 15/05S | 7.125 | 17,400,000 | 2,253,514,036 | 2024/5/15 |
| ドイツ | UNITYMEDIA HESSEN REGS 5.50 12-22 15/09S | 5.5 | 17,938,260 | 2,183,862,901 | 2022/9/15 |
| ルクセンブルク | FIAT FINANCE TRADE 4.75 14-22 15/07A | 4.75 | 17,250,000 | 2,183,096,381 | 2022/7/15 |
| フランス | CERBA EUROPEAN LAB 7.00 13-20 01/02S | 7 | 17,410,000 | 2,093,939,616 | 2020/2/1 |
| | ACCOR FL.R 14-XX 30/06A | 4.125 | 17,800,000 | 2,080,186,537 | 2049/6/30 |
| イタリア | INTESA SAN PAOLO 8.375 09-XX 14/10A | 8.375 | 15,600,000 | 2,043,700,989 | 2049/10/14 |
| ルクセンブルク | MATTERHORN REGS 3.875 15-22 01/05S | 3.875 | 17,500,000 | 2,025,228,022 | 2022/5/1 |
| フランス | HOMEVI REGS 6.875 14-21 15/08S | 6.875 | 16,470,000 | 2,017,083,533 | 2021/8/15 |
| オランダ | SCHAEFFLER FIN 3.25 14-19 15/05S | 3.25 | 17,000,000 | 1,996,871,097 | 2019/5/15 |
| フランス | NUMERICABLE GRP REGS 5.375 14-22 15/05S | 5.375 | 16,500,000 | 1,992,347,556 | 2022/5/15 |
| オランダ | OI EUROPEAN GROUP BV 6.75 10-20 15/09S | 6.75 | 13,800,000 | 1,922,628,626 | 2020/9/15 |
| ルクセンブルク | PICARD BONDCO REGS 7.75 15-20 01/02S | 7.75 | 15,700,000 | 1,922,473,084 | 2020/2/1 |
| スウェーデン | VOLVO TREAS REGS SUB FL.R 14-75 10/06A | 4.2 | 15,300,000 | 1,844,691,399 | 2075/6/10 |

ストラクチュラ-欧州ハイ・イールド・ボンド

■(1)直物為替先渡取引 (I11シェアクラス、資源国通貨)

(2016年10月10日現在)

| | | | | | 評価損益 |
|-------|--------------|---------|---------------|-----------|---------------|
| | | | | | 日本円 |
| 買建 | 契約額 | 売建 | 契約額 | 満期日 | |
| ユーロ | 300,000.00 | ブラジルリアル | 1,151,197.20 | 2016/12/2 | △1,831,778 |
| ユーロ | 300,000.00 | ブラジルリアル | 1,108,025.40 | 2016/12/2 | △441,093 |
| 合計① | | | | | △2,272,871 |
| | | | | | 評価損益 |
| | | | | | 日本円 |
| 売建 | 契約額 | 買建 | 契約額 | 満期日 | |
| ユーロ | 9,000,000.00 | ブラジルリアル | 33,199,065.00 | 2016/12/2 | 11,889,629 |
| ユーロ | 300,000.00 | ブラジルリアル | 1,105,134.90 | 2016/12/2 | 347,982 |
| 小計② | | | | | 12,237,611 |
| 合計①+② | | | | | 9,964,740 (1) |

■(2)外国為替先物契約 (I11シェアクラス、資源国通貨)

| | | | | | 評価損益 |
|------------|--------------|-----------|----------------|-----------|----------------|
| | | | | | 日本円 |
| 買建 | 契約額 | 売建 | 契約額 | 満期日 | |
| ユーロ | 265,490.54 | オーストラリアドル | 400,000.00 | 2016/12/2 | △788,248 |
| ユーロ | 339,959.14 | オーストラリアドル | 500,000.00 | 2016/12/2 | △46,702 |
| ユーロ | 190,792.83 | 南アフリカランド | 3,100,000.00 | 2016/12/2 | △1,010,446 |
| ユーロ | 308,953.43 | 南アフリカランド | 4,800,000.00 | 2016/12/2 | 17,602 |
| 小計① | | | | | △1,827,794 |
| | | | | | 評価損益 |
| | | | | | 日本円 |
| 売建 | 契約額 | 買建 | 契約額 | 満期日 | |
| ユーロ | 9,017,371.00 | オーストラリアドル | 13,300,000.00 | 2016/12/2 | 4,190,622 |
| ユーロ | 270,564.78 | オーストラリアドル | 400,000.00 | 2016/12/2 | 199,338 |
| ユーロ | 9,178,647.16 | 南アフリカランド | 147,200,000.00 | 2016/12/2 | 33,673,577 |
| 小計② | | | | | 38,063,537 |
| 合計①+② | | | | | 36,235,743 (2) |
| 合計(1)+(2)= | | | | | 46,200,483 |

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 | | | 2 年 未 満 |
| | | | | | 5 年 以 上 | 2 年 以 上 | 2 年 未 満 | |
| | 千円 | 千円 | % | % | % | % | % | % |
| 地 方 債 証 券 | 500,000 | 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) ー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 | |
| 地 方 債 証 券 | 第303回大阪府公募公債（10年） | | 1.93 | 500,000 | 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-欧州ハイ・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-欧州ハイ・イールド・ボンド (I11シェアクラス、資源国通貨)」は、「ストラクチュラ-欧州ハイ・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す。

「ストラクチュラ-欧州ハイ・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-欧州ハイ・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 | 欧州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。 各シェアクラスについては、外国為替予約取引、為替先渡取引、直物為替先渡取引等を活用します。 | |
| 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 | アムンディ アセットマネジメント (*) |
| | 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0.67% |
| 申込手数料 | ありません。 | |

(*) 2015年11月12日付で、「アムンディ」から「アムンディ アセットマネジメント」へ社名変更しました。

■費用の明細

| 項目 | 当期 |
|------------|---------------|
| | 円 |
| (a) 運用報酬 | 4,097,964,839 |
| (b) 管理費用等 | 894,069,001 |
| (c) その他の費用 | 1,388,752,624 |
| 合計 | 6,380,786,464 |

■純資産計算書

2015年12月31日現在

| 項目 | 当期末 |
|------------|-----------------|
| | 円 |
| 資産合計 | 561,377,338,327 |
| 有価証券 | 507,269,370,984 |
| 預金 | 26,825,143,301 |
| 未収利息 | 8,901,639,179 |
| 有価証券売却未収入金 | 3,199,489,166 |
| 未収追加設定金 | 301,079,000 |
| 為替予約取引評価勘定 | 8,137,909,744 |
| スワップ取引評価勘定 | 4,227,280,353 |
| 為替未収入金 | 2,515,426,600 |
| 負債合計 | 20,452,975,422 |
| 借入金 | 595,000,000 |
| 未払配当金 | 11,136,985,000 |
| 有価証券買付未払金 | 2,515,426,600 |
| 未払解約金 | 2,816,505,600 |
| 未払運用報酬 | 816,387,930 |
| 未払管理費用 | 56,893,619 |
| 未払税 | 13,801,533 |
| 為替未払金 | 2,501,974,418 |
| その他の負債 | 722 |
| 純資産 | 540,924,362,905 |

