

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／債券	
信託期間	2013年10月11日から2019年11月7日までです。	
運用方針	米ドル建のハイイールド債を主要投資対象とする米ドル売り／トルコリラ買いの為替取引を行う、「ストラクチャラ-米国ハイ・イールド・ボンド (I12シェアクラス、トルコリラ)」を主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保と中長期的な投資信託財産の成長を目指して運用を行います。なお、「CAマネーパブルファンド (適格機関投資家専用)」への投資も行います。	
主要運用対象	アムンディ・リそな米国ハイ・イールド債券ファンド (トルコリラコース)	ストラクチャラ-米国ハイ・イールド・ボンド (I12シェアクラス、トルコリラ) CAマネーパブルファンド (適格機関投資家専用)
	ストラクチャラ-米国ハイ・イールド・ボンド (I12シェアクラス、トルコリラ)	米ドル建のハイイールド債
	CAマネーパブルファンド (適格機関投資家専用)	本邦通貨表示の短期公社債
組入制限	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。原則として外貨建資産への直接投資は行いません。	
分配方針	毎決算時 (年12回、原則毎月8日。休業日の場合は翌営業日) に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益と売買益 (評価益を含みます。) 等の全額とします。分配金額は、委託者が基準価額水準および市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。	

## アムンディ・リそな米国ハイ・イールド債券ファンド (トルコリラコース)

### 運用報告書 (全体版) 第5作成期

第25期	(決算日 2015年11月9日)
第26期	(決算日 2015年12月8日)
第27期	(決算日 2016年1月8日)
第28期	(決算日 2016年2月8日)
第29期	(決算日 2016年3月8日)
第30期	(決算日 2016年4月8日)

### 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚くお礼申し上げます。

当ファンドはこの度、上記の決算を行いました。ここに、作成期中の運用状況についてご報告申し上げます。

今後とも一層のお引き立てを賜りますよう、よろしく申し上げます。

### アムンディ・ジャパン株式会社

〒100-0011 東京都千代田区内幸町1丁目2番2号

お客様サポートライン 0120-202-900 (フリーダイヤル)

受付は委託会社の営業日の午前9時から午後5時まで

ホームページアドレス : <http://www.amundi.co.jp>

# アムンディ・リそな米国ハイ・イールド債券ファンド（トルコリラコース）

## ■設定以来の運用実績

	決 算 期	基 準 価 額 (分配落)	騰 落 中 率			投 資 信 託 組 入 証 券 比 率	投 資 証 券 組 入 比 率	純資産総額
			税 分	込 配	み 金			
第1作成期	(設 定 日) 2013年10月11日	円 10,000				% -	% -	百万円 1
	1期 (2013年11月8日)	10,024		0	0.2	0.5	83.3	30
	2期 (2013年12月9日)	10,391		0	3.7	0.3	81.7	187
	3期 (2014年1月8日)	9,985		100	△ 2.9	0.5	97.4	248
	4期 (2014年2月10日)	9,485		100	△ 4.0	0.6	97.2	189
	5期 (2014年3月10日)	9,729		100	3.6	0.6	96.3	199
	6期 (2014年4月8日)	10,135		100	5.2	0.5	97.4	161
第2作成期	7期 (2014年5月8日)	10,136		100	1.0	0.4	97.5	169
	8期 (2014年6月9日)	10,307		100	2.7	0.4	95.8	179
	9期 (2014年7月8日)	10,017		100	△ 1.8	0.4	92.3	192
	10期 (2014年8月8日)	9,709		100	△ 2.1	0.3	97.7	248
	11期 (2014年9月8日)	10,043		100	4.5	0.2	97.5	349
	12期 (2014年10月8日)	9,726		100	△ 2.2	0.5	97.6	438
第3作成期	13期 (2014年11月10日)	10,348		100	7.4	0.5	97.4	441
	14期 (2014年12月8日)	10,726		100	4.6	0.5	96.7	389
	15期 (2015年1月8日)	10,138		100	△ 4.5	0.6	94.9	352
	16期 (2015年2月9日)	9,688		100	△ 3.5	0.6	97.1	345
	17期 (2015年3月9日)	9,251		100	△ 3.5	0.6	95.5	329
	18期 (2015年4月8日)	9,366		100	2.3	0.5	97.6	315
第4作成期	19期 (2015年5月8日)	8,989		100	△ 3.0	0.5	97.5	300
	20期 (2015年6月8日)	9,466		100	6.4	0.4	97.7	365
	21期 (2015年7月8日)	9,038		100	△ 3.5	0.6	97.6	281
	22期 (2015年8月10日)	8,799		100	△ 1.5	0.6	97.4	272
	23期 (2015年9月8日)	7,667		100	△11.7	0.8	97.2	214
	24期 (2015年10月8日)	7,816		80	3.0	0.8	97.2	210
第5作成期	25期 (2015年11月9日)	8,019		80	3.6	0.8	97.3	213
	26期 (2015年12月8日)	7,739		80	△ 2.5	0.6	97.2	161
	27期 (2016年1月8日)	7,051		80	△ 7.9	0.6	97.3	146
	28期 (2016年2月8日)	6,917		80	△ 0.8	0.7	97.3	142
	29期 (2016年3月8日)	6,964		80	1.8	0.5	97.4	141
	30期 (2016年4月8日)	6,862		80	△ 0.3	0.5	97.4	138

(注1) 設定日の基準価額は設定時の価額（10,000円）、純資産総額は設定元本を表示しております。

(注2) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注3) 当ファンドは運用成果の目標基準となるベンチマークを設けておりません。また、当ファンドと適切に対比できる参考指数はありません。以下同じ。

# アムンディ・リそな米国ハイ・イールド債券ファンド（トルコリラコース）

## ■ 当作成期中の基準価額等の推移

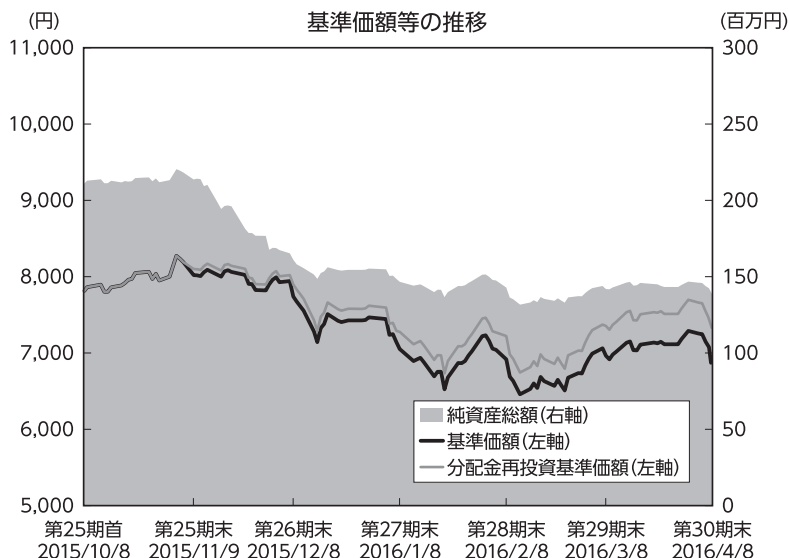
決算期	年 月 日	基準価額	騰 落 率	投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 比 率	投 資 証 券 組 入 比 率
第25期	(期 首)2015年10月 8 日	円 7,816	% —	% 0.8	% 97.2
	10月末	7,951	1.7	0.8	97.3
	(期 末)2015年11月 9 日	8,099	<b>3.6</b>	0.8	97.3
第26期	(期 首)2015年11月 9 日	8,019	—	0.8	97.3
	11月末	7,820	△2.5	0.9	97.0
	(期 末)2015年12月 8 日	7,819	<b>△2.5</b>	0.6	97.2
第27期	(期 首)2015年12月 8 日	7,739	—	0.6	97.2
	12月末	7,468	△3.5	0.6	97.4
	(期 末)2016年 1 月 8 日	7,131	<b>△7.9</b>	0.6	97.3
第28期	(期 首)2016年 1 月 8 日	7,051	—	0.6	97.3
	1 月末	7,025	△0.4	0.6	97.5
	(期 末)2016年 2 月 8 日	6,997	<b>△0.8</b>	0.7	97.3
第29期	(期 首)2016年 2 月 8 日	6,917	—	0.7	97.3
	2 月末	6,736	△2.6	0.5	97.3
	(期 末)2016年 3 月 8 日	7,044	<b>1.8</b>	0.5	97.4
第30期	(期 首)2016年 3 月 8 日	6,964	—	0.5	97.4
	3 月末	7,237	3.9	0.5	97.6
	(期 末)2016年 4 月 8 日	6,942	<b>△0.3</b>	0.5	97.4

