

アムンディ・欧州CBファンド
 (ユーロコース)
 <毎月決算型>

■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／その他資産（転換社債）	
信託期間	2014年3月28日から2019年7月18日までです。	
運用方針	欧州の転換社債（CB）を主要投資対象とする「ストラクチャラ-欧州コンバーチブル（I10シェアクラス、ユーロ）」を主要投資対象とし、中長期的な投資信託財産の成長を図ることを目的と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。原則として対円で為替ヘッジは行いません。	
主要運用対象	アムンディ・欧州CBファンド（ユーロコース）<毎月決算型>	ストラクチャラ-欧州コンバーチブル（I10シェアクラス、ユーロ） CAマネーブルファンド（適格機関投資家専用）
	ストラクチャラ-欧州コンバーチブル（I10シェアクラス、ユーロ）	欧州の転換社債
	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。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18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。	

運用報告書（全体版）
 第4作成期

第17期	（決算日	2015年8月18日）
第18期	（決算日	2015年9月18日）
第19期	（決算日	2015年10月19日）
第20期	（決算日	2015年11月18日）
第21期	（決算日	2015年12月18日）
第22期	（決算日	2016年1月18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、よろしくご願い申し上げます。

アムンディ・ジャパン株式会社

〒100-0011 東京都千代田区内幸町1丁目2番2号

お客様サポートライン 0120-202-900（フリーダイヤル）

受付は委託会社の営業日の午前9時から午後5時まで

ホームページアドレス：<http://www.amundi.co.jp>

アムンディ・欧州CBファンド（ユーロコース）＜毎月決算型＞

■設定以来の運用実績

	決 算 期	基 準 価 額 (分 配 落)	税 込 分	み 金	期 騰 落 中 率	投 資 信 託 証 券 組 入 比 率	投 資 証 券 組 入 比 率	純 資 産 総 額
	(設 定 日)	円	円	円	%	%	%	百万円
第1作成期	2014年3月28日	10,000	—	—	—	—	—	55
	1期(2014年4月18日)	9,921	0	0	△0.8	0.9	92.9	278
	2期(2014年5月19日)	9,794	0	0	△1.3	0.8	97.0	295
	3期(2014年6月18日)	9,791	5	5	0.0	0.8	95.6	305
第2作成期	4期(2014年7月18日)	9,567	5	5	△2.2	0.8	97.0	309
	5期(2014年8月18日)	9,412	5	5	△1.6	0.8	97.2	304
	6期(2014年9月18日)	9,627	5	5	2.3	0.8	97.3	311
	7期(2014年10月20日)	9,014	5	5	△6.3	0.9	97.2	291
	8期(2014年11月18日)	9,804	5	5	8.8	0.9	97.3	278
	9期(2014年12月18日)	9,846	5	5	0.5	0.5	96.3	193
第3作成期	10期(2015年1月19日)	9,367	5	5	△4.8	0.6	97.0	177
	11期(2015年2月18日)	9,729	5	5	3.9	0.6	96.6	178
	12期(2015年3月18日)	9,446	5	5	△2.9	0.6	96.5	173
	13期(2015年4月20日)	9,454	5	5	0.1	0.6	97.2	168
	14期(2015年5月18日)	10,078	5	5	6.7	0.6	97.4	171
	15期(2015年6月18日)	10,075	5	5	0.0	0.6	97.2	159
第4作成期	16期(2015年7月21日)	9,923	5	5	△1.5	0.6	97.1	152
	17期(2015年8月18日)	9,914	5	5	△0.0	0.7	95.1	134
	18期(2015年9月18日)	9,606	5	5	△3.1	0.8	96.4	124
	19期(2015年10月19日)	9,485	5	5	△1.2	0.8	96.4	121
	20期(2015年11月18日)	9,475	5	5	△0.1	0.8	96.7	120
	21期(2015年12月18日)	9,332	5	5	△1.5	0.8	96.7	118
	22期(2016年1月18日)	8,640	5	5	△7.4	0.9	96.6	108