■有価証券等明細

(1) 公社債

(2015年12月31日現在)

| 銘柄 | | 通貨 | 額面金額 | 円換算評価額 | 銘柄 | | 通貨 | 額面金額 | 円換算評価額 |
|--------|--|-----|---------------|---------------|--|--|---------------|---------------|---------------|
| アイルランド | ALLIED IRISH BK SUB FL R 15-25 26/11A | EUR | 3,000,000.00 | 394,997,012 | イタリア | NEW LOOK SENIOR IS 8.00 15-23 01/7S | GBP | 4,300,000.00 | 745,458,216 |
| | ARDAGH REGS 4.25 14-22 15/01S | EUR | 16,300,000.00 | 2,153,903,727 | | OLD MUTUAL PLC 7.875 15-25 03/11S | GBP | 635,000.00 | 113,262,210 |
| | ARDEGH PKG REGS 9.25 10-20 15/10S | EUR | 11,550,000.00 | 1,582,876,913 | | OLD MUTUAL REG-S FL R 05-XX 24/03A | GBP | 5,100,000.00 | 873,785,840 |
| | BANK IRELAND FL R 14-24 11/06A | EUR | 920,000.00 | 124,688,594 | | PRIMO GROUP REGS 7.00 11-18 15/02S | GBP | 1,959,049.13 | 356,522,830 |
| | EIRCOM FIN REGS EMTN 9.25 13-20 15/05S | EUR | 4,500,000.00 | 631,612,207 | | R&R ICE CREAM REGS 5.50 14-20 15/05S | GBP | 13,000,000.00 | 2,385,802,160 |
| | SMURFIT KAPPA ACQ 3.25 14-21 01/06S | EUR | 10,000,000.00 | 1,372,560,092 | | RBS GRP PLC FL R 15-XX 30/09Q | USD | 5,900,000.00 | 737,179,016 |
| | SMURFIT KAPPA ACQ 4.125 13-20 30/01S | EUR | 6,300,000.00 | 895,395,820 | | RBS SUB FL R 14-24 25/03A | EUR | 33,000,000.00 | 4,439,838,237 |
| | BALL 3.50 15-20 15/12S | EUR | 6,650,000.00 | 893,773,536 | | ROYAL BK OF SCOT.SUB FL R 04-21 12/09A | EUR | 17,900,000.00 | 2,373,469,958 |
| | BALL CORP 4.375 15-23 15/12S | EUR | 6,850,000.00 | 922,659,043 | | ROYAL BK OF SCOTL. FL R 07-XX 30/09A | EUR | 9,950,000.00 | 1,372,068,423 |
| | CELANESE CORP 3.25 14-19 15/10S | EUR | 8,000,000.00 | 1,080,411,981 | | SANTANDER UK GROUP FL R 15-49 24/09Q | GBP | 1,040,000.00 | 187,665,034 |
| アメリカ | CEMEX FIN REGS 5.25 14-21 01/04S | EUR | 13,880,000.00 | 1,775,554,451 | TESCO 5.00 06-23 24/03A | GBP | 4,000,000.00 | 694,229,608 | |
| | FLASH DUTCH 2 REGS 6.75 15-23 01/02S | EUR | 3,750,000.00 | 510,373,210 | TESCO CORP 1.375 14-19 01/07A | EUR | 5,100,000.00 | 641,884,552 | |
| | PRESENTUS US FIN REGS 4.25 14-21 01/02S | USD | 4,550,000.00 | 553,841,901 | TESCO CORP 2.50 14-24 01/07A | EUR | 5,400,000.00 | 629,287,081 | |
| | HUNTSMAN INT 5.125 14-21 15/04A | EUR | 6,700,000.00 | 812,073,640 | TESCO EMTN 2.125 13-20 12/11A | EUR | 9,880,000.00 | 1,247,690,016 | |
| | HUNTSMAN INTL LLC 4.25 15-25 01/04S | EUR | 4,850,000.00 | 514,946,886 | TESCO EMTN 6.125 09-22 24/02A | GBP | 11,695,000.00 | 2,173,301,083 | |
| | IMS HEALTH REGS 4.125 15-23 01/04S | EUR | 10,000,000.00 | 1,279,440,054 | THOMAS COOK FIN 6.125 15-21 15/06S | EUR | 1,000,000.00 | 136,865,286 | |
| | JARDEN REGS 3.75 14-21 01/10S | EUR | 14,500,000.00 | 1,997,279,770 | THOMAS COOK GRP REGS 7.75 13-20 15/06S | EUR | 22,500,000.00 | 3,075,058,620 | |
| | MPT OPER PARTNERSHIP 4.00 15-22 19/08A | EUR | 4,000,000.00 | 534,017,153 | TWINKLE PIZZA REGS 6.875 14-21 01/08S | GBP | 6,570,000.00 | 1,198,094,717 | |
| | MPT OPER PARTNERSHIP 5.75 13-20 01/10S | EUR | 4,000,000.00 | 558,202,751 | VERGIN MEDIA SECURED 6.00 13-21 15/04S | GBP | 28,291,500.00 | 5,201,527,726 | |
| | PSPC ESCROW REGS 6.00 15-23 01/02S | EUR | 5,350,000.00 | 600,801,901 | VIRGIN MEDIA FIN 4.50 15-25 15/03S | EUR | 4,720,000.00 | 589,043,334 | |
| イギリス | VWR FUNDING INC 4.625 15-22 15/04S | EUR | 16,000,000.00 | 2,050,428,496 | VIRGIN MEDIA FIN 5.125 15-25 15/01S | GBP | 2,900,000.00 | 491,773,571 | |
| | ZF NA CAPITAL 2.75 15-23 27/04A | EUR | 11,100,000.00 | 1,389,094,061 | VIRGIN MEDIA REGS 5.50 14-25 15/01S | GBP | 1,935,000.00 | 337,717,021 | |
| | ZF NA CAPITAL 2.25 15-19 26/04A | EUR | 12,200,000.00 | 1,596,628,126 | VIRGIN MEDIA SECURED 6.25 14-29 28/03S | GBP | 9,390,000.00 | 1,683,943,674 | |
| | ANGLIAN WATER SVS FIN 5.00 15-23 30/04S | GBP | 2,100,000.00 | 376,958,251 | VOUGEOT BIDCO REGS 7.875 13-20 15/07S | GBP | 5,200,000.00 | 972,437,029 | |
| | ANGLIAN WATER SVS FIN 7.00 11-18 31/01S | GBP | 3,808,000.00 | 736,455,357 | WILLIAM HILL REGS 4.25 13-20 05/06S | GBP | 12,000,000.00 | 2,172,939,877 | |
