

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

	Aコース(為替ヘッジあり)	Bコース(為替ヘッジなし)
商品分類	追加型投信／内外／株式	
信託期間	2012年7月20日から2022年12月5日までです。	
運用方針	ファースト・イーグル・アムンディ・インターナショナル・ファンドへの投資を通じて、主として世界各国の株式等へ実質的に投資を行い、投資信託財産の中長期的な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。	
	原則として外貨建資産の為替ヘッジを行い、為替リスクの低減を図ります。	原則として外貨建資産の為替ヘッジは行いません。
主要運用対象	ワールド・バリュ・アロケーション	ファースト・イーグル・アムンディ・インターナショナル・ファンド CAマネープールファンド(適格機関投資家専用)
	ファースト・イーグル・アムンディ・インターナショナル・ファンド	世界各国の株式等
	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。外貨建資産への投資割合には制限を設けません。	
分配方針	毎決算時(年2回、原則毎年6月5日および12月5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、繰越分も含めた経費控除後の配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。収益分配金額は、委託会社が基準価額水準、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があります。	

ワールド・バリュ・アロケーション  
Aコース(為替ヘッジあり)／  
Bコース(為替ヘッジなし)

## 運用報告書(全体版)

第7期(決算日 2015年12月7日)

### 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、この度、上記の決算を行いました。ここに期中の運用状況を報告申し上げます。

今後とも一層のお引き立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

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>

◆最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	標準価額		投資信託 受益証券 組入比率	投資 証券 組入比率	純資産額
		税金 分配	み 金 騰 落 率			
	円	円	%	%	%	百万円
3期 (2013年12月5日)	11,423	100	3.6	0.4	100.6	5,849
4期 (2014年6月5日)	11,951	100	5.5	0.2	97.2	10,002
5期 (2014年12月5日)	11,905	0	△0.4	0.3	110.0	12,174
6期 (2015年6月5日)	11,987	80	1.4	0.3	100.3	12,882
7期 (2015年12月7日)	11,592	0	△3.3	0.3	97.5	12,957

(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。

◆当期中の基準価額等の推移

年月日	基準 価額	標準 騰落率		投資信託 受益証券 組入比率	投資 証券 組入比率
(期首) 2015年6月5日	円 11,987	% —		% 0.3	% 100.3
6月末	11,761	△1.9		0.3	96.3
7月末	11,581	△3.4		0.3	97.9
8月末	11,289	△5.8		0.3	95.5
9月末	10,765	△10.2		0.3	97.5
10月末	11,632	△3.0		0.3	98.3
11月末	11,579	△3.4		0.3	99.6
(期末) 2015年12月7日	11,592	△3.3		0.3	97.5

(注) 騰落率は期首比です。

◆最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	標準価額		投資信託 受益証券 組入比率	投資 証券 組入比率	純資産額
		税込み 分配金	騰落率			
	円	円	%	%	%	百万円
3期 (2013年12月5日)	14,653	150	5.8	0.1	98.3	12,124
4期 (2014年6月5日)	15,370	150	5.9	0.1	98.3	31,374
5期 (2014年12月5日)	17,642	150	15.8	0.3	98.2	65,181
6期 (2015年6月5日)	18,485	150	5.6	0.2	98.0	80,914
7期 (2015年12月7日)	17,735	0	△4.1	0.2	97.3	82,979

(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。

◆当期中の基準価額等の推移

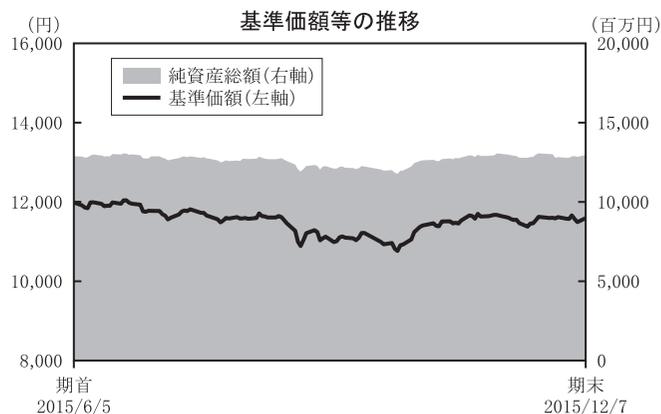
年月日	基準価額	標準価額		投資信託 受益証券 組入比率	投資 証券 組入比率
		騰落率	騰落率		
(期首) 2015年6月5日	円 18,485	% —	% 0.2	% 98.0	% 98.0
6月末	17,855	△3.4	0.2	97.5	97.5
7月末	17,815	△3.6	0.2	97.7	97.7
8月末	16,964	△8.2	0.2	97.5	97.5
9月末	16,013	△13.4	0.2	97.9	97.9
10月末	17,448	△5.6	0.2	98.3	98.3
11月末	17,651	△4.5	0.2	98.2	98.2
(期末) 2015年12月7日	17,735	△4.1	0.2	97.3	97.3

(注) 騰落率は期首比です。

■ワールド・バリュー・アロケーション Aコース (為替ヘッジあり) ■

【基準価額等の推移】

第7期首	11,987円
第7期末	11,592円
既払分配金 (税込み)	0円
騰落率	△3.3%



【基準価額の主な変動要因】

下落要因

- ① 2015年8月、中国人民銀行が予想外に人民元を切り下げたことから、予想以上に低調な中国および世界の経済成長に対する懸念が増大したこと
- ② 2015年9月、F R B (米連邦準備理事会) が利上げを先送りしたことから、米国の金融政策に対して不透明感が高まり、リスク回避姿勢が強まったこと