(注) 期末基準価額は当該期の分配金込み、騰落率は各期首比です。

# アムンディ・リそな米国ハイ・イールド債券ファンド（トルコリラコース）

## 【基準価額等の推移】

第25期首	7,816円
第30期末	6,862円
既払分配金 (税込み)	480円
騰落率	△6.2% (分配金再投資ベース)



- (注1) 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 実際のファンドにおいては、分配金を再投資するかどうかについては、お客さまご利用のコースにより異なり、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なるため、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額は、2015年10月8日の値を基準価額と同一となるように指数化しています。

## 【基準価額の主な変動要因】

### 下落要因

- ① 2015年11月から2016年2月にかけて、エネルギーを含むコモディティ価格の下落により関連セクターが大きく下落したこと
- ② F R B（米連邦準備理事会）が2015年12月に9年半ぶりの利上げを行い、米国は利上げサイクルに入ったため、市場の重しとなったこと
- ③ 2015年11月以降、地政学的リスクの高まり、中国景気不安や原油価格の下落などからトルコリラが対円で下落したこと

### 上昇要因

- ① 2016年2月から3月にかけて、原油増産凍結合意への動きがみられたことを背景に、原油価格は反発し関連セクターが大きく反発したこと
- ② 同時期に、F R Bが金融緩和的な姿勢を示したことや、市場予想を上回る経済指標により、投資家心理が好転したこと
- ③ 2015年10月から11月にかけて、米国の利上げの先送り観測や、ユーロ圏の緩和期待、11月の総選挙での与党圧勝を受けた政権安定化への期待からトルコリラが対円で上昇したこと
- ④ 組入れたハイイールド債からインカムゲインや、米ドル売り／トルコリラ買いの為替取引により、プレミアム（金利差相当分の収益）を得たこと

## 【投資環境】

### ＜米国ハイイールド債券市場＞

ハイイールド債券市場は、2015年11月以降大きく下落しました。エネルギーを含むコモディティ価格が長期かつ大幅に下落する中、関連セクターの債券は売られました。また需給関係が崩れたことから、エネルギーやコモディティ関連セクター以外のハイイールド債も下落しました。2016年1月から2月にかけて原油価格が下落し、ハイイールド債の下落が加速しました。また、コモディティ価格の下落により世界経済の先行き不透明感や米国の景気後退懸念が広がる中で、米国が利上げのサイクルに入ったことも、市場の重しとなりました。その後原油増産凍結合意への動きなど供給安定化の兆しが出てきたことを背景に、原油価格は反発し、ハイイールド債も大きく反発しました。FRBが今後の利上げのペースは緩やかであることを強調し、金融緩和的な姿勢を示したことに加え、市場予想を上回る経済指標が発表されたことなどを背景に、市場の米国景気後退懸念は後退しました。

新規発行は低調な一方、格付が投資適格から非投資適格に引き下げられハイイールド債となった銘柄（フォーリンエンジェル）が増加しました。2016年1-3月期の合計で既に1,050億米ドルに達しており、2015年全体で合計530億米ドルであったのに比べ大幅に増えています。わずか3ヵ月でこれだけの金額に達し、年間の合計額として既に金融危機以来の水準となっています。需給関係は2月以降、作成期末に近づくに従って急速に改善しました。ハイイールド債に投資する投資信託において、2015年10-12月期は67億米ドルの純流出となったのに対し、2016年1-3月期は81億米ドルの純流入となりました。過去12ヵ月の発行額面ベースのハイイールド債のデフォルト（債務不履行）率は上昇傾向をたどり、2016年3月で3.22%となりました。エネルギーセクターと金属／鉱業セクターを除くと、デフォルト率は0.41%まで低下します。

### ＜為替市場＞

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

### ＜日本の短期国債市場＞

当作成期の日本の短期国債市場では、強い需要を背景に非常に低い利回りで推移しました。日銀による量的・質的金融緩和のもとで、TDB（国庫短期証券）3ヵ月物の利回りは0.00%近辺の利回り水準で始まりしました。日銀が金融緩和策としてTDBを大量に買い続けていることから、利回りは0.00%からマイナス圏での推移となりました。2016年1月末の日銀によるマイナス金利導入決定後に-0.20%まで低下したTDB3ヵ月物の利回りは、日銀のさらなる利下げが期待される中、急速に需給が逼迫（ひっばく）し、当作成期末には-0.48%まで低下しました。

## 【ポートフォリオ】

### ＜当ファンド＞

当ファンドは、円建の外国籍投資信託「ストラクチャル-米国ハイ・イールド・ボンド（I12シェアクラス、トルコリラ）」と、円建の国内籍投資信託「CAMネーブルファンド（適格機関投資家専用）」を主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保と中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行いました。当ファンドは「ストラクチャル-米国ハイ・イールド・ボンド（I12シェアクラス、トルコリラ）」に90%以上投資することを基本としていることから、この運用の基本方針に従い、当作成期初より当該投資信託を高位に組入れました。

（アムンディ・ジャパン株式会社）

# アムンディ・リそな米国ハイ・イールド債券ファンド（トルコリラコース）

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

ポートフォリオでは、当作成期末時点で化学、ゲーム、テクノロジーといったセクターに割安感があると考え、当ファンドの参考指数であるB of Aメリルリンチ・USハイ・イールド・コンストレインド・インデックス（以下、「参考指数」）に対してオーバーウェイトとしています。一方、銀行／金融、金属／鉱業、住宅建設といったセクターについては、今後の厳しい事業見通しや割高感から、アンダーウェイトとしています。ポートフォリオのデュレーションは参考指数より短くしている一方、ポートフォリオのスプレッド（国債との利回り格差）は参考指数に比べ拡大しており、利回りも高くなっています。

（J.P.モルガン・インベストメント・マネージメント・インク）

米ドル建資産に対し、米ドル売り／トルコリラ買いの為替取引を行い、当作成期を通じてトルコリラのエクスポージャーをおおむね100%に維持しました。

（アムンディ・ジャパン株式会社）

## ＜CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）＞

当作成期、主として6ヵ月以内に償還を迎える国債への投資と債券現先取引を行い、安定した収益の確保を目指して運用を行いました。

（アムンディ・ジャパン株式会社）

## 【分配金】

収益分配金につきましては、基準価額水準および市況動向等を勘案した結果、分配を行いました（各期の分配金額および分配原資の内訳につきましては、後記の「分配金のお知らせ」をご覧ください）。なお、収益分配に充てず、信託財産内に留保した収益については、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

## 【今後の運用方針】

### ＜当ファンド＞

当ファンドが投資する「ストラクチャル-米国ハイ・イールド・ボンド（I12シェアクラス、トルコリラ）」の組入比率を引き続き高位に保ちます。

（アムンディ・ジャパン株式会社）

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

ハイイールド債の大半の発行体は収益やキャッシュ・フローを順調に伸ばし、良好なファンダメンタルズを維持していくものとみています。現在のハイイールド債のスプレッドは魅力的なもので、先進国の景気後退リスクを過度に織り込んでいると考えます。今後も市場では変動性の高い状態が継続すると予想されるため、当ファンドのセクター配分や、ファンダメンタルズ及び個別銘柄分析に基づいた投資方針により投資機会を捉えることができると考えます。

（J.P.モルガン・インベストメント・マネージメント・インク）

今後もファンドの基本方針に従い、引き続き米ドル建資産に対し、米ドル売り／トルコリラ買いの為替取引を継続いたします。

（アムンディ・ジャパン株式会社）

## ＜CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）＞

安全性重視の観点から、6ヵ月以内に償還を迎える債券への投資により安定的な運用を行います。

（アムンディ・ジャパン株式会社）

# アムンディ・リそな米国ハイ・イールド債券ファンド（トルコリラコース）

## ■ 1万口当たりの費用明細

項 目	第25期～第30期 (2015年10月9日 ～2016年4月8日)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬 ( 投 信 会 社 ) ( 販 売 会 社 )  ( 受 託 会 社 )	35円 (14) (20)  ( 1 )	0.475% (0.189) (0.270)  (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 )	0 ( 0 )	0.005 (0.005)	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
合 計	35	0.480	

期中の平均基準価額は7,372円です。

- (注1) 費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。  
(注2) 消費税は報告日の税率を採用しています。  
(注3) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。  
(注4) 各項目の費用は、このファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。  
(注5) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

## ■ 当作成期中の売買及び取引の状況（2015年10月9日から2016年4月8日まで）

### 投資信託受益証券、投資証券

決 算 期		第 25 期 ～ 第 30 期			
		買 付		売 付	
		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
国内	CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）	口 —	千円 —	口 893,124	千円 900
外国	(ルクセンブルク) ストラクチュラ-米国ハイ・イールド・ボンド (I12シェアクラス、トルコリラ)	850	5,913	7,660	58,191

