

■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10月27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／トルコリラ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 (I12シェアクラス、トルコリラ)」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マネープールファンド (適格機関投資家専用)」への投資も行います。	
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 (トルコリラコース)	ストラクチャラ-欧州ハイ・イールド・ボンド (I12シェアクラス、トルコリラ) CAマネープールファンド (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 (I12シェアクラス、トルコリラ)	欧州のハイイールド債
	CAマネープールファンド (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・欧州  
 ハイ・イールド債券ファンド  
 (トルコリラコース)

運用報告書 (全体版)  
 第9作成期

第49期	(決算日 2015年11月9日)
第50期	(決算日 2015年12月8日)
第51期	(決算日 2016年1月8日)
第52期	(決算日 2016年2月8日)
第53期	(決算日 2016年3月8日)
第54期	(決算日 2016年4月8日)

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚くお礼申し上げます。

当ファンドはこの度、上記の決算を行いました。ここに、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（トルコリラコース）

## ■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 込	み 金	中 率			
第5作成期		円	円	%	%	%	百万円	
	25期 (2013年11月8日)	10,694	250	2.2	0.4	92.5	83,375	
	26期 (2013年12月9日)	10,934	250	4.6	0.5	93.2	141,475	
	27期 (2014年1月8日)	10,407	250	△ 2.5	0.5	96.0	173,688	
	28期 (2014年2月10日)	9,718	250	△ 4.2	0.4	97.7	182,889	
	29期 (2014年3月10日)	9,829	250	3.7	0.5	97.3	197,199	
第6作成期	30期 (2014年4月8日)	10,122	250	5.5	0.4	96.9	221,954	
	31期 (2014年5月8日)	10,013	250	1.4	0.5	96.6	247,394	
	32期 (2014年6月9日)	10,033	250	2.7	0.5	96.8	289,790	
	33期 (2014年7月8日)	9,563	250	△ 2.2	0.5	96.4	321,088	
	34期 (2014年8月8日)	9,125	250	△ 2.0	0.5	97.2	334,021	
	35期 (2014年9月8日)	9,330	250	5.0	0.4	97.2	358,497	
第7作成期	36期 (2014年10月8日)	8,911	250	△ 1.8	0.5	97.4	361,942	
	37期 (2014年11月10日)	9,333	250	7.5	0.5	98.0	386,730	
	38期 (2014年12月8日)	9,724	250	6.9	0.5	97.4	402,995	
	39期 (2015年1月8日)	9,047	250	△ 4.4	0.5	97.6	390,355	
	40期 (2015年2月9日)	8,455	250	△ 3.8	0.5	97.7	380,752	
	41期 (2015年3月9日)	8,057	200	△ 2.3	0.5	97.5	376,650	
第8作成期	42期 (2015年4月8日)	7,989	200	1.6	0.5	98.4	371,187	
	43期 (2015年5月8日)	7,458	200	△ 4.1	0.5	97.9	346,075	
	44期 (2015年6月8日)	7,726	200	6.3	0.5	98.0	358,942	
	45期 (2015年7月8日)	7,235	200	△ 3.8	0.6	97.9	334,200	
	46期 (2015年8月10日)	7,063	200	0.4	0.6	97.9	322,504	
	47期 (2015年9月8日)	6,006	200	△ 12.1	0.7	97.8	266,648	
第9作成期	48期 (2015年10月8日)	6,079	150	3.7	0.7	97.8	266,638	
	49期 (2015年11月9日)	6,238	150	5.1	0.7	97.8	267,941	
	50期 (2015年12月8日)	6,171	150	1.3	0.6	97.9	256,450	
	51期 (2016年1月8日)	5,551	150	△ 7.6	0.7	97.8	222,557	
	52期 (2016年2月8日)	5,470	100	0.3	0.7	97.1	216,039	
	53期 (2016年3月8日)	5,333	100	△ 0.7	0.5	98.0	200,393	
	54期 (2016年4月8日)	5,226	100	△ 0.1	0.5	98.0	191,002	