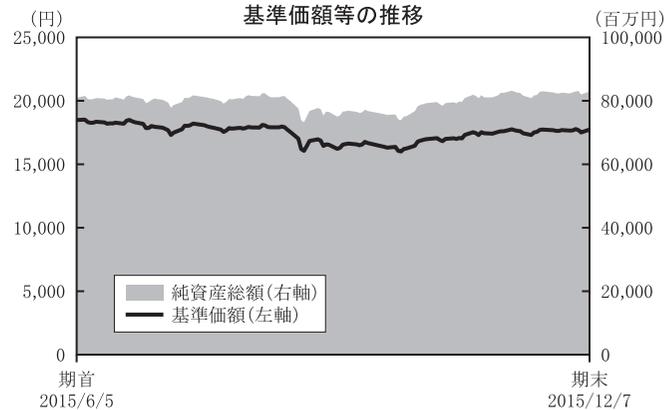
上昇要因

- ① 2015年10月、中国人民銀行が利下げを実施したことなどから、新興国の景気減速に対する過度な懸念が薄らいだこと
- ② 2015年10月、E C B (欧州中央銀行) が12月の理事会で追加的金融緩和に踏み切る可能性を示唆し、市場の支援材料となったこと

■ワールド・バリュー・アロケーション Bコース (為替ヘッジなし) ■

【基準価額等の推移】

第7期首	18,485円
第7期末	17,735円
既払分配金 (税込み)	0円
騰落率	△4.1%



【基準価額の主な変動要因】

下落要因

- ① 2015年8月、中国人民銀行が予想外に人民元を切り下げたことから、予想以上に低調な中国および世界の経済成長に対する懸念が増大したこと
- ② 2015年9月、F R B (米連邦準備理事会) が利上げを先送りしたことから、米国の金融政策に対して不透明感が高まり、リスク回避姿勢が強まったこと

上昇要因

- ① 2015年10月、中国人民銀行が利下げを実施したことなどから、新興国の景気減速に対する過度な懸念が薄らいだこと
- ② 2015年10月、E C B (欧州中央銀行) が12月の理事会で追加的金融緩和に踏み切る可能性を示唆し、市場の支援材料となったこと

## 【投資環境】

### <世界株式市場>

当期の先進国の株式市場は、大きく変動する展開となりました。中国経済の低迷を反映して6月以降中国株式市場が急落し、さらに8月には中国当局が人民元の米ドル基準値の切り下げを発表すると、その余波が新興国の通貨や株式のみならず、先進国の株式や商品価格等にも波及しました。9月にはFRBが予定していた利上げを延期し、米国の金融政策への不透明感が一時強まりましたが、欧州や中国の中央銀行が金融緩和策を拡大する政策対応を打ち出し、新興国の景気減速に対する過度な懸念も薄らいだことから、10月に入って株式市場は反発し、期初からの下げ幅を縮小しました。この結果、先進国の株式市場の動きを表す代表的な株価指数であるMSCIワールド指数は当期3.75%の下落、主要米国企業の株価の動きを表すS&P500指数は同0.88%の上昇となりました（それぞれ米ドルベース）。

### <原油・金市場等>

当期の商品市場では、前期に続き原油価格の下落傾向が続き、原油価格（WTI先物）は前期末の1バレル58ドル台から39ドル台に、30%以上も急落しました。金価格も前期末の1オンス1,176ドル台から1,086ドル台へと大幅に下落しました。

### <為替市場>

当期の為替市場では、デフレ傾向が続く欧州経済に対処するため、ECBが緩和策を拡充するとの期待から、ユーロ/ドルレートは前期末の1ユーロ1.12ドル台から1.08ドル台へと、前期に続きユーロ安が進みました。一方、ドル/円レートは、中国景気に対する不安から世界の株式市場が調整する中、円が買われる局面もあって、前期末の1ドル124円台から123円台へとドル安円高で終わりました。

### <日本短期国債市場>

当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ました。その後も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。11月には日銀による追加金融緩和観測が高まったことから利回りは一時-0.10%まで低下し、当期末の利回りも-0.07%となりました。

## 【ポートフォリオ】

### ■ Aコース（為替ヘッジあり）

当ファンドは、主として米ドル建のルクセンブルク籍の会社型投資信託である「ファースト・イーグル・アムンディ・インターナショナル・ファンド」と円建の国内籍の投資信託である「CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）」に投資しました。世界の株式等への実質的な投資は「ファース

ト・イーグル・アムンディ・インターナショナル・ファンド」を通じて行いました。また、外貨建資産については為替ヘッジを行い為替リスクの低減を図りました。

(アムンディ・ジャパン株式会社)

## ■Bコース（為替ヘッジなし）

当ファンドは、主として米ドル建のルクセンブルク籍の会社型投資信託である「ファースト・イーグル・アムンディ・インターナショナル・ファンド」と円建の国内籍の投資信託である「CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）」に投資しました。世界の株式等への実質的な投資は「ファースト・イーグル・アムンディ・インターナショナル・ファンド」を通じて行いました。

(アムンディ・ジャパン株式会社)

