

■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マネーブルファンド(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・バリュー・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マネーブルファンド(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。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・バリュー・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14期(決算日 2019年6月5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、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 : <https://www.amundi.co.jp/>

■最近5期の運用実績

決算期	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	純資産 総額
	(分配落)	税金 込み 分配 金				
	円	円	%	%	%	百万円
10期 (2017年6月5日)	12,617	80	6.4	0.1	95.7	15,919
11期 (2017年12月5日)	12,868	80	2.6	0.1	100.0	15,645
12期 (2018年6月5日)	12,829	0	△0.3	0.1	101.3	15,640
13期 (2018年12月5日)	11,971	0	△6.7	0.1	100.2	13,185
14期 (2019年6月5日)	12,099	80	1.7	0.1	95.4	11,967

(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		騰落率	投資信託 受益証券 組入比率	投資証券 組入比率
	円	%			
(期首) 2018年12月5日	11,971	—		0.1	100.2
12月末	11,337	△5.3		0.1	96.3
2019年1月末	12,091	1.0		0.1	94.7
2月末	12,432	3.9		0.1	96.8
3月末	12,366	3.3		0.1	97.9
4月末	12,522	4.6		0.1	97.6
5月末	12,051	0.7		0.1	96.0
(期末) 2019年6月5日	12,179	1.7		0.1	95.4

(注) 期末基準価額は分配金込み、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		騰落率	投資信託 受益証券 組入比率	投資証券 組入比率	純資産 総額
	(分配落)	税金 込み 分配 金				
	円	円	%	%	%	百万円
10期 (2017年6月5日)	17,825	150	4.4	0.1	98.1	70,544
11期 (2017年12月5日)	18,593	150	5.2	0.1	97.3	65,947
12期 (2018年6月5日)	18,330	0	△1.4	0.1	97.2	60,726
13期 (2018年12月5日)	17,795	0	△2.9	0.1	97.2	52,684
14期 (2019年6月5日)	17,638	0	△0.9	0.1	96.7	49,363

(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

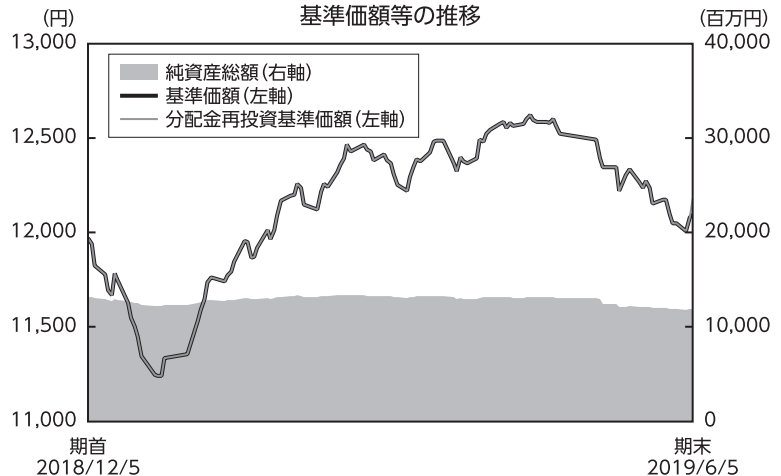
年月日	基準価額		投資信託 受益証券 組入比率	投資証券 組入比率
		騰落率		
(期首)	円	%	%	%
2018年12月5日	17,795	—	0.1	97.2
12月末	16,626	△6.6	0.1	97.5
2019年1月末	17,485	△1.7	0.1	97.5
2月末	18,323	3.0	0.1	98.3
3月末	18,278	2.7	0.1	97.5
4月末	18,679	5.0	0.1	97.4
5月末	17,636	△0.9	0.1	97.0
(期末)				
2019年6月5日	17,638	△0.9	0.1	96.7

(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14期首	11,971円
第14期末	12,099円
既払分配金 (税込み)	80円
騰落率	1.7% (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様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客様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、2018年12月5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 2019年1月に米国の利上げ停止観測などを背景に世界経済に対する過度な減速懸念が後退し、株式市場が上昇したこと
- ② 2019年4月に米中貿易交渉に関して楽観的な見方が強まったことなどを背景に株式市場が上昇したこと