(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（トルコリラコース）

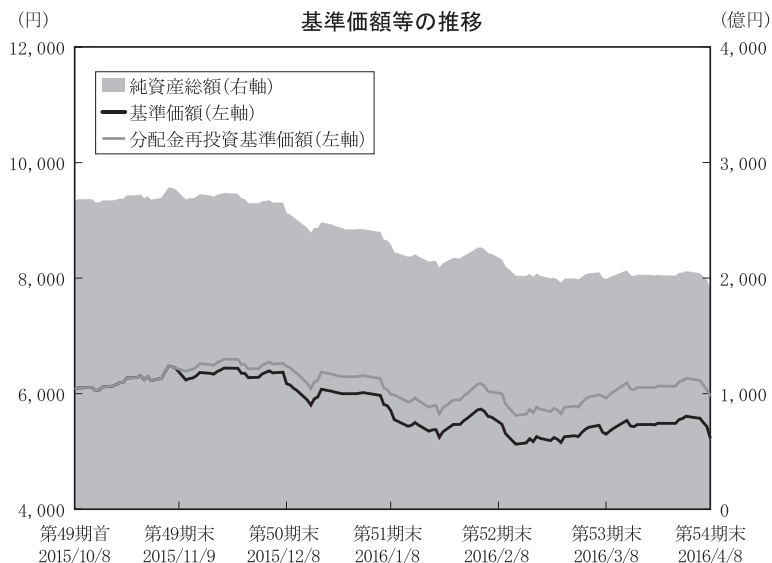
■ 当作成期中の基準価額等の推移

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49期	(期 首)2015年10月 8 日	円 6,079	% —	% 0.7	% 97.8
	10月末	6,227	2.4	0.7	97.9
	(期 末)2015年11月 9 日	6,388	<b>5.1</b>	0.7	97.8
第50期	(期 首)2015年11月 9 日	6,238	—	0.7	97.8
	11月末	6,284	0.7	0.7	97.8
	(期 末)2015年12月 8 日	6,321	<b>1.3</b>	0.6	97.9
第51期	(期 首)2015年12月 8 日	6,171	—	0.6	97.9
	12月末	6,018	△2.5	0.6	97.9
	(期 末)2016年 1 月 8 日	5,701	<b>△7.6</b>	0.7	97.8
第52期	(期 首)2016年 1 月 8 日	5,551	—	0.7	97.8
	1 月末	5,572	0.4	0.7	97.9
	(期 末)2016年 2 月 8 日	5,570	<b>0.3</b>	0.7	97.1
第53期	(期 首)2016年 2 月 8 日	5,470	—	0.7	97.1
	2 月末	5,271	△3.6	0.5	98.0
	(期 末)2016年 3 月 8 日	5,433	<b>△0.7</b>	0.5	98.0
第54期	(期 首)2016年 3 月 8 日	5,333	—	0.5	98.0
	3 月末	5,569	4.4	0.4	98.1
	(期 末)2016年 4 月 8 日	5,326	<b>△0.1</b>	0.5	98.0

(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49期首	6,079円
第54期末	5,226円
既払分配金 (税込み)	750円
騰落率	△2.1% (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、2015年10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】

### 下落要因

- ① 2015年11月から2016年2月にかけて、原油価格の下落を背景にエネルギー・セクターの大幅な下落が欧州ハイイールド債市場全体の重しとなったこと
- ② 市場が軟調に推移する中、2015年12月のECB（欧州中央銀行）の追加金融緩和が投資家の期待を下回り、失望を招いたこと
- ③ 為替市場において、当作成期はトルコリラ安・円高となったこと

### 上昇要因

- ① 2015年10月から11月、および2016年2月から3月にかけて、ECBを含む各国の中央銀行の緩和的な金融政策を受け、投資家心理が好転したこと
- ② 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
- ③ ユーロ売り／トルコリラ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