## <ファースト・イーグル・アムンディ・インターナショナル・ファンド>

当期のポートフォリオにおいては、株式の組入比率が前期末の約72%から当期末には約76%に増加し、一方で、現金・短期金融商品の組入比率は約19%から約15%へと低下しました。金関連株式等の組入比率は9%前後でおおむね横ばいとなっています。当期は世界の株式市場の変動性の高まりを利用して、保有する現金の一部を安全マージン（予期せぬ事態が生じて、回復不可能な損失を回避できるよう、十分に割安な水準で投資を行うこと）を確保しながら株式投資に充てることができました。しかし、株式市場の下落が極端なものではなく、比較的すぐに回復する傾向にあったため、現金・短期金融商品の組入比率はなお高い水準にあります。

当期の当ファンドのパフォーマンスについては、国別には米国が最もプラスに寄与し、イタリアがそれに続きました。一方、カナダと英国がマイナスに寄与しました。セクター別では、主に情報技術と生活必需品がプラスに寄与したのに対し、素材やエネルギーが大きくマイナスの寄与となりました。

(ファースト・イーグル)

## <CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）>

当期中、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】

### ■Aコース（為替ヘッジあり）／Bコース（為替ヘッジなし）

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

運用を行います。

## 【今後の運用方針】

### ■Aコース（為替ヘッジあり）

当ファンドは引き続き、主として米ドル建のルクセンブルク籍の会社型投資信託である「ファースト・イーグル・アムンディ・インターナショナル・ファンド」と円建の国内籍の投資信託である「CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）」に投資します。また、外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行い、為替リスクの低減を図ります。

（アムンディ・ジャパン株式会社）

### ■Bコース（為替ヘッジなし）

当ファンドは引き続き、主として米ドル建のルクセンブルク籍の会社型投資信託である「ファースト・イーグル・アムンディ・インターナショナル・ファンド」と円建の国内籍の投資信託である「CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）」に投資します。

（アムンディ・ジャパン株式会社）

## <ファースト・イーグル・アムンディ・インターナショナル・ファンド>

当ファンドは、世界の優良企業を対象に、本源的価値に対し十分に割安な水準で投資をすることにより、長期的に資産を守り購買力を成長させていくことを運用の目的としています。安全マージンを重視し、質の高い事業や希少な資産を有する企業の株式に割安な水準で長期的に投資を行っていくという、当ファンドの運用方針に変更はありません。

当期は、私たちが以前から懸念していた中国経済の脆弱（ぜいじゃく）性が表面化し、世界の株式市場が一時急落するなど、市場のボラティリティ（価格変動性）が上昇しました。市場のボラティリティが上昇すると、優良企業の株価であっても、非常に割安な状態になることがあります。私たちのようなバリュー投資家は、このような優良企業に割安な水準で投資を行うことができます。現在保有する現金（含む短期国債等）や金関連株式等の保有比率は適正であると考えています。引き続き中・長期的に購買力を維持し成長させるために耐久性のあるポートフォリオを構築することを念頭に、今後も市場の変動性が増大する際には、保有する現金や金関連株式等を積極的に活用していく予定です。

（ファースト・イーグル）

## <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国債への投資および債券現先取引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 7 期 (2015年6月6日 ～2015年12月7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)	49円 ( 16) ( 31) ( 2)	0.426% (0.136) (0.273) (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种書類の送付、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 (保 管 費 用) (監 査 費 用) (印 刷)	2 ( 0) ( 1) ( 1)	0.014 (0.000) (0.005) (0.008)	その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の 送金・資産の移転等に要する費用 監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 印刷会社に支払うファンドに係る費用
合 計	51	0.440	

期中の平均基準価額は11,434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。

◆ 売買及び取引の状況 (2015年6月6日から2015年12月7日まで)

投資証券

		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	(ルクセンブルク) ファースト・イーグル・アムンディ・インターナショナル・ファンド	千口	千米ドル	千口	千米ドル
		6	9,950	5	8,669

(注1) 金額は受渡し代金です。

(注2) 単位未満は切捨てです。

◆ 利害関係人との取引状況等 (2015年6月6日から2015年12月7日まで)

(1) 当期中の利害関係人との取引状況

区 分	当 期			期		
	買 付 額 等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売 付 額 等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
投資信託証券	百万円 1,207	百万円 —	% —	百万円 1,061	百万円 —	% —
為替先物取引	26,745	13,176	49.3	26,415	13,296	50.3
為替直物取引	1,233	486	39.4	1,068	282	26.4

# ワールド・バリュー・アロケーション Aコース (為替ヘッジあり)

## (2) 売買委託手数料総額における利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)	一千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	一千円
(B) / (A)	-%

(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あり、当期における当ファンドに係る利害関係人とは、クレディ・アグリコル銀行です。

## ◆組入資産の明細

### (1) 国内(邦貨建)投資信託受益証券

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
C Aマネープールファンド(適格機関投資家専用)	千口	千口	千円
	34,747	34,747	35,015
合 計	口 数・金 額	34,747	35,015
	銘 柄 数 <比 率>	1	<0.3%>

(注1) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

(注2) 単位未満は切捨てです。

### (2) 外国(外貨建)投資証券

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
(ルクセンブルク)	千口	千口	千米ドル	千円
ファースト・イーグル・アムンディ・インターナショナル・ファン	64	65	102,467	12,628,147
合 計	口 数・金 額	64	65	12,628,147
	銘 柄 数 <比 率>	1	1	<97.5%>