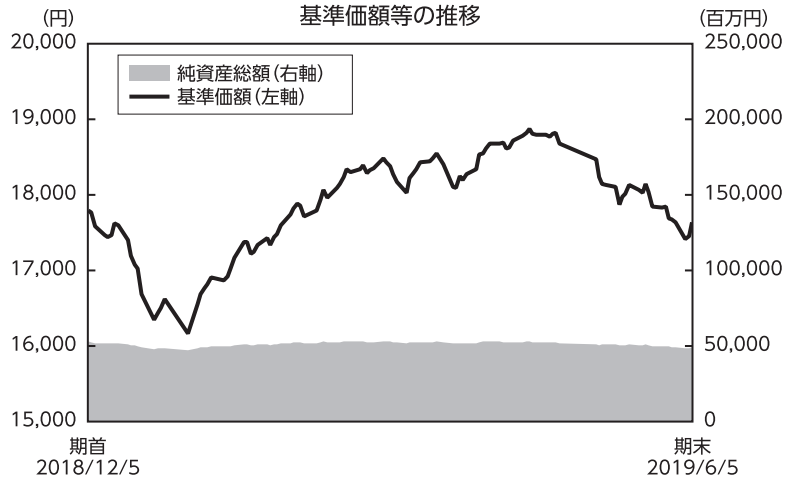
下落要因

- ① 2018年12月に米中通商交渉への不安が再燃したことなどから投資家のリスク回避姿勢が強まり、株式市場が下落したこと
- ② 2019年5月に米中貿易摩擦激化への懸念から株式市場が下落したこと

■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14期首	17,795円
第14期末	17,638円
既払分配金 (税込み)	0円
騰落率	△0.9%



【基準価額の主な変動要因】

下落要因

- ① 2018年12月に米中通商交渉への不安が再燃したことなどから投資家のリスク回避姿勢が強まり、株式市場が下落したこと
- ② 2019年5月に米中貿易摩擦激化への懸念から株式市場が下落したこと
- ③ 為替市場において、当期は米ドル安・円高となったこと

上昇要因

- ① 2019年1月に米国の利上げ停止観測などを背景に世界経済に対する過度な減速懸念が後退し、株式市場が上昇したこと
- ② 2019年4月に米中貿易交渉に関して楽観的な見方が強まったことなどを背景に株式市場が上昇したこと

【投資環境】**<世界株式市場>**

当期の株式市場では、2018年12月は米中通商交渉への不安が再燃したこと、英国でEU（欧州連合）離脱協定案の議会採決が延期となり、合意なき離脱への警戒感が高まったこと、FOMC（米連邦公開市場委員会）後のパウエルFRB（米連邦準備理事会）議長の会見内容が市場の期待ほどハト派的ではなかったことなどから投資家のリスク回避姿勢が強まり、大きく下落しました。2019年1月以降は米中通商協議進展への期待感や米国の利上げ停止観測などを背景に世界経済に対する過度な減速懸念が後退し、リスク資産に対する買い安心感が広がって世界株式は4月まで上昇基調で推移しました。5月は米国が中国からの輸入品に対して追加関税引き上げを表明したことや、中国の大手通信機器メーカーを事実上の輸出規制対象としたこと、それに対して中国が対米報復関税を発表したことで米中貿易摩擦激化を懸念した動きとなり下落しました。このような環境下、当期の世界の先進国の主要株式の動きを示すMSCIワールド指数（配当込み）は4.2%（米ドルベース）の上昇となりました。

<原油・金市場等>

当期の商品市場では、原油価格（WTI先物）は、2019年1月以降主要産油国による協調減産やイラン制裁などから上昇基調で推移した後、5月は米中貿易摩擦への懸念から下落し、前期末並みの水準で着地しました。金価格は、当期末から2019年2月にかけては株式の乱高下や米国での利上げ観測が後退したことなどから上昇基調で推移しましたが、その後は一進一退で推移し、当期末の金価格は前期末比で上昇しました。