(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。

■当作成期中の基準価額等の推移

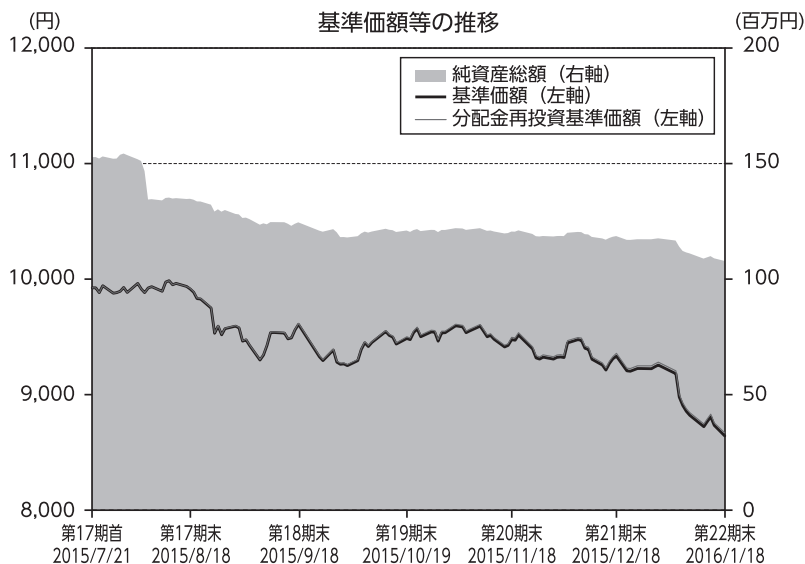
決算期	年 月 日	基準価額	騰 落 率	投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 比 率	投 資 証 券 組 入 比 率
			%		
第17期	(期 首) 2015年 7月21日	円 9,923	% —	% 0.6	% 97.1
	7月末	9,884	△0.4	0.6	96.2
	(期 末) 2015年 8月18日	9,919	△0.0	0.7	95.1
第18期	(期 首) 2015年 8月18日	9,914	—	0.7	95.1
	8月末	9,592	△3.2	0.8	96.6
	(期 末) 2015年 9月18日	9,611	△3.1	0.8	96.4
第19期	(期 首) 2015年 9月18日	9,606	—	0.8	96.4
	9月末	9,261	△3.6	0.8	97.9
	(期 末) 2015年10月19日	9,490	△1.2	0.8	96.4
第20期	(期 首) 2015年10月19日	9,485	—	0.8	96.4
	10月末	9,534	0.5	0.8	96.8
	(期 末) 2015年11月18日	9,480	△0.1	0.8	96.7
第21期	(期 首) 2015年11月18日	9,475	—	0.8	96.7
	11月末	9,307	△1.8	0.8	96.6
	(期 末) 2015年12月18日	9,337	△1.5	0.8	96.7
第22期	(期 首) 2015年12月18日	9,332	—	0.8	96.7
	12月末	9,255	△0.8	0.8	96.7
	(期 末) 2016年 1月18日	8,645	△7.4	0.9	96.6

(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・欧州CBファンド（ユーロコース）〈毎月決算型〉

【基準価額等の推移】

第17期首	9,923円
第22期末	8,640円
既払分配金 (税込み)	30円
騰落率	△12.7% (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、お客さまが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7月21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8月に中国元の対米ドル為替レートが突然切り下げられたことを受け、株式など価格変動性のあるリスク資産を回避する姿勢が世界的に強まるとともに、世界のほぼすべての国・地域で成長が鈍化する見通しを織り込む形で資産価格が急激に調整し、欧州CB価格も広く影響を受けたこと
- ② 2015年12月以降は、ECB（欧州中央銀行）が発表した金融緩和政策が期待外れのものとなったことや、中国のさらなる成長減速懸念を背景に株式市場で再び売りが膨らみ、欧州CB価格への下落圧力となったこと
- ③ おおむね当作成期全体を通じて、特にエネルギーセクターおよび格付けの低い小型銘柄全般の信用スプレッドが急拡大し、当ファンドでもエネルギーセクターに10%を越す組入比率を維持していたことなどで影響を受けたこと

上昇要因

- ① 2015年10月にECBが追加の金融緩和措置に前向きな姿勢を示したことなどから、株式市場が急反発し、欧州CB価格にもプラスに寄与したこと
- ② CB流通市場においては、償還や株式への転換によって特に大型CB中心に需給関係が比較的良好に推移したため、全般に当作成期を通じてCBの理論価格に対するプレミアムが拡大する展開であったこと

【投資環境】

＜欧州CB市場＞

当作成期は全般に極めて不安定な投資環境となりました。2015年前半には概して強気であった投資家は、年後半になると過度に楽観的な世界の成長見通しを見直しました。その結果生じた株式市場と社債市場の激しい乱高下を受けて、多くの投資家がリスク資産を削減する形で資産配分を変更し、総じて取引量が細る中で世界のリスク資産の下落に拍車が掛かりました。