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

(注3) 単位未満は切捨てです。

## ◆投資信託財産の構成

(2015年12月7日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投 資 信 託 受 益 証 券	千円 35,015	% 0.3
投 資 証 券	12,628,147	93.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	812,069	6.0
投 資 信 託 財 産 総 額	13,475,231	100.0

(注1) 金額の単位未満は切捨てです。

(注2) 当期末における外貨建純資産(12,628,150千円)の投資信託財産総額(13,475,231千円)に対する比率は93.7%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

なお、2015年12月7日における邦貨換算レートは、1米ドル123.24円です。

◆資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2015年12月7日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	26,021,898,437円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	811,697,405
投 資 信 託 受 益 証 券 (評 価 額)	35,015,293
投 資 証 券 (評 価 額)	12,628,147,361
未 収 入 金	12,547,038,190
未 収 利 息	188
(B) 負 債	13,064,711,475
未 払 金	12,977,679,290
未 払 解 約 金	31,463,178
未 払 信 託 報 酬	53,876,440
そ の 他 未 払 費 用	1,692,567
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	12,957,186,962
元 本	11,177,690,418
次 期 繰 越 損 益 金	1,779,496,544
(D) 受 益 権 総 口 数	11,177,690,418口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D)	11,592円

(注記事項)

期首元本額	10,747,061,435円
期中追加設定元本額	1,584,355,803円
期中一部解約元本額	1,153,726,820円

◆損益の状況

当期 (自2015年6月6日 至2015年12月7日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	17,398円
受 取 利 息	17,398
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△317,611,538
売 買 益	428,226,095
売 買 損	△745,837,633
(C) 信 託 報 酬 等	△55,614,307
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	△373,208,447
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	459,365,811
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	1,693,339,180
(配 当 等 相 当 額)	(1,097,167,080)
(売 買 損 益 相 当 額)	( 596,172,100)
(G) 計 (D + E + F)	1,779,496,544
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)	1,779,496,544
追 加 信 託 差 損 益 金	1,693,339,180
(配 当 等 相 当 額)	(1,097,167,080)
(売 買 損 益 相 当 額)	( 596,172,100)
分 配 準 備 積 立 金	459,365,811
繰 越 損 益 金	△373,208,447

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

◆分配金のお知らせ

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

収益分配金に関する留意事項

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

課税上の取扱いについて

●普通分配金

普通分配金並びに解約時または償還時の差益に対し、所得税15%に2.1%の率を乗じた復興特別所得税が付加され、20.315%（所得税および復興特別所得税15.315%、並びに地方税5%）の税率が適用されます。

※法人の受益者の場合、税率が異なります。

※少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

NISAをご利用の場合、毎年、年間100万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託等から生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。

※税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

【分配原資の内訳】

(単位：円・1万口当たり・税込み)

項 目	第7期
	(2015年6月6日～2015年12月7日)
当期分配金	—
(対基準価額比率)	(—%)
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	1,591

(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。

◆ 1 万口当たりの費用明細

項 目	第 7 期 (2015年6月6日 ～2015年12月7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)	74円 ( 24) ( 47) ( 3)	0.426% (0.136) (0.273) (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种書類の送付、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 (保 管 費 用) (監 査 費 用) (印 刷)	1 ( 0) ( 0) ( 0)	0.004 (0.000) (0.003) (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 海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の 送金・資産の移転等に要する費用 監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 印刷会社に支払うファンドに係る費用
合 計	75	0.430	

期中の平均基準価額は17,291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。

◆ 売買及び取引の状況 (2015年6月6日から2015年12月7日まで)

投資証券

		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	(ルクセンブルク) ファースト・イーグル・アムンディ・インターナショナル・ファンド	千口 33	千米ドル 50,760	千口 9	千米ドル 15,230

(注1) 金額は受渡し代金です。

(注2) 単位未満は切捨てです。

◆ 利害関係人との取引状況等 (2015年6月6日から2015年12月7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。

# ワールド・バリュー・アロケーション Bコース (為替ヘッジなし)

## ◆組入資産の明細

### (1) 国内（邦貨建）投資信託受益証券

銘	柄	期首(前期末)	当 期 末	
		口 数	口 数	評 価 額
		千口	千口	千円
CAマネープールファンド(適格機関投資家専用)		171,687	171,687	173,009
合 計	口 数・金 額 銘 柄 数 <比 率>	171,687 1	171,687 1	173,009 <0.2%>

(注1) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

(注2) 単位未満は切捨てです。

### (2) 外国（外貨建）投資証券

銘	柄	期首(前期末)	当 期 末		
		口 数	口 数	評 価 額	
				外貨建金額	邦貨換算金額
		千口	千口	千米ドル	千円
(ルクセンブルク) ファースト・イーグル・アムンディ・インターナショナル・ファンド		397	421	655,200	80,746,952
合 計	口 数・金 額 銘 柄 数 <比 率>	397 1	421 1	655,200 -	80,746,952 <97.3%>

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

(注3) 単位未満は切捨てです。

## ◆投資信託財産の構成

(2015年12月7日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投 資 信 託 受 益 証 券	千円 173,009	% 0.2
投 資 証 券	80,746,952	96.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	3,035,721	3.6
投 資 信 託 財 産 総 額	83,955,682	100.0

(注1) 金額の単位未満は切捨てです。

(注2) 当期末における外貨建純資産(80,746,959千円)の投資信託財産総額(83,955,682千円)に対する比率は96.2%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

なお、2015年12月7日における邦貨換算レートは、1米ドル123.24円です。

◆資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2015年12月7日現在)