## 【投資環境】

### ＜欧州ハイイールド債券市場＞

当作成期初は、中国人民銀行の金融緩和やFRB（米連邦準備理事会）の最初の利上げの先送り等により、欧州ハイイールド債市場は上昇傾向となりました。しかし、11月に市場が軟調な動きを示し、ECB（欧州中央銀行）による追加金融緩和への期待が高まる中、12月に決定された追加緩和は投資家の期待を下回り、市場は下落傾向を遂げました。2016年に入り、原油価格が1バレル26ドル台まで下落するにつれ、欧州ハイイールド債市場も下落傾向が続きました。2月にはドイツ銀行が発行する劣後債のクーポン支払いに対する懸念が浮上し、金融セクターを中心に軟調に推移しましたが、ドイツ銀行が財務内容に対する懸念を払拭（ふっしょく）したこと等により欧州ハイイールド債市場は上昇に転じました。3月に行われたECBの追加金融緩和が、利下げに加え資産購入プログラムの拡大や非金融投資適格社債を買入れ対象に加えるなど市場予想を上回る大規模なものとなったことも市場にとってプラスとなりました。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。

### ＜為替市場＞

当作成期初41円台で始まったトルコリラ／円相場は、米国の利上げの先送り観測や、ユーロ圏における追加緩和期待、11月の総選挙での与党圧勝を受けた政権安定化が期待されたことなどを背景に上昇基調となりました。しかし、領空を侵犯したとしてトルコ軍がロシア機を撃墜したことや、武装組織との対立など地政学的リスクが懸念されたことで下落に転じました。2016年1月以降、中国景気不安や原油価格の急落を受けて投資家のリスク回避の姿勢が強まる中、中東情勢の悪化もあり、トルコリラの下落は継続しました。その後ECBの追加緩和示唆をきっかけに、原油、世界株式が反発したことでリスク回避の動きが和らぎ、下落幅の一部を埋める展開となったものの、世界経済に対する不透明感が台頭すると再びトルコリラは下落しました。テロが相次ぎ、政治的・地政学的リスクがトルコリラの不透明要因となっているものの、米国の利上げペースが緩やかになるとの見方などを受けて下げ渋り、37円台で当作成期末を迎えました。

### ＜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、強い需要を背景に非常に低い利回りで推移しました。日銀による量的・質的金融緩和のもとで、TDB（国庫短期証券）3ヵ月物の利回りは0.00%近辺の利回り水準で始まりしました。日銀が金融緩和策としてTDBを大量に買い続けていることから、利回りは0.00%からマイナス圏での推移となりました。1月末の日銀によるマイナス金利導入決定後に-0.20%まで低下したTDB3ヵ月物の利回りは、日銀のさらなる利下げが期待されるなか急速に需給が逼迫（ひっばく）し、当作成期末には-0.48%まで低下しました。

## 【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（I12シェアクラス、トルコリラ）」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）」を投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保と中長期的な投資信託財産の成長を目指して運用を行いました。当ファンドは「ストラクチャル-欧州ハイ・イールド・ボンド（I12シェアクラス、トルコリラ）」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）

### ＜ストラクチャル-欧州ハイ・イールド・ボンド（I12シェアクラス、トルコリラ）＞

当ファンドでは、欧州ハイイールド債市場に対して前向きな姿勢を維持しており、市場よりもややリスクを高めにした運用を継続しました。ただし、市場の流動性に関しては、分散投資を維持し流動性低下への対応を行っています。また、相対的に格付が低い社債については、金融機関の損失吸収能力の基準が公表された際に魅力が高まった劣後債のポジションを積み増す等、選別的な銘柄選択を行いました。この他、当作成期を通じて、発行市場を活用して多くの銘柄に投資しました。

（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（トルコリラコース）

実質的なユーロ建資産に対し、ユーロ売り／トルコリラ買いの為替取引を行い、当作成期を通じてトルコリラ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への投資と債券現先取引を行い、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（I12シェアクラス、トルコリラ）」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（I12シェアクラス、トルコリラ）>

