

アムンディ・リそな米国ハイ・イールド債券ファンド（メキシコペソコース）

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	第37期～第42期 (2016年10月12日 ～2017年4月10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)	27円 (11) (16) (1)	0.471% (0.187) (0.268) (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) (そ の 他)	0 (0) (0)	0.005 (0.005) (0.000)	その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用等
合 計	27	0.476	

期中の平均基準価額は5,790円です。

(注1) 費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注2) 消費税は報告日の税率を採用しています。

(注3) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注4) 各項目の費用は、このファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

(注5) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

■ 当作成期中の売買及び取引の状況（2016年10月12日から2017年4月10日まで）

投資信託受益証券、投資証券

決 算 期		第 37 期 ～ 第 42 期			
		買 付		売 付	
		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
外国	(ルクセンブルク)	口	千円	口	千円
	ストラクチャー-米国ハイ・イールド・ボンド (I13シェアクラス、メキシコペソ)	140,770	808,708	2,050	11,652

(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・リそな米国ハイ・イールド債券ファンド（メキシコペソコース）

■利害関係人との取引状況等（2016年10月12日から2017年4月10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（2017年4月10日現在）

(1) 国内（邦貨建）投資信託受益証券

銘	柄	第6作成期末 (第36期末)	第7作成期末 (第42期末)	
		口数	口数	評価額
		口	口	千円
	CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）	294,275	294,275	296
合計	口数・金額	294,275	294,275	296
	銘柄数<比率>	1	1	<0.0%>

（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6作成期末 (第36期末)	第7作成期末 (第42期末)	
		口数	口数	評価額
		口	口	千円
	(ルクセンブルク) ストラクチャラ-米国ハイ・イールド・ボンド (I13シェアクラス、メキシコペソ)	38,880	177,600	1,038,072
合計	口数・金額	38,880	177,600	1,038,072
	銘柄数<比率>	1	1	<97.3%>

アムンディ・リそな米国ハイ・イールド債券ファンド（メキシコペソコース）

■投資信託財産の構成（2017年4月10日現在）

項 目	第 7 作 成 期 末 (第 42 期 末)	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投 資 信 託 受 益 証 券	296	0.0
投 資 証 券	1,038,072	95.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	51,499	4.8
投 資 信 託 財 産 総 額	1,089,867	100.0

(注) 金額の単位未満は切捨てです。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	(2016年11月8日)	(2016年12月8日)	(2017年1月10日)	(2017年2月8日)	(2017年3月8日)	(2017年4月10日)現在
	第 37 期 末	第 38 期 末	第 39 期 末	第 40 期 末	第 41 期 末	第 42 期 末
(A) 資 産	230,008,016円	224,843,363円	248,864,407円	391,987,600円	734,680,366円	1,089,867,042円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	9,648,340	9,456,927	10,588,851	44,409,883	66,872,149	51,498,825
投資信託受益証券(評価額)	296,276	296,276	296,276	296,217	296,217	296,217
投 資 証 券(評価額)	220,063,400	215,090,160	237,979,280	347,281,500	667,512,000	1,038,072,000
(B) 負 債	3,707,384	5,009,911	5,459,335	27,038,214	37,348,810	22,961,666
未 払 金	-	557,000	275,400	20,368,500	26,307,000	5,825,000
未 払 収 益 分 配 金	3,537,603	3,489,173	3,918,975	5,937,956	10,691,886	16,332,273
未 払 解 約 金	-	792,174	1,057,901	519,817	-	-
未 払 信 託 報 酬	167,950	167,924	201,249	203,850	338,109	784,201
未 払 利 息	23	25	27	115	192	98
そ の 他 未 払 費 用	1,808	3,615	5,783	7,976	11,623	20,094
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	226,300,632	219,833,452	243,405,072	364,949,386	697,331,556	1,066,905,376
元 本	393,067,094	387,685,920	435,441,698	659,772,944	1,187,987,407	1,814,697,044
次 期 繰 越 損 益 金	△166,766,462	△167,852,468	△192,036,626	△294,823,558	△ 490,655,851	△ 747,791,668
(D) 受 益 権 総 口 数	393,067,094口	387,685,920口	435,441,698口	659,772,944口	1,187,987,407口	1,814,697,044口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D)	5,757円	5,670円	5,590円	5,531円	5,870円	5,879円

(注記事項)

作成期首元本額	394,096,249円
作成期中追加設定元本額	1,511,831,414円
作成期中一部解約元本額	91,230,619円

アムンディ・リそな米国ハイ・イールド債券ファンド（メキシコペソコース）

■損益の状況

第37期 自2016年10月12日 至2016年11月8日 第40期 自2017年1月11日 至2017年2月8日
 第38期 自2016年11月9日 至2016年12月8日 第41期 自2017年2月9日 至2017年3月8日
 第39期 自2016年12月9日 至2017年1月10日 第42期 自2017年3月9日 至2017年4月10日

項 目	第 37 期	第 38 期	第 39 期	第 40 期	第 41 期	第 42 期
(A) 配 当 等 收 益	3,853,563円	3,798,581円	4,112,358円	4,854,777円	7,915,524円	16,951,984円
受 取 配 当 金	3,854,000	3,799,010	4,113,174	4,856,683	7,919,644	16,956,966
支 払 利 息	△ 437	△ 429	△ 816	△ 1,906	△ 4,120	△ 4,982
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 1,556,203	△ 3,421,967	△ 4,280,487	△ 2,841,431	27,361,714	2,100,881
売 買 益	117,692	376,605	79,085	142,827	27,616,720	2,307,214
売 買 損	△ 1,673,895	△ 3,798,572	△ 4,359,572	△ 2,984,258	△ 255,006	△ 206,333
(C) 信 託 報 酬 等	△ 169,758	△ 169,746	△ 203,417	△ 206,043	△ 341,871	△ 792,672
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	2,127,602	206,868	△ 371,546	1,807,303	34,935,367	18,260,193
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△162,103,467	△158,082,609	△157,773,332	△157,912,182	△158,788,408	△128,669,438
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 3,252,994	△ 6,487,554	△ 29,972,773	△132,780,723	△356,110,924	△621,050,150
(配 当 等 相 当 額)	(16,556,862)	(16,594,481)	(20,359,786)	(38,176,424)	(76,843,961)	(119,428,596)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 19,809,856)	(△ 23,082,035)	(△ 50,332,559)	(△170,957,147)	(△432,954,885)	(△740,478,746)
(G) 計 (D+E+F)	△163,228,859	△164,363,295	△188,117,651	△288,885,602	△479,963,965	△731,459,395
(H) 收 益 分 配 金	△ 3,537,603	△ 3,489,173	△ 3,918,975	△ 5,937,956	△ 10,691,886	△ 16,332,273
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	△166,766,462	△167,852,468	△192,036,626	△294,823,558	△490,655,851	△747,791,668
追 加 信 託 差 損 益 金	△ 3,252,994	△ 6,487,554	△ 29,972,773	△134,069,919	△358,964,470	△621,050,150
(配 当 等 相 当 額)	(16,556,862)	(16,594,481)	(20,359,786)	(36,887,228)	(73,990,415)	(119,428,596)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 19,809,856)	(△ 23,082,035)	(△ 50,332,559)	(△170,957,147)	(△432,954,885)	(△740,478,746)
分 配 準 備 積 立 金	11,931,578	11,681,648	11,414,910	11,128,526	10,994,618	10,670,276
繰 越 損 益 金	△175,445,046	△173,046,562	△173,478,763	△171,882,165	△142,685,999	△137,411,794

(注1) (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) (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

第37期計算期間末における費用控除後の配当等収益(3,683,805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(16,556,862円)および分配準備積立金(11,785,376円)より分配対象収益は32,026,043円(10,000口当たり814円)であり、うち3,537,603円(10,000口当たり90円)を分配金額としております。