- (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10月9日から2016年4月8日まで）

当作成期中における利害関係人との取引等はありません。

- (注) 利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

# アムンディ・リそな米国ハイ・イールド債券ファンド（トルコリラコース）

## ■組入資産の明細（2016年4月8日現在）

### (1) 国内（邦貨建）投資信託受益証券

銘	柄	第4作成期末 (第24期末)	第5作成期末(第30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）		1,627,663	734,539	740
合計	口数・金額	1,627,663	734,539	740
	銘柄数<比率>	1	1	<0.5%>

(注1) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。以下同じ。

(注2) 評価額の単位未満は切捨てです。以下同じ。

### (2) 外国（邦貨建）投資証券

銘	柄	第4作成期末 (第24期末)	第5作成期末(第30期末)	
		口数	口数	評価額
		口	口	千円
(ルクセンブルク) ストラクチャル-米国ハイ・イールド・ボンド (I12シェアクラス、トルコリラ)		27,030	20,220	134,483
合計	口数・金額	27,030	20,220	134,483
	銘柄数<比率>	1	1	<97.4%>

## ■投資信託財産の構成（2016年4月8日現在）

項目	第5作成期末(第30期末)	
	評価額	比率
投資信託受益証券	千円 740	% 0.5
投資証券	134,483	96.2
コール・ローン等、その他	4,643	3.3
投資信託財産総額	139,866	100.0

(注) 金額の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（トルコリラコース）

## ■資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	(2015年11月9日)	(2015年12月8日)	(2016年1月8日)	(2016年2月8日)	(2016年3月8日)	(2016年4月8日)現在
	第25期末	第26期末	第27期末	第28期末	第29期末	第30期末
(A) 資 産	215,993,352円	165,293,222円	148,421,922円	146,701,607円	143,641,346円	139,866,933円
コール・ローン等	6,547,055	7,069,526	4,839,226	4,530,232	4,743,145	4,643,592
投資信託受益証券(評価額)	1,640,196	940,195	940,195	940,195	740,121	740,121
投 資 証 券(評価額)	207,806,100	156,583,500	142,642,500	139,008,960	138,158,080	134,483,220
未 収 入 金	—	700,000	—	2,222,220	—	—
未 収 利 息	1	1	1	—	—	—
(B) 負 債	2,311,370	4,218,805	1,792,770	3,845,851	1,740,102	1,735,406
未 払 収 益 分 配 金	2,131,765	1,664,968	1,663,690	1,652,167	1,630,108	1,610,332
未 払 解 約 金	—	2,408,357	—	2,070,988	—	—
未 払 信 託 報 酬	177,693	142,038	124,301	116,665	102,860	116,687
そ の 他 未 払 費 用	1,912	3,442	4,779	6,031	7,134	8,387
(C) 純 資 産 総 額 (A－B)	213,681,982	161,074,417	146,629,152	142,855,756	141,901,244	138,131,527
元 本	266,470,696	208,121,021	207,961,355	206,520,941	203,763,544	201,291,540
次 期 繰 越 損 益 金	△ 52,788,714	△ 47,046,604	△ 61,332,203	△ 63,665,185	△ 61,862,300	△ 63,160,013
(D) 受 益 権 総 口 数	266,470,696口	208,121,021口	207,961,355口	206,520,941口	203,763,544口	201,291,540口
1万口当たり基準価額(C/D)	8,019円	7,739円	7,051円	6,917円	6,964円	6,862円

(注記事項)

作成期首元本額	269,546,263円
作成期中追加設定元本額	10,235,011円
作成期中一部解約元本額	78,489,734円

# アムンディ・リそな米国ハイ・イールド債券ファンド（トルコリラコース）

## ■損益の状況

第25期 自2015年10月9日 至2015年11月9日 第28期 自2016年1月9日 至2016年2月8日  
 第26期 自2015年11月10日 至2015年12月8日 第29期 自2016年2月9日 至2016年3月8日  
 第27期 自2015年12月9日 至2016年1月8日 第30期 自2016年3月9日 至2016年4月8日

項 目	第 25 期	第 26 期	第 27 期	第 28 期	第 29 期	第 30 期
(A) 配 当 等 收 益	2,137,634円	1,665,609円	1,672,017円	1,665,291円	1,638,400円	1,619,876円
受 取 配 当 金	2,137,600	1,665,565	1,672,000	1,665,282	1,638,400	1,619,876
受 取 利 息	34	44	17	9	—	—
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	5,569,966	△ 5,712,581	△14,168,709	△ 2,637,259	1,062,755	△ 1,944,804
売 買 益	5,602,970	478,692	3	24,351	1,065,167	56,241
売 買 損	△ 33,004	△ 6,191,273	△14,168,712	△ 2,661,610	△ 2,412	△ 2,001,045
(C) 信 託 報 酬 等	△ 179,605	△ 143,568	△ 125,638	△ 117,917	△ 103,963	△ 117,940
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	7,527,995	△ 4,190,540	△12,622,330	△ 1,089,885	2,597,192	△ 442,868
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△53,059,600	△36,943,712	△42,014,850	△55,389,734	△56,822,142	△54,717,048
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 5,125,344	△ 4,247,384	△ 5,031,333	△ 5,533,399	△ 6,007,242	△ 6,389,765
(配 当 等 相 当 額)	( 18,764,464)	( 14,690,542)	( 14,681,225)	( 14,535,010)	( 14,310,562)	( 14,152,977)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△23,889,808)	(△18,937,926)	(△19,712,558)	(△20,068,409)	(△20,317,804)	(△20,542,742)
(G) 計 (D+E+F)	△50,656,948	△45,381,636	△59,668,513	△62,013,018	△60,232,192	△61,549,681
(H) 收 益 分 配 金	△ 2,131,765	△ 1,664,968	△ 1,663,690	△ 1,652,167	△ 1,630,108	△ 1,610,332
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	△52,788,714	△47,046,604	△61,332,203	△63,665,185	△61,862,300	△63,160,013
追 加 信 託 差 損 益 金	△ 5,157,320	△ 4,390,363	△ 5,148,623	△ 5,638,105	△ 6,062,055	△ 6,498,261
(配 当 等 相 当 額)	( 18,732,488)	( 14,547,563)	( 14,563,935)	( 14,430,304)	( 14,255,749)	( 14,044,481)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△23,889,808)	(△18,937,926)	(△19,712,558)	(△20,068,409)	(△20,317,804)	(△20,542,742)
分 配 準 備 積 立 金	13,064,100	10,182,071	10,031,654	9,891,909	9,689,545	9,503,982
繰 越 損 益 金	△60,695,494	△52,838,312	△66,215,234	△67,918,989	△65,489,790	△66,165,734

(注1) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

### 分配金の計算過程

第25期計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,087,830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(18,764,464円)および分配準備積立金(13,076,059円)より分配対象収益は33,928,353円(10,000口当たり1,273円)であり、うち2,131,765円(10,000口当たり80円)を分配金額としております。

第26期計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,522,041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(14,690,542円)および分配準備積立金(10,182,019円)より分配対象収益は26,394,602円(10,000口当たり1,268円)であり、うち1,664,968円(10,000口当たり80円)を分配金額としております。

第27期計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,546,379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(14,681,225円)および分配準備積立金(10,031,675円)より分配対象収益は26,259,279円(10,000口当たり1,262円)であり、うち1,663,690円(10,000口当たり80円)を分配金額としております。

第28期計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,547,374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(14,535,010円)および分配準備積立金(9,891,996円)より分配対象収益は25,974,380円(10,000口当たり1,257円)であり、うち1,652,167円(10,000口当たり80円)を分配金額としております。

第29期計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,575,336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(14,310,562円)および分配準備積立金(9,689,504円)より分配対象収益は25,575,402円(10,000口当たり1,255円)であり、うち1,630,108円(10,000口当たり80円)を分配金額としております。

第30期計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,501,936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(14,152,977円)および分配準備積立金(9,503,882円)より分配対象収益は25,158,795円(10,000口当たり1,249円)であり、うち1,610,332円(10,000口当たり80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（トルコリラコース）

## ■分配金のお知らせ

決 算 期	第25期	第26期	第27期	第28期	第29期	第30期
1万口当たりの分配金（税込み）	80円	80円	80円	80円	80円	80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25期	第26期	第27期	第28期	第29期	第30期
	(2015年10月9日 ～2015年11月9日)	(2015年11月10日 ～2015年12月8日)	(2015年12月9日 ～2016年1月8日)	(2016年1月9日 ～2016年2月8日)	(2016年2月9日 ～2016年3月8日)	(2016年3月9日 ～2016年4月8日)
当期分配金	80	80	80	80	80	80
（対基準価額比率）	(0.988%)	(1.023%)	(1.122%)	(1.143%)	(1.136%)	(1.152%)
当期の収益	78	73	74	74	77	74
当期の収益以外	1	6	5	5	2	5
翌期繰越分配対象額	1,193	1,188	1,182	1,177	1,175	1,169

（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（I 12シエアクラス、トルコリラ）」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2016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）