英国のEU（欧州連合）離脱リスク、中国の景気減速懸念、原油価格の動向、マイナス金利による金融システムの健全性への悪影響などの懸念はあるものの、欧州経済は緩やかに成長するという当ファンドの見方に変わりはありません。欧州ハイイールド債の発行体のファンダメンタルズ（基礎的条件）は堅調を維持しており、デフォルト率は低水準で推移すると予想します。当ファンドはこの資産クラスに対して引き続き前向きな見方をしており、ポートフォリオの価格変動性は市場全体に比べやや高めに維持する方針です。また、低金利環境を鑑み、デュレーションも引き続き中立とします。ポートフォリオでは、十分に銘柄を分散させ、流動性を維持しつつ、利回りを高めるためにC o C o債（偶発転換社債）や劣後債等に選別的に投資いたします。ECBによる資産買い入れプログラムが社債にまで拡大したことに伴い投資家の利回り追求の動きはより強まるとみられることから、欧州ハイイールド債市場は引き続き恩恵を享受すると考えます。

(アムンディ アセットマネジメント)

今後もファンドの基本方針に従い、引き続き実質的なユーロ建資産に対し、ユーロ売り／トルコリラ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)

# アムンディ・欧州ハイ・イールド債券ファンド（トルコリラコース）

## ■ 1万口当たりの費用明細

項 目	第49期～第54期 (2015年10月9日 ～2016年4月8日)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬 ( 投 信 会 社 ) ( 販 売 会 社 )  ( 受 託 会 社 )	32円 ( 9 ) (22)  ( 1 )	0.545% (0.151) (0.378)  (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 )	0 ( 0 ) ( 0 )	0.002 (0.001) (0.001)	その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 ファンドの法定開示資料の印刷に係る費用
合 計	32	0.547	

期中の平均基準価額は5,823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（2015年10月9日から2016年4月8日まで）

### 投資信託受益証券、投資証券

決 算 期		第 49 期 ～ 第 54 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 932,783,827	千円 940,000
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 （I12シェアクラス、トルコリラ）	口 —	千円 —	口 6,094,000	千円 43,216,147

- (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（トルコリラコース）

## ■利害関係人との取引状況等（2015年10月9日から2016年4月8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4月8日現在）

### (1) 国内（邦貨建）投資信託受益証券

銘	柄	第8作成期末 (第48期末)	第9作成期末(第54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）		1,843,403,989	910,620,162	917,540
合計	口数・金額	1,843,403,989	910,620,162	917,540
	銘柄数<比率>	1	1	<0.5%>

（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8作成期末 (第48期末)	第9作成期末(第54期末)	
		口数	口数	評価額
		口	口	千円
(ルクセンブルク) ストラクチュラ-欧州ハイ・イールド・ボンド (I12シェアクラス、トルコリラ)		35,284,000	29,190,000	187,107,900
合計	口数・金額	35,284,000	29,190,000	187,107,900
	銘柄数<比率>	1	1	<98.0%>