第38期計算期間末における費用控除後の配当等収益(3,628,835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(16,594,481円)および分配準備積立金(11,541,986円)より分配対象収益は31,765,302円(10,000口当たり819円)であり、うち3,489,173円(10,000口当たり90円)を分配金額としております。

第39期計算期間末における費用控除後の配当等収益(3,908,941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(20,359,786円)および分配準備積立金(11,424,944円)より分配対象収益は35,693,671円(10,000口当たり819円)であり、うち3,918,975円(10,000口当たり90円)を分配金額としております。

第40期計算期間末における費用控除後の配当等収益(4,648,734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(20,359,786円)および分配準備積立金(11,128,552円)より分配対象収益は53,953,710円(10,000口当たり817円)であり、うち5,937,956円(10,000口当たり90円)を分配金額としております。

第41期計算期間末における費用控除後の配当等収益(7,838,808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(76,843,961円)および分配準備積立金(10,994,150円)より分配対象収益は95,676,919円(10,000口当たり805円)であり、うち10,691,886円(10,000口当たり90円)を分配金額としております。

第42期計算期間末における費用控除後の配当等収益(16,246,744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(119,428,596円)および分配準備積立金(10,755,805円)より分配対象収益は146,431,145円(10,000口当たり806円)であり、うち16,332,273円(10,000口当たり90円)を分配金額としております。

アムンディ・リそな米国ハイ・イールド債券ファンド（メキシコペソコース）

■分配金のお知らせ

決 算 期	第37期	第38期	第39期	第40期	第41期	第42期
1万口当たりの分配金（税込み）	90円	90円	90円	90円	90円	90円

◇分配金をお支払いする場合

分配金は各決算日から起算して5営業日目までにお支払いを開始しております。

◇分配金を再投資する場合

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

収益分配金に関する留意事項

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

【分配原資の内訳】

（単位：円・1万口当たり・税込み）

項 目	第37期	第38期	第39期	第40期	第41期	第42期
	(2016年10月12日 ～2016年11月8日)	(2016年11月9日 ～2016年12月8日)	(2016年12月9日 ～2017年1月10日)	(2017年1月11日 ～2017年2月8日)	(2017年2月9日 ～2017年3月8日)	(2017年3月9日 ～2017年4月10日)
当期分配金	90	90	90	90	90	90
（対基準価額比率）	(1.539%)	(1.563%)	(1.585%)	(1.601%)	(1.510%)	(1.508%)
当期の収益	90	90	89	70	65	89
当期の収益以外	—	—	0	19	24	0
翌期繰越分配対象額	724	729	729	727	715	716

（注1）「対基準価額比率」は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なる点にご留意ください。

（注2）「当期の収益」「当期の収益以外」は小数点以下切捨てで算出しているため、合計が「当期分配金」と一致しない場合があります。

ストラクチャラ-米国ハイ・イールド・ボンド

< 1. 補足情報 >

「ストラクチャラ-米国ハイ・イールド・ボンド（I13シエアクラス、メキシコペソ）」は、「ストラクチャラ-米国ハイ・イールド・ボンド」にて他のクラスと合わせた合同運用が行われています。

「ストラクチャラ-米国ハイ・イールド・ボンド」の決算日（毎年12月31日）と当ファンドの決算日が異なっておりますので、以下2017年4月7日現在における「ストラクチャラ-米国ハイ・イールド・ボンド」の補足情報を記載しております。

■有価証券明細（評価額上位30銘柄）（2017年4月7日現在）

銘柄		利率	額面金額/株数	評価額	償還年月日	
		%	米ドル	円		
アメリカ	債券	SPRINT CORP 7.875 14-23 15/09S	7.875	7,075,000.00	870,280,281	2023/9/15
		HARRAHS OPERATING(DEFAULT)LT09-17 01/06S	11.25	5,382,118.98	682,780,133	2017/6/1
		FIRST DATA CORPORA 5.75 15-24 15/01S	5.75	5,680,000.00	649,926,234	2024/1/15
		HCA INC 7.50 11-22 15/02S	7.5	4,840,000.00	613,901,952	2022/2/15
ルクセンブルク アメリカ	債券	INTELSAT 7.25 10-20 15/10S	7.25	5,905,000.00	605,123,309	2020/10/15
		SPRINT CAP CORP 8.75 02-32 15/03S	8.75	4,340,000.00	579,115,887	2032/3/15
		RADIO SYST CORP 144A 8.375 12-19 01/11S	8.375	4,565,000.00	528,253,242	2019/11/1
		HCA INC 5.375 15-25 01/02S	5.375	4,575,000.00	523,381,731	2025/2/1
カナダ アメリカ	株式 債券	DISH DBS CORP 5.875 15-24 15/11S	5.875	4,495,000.00	523,358,510	2024/11/15
		CCO HLDGS LLC/CAP 5.875 16-24 01/04S	5.875	4,045,000.00	475,506,385	2024/4/1
		VPII ESCROW CORP 144A 7.50 13-21 15/07S	7.5	4,940,000.00	465,813,425	2021/7/15
		REICHHOLD CAYMAN EQUITY	—	5,835.00	462,635,529	—
カナダ アメリカ ルクセンブルク アメリカ	株式 債券	CLEAR CHANNEL WORLDW 7.625 12-20 15/03S	7.625	3,995,000.00	449,301,019	2020/3/15
		MGM RESORT 7.75 12-22 15/03S	7.75	3,495,000.00	447,997,706	2022/3/15
		CLEAR CHANNEL 6.50 13-22 15/11S	6.5	3,400,000.00	392,741,338	2022/11/15
		TENET HEALTHCARE CORP 8.125 13-22 01/04S	8.125	3,365,000.00	387,424,040	2022/4/1
カナダ アメリカ ルクセンブルク アメリカ	株式 債券	REGENCY AGENCY 5.50 12-23 15/04S	5.5	3,235,000.00	373,340,619	2023/4/15
		REICHHOLD HLDG INTL 12.00 15-18 31/03Q	—	3,355,061.17	371,522,860	—
		HCA 5.875 15-26 15/02S	5.875	3,060,000.00	357,577,446	2026/2/15
		CLEAR CHANNEL WORLDW 6.50 13-22 15/11S	6.5	3,055,000.00	346,905,195	2022/11/15
		WESTERN DIGITAL CORP 10.50 16-24 01/04S	10.5	2,615,000.00	340,473,144	2024/4/1
		QUEBECOR MEDIA INC 5.75 13-23 15/01S	5.75	2,843,000.00	330,060,166	2023/1/15
		SPRINT 7.625 15-25 15/02S	7.625	2,660,000.00	323,106,467	2025/2/15
		ALBEA BEAUTY HLDG 144A 8.375 12-19 01/11S	8.375	2,790,000.00	322,853,570	2019/11/1
		BELDEN INC 5.50 12-22 01/09S	5.5	2,830,000.00	322,336,592	2022/9/1
		BANK OF AMERICA CORP FL.R 08-XX 30/01S	8	2,785,000.00	318,972,046	—
		WINDSTREAM SERVICES 7.50 11-22 01/06S	7.5	2,865,000.00	307,043,445	2022/6/1
		SABINE PASS 6.25 14-22 15/03S	6.25	2,475,000.00	305,159,659	2022/3/15
INFOR(US) 6.50 16-22 15/05S	6.5	2,680,000.00	304,625,429	2022/5/15		
T-MOBILE USA INC 6.731 13-22 28/04S	6.731	2,545,000.00	292,146,608	2022/4/28		

ストラクチャラ-米国ハイ・イールド・ボンド

■外国為替先物契約（I13シェアクラス、メキシコペソ）

(2017年4月7日現在)