（2016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	HCA INC 7.50 11-22 15/02S	7.5	7,645,000.00	933,866,060	2022/2/15
		SPRINT CORP 7.875 14-23 15/09S	7.875	11,085,000.00	910,192,624	2023/9/15
		MGM RESORT 7.75 12-22 15/03S	7.75	6,050,000.00	731,542,791	2022/3/15
		CAESARS OP/CORP (DEFAULT) 13-20 15/02S	9	7,515,000.00	701,433,632	2020/2/15
		FIRST DATA CORPORA 5.75 15-24 15/01S	5.75	5,930,000.00	641,015,518	2024/1/15
		RADIO SYST CORP 144A 8.375 12-19 01/11S	8.375	4,565,000.00	510,750,356	2019/11/01
		HARRAHS OPERATING(DEFAULT)LT09-17 01/06S	11.25	5,470,000.00	506,131,011	2017/6/01
		REYNOLDS GROUP 9.875 12-19 15/08S	9.875	4,493,000.00	501,654,777	2019/8/15
		VPII ESCROW CORP 144A 7.50 13-21 15/07S	7.5	4,940,000.00	480,060,045	2021/7/15
		ARDAGH GLASS FIN 144A 9.125 10-20 15/10S	9.125	4,075,000.00	455,102,745	2020/10/15
カナダ	債券	DISH DBS CORP 5.875 15-24 15/11S	5.875	4,400,000.00	439,681,289	2024/11/15
		SPRINT CAP CORP 8.75 02-32 15/03S	8.75	5,130,000.00	435,330,334	2032/3/15
アイルランド	債券	SERVICE CORP INTL 7.50 07-27 01/04S	7.5	3,465,000.00	426,882,297	2027/4/01
		INTELSAT 7.25 10-20 15/10S	7.25	5,905,000.00	418,307,956	2020/10/15
アメリカ	株式	ADVENT INTL 144A 8.125 12-20 01/10S	8.125	3,515,000.00	393,509,234	2020/10/01
		CLEAR CHANNEL WORLDW 7.625 12-20 15/03S	7.625	3,995,000.00	384,597,000	2020/3/15
		WINDSTREAM GTD 7.75 11-21 01/10S	7.75	4,280,000.00	374,209,684	2021/10/01
		REICHHOLD CAYMAN EQUITY	—	5,835.00	373,997,585	—
		TENET HEALTHCARE CORP 8.125 13-22 01/04S	8.125	3,365,000.00	373,368,737	2022/4/01
		CLEAR CHANNEL 6.50 13-22 15/11S	6.5	3,400,000.00	364,029,970	2022/11/15
		KINETICS CONCEPT 10.50 13-18 01/11S	10.5	3,350,000.00	361,998,605	2018/11/01
		HEXION US FIN 6.625 12-20 15/04S	6.625	4,060,000.00	359,776,119	2020/4/15
		GREAT LAKES DREDGE 7.375 11-19 01/02S	7.375	3,475,000.00	357,158,743	2019/2/01
		REICHHOLD HLDG INTL 12.00 15-17 31/03Q	12	3,208,502.02	346,213,350	2017/3/31
アメリカ	債券	ARGOS MERGER 144A 7.125 15-23 15/03S	7.125	2,990,000.00	339,858,197	2023/3/15
		LSB INDUSTRIES 7.75 14-19 01/08S	7.75	3,380,000.00	338,046,948	2019/8/01
		JACK COOPER 144A 10.25 13-20 01/06S	10.25	4,375,000.00	333,999,636	2020/6/01
		GEO GROUP 6.625 11-21 15/02S	6.625	2,980,000.00	332,811,333	2021/2/15
		INFOR(US) 6.50 16-22 15/05S	6.5	3,355,000.00	330,014,917	2022/5/15
		REGENCY AGENCY 5.50 12-23 15/04S	5.5	3,235,000.00	319,649,284	2023/4/15

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（I 12シェアクラス、トルコリラ）

(2016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	1,102,963.17	トルコリラ	3,355,000.00	2016/5/25	6,249,703
米ドル	41,397.68	トルコリラ	125,000.00	2016/5/25	199,681
米ドル	29,842.38	トルコリラ	90,000.00	2016/5/25	139,833
米ドル	30,687.44	トルコリラ	90,000.00	2016/5/25	47,529
				合計	6,636,746

CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）

< 2. 補足情報 >

「CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）」の決算日（2016年2月15日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、以下2016年4月8日現在における「CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）」の補足情報を掲載しております。

■組入資産の明細（2016年4月8日現在）

公社債

(A) 公社債種類別

国内（邦貨建）公社債

区 分	2016 年 4 月 8 日 現 在						
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	う ち 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	500,000	500,008	16.5	—	—	—	16.5
合 計	500,000	500,008	16.5	—	—	—	16.5

(注1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

(注2) 単位未満は切捨てです。

(注3) —印は組入れなしです。

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

(B) 公社債銘柄別

国内（邦貨建）公社債

種 類	銘	柄	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
			%	千円	千円	
国 債 証 券	第582回国庫短期証券		—	500,000	500,008	2016/4/18
合 計				500,000	500,008	

(注) 額面・評価額の単位未満は切捨てです。

## ストラクチャラ-米国ハイ・イールド・ボンド

決算日 2015年12月31日  
 (計算期間：2015年1月1日～2015年12月31日)

「ストラクチャラ-米国ハイ・イールド・ボンド (I 12シェアクラス、トルコリラ)」は、「ストラクチャラ-米国ハイ・イールド・ボンド」にて既存の他のクラスと合わせた合同運用が行われております。

「ストラクチャラ-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2015年12月31日を基準日とするデータおよび年次報告書(監査済み)に基づき、委託会社が抜粋・翻訳・作成したものです。

開示情報につきましては、各クラス別のものがないので、「ストラクチャラ-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。

商品分類	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。	
ファンドの関係法人	投資顧問会社	アムンディ・ジャパン株式会社
	副投資顧問会社	J.P.モルガン・インベストメント・マネージメント・インク
	管理会社	アムンディ・ルクセンブルク・エス・エー
	保管銀行・管理事務代行会社	CACEIS・バンク・ルクセンブルク・エス・エー
費用	運用報酬等	純資産総額に対し年率0.73%
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

項目	当期
	円
(a) 運用報酬	476,478,644
(b) 管理費用等	144,644,067
(c) その他の費用	12,388,120
合計	633,510,831

■純資産計算書

2015年12月31日現在

項目	当期末
	円
資産合計	56,162,475,561
有価証券	52,240,938,487
預金	1,317,601,499
未収利息	1,073,486,482
有価証券売却未収入金	724,336,487
為替予約取引評価勘定	466,871,026
為替未収入金	339,241,580
負債合計	2,021,421,369
借入金	28,258,618
未払配当金	880,134,400
未払解約金	339,241,580
有価証券買付未払金	339,241,580
未払運用報酬	86,108,363
未払管理費用	8,103,392
未払税	1,375,530
為替未払金	338,949,614
その他の負債	8,292
純資産	54,141,054,192



## ■有価証券明細

## (1) 公社債

(2015年12月31日現在)