# アムンディ・欧州ハイ・イールド債券ファンド（トルコリラコース）

## ■投資信託財産の構成（2016年4月8日現在）

項 目	第 9 作 成 期 末 (第 54 期 末)	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投 資 信 託 受 益 証 券	917,540	0.5
投 資 証 券	187,107,900	95.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	7,207,196	3.7
投 資 信 託 財 産 総 額	195,232,636	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	(2015年11月9日)	(2015年12月8日)	(2016年1月8日)	(2016年2月8日)	(2016年3月8日)	(2016年4月8日)現在
	第 49 期 末	第 50 期 末	第 51 期 末	第 52 期 末	第 53 期 末	第 54 期 末
<b>(A) 資 産</b>	275,187,672,165円	264,150,520,687円	229,434,680,676円	220,510,123,380円	204,929,666,452円	195,232,636,250円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	11,208,553,254	11,052,305,723	9,867,076,037	9,309,421,189	7,302,855,577	7,076,475,342
投資信託受益証券(評価額)	1,857,598,199	1,517,631,936	1,517,631,936	1,517,631,936	917,540,875	917,540,875
投資証券(評価額)	262,044,360,000	251,011,800,000	217,640,230,000	209,683,070,000	196,447,310,000	187,107,900,000
未 収 入 金	76,840,000	568,780,000	409,740,000	-	261,960,000	130,720,000
未 収 利 息	3,070	3,028	2,703	255	-	33
そ の 他 未 収 収 益	317,642	-	-	-	-	-
<b>(B) 負 債</b>	7,246,320,075	7,699,683,153	6,877,556,154	4,470,183,874	4,536,190,545	4,230,340,617
未 払 収 益 分 配 金	6,442,497,860	6,233,804,088	6,013,652,062	3,949,866,927	3,757,281,710	3,654,537,663
未 払 解 約 金	543,926,819	1,230,530,273	635,418,542	314,683,742	600,186,101	384,003,721
未 払 信 託 報 酬	257,580,868	232,749,223	225,581,282	202,424,238	175,228,726	188,000,405
そ の 他 未 払 費 用	2,314,528	2,599,569	2,904,268	3,208,967	3,494,008	3,798,828
<b>(C) 純 資 産 総 額 (A-B)</b>	267,941,352,090	256,450,837,534	222,557,124,522	216,039,939,506	200,393,475,907	191,002,295,633
元 本	429,499,857,395	415,586,939,229	400,910,137,496	394,986,692,732	375,728,171,070	365,453,766,380
次 期 繰 越 損 益 金	△161,558,505,305	△159,136,101,695	△178,353,012,974	△178,946,753,226	△175,334,695,163	△174,451,470,747
<b>(D) 受 益 権 総 口 数</b>	429,499,857,395口	415,586,939,229口	400,910,137,496口	394,986,692,732口	375,728,171,070口	365,453,766,380口
1万口当たり基準価額(C/D)	6,238円	6,171円	5,551円	5,470円	5,333円	5,226円

(注記事項)

作成期首元本額	438,599,464,380円
作成期中追加設定元本額	19,176,417,324円
作成期中一部解約元本額	92,322,115,324円

# アムンディ・欧州ハイ・イールド債券ファンド（トルコリラコース）

## ■損益の状況

第49期 自2015年10月9日 至2015年11月9日 第52期 自2016年1月9日 至2016年2月8日  
 第50期 自2015年11月10日 至2015年12月8日 第53期 自2016年2月9日 至2016年3月8日  
 第51期 自2015年12月9日 至2016年1月8日 第54期 自2016年3月9日 至2016年4月8日

項 目	第 49 期	第 50 期	第 51 期	第 52 期	第 53 期	第 54 期
(A) 配 当 等 收 益	5,511,459,225円	5,313,242,681円	5,094,430,912円	5,015,626,652円	3,614,713,392円	3,507,598,287円
受 取 配 当 金	5,511,090,727	5,313,194,277	5,094,384,917	5,015,592,549	3,614,712,344	3,507,598,240
受 取 利 息	52,011	48,404	45,995	34,103	1,048	47
そ の 他 収 益 金	316,487	-	-	-	-	-
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	7,968,615,950	△ 1,684,913,361	△ 23,641,268,581	△ 4,092,689,703	△ 4,794,713,553	△ 3,588,001,593
売 買 損 益	8,111,964,321	98,673,344	345,471,391	96,379,557	524,675,061	137,904,365
売 買 損 益	△ 143,348,371	△ 1,783,586,705	△ 23,986,739,972	△ 4,189,069,260	△ 5,319,388,614	△ 3,725,905,958
(C) 信 託 報 酬 等	△ 259,895,396	△ 233,034,264	△ 225,885,981	△ 202,728,937	△ 175,513,767	△ 188,305,225
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	13,220,179,779	3,395,295,056	△ 18,772,723,650	720,208,012	△ 1,355,513,928	△ 268,708,531
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△103,337,959,608	△ 91,725,289,399	△ 89,028,860,780	△110,142,610,288	△107,303,628,645	△108,598,678,371
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 64,998,227,616	△ 64,572,303,264	△ 64,537,776,482	△ 65,574,484,023	△ 62,918,270,880	△ 61,929,546,182
(配 当 等 相 当 額)	( 46,280,288,813)	( 43,908,191,066)	( 41,415,401,705)	( 39,784,215,898)	( 37,911,428,620)	( 36,617,631,797)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△111,278,516,429)	(△108,480,494,330)	(△105,953,178,187)	(△105,358,699,921)	(△100,829,699,500)	(△ 98,547,177,979)
(G) 計 (D+E+F)	△155,116,007,445	△152,902,297,607	△172,339,360,912	△174,996,886,299	△171,577,413,453	△170,796,933,084
(H) 収 益 分 配 金	△ 6,442,497,860	△ 6,233,804,088	△ 6,013,652,062	△ 3,949,866,927	△ 3,757,281,710	△ 3,654,537,663
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	△161,558,505,305	△159,136,101,695	△178,353,012,974	△178,946,753,226	△175,334,695,163	△174,451,470,747
追 加 信 託 差 損 益 金	△ 66,019,578,276	△ 65,725,972,607	△ 65,682,775,835	△ 65,574,484,023	△ 63,236,512,641	△ 62,264,667,285
(配 当 等 相 当 額)	( 45,258,938,153)	( 42,754,521,723)	( 40,270,402,352)	( 39,784,215,898)	( 37,593,186,859)	( 36,282,510,694)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△111,278,516,429)	(△108,480,494,330)	(△105,953,178,187)	(△105,358,699,921)	(△100,829,699,500)	(△ 98,547,177,979)
分 配 準 備 積 立 金	14,702,407,153	14,124,510,686	13,474,028,654	14,039,559,613	13,299,291,843	12,888,838,462
繰 越 損 益 金	△110,241,334,182	△107,534,639,774	△126,144,265,793	△127,411,828,816	△125,397,474,365	△125,075,641,924