米国の社債市場の低迷は、当作成期初こそ苦境にあるエネルギーセクターに限られていましたが、他のセクター（小売業、ケーブルテレビなど）や国外にも波及し、欧州と新興国の社債も資金流出や価格変動性の拡大に見舞われました。

量的緩和などこれまでの非伝統的な措置の有効性が試される中、過去数年にわたって市場安定の柱の一つであった各国中央銀行による支援は即応性に欠けるものとなりました。全般的な不安感をよそにFRB（米連邦準備理事会）が2006年以來の利上げに踏み切った上、依然緩和モードにあるECBと日銀による政策も、市場の期待を上回るには至りませんでした。

このような不透明な環境の中、欧州CB市場は比較的良好に持ちこたえました。絶対ベースでは下落となりましたが、理論上の株価感応度以上に価格が下がることはありませんでした。CBの新規発行は比較的多かったものの、11月と12月に大量の債券償還／株式転換があったために、欧州CB流通市場での需給不均衡に一段と拍車が掛かりました。これが大型発行体中心にCBの理論価格に対するプレミアムを下支えすることとなりました。

＜為替市場＞

当作成期初135円台前半で始まったユーロ／円相場は、ギリシャ債務問題に関して債権団が支援再開を決めたことから、しばらくユーロが底堅く推移しました。しかし、ドイツの弱い経済指標を受けて、2015年10月にドラギECB総裁が早ければ12月にも追加緩和策を講じると発言したことで、ユーロは下落に転じました。12月に実施されたECBの政策理事会では中銀預金金利を-0.2%から-0.3%に0.1%引き下げ、資産買入れプログラムの終了時期のめどを2016年9月から2017年3月に延長するなどの決定がなされましたが、市場の期待に届かず、投資家は一気にユーロの売り持ち解消に動いたことで、ユーロは急反発しました。しかし2016年1月に入って原油価格の下落が加速し、中国では株安と人民元安が進むとリスク回避目的の円買いが旺盛となり、127円台後半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。2015年11月には日銀による追加金融緩和観測が高まり、利回りは一時-0.10%まで低下しましたが、当作成期末の利回りは-0.02%とやや戻りました。

【ポートフォリオ】

＜当ファンド＞

当ファンドは、欧州の転換社債を主要投資対象とする円建の外国籍投資信託「ストラクチャー欧州コンバーチブル（I10シェアクラス、ユーロ）」と、円建の国内籍投資信託「CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）」を投資対象とし、中長期的な投資信託財産の成長を図ることを目的として運用を行いました。当ファンドは「ストラクチャー欧州コンバーチブル（I10シェアクラス、ユーロ）」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・欧州CBファンド（ユーロコース）〈毎月決算型〉

＜ストラクチャード欧州コンバーチブル（I10シェアクラス、ユーロ）＞

当ファンドは下値抵抗力がある一方で株価上昇に追随できる特性を備えた銘柄を一貫して重視しており、当作成期もこうした特性のバランスが良い新発債をポートフォリオに加えました。主な組入銘柄は、Totalの2022年満期、IAGの2022年満期、Vodafoneの2020年満期のCBなどです。

一方、投資していただくいくつかの大型銘柄で満期／最終転換日が到来したため、流通市場でこうした銘柄の売却処理を進めました。主に、Peugeotの2016年満期、Artemis／Keringの2016年満期、ENI／Snamの2015年満期、およびAlcatelなどの銘柄です。

（アムンディ アセットマネジメント）

＜CAM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「ストラクチャード欧州コンバーチブル（I10シェアクラス、ユーロ）」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）

＜ストラクチャード欧州コンバーチブル（I10シェアクラス、ユーロ）＞

昨年後半にリスク資産が全般的に大きく調整したことや世界経済の成長減速を受けても、弊社はなお欧州株式市場には上昇余地が十分にあるとみております。欧州株式市場は原油安、ユーロ安、域内の成長動向の改善から中長期的に恩恵を受けるとみられます。とはいえ、金融市場のリスクは明らかに上昇傾向にあり、社債市場では取引が細る中で信用格付けの見通しも悲観的なものとなっています。また、CB流通市場では、大型CB中心に理論価格に対するプレミアムが過去のレンジの上限にあることにも警戒が必要です。そのため、当ファンドは株式市場の中長期的な上昇からの恩恵と、当面の下値に対する抵抗力のバランスのとれたポートフォリオ特性を維持する方針です。