銘柄		通貨	額面金額	評価額	銘柄		通貨	額面金額	評価額
アイランド	ALLEGION PLC 5.875 15-23 15/09S	USD	240,000.00	29,556,480	CCO HOLDINGS 6.50 11-21 30/04S	USD	2,690,000.00	335,550,308	
	ARDAGH GLASS FIN 144A 9.125 10-20 15/10S	USD	4,075,000.00	504,908,154	CCO HOLDINGS 6.625 12-22 31/01S	USD	640,000.00	81,070,740	
アメリカ	ARDAGH PACKAGING 144A 6.75 14-21 31/01S	USD	200,000.00	23,186,860	CCOH SAFARI LLC 5.75 15-26 15/02S	USD	865,000.00	104,835,582	
	ARDAGH PACKAGING 144A 7.00 13-20 15/11S	USD	409,411.76	49,311,747	CENTRAL GARDEN&PET 6.125 15-23 15/11S	USD	620,000.00	75,701,638	
	ENDO FIN/ENDO LTD/ 6.00 15-23 15/07S	USD	1,840,000.00	221,440,176	CENTURY LINK 6.75 13-23 01/12S	USD	1,760,000.00	199,479,699	
	JAMES HARDIE INTL F 5.875 15-23 15/02S	USD	745,000.00	91,860,263	CENTURYLINK 5.80 12-22 15/03S	USD	485,000.00	53,700,129	
	21ST CENTURY ONCOLOGY 11.00 15-23 01/05S	USD	930,000.00	85,583,872	CHEMOURS CO 144A 6.625 15-23 15/05S	USD	1,375,000.00	118,265,014	
	ACCO BRANDS 6.75 13-20 30/04S	USD	450,000.00	56,149,191	CHEMOURS CO 144A 7.00 15-25 15/05S	USD	455,000.00	37,492,942	
	ADT CORP 3.50 13-22 15/07S	USD	2,075,000.00	225,180,075	CHESAPEAKE 6.125 12-22 15/07S	USD	2,730,000.00	311,061,421	
	ADT CORP 6.25 14-21 15/10S	USD	165,000.00	20,794,462	CHESAPEAKE ENERGY 8.00 15-22 15/12S	USD	1,518,000.00	89,477,821	
	ADVENT INTL 144A 8.125 12-20 01/10S	USD	4,175,000.00	526,087,590	CHESAPEAKE ENERGY FL R 14-19 15/04Q	USD	270,000.00	9,133,277	
	AIR MED MERGER 144A 6.375 15-23 15/06S	USD	1,250,000.00	133,828,178	CHINOS INTER A 144A 7.75 13-19 01/05S	USD	2,845,000.00	87,271,009	
	ALCATEL LUCENT 144A 6.75 13-20 15/11S	USD	65,000.00	8,288,325	CHIQUITA BRANDS 7.875 13-21 01/02S	USD	171,000.00	21,650,392	
	ALCATEL LUCENT USA 8.875 13-20 01/01S	USD	640,000.00	81,993,066	CINERMARK USA INC SUB 7.375 11-21 15/06S	USD	1,295,000.00	164,192,686	
	ALERE SUB 6.50 13-21 15/06S	USD	1,415,000.00	164,038,521	CIT GROUP INC 5.50 12-19 15/02S	USD	1,790,000.00	225,842,503	
	ALLEGION 5.75 14-21 01/10S	USD	1,295,000.00	159,676,565	CLAIRE S STORES 8.875 11-19 15/03S	USD	3,140,000.00	90,182,148	
	ALLY FINANCE 4.625 15-22 19/05S	USD	275,000.00	33,433,767	CLAIRE S STORES 144A 9.00 12-19 15/03S	USD	3,965,000.00	293,336,330	
	ALLY FINANCIAL 4.625 15-25 30/03S	USD	2,365,000.00	280,355,369	CLEAR CHANNEL 6.50 13-22 15/11S	USD	3,400,000.00	401,330,076	
	ALLY FINANCIAL 5.125 14-24 30/09S	USD	545,000.00	67,587,254	CLEAR CHANNEL COMM 9.00 11-21 01/03S	USD	1,850,000.00	153,389,647	
	ALLY FINANCIAL INC 5.75 15-25 20/11S	USD	610,000.00	74,049,904	CLEAR CHANNEL WORLDW 6.50 13-22 15/11S	USD	3,055,000.00	350,155,143	
	AMERICAN ENERGY 144A 7.125 14-20 01/08S	USD	850,000.00	39,877,790	CLEAR CHANNEL WORLDW 7.625 12-20 15/03S	USD	265,000.00	29,293,810	
	AMERICAN ENERGY 144A 7.375 14-21 01/11S	USD	1,120,000.00	53,892,156	CLEAR CHANNEL WORLDW 7.625 12-20 15/03S	USD	3,995,000.00	446,861,104	
	AMKOR TECHNOLOGY 6.375 12-22 01/10S	USD	1,250,000.00	20,653,748	CNH INDUSTRIAL 4.375 15-20 06/11S	USD	575,000.00	65,424,085	
	AMKOR TECHNOLOGY 6.625 11-21 01/06S	USD	2,085,000.00	250,085,186	COGENT COMM 144A 5.375 15-22 01/03S	USD	875,000.00	102,889,810	
	ANTERO RESOURCES 5.125 15-22 01/12S	USD	45,000.00	4,113,764	COGENT COMM FIN 144A 5.625 14-21 15/04S	USD	2,520,000.00	284,196,918	
	ANTERO RESOURCES 5.375 14-21 01/11S	USD	3,675,000.00	163,188,066	COMMSCOPE INC 144A 5.00 14-21 15/06S	USD	360,000.00	41,790,480	
	ARGOS MERGER 144A 7.125 15-23 15/03S	USD	3,100,000.00	370,583,758	COMMUNICATIONS SALES 8.25 15-23 15/10S	USD	2,225,000.00	228,846,185	
	ASHLAND INC 4.75 13-22 15/08S	USD	1,485,000.00	174,847,363	CONSOL ENERGY 5.875 14-22 15/04S	USD	130,000.00	9,712,822	
	ASHTAD CAPITAL 144A 6.50 12-22 15/07S	USD	475,000.00	59,854,277	CORRECTION CORP OF AM 4.625 13-23 01/05S	USD	1,045,000.00	121,652,917	
	ASPECT SOFTWARE 10.625 11-17 15/05S	USD	3,395,000.00	335,910,231	CSI COMPRESSO LP 7.25 15-22 15/08S	USD	810,000.00	72,104,818	
	ASSOCIATED MATERIALS 9.125 11-17 01/11S	USD	953,000.00	80,248,789	DANA HOLDING CORP 5.50 14-24 15/12S	USD	495,000.00	58,411,669	
	ATWOOD OCEANICS 6.50 12-20 01/02U	USD	1,415,000.00	91,376,112	DANA HOLDINGS 6.00 13-23 15/09S	USD	1,245,000.00	152,665,261	
	AUDAET NORTH 144A 6.00 13-21 15/06S	USD	2,090,000.00	254,559,239	DAVITA HEALTHCARE 5.00 15-25 01/05S	USD	555,000.00	64,667,340	
	AVAYA -144 A- 7.00 11-19 01/04S	USD	1,915,000.00	171,621,857	DENBURY RESOURCE INC 4.625 13-23 15/07S	USD	360,000.00	13,845,424	
	AVIS BUDGET CAR 5.50 13-23 01/04S	USD	1,235,000.00	149,889,508	DENBURY RESOURCE SUB 5.50 14-22 01/05S	USD	2,685,000.00	111,684,192	
	BANK OF AMERICA CORP FL R 08-XX 30/01S	USD	3,335,000.00	409,135,259	DINEGY 7.375 15-22 01/11S	USD	1,715,000.00	180,499,104	
	BC MOUNTAIN FIN 144A 7.00 13-21 01/02	USD	1,010,000.00	95,072,139	DISH DBS CORP 5.00 12-23 15/03S	USD	1,495,000.00	156,181,129	
	BELDEN INC 5.50 12-22 01/09S	USD	2,830,000.00	330,221,781	DISH DBS CORP 5.875 12-22 15/07S	USD	3,105,000.00	348,983,421	
	BERRY PETROLEUM 6.375 12-22 15/09S	USD	525,000.00	15,788,718	DISH DBS CORP 5.875 15-24 15/11S	USD	4,400,000.00	469,921,317	
	BG FOODS INC 4.625 13-21 01/06S	USD	940,000.00	111,983,835	DISH DBS CORPORATION 6.75 11-21 01/06S	USD	1,275,000.00	155,221,229	
	BLACKBOARD 144A 7.75 13-19 15/11S	USD	1,140,000.00	119,651,413	DJO FINCO 144A 8.125 15-21 15/06S	USD	3,390,000.00	367,020,019	
	BLUE RACER MID 144A 6.125 14-22 15/11S	USD	1,280,000.00	107,399,368	DYNEGY 7.625 15-24 01/11S	USD	565,000.00	58,298,411	
	BREITBURN ENEGY WI 8.625 11-20 15/10	USD	2,580,000.00	65,200,656	ENERGIZER SPINCO INC 5.50 15-25 15/06S	USD	1,625,000.00	184,638,271	
	BUMBLE BEE 144A 9.00 10-17 15/12S	USD	1,988,000.00	243,182,040	ENTEGRIS 144A 6.00 14-22 01/04S	USD	825,000.00	100,980,127	
	CAESARS ENTERTAIN (DEFAULT) 12-20 15/02S	USD	1,240,000.00	115,976,401	EP ENERGY 9.375 12-20 01/05S	USD	2,480,000.00	188,321,809	
	CAESARS OP/CORP (DEFAULT) 13-20 15/02S	USD	10,390,000.00	965,520,684	EP ENERGY AS WHEN I 7.75 12-22 01/09S	USD	1,528,000.00	95,581,589	
	CALIFORNIA RES 144A 8.00 15-22 15/12S	USD	1,220,000.00	77,415,842	EQUINIX 5.875 15-26 15/01S	USD	365,000.00	45,260,468	
	CALIFORNIA RESOURCES 6.00 15-24 15/11S	USD	455,000.00	17,382,494	EV ENERGY 8.00 11-19 15/04S	USD	1,430,000.00	86,871,028	
	CAREFUSION 5.50 14-24 15/06S	USD	155,000.00	17,806,666	FGI 7.875 13-20 01/05S	USD	1,151,000.00	100,556,237	
	CCO HLDGS 144A 5.375 15-25 01/05S	USD	740,000.00	89,240,839	FIRST DATA 144A 5.375 15-23 15/08S	USD	2,765,000.00	336,357,577	
	CCO HLDGS LLC/CAP COR 5.125 15-23 01/05S	USD	1,555,000.00	186,864,171	FIRST DATA CORP (PIK) 8.75 10-22 15/01S	USD	2,234,000.00	280,496,343	