項目	当 期 末
(A) 資 産	83,955,682,683円
コール・ローン等	3,035,720,663
投資信託受益証券(評価額)	173,009,037
投資証券(評価額)	80,746,952,152
未 収 利 息	831
(B) 負 債	976,198,461
未 払 解 約 金	633,208,144
未 払 信 託 報 酬	339,955,255
そ の 他 未 払 費 用	3,035,062
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	82,979,484,222
元 本	46,789,671,439
次 期 繰 越 損 益 金	36,189,812,783
(D) 受 益 権 総 口 数	46,789,671,439口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D)	17,735円

(注記事項)

期首元本額	43,773,457,996円
期中追加設定元本額	8,709,367,421円
期中一部解約元本額	5,693,153,978円

◆損益の状況

当期 (自2015年6月6日 至2015年12月7日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	107,167円
受 取 利 息	107,167
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△2,375,007,041
売 買 益	310,491,259
売 買 損	△2,685,498,300
(C) 信 託 報 酬 等	△343,064,117
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	△2,717,963,991
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	9,980,405,943
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	28,927,370,831
(配 当 等 相 当 額)	(17,640,715,698)
(売 買 損 益 相 当 額)	(11,286,655,133)
(G) 計 (D+E+F)	36,189,812,783
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	36,189,812,783
追 加 信 託 差 損 益 金	28,927,370,831
(配 当 等 相 当 額)	(17,640,715,698)
(売 買 損 益 相 当 額)	(11,286,655,133)
分 配 準 備 積 立 金	9,980,405,943
繰 越 損 益 金	△2,717,963,991

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

◆分配金のお知らせ

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

収益分配金に関する留意事項

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

課税上の取扱いについて

●普通分配金

普通分配金並びに解約時または償還時の差益に対し、所得税15%に2.1%の率を乗じた復興特別所得税が付加され、20.315%（所得税および復興特別所得税15.315%、並びに地方税5%）の税率が適用されます。

※法人の受益者の場合、税率が異なります。

※少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

NISAをご利用の場合、毎年、年間100万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託等から生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。

※税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

【分配原資の内訳】

(単位：円・1万口当たり・税込み)

項 目	第7期
	(2015年6月6日～2015年12月7日)
当期分配金	—
(対基準価額比率)	(—%)
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	7,734

(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。

<1. 補足情報>

「ファースト・イーグル・アムンディ・インターナショナル・ファンド」の決算日（毎年2月末）と当ファンドの決算日が異なっておりますので、以下2015年12月4日現在における「ファースト・イーグル・アムンディ・インターナショナル・ファンド」の補足情報を掲載しております。

◆有価証券明細（評価額上位 30 銘柄）

(1) 株式

(2015年12月4日現在)

銘柄	株数	評価額			
		通貨	現地通貨建金額	米ドル建金額	
アメリカ	MICROSOFT CORP	2,706,588	USD	151,325,335.08	151,325,335.08
	ORACLE CORP	3,824,951	USD	149,785,081.16	149,785,081.16
	COMCAST CLASS A SPECIAL	2,332,647	USD	141,871,590.54	141,871,590.54
	NORTHROP GRUMMAN CORP	622,396	USD	116,979,328.20	116,979,328.20
	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	2,363,759	USD	104,147,221.54	104,147,221.54
日本	KDDI CORP	4,195,300	JPY	12,766,297,900.00	103,694,065.75
アメリカ	3 M	640,527	USD	101,344,181.94	101,344,181.94
	OMNICOM GROUP INC	1,271,398	USD	95,659,985.52	95,659,985.52
日本	SECOM CO LTD	1,341,690	JPY	11,284,954,590.00	91,661,876.64
アメリカ	AMERICAN EXPRESS CO	1,278,181	USD	90,878,669.10	90,878,669.10
	INTEL CORP	2,593,874	USD	90,616,988.19	90,616,988.19
ドイツ	HEIDELBERGCEMENT AG	1,112,708	EUR	80,270,755.12	87,402,811.71
日本	FANUC LTD	469,800	JPY	10,380,231,000.00	84,313,272.67
フランス	DANONE	1,138,747	EUR	71,456,374.25	77,805,273.10
アメリカ	NATIONAL OILWELL VARCO	2,113,279	USD	77,324,878.61	77,324,878.61
	CINTAS CORP	833,083	USD	77,201,801.61	77,201,801.61
日本	NKSJ HOLDINGS	2,369,280	JPY	9,180,960,000.00	74,572,211.72
メキシコ	GRUPO TELEVISIA GDR	2,500,611	USD	72,167,633.46	72,167,633.46
アメリカ	BERKSHIRE HATHAWAY A	347	USD	70,961,500.00	70,961,500.00
日本	KEYENCE CORP	132,410	JPY	8,635,780,200.00	70,143,996.86
スイス	NESTLE SA	906,526	CHF	68,170,755.20	68,192,675.06
ベルギー	GROUPE BRUXELLES LAMBERT	807,031	EUR	61,778,223.05	67,267,218.17
日本	SMC CORP	249,574	JPY	8,193,514,420.00	66,551,699.61
アメリカ	LINEAR TECHNOLOGY CORP	1,454,200	USD	66,442,398.00	66,442,398.00

(2) 公社債

(2015年12月4日現在)