（アムンディ アセットマネジメント）

＜CAMマネープールファンド（適格機関投資家専用）＞

安全性重視の観点から、6ヵ月以内に償還を迎える国債への投資および債券現先取引により安定的な運用を行います。

（アムンディ・ジャパン株式会社）

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	第17期～第22期 (2015年7月22日 ～2016年1月18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 (14) (35) (2)	0.539% (0.150) (0.374) (0.016)	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 委託した資金の運用の対価 交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) その他費用 (監 査 費 用) (印 刷 費 用)	7 (0) (6)	0.071 (0.005) (0.066)	その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 ファンドの法定開示資料の印刷に係る費用
合 計	58	0.610	

期中の平均基準価額は9,472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7月22日から2016年1月18日まで）
投資証券

決 算 期		第 17 期 ～ 第 22 期			
		買 付		売 付	
		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
			千円		千円
外国	(ルクセンブルク) ストラクチュラ-欧州コンバーチブル (I10シェアクラス、ユーロ)	—	—	2,834	27,311

- (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7月22日から2016年1月18日まで）

当作成期中における利害関係人との取引等はありません。

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

■ 組入資産の明細（2016年1月18日現在）

(1) 国内（邦貨建）投資信託受益証券

銘 柄		第3作成期末 (第16期末)	第4作成期末（第22期末）	
		口 数	口 数	評 価 額
				千円
CAマネーブルファンド（適格機関投資家専用）		984,915	984,915	992
合 計	口 数 ・ 金 額	984,915	984,915	992
銘 柄 数 < 比 率 >		1	1	<0.9%>

- (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。

アムンディ・欧州CBファンド（ユーロコース）〈毎月決算型〉

(2) 外国（邦貨建）投資証券

銘柄	第3作成期末 (第16期末)		第4作成期末 (第22期末)	
	口数	金額	口数	評価額
(ルクセンブルク) ストラクチャラ-欧州コンバーチブル (I10シェアクラス、ユーロ)	15,034		12,200	104,352
合計	15,034		12,200	104,352
	銘柄数 < 比率 >		1	< 96.6% >

■投資信託財産の構成（2016年1月18日現在）

項目	第4作成期末 (第22期末)	
	評価額	比率
投資信託受益証券	992	0.9
投資証券	104,352	96.4
コール・ローン等、その他	2,913	2.7
投資信託財産総額	108,257	100.0

(注) 金額の単位未満は切捨てです。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

項目	(2015年8月18日)	(2015年9月18日)	(2015年10月19日)	(2015年11月18日)	(2015年12月18日)	(2016年1月18日)現在
	第17期末	第18期末	第19期末	第20期末	第21期末	第22期末
(A) 資産	135,095,538円	125,915,084円	121,382,271円	120,943,104円	118,997,835円	108,257,613円
コール・ローン等	5,825,399	4,661,762	3,575,434	3,260,274	3,137,904	2,912,759
投資信託受益証券(評価額)	992,498	992,498	992,498	992,498	992,498	992,498
投資証券(評価額)	128,277,640	120,260,823	116,814,339	116,690,332	114,867,433	104,352,356
未収利息	1	1	—	—	—	—
(B) 負債	202,984	1,212,443	220,130	231,230	244,193	257,519
未払収益分配金	68,028	64,911	63,870	63,698	63,625	62,500
未払解約金	—	999,999	—	—	—	—
未払信託報酬	121,032	118,339	111,852	108,401	106,731	106,006
その他未払費用	13,924	29,194	44,408	59,131	73,837	89,013
(C) 純資産総額(A-B)	134,892,554	124,702,641	121,162,141	120,711,874	118,753,642	108,000,094
元本	136,056,302	129,823,330	127,741,367	127,396,910	127,250,415	125,000,271
次期繰越損益金	△ 1,163,748	△ 5,120,689	△ 6,579,226	△ 6,685,036	△ 8,496,773	△ 17,000,177
(D) 受益権総口数	136,056,302口	129,823,330口	127,741,367口	127,396,910口	127,250,415口	125,000,271口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,914円	9,606円	9,485円	9,475円	9,332円	8,640円

(注記事項)