| | ARROW GLOBAL FINANCE 7.875 13-20 01/03S | GBP | 4,700,000.00 | 872,633,767 | ASSICURAZIONI GEN. FL R 07-XX 08/02A | GBP | 2,600,000.00 | 466,645,681 | |
| | BAKKAHORVAT FIN. REG S 8.25 11-18 15/02S | GBP | 6,591,626.92 | 1,202,178,808 | BANCO POPOLARE 2.375 14-18 22/01A | EUR | 2,000,000.00 | 263,033,400 | |
| | BARCLAYS BK SUB FL R 14-XX 15/09Q | EUR | 19,010,000.00 | 2,521,297,496 | BANCO POPOLARE 3.50 14-19 14/03A | EUR | 41,050,000.00 | 5,512,858,504 | |
| | BOPARAN FIN REG S 5.50 14-21 15/07S | GBP | 3,460,000.00 | 545,660,386 | BANCO POPOLARE REGS 2.75 15-20 27/07A | EUR | 7,540,000.00 | 985,714,259 | |
| | BOPARAN FINANCE PLC 4.375 14-21 15/07S | EUR | 10,770,000.00 | 1,249,504,876 | BUZZI UNICEM 6.25 12-18 28/09A | EUR | 11,080,000.00 | 1,613,606,656 | |
| イタリア | BOPARAN FINANCE REGS 5.25 14-19 15/07S | GBP | 350,000.00 | 58,223,224 | CERVED TECHNO SPA 6.375 13-20 15/01S | EUR | 2,000,000.00 | 269,886,072 | |
| | EPHIOS BONDCO 8.25 15-23 01/07S | EUR | 9,500,000.00 | 1,260,407,683 | CERVED TECHNO SUB 8.00 13-16 15/01S | EUR | 6,000,000.00 | 831,219,831 | |
| | EPHIOS BONDCO 6.25 15-22 01/07S | EUR | 9,200,000.00 | 1,254,544,100 | ENEL FL. R 14-75 15/01A | EUR | 4,450,000.00 | 609,742,522 | |
| | HSBC HLDGS FL. R 14-XX 16/09S | EUR | 16,100,000.00 | 2,079,107,011 | ENEL SPA FL. R 13-74 10/01A | EUR | 32,500,000.00 | 4,598,974,710 | |
| | HSBC HLDGS FL. R 15-XX 29/09S | EUR | 3,200,000.00 | 421,660,496 | ENEL SUB FL. R 14-76 15/09A | GBP | 11,000,000.00 | 2,028,487,483 | |
| | INEOS FINANCE REGS 4.00 15-23 01/05S | EUR | 13,020,000.00 | 1,630,747,931 | FINMEC FINANCE 4.50 13-21 19/01A | EUR | 21,000,000.00 | 2,994,806,292 | |
| | INTER GAME TECH REGS 4.75 15-23 15/02S | EUR | 17,500,000.00 | 2,150,062,102 | FINMECCANICA FINANCE 5.25 09-22 21/01A | EUR | 8,000,000.00 | 1,187,033,509 | |
| | INTER GANE TECH REGS 4.125 15-20 15/02S | EUR | 10,200,000.00 | 1,340,044,133 | INTESA SAN PAOLO 5.15 10-20 16/07A | EUR | 1,650,000.00 | 239,702,622 | |
| | INTL PERS FIN 5.75 14-21 07/04A | EUR | 5,807,000.00 | 700,415,197 | INTESA SAN PAOLO 6.625 13-23 13/09A | EUR | 26,088,000.00 | 4,117,938,735 | |
| | INRN MOUNTAIN REGS 6.125 14-22 15/09S | GBP | 10,000,000.00 | 1,826,385,331 | INTESA SAN PAOLO 8.375 09-XX 14/10A | EUR | 15,600,000.00 | 2,356,240,660 | |
| イギリス | JAGUAR LAND ROV REGS 5.625 13-23 01/02S | USD | 2,350,000.00 | 285,195,065 | INTESA SANPAOLO SP FL R 15-49 17/03S | USD | 5,400,000.00 | 659,914,986 | |
| | JAGUAR LAND ROVER 3.875 15-23 01/03S | GBP | 9,000,000.00 | 1,500,934,397 | INTESA SANPAOLO SPA FL R 08-XX 20/06A | EUR | 27,300,000.00 | 3,964,740,220 | |
| | JAGUAR LAND ROVER 5.00 14-22 15/02S | GBP | 6,600,000.00 | 1,208,363,115 | INTESA SANPAOLO SUB FL R 10-XX 01/06A | EUR | 4,000,000.00 | 539,531,700 | |
| | KERLING PLC REG-S 10.625 10-17 28/01A | EUR | 4,800,000.00 | 632,101,852 | RHINO BONDCO REGS 7.25 13-20 15/11S | EUR | 7,030,000.00 | 980,958,655 | |
| | LLOYDS BANKING GR FL R 14-XX 27/06Q | GBP | 11,218,000.00 | 2,026,165,454 | SALINI 6.125 13-18 01/08A | EUR | 2,000,000.00 | 278,356,519 | |
| | LLOYDS BANKING GR FL R 14-XX 27/06Q | GBP | 9,069,000.00 | 1,251,482,441 | SNAI REGS 7.625 13-18 15/06S | EUR | 14,000,000.00 | 1,755,376,753 | |
| | LYNX II CORP REGS 7.00 13-23 15/04S | GBP | 13,000,000.00 | 2,425,376,531 | TELECOM ITALIA EMTN 3.75 15-23 16/01A | EUR | 7,900,000.00 | 1,050,595,796 | |
| | MERLIN ENTERTAINMENTS 2.75 15-22 15/03S | EUR | 5,900,000.00 | 753,790,245 | TELECOM ITALIA SPA 4.875 13-20 25/09A | EUR | 1,500,000.00 | 221,661,235 | |
| | MOY PARK BONDCO 6.25 14-21 29/05S | GBP | 6,090,000.00 | 1,105,628,289 | TELECOM ITALIA SPA 5.875 07-23 19/05A | GBP | 9,600,000.00 | 1,834,381,407 | |
| | NEW LOOK REGS REGS 6.50 15-22 01/07S | GBP | 13,300,000.00 | 2,350,121,577 | UNICREDIT FL. R 14-XX 10/09S | EUR | 13,700,000.00 | 1,693,664,538 | |