銘柄	利率	額面金額	評価額		償還年月日
			米ドル	米ドル	
アメリカ	USA 0% T BILL 10/12/2015	—	150,000,000	149,999,500.00	2015/12/10
	USA 0% 11/02/2016	—	150,000,000	149,998,562.47	2016/2/11
	UNITED STATES OF AMERICA 0% 17/12/2015	—	150,000,000	149,998,104.17	2015/12/17
	USA 0% 18/02/2016	—	150,000,000	149,966,750.00	2016/2/18

(3) 投資証券

(2015年12月4日現在)

銘柄	口数	評価額			
		通貨	現地通貨建金額	米ドル建金額	
ジャージー	ETFS PHYSICAL GOLD LTD 0% PERPETUAL	2,000,694	USD	210,392,981.04	210,392,981.04
	DB PHYSICAL GOLD ETC	1,692,134	USD	181,075,259.34	181,075,259.34

(注) 通貨欄の表記は以下の通りです。

USD (米ドル)、JPY (日本円)、EUR (ユーロ)、CHF (スイスフラン)

## <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（2015年2月16日）と当ファンドの決算日が異なっておりますので、以下2015年12月7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）」の補足情報を記載しております。

### ◆主要な売買銘柄（2015年2月17日から2015年12月7日まで）

公社債

買		付		売		付	
銘柄	柄	金額	額	銘柄	柄	金額	額
			千円				千円
第336回利付国債（2年）		1,000,542					
第521回国庫短期証券		999,965					
第522回国庫短期証券		999,965					
第525回国庫短期証券		999,980					
第567回国庫短期証券		1,000,000					
第568回国庫短期証券		1,000,013					

（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）社債券には新株予約権付社債（転換社債）は含まれておりません。

### ◆組入資産の明細

公社債

(A) 公社債種類別

国内（邦貨建）公社債

区分	2015年12月7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
国債証券	千円 3,000,000	千円 3,000,318	% 66.4	% —	% —	% —	% 66.4
合計	3,000,000	3,000,318	66.4	—	—	—	66.4

（注1）組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

（注2）単位未満は切捨てです。

（注3）—印は組入れなしです。

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

(B) 公社債銘柄別

国内（邦貨建）公社債

(2015年12月7日現在)

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336回利付国債（2年）	0.1	1,000,000	1,000,130	2016/1/15
	第567回国庫短期証券	—	1,000,000	1,000,073	2016/2/8
	第568回国庫短期証券	—	1,000,000	1,000,115	2016/2/15
合計			3,000,000	3,000,318	

（注）額面・評価額の単位未満は切捨てです。

## ファースト・イーグル・アムンディ・インターナショナル・ファンド

決算日 2015年2月28日

(計算期間：2015年3月1日～2015年2月28日)

「ファースト・イーグル・アムンディ・インターナショナル・ファンド」は毎年2月末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2月28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ため、「ファースト・イーグル・アムンディ・インターナショナル・ファンド」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。

ファンドの形態	ルクセンブルク籍／オープンエンド／会社型投資信託（米ドル建）
投資方針	全ての資産カテゴリーにダイナミックに分散投資することによって資産の成長を目指します。時価総額、地理的分散またはポートフォリオの状況に制約を受けることなく、主として世界の株式および債券に投資します。
収益分配方針	キャピタルゲイン、インカムゲイン等は資本化し、原則として分配を行いません。
運用管理費用（信託報酬）	年率1.0%
成功報酬（パフォーマンス・フィー）	成功報酬算定期間（毎年9月1日から翌年8月31日まで）において、基準価額（当該日の成功報酬計算前）の収益率が、3カ月米ドルLibor+4%（年率）を上回った場合に、当該超過分に対して15%の成功報酬がかかります。成功報酬は、日々計上（再計算）されます（値下がりの場合は戻し入れされます）。
その他の費用	ルクセンブルクの年次税（年率0.01%）の他、管理、受託、監査費用、有価証券売買委託手数料、その他ファンドの運営に必要な各種経費等がかかります。
投資顧問会社	ファースト イーグル インベストメント マネジメント
管理会社	アムンディ・ルクセンブルク
保管会社	ソシエテ ジェネラル バンク&トラスト

## ■費用の明細

(計算期間 2014年3月1日～2015年2月28日)

項目	当期
	米ドル
(a) 運用報酬	122,077,589
(b) 成功報酬	13,056,945
(c) 管理費用等	9,707,428
(d) その他の費用	12,238,648
合計	157,080,610

## ■純資産計算書

2015年2月28日現在

項目	当期末
	米ドル
<b>資産合計</b>	7,809,851,694
有価証券	7,690,424,032
預金	63,487,774
有価証券売却未収入金	865,741
未収利息(債券)	454,993
未収配当	7,738,091
未収利息(預金)	193,090
未収追加設定金	36,066,502
為替予約取引評価勘定	10,621,471
<b>負債合計</b>	67,719,254
借入金	19,988,396
未払利息	3,600
未払解約金	15,034,786
有価証券買付未払金	7,269,029
未払運用報酬	20,550,463
未払成功報酬	685,493
未払管理費用等	794,601
未払販売手数料	898,477
追加設定に係る未払税	426,656
その他の負債	2,067,753
<b>純資産</b>	7,742,132,440