作成期首元本額	154,111,373円
作成期中追加設定元本額	2,360,327円
作成期中一部解約元本額	31,471,429円

アムンディ・欧州CBファンド（ユーロコース）〈毎月決算型〉

■ 損益の状況

	第17期 自2015年7月22日	自2015年8月18日	至2015年8月18日	第20期 自2015年10月20日	自2015年11月18日	至2015年11月18日
	第18期 自2015年8月19日	自2015年9月18日	至2015年9月18日	第21期 自2015年11月19日	自2015年12月19日	至2015年12月18日
	第19期 自2015年9月19日	自2015年10月19日	至2015年10月19日	第22期 自2015年12月19日	自2016年1月18日	至2016年1月18日

項 目	第 17 期	第 18 期	第 19 期	第 20 期	第 21 期	第 22 期
(A) 配 当 等 收 益	206,360円	192,471円	186,024円	186,014円	185,855円	184,289円
受 取 配 当 金	206,317	192,442	186,010	186,010	185,850	184,276
受 取 利 息	43	29	14	4	5	13
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 127,353	△4,004,643	△1,535,647	△ 124,054	△1,819,889	△ 8,655,768
売 買 益	81,722	277,797	69,526	△ 3	3,009	100,271
売 買 損	△ 209,075	△4,282,440	△1,605,173	△ 124,051	△1,822,898	△ 8,756,039
(C) 信 託 報 酬 等	△ 134,956	△ 133,609	△ 127,066	△ 123,124	△ 121,437	△ 121,182
(D) 当 期 損 益 (A+B+C)	△ 55,949	△3,945,781	△1,476,689	△ 61,164	△1,755,471	△ 8,592,661
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 400,005	△ 494,459	△4,428,223	△5,945,223	△6,061,303	△ 7,738,404
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 639,766	△ 615,538	△ 610,444	△ 614,951	△ 616,374	△ 606,612
(配 当 等 相 当 額)	(38,903)	(38,743)	(39,077)	(40,838)	(41,220)	(40,695)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 678,669)	(△ 654,281)	(△ 649,521)	(△ 655,789)	(△ 657,594)	(△ 647,307)
(G) 計 (D+E+F)	△1,095,720	△5,055,778	△6,515,356	△6,621,338	△8,433,148	△16,937,677
(H) 収 益 分 配 金	△ 68,028	△ 64,911	△ 63,870	△ 63,698	△ 63,625	△ 62,500
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	△1,163,748	△5,120,689	△6,579,226	△6,685,036	△8,496,773	△17,000,177
追 加 信 託 差 損 益 金	△ 639,766	△ 615,538	△ 610,444	△ 614,951	△ 616,374	△ 606,612
(配 当 等 相 当 額)	(38,903)	(38,743)	(39,077)	(40,838)	(41,220)	(40,695)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 678,669)	(△ 654,281)	(△ 649,521)	(△ 655,789)	(△ 657,594)	(△ 647,307)
分 配 準 備 積 立 金	1,648,440	1,570,254	1,541,145	1,534,811	1,533,566	1,508,441
繰 越 損 益 金	△2,172,422	△6,075,405	△7,509,927	△7,604,896	△9,413,965	△17,902,006

(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17期計算期間末における費用控除後の配当等収益(71,404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(38,903円)および分配準備積立金(1,645,064円)より分配対象収益は1,755,371円(10,000口当たり129円)であり、うち68,028円(10,000口当たり5円)を分配金額としております。

第18期計算期間末における費用控除後の配当等収益(58,862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(38,743円)および分配準備積立金(1,576,303円)より分配対象収益は1,673,908円(10,000口当たり128円)であり、うち64,911円(10,000口当たり5円)を分配金額としております。

第19期計算期間末における費用控除後の配当等収益(58,958円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(39,077円)および分配準備積立金(1,546,057円)より分配対象収益は1,644,092円(10,000口当たり128円)であり、うち63,870円(10,000口当たり5円)を分配金額としております。

第20期計算期間末における費用控除後の配当等収益(62,890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(40,838円)および分配準備積立金(1,535,619円)より分配対象収益は1,639,347円(10,000口当たり128円)であり、うち63,698円(10,000口当たり5円)を分配金額としております。

第21期計算期間末における費用控除後の配当等収益(64,418円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(41,220円)および分配準備積立金(1,532,773円)より分配対象収益は1,638,411円(10,000口当たり128円)であり、うち63,625円(10,000口当たり5円)を分配金額としております。

第22期計算期間末における費用控除後の配当等収益(63,107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(40,695円)および分配準備積立金(1,507,834円)より分配対象収益は1,611,636円(10,000口当たり128円)であり、うち62,500円(10,000口当たり5円)を分配金額としております。