売 建	契 約 額	買 建	契 約 額	満 期 日	評 価 損 益
					日本円
米ドル	3,144,726.76	メキシコペソ	65,020,000.00	2017/5/24	34,404,826
米ドル	72,652.36	メキシコペソ	1,500,000.00	2017/5/24	782,189
米ドル	63,584.11	メキシコペソ	1,310,000.00	2017/5/24	668,232
米ドル	81,972.14	メキシコペソ	1,700,000.00	2017/5/24	927,142
米ドル	277,857.89	メキシコペソ	5,530,000.00	2017/5/24	1,774,898
米ドル	157,834.41	メキシコペソ	3,160,000.00	2017/5/24	1,118,485
米ドル	153,356.04	メキシコペソ	3,070,000.00	2017/5/24	1,084,757
米ドル	215,621.22	メキシコペソ	4,360,000.00	2017/5/24	1,781,344
米ドル	784,067.22	メキシコペソ	15,810,000.00	2017/5/24	6,216,574
米ドル	489,622.18	メキシコペソ	9,710,000.00	2017/5/24	2,924,050
米ドル	220,352.29	メキシコペソ	4,350,000.00	2017/5/24	1,198,597
米ドル	124,683.89	メキシコペソ	2,460,000.00	2017/5/24	669,980
米ドル	206,437.55	メキシコペソ	4,080,000.00	2017/5/24	1,150,523
米ドル	602,949.08	メキシコペソ	11,950,000.00	2017/5/24	3,556,980
米ドル	265,171.12	メキシコペソ	5,210,000.00	2017/5/24	1,296,600
米ドル	246,428.34	メキシコペソ	4,760,000.00	2017/5/24	723,878
米ドル	143,686.32	メキシコペソ	2,770,000.00	2017/5/24	390,065
米ドル	300,588.36	メキシコペソ	5,760,000.00	2017/5/24	611,367
米ドル	384,638.55	メキシコペソ	7,320,000.00	2017/5/24	484,506
米ドル	333,390.23	メキシコペソ	6,340,000.00	2017/5/24	392,294
米ドル	201,580.24	メキシコペソ	3,790,000.00	2017/5/24	△ 18,220
米ドル	232,833.65	メキシコペソ	4,390,000.00	2017/5/24	51,870
				合計	62,190,937

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（2017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2017年4月10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（2017年4月10日現在）

公社債

(A) 公社債種類別

国内（邦貨建）公社債

区 分	2017年4月10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	502,080	63.3	—	—	—	63.3
合 計	500,000	502,080	63.3	—	—	—	63.3

(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	
地方債証券	第303回大阪府公募公債（10年）	1.93	500,000	502,080	2017/6/28
合 計			500,000	502,080	

(注) 額面・評価額の単位未満は切捨てです。

ストラクチュラ-米国ハイ・イールド・ボンド

決算日 2016年12月31日
 (計算期間：2016年1月1日～2016年12月31日)

「ストラクチュラ-米国ハイ・イールド・ボンド (I 13シェアクラス、メキシコペソ)」は、「ストラクチュラ-米国ハイ・イールド・ボンド」にて他のクラスと合わせた合同運用が行われております。

「ストラクチュラ-米国ハイ・イールド・ボンド」は毎年12月31日を決算日としており、当該運用報告書の作成時点において入手可能な2016年12月31日を基準日とするデータおよび年次報告書(監査済み)に基づき、委託会社が抜粋・翻訳・作成したものです。

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

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

ファンドの形態	ルクセンブルク籍会社型投資信託
投資方針	米ドル建のハイイールド債を主要投資対象とし、インカムゲインの確保に加え、中長期的なキャピタルゲインの獲得を目指して運用を行います。
投資顧問会社	アムンディ・ジャパン株式会社
副投資顧問会社	J.P. モルガン・インベストメント・マネージメント・インク
信託報酬率 (年率)	0.73%
申込手数料	ありません。

ストラクチュラ-米国ハイ・イールド・ボンド

■費用の明細 (2016年1月1日～2016年12月31日)

項目	当期
	円
(a) 運用報酬	269,591,149
(b) 管理費用等	81,571,369
(c) その他の費用	11,366,833
合計	362,529,351

■純資産計算書 (2016年12月31日現在)

項目	当期末
	円
資産合計	52,143,968,209
有価証券	48,612,767,092
預金	1,363,492,861
未収利息	835,140,987
未収追加設定金	510,170,290
為替未収入金	822,396,979
負債合計	2,120,891,417
借入金	27,419,594
未払配当金	532,758,150
有価証券買付未払金	1
未払解約金	4,504,200
為替予約取引評価勘定	658,432,172
未払運用報酬	66,099,322
未払管理費用	6,926,815
未払税	1,250,577
為替未払金	823,500,586
純資産	50,023,076,792

■有価証券明細(2016年12月31日現在)