<為替市場>

当期の為替市場では、期初から2019年1月にかけては米国経済指標の弱さや、世界株式市場の急落、米政府機関の一部閉鎖などにより、米ドル安・円高が進行しました。その後、米中通商交渉の進展期待や米製造業景況感の持ち直しなどにより米ドル高・円安基調で推移したものの、5月に入ると、米政権が再び対中関税引き上げを表明し、中国も報復措置を採ったことから米中摩擦激化が不安視されたことが米ドル売りを促し、当期末の米ドル/円レートは前期末に比べ米ドル安・円高となりました。

<日本短期国債市場>

当期の短期国債市場では、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-0.23%前後の水準で始まりました。その後、海外投資家によるTDBへの買い需要が後退したことで利回りは上昇し、-0.16%前後で当期末を迎えました。

【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・ファンドの基準価額は3.9%の上昇（米ドルベース）となりました。基準価額への貢献度をみますと、国別では米国、日本のプラス貢献が相対的に高くなりました。セクター別では、金融、一般消費財・サービスがプラスに貢献した反面、エネルギーはパフォーマンスの重しとなりました。金関連資産はパフォーマンスにプラスに貢献しました。当期は、2019年1月以降に株式市場全体が上昇するなか、個別銘柄単位で株価が想定する本源的価値を反映していると判断した銘柄を売却しました。

(ファースト イーグル インベストメント マネジメント)

<CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）>

当期、主として12ヵ月以内に償還を迎える地方債への投資により、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】

■Aコース（為替ヘッジあり）

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（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。

■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いては後記の「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>

私たちは、最も深刻な投資のリスクは投資元本の永続的な毀損であり、そのリスクの主たる源泉は割高な証券への投資であると考えます。私たちは、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することを重視し、個別銘柄の株価が私たちの考える本源的価値を十分に下回る場合にのみ、投資します。十分に割安と判断できる投資機会に限られる局面では、無理に投資せずに現金等を保持します。現金等は個別銘柄単位で十分に割安と判断できる投資機会を特定した段階で、投資資金に充当するものと位置付けています。また、予期せぬリスクに対するヘッジ手段、および中長期的に資産の実質的価値の維持を目指す手段として、金関連資産を一定比率保有し続ける方針です。

私たちは引き続き、短期的な市場動向や市場予測に頼るのではなく、ボトムアップによる銘柄選択を通じて、競争力を持続できるような質の高い事業や希少な資産を有すると考えられる企業に分散投資することで、米ドルベースで相場環境にかかわらずプラスのリターンを追求し、投資信託財産の長期的な成長を目指した運用を継続する方針です。

（ファースト イーグル インベストメント マネジメント）

<CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）>

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

（アムンディ・ジャパン株式会社）

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	第 14 期 (2018年12月6日 ～2019年6月5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)	51円 (16) (33) (2)	0.420% (0.135) (0.269) (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 (保 管 費 用) (監 査 費 用) (印 刷 費 用) (そ の 他) 合 計	1 (0) (1) (0) (0) 52	0.010 (0.000) (0.005) (0.004) (0.001) 0.430	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 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

期中の平均基準価額は12,133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。

■ 売買及び取引の状況 (2018年12月6日から2019年6月5日まで)

投資信託受益証券、投資証券

		買 付		売 付	
		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
外国	(ルクセンブルク)	千口	千米ドル	千口	千米ドル
	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	—	—	8	16,000

(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 (2018年12月6日から2019年6月5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 (2019年6月5日現在)

(1) 国内(邦貨建)投資信託受益証券

銘柄	期首 (前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
CAマネープールファンド(適格機関投資家専用)	千口 9,936	千口 9,936	千円 9,988
合 計	口 数・金 額 9,936	口 数 9,936	評 価 額 9,988
	銘 柄 数 <比 率>	1	<0.1%>

(注1) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。以下同じ。

(注2) 単位未満は切捨てです。以下同じ。

(2) 外国(外貨建)投資証券

銘柄	期首 (前期末)	当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
(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 65	千口 56	千米ドル 105,552	千円 11,413,360
合 計	口 数・金 額 65	口 数 56	105,552	11,413,360
	銘 柄 数 <比 率>	1	1	<95.4%>