(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49期計算期間末における費用控除後の配当等収益（5,405,187,998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（46,280,288,813円）および分配準備積立金（14,718,366,355円）より分配対象収益は66,403,843,166円（10,000口当たり1,546円）であり、うち6,442,497,860円（10,000口当たり150円）を分配金額としております。

第50期計算期間末における費用控除後の配当等収益（5,080,208,417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（43,908,191,066円）および分配準備積立金（14,124,437,014円）より分配対象収益は63,112,836,497円（10,000口当たり1,518円）であり、うち6,233,804,088円（10,000口当たり150円）を分配金額としております。

第51期計算期間末における費用控除後の配当等収益（4,868,544,931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（41,415,401,705円）および分配準備積立金（13,474,136,432円）より分配対象収益は59,758,083,068円（10,000口当たり1,490円）であり、うち6,013,652,062円（10,000口当たり150円）を分配金額としております。

第52期計算期間末における費用控除後の配当等収益（4,812,897,715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（39,784,215,898円）および分配準備積立金（13,176,528,825円）より分配対象収益は57,773,642,438円（10,000口当たり1,462円）であり、うち3,949,866,927円（10,000口当たり100円）を分配金額としております。

第53期計算期間末における費用控除後の配当等収益（3,439,199,625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（37,911,428,620円）および分配準備積立金（13,299,132,167円）より分配対象収益は54,649,760,412円（10,000口当たり1,454円）であり、うち3,757,281,710円（10,000口当たり100円）を分配金額としております。

第54期計算期間末における費用控除後の配当等収益（3,319,293,062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（36,617,631,797円）および分配準備積立金（12,888,961,960円）より分配対象収益は52,825,886,819円（10,000口当たり1,445円）であり、うち3,654,537,663円（10,000口当たり100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49期	第50期	第51期	第52期	第53期	第54期
1万口当たりの分配金（税込み）	150円	150円	150円	100円	100円	100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かさ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49期	第50期	第51期	第52期	第53期	第54期
	(2015年10月9日 ～2015年11月9日)	(2015年11月10日 ～2015年12月8日)	(2015年12月9日 ～2016年1月8日)	(2016年1月9日 ～2016年2月8日)	(2016年2月9日 ～2016年3月8日)	(2016年3月9日 ～2016年4月8日)
当期分配金	150	150	150	100	100	100
（対基準価額比率）	(2.348%)	(2.373%)	(2.631%)	(1.795%)	(1.841%)	(1.878%)
当期の収益	125	122	121	100	91	90
当期の収益以外	24	27	28	—	8	9
翌期繰越分配対象額	1,396	1,368	1,340	1,362	1,354	1,345