(1) 債券

	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
アイランド	ALLEGION PLC 5.875 15-23 15/09S	USD	240,000	29,733,185		CARE CAPITAL 144A 5.125 16-26 15/08S	USD	560,000	63,422,216
	ARDAGH PACKAGING 144A 6.75 14-21 31/01S	USD	575,000	69,244,760		CAREFUSION 5.50 14-24 15/06S	USD	155,000	18,801,567
	ARDAGH PKG FIN 1447.25 16-24 15/05S	USD	710,000	87,365,471		CBS RADIO 144A 7.25 16-24 01/11S	USD	225,000	27,686,240
アメリカ	ENDO FIN/ENDO LTD/ 6.00 15-23 15/07S	USD	1,840,000	189,123,704		CCO HLDGS 144A 5.375 15-25 01/05S	USD	550,000	66,073,746
	JAMES HARDIE INTL F 5.875 15-23 15/02S	USD	745,000	90,803,289		CCO HLDGS 144A 5.50 16-26 01/05S	USD	845,000	101,020,517
	21ST CENTURY ONCOLOGY 11.00 15-23 01/05S	USD	935,824	74,221,906		CCO HLDGS LLC/CAP 5.875 16-24 01/04S	USD	4,045,000	505,993,385
	ACCESS MIDSTREAM PART 6.125 12-22 15/07S	USD	1,730,000	208,714,745		CCO HLDGS LLC/CAP COR 5.125 15-23 01/05S	USD	650,000	78,276,686
	ACCO BRANDS 6.75 13-20 30/04S	USD	775,000	94,798,767		CCO HOLDINGS 6.625 12-22 31/01S	USD	10,000	1,214,824
	ACCO BRANDS 144A 5.25 16-24 15/12S	USD	420,000	49,537,814		CCO HOLDINGS 144A 5.75 16-26 15/02S	USD	1,435,000	173,647,694
	ADT CORP 3.50 13-22 15/07S	USD	1,435,000	160,040,409		CENTRAL GARDEN&PET 6.125 15-23 15/11S	USD	700,000	86,543,194
	ADVANCEPIERRE FOODS 5.50 16-24 15/12S	USD	170,000	20,174,945		CENTURY LINK 6.75 13-23 01/12S	USD	880,000	105,272,540
	AES 6.00 16-26 15/05S	USD	270,000	32,215,762		CENTURYLINK 5.80 12-22 15/03S	USD	110,000	13,129,687
	AIR MED MERGER 144A 6.375 15-23 15/05S	USD	1,250,000	140,691,007		CHEMOURS CO 6.625 16-23 15/05S	USD	700,000	81,397,140
	ALBERTSONS 144A 6.625 16-24 15/06S	USD	440,000	53,885,384		CHEMOURS CO 7.00 16-25 15/05S	USD	455,000	52,723,461
	ALCOA 5.90 07-27 01/02S	USD	255,000	31,269,776		CHEMUR CORP CHRI 5.875 16-25 31/03A	USD	585,000	69,937,281
	ALERE SUB 6.50 13-20 15/06S	USD	1,415,000	163,800,781		CHESAPEAKE ENERGY 6.875 06-20 15/11S	USD	205,000	24,029,733
	ALLEGION 5.75 14-21 01/10S	USD	195,000	23,804,376		CHESAPEAKE ENERGY 8.00 15-22 15/12S	USD	1,518,000	191,658,767
	ALLY FINANCE 4.625 15-22 19/05S	USD	275,000	32,509,245		CHESAPEAKE ENERGY 8.00 16-25 15/01S	USD	785,000	93,847,462
	ALLY FINANCIAL 4.25 16-21 15/04S	USD	2,110,000	248,585,527		CHINOS INTER A 144A 7.75 13-19 01/05S	USD	3,091,963	152,366,683
	ALLY FINANCIAL 4.625 15-25 30/03S	USD	1,800,000	205,206,742		CINEMARK USA 4.875 13-23 01/06S	USD	885,000	105,621,914
	ALLY FINANCIAL 5.125 14-24 30/09S	USD	545,000	64,985,523		CIT GROUP INC 5.50 12-19 15/02S	USD	1,640,000	202,019,993
	ALLY FINANCIAL INC 5.75 15-25 20/11S	USD	610,000	71,283,261		CITIGROUP INC FL R 14-XX 15/11S	USD	120,000	14,174,236
	ALTA MESA 144A 7.875 16-24 15/12S	USD	345,000	41,848,650		CITIGROUP SUB FL R 15-XX 27/03S	USD	70,000	8,284,062
	AMC ENTERTAINMENT 5.75 15-25 15/06S	USD	1,255,000	150,727,288		CLAIRE S STORES 144A 9.00 12-19 15/03S	USD	3,965,000	238,165,819
	AMC ENTERTAINMENT SUB 5.875 16-26 15/11S	USD	175,000	20,997,951		CLEAN HARBORS INC 5.125 13-21 01/06S	USD	1,065,000	127,546,548
	AMC NETWORKS 5.00 16-24 01/04S	USD	1,110,000	130,112,210		CLEAR CHANNEL 6.50 13-22 15/11S	USD	3,400,000	409,272,793
	AMERIGAS PART/FIN 5.50 16-25 20/05S	USD	530,000	63,052,898		CLEAR CHANNEL COMM 9.00 11-21 01/03S	USD	1,850,000	160,752,232
	AMKOR TECHNOLOGY 6.375 12-22 01/10S	USD	330,000	40,057,625		CLEAR CHANNEL WORLDW 6.50 13-22 15/11S	USD	3,055,000	357,324,845
	AMKOR TECHNOLOGY 6.625 11-21 01/06S	USD	2,355,000	283,256,363		CLEAR CHANNEL WORLDW 7.625 12-20 15/03S	USD	265,000	30,058,306
	ANTERO MEADSTREAM 5.375 16-24 15/09S	USD	425,000	50,685,211		CLEAR CHANNEL WORLDW 7.625 12-20 15/03S	USD	3,995,000	465,076,294
	ANTERO RESOURCES 5.125 15-22 01/12S	USD	410,000	48,552,014		CNH INDUSTRIAL 4.375 15-20 06/11S	USD	425,000	51,025,756
	ANTERO RESOURCES 5.375 14-21 01/11S	USD	475,000	56,880,864		CNH INDUSTRIAL 4.875 16-21 01/04S	USD	1,175,000	142,637,646
	ANTERO RESOURCES 5.625 15-23 01/06S	USD	835,000	99,825,008		COGENET COMM 144A 5.375 15-22 01/03S	USD	1,010,000	122,218,934
	ANTERO MERGER 144A 7.125 15-23 15/03S	USD	2,685,000	320,994,187		COGENET COMM FIN 144A 5.625 14-21 15/04S	USD	2,520,000	298,329,085
	ASHLAND 6.875 13-43 15/05S	USD	680,000	82,441,466		COMMSCOPE TECH 144A 6.00 15-25 15/06S	USD	510,000	63,052,898
	ASHLAND INC 4.75 13-22 15/08S	USD	1,485,000	179,841,894		COMMUNICATIONS SAL 7.125 16-24 15/12S	USD	240,000	28,272,332
	ASHTREAD CAPITAL 144A 6.50 12-22 15/07S	USD	475,000	58,345,129		COMMUNICATIONS SALES 8.25 15-23 15/10S	USD	2,225,000	275,732,505
	AVAYA -144 A- 7.00 11-19 01/04S	USD	740,000	75,952,733		CONCHO RESOURCES INC 6.50 11-22 15/01S	USD	65,000	7,865,575
	AVIS BUDGET 144A 5.125 14-22 01/06S	USD	55,000	6,318,703		CONTINENTAL RESOURCES 4.25 13-23 15/04S	USD	1,110,000	126,929,963
	AVIS BUDGET CAR 5.50 13-23 01/04S	USD	1,055,000	121,303,879		COOPER STANDARD AUT 5.625 16-25 15/11S	USD	405,000	46,882,909
	AVIS BUDGET CAR 144A 6.375 16-24 01/04S	USD	1,040,000	121,300,433		CORRECTION CORP OF AM 4.625 13-23 01/05S	USD	1,045,000	120,664,772
	AXALTA COATING SYS 4.875 16-24 15/08S	USD	375,000	43,956,828		CRESTWOOD MIDSTREAM 6.25 16-23 01/04S	USD	875,000	105,117,323
	BANK OF AMERICA CORP FL R 08-XX 30/01S	USD	2,785,000	334,670,870		CSI COMPRESSO LP 7.25 15-22 15/08S	USD	810,000	88,905,913
	BC MOUNTAIN FIN 144A 7.00 13-21 01/02	USD	1,010,000	106,021,244		DANA 5.50 14-24 15/12S	USD	495,000	59,473,300
	BELDEN INC 5.50 12-22 01/09S	USD	2,830,000	340,804,647		DANA 6.00 13-23 15/09S	USD	2,060,000	251,887,534
	BLUE RACER MID 144A 6.125 14-22 15/11S	USD	1,280,000	150,039,305		DAVITA 5.00 15-25 01/05S	USD	875,000	101,157,563
	BOISE CASCADE CO 5.625 16-24 01/09S	USD	185,000	21,496,565		DENBURY RESOURCE INC 4.625 13-23 15/07S	USD	265,000	24,974,512
	BOYD GAMING CORP 6.375 16-26 01/04S	USD	395,000	49,549,186		DENBURY RESOURCE SUB 5.50 14-22 01/05S	USD	1,325,000	135,610,093
	BUMBLE BEE 144A 9.00 10-17 15/12S	USD	1,988,000	230,131,415		DIAMOND 1 FIN 144A 5.45 16-23 15/06S	USD	770,000	95,342,105
	CAESARS ENTERTAIN (DEFAULT) 12-20 15/02S	USD	1,219,651	147,766,450		DIAMOND 1 FIN 144A 6.02 16-26 15/06S	USD	1,040,000	131,317,423
	CAESARS OP/CORP (DEFAULT) 13-20 15/02S	USD	7,391,430	899,816,639		DIAMOND 1 FIN/DIAM 5.875 16-21 15/06S	USD	320,000	39,337,544