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

■投資信託財産の構成 (2019年6月5日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投 資 信 託 受 益 証 券	千円 9,988	% 0.1
投 資 証 券	11,413,360	94.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	695,285	5.7
投 資 信 託 財 産 総 額	12,118,633	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(11,413,653千円)の投資信託財産総額(12,118,633千円)に対する比率は94.2%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、2019年6月5日現在における邦貨換算レートは、1米ドル108.13円です。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2019年6月5日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	23,507,103,077円
コール・ローン等	411,634,554
投資信託受益証券(評価額)	9,988,965
投資証券(評価額)	11,413,360,638
未 収 入 金	11,672,118,920
(B) 負 債	11,539,317,217
未 払 金	11,388,470,000
未 払 収 益 分 配 金	79,130,111
未 払 解 約 金	16,451,276
未 払 信 託 報 酬	54,109,634
未 払 利 息	1,014
そ の 他 未 払 費 用	1,155,182
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	11,967,785,860
元 本	9,891,263,929
次 期 繰 越 損 益 金	2,076,521,931
(D) 受 益 権 総 口 数	9,891,263,929口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	12,099円

(注記事項)

期首元本額	11,014,567,925円
期中追加設定元本額	591,049,114円
期中一部解約元本額	1,714,353,110円

■損益の状況

当期 (自2018年12月6日 至2019年6月5日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 3,611円
受 取 利 息	121,720
支 払 利 息	△ 125,331
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	247,678,377
売 買 益	827,511,360
売 買 損	△ 579,832,983
(C) 信 託 報 酬 等	△ 55,349,564
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	192,325,202
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	1,444,301
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	1,961,882,539
(配 当 等 相 当 額)	(1,447,473,701)
(売 買 損 益 相 当 額)	(514,408,838)
(G) 計 (D+E+F)	2,155,652,042
(H) 収 益 分 配 金	△ 79,130,111
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	2,076,521,931
追 加 信 託 差 損 益 金	1,961,882,539
(配 当 等 相 当 額)	(1,447,473,701)
(売 買 損 益 相 当 額)	(514,408,838)
分 配 準 備 積 立 金	745,503,709
繰 越 損 益 金	△ 630,864,317

(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。

分配金の計算過程

計算期間末における費用控除後の配当等収益(0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(1,447,473,701円)および分配準備積立金(824,633,820円)より分配対象収益は2,272,107,521円(1万口当たり2,297円)であり、うち79,130,111円(1万口当たり80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14期
1 万口当たりの分配金 (税込み)	80円

◇分配金をお支払いする場合

分配金は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います。

◇分配金を再投資する場合

お手取り分配金は、決算日現在の基準価額に基づいて、みなさまの口座に繰り入れて再投資いたしました。

収益分配金に関する留意事項

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

【分配原資の内訳】

(単位：円・1万口当たり・税込み)

項 目	第14期
	(2018年12月6日～2019年6月5日)
当期分配金	80
(対基準価額比率)	(0.657%)
当期の収益	—
当期の収益以外	80
翌期繰越分配対象額	2,217

(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 14 期 (2018年12月6日 ～2019年6月5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)	75円 (24) (48) (3)	0.420% (0.135) (0.269) (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 (保 管 費 用) (監 査 費 用) (印 刷 費 用) (そ の 他) 合 計	1 (0) (1) (0) (0) 76	0.005 (0.000) (0.003) (0.001) (0.001) 0.425	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 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

期中の平均基準価額は17,837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。

■ 売買及び取引の状況 (2018年12月6日から2019年6月5日まで)

投資信託受益証券、投資証券

		買 付		売 付	
		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
外国	(ルクセンブルク)	千口	千米ドル	千口	千米ドル
	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	2	5,000	18	35,000

- (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 (2018年12月6日から2019年6月5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 (2019年6月5日現在)

(1) 国内 (邦貨建) 投資信託受益証券

銘	柄	期首 (前期末)	当 期 末	
		口 数	口 数	評 価 額
		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)		72,441	72,441	72,825
合 計	口 数・金 額	72,441	72,441	72,825
	銘 柄 数 <比 率>	1	1	<0.1%>

(注1) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。以下同じ。

(注2) 単位未満は切捨てです。以下同じ。

(2) 外国 (外貨建) 投資証券

銘	柄	期首 (前期末)	当 期 末		
		口 数	口 数	評 価 額	
				外貨建金額	邦貨換算金額
		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		253	237	441,347	47,722,880
合 計	口 数・金 額	253	237	441,347	47,722,880
	銘 柄 数 <比 率>	1	1	—	<96.7%>