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	評価額	銘柄		通貨	額面金額	評価額
FIRST DATA CORP	144A 7.00 15-23 01/12S	USD	1,560,000.00	188,116,201	MARIPOSA BORROW	144A 8.00 13-21 15/10S	USD	1,685,000.00	151,516,053
FIRST DATA CORPORA	5.75 15-24 15/01S	USD	7,135,000.00	852,940,360	MARIPOSA BORROW	144A 8.75 13-21 15/10S	USD	840,000.00	65,428,446
FRONTIER COMM	144A 10.50 15-22 15/09S	USD	690,000.00	82,210,860	MCGRAW GLB EDC FL R	14-21 01/04S	USD	1,205,000.00	154,861,721
FRONTIER COMM	144A 11.00 15-25 15/09S	USD	1,720,000.00	205,045,219	MEMORIAL PROD PART	7.625 13-21 01/05S	USD	1,845,000.00	67,692,999
GCI	6.75 11-21 01/06S	USD	425,000.00	52,124,361	MEMORIAL PROD PARTNER	6.875 15-22 01/08S	USD	575,000.00	20,405,037
GENERAL CABLE CORP FL R	14-22 01/10S	USD	2,890,000.00	269,430,707	MGM RESORT	5.25 13-20 31/03S	USD	2,425,000.00	290,367,629
GENERAL MOTORS	4.25 13-18 15/05S	USD	1,870,000.00	222,830,341	MGM RESORT	7.75 12-22 15/03S	USD	6,050,000.00	776,509,885
GENERAL MOTORS	4.875 14-23 02/10S	USD	840,000.00	103,355,724	MICRON TECHNOLOGY	5.50 14-25 01/02S	USD	165,000.00	17,399,943
GEO GROUP	6.625 11-21 15/02S	USD	3,780,000.00	469,079,517	MICRON TECHNOLOGY	5.875 15-22 15/02S	USD	165,000.00	19,450,707
GLYMBOREE	9.125 11-18 01/12S	USD	4,760,000.00	134,561,977	MICRON TECHNOLOGY	144A 5.25 15-24 15/01S	USD	1,565,000.00	166,140,917
GOODYEAR TIRE & RU	5.125 15-23 15/11	USD	645,000.00	79,548,648	MPLX LP	5.50 15-23 15/02S	USD	1,850,000.00	196,107,190
GREAT LAKES DREDGE	7.375 11-19 01/02S	USD	3,955,000.00	446,031,274	NEPTUNE FINCO	144A 10.125 15-23 15/01S	USD	675,000.00	85,157,576
HALCON RESOURCE	144A 13.00 15-22 15/02S	USD	2,433,000.00	102,437,200	NEPTUNE FINCO CORP	10.875 15-25 15/10S	USD	1,005,000.00	127,243,531
HARRIS OPERATING (DEFAULT) LT	09-17 01/06S	USD	5,470,000.00	491,042,652	NEXEO SOLUTION SUB	8.375 12-18 01/03S	USD	2,045,000.00	232,165,575
HCA	5.875 15-26 15/02S	USD	1,585,000.00	191,620,899	NEXSTAR BROADCASTING	6.125 15-22 29/02S	USD	715,000.00	84,720,755
HCA INC	5.375 15-25 01/02S	USD	4,120,000.00	490,168,553	NEXSTAR BROADCAST	6.875 13-20 15/11S	USD	1,345,000.00	165,388,652
HCA INC	7.50 11-22 15/02S	USD	7,645,000.00	1,021,405,864	NIELSEN FIN -144A-	5.00 14-22 15/04S	USD	1,710,000.00	203,904,521
HD SUPPLY	11.50 13-20 15/07S	USD	585,000.00	78,186,740	NORANDA ALUMINIUM	11.00 14-19 01/06S	USD	2,275,000.00	30,487,865
HEALTHSOUTH	144A 5.75 15-25 15/09S	USD	525,000.00	59,365,579	NRG ENERGY	7.875 11-21 15/05S	USD	1,190,000.00	133,462,577
HERTZ	5.875 12-20 15/10S	USD	2,435,000.00	303,826,582	NRG ENERGY INC	6.25 14-22 15/07S	USD	1,010,000.00	105,910,970
HERTZ	7.375 11-21 15/01S	USD	935,000.00	116,707,158	OASIS PETROLEUM	6.875 14-22 15/03S	USD	1,935,000.00	152,464,879
HEXION US FIN	6.625 12-20 15/04S	USD	4,790,000.00	450,886,681	OMEGA US SUB	144A 8.75 15-23 15/07S	USD	895,000.00	99,858,376
HEXION US FIN	8.875 10-18 01/02S	USD	1,250,000.00	108,023,399	OSHKOSH	5.375 15-25 01/03S	USD	515,000.00	61,332,401
HILLP / HILFIN	144A 7.25 12-20 01/10S	USD	2,560,000.00	312,382,035	OSHKOSH CORP	5.375 14-22 01/03S	USD	355,000.00	43,407,215
HMAN FINANCE	144A 6.375 14-22 15/07S	USD	1,430,000.00	142,993,153	PEABODY ENERGY	6.25 12-21 15/11S	USD	2,360,000.00	42,260,785
HRG GROUP	144A 7.75 15-22 15/01S	USD	315,000.00	37,750,824	PEABODY ENERGY	6.50 10-20 15/09S	USD	170,000.00	2,760,770
HUNTSMAN INTL	4.875 12-20 15/11S	USD	1,040,000.00	114,592,816	PLANTRONICS INC	5.50 15-23 31/05S	USD	980,000.00	117,490,508
IHEARTCOMMUNICATIO	10.625 15-23 15/03	USD	1,140,000.00	94,624,040	POST HOLDINGS	7.375 12-22 15/02S	USD	2,930,000.00	367,821,196
INFINITY ACQ LLC	144A 7.25 14-22 01/08S	USD	1,465,000.00	152,440,821	POST HOLDINGS	144A 6.00 14-22 15/12S	USD	150,000.00	17,773,585
INFOR SOFTWARE PIK	7.125 14-21 01/05S	USD	2,400,000.00	210,756,825	POST HOLDINGS	144A 7.75 15-24 15/03S	USD	645,000.00	81,857,734
INFOR US INC	6.50 15-22 15/05S	USD	3,460,000.00	354,828,122	POST HOLDINGS INC	8.00 15-25 15/07S	USD	910,000.00	116,447,055
INTL LEASE FINANCE	5.875 12-19 01/04S	USD	1,685,000.00	215,053,474	QWEST CAP FDG	7.75 01-31 15/02S	USD	2,295,000.00	233,912,455
INVENTIV HEALTH	10.00 15-18 15/08S	USD	1,133,000.00	135,612,755	RADIO SYST CORP	144A 8.375 12-19 01/11S	USD	4,565,000.00	570,769,284
INVENTIV HEALTH	10.00 15-18 15/08S	USD	769,000.00	88,344,040	RAIN CII CARBON	144A 8.00 10-18 01/12S	USD	935,000.00	97,572,771
INVENTIV HEALTH	144A 10.00 14-18 15/08	USD	1,654,756.00	189,603,564	RAIN CII CARBON	144A 8.25 12-21 15/01S	USD	125,000.00	11,803,947
INVENTIV HEALTH	144A 9.00 12-18 15/01S	USD	3,015,000.00	370,849,911	REGAL ENTERTAINMENT	5.75 14-22 15/03S	USD	1,100,000.00	133,907,092
ITALICS MERGER SUB	7.125 15-23 15/07S	USD	1,635,000.00	175,538,962	REGENCY AGENCY	5.50 12-23 15/04S	USD	3,235,000.00	355,103,297
JACK COOPER	144A 9.25 13-20 01/06S	USD	4,375,000.00	440,110,505	REICHHOLD	12.00 15-17 31/03Q	USD	1,270,000.00	152,774,640
JC PENNEY CO INC	6.375 07-36 15/10S	USD	2,129,000.00	161,027,928	REICHHOLD HLDG INTL	12.00 15-17 31/03Q	USD	3,114,370.18	374,643,134
JCH PARENT PIK	144A 10.50 14-19 15/03S	USD	1,534,037.00	115,566,276	REICHHOLD	144A 9.00 12-17 20/04S	USD	3,734,025.66	5
KINETICS CONCEPT	10.50 13-18 01/11S	USD	3,350,000.00	391,611,864	RENAISSANCE ACQ	144A 6.875 13-21 15/08S	USD	1,160,000.00	107,796,342
KRATOS DEF SEC	7.00 14-19 15/05S	USD	2,488,000.00	205,390,466	RENTECH NIT PART/FIN	6.50 13-21 15/04S	USD	985,000.00	115,824,529
LAREDO PETROLEUM INC	5.625 14-22 15/01S	USD	670,000.00	70,447,177	REYNOLDS GROUP	5.75 12-20 15/10S	USD	1,185,000.00	144,670,702
LEGACY RESERVES	6.625 13-21 01/12S	USD	115,000.00	2,905,124	REYNOLDS GROUP	9.875 12-19 15/08S	USD	4,493,000.00	544,976,831
LEGACY RESERVES	8.00 13-20 01/12S	USD	3,250,000.00	86,010,919	REYNOLDS GRP	9.00 12-19 15/04S	USD	4,395,000.00	519,962,422
LEVEL 3 COMMUNICATIONS	5.75 14-22 01/12S	USD	1,000,000.00	123,334,846	RPH HOTEL	5.00 15-23 15/04S	USD	495,000.00	60,141,481
LEVEL 3 FINANCING	5.625 15-23 01/02S	USD	385,000.00	47,517,725	RSP PERMIAN	6.875 15-22 01/10S	USD	570,000.00	63,082,693
LEVEL 3 FINANCING	5.375 15-24 15/01S	USD	660,000.00	79,919,494	SABINE PASS	5.625 14-23 15/04S	USD	100,000.00	10,481,784
LEVEL 3 FING	144A 5.375 15-25 01/05S	USD	525,000.00	62,996,983	SABINE PASS	5.75 14-24 15/05S	USD	1,410,000.00	148,882,086
LINN ENERGY	7.75 11-21 01/02S	USD	2,230,000.00	40,238,674	SABINE PASS	6.25 14-22 15/03S	USD	2,475,000.00	273,718,171
LINN ENERGY	8.625 11-20 15/04S	USD	310,000.00	6,619,232	SABRE INC	144A 5.25 15-23 15/11S	USD	585,000.00	70,020,708
LSB INDUSTRIES	7.75 14-19 01/08S	USD	3,380,000.00	343,574,526	SABRE INC	144A 5.375 15-23 15/04S	USD	1,095,000.00	131,723,015
LTF MERGER SUB INC	8.50 15-23 15/06S	USD	1,845,000.00	213,066,489	SALLY HOLDINGS/SAL	5.625 15-25 01/12S	USD	460,000.00	56,356,086
MAGNACHIP SEMI	6.625 13-21 15/07S	USD	2,120,000.00	181,068,021	SANCHEZ ENERGY	6.125 15-23 15/01S	USD	1,725,000.00	112,573,557