ストラクチャ-米国ハイ・イールド・ボンド

銘柄		通貨	額面金額	円換算評価額	銘柄		通貨	額面金額	円換算評価額
DINEGY 7.375 15-22 01/11S	USD	1,760,000	198,092,938	HILL-ROM HOLDINGS INC 5.75 15-23 01/09S	USD	375,000	45,214,299		
DINEGY 144A 8.00 16-25 15/01S	USD	375,000	41,113,849	HILTON DOMESTIC 144A 4.25 16-24 01/09S	USD	165,000	18,739,605		
DISH DBS 7.75 16-26 01/07S	USD	380,000	50,193,886	HILTON GRAND VACA 6.125 16-24 01/12S	USD	195,000	23,483,006		
DISH DBS CORP 5.00 12-23 15/03S	USD	2,520,000	293,358,893	HMAN FINANCE 144A 6.375 14-22 15/07S	USD	1,430,000	155,112,929		
DISH DBS CORP 5.875 12-22 15/07S	USD	2,120,000	261,115,651	HRG GROUP 7.75 14-22 15/01S	USD	605,000	73,915,994		
DISH DBS CORP 5.875 15-24 15/11S	USD	4,425,000	531,402,356	HUGHES SATELLITE S 5.25 16-26 01/08S	USD	280,000	32,128,753		
DISH DBS CORPORATION 6.75 11-21 01/06S	USD	210,000	26,635,546	HUGHES SATELLITE S 6.125 16-26 01/08S	USD	180,000	21,195,641		
DJO FINCO 144A 8.125 15-21 15/06S	USD	2,145,000	218,909,375	HUNTSMAN INTL 5.625 15-22 15/11S	USD	1,782,000	213,299,521		
DYNEGY 7.625 15-24 01/11S	USD	415,000	44,954,786	IHEARTCOMMUNICATIO 10.625 15-23 15/03	USD	1,140,000	100,387,771		
ENERGIZER SPINCO INC 5.50 15-25 15/06S	USD	1,055,000	124,280,458	ILFC 4.625 13-21 15/04S	USD	1,318,000	159,511,180		
ENTEGRIS 144A 6.00 14-22 01/04S	USD	1,495,000	182,651,917	IMS HEALTH INC 5.00 16-26 15/10S	USD	810,000	95,064,840		
EP ENERGY 9.375 12-20 01/05S	USD	1,520,000	163,988,855	INCEPTION MRGR/RAC 8.625 16-24 15/11S	USD	790,000	97,900,530		
EP ENERGY 144A 8.00 16-24 29/11S	USD	295,000	37,159,921	INFINITY ACQ LLC 144A 7.25 14-22 01/08S	USD	1,465,000	145,880,537		
EP ENERGY AS WHEN I 7.75 12-22 01/09S	USD	708,000	68,371,778	INFOR SOFTWARE PIK 7.125 14-21 01/05S	USD	1,565,000	188,466,174		
EQUINIX 5.875 15-26 15/01S	USD	365,000	44,779,559	INFOR (US) 6.50 16-22 15/05S	USD	2,665,000	325,596,896		
ESH HOSPITALITY INC 5.25 15-25 01/05S	USD	370,000	43,142,016	INTERVAL ACQUISITI 5.625 16-23 15/04S	USD	804,000	95,650,057		
FGI 7.875 13-20 01/05S	USD	1,151,000	112,096,179	INTL LEASE FINANCE 5.875 12-19 01/04S	USD	1,400,000	173,817,922		
FIRST DATA 144A 5.375 15-23 15/08S	USD	1,986,000	240,323,568	INVENTIV HEALTH 144A 7.50 16-24 01/10S	USD	710,000	87,365,470		
FIRST DATA CORPORA 5.75 15-24 15/01S	USD	5,680,000	684,017,808	INVENTIV HEALTH 144A 9.00 12-18 15/01S	USD	1,550,000	181,010,279		
FREEPORT MCMORAN 3.875 13-23 15/03S	USD	210,000	22,635,781	ITALICS MERGER SUB 7.125 15-23 15/07S	USD	1,635,000	182,831,973		
FREEPORT MCMORAN 4.55 14-24 14/11S	USD	180,000	19,743,884	JACK COOPER HOLDIN 9.25 16-20 01/06S	USD	4,375,000	224,522,437		
FRONTIER COMM 6.875 14-25 15/01S	USD	400,000	39,191,237	JACK OHIO FIN LLC/ 6.75 16-21 15/11S	USD	700,000	82,971,246		
FRONTIER COMM 10.50 16-22 15/09S	USD	110,000	13,537,164	JC PENNEY CO INC 6.375 07-36 15/10S	USD	789,000	77,646,128		
FRONTIER COMM 11.00 16-25 15/09S	USD	1,710,000	206,258,977	KINDRED HEALTHCARE 8.75 15-23 15/01S	USD	1,570,000	173,735,917		
GATES GLOBAL 144A 6.00 14-22 15/07S	USD	770,000	88,125,056	KINETIC CONCEPT/KC 9.625 16-21 01/10S	USD	2,110,000	261,173,537		
GCI 6.75 11-21 01/06S	USD	870,000	104,897,174	KINETICS CONCEPT 7.875 16-21 15/02S	USD	555,000	70,558,362		
GENERAL CABLE CORP FL R 14-22 01/10S	USD	1,775,000	199,781,230	KRATOS DEF SEC 7.00 14-19 15/05S	USD	1,098,000	124,914,860		
GENERAL MOTORS 4.25 13-18 15/05S	USD	1,520,000	178,602,478	L BRANDS INC 6.75 16-36 01/07S	USD	855,000	100,965,500		
GENERAL MOTORS 4.875 14-23 02/10S	USD	840,000	102,558,583	LAREDO PETROLEUM INC 5.625 14-22 15/01S	USD	560,000	65,560,552		
GEO GROUP 5.875 14-25 15/01S	USD	50,000	5,911,938	LEVEL 3 COMMUNICATIONS 5.75 14-22 01/12S	USD	1,000,000	119,843,662		
GEO GROUP 6.00 16-26 15/04S	USD	1,360,000	157,235,686	LEVEL 3 FIN 5.375 16-24 15/01S	USD	375,000	44,448,882		
GEO GROUP INC/THE 5.125 13-23 01/04A	USD	45,000	5,051,754	LEVEL 3 FINANCING 5.625 15-23 01/02S	USD	385,000	46,104,785		
GOODYEAR TIRE & RU 5.125 15-25 15/11	USD	645,000	77,540,649	LEVEL 3 FINANCING 5.375 16-25 01/05S	USD	625,000	73,625,135		
GOODYEAR TIRE RUBBER 5.00 16-26 31/05S	USD	265,000	30,916,319	LIVE NATION ENT 144A 4.875 16-24 01/11S	USD	145,000	16,954,360		
GREAT LAKES DREDGE 7.375 11-19 01/02S	USD	1,459,000	169,957,799	LSB INDUSTRIES 8.50 14-19 01/08S	USD	1,878,000	203,160,147		
GULFPORT ENERGY 6.00 16-24 15/10S	USD	215,000	25,452,680	LTF MERGER SUB INC 8.50 15-23 15/06S	USD	1,210,000	145,715,061		
HALCON RESOURCES 144A 8.625 15-20 01/02S	USD	65,000	7,941,388	MAGNACHIP SEMI 6.625 13-21 15/07S	USD	1,580,000	160,326,515		
HANESBRANDS 144A 4.625 16-24 15/05S	USD	410,000	46,594,966	MARIPOSA BORROW 144A 8.00 13-21 15/10S	USD	940,000	82,090,651		
HANESBRANDS 144A 4.875 16-26 15/05S	USD	280,000	31,984,241	MARIPOSA BORROW 144A 8.75 13-21 15/10S	USD	840,000	70,295,934		
HARRAHS OPERATING (DEFAULT)L709-17 01/06S	USD	5,382,118	634,805,735	MGM GROWTH LP/MGP 4.50 16-26 01/09S	USD	400,000	45,137,757		
HCA 5.25 14-25 15/04S	USD	545,000	66,457,079	MGM RESORT 5.25 13-20 31/03S	USD	720,000	88,860,499		
HCA 5.875 15-26 15/02S	USD	2,660,000	319,662,145	MGM RESORT 7.75 12-22 15/03S	USD	4,955,000	669,510,609		
HCA INC 5.25 16-26 15/06S	USD	675,000	81,310,946	MGP ESCROW ISSUER LLC 5.625 16-24 01/05S	USD	140,000	17,186,172		
HCA INC 5.375 15-25 01/02S	USD	4,575,000	536,999,000	MICRON TECHNOLOGY 7.50 16-23 15/09S	USD	490,000	63,131,463		
HCA INC 7.50 11-22 15/02S	USD	4,840,000	640,971,270	MICRON TECHNOLOGY 144A 5.25 15-24 15/01S	USD	1,910,000	222,772,911		
HD SUPPLY 144A 5.75 16-24 15/04S	USD	785,000	96,731,555	MICROSEMI CORP 9.125 16-23 15/04S	USD	635,000	86,653,997		
HEALTHSOUTH 5.75 15-25 15/09S	USD	1,195,000	139,901,534	MPLX LP 5.50 16-23 15/02S	USD	1,650,000	200,566,695		
HERTS GLOBAL 144A 7.50 16-22 01/06S	USD	680,000	83,819,113	NABORS INDUSTRIES 5.50 16-23 15/01A	USD	210,000	25,557,287		
HERTZ 7.375 11-21 15/01S	USD	1,780,000	210,288,530	NEPTUNE FINCO 144A 10.125 15-23 15/01S	USD	675,000	91,325,230		
HERTZ 144A 5.50 16-24 15/10S	USD	575,000	58,866,430	NEPTUNE FINCO CORP 10.875 15-25 15/10S	USD	1,005,000	139,489,666		
HERTZ CORP 6.25 13-22 15/10S	USD	1,315,000	143,930,230	NEWFIELD EXPLORATION 5.75 11-22 30/01S	USD	795,000	97,284,132		
HERTZ GLOBAL 144A 7.75 16-24 01/06S	USD	980,000	120,081,457	NEXSTAR BROADCASTING 6.125 15-22 29/02S	USD	390,000	47,307,169		
HEXION US FIN 6.625 12-20 15/04S	USD	2,510,000	259,994,765	NEXTAR BROADCAST 6.875 13-20 15/11S	USD	1,345,000	163,149,082		
HEXION US FIN 8.875 10-18 01/02S	USD	1,250,000	144,700,336	NIELSEN FIN -144A- 5.00 14-22 15/04S	USD	1,325,000	158,598,129		