ストラクチャラ-欧州ハイ・イールド・ボンド

| 銘柄 | | 通貨 | 額面金額 | 円換算評価額 | 銘柄 | 通貨 | 額面金額 | 円換算評価額 | |
|--------------|--|-----|---------------|---------------|---|---|---------------|---------------|---------------|
| イタリア | UNICREDIT SPA 6.125 11-21 19/04A | EUR | 7,000,000.00 | 1,054,296,292 | カナダ | BOMBARDIER REGS EMTN 6.125 10-21 15/05S | EUR | 9,000,000.00 | 1,029,371,066 |
| | UNICREDIT SPA EMTN FL R 13-25 28/10A | EUR | 19,000,000.00 | 2,695,235,757 | | ENTERTAINM ONE 6.875 15-22 15/12S | GBP | 3,600,000.00 | 637,737,950 |
| オーストリア | UNICREDIT SPA REGS 6.95 12-22 31/10A | EUR | 20,000,000.00 | 3,065,512,705 | クロアチア | VRX ESCROW 4.50 15-23 15/05S | EUR | 8,600,000.00 | 984,745,058 |
| | UNIPOLSAI SPA EMTN FL R 14-XX 18/06A | EUR | 11,000,000.00 | 1,395,798,286 | | AGROKOR DD REGS 9.125 12-20 01/02S | EUR | 16,860,000.00 | 2,360,888,325 |
| オランダ | SAPPI PAPIER HOLDNG G 3.375 15-22 01/04S | EUR | 10,500,000.00 | 1,319,894,216 | AGROKOR DD REGS 9.875 12-19 01/05S | EUR | 3,640,000.00 | 510,637,726 | |
| | WIENERBERGER 4.00 13-20 17/04A | EUR | 6,085,000.00 | 852,521,536 | ASTON MARTIN CAP REGS 9.00 15-11 18/07S | GBP | 4,047,000.00 | 731,166,504 | |
| オランダ | WIENERBERGER REGS FL R 14-XX 09/02A | EUR | 500,000.00 | 66,716,862 | AVIS BUDGET CAR 6.00 13-21 01/03S | EUR | 10,500,000.00 | 1,424,366,118 | |
| | ABN AMRO FL R 15-XX 22/03S | EUR | 10,200,000.00 | 1,336,022,092 | HBO5 PERP. SUB FL R 01-XX 29/11S | GBP | 5,000,000.00 | 945,052,862 | |
| オランダ | ABN AMRO BANK NV FL R 06-XX 10/03A | EUR | 10,740,000.00 | 1,411,408,686 | MERCURY BONDCO 8.25 15-21 30/05S | EUR | 15,000,000.00 | 1,956,755,696 | |
| | CABLE COMM SYS REGS 7.50 13-20 01/11S | EUR | 11,500,000.00 | 1,592,359,842 | CREDIT SUISSE FL R 13-25 18/09A | EUR | 7,170,000.00 | 1,022,606,129 | |
| オランダ | DARLING GLOBAL FINAN 4.75 15-22 30/05S | EUR | 4,000,000.00 | 507,939,361 | UBS GROUP SUB FL R 15-XX 19/02A | EUR | 9,400,000.00 | 1,290,673,263 | |
| | DT ANNINGTON FI SUB FL R 14-XX 17/12A | EUR | 200,000.00 | 25,482,692 | EILEME 2 AB REGS 11.75 12-20 31/01S | EUR | 12,078,000.00 | 1,684,946,099 | |
| オランダ | DT ANNINGTON FIN SUB FL R 14-74 08/04A | EUR | 4,000,000.00 | 531,168,407 | NORDEA BANK FL R 15-XX 12/03A | USD | 10,800,000.00 | 1,233,044,355 | |
| | EDP FINANCE 5.25 14-21 14/01S | USD | 8,000,000.00 | 999,545,521 | SHB SUB FL R 15-XX 01/03A | USD | 18,400,000.00 | 2,146,228,177 | |
| オランダ | EDP FINANCE REGS 8.625 08-24 04/01A | GBP | 2,000,000.00 | 458,425,147 | SWEDBANK SUB FL R 15-XX 17/03S | USD | 5,200,000.00 | 625,946,809 | |
| | FRESENIUS REGS 3.00 14-21 01/02S | EUR | 5,500,000.00 | 773,659,468 | VVN FIN. CORP III REGS 7.375 13-20 15/12S | EUR | 14,360,000.00 | 2,028,229,965 | |
| オランダ | FRESENIUS REGS 4.00 14-24 01/02S | EUR | 5,500,000.00 | 816,308,341 | VERISURE HLDG REGS 6.00 15-22 01/11S | EUR | 13,550,000.00 | 1,845,759,839 | |
| | GAS NAT PENOSA REGS FL R 14-XX 30/11A | EUR | 15,700,000.00 | 1,963,790,401 | VOLVO TREAS REGS SUB FL R 14-75 10/06A | EUR | 21,100,000.00 | 2,709,461,979 | |
| オランダ | GENERALI FIN SUB FL R 14-XX 21/11A | EUR | 4,000,000.00 | 507,244,163 | VOLVO TREASURY SUB FL R 14-78 10/03A | EUR | 1,000,000.00 | 126,115,842 | |
| | GOODYEAR DUNLOP TI 3.75 15-23 17/12S | EUR | 3,460,000.00 | 460,080,104 | ALMIRALL EMTN REGS 4.625 14-21 01/04S | EUR | 2,623,000.00 | 359,148,463 | |
| オランダ | GRUPO ANTOLIN DUTCH 4.75 14-21 01/04S | EUR | 14,000,000.00 | 1,895,569,062 | BANCO SANTANDER SA FL R 14-XX 12/03A | EUR | 17,000,000.00 | 2,111,468,773 | |
| | GRUPO ANTOLIN DUTCH 5.125 15-22 30/06S | EUR | 4,550,000.00 | 619,657,141 | BCO BILBAO VIZCAYA FL R 15-XX 18/05Q | EUR | 16,400,000.00 | 2,101,646,347 | |
| オランダ | ING GROEP SUB 6.00 15-XX 30/04S | USD | 8,650,000.00 | 1,042,559,942 | CAIXABANK EMTN FL R 13-23 14/11A | EUR | 2,100,000.00 | 287,310,078 | |
| | KPN FL R 13-XX 14/09A | EUR | 20,000,000.00 | 2,783,042,491 | CAMPOFRIO REGS 3.375 15-22 15/03S | EUR | 8,000,000.00 | 1,053,199,917 | |
| オランダ | LGE HOLDCO VI BV 7.125 14-24 15/05S | EUR | 20,900,000.00 | 2,969,784,626 | CELLNEX TELECOM 3.125 15-22 27/07A | EUR | 5,600,000.00 | 703,994,807 | |
| | O1 EUROPEAN GROUP BV 4.875 13-21 31/03S | EUR | 550,000.00 | 78,449,778 | ENCE ENERGIA REGS 5.375 15-22 01/11S | EUR | 2,600,000.00 | 351,555,194 | |