アムンディ・欧州CBファンド（ユーロコース）＜毎月決算型＞

■分配金のお知らせ

決 算 期	第17期	第18期	第19期	第20期	第21期	第22期
1 万口当たりの分配金（税込み）	5円	5円	5円	5円	5円	5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17期	第18期	第19期	第20期	第21期	第22期
	(2015年7月22日 ～2015年8月18日)	(2015年8月19日 ～2015年9月18日)	(2015年9月19日 ～2015年10月19日)	(2015年10月20日 ～2015年11月18日)	(2015年11月19日 ～2015年12月18日)	(2015年12月19日 ～2016年1月18日)
当期分配金	5	5	5	5	5	5
（対基準価額比率）	(0.050%)	(0.052%)	(0.053%)	(0.053%)	(0.054%)	(0.058%)
当期の収益	5	4	4	4	5	5
当期の収益以外	—	0	0	0	—	—
翌期繰越分配対象額	124	123	123	123	123	123

（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。

ストラクチュラ-欧州コンバートブル

< 1. 補足情報 >

「ストラクチュラ-欧州コンバートブル（I 10シェアクラス、ユーロ）」は、「ストラクチュラ-欧州コンバートブル」にて既存の他のクラスと合わせた合同運用が行われています。

「ストラクチュラ-欧州コンバートブル」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1月15日現在における「ストラクチュラ-欧州コンバートブル」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1月15日現在）

銘柄		利率	額面金額	評価額	償還年月日	
メキシコ	社債券	AMERICA MOVIL 0.00 15-20 28/05U	0	1,900,000	243,797,296	2020/5/28
オランダ		SIEMENS FIN CV 1.05 12-17 16/08S	1.05	1,750,000	209,307,556	2017/8/16
アラブ首長国連邦		AABAR INVEST CV 1.00 15-22 27/03S	1	1,100,000	117,686,031	2022/3/27
スペイン		LA CAXA CV 1.00 13-17 25/11S	1	900,000	115,725,983	2017/11/25
フランス		TOTAL CV 0.50 15-22 02/12S	0.5	1,000,000	111,526,609	2022/12/2
イギリス		J SAINSBURY PLC 1.25 14-19 21/11S	1.25	600,000	104,690,718	2019/11/21
ルクセンブルク		GBL VERWALTUNG CV 1.25 13-17 07/02A	1.25	800,000	104,545,753	2017/2/7
フランス		FONCIERE DES REGIONS 3.34 11-17 01/01S	3.34	7,764	95,383,379	2017/1/1
スペイン		INTL CONSOLIDATED CV 0.614 15-22 17/11S	0.625	700,000	88,298,760	2022/11/17
フランス		AIR FRANCE KLM CV 2.03 13-23 15/02A	2.03	62,340	86,887,910	2023/2/15
ドイツ		FRESENIUS REGS CV 0.00 14-19 24/09U	0	500,000	84,027,076	2019/9/24
		RAG STIFTUNG CV 0.00 15-21 18/02U	0	600,000	83,492,331	2021/2/18
イタリア		TELECOM ITALIA CV 1.125 15-22 26/03S	1.125	600,000	81,570,170	2022/3/26
ジャージー		BRITISH LAND CV 1.50 12-17 10/09S	1.5	400,000	75,092,026	2017/9/10
イギリス		VODAFONE GROUP CV 0.00 15-20 26/11U	0	400,000	66,666,789	2020/11/26
ルクセンブルク		SUBSEA 7 INC CV 1.00 06-11 06/06S	1	600,000	64,855,168	2017/10/5
アラブ首長国連邦		AABAR INVEST CV 0.50 15-20 27/03S	0.5	600,000	64,640,092	2020/3/27
ルクセンブルク		FORTIFINLUX SA REG-S FL. R 02-XX 29/01Q	1.279	750,000	59,679,754	2049/11/29
オランダ		IBERDROLA INTL CV 0.00 15-22 11/11A	0	400,000	51,099,459	2022/11/11
ルクセンブルク		TELECOM ITALIA 6.125 13-16 15/11A	6.125	300,000	48,984,415	2016/11/15
オランダ		QIAGEN FINANCE CV 0.375 14-19 19/03S	0.375	400,000	48,826,666	2019/3/19
ベルギー		FORTIS BK SUB CV FL. R 07-XX 19/12Q	1.867	500,000	48,313,233	2049/12/19
ドイツ		FRESENIUS MED CARE CV 1.125 14-20 31/01S	1.125	300,000	46,933,238	2020/1/31
スウェーデン		AB INDUSTRIVARDEN 0.00 14-19 15/05U	0	3,000,000	45,333,480	2019/5/15
ベルギー		SAGERPAR REGS CV 0.375 13-18 09/10A	0.375	300,000	41,402,895	2018/10/9
フランス		UNIBAIL RODAMCO CV 0.00 14-21 01/07U	0	1,015	41,169,648	2021/7/1
ドイツ		HANIEL FIN DEUTSC CV 0.00 15-20 12/05U	0	300,000	39,626,258	2020/5/12
フランス		RALLYE CV 1.00 13-20 02/10A	1	3,511	36,667,540	2020/10/2
		SAFRAN SA CV 0.00 16-20 31/10U	0	3,008	35,587,066	2020/12/31
		NEXITY SA CV 0.625 14-20 01/01S	0.625	5,480	35,575,112	2020/1/1