ファースト・イーグル・アムンディ・インターナショナル・ファンド

銘柄		株数	現地通貨	米ドル換算評価額
スウェーデン	INVESTOR A	453,493	SEK	17,670,504.47
	INVESTOR B	993,404	SEK	39,506,301.65
タイ	BANGKOK BANK (NVDR)	5,183,090	THB	29,338,240.81
デンマーク	ISS	468,915	DKK	14,660,274.99
ドイツ	DAIMLER	170,721	EUR	16,565,731.53
	FRAPORT	51,791	EUR	3,134,610.60
日本	HEIDELBERGCEMENT AG	1,310,809	EUR	104,580,227.90
	HORNBAACH HOLDING AG NON VTG PR	81,539	EUR	6,884,060.17
	ASTELLAS PHARMA INC	5,014,400	JPY	79,738,796.10
	CHOFU SEISAKUSHO	185,960	JPY	4,822,251.02
	FAMILYMART	51,000	JPY	2,303,734.99
	FANUC LTD	551,900	JPY	105,929,528.40
	HIROSE ELECTRIC	303,450	JPY	39,877,865.99
	HOYA CORP	2,284,210	JPY	92,241,614.05
	KDDI CORP	1,608,900	JPY	111,571,215.60
	KEYENCE CORP	171,310	JPY	87,557,329.69
	MINITUBISHI ESTATE CO LTD	2,149,190	JPY	50,221,776.34
	MS AD ASSURANCE	2,500,625	JPY	69,091,675.58
	NISSAN FOOD PRODUCTS CO LTD	511,730	JPY	25,384,239.35
	NITORI	80,200	JPY	5,313,346.43
	NKSJ HOLDINGS	2,518,980	JPY	78,427,734.66
	NOMURA RESEARCH	528,520	JPY	18,502,289.48
	SECOM CO LTD	1,873,190	JPY	116,689,496.90
SECOM JOSHINETSU	218,397	JPY	5,827,817.38	
SHIMANO	552,490	JPY	83,188,924.50	
SHIN-ETSU CHEMICAL CO LTD	105,400	JPY	7,232,391.13	
SMC CORP	287,774	JPY	80,101,048.39	

銘柄		株数	現地通貨	米ドル換算評価額
ノルウェー	T. HASEGAWA	350,609	JPY	5,109,045.77
	ORKLA ASA	310,060	NOK	2,446,270.49
バミューダ	GUOCO GRP	745,690	HKD	9,057,372.81
	JARDINE MATHESON HOLDINGS	833,540	USD	53,763,330.00
フランス	BOUYGUES	2,024,558	EUR	80,456,055.38
	CARREFOUR SA	1,873,692	EUR	62,134,591.37
	COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN SA	1,273,164	EUR	57,457,366.46
	DANONE	1,102,468	EUR	77,076,232.86
	GAUMONT	14,973	EUR	621,395.22
	LEGRAND	224,097	EUR	12,417,104.96
	NEOPOST	249,804	EUR	13,505,286.05
	NSC GROUPE	2,815	EUR	202,013.32
	REXEL	412,063	EUR	8,069,845.50
	ROBERTET S. A.	18,700	EUR	3,460,851.08
	SANOFI	758,086	EUR	74,571,938.10
	SODEXO	405,474	EUR	40,959,280.08
	TOTAL	1,117,053	EUR	60,435,681.37
	VIVENDI	1,675,263	EUR	40,991,666.50
WEINDEL ACT	140,560	EUR	17,161,195.65	
ベルギー	GROUPE BRUXELLES LAMBERT	845,858	EUR	74,202,255.70
香港	HYSAN DEVELOPMENT CO	2,612,705	HKD	12,532,171.76
南アフリカ	ANGLOGOLD ASHANTI-SPON ADR	2,913,675	USD	32,837,117.25
	GOLD FIELDS ADR	5,165,383	USD	24,019,030.95
メキシコ	GRUPO TELEVISIA GDR	2,639,412	USD	90,056,737.44
ルクセンブルク	INDUSTRIAS PENOLES SA DE CV	728,966	MXN	15,490,003.75
	GAZPROM OAO-SPON ADR REG	2,561,698	USD	12,782,873.02

(2) 公社債

(2015年2月28日現在)

銘柄		通貨	額面金額	米ドル換算評価額
アメリカ	USA 0% 02/04/2015	USD	150,000,000	149,995,750.00
	USA 0% 09/04/2015	USD	150,000,000	149,996,583.33
	USA 0% 12/03/2015	USD	150,000,000	149,998,916.67
	USA 0% 16/04/15	USD	150,000,000	149,995,000.00
	USA 0% 21/05/2015	USD	150,000,000	149,996,541.65
	USA 0% 23/04/2015	USD	150,000,000	149,995,416.67
	USA T-BILLS 26/03/15	USD	150,000,000	149,998,875.00
	USA ZCP 11/06/2015	USD	150,000,000	149,993,499.99
シンガポール	SINGAPORE GOVERNMENT 01/04/2018	SGD	23,689,000	17,087,059.24
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.375% 01/04/2017	SGD	20,131,000	15,362,465.27
	SINGAPORE GOVERNMENT 3.25% 01/09/2020	SGD	9,754,000	7,803,162.99
メキシコ	MEXICAN BONOS 4.75% 14/06/2018	MXP	1,337,000	9,053,325.68
	MEXICAN BONOS DESARR FIX RT 5% 11/12/2019	MXP	1,158,904	7,808,524.60

## (3) ワラント

銘柄		証券数	現地通貨	米ドル換算評価額
アメリカ	JP MORGAN CHASE WRT 28/10/2018	909,507	USD	19,163,312.49