| オランダ | O1 EUROPEAN GROUP BV 6.75 10-20 15/09S | EUR | 17,000,000.00 | 2,586,336,537 | NH HOTELES REGS 6.875 13-19 15/11S | EUR | 3,500,000.00 | 504,668,530 | |
| | PETROBRAS GLOBAL FIN 2.75 14-18 15/01A | EUR | 4,200,000.00 | 449,874,064 | CO ENERGY REGS 7.00 14-21 01/02S | EUR | 5,420,000.00 | 719,981,084 | |
| オランダ | PETROBRAS INTL FIN 3.25 12-19 01/04A | EUR | 14,667,000.00 | 1,417,636,483 | DANSKE BANK EMTN FL R 15-XX 06/04S | EUR | 14,500,000.00 | 1,923,458,030 | |
| | PETROBRAS INTL FIN 4.875 11-18 07/03A | EUR | 6,800,000.00 | 744,984,351 | TDC FL R 15-15 26/02A | EUR | 3,680,000.00 | 452,968,901 | |
| オランダ | PHOENIX PIB DUTCH 3.625 14-21 30/07A | EUR | 5,200,000.00 | 719,289,702 | COMMERZBANK AG 7.75 11-21 16/03A | EUR | 27,500,000.00 | 4,389,513,429 | |
| | PHOENIX PIB DUTCH EMTN3.125 13-20 27/05A | EUR | 4,300,000.00 | 588,992,736 | COMMERZBANK AG 8.125 13-23 19/09S | USD | 7,800,000.00 | 1,078,558,158 | |
| オランダ | RABOBANK NEDERLAND FL R 15-XX 31/12S | EUR | 18,000,000.00 | 2,387,364,654 | DEUTSCHE RASTSTATTEN 6.75 13-20 30/12S | EUR | 5,900,000.00 | 822,925,012 | |
| | REPSOL INTL FINANCE FL R 15-49 29/12A | EUR | 8,000,000.00 | 904,207,855 | RWE AG FL R 12-XX 20/03A | GBP | 2,400,000.00 | 419,622,725 | |
| オランダ | REPSOL INTL FINANCE FL R 15-75 25/03A | EUR | 14,300,000.00 | 1,472,308,955 | RWE SUB REGS FL R 15-XX 21/04A | EUR | 8,300,000.00 | 933,039,654 | |
| | SCAHEFFLER FIN REGS 3.25 15-25 15/05S | EUR | 5,000,000.00 | 637,152,235 | TECHEM EMTN REGS 6.125 12-19 01/10S | EUR | 7,076,000.00 | 971,621,128 | |
| オランダ | SCHAEFFLER FIN 3.25 14-19 15/05S | EUR | 25,500,000.00 | 3,382,699,733 | TECHEM ENER REGS 7.875 12-20 01/10S | EUR | 11,000,000.00 | 1,547,563,302 | |
| | SCHAEFFLER FIN 6.875 13-18 15/08S | EUR | 11,000,000.00 | 1,490,036,915 | THYSSENKRUPP 3.125 14-19 25/10A | EUR | 16,500,000.00 | 2,227,077,575 | |
| オランダ | SCHAEFFLER FIN REGS 4.25 13-18 15/05S | EUR | 7,000,000.00 | 934,648,935 | THYSSENKRUPP AG 1.75 15-20 25/11A | EUR | 12,500,000.00 | 1,587,049,151 | |
| | SCHAEFFLER FINANCE 2.50 15-20 15/04S | EUR | 2,000,000.00 | 263,914,159 | THYSSENKRUPP AG 4.00 13-18 27/08A | EUR | 18,000,000.00 | 2,474,677,432 | |
| オランダ | SCHAEFFLER FINANCE 3.50 14-22 15/05S | EUR | 7,400,000.00 | 989,759,375 | TRIONISTA HOLDCO REGS 5.00 13-20 30/04S | EUR | 9,200,000.00 | 1,242,822,422 | |
| | SM MTH AUTO GRP REGS 4.125 14-21 15/07S | EUR | 12,800,000.00 | 1,633,016,552 | TRIONISTA HOLDCO REGS 6.875 13-21 30/04S | EUR | 15,000,000.00 | 2,074,109,682 | |
| オランダ | SNS BANK 3.75 15-25 05/11A | EUR | 5,200,000.00 | 676,955,759 | UNITY MEDIA REGS 5.125 13-23 21/01S | EUR | 117,900.00 | 16,182,637 | |
| | TELE EUR REGS SUB FL R 14-XX 31/03A | EUR | 8,000,000.00 | 1,055,269,832 | UNITYMEDIA HESSEN REGS 5.50 12-22 15/09S | EUR | 19,211,400.00 | 2,666,353,102 | |
| オランダ | TELEFONICA EUROPA SUB 7.625 13-XX 18/09A | EUR | 23,700,000.00 | 3,422,467,973 | UNITYMEDIA KABEL SUB 3.75 15-27 15/01S | EUR | 18,600,000.00 | 2,109,963,902 | |
| | TELEFONICA EUROPA SUB FL R 13-XX 26/11A | GBP | 11,000,000.00 | 2,004,089,699 | UNITYMEDIA NRW REGS 5.75 12-23 15/01S | EUR | 12,906,000.00 | 1,795,796,129 | |
| オランダ | TELEFONICA EUROPE BV FL R 13-XX 18/09A | EUR | 15,500,000.00 | 2,136,400,533 | UNITYMEDIA NRW/HESSEN 6.25 13-29 15/01S | EUR | 14,840,000.00 | 2,134,267,735 | |
| | UPC HOLDING REGS 6.375 12-22 15/09S | EUR | 24,000,000.00 | 3,337,455,625 | WEPA HYGIENPROD REGS 6.50 13-20 15/05S | EUR | 4,300,000.00 | 598,163,087 | |
| オランダ | UPC HOLDING REGS 6.75 13-23 15/03S | EUR | 7,000,000.00 | 989,651,959 | SOFTBANK GROUP 4.00 15-27 30/01S | EUR | 2,100,000.00 | 279,143,323 | |
| | ZIGGO BOND CO 4.625 15-25 15/01S | EUR | 2,450,000.00 | 298,143,287 | SOFTBANK GROUP 5.25 15-27 30/07S | EUR | 4,100,000.00 | 512,468,294 | |
| オランダ | ZIGGO FIN REGS 3.75 15-25 15/01S | EUR | 16,700,000.00 | 2,024,123,849 | SOFTBANK GROUP CORP 4.75 15-25 30/07S | EUR | 29,100,000.00 | 3,707,047,175 | |
| | CS GUERNESEY FL R 11-41 24/02S | USD | 7,000,000.00 | 869,086,805 | SOFTBANK REGS 4.625 13-20 15/04S | EUR | 9,673,000.00 | 1,338,194,135 | |
| ガンゾー、チャンネル諸島 | | | | | ノルウェー | LINDOR REGS 7.00 14-21 15/08S | EUR | 17,000,000.00 | 2,325,821,274 |