CAマネーパールファンド（適格機関投資家専用）

< 2. 補足情報 >

「CAマネーパールファンド（適格機関投資家専用）」の決算日（2015年2月16日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、以下2016年1月18日現在における「CAマネーパールファンド（適格機関投資家専用）」の補足情報を掲載しております。

■主要な売買銘柄（2015年2月17日から2016年1月18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）	1,000,542		
第521回国庫短期証券	999,965		
第522回国庫短期証券	999,965		
第525回国庫短期証券	999,980		
第567回国庫短期証券	1,000,000		
第568回国庫短期証券	1,000,013		
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）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（2016年1月18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1月18日現在						
	額面金額	評価額	組入比率	うちBB格 以下組入比率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	4,000,000	4,000,929	88.6	—	—	—	88.6
合 計	4,000,000	4,000,929	88.6	—	—	—	88.6

（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）—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567回国庫短期証券	—	1,000,000	1,000,000	2016/2/8
	第568回国庫短期証券	—	1,000,000	1,000,000	2016/2/15
	第575回国庫短期証券※	—	1,500,000	1,500,900	—
	第582回国庫短期証券	—	500,000	500,029	2016/4/18
合 計			4,000,000	4,000,929	

（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。

ストラクチュラ-欧州コンバーチブル

決算日 2014年12月31日

(計算期間：2014年3月28日～2014年12月31日)

「ストラクチュラ-欧州コンバーチブル (I10シェアクラス、ユーロ)」は、「ストラクチュラ-欧州コンバーチブル」にて既存の他のクラスと合わせた合同運用が行われております。

「ストラクチュラ-欧州コンバーチブル」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2014年12月31日を基準日とするデータ及び年次報告書（監査済み）に基づき、委託会社が抜粋・翻訳・作成したものです。

開示情報につきましては、各クラス別のものがないため、「ストラクチュラ-欧州コンバーチブル」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（円建）	
投資方針	欧州の転換社債を主要投資対象とし、投資信託財産の中長期的な成長を図ることを目的として運用を行います。 各シェアクラスについては、外国為替予約取引、為替先渡取引、直物為替先渡取引等を活用します。	
ファンドの関係法人	投資顧問会社	アムンディ・ジャパン株式会社
	副投資顧問会社	アムンディ（※）
	管理会社	アムンディ・ルクセンブルク
	保管銀行・ 管理事務代行会社	CACEIS・バンク・ルクセンブルク
費用	運用報酬等	純資産総額に対し年率0.67%
	申込手数料	ありません。

(※) 2015年11月12日付で、「アムンディ」から「アムンディ アセットマネジメント」に社名変更しておりますが、旧社名で記載しております。

ストラクチュラ-欧州コンバーチブル

■費用の明細

項目	当期
	円
(a) 運用報酬	22,763,487
(b) 管理費用等	4,965,799
(c) その他の費用	2,596,439
合計	30,325,725

■純資産計算書

2014年12月31日現在

項目	当期末
	円
資産合計	6,499,386,523
有価証券	5,864,774,192
買いオプション（評価額）	74,323,251
預金	464,821,740
未収利息	36,516,692
為替予約取引評価勘定	58,950,648
負債合計	170,484,374
売りオプション（評価額）	3,627,698
未払配当金	26,247,955
未払解約金	119,909,672
先物取引評価勘定	10,481,954
未払運用報酬	8,949,243
未払管理費用	662,778
追加設定に係る未払税	158,879
為替未払金	444,862
その他の負債	1,333
純資産	6,328,902,149