ストラクチャー-米国ハイ・イールド・ボンド

銘柄	通貨	額面金額	評価額
SANDRIDGE ENERGY 7.50 11-21 15/03S	USD	565,000.00	7,136,500
SERVICE CORP INTL 7.50 07-27 01/04S	USD	3,465,000.00	468,270,503
SINCLAIR TELE GRP 5.375 13-21 01/04S	USD	1,790,000.00	216,658,762
SINCLAIR TELE GRP 6.125 13-22 01/10S	USD	140,000.00	17,218,544
SIRIUS XM RADIO 144A 4.625 13-23 15/05S	USD	980,000.00	115,776,519
SIRIUS XM RADIO 144A 6.00 14-24 15/07S	USD	955,000.00	120,613,166
SIRIUS XM RADIO INC 5.75 13-21 01/08S	USD	1,650,000.00	204,770,826
SM ENERGY 6.125 15-22 15/11S	USD	300,000.00	26,885,931
SPRINT CAP CORP 8.75 02-32 15/03S	USD	8,250,000.00	761,246,255
SPRINT CORP 7.875 14-23 15/09S	USD	11,585,000.00	1,045,519,704
TARGA RESOURCES 144A 6.75 15-24 15/03S	USD	995,000.00	102,337,957
TARGA RESOURCES PA 4.125 14-19 15/11S	USD	725,000.00	72,823,581
TEGNA 144A 4.875 14-21 15/09S	USD	505,000.00	61,280,524
TEGNA 144A 5.50 14-24 15/09S	USD	505,000.00	61,128,652
TENET HEALTHCARE 6.75 15-23 15/06S	USD	1,495,000.00	166,426,671
TENET HEALTHCARE 8.00 11-20 01/08S	USD	2,580,000.00	310,230,726
TENET HEALTHCARE CORP 8.125 13-22 01/04S	USD	2,870,000.00	341,990,950
TEREX CORP 6.00 12-21 15/05S	USD	1,905,000.00	214,314,555
TEREX CORP 6.50 12-20 01/04S	USD	2,035,000.00	238,763,532
TESORO 5.875 13-20 01/10S	USD	1,932,000.00	224,696,238
TIME INC 144A 5.75 14-22 15/04S	USD	1,505,000.00	167,465,665
T-MOBILE USA 6.50 15-26 15/01S	USD	1,130,000.00	136,625,241
T-MOBILE USA INC 6.633 13-21 28/04S	USD	1,020,000.00	128,326,727
T-MOBILE USA INC 6.731 13-22 28/04S	USD	3,015,000.00	379,159,125
TRIUMPH GROUP INC 4.875 13-21 01/04S	USD	2,230,000.00	218,541,608
UCI 8.625 11-19 15/02S	USD	6,080,000.00	254,159,258
UNITED RENTALS 7.625 12-22 15/04S	USD	1,670,000.00	214,649,763
UNITED RENTALS NA 6.125 12-23 15/06S	USD	595,000.00	72,956,927
US COATING ACQ 144A 7.375 13-21 01/05S	USD	665,000.00	84,395,959
VALEANT PHARMA 144A 7.25 11-22 15/07S	USD	3,940,000.00	466,644,289
VALEANT PHARMA -144A- 6.75 11-21 15/08S	USD	2,560,000.00	298,149,886
VANGUARD NAT RES 7.875 12-20 01/04S	USD	1,560,000.00	53,222,306
VISTA OUTDOOR INC 5.875 15-23 01/10S	USD	720,000.00	89,319,031
WHITING PETROLEUM 5.75 13-21 15/03S	USD	2,380,000.00	213,544,132
WINDSTREAM GTD 7.75 11-21 01/10S	USD	7,115,000.00	673,652,320
WMG ACQUISITION 144A 5.625 14-22 15/04S	USD	405,000.00	47,623,283
WMG ACQUISITION 144A 6.00 12-21 15/01S	USD	981,000.00	118,746,946
WPX ENERGY 5.25 14-24 15/09S	USD	765,000.00	62,117,326
WPX ENERGY 8.25 15-23 01/08S	USD	1,720,000.00	168,629,519
WYNN LAS VEGAS 5.50 15-25 01/03S	USD	2,800,000.00	301,098,845

銘柄	通貨	額面金額	評価額
XPO LOGISTICS INC 6.50 15-22 15/06S	USD	1,635,000.00	183,160,402
ZAYO GROUP 6.00 15-23 01/04S	USD	1,160,000.00	132,565,081
ZEBRA TECHNO 7.25 15-22 15/10S	USD	1,785,000.00	225,462,888
ZF NA CAPITAL 4.75 15-25 29/04S	USD	2,210,000.00	254,417,640
ZF NA CAPITAL -144A- 4.50 15-22 29/04S	USD	675,000.00	79,435,474
ALGECO SCOTSMAN 144A 8.50 12-18 15/10S	USD	3,360,000.00	340,531,062
INTER GAME TECH 144A 6.50 15-25 15/02S	USD	2,525,000.00	268,814,196
INTL GAME TECH 144A 6.25 15-22 15/02S	USD	1,410,000.00	159,863,022
SENSATA TECH UK FI 6.25 15-26 15/02S	USD	1,410,000.00	177,248,655
CONSTELLIUM 144A 5.75 14-24 15/05S	USD	250,000.00	20,750,886
NXP BV 144A 5.75 13-23 15/03S	USD	960,000.00	119,813,812
BOMBARDIER 144A 7.50 15-25 15/03S	USD	540,000.00	45,552,706
BOMBARDIER 144A 7.75 10-20 15/03S	USD	1,670,000.00	163,978,614
MEG ENERGY 144A 6.375 12-23 30/01S	USD	1,940,000.00	163,360,599
MEG ENERGY 144A 7.00 13-24 31/03S	USD	1,035,000.00	89,643,828
QUEBECOR MEDIA INC 5.75 13-23 15/01S	USD	2,843,000.00	345,056,129
TRINIDAD DRILL -144A- 7.875 10-19 15/01S	USD	1,420,000.00	159,715,660
ULTRA PETROLEUM 144A 6.125 14-24 01/10S	USD	1,805,000.00	48,854,803
VPII ESCROW CORP 144A 7.50 13-21 15/07S	USD	5,940,000.00	713,873,425
VRX ESCROW 144A 5.875 15-23 15/05S	USD	1,285,000.00	138,589,406
VRX ESCROW 144A 6.125 15-25 15/04S	USD	160,000.00	17,322,478
AIRCASLE 5.125 14-21 15/03S	USD	335,000.00	41,575,489
AIRCASLE 7.625 12-20 15/04S	USD	230,000.00	31,312,257
NUMERICABLE 144A 6.00 14-22 15/05S	USD	1,660,000.00	193,601,147
NUMERICABLE 144A 6.25 14-24 15/05S	USD	945,000.00	110,268,404
ALBEA BEAUTY HLDG 144A 8.375 12-19 01/11S	USD	2,990,000.00	377,666,126
ALTICE FINANCE 144A 6.625 15-23 15/02S	USD	810,000.00	96,708,151
ALTICE FINANCE 144A 7.625 15-25 15/02S	USD	380,000.00	39,655,244
ALTICE FINANCE 144A 7.75 14-22 15/05S	USD	1,530,000.00	166,509,404
INEOS 144A 6.125 13-18 15/08S	USD	2,465,000.00	293,911,785
INEOS GRP 144A 5.875 14-19 01/02S	USD	1,235,000.00	144,786,324
INTELSAT 5.50 13-23 01/08S	USD	2,785,000.00	265,591,686
INTELSAT 6.625 12-22 15/12S	USD	1,340,000.00	103,656,631
INTELSAT 7.25 10-20 15/10S	USD	5,905,000.00	625,534,203
INTELSAT LUX 7.75 13-21 01/06S	USD	1,600,000.00	90,461,834
MALLINCKRODT FIN/S 5.625 15-23 15/10S	USD	775,000.00	89,499,474
MALLINCKRODT INTL FIN 5.50 15-25 15/04A	USD	425,000.00	47,290,969