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

■投資信託財産の構成 (2019年6月5日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投 資 信 託 受 益 証 券	72,825	0.1
投 資 証 券	47,722,880	96.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,887,571	3.8
投 資 信 託 財 産 総 額	49,683,276	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 (47,724,076千円) の投資信託財産総額 (49,683,276千円) に対する比率は96.1%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、2019年6月5日現在における邦貨換算レートは、1米ドル108.13円です。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2019年6月5日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	49,683,276,458円
コール・ローン等	1,887,570,390
投資信託受益証券(評価額)	72,825,252
投 資 証 券(評価額)	47,722,880,816
(B) 負 債	319,957,229
未 払 解 約 金	102,628,790
未 払 信 託 報 酬	215,328,959
未 払 利 息	4,651
そ の 他 未 払 費 用	1,994,829
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	49,363,319,229
元 本	27,986,324,369
次 期 繰 越 損 益 金	21,376,994,860
(D) 受 益 権 総 口 数	27,986,324,369口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D)	17,638円

(注記事項)

期首元本額	29,605,320,053円
期中追加設定元本額	1,664,522,215円
期中一部解約元本額	3,283,517,899円

■損益の状況

当期 (自2018年12月6日 至2019年6月5日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	45,610円
受 取 利 息	528,339
支 払 利 息	△ 482,729
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 251,314,285
売 買 益	1,940,050,512
売 買 損	△ 2,191,364,797
(C) 信 託 報 酬 等	△ 217,627,465
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	△ 468,896,140
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	3,141,068,258
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	18,704,822,742
(配 当 等 相 当 額)	(13,037,184,385)
(売 買 損 益 相 当 額)	(5,667,638,357)
(G) 計 (D+E+F)	21,376,994,860
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	21,376,994,860
追 加 信 託 差 損 益 金	18,704,822,742
(配 当 等 相 当 額)	(13,037,184,385)
(売 買 損 益 相 当 額)	(5,667,638,357)
分 配 準 備 積 立 金	5,152,556,684
繰 越 損 益 金	△ 2,480,384,566

(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)信託報酬には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

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

■分配金のお知らせ

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

収益分配金に関する留意事項

- 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。
- 分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。
- また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。
- 投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり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14期
	(2018年12月6日～2019年6月5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	7,638

(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いますので、以下2019年6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います。

■有価証券明細（評価額上位30銘柄）（2019年6月4日現在）

(1) 株式

	銘柄	通貨	株数	米ドル換算評価額
アメリカ	ORACLE CORP	USD	3,645,689	189,648,741.78
	COMCAST CLASS A	USD	4,036,368	167,105,635.20
	EXXON MOBIL CORP	USD	2,084,730	153,415,280.70
日本	FANUC LTD	JPY	774,000	130,447,017.84
キュラソー	SCHLUMBERGER LTD	USD	3,417,894	122,121,352.62
イギリス	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	GBP	3,215,141	115,645,150.16
フランス	DANONE	EUR	1,423,461	114,838,294.10
日本	KDDI CORP	JPY	4,414,500	111,223,463.26
アメリカ	WEYERHAEUSER CO REIT	USD	4,734,858	110,890,374.36
日本	SOMPO HOLDINGS SHS	JPY	2,779,080	106,478,151.40
アメリカ	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC	USD	1,279,277	100,423,244.50
日本	MITSUBISHI ESTATE CO LTD REIT	JPY	5,255,690	98,475,944.25
カナダ	NUTRIEN LTD	CAD	1,839,537	93,996,067.75
アメリカ	COLGATE PALMOLIVE CO	USD	1,322,492	93,658,883.44
	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	USD	2,072,312	91,782,698.48
スイス	NESTLE SA	CHF	919,201	91,779,144.60
日本	SECOM CO LTD	JPY	1,102,290	91,529,293.02
ベルギー	GROUPE BRUXELLES LAMBERT	EUR	957,224	90,428,501.38
バミューダ諸島	JARDINE MATHESON HOLDINGS	USD	1,245,740	81,209,790.60
アメリカ	DEERE & CO	USD	539,583	78,574,076.46
	NATIONAL OILWELL VARCO	USD	3,432,983	73,191,197.56
	3 M	USD	439,983	72,284,807.07
	OMNICOM GROUP INC	USD	924,123	72,109,317.69