ストラクチャ-米国ハイ・イールド・ボンド

銘柄		通貨	額面金額	円換算評価額	銘柄		通貨	額面金額	円換算評価額
	NORANDA ALUM IN DEF 11.00 14-19 01/06S	USD	2,275,000	2,679,981		SPRINT CAP CORP 8.75 02-32 15/03S	USD	4,430,000	572,098,202
	NOVELIS 144A 5.875 16-26 30/09S	USD	400,000	47,353,823		SPRINT CORP 7.875 14-23 15/09S	USD	8,110,000	1,013,665,649
	NOVELIS 144A 6.25 16-24 15/08S	USD	305,000	37,708,105		SPX FLOW 144A 5.625 16-24 15/08S	USD	275,000	32,395,380
	NRG ENERGY 7.875 11-21 15/05S	USD	111,000	13,479,108		SPX FLOW INC 5.875 16-26 15/08S	USD	420,000	49,109,180
	NRG ENERGY 144A 6.625 16-27 15/01S	USD	570,000	63,240,972		TARGA RES 4.25 13-23 15/11S	USD	85,000	9,505,323
	NRG ENERGY INC 6.25 14-22 15/07S	USD	1,010,000	118,514,080		TARGA RES 5.125 16-25 01/02S	USD	215,000	24,951,150
	OASIS PETROLEUM 6.875 14-22 15/03S	USD	1,440,000	172,993,079		TARGA RESOURCES PTRN 6.75 15-24 15/03S	USD	995,000	125,336,005
	OASIS PETROLEUM 6.875 15-23 15/01S	USD	385,000	46,028,896		TEGNA 144A 4.875 14-21 15/09S	USD	505,000	60,078,705
	OASIS PETROLEUM INC 6.50 11-21 01/11S	USD	360,000	42,780,517		TEGNA 144A 5.50 14-24 15/09S	USD	505,000	59,784,201
	OMEGA US SUB 144A 8.75 15-23 15/07S	USD	1,065,000	131,048,206		TEMPUR SEALY INTL 5.50 16-26 15/06S	USD	620,000	72,946,464
	OSHKOSH 5.375 15-25 01/03S	USD	515,000	61,118,214		TEMPUR SEALY INTL 5.625 16-23 15/10S	USD	900,000	108,907,961
	OSHKOSH CORP 5.375 14-22 01/03S	USD	355,000	43,255,431		TENET HEALTHCARE 4.50 13-21 01/04S	USD	800,000	93,150,335
	PARSLEY ENERGY LLC 6.25 16-24 01/06S	USD	140,000	17,226,995		TENET HEALTHCARE 6.75 15-23 15/06S	USD	2,140,000	221,269,485
	PLANTRONICS INC 5.50 15-23 31/05S	USD	670,000	79,122,290		TENET HEALTHCARE 8.00 11-20 01/08S	USD	1,840,000	212,554,656
	POST HOLDINGS 144A 7.75 15-24 15/03S	USD	1,052,000	136,503,810		TENET HEALTHCARE 144A 7.50 16-22 01/01S	USD	210,000	25,718,024
	POST HOLDINGS INC 8.00 15-25 15/07S	USD	605,000	79,561,129		TENET HEALTHCARE CORP 8.125 13-22 01/04S	USD	3,365,000	372,217,225
	PROJECT HOMESTAKE 8.875 15-23 01/03S	USD	755,000	92,902,719		TENNECO INC 5.00 16-26 15/07S	USD	480,000	55,048,750
	QWEST CAP FDG 7.75 01-31 15/02S	USD	2,295,000	243,043,047		TEREX CORP 6.00 12-21 15/05S	USD	1,230,000	147,640,111
	RADIO SYST CORP 144A 8.375 12-19 01/11S	USD	4,565,000	557,064,221		TEREX CORP 6.50 12-20 01/04S	USD	1,755,000	209,879,392
	REGAL ENTERTAINMENT 5.75 13-23 15/06S	USD	390,000	46,423,799		TESORO 5.875 13-20 01/10S	USD	1,822,000	219,946,844
	REGAL ENTERTAINMENT 5.75 14-22 15/03S	USD	625,000	76,537,365		TESORO 6.125 13-21 15/10S	USD	90,000	11,017,497
	REGENCY AGENCY 5.50 12-23 15/04S	USD	3,235,000	392,760,633		TESORO 6.375 16-24 01/05S	USD	310,000	38,868,625
	REICHHOLD 144A 9.00 12-17 20/04S	USD	3,734,026	5		TESORO LOGISTICS L 5.25 16-25 15/01S	USD	345,000	41,043,867
	REICHHOLD HLDG INTL 12.00 15-17 31/03Q	USD	3,305,478	385,534,647		THREEHOUSE FOODS 144A 6.00 16-24 15/02S	USD	600,000	73,829,975
	REICHHOLD LLC 2.12 12.00 15-17 31/03Q	USD	1,270,000	148,126,490		TIME INC 144A 5.75 14-22 15/04S	USD	1,505,000	182,337,732
	RENAISSANCE ACQ 144A 6.875 13-21 15/08S	USD	1,160,000	135,634,879		T-MOBILE USA 6.50 15-26 15/01S	USD	1,130,000	142,599,717
	REYNOLDS GROUP 5.75 12-20 15/10S	USD	1,185,000	142,515,069		T-MOBILE USA INC 6.633 13-21 28/04S	USD	520,000	63,568,705
	REYNOLDS GRP ISS 1 7.00 16-24 15/07S	USD	375,000	46,471,770		T-MOBILE USA INC 6.731 13-22 28/04S	USD	2,545,000	311,443,463
	RPH HOTEL 5.00 15-23 15/04S	USD	497,000	58,982,044		TRIUMPH GROUP INC 4.875 13-21 01/04S	USD	2,230,000	244,935,118
	RSI HOME PROD 144A 6.50 15-23 15/03A	USD	1,365,000	167,963,193		UCI IN DEFAULT 8.625 11-19 15/02S	USD	6,080,000	147,146,756
	RSP PERMIAN 6.875 15-22 01/10S	USD	570,000	70,289,391		UNITED RENTAL 5.875 16-26 15/09S	USD	505,000	60,571,115
	RSP PERMIAN INC 14 5.25 16-25 15/01S	USD	225,000	26,505,311		UNITED RENTALS 7.625 12-22 15/04S	USD	504,000	61,896,672
	SABINE PASS 5.625 14-23 15/04S	USD	100,000	12,431,895		UNITED RENTALS NA 6.125 12-23 15/06S	USD	595,000	73,833,060
	SABINE PASS 5.75 14-24 15/05S	USD	910,000	113,504,909		UNITED RENTALS NOR 5.5 16-27 15/05S	USD	530,000	61,806,058
	SABINE PASS 6.25 14-22 15/03S	USD	2,475,000	317,178,034		UNITED RENTALS NORTH 5.75 14-24 15/11S	USD	225,000	27,335,636
	SABRE INC 144A 5.25 15-23 15/11S	USD	585,000	69,937,281		VALEANT PHARMA 144A 7.25 11-22 15/07S	USD	2,205,000	211,530,752
	SABRE INC 144A 5.375 15-23 15/04S	USD	1,095,000	130,908,244		VALEANT PHARMA -144A- 6.75 11-21 15/08S	USD	1,515,000	147,546,231
	SANCHEZ ENERGY 6.125 15-23 15/01S	USD	730,000	81,312,112		VALVOLINE FINCO TWO 5.50 16-24 15/07S	USD	100,000	12,071,726
	SBA COMMUNICATIONS 4.875 16-24 01/09S	USD	750,000	86,710,856		VERITAS US INC 7.50 16-23 01/02S	USD	755,000	83,546,403
	SCOTT'S MIRACLE 144A 5.25 16-26 15/12S	USD	290,000	34,035,560		VERSUM MATERIALS 5.50 16-24 30/09S	USD	330,000	39,499,912
	SCOTT'S MIRACLE 144A 6.00 15-23 15/10S	USD	1,000,000	124,216,309		VISTA OUTDOOR 5.875 16-23 01/10S	USD	1,030,000	125,878,894
	SERVICE CORP INTL 7.50 07-27 01/04S	USD	2,045,000	277,277,919		WESTERN DIGITAL 144A 7.375 16-23 01/04S	USD	930,000	119,793,824
	SINCLAIR TELE 144A 5.125 16-27 15/02S	USD	280,000	31,188,207		WESTERN DIGITAL 144A 10.50 16-24 01/04S	USD	2,230,000	308,213,904
	SINCLAIR TELE GRP 6.125 13-22 01/10S	USD	1,150,000	139,833,506		WHITING PETROLEUM 5.75 13-21 15/03S	USD	665,000	77,251,271
	SINCLAIR TV GR 144 5.625 14-24 01/08S	USD	515,000	61,718,885		WHITING PETROLEUM 6.25 15-23 01/04S	USD	1,355,000	158,830,670
	SIRIUS XM RADIO 144A 6.00 14-24 15/07S	USD	1,160,000	142,230,589		WINDSTREAM GTD 7.75 11-21 01/10S	USD	2,140,000	257,039,514
	SIRIUS XM RADIO INC 5.375 15-25 15/04S	USD	1,695,000	198,190,620		WINDSTREAM SERVICES 7.50 11-22 01/06S	USD	2,505,000	287,384,998
	SIRIUS XM RADIO INC 5.375 16-26 15/07S	USD	580,000	66,464,473		WMG ACQUISITION 144A 5.625 14-22 15/04S	USD	365,000	44,274,658
	SIRIUS XM RADIO INC 5.75 13-21 01/08S	USD	350,000	42,710,290		WMG ACQUISITION CORP 4.875 16-24 01/11S	USD	175,000	20,411,130
	SIX FLAGS ENTERTAIN 4.875 16-24 31/07S	USD	315,000	36,372,635		WFX ENERGY 5.25 14-24 15/09S	USD	190,000	21,551,238
	SM ENERGY 6.125 15-22 15/11S	USD	300,000	35,602,843		WFX ENERGY 6.00 11-22 15/01S	USD	430,000	51,683,234
	SOUTHWEST ENERGY 4.10 12-22 15/03S	USD	155,000	17,125,696		WFX ENERGY 8.25 15-23 01/08S	USD	1,650,000	215,782,099
	SOUTHWESTERN ENER 6.70 15-25 23/01S	USD	620,000	73,987,059		WYNN LAS VEGAS 5.50 15-25 01/03S	USD	2,800,000	324,945,198
	SPRINT 7.625 15-25 15/02S	USD	2,660,000	326,115,328		XPO LOGISTICS 6.125 16-23 01/09S	USD	265,000	32,453,697