## (4) 投資証券

銘柄		口数	現地通貨	米ドル換算評価額
ジャージー	DB PHYSICAL GOLD ETC	1,742,118	USD	209,210,950.60
	ETFS PHYSICAL GOLD LTD 0% PERPETUAL	1,563,972	USD	184,587,795.30

(注) 通貨欄の表記は以下の通りです。

GBP(英ポンド)、USD(米ドル)、ILS(イスラエルシェケル)、EUR(ユーロ)、AUD(オーストラリアドル)、CAD(カナダドル)、KRW(韓国ウォン)、HKD(香港ドル)、SGD(シンガポールドル)、CHF(スイスフラン)、SEK(スウェーデンクローナ)、THB(タイバーツ)、JPY(日本円)、MXN(メキシコペソ)、NOK(ノルウェメキシコペソ)、NOK(ノルウェークローネ)、DKK(デンマーククローネ)

# 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8期》

決算日：2015年2月16日

（計算期間：2014年2月18日～2015年2月16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	税 込 分 配 金		騰 落 率	債 券 組 入 率 比	純 資 産 額
		円	円			
4期（2011年2月15日）	10,063	0	0.0	87.6	798	
5期（2012年2月15日）	10,068	0	0.0	84.3	1,007	
6期（2013年2月15日）	10,072	0	0.0	77.0	1,882	
7期（2014年2月17日）	10,076	0	0.0	79.5	3,458	
8期（2015年2月16日）	10,077	0	0.0	79.2	5,683	

（注）当ファンドは安定した収益の確保を目指すファンドであり、ベンチマークおよび参考指数はございません。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 比
（期 首） 2014年2月17日	10,076	—	79.5
2月末	10,076	0.0	75.4
3月末	10,076	0.0	74.7
4月末	10,076	0.0	75.3
5月末	10,076	0.0	70.7
6月末	10,076	0.0	70.0
7月末	10,077	0.0	88.2
8月末	10,077	0.0	77.4
9月末	10,077	0.0	59.3
10月末	10,077	0.0	78.4
11月末	10,077	0.0	81.2
12月末	10,077	0.0	79.3
2015年1月末	10,077	0.0	79.2
（期 末） 2015年2月16日	10,077	0.0	79.2

（注）騰落率は期首比です。

## ■ 1万口当たりの費用明細

項 目	第 8 期 (2014年2月18日 ～2015年2月16日)		項 目 の 概 要
	金額	比率	
信 託 報 酬 (投 信 会 社) (販 売 会 社)	2円 (2)	0.024% (0.020)	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
(受 託 会 社)	(0)	(0.001)	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
(受 託 会 社)	(0)	(0.003)	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10,076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（2014年2月18日から2015年2月16日まで）  
公社債

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国 内	国 債 証 券	179,106,176	170,007,187 (7,350,000)

- (注1) 金額は受渡し代金です。経過利子分は含まれておりません。  
(注2) 単位未満は切捨てです。  
(注3) ( )内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

■ 主要な売買銘柄（2014年2月18日から2015年2月16日まで）  
公社債

買		付		売		付	
銘	柄	金	額	銘	柄	金	額
		千円				千円	
第492回	国庫短期証券	999,960					
第464回	国庫短期証券	999,890					
第457回	国庫短期証券	999,830					
第451回	国庫短期証券	699,867					
第443回	国庫短期証券	499,885					
第435回	国庫短期証券	399,932					

- (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（2014年2月18日から2015年2月16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。

C A マネープールファンド（適格機関投資家専用）

■組入資産の明細

公社債

(A) 公社債種類別

国内（邦貨建）公社債

2015年2月16日現在

区 分	当 期			末				
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	う ち B B 格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率	5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
	千円	千円	%	%	%	%	%	%
国 債 証 券	4,500,000	4,500,045	79.2	—	—	—	—	79.2
合 計	4,500,000	4,500,045	79.2	—	—	—	—	79.2

(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

2015年2月16日現在

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498回国庫短期証券※	—	4,500,000	4,500,045	—
合 計			4,500,000	4,500,045	

(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

2015年2月16日現在

項 目	当 期		末	
	評 価 額	比 率	評 価 額	比 率
	千円	%	千円	%
公 社 債	4,500,045	79.2		
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,184,051	20.8		
投 資 信 託 財 産 総 額	5,684,096	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

2015年2月16日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	5,684,096,609円
コール・ローン等	1,184,051,285
公社債(評価額)	4,500,045,000
未 収 利 息	324
(B) 負 債	1,033,707
未 払 信 託 報 酬	1,033,707
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	5,683,062,902
元 本	5,639,658,154
次 期 繰 越 損 益 金	43,404,748
(D) 受 益 権 総 口 数	5,639,658,154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	3,432,509,342円
期中追加設定元本額	2,967,255,880円
期中一部解約元本額	760,107,068円

## ■損益の状況

当期 自2014年2月18日 至2015年2月16日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	626,781円
受 取 利 息	626,781
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	916,937
売 買 益	968,729
売 買 損	△ 51,792
(C) 信 託 報 酬 等	△1,033,707
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	510,011
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	1,261,479
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	41,633,258
(配 当 等 相 当 額)	(28,071,711)
(売 買 損 益 相 当 額)	(13,561,547)
(G) 計 (D + E + F)	43,404,748
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)	43,404,748
追 加 信 託 差 損 益 金	41,633,258
(配 当 等 相 当 額)	(28,071,711)
(売 買 損 益 相 当 額)	(13,561,547)
分 配 準 備 積 立 金	1,771,490

(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。