ストラクチャラ-欧州ハイ・イールド・ボンド

| 銘柄 | | 通貨 | 額面金額 | 円換算評価額 | 銘柄 | | 通貨 | 額面金額 | 円換算評価額 |
|---|-----------------------------------|---------------|---------------|--|------------------------------------|--|---------------|---------------|---------------|
| ノルウェー フィンランド フランス | SILK BIDCO REGS 7.50 15-22 01/02S | EUR | 5,000,000.00 | 677,080,424 | ベルギー | SMCP SAS 8.875 13-20 15/06S | EUR | 10,000,000.00 | 1,402,354,323 |
| | STORA ENSO OYJ 5.50 12-19 07/03A | EUR | 9,000,000.00 | 1,318,241,813 | | SOCIETE GEN. REG-S SUB FL R 05-XX 16/06A | GBP | 3,000,000.00 | 587,536,068 |
| | ACCOR FL. R 14-XX 30/06A | EUR | 20,500,000.00 | 2,642,970,404 | | SOCIETE GENE SA SUB FL R 09-XX 04/09A | EUR | 21,000,000.00 | 3,367,304,739 |
| AREVA 3.25 13-20 04/09A | EUR | 4,800,000.00 | 609,075,615 | SOCIETE GENERALE REGS FL R 14-XX 07/04S | EUR | 18,300,000.00 | 2,449,465,631 | | |
| AREVA EMTN 3.50 10-21 22/03A | EUR | 7,950,000.00 | 1,018,183,333 | SOGECAP SA FL. R 14-49 29/12A | EUR | 13,500,000.00 | 1,673,967,285 | | |
| AREVA EMTN 4.375 09-19 06/11A | EUR | 4,250,000.00 | 579,505,952 | SOLVAY FIN SUB FL R 13-XX 12/05A | EUR | 2,000,000.00 | 258,836,072 | | |
| AREVA SA 3.125 14-23 20/03A | EUR | 4,000,000.00 | 478,594,658 | SOLVAY FINANCE FL R 13-XX 12/11A | EUR | 1,884,000.00 | 242,275,016 | | |
| ARKEMA SA FL. R 14-XX 29/10A | EUR | 5,000,000.00 | 647,371,133 | SOLVAY FINANCE SUB FL R 15-XX 02/06A | EUR | 4,800,000.00 | 626,105,370 | | |
| BFCM 3.00 15-25 11/09A | EUR | 4,000,000.00 | 538,632,645 | SOLVAY FINANCE SUB FL R 15-XX 03/06A | EUR | 3,000,000.00 | 390,445,552 | | |
| BFCM(BQ FED. CM) OIS 0.12 190416 | EUR | 10,000,000.00 | 1,306,794,500 | SPCM REGS 2.875 15-23 15/06S | EUR | 19,000,000.00 | 2,388,231,039 | | |
| BFCM(BQ FED. CM) OIS 0.12 250416 | EUR | 15,000,000.00 | 1,960,146,750 | THOM EUOPE REGS 7.375 14-19 15/07S | EUR | 10,700,000.00 | 1,458,725,791 | | |
| BFCM(BQ FED. CM) OIS 0.16 160516 | EUR | 15,000,000.00 | 1,960,146,750 | VEOLIA ENVIRONNEMENT FL R 13-XX 16/04A | EUR | 22,400,000.00 | 3,040,872,354 | | |
| BNP PAR FL. R 15-XX 19/08S | USD | 2,300,000.00 | 284,680,023 | BELGIER | KBC GROEP SUB FL R 14-XX 19/03Q | EUR | 15,400,000.00 | 2,014,671,237 | |
| BNP PARIBAS 4.032 14-XX 25/11A | EUR | 2,000,000.00 | 249,978,822 | PORTUGAL | ONTEX GROUP REGS 4.75 14-21 15/11S | EUR | 4,500,000.00 | 627,037,225 | |
| BNP PARIBAS OIS 0.08 250416 | EUR | 15,000,000.00 | 1,960,146,750 | BANCO ESPIRITO SANTO 2.625 14-17 08/05A | EUR | 6,000,000.00 | 112,222,321 | | |
| BNP PARIBAS SUB FL. R 15-XX 17/06S | EUR | 13,700,000.00 | 1,838,067,504 | BANCO ESPIRITO SANTO 4.75 13-18 15/01A | EUR | 2,900,000.00 | 55,949,906 | | |
| BPCE FL. R 06-XX 01/02A | EUR | 7,350,000.00 | 964,150,515 | BCO ESPIRITO SANTO 4.00 14-19 21/01A | EUR | 12,000,000.00 | 219,787,334 | | |
| BUT SA REGS 7.375 14-19 15/09S | EUR | 3,000,000.00 | 411,434,803 | PORTUCEL SA REGS 5.375 13-20 15/06S | EUR | 1,714,285.72 | 235,495,392 | | |
| CA ASSURANCES SUB FL R 14-XX 14/10A | EUR | 11,500,000.00 | 1,444,005,482 | CEMEX REGS 4.75 14-22 11/01S | EUR | 1,000,000.00 | 122,348,440 | | |
| CASA TIER 1 EUR FL. R 14-45 08/04Q | EUR | 14,900,000.00 | 2,004,089,581 | CEMEX SAB DE CV 4.375 15-23 05/03S | EUR | 7,060,000.00 | 839,071,736 | | |
| CASINO GUICHARD FL. R 13-XX 31/01A | EUR | 15,000,000.00 | 1,762,387,544 | CEMEX SAB DE CV 6.125 15-25 05/05S | USD | 3,400,000.00 | 352,127,018 | | |
| CEGEDIM 6.75 13-20 01/04S | EUR | 16,000,000.00 | 2,224,949,508 | ALBEA BEAUTY HOLDINGS 8.75 12-19 01/11S | EUR | 6,000,000.00 | 836,755,285 | | |
| CERBA ASSURANCES LAB 7.00 13-20 01/02S | EUR | 19,110,000.00 | 2,595,392,951 | ALTICE FINANCE REGS 5.25 15-23 15/02S | EUR | 9,700,000.00 | 1,269,044,612 | | |
| CNP ASSURANCES SUB FL R 14-45 05/06A | EUR | 5,800,000.00 | 748,426,629 | ALTICE FINANCING REGS 6.50 13-22 15/01S | EUR | 6,100,000.00 | 839,071,133 | | |
| CREDIT AGRICOLE FL. R 09-XX 26/10A | EUR | 13,000,000.00 | 1,999,208,554 | ALTICE FINANCING REGS 8.00 12-19 15/12S | EUR | 4,400,000.00 | 601,206,803 | | |
| CREDIT AGRICOLE SUB FL. R 14-XX 23/12Q | USD | 8,890,000.00 | 1,053,616,411 | ALTICE REGS 7.25 14-22 15/05S | EUR | 31,540,000.00 | 3,861,837,298 | | |