ストラクチャラ-米国ハイ・イールド・ボンド

銘柄		通貨	額面金額	円換算評価額	銘柄	通貨	額面金額	円換算評価額	
イギリス	XPO LOGISTICS INC 6.50 15-22 15/06S	USD	1,406,000	172,393,283	ドイツ	SCHAEFFLER VER ZWEI 4.50 16-23 15/09S	USD	340,000	38,927,432
	ZAYO GROUP 6.00 15-23 01/04S	USD	1,160,000	141,215,864	バミューダ	AIRCASLE 5.00 16-23 01/04S	USD	740,000	88,760,263
	ZAYO GROUP LLC/ ZAY 6.375 15-25 15/05S	USD	400,000	48,753,443		WEATHERFORD 144A 9.875 16-24 15/02S	USD	160,000	19,784,287
	ZEBRA TECHNO 7.25 15-22 15/10S	USD	2,020,000	256,359,368	フランス	NUMERICABLE 144A 6.00 14-22 15/05S	USD	1,020,000	121,905,046
	ZF NA CAPITAL 4.75 15-25 29/04S	USD	1,870,000	222,742,294		NUMERICABLE 144A 6.25 14-24 15/05S	USD	945,000	110,961,886
	ZF NA CAPITAL -144A- 4.50 15-22 29/04S	USD	50,000	6,050,442		NUMERICABLE-SFR SA 7.375 16-26 01/05S	USD	765,000	91,567,976
	INTER GAME TECH 144A 6.50 15-25 15/02S	USD	1,950,000	245,064,781	ルクセンブルク	ALBEA BEAUTY HLDG 144A8.375 12-19 01/11S	USD	2,790,000	339,648,503
	INTL GAME TECH 144A 6.25 15-22 15/02S	USD	140,000	17,573,983		ALTICE FINANCE 144A 6.625 15-23 15/02S	USD	555,000	66,936,583
	SENSATA TECH UK FI 6.25 15-26 15/02S	USD	1,610,000	196,467,337		ALTICE FINANCE 144A 7.75 14-22 15/06S	USD	1,910,000	237,921,469
	ALCOA NEDERLAND HLD 7.00 16-26 30/09S	USD	375,000	48,164,196		ALTICE FINANCING 144A 7.50 16-26 15/06S	USD	1,160,000	140,443,321
オランダ	CONSTELLIUM 7.875 16-21 01/04S	USD	470,000	58,792,803		INEOS GROUP HOLDIN 5.625 16-24 01/08S	USD	1,405,000	162,793,941
	CONSTELLIUM 144A 5.75 14-24 15/05S	USD	250,000	27,555,026		INEOS GRP 144A 5.875 14-19 01/02S	USD	2,445,000	291,201,203
	NXP BV 144A 4.625 16-23 01/06S	USD	845,000	103,977,215		INTELSAT 5.50 13-23 01/08S	USD	2,785,000	220,883,424
	NXP BV 144A 5.75 13-23 15/03S	USD	1,910,000	235,512,737		INTELSAT 7.25 10-20 15/10S	USD	5,905,000	537,209,293
	SENSATA TECHNOLOGI 4.875 13-23 15/10S	USD	185,000	22,251,777		INTELSAT CONNECT FIN 12.50 16-22 01/04S	USD	261,000	18,873,881
	BOMBARDIER 144A 7.50 15-25 15/03S	USD	540,000	62,510,546		INTELSAT LUX 7.75 13-21 01/06S	USD	194,000	7,410,406
	MEG ENERGY 144A 6.375 12-23 30/01S	USD	1,640,000	169,284,085		MALLINCKRODT FIN/S 5.625 15-23 15/10S	USD	560,000	61,151,748
	MEG ENERGY 144A 7.00 13-24 31/03S	USD	975,000	102,347,241		MALLINCKRODT INTL FIN 5.50 15-25 15/04S	USD	755,000	79,253,504
	QUEBECOR MEDIA INC 5.75 13-23 15/01S	USD	2,843,000	345,271,623		TRINSEO FIN 144A 6.75 15-22 01/05S	USD	390,000	47,705,186
	VPII ESCROW CORP 144A 7.50 13-21 15/07S	USD	4,940,000	489,750,499		WIND ACQUIL.FIN 144A 7.375 14-21 23/04S	USD	700,000	84,924,183
ケイマン諸島 ジャージー、 チャンネル諸島	VRX ESCROW 144A 5.875 15-23 15/05S	USD	3,195,000	283,213,185					
	VRX ESCROW 144A 6.125 15-25 15/04S	USD	1,005,000	88,499,747					
	UPCB FINANCE IV 144A 5.375 15-25 15/01S	USD	1,150,000	135,391,111					
	ADIANT GLOBAL HOLD 4.875 16-26 15/08S	USD	750,000	84,633,295					