（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。

《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の投資制限に関する条文の新設、およびそれに伴う条文整備のため、投資信託約款に所要の変更を行いました。

## 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 12シエアクラス、トルコリラ)」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4月7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4月7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 3 M I (C)	% ユーロ	170,441	22,195,283,235	—
		AMUNDI TRESO CT C 3D -C- CAP 3 DEC	—	7,852,042	18,186,551,783	—
イギリス	債券	VERGIN MEDIA SECURED 6.00 13-21 15/04S	6	27,481,500	4,367,308,556	2021/4/15
イタリア	ルクセンブルク	ENEL SPA FL. R 13-74 10/01A	6.5	31,500,000	4,186,490,086	2074/1/10
ドイツ		FIAT FIN TRADE 6.75 13-19 14/10A	6.75	29,000,000	4,059,240,768	2019/10/14
イタリア	COMMERZBANK AG 7.75 11-21 16/03A	7.75	25,500,000	3,804,001,544	2021/3/16	
日本	ルクセンブルク	INTESA SAN PAOLO 6.625 13-23 13/09A	6.625	24,788,000	3,672,549,786	2023/9/13
		INTESA SANPAOLO SPA FL. R 08-XX 20/06A	8.047	27,300,000	3,636,807,815	2049/6/29
イタリア	ルクセンブルク	SOFTBANK GROUP CORP 4.75 15-25 30/07S	4.75	28,600,000	3,618,026,694	2025/7/30
		WIND ACQUI. FIN 4.00 14-20 15/07S	4	29,000,000	3,554,155,233	2020/7/15
イタリア	ルクセンブルク	ALTICE REGS 7.25 14-22 15/05S	7.25	28,240,000	3,455,705,257	2022/5/15
		WIND ACQUI. FIN REGS 7.00 14-21 23/04S	7	29,000,000	3,440,999,832	2021/4/23
イタリア	ルクセンブルク	HEIDELBERGCEMENT 7.50 10-20 03/04S	7.5	22,700,000	3,440,728,160	2020/4/3
		BANCO POPOLARE 3.50 14-19 14/03A	3.5	26,000,000	3,272,063,202	2019/3/14
オランダ	TELEFONICA EUROPA SUB 7.625 13-XX 18/09A	7.625	23,700,000	3,247,608,282	2049/9/18	
フランス	NOVALIS SAS REGS 3.00 15-22 30/04S	3	25,300,000	3,136,956,023	2022/4/30	
オランダ	UNICREDIT FINANCE FL. R 09-XX 10/12A	8.125	23,000,000	3,077,056,110	2049/12/10	
フランス	ルクセンブルク	SCHAEFFLER FIN 3.25 14-19 15/05S	3.25	24,500,000	3,060,120,813	2019/5/15
		UPC HOLDING REGS 6.375 12-22 15/09S	6.375	23,200,000	3,047,338,709	2022/9/15
フランス	SOCIETE GENE SA SUB FL. R 09-XX 04/09A	9.375	20,500,000	3,004,767,602	2049/9/4	
イギリス	RBS SUB FL. R 14-24 25/03A	3.625	24,000,000	2,847,222,904	2024/3/25	
イタリア	UNICREDIT SPA REGS 6.95 12-22 31/10A	6.95	19,500,000	2,680,584,802	2022/10/31	
オランダ	LGE HOLDCO VI BV 7.125 14-24 15/05S	7.125	19,600,000	2,630,202,996	2024/5/15	
イギリス	INTER GAME TECH REGS 4.75 15-23 15/02S	4.75	20,400,000	2,553,781,557	2023/2/15	
フランス	VEOLIA ENVIRONNEMENT FL. R 13-XX 16/04A	4.45	19,500,000	2,500,461,343	2049/4/16	
オランダ	OI EUROPEAN GROUP BV 6.75 10-20 15/09S	6.75	17,000,000	2,457,454,357	2020/9/15	
フランス	ACCOR FL. R 14-XX 30/06A	4.125	20,000,000	2,454,899,754	2049/6/30	
イタリア	FINMEC FINANCE 4.50 13-21 19/01A	4.5	17,533,000	2,437,472,451	2021/1/19	
オランダ	KPN FL. R 13-XX 14/09A	6.125	18,500,000	2,429,058,348	2049/9/14	
ルクセンブルク	FIAT FINANCE TRADE 4.75 14-22 15/07A	4.75	18,250,000	2,413,245,602	2022/7/15	