(2) 債券

	銘柄	通貨	額面金額	米ドル換算評価額
アメリカ	USA 0% 13/06/2019	USD	150,000,000	149,911,125.00
	USA 0% 20/06/2019	USD	150,000,000	149,843,333.33
	USA 0% 27/06/2019	USD	150,000,000	149,773,833.33
	USA 0% 11/07/2019	USD	150,000,000	149,638,479.16
	USA 0% 05/09/2019	USD	150,000,000	149,120,375.00

(3) 投資証券

	銘柄	通貨	口数	米ドル換算評価額
ジャージー	ETFS METAL SECURITIES LTD	USD	4,695,524	591,542,113.52
	DB PHYSICAL GOLD ETC	USD	1,125,097	144,844,987.78

(注) 通貨欄の表記は以下の通りです。

USD (米ドル)、JPY (日本円)、GBP (英ポンド)、EUR (ユーロ)、CAD (カナダドル)、CHF (スイスフラン)

<2. 補足情報>

「C A マネープールファンド（適格機関投資家専用）」の決算日（2019年2月15日）と当ファンドの決算日が異なっていますので、以下2019年6月5日現在における「C A 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います。

■主要な売買銘柄（2019年2月16日から2019年6月5日まで）

公社債

買		付		売		付	
銘柄	柄	金	額	銘柄	柄	金	額
			千円				千円
平成22年度第1回北海道公募公債			203,255	—			—

（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（2019年6月5日現在）

公社債

(A) 債券種類別開示

国内（邦貨建）公社債

区 分	2019 年 6 月 5 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	%	%	%	%	%
地 方 債 証 券	500,000	502,675	65.2	—	—	—	65.2
合 計	500,000	502,675	65.2	—	—	—	65.2

（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) 個別銘柄開示

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	平成22年度第1回北海道公募公債	1.47	200,000	202,642	2020/4/30
	平成26年度第1回福岡市公募公債（5年）	0.209	300,000	300,033	2019/6/26
合 計			500,000	502,675	

（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 2019年2月28日

(計算期間：2018年3月1日～2019年2月28日)

■投資対象ファンドの概要

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
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・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。
決算日	毎年2月末日
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
運用費用 (信託報酬)	1.0%

*作成時点において、入手可能な直前計算期間の年次報告書をもとに委託会社が翻訳・抜粋・作成しております。

*開示情報につきましては各クラス別の情報がないため、全てのシェアクラスを含むファンド全体の情報を開示しております。

■費用の明細 (2018年3月1日～2019年2月28日)

項目	当期
	米ドル
(a)運用報酬	149,776,140
(b)成功報酬	511,961
(c)管理費用等	17,247,360
(d)その他の費用	5,604,388
合計	173,139,849

■純資産計算書 (2019年2月28日現在)

項目	当期末
	米ドル
資産合計	8,630,238,740
有価証券	8,029,461,439
預金	514,545,935
未収利息	1,077,685
未収配当金	9,371,673
有価証券売却未収入金	32,214,250
未収追加設定金	10,744,939
為替予約取引評価勘定	32,713,685
為替未収金	109,134
負債合計	55,000,446
借入金	16,275
未払解約金	16,453,840
未払配当金	8,838,612
未払運用報酬	22,161,431
その他の負債	7,530,288
純資産	8,575,238,294