| CROWN EURO HLDG REGS 4.00 14-22 15/07S | EUR | 18,000,000.00 | 2,440,241,573 | ARCELORMITTAL REGS 3.00 14-19 25/03A | EUR | 15,500,000.00 | 1,766,790,034 | | |
| CROWN EURO HOLDINGS 3.375 15-25 15/05S | EUR | 8,700,000.00 | 1,066,057,172 | ARDAGH FINANCIAL REGS 8.375 14-19 15/06S | EUR | 6,134,151.00 | 816,386,411 | | |
| DARTY FINANCE REGS 5.875 14-21 01/03S | EUR | 8,500,000.00 | 1,177,483,674 | CIRSA FUNDING 5.875 15-23 15/05S | EUR | 5,800,000.00 | 719,746,808 | | |
| ELECT. DE FRANCE FL. R 13-XX 29/01S | GBP | 2,700,000.00 | 460,897,903 | CIRSA FUNGING 8.75 10-18 15/05S | EUR | 5,841,902.77 | 776,644,089 | | |
| EUROPCAR 5.75 15-22 15/06S | EUR | 9,300,000.00 | 1,265,385,280 | CNH IND FIN 2.875 14-21 27/09A | EUR | 12,000,000.00 | 1,552,075,559 | | |
| FAURECIA 3.125 15-22 15/06S | EUR | 16,000,000.00 | 2,063,956,121 | CNH INDUSTRIAL FIN 2.75 14-19 18/03A | EUR | 10,200,000.00 | 1,327,408,360 | | |
| GROUPAMA SA FL. R 14-XX 28/05A | EUR | 16,000,000.00 | 2,024,251,389 | CONVATEC HEALTHCARE 10.875 10-18 15/12S | EUR | 4,400,000.00 | 591,150,465 | | |
| GROUPAMA SA PERP FL. R 07-49 22/10A | EUR | 7,000,000.00 | 926,763,917 | DUFREY FIN SCA 4.50 14-22 15/07S | EUR | 18,000,000.00 | 2,465,480,423 | | |
| GROUPAMA SUB FL. R 09-39 27/10A | EUR | 14,000,000.00 | 1,964,229,082 | DUFREY FINANCE SCA REGS4.50 15-23 01/08S | EUR | 5,300,000.00 | 712,756,873 | | |
| HOMEVI REGS 6.875 14-21 15/08S | EUR | 18,070,000.00 | 2,493,864,536 | ELIOR FINANCE REGS 6.50 13-20 01/05S | EUR | 10,247,250.00 | 1,429,461,763 | | |
| ITALCEMENTI FINANCE 6.625 10-20 19/03A | EUR | 12,350,000.00 | 1,883,383,941 | EMPARK FUNDING REGS 6.75 13-19 15/12S | EUR | 3,300,000.00 | 464,704,535 | | |
| LA FINANCIERE ITALIAN 7.25 13-20 15/01S | EUR | 8,315,000.00 | 1,175,065,324 | FIAT FIN TRADE 6.75 13-19 14/10A | EUR | 41,000,000.00 | 6,054,400,661 | | |
| LABEYRIE FINE FOODS 5.625 14-21 15/03S | EUR | 11,500,000.00 | 1,584,365,057 | FIAT FIN TRADE 6.875 13-18 15/03A | EUR | 15,000,000.00 | 2,135,403,471 | | |
| LOXAM SAS 7.375 13-20 24/01S | EUR | 8,350,000.00 | 1,155,067,828 | FIAT FINANCE REGS 4.75 14-21 22/03A | EUR | 4,700,000.00 | 658,332,666 | | |
| MEDI-PARTENAIRE 7.00 13-20 15/05S | EUR | 9,800,000.00 | 1,365,701,408 | FIAT FINANCE TRADE 4.75 14-22 15/07A | EUR | 22,950,000.00 | 3,211,565,396 | | |
| NATIXIS OIS 0.17 160516 | EUR | 15,000,000.00 | 1,960,146,750 | FIAT FINANCE TRADE 7.375 11-18 09/07A | EUR | 14,500,000.00 | 2,106,136,520 | | |
| NATIXIS PERPETUAL FL. R 07-49 18/10A | EUR | 6,000,000.00 | 843,451,147 | FIAT INDUSTRIAL EMTN 6.25 11-18 09/03A | EUR | 14,500,000.00 | 2,034,323,276 | | |
| NOVAFIVES SAS REGS 4.50 14-21 30/06S | EUR | 4,700,000.00 | 519,405,305 | FMC FIN VII REG S 5.25 11-21 15/02S | EUR | 13,250,000.00 | 2,014,020,403 | | |
| NOVALIS SAS REGS 3.00 15-22 30/04S | EUR | 25,300,000.00 | 3,252,026,157 | GARFUNKELUX REGS 8.50 15-22 01/11S | GBP | 7,800,000.00 | 1,400,393,403 | | |
| NUMERICABLE GRP REGS 5.375 14-22 15/05S | EUR | 19,000,000.00 | 2,543,310,009 | GARFUNKELUX REGS 11.00 15-23 01/11S | GBP | 2,000,000.00 | 358,323,494 | | |
| NUMERICABLE REGS 5.625 14-24 15/05S | EUR | 14,500,000.00 | 1,925,239,150 | GAZPROM 3.389 13-20 20/03A | EUR | 1,900,000.00 | 238,554,956 | | |
| PAPREC HOLDING REGS 5.25 15-22 01/04S | EUR | 16,850,000.00 | 2,196,459,494 | GAZPROM OAO REG-S 3.755 12-17 15/03A | EUR | 5,000,000.00 | 654,891,563 | | |
| PEUGEOT 6.50 13-19 18/01A | EUR | 9,000,000.00 | 1,353,230,432 | GAZPROM REGS 3.70 13-18 25/07A | EUR | 3,900,000.00 | 509,622,866 | | |
| PEUGEOT 7.375 13-18 06/03A | EUR | 2,000,000.00 | 294,544,718 | GCS HOLDCO FINANCE I 6.50 13-18 15/11S | EUR | 8,500,000.00 | 1,152,125,256 | | |
| REXEL 3.25 15-22 15/06S | EUR | 13,370,000.00 | 1,729,672,895 | GESTAMP FUND LUX REGS 5.875 13-20 31/05S | EUR | 16,000,000.00 | 2,165,026,516 | | |
| REXEL SA 5.125 13-20 15/06S | EUR | 12,000,000.00 | 1,644,547,442 | HEIDELBERGCEMENT 7.50 10-20 03/04S | EUR | 32,500,000.00 | 5,210,540,497 | | |
| SGD GROUP SAS REGS 5.625 14-19 15/04S | EUR | 1,600,000.00 | 214,411,829 | HEIDELBERGCEMENT FIN 8.50 09-19 31/10S | EUR | 3,500,000.00 | 569,939,456 | | |