ストラクチュラ-欧州ハイ・イールド・ボンド

■外国為替先物契約（I 12シェアクラス、トルコリラ）

(2016年4月7日現在)

					評価損益	
買 建	契約額	売 建	契約額	満 期 日	日本円	
ユーロ	41,912,379.26	トルコリラ	137,000,000.00	2016/5/25	42,503,434	
小計①					42,503,434	
					評価損益	
売 建	契約額	買 建	契約額	満 期 日	日本円	
ユーロ	351,682,566.63	トルコリラ	1,200,000,000.00	2016/5/25	1,548,801,931	
ユーロ	308,728,857.03	トルコリラ	1,043,000,000.00	2016/5/25	965,500,661	
ユーロ	422,434,532.45	トルコリラ	1,400,000,000.00	2016/6/2	180,722,319	
ユーロ	424,441,243.64	トルコリラ	1,395,000,000.00	2016/6/2	△ 258,474,293	
ユーロ	35,759,410.68	トルコリラ	117,000,000.00	2016/6/2	△ 41,777,510	
小計②					2,394,773,108	
合計①+②					2,437,276,542	

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4月8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。

■組入資産の明細（2016年4月8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 4 月 8 日 現 在						
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
					5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国 債 証 券	500,000	500,008	16.5	—	—	—	16.5
合 計	500,000	500,008	16.5	—	—	—	16.5

(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	500,008	2016/4/18
合 計			500,000	500,008	

(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 (I 12シェアクラス、トルコリラ)」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	355,522,830
	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	
	BAKKAHORV 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	
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	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	ベルギー	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		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	ポルトガル	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	メキシコ	CEMEX REGS 4.75 14-22 11/01S	EUR	1,000,000.00	122,348,440	
CASA TIER 1 EUR FL. R 14-49 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	ルクセンブルク	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 15/06S	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	6,054,400,671		
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	1,729,672,695	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
	MATTEH 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)

■外国為替先物契約（I 12シェアクラス、トルコリラ）

（2015年12月31日現在）

買 建	契 約 額	売 建	契 約 額	満 期 日	評 価 損 益	
					日本円	
ユーロ	108,969,875.61	トルコリラ	349,000,000.00	2016/2/2	△	14,094,456
ユーロ	38,226,665.01	トルコリラ	128,000,000.00	2016/1/27	△	243,927,741
ユーロ	33,264,090.14	トルコリラ	107,000,000.00	2016/1/27	△	31,620,939
				小計①	△	289,643,136
					評 価 損 益	
売 建	契 約 額	買 建	契 約 額	満 期 日	日本円	
ユーロ	471,138,136.82	トルコリラ	1,595,000,000.00	2016/1/27		3,724,242,558
ユーロ	441,212,935.54	トルコリラ	1,500,000,000.00	2016/1/27		3,747,718,165
ユーロ	490,897,960.05	トルコリラ	1,550,000,000.00	2016/2/2	△	851,796,003
ユーロ	489,852,310.96	トルコリラ	1,543,000,000.00	2016/2/2	△	1,002,403,538
ユーロ	63,110,461.57	トルコリラ	197,000,000.00	2016/2/2	△	203,059,947
				小計②		5,414,701,235
				合計①+②		5,125,058,999

# 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
		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)	0.024% (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。

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				
	額面金額	評価額	組入比率	うちBB格 以下組入比率	残存期間別組入比率			
					5年以上	2年以上	2年未満	
	千円	千円	%	%	%	%	%	
国債証券	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) 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	
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
	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。