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

株数	評価額 米ドル	株数/額面	評価額 米ドル
	シンガポール		
417,207	HAW PAR CORP	244,666	CINCINNATI FINANCIAL CORP
		104,836	CINTAS CORP
		1,322,492	COLGATE PALMOLIVE CO
	韓国	4,036,368	COMCAST CLASS A
56,706	FURSYS	417,440	CONOCOPHILLIPS
174,623	HYUNDAI MOBIS	274,305	CUMMINS INC
1,486,422	KIA MOTORS CORP	539,583	DEERE & CO
731,652	KT&G CORP	755,422	DENTSPLY INTERNATIONAL INC
18,030	LOTTE CONFECTIONERY CO LTD	1,847,566	EXXON MOBIL CORP
107,147	LOTTE CORP	261,472	FACEBOOK A
		1,521,674	FLOWSERVE CORP
	スウェーデン	275,697	HCA HEALTHCARE RG REGISTERED SHS
439,074	INVESTOR A	685,544	H&R BLOCK INC
1,069,804	INVESTOR B	194,607	IPG PHOTONICS
1,281,193	SVENSKA HANDELSBANKEN AB	656,247	MICROSOFT CORP
		3,247,700	NATIONAL OILWELL VARCO
	スイス	1,026,439	NEWMONT MINING CORP
753,807	CIE FINANCIERE RICHEMONT SA	1,018,440	NOW INC
919,201	NESTLE SA	924,123	OMNICOM GROUP INC
202,215	PARGESA HOLDING	3,645,689	ORACLE CORP
		1,279,277	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC
	台湾	203,413	ROYAL GOLD INC
822,431	TAIWAN SEMICONDUCTOR-SP ADR	336,024	SCOTTS MIRACLE-GRO A
		899,758	SYNCHRONY FINANCIAL
	タイ	1,797,410	TERADATA CORP COM STK USD0.01
8,667,890	BANGKOK BANK (NVDR)	407,493	TEXAS INSTRUMENTS
		305,185	TIFFANY & CO
	イギリス	232,750	TRAVELERS COMPANIES INC
1,107,313	BERKELEY GROUP HOLDINGS UNITS	357,465	UGI CORP
3,215,141	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	436,674	UNION PACIFIC CORP
8,188,430	BT GROUP PLC	336,526	UNIVERSAL HEALTH SERV CL B
1,095,435	DIAGEO	1,355,951	US BANCORP
3,165,756	FRESNILLO PLC-W/I	249,079	VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC
2,504,776	GLAXOSMITHKLINE PLC	482,731	VISTA OUTDOOR INC
792,740	LIBERTY GLOBAL PLC	636,786	WELLS FARGO & CO
172,780	LINDE PLC	4,528,952	WEYERHAEUSER CO REIT
82,701,232	LLOYDS BANKING GROUP PLC	876,446	W.R.BERKLEY CORP.
2,639,209	TECHNIPFMC PLC	172,217	XILINX INC
	アメリカ		債券
470,142	3 M		インドネシア
69,686	ALLEGHANY CORPORATION	170,289,000,000	INDONESIA 8.25% 15/07/2021
21,075	ALPHABET INC A		マレーシア
24,875	ALPHABET INC SHS C		MALAYSIA 3.659% 15/10/2020
823,056	AMERICAN EXPRESS CO	9,291,000	
472,082	ANALOG DEVICES INC		メキシコ
186,615	ANTHEM INC		MEXICO 5.00% 11/12/2019
2,072,312	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	1,158,904	MEXICO 6.50% 09/06/2022
147	BERKSHIRE HATHAWAY A	3,973,200	MEXICO 6.50% 10/06/2021
13,178	BOOKING HOLDINGS INC	2,801,000	
1,378,740	BRANCH BANKING AND TRUST CORP		シンガポール
1,340,080	BROWN & BROWN		SINGAPORE 2.25% 01/06/2021
686,808	C.H. ROBINSON WORLDWIDE	26,267,000	SINGAPORE 3.25% 01/09/2020
		17,090,000	

口数／額面	評価額 米ドル
投資証券	733,938,766
ジャージー	733,938,766
1,125,097 DB PHYSICAL GOLD ETC	144,321,818
4,695,524 ETFS METAL SECURITIES LTD	589,616,948
債券	748,719,708
アメリカ	748,719,708
150,000,000 USA T-BILLS 0% 07/03/2019	149,932,333
150,000,000 USA T-BILLS 0% 11/04/2019	149,594,000
150,000,000 USA T-BILLS 0% 12/03/2019	149,882,000
150,000,000 USA T-BILLS 0% 18/04/2019	149,516,125
150,000,000 USA T-BILLS 0% 21/03/2019	149,795,250
合計	8,029,461,439