(注1) 額面金額の小数点以下は切捨てです。

(注2) 通貨欄の表記は以下の通りです。

USD(米ドル)

(2) その他

銘柄		口数	現地通貨	円換算評価額
アメリカ	HALCON RESOURCES CORP	93,554	USD	101,915,033
	REICHHOLD CAYMAN EQUITY	5,835	USD	430,797,905

(注) 通貨欄の表記は以下の通りです。

USD(米ドル)

■外国為替先物契約 (I13シェアクラス、メキシコペソ)

(2016年12月31日現在)

					評価損益	
買建	契約額	売建	契約額	満期日	日本円	
米ドル	87,877.05	メキシコペソ	1,720,000.00	2017/1/25	544,305	
米ドル	65,604.27	メキシコペソ	1,370,000.00	2017/1/25	△ 80,204	
小計①					464,101	
					評価損益	
売建	契約額	買建	契約額	満期日	日本円	
米ドル	2,133,098.31	メキシコペソ	41,080,000.00	2017/1/25	△16,955,031	
米ドル	42,295.65	メキシコペソ	860,000.00	2017/1/25	△ 79,660	
米ドル	106,837.66	メキシコペソ	2,220,000.00	2017/1/25	67,772	
小計②					△16,966,919	
合計①+②					△16,502,818	

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10期》

決算日：2017年2月15日

（計算期間：2016年2月16日～2017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		
	円	円	%	%	百万円
6期（2013年2月15日）	10,072	0	0.0	77.0	1,882
7期（2014年2月17日）	10,076	0	0.0	79.5	3,458
8期（2015年2月16日）	10,077	0	0.0	79.2	5,683
9期（2016年2月15日）	10,077	0	0.0	66.6	4,511
10期（2017年2月15日）	10,067	0	△0.1	63.6	791

（注）当ファンドは運用成果の目標基準となるベンチマークを設けておりません。また、当ファンドと適切に対比できる参考指数はありません。以下同じ。

CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）

■ 当期中の基準価額等の推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率		債 券 組 入 率
		騰 落	率	
(期 首) 2016年 2月15日	円 10,077		% —	% 66.6
2月末	10,076	△0.0		16.2
3月末	10,076	△0.0		16.2
4月末	10,076	△0.0		60.2
5月末	10,074	△0.0		61.3
6月末	10,074	△0.0		61.3
7月末	10,073	△0.0		61.2
8月末	10,069	△0.1		62.1
9月末	10,069	△0.1		62.4
10月末	10,070	△0.1		62.6
11月末	10,068	△0.1		64.3
12月末	10,067	△0.1		64.0
2017年 1月末	10,067	△0.1		60.9
(期 末) 2017年 2月15日	10,067	△0.1		63.6

(注) 騰落率は期首比です。

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	第10期 (2016年 2月16日 ～2017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)	0 (0)	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 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	1	0.012	

期中の平均基準価額は10,071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 (2016年2月16日から2017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	5,501,706	7,507,312 (1,000,000)
	地 方 債 証 券	508,590	—
	特 殊 債 証 券	500,175	— (500,000)

(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 (2016年2月16日から2017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303回大阪府公募公債(10年)	508,590	—	—
第189回政府保証預金保険機構債	500,175	—	—
第591回国庫短期証券	500,071	—	—

(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 (2016年2月16日から2017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 (2017年2月15日現在)

公社債

(A) 公社債種類別

国内 (邦貨建) 公社債

区 分	当 期			末			
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	残 存 期 間 別 組 入 比 率			
				う ち B B 格 以 下 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	503,500	63.6	—	—	—	63.6
合 計	500,000	503,500	63.6	—	—	—	63.6

(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) 一印は組入れなしです。

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

(B) 公社債銘柄別

国内 (邦貨建) 公社債

種 類	銘 柄	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
地 方 債 証 券	第303回大阪府公募公債(10年)	1.93	500,000	503,500	2017/6/28
合 計			500,000	503,500	

(注) 額面・評価額の単位未満は切捨てです。

CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）

■投資信託財産の構成（2017年2月15日現在）

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公 社 債	503,500	63.6
コール・ローン等、その他	287,849	36.4
投資信託財産総額	791,349	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

2017年2月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	791,349,724円
コール・ローン等	286,554,262
公 社 債(評価額)	503,500,000
未 収 利 息	1,295,462
(B) 負 債	205,404
未 払 解 約 金	50,807
未 払 信 託 報 酬	153,891
未 払 利 息	706
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	791,144,320
元 本	785,904,214
次 期 繰 越 損 益 金	5,240,106
(D) 受 益 権 総 口 数	785,904,214口
1万口当たり基準価額(C/D)	10.067円

(注記事項)

期首元本額	4,477,162,110円
期中追加設定元本額	78,053,908円
期中一部解約元本額	3,769,311,804円

■損益の状況

当期 自2016年2月16日 至2017年2月15日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	4,365,396円
受 取 利 息	4,608,111
支 払 利 息	△ 242,715
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△4,946,044
売 買 益	339,895
売 買 損	△5,285,939
(C) 信 託 報 酬 等	△ 166,028
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△ 746,676
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	205,390
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	5,781,392
(配 当 等 相 当 額)	(4,108,143)
(売 買 損 益 相 当 額)	(1,673,249)
(G) 計 (D+E+F)	5,240,106
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	5,240,106
追 加 信 託 差 損 益 金	5,781,392
(配 当 等 相 当 額)	(4,108,143)
(売 買 損 益 相 当 額)	(1,673,249)
分 配 準 備 積 立 金	4,417,393
繰 越 損 益 金	△4,958,679

(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。