(注) 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	評価額
アメリカ REICHHOLD CAYMAN EQUITY	5,835	USD	385,354,781.00

(注) 通貨欄の表記は以下の通りです。

USD(米ドル)

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（I 12シェアクラス、トルコリラ）

(2015年12月31日現在)

					評価損益	
					日本円	
買建	契約額	売建	契約額	満期日		
米ドル	93,311.66	トルコリラ	270,000.00	2016/1/27	171,918	
米ドル	46,968.31	トルコリラ	140,000.00	2016/1/27	△ 82,268	
米ドル	81,904.11	トルコリラ	240,000.00	2016/1/27	26,928	
米ドル	40,988.76	トルコリラ	120,000.00	2016/1/27	17,909	
米ドル	117,381.71	トルコリラ	340,000.00	2016/1/27	201,733	
米ドル	101,048.38	トルコリラ	300,000.00	2016/1/27	△ 127,607	
米ドル	30,603.90	トルコリラ	90,000.00	2016/1/27	△ 3,239	
米ドル	27,066.75	トルコリラ	80,000.00	2016/1/27	△ 19,435	
米ドル	33,326.40	トルコリラ	100,000.00	2016/1/27	△ 85,692	
				小計①	100,247	
					評価損益	
					日本円	
売建	契約額	買建	契約額	満期日		
米ドル	1,675,017.16	トルコリラ	4,995,000.00	2016/1/27	3,025,399	
米ドル	33,540.72	トルコリラ	100,000.00	2016/1/27	59,740	
米ドル	66,959.44	トルコリラ	200,000.00	2016/1/27	134,253	
				小計②	3,219,392	
				合計①+②	3,319,639	

# C A マネープールファンド（適格機関投資家専用）

## 運用報告書

《第9期》

決算日：2016年2月15日

（計算期間：2015年2月17日～2016年2月15日）

当ファンドはこの度、上記の決算を行いました。ここに、期中の運用状況についてご報告申し上げます。

### ■当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	主として本邦通貨表示の短期公社債に投資し、安定した収益の確保をめざして運用を行うとともに、あわせてコール・ローンなどで運用を行うことで流動性の確保を図ります。
主要運用対象	本邦通貨表示の短期公社債を主要投資対象とします。
組入制限	外貨建資産への投資は行いません。

### ■最近5期の運用実績

決算期	基	準 価 額		債券組入率 比	純 資 産 額
		税 込 分 配	み 金 騰 落 中 率		
	円	円	%	%	百万円
5期（2012年2月15日）	10,068	0	0.0	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
9期（2016年2月15日）	10,077	0	0.0	66.6	4,511

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

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) 2015年 2月16日	円 10,077		% —	% 79.2
2月末	10,077		0.0	79.2
3月末	10,077		0.0	18.4
4月末	10,077		0.0	78.9
5月末	10,077		0.0	78.9
6月末	10,077		0.0	18.2
7月末	10,077		0.0	—
8月末	10,077		0.0	78.7
9月末	10,077		0.0	—
10月末	10,077		0.0	59.0
11月末	10,078		0.0	82.7
12月末	10,077		0.0	66.4
2016年 1月末	10,077		0.0	88.6
(期 末) 2016年 2月15日	10,077		0.0	66.6

(注) 騰落率は期首比です。

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	第9期 (2015年2月17日 ～2016年2月15日)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬 ( 投 信 会 社 ) ( 販 売 会 社 ) ( 受 託 会 社 )	2円 (2) (0)	0.024% (0.019) (0.001)	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 委託した資金の運用の対価 交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、 購入後の情報提供等の対価
合 計	2	0.024	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価

期中の平均基準価額は10,077円です。

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

(注2) 消費税は報告日の税率を採用しています。

(注3) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注4) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

■ 期中の売買及び取引の状況（2015年2月17日から2016年2月15日まで）

公 社 債		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国 内	国 債 証 券	615,387,673	610,882,802 ( 6,000,000)

(注1) 金額は受渡し代金です。経過利子分は含まれておりません。

(注2) 単位未満は切捨てです。

(注3) ( )内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

■主要な売買銘柄 (2015年2月17日から2016年2月15日まで)  
公社債

買付		売付	
銘柄	金額	銘柄	金額
	千円		千円
第336回利付国債(2年)	1,000,200		
第568回国庫短期証券	1,000,013		
第567回国庫短期証券	1,000,000		
第525回国庫短期証券	999,980		—
第521回国庫短期証券	999,965		
第522回国庫短期証券	999,965		
第582回国庫短期証券	500,029		

(注1) 金額は受渡し代金です。経過利子分は含まれておりません。

(注2) 国内の現先取引によるものは含まれておりません。

■利害関係人との取引状況等 (2015年2月17日から2016年2月15日まで)

当期中における利害関係人との取引等はありません。

(注) 利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

■組入資産の明細 (2016年2月15日現在)

公社債

(A) 公社債種類別

国内(邦貨建)公社債

区分	当			期				
	額面金額	評価額	組入比率	うちBB格 以下組入比率	残存期間別組入比率			
	千円	千円	%	%	5年以上	2年以上	2年未満	%
国債証券	3,000,000	3,005,775	66.6	—	—	—	—	66.6
合計	3,000,000	3,005,775	66.6	—	—	—	—	66.6

(注1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

(注2) 単位未満は切捨てです。

(注3) 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	
国債証券	第582回国庫短期証券 第583回国庫短期証券※	—	500,000	500,100	2016/4/18
合計		—	2,500,000	2,505,675	—
			3,000,000	3,005,775	

(注1) 額面・評価額の単位未満は切捨てです。

(注2) ※印は現先で保有している債券です。

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（2016年2月15日現在）

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公 社 債	3,005,775	66.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,506,957	33.4
投 資 信 託 財 産 総 額	4,512,732	100.0

(注) 金額の単位未満は切捨てです。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

2016年2月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	4,512,732,049円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,506,957,008
公 社 債(評価額)	3,005,775,000
未 収 利 息	41
(B) 負 債	1,190,554
未 払 信 託 報 酬	1,190,554
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	4,511,541,495
元 本	4,477,162,110
次 期 繰 越 損 益 金	34,379,385
(D) 受 益 権 総 口 数	4,477,162,110口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D)	10,077円

(注記事項)

期首元本額	5,639,658,154 円
期中追加設定元本額	175,776,533 円
期中一部解約元本額	1,338,272,577 円

■損益の状況

当期 自2015年2月17日 至2016年2月15日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	1,181,407円
受 取 利 息	1,181,407
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 69,771
売 買 益	137,246
売 買 損	△ 207,017
(C) 信 託 報 酬 等	△ 1,190,554
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△ 78,918
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	1,361,672
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	33,096,631
(配 当 等 相 当 額)	( 22,331,388)
(売 買 損 益 相 当 額)	( 10,765,243)
(G) 計 (D+E+F)	34,379,385
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	34,379,385
追 加 信 託 差 損 益 金	33,096,631
(配 当 等 相 当 額)	( 22,331,388)
(売 買 損 益 相 当 額)	( 10,765,243)
分 配 準 備 積 立 金	1,361,672
繰 越 損 益 金	△ 78,918

(注1) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含まず。

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

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

《お知らせ》

- 平成28年1月9日付で、信用リスク集中回避のため、投資制限の条文新設に伴い、投資信託約款に所要の変更を行いました。