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12期》

決算日：2019年2月15日

（計算期間：2018年2月16日～2019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
	基	準	額		
	税	込	期		
	分	み	騰		
	配	金	落	率	
			率		
8期（2015年2月16日）	円	円	%	%	百万円
9期（2016年2月15日）	10,077	0	0.0	79.2	5,683
10期（2017年2月15日）	10,077	0	0.0	66.6	4,511
11期（2018年2月15日）	10,067	0	△0.1	63.6	791
12期（2019年2月15日）	10,064	0	△0.0	65.3	770
12期（2019年2月15日）	10,055	0	△0.1	59.0	763

（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	率	
(期 首) 2018年 2月15日	円 10,064		% —	% 65.3
2月末	10,061	△0.0		65.3
3月末	10,061	△0.0		64.9
4月末	10,061	△0.0		64.6
5月末	10,060	△0.0		65.1
6月末	10,057	△0.1		59.0
7月末	10,057	△0.1		58.7
8月末	10,057	△0.1		59.4
9月末	10,056	△0.1		59.4
10月末	10,056	△0.1		59.2
11月末	10,056	△0.1		59.1
12月末	10,055	△0.1		59.8
2019年 1月末	10,055	△0.1		58.7
(期 末) 2019年 2月15日	10,055	△0.1		59.0

(注) 騰落率は期首比です。

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	第12期 (2018年 2月16日 ～2019年 2月15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)	1円 (1) (0) (0)	0.011% (0.009) (0.001) (0.002)	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 委託した資金の運用の対価 交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、 購入後の情報提供等の対価 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) そ の 他 費 用 (そ の 他)	2 (2)	0.020 (0.020)	その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用等
合 計	3	0.031	

期中の平均基準価額は10,057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（2018年2月16日から2019年2月15日まで）

公社債

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国 内	地 方 債 証 券	451,015	(200,000)
	特 殊 債 証 券	—	(300,000)

(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（2018年2月16日から2019年2月15日まで）

公社債

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
		千円	
平成26年度第1回福岡市公募公債（5年）	300,702	—	—
平成26年度第2回千葉県公募公債	150,313	—	—

(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（2018年2月16日から2019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（2019年2月15日現在）

公社債

(A) 債券種類別開示

国内（邦貨建）公社債

区 分	当 期			末				
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	う ち 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	%	%	%	%	%		
地方債証券	450,000	450,283	59.0	—	—	—	59.0	

(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) 一印は組入れなしです。

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

(B) 個別銘柄開示

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	平成26年度第2回千葉県公募公債	0.209	150,000	150,076	2019/5/24
	平成26年度第1回福岡市公募公債（5年）	0.209	300,000	300,207	2019/6/26
合 計			450,000	450,283	

(注) 額面・評価額の単位未満は切捨てです。

■投資信託財産の構成 (2019年2月15日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公 社 債	450,283	59.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	313,094	41.0
投 資 信 託 財 産 総 額	763,377	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

2019年2月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	763,377,146円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	312,935,723
公 社 債(評価額)	450,283,500
未 収 利 息	157,923
(B) 負 債	82,538
未 払 信 託 報 酬	82,538
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	763,294,608
元 本	759,136,573
次 期 繰 越 損 益 金	4,158,035
(D) 受 益 権 総 口 数	759,136,573口
1 万 口 当 り 基 準 価 額 (C/D)	10,055円

(注記事項)

期首元本額	765,948,597円
期中追加設定元本額	36,989,159円
期中一部解約元本額	43,801,183円

■損益の状況

当期 自2018年2月16日 至2019年2月15日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	3,712,878円
受 取 利 息	3,882,370
支 払 利 息	△ 169,492
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 4,120,014
売 買 損 益	66,623
売 買 損 益	△ 4,186,637
(C) 信 託 報 酬 等	△ 235,965
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△ 643,101
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 695,438
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	5,496,574
(配 当 等 相 当 額)	(5,045,365)
(売 買 損 益 相 当 額)	(451,209)
(G) 計 (D+E+F)	4,158,035
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	4,158,035
追 加 信 託 差 損 益 金	5,496,574
(配 当 等 相 当 額)	(5,045,365)
(売 買 損 益 相 当 額)	(451,209)
分 配 準 備 積 立 金	15,704,784
繰 越 損 益 金	△17,043,323

(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。