ストラクチュラ-欧州ハイ・イールド・ボンド

| 銘柄 | | 通貨 | 額面金額 | 円換算評価額 |
|---------|---|-----|---------------|---------------|
| ルクセンブルク | INEOS FIN REGS 6.50 13-18 15/08S | EUR | 15,000,000.00 | 1,986,608,731 |
| | INEOS GRP REGS 5.75 14-19 15/02S | EUR | 6,150,000.00 | 808,883,959 |
| | KION FIN REGS 6.75 13-20 15/02S | EUR | 5,000,000.00 | 682,085,332 |
| | MAGNOLIA BC REGS 9.00 13-20 01/08S | EUR | 9,816,000.00 | 1,369,919,341 |
| | MATTERH TEL HOL REGS 4.875 15-23 01/05S | EUR | 7,500,000.00 | 824,045,693 |
| | MATTERHORN REGS 3.875 15-22 01/05S | EUR | 21,000,000.00 | 2,509,493,558 |
| | ONEX WIZARD AC II 7.75 15-23 15/02S | EUR | 13,300,000.00 | 1,825,852,522 |
| | PICARD BONDCO REGS 7.75 15-20 01/02S | EUR | 20,500,000.00 | 2,872,924,366 |
| | PLAY FINANCE 2 SA 5.25 14-19 01/02S | EUR | 17,500,000.00 | 2,342,202,220 |
| | PLAY FINANCE 2 SA 6.50 14-19 01/08S | EUR | 8,700,000.00 | 1,188,238,215 |
| | PLAY TOPCO REGS 7.75 14-20 28/02S | EUR | 8,100,000.00 | 1,084,750,700 |
| | TELENET FIN V REGS 6.75 12-24 15/08S | EUR | 6,700,000.00 | 962,997,883 |
| | TELENET FINANCE 6.625 11-21 15/02S | EUR | 13,000,000.00 | 1,762,498,619 |
| | TELENET FINANCE REGS 6.25 12-22 15/08S | EUR | 8,500,000.00 | 1,204,408,250 |
| | UNICREDIT F REGS SUB 6.00 07-17 31/10S | USD | 1,000,000.00 | 126,442,066 |
| | UNICREDIT FINANCE FL.R 09-XX 10/12A | EUR | 23,000,000.00 | 3,404,425,999 |
| | WIND ACQUI.FIN 4.00 14-20 15/07S | EUR | 32,000,000.00 | 4,184,657,185 |
| | WIND ACQUI.FIN REGS 7.00 14-21 23/04S | EUR | 31,000,000.00 | 4,033,429,250 |
| | ZINC CAPITAL REGS 8.875 11-18 11/05S | EUR | 8,338,000.00 | 1,071,874,561 |

(注) 通貨欄の表記は以下の通りです。
EUR(ユーロ)、USD(米ドル)、GBP(英ポンド)

(2) 投資証券

(2015年12月31日現在)

| 銘柄 | | 口数 | 現地通貨 | 円換算評価額 |
|------|------------------------------------|------------|------|----------------|
| フランス | AMUNDI 3 M I (C) | 178 | EUR | 24,662,725,303 |
| | AMUNDI TRESO CT C 3D -C- CAP 3 DEC | 10,119.439 | EUR | 24,945,748,010 |

(注) 通貨欄の表記は以下の通りです。
EUR(ユーロ)

■ (1) 直物為替先渡取引 (I 11シェアクラス、資源国通貨)

(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 | | |
| ユーロ | 200,000.00 | ブラジルレアル | 839,529.60 | 2016/2/2 | 896,003 | |
| ユーロ | 300,000.00 | ブラジルレアル | 1,318,307.70 | 2016/2/2 | △ 450,382 | |
| 小計① | | | | | 445,621 | |
| | | | | | 評価損益 | |
| | | | | | 日本円 | |
| 売 建 | 契約額 | 買 建 | 契約額 | 満 期 日 | | |
| ユーロ | 11,800,000.00 | ブラジルレアル | 49,468,609.00 | 2016/2/2 | △ 54,799,177 | |
| ユーロ | 200,000.00 | ブラジルレアル | 832,611.20 | 2016/2/2 | △ 1,106,367 | |
| 小計② | | | | | △ 55,905,544 | |
| 合計①+② | | | | | △ 55,459,923 (1) | |

■ (2) 外国為替先物契約 (I 11シェアクラス、資源国通貨)

| | | | | | 評価損益 | |
|------------|---------------|-----------|----------------|----------|------------------|--|
| | | | | | 日本円 | |
| 買 建 | 契約額 | 売 建 | 契約額 | 満 期 日 | | |
| ユーロ | 668,797.01 | オーストラリアドル | 1,000,000.00 | 2016/2/2 | 58,494 | |
| ユーロ | 199,267.23 | オーストラリアドル | 300,000.00 | 2016/2/2 | △ 162,104 | |
| ユーロ | 261,781.82 | オーストラリアドル | 400,000.00 | 2016/2/2 | △ 727,884 | |
| ユーロ | 315,086.87 | 南アフリカランド | 5,300,000.00 | 2016/2/2 | 274,705 | |
| ユーロ | 252,504.71 | 南アフリカランド | 4,200,000.00 | 2016/2/2 | 587,504 | |
| 小計③ | | | | | 30,715 | |
| | | | | | 評価損益 | |
| | | | | | 日本円 | |
| 売 建 | 契約額 | 買 建 | 契約額 | 満 期 日 | | |
| ユーロ | 12,287,643.89 | オーストラリアドル | 18,700,000.00 | 2016/2/2 | 27,566,784 | |
| ユーロ | 342,782.48 | オーストラリアドル | 500,000.00 | 2016/2/2 | △ 1,127,163 | |
| ユーロ | 11,681,853.93 | 南アフリカランド | 182,400,000.00 | 2016/2/2 | △119,627,863 | |
| ユーロ | 419,368.29 | 南アフリカランド | 6,500,000.00 | 2016/2/2 | △ 4,667,167 | |
| 小計④ | | | | | △ 97,855,409 | |
| 合計③+④ | | | | | △ 97,824,694 (2) | |
| 合計(1)+(2)= | | | | | △153,284,617 | |

CA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 総 |
|----------------|--------|---------|-------------|------------|--------------|
| | | 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 | 1,007 |
| 6期（2013年2月15日） | 10,072 | | 0 | 0.0 | 1,882 |
| 7期（2014年2月17日） | 10,076 | | 0 | 0.0 | 3,458 |
| 8期（2015年2月16日） | 10,077 | | 0 | 0.0 | 5,683 |
| 9期（2016年2月15日） | 10,077 | | 0 | 0.0 | 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。

■ 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 | |
| (期 首) 2015年 2月16日 | 円 10,077 | % — | % — | % 79.2 |
| 2月末 | 10,077 | 0.0 | 0.0 | 79.2 |
| 3月末 | 10,077 | 0.0 | 0.0 | 18.4 |
| 4月末 | 10,077 | 0.0 | 0.0 | 78.9 |
| 5月末 | 10,077 | 0.0 | 0.0 | 78.9 |
| 6月末 | 10,077 | 0.0 | 0.0 | 18.2 |
| 7月末 | 10,077 | 0.0 | 0.0 | — |
| 8月末 | 10,077 | 0.0 | 0.0 | 78.7 |
| 9月末 | 10,077 | 0.0 | 0.0 | — |
| 10月末 | 10,077 | 0.0 | 0.0 | 59.0 |
| 11月末 | 10,078 | 0.0 | 0.0 | 82.7 |
| 12月末 | 10,077 | 0.0 | 0.0 | 66.4 |
| 2016年 1月末 | 10,077 | 0.0 | 0.0 | 88.6 |
| (期 末) 2016年 2月15日 | 10,077 | 0.0 | 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) | 0.024% (0.019) (0.001) (0.004) | 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 |
| 合 計 | 2 | 0.024 | |

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。

CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）

■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BB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・評価額の単位未満は切捨てです。

(注2) ※印は現先で保有している債券です。

■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 |
| 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。