(注) 各項目の金額の整数未満を四捨五入しているため、資産合計および負債合計並びに純資産が一致しない場合があります。

■有価証券明細
(1) 転換社債等

(2014年12月31日現在)

銘柄		通貨	額面金額	円 換算評価額	銘柄	通貨	額面金額	円 換算評価額	
アラブ首長国連邦	AABAR INV REGS CV 4.00 11-16 27/05S	EUR	1,500,000	260,106,246	ジャージー	BRITISH LAND CV 1.50 12-17 10/09S	GBP	500,000	110,024,825
イギリス	DIALOG SEMICONDUCTOR 1.00 12-17 12/04S	USD	400,000	61,721,469		CARILLION FINANCE CV 2.50 14-19 19/12S	GBP	100,000	19,213,310
	IMMARSAT CV 1.75 07-17 16/11S	USD	100,000	16,660,610		CPTL SHOPPING CENTER 2.50 12-18 04/10S	GBP	100,000	20,479,678
	J SAINSBURY PLC 1.25 14-19 21/11S	GBP	500,000	96,288,080		DERWENT LONDON CAP CV 1.125 13-19 24/07S	GBP	200,000	41,114,520
	TUI AG CV 4.90 10-17 27/04S	GBP	600,000	138,960,602		GABRIEL FINANCE CV 2.00 13-16 26/11S	EUR	300,000	42,332,877
イタリア	BENI STABILI CV 2.625 13-19 17/04S	EUR	100,000	16,025,275		GREAT PORTLAND 1.00 13-18 10/09S	GBP	100,000	20,759,722
	BUZZI UNICEM CV 1.375 13-19 17/07S	EUR	100,000	15,138,988	スウェーデン	AB INDUSTRIVARDEN 0.00 14-19 15/05U	SEK	1,000,000	16,919,892
	ENI SPA CV 0.625 13-16 18/01A	EUR	1,400,000	214,259,267	スペイン	ABENGOA CV 4.50 10-17 03/02S	EUR	250,000	36,045,953
	PRYSMIAN CV 1.25 13-18 08/03S	EUR	100,000	14,774,841		CAIXABANK 4.50 13-16 22/11A	EUR	300,000	39,298,840
	SAPILLO CV 1.25 14-19 22/05S	EUR	100,000	12,697,890		INDRA SISTEMAS REGS 1.75 13-18 17/10S	EUR	100,000	12,994,286
	SCHEMATRENTQUATTRO CV 0.25 13-16 29/11A	EUR	100,000	14,808,934		INTL CONSOL AIRLIN CV 1.75 13-18 31/05S	EUR	400,000	89,052,942
オーストリア	IMMOFINANZ AG CV 4.25 11-18 08/03S	EUR	56,000	33,564,513		LA CAXA CV 1.00 13-17 25/11S	EUR	900,000	148,884,951
	STEINHOFF FIN HLDG CV 4.00 14-21 30/01S	EUR	100,000	18,666,293		MELIA HOTELS INTL SA 4.50 13-18 04/04Q	EUR	100,000	19,246,173
オランダ	ACS ACTIVIDADES CV 1.625 14-19 27/03Q	EUR	600,000	91,344,898		TELEFONICA CV 6.00 14-17 24/07A	EUR	200,000	29,849,704
	ACS ACTIVIDADES CV 2.625 13-18 22/10Q	EUR	400,000	64,415,054	ドイツ	DEUTSCHE WOHNEN 0.875 14-21 08/09A	EUR	400,000	66,651,011
	AMORIM ENERGY CV 3.375 13-18 03/06S	EUR	500,000	64,676,921		DEUTSCHE WOHNEN REGS 0.50 13-20 22/11S	EUR	400,000	70,971,462
	AMPLITER NV 2.875 13-18 14/11S	EUR	200,000	32,037,494		FRESENIS REGS CV 0.00 14-19 24/09U	EUR	100,000	16,320,366
	LUKOIL INTL CV (SHS) 2.625 10-15 16/06S	USD	900,000	103,723,086		FRESENIUS MED CARE CV 1.125 14-20 31/01S	EUR	400,000	63,653,099
	QIAGEN FINANCE CV 0.375 14-19 19/03S	USD	800,000	100,823,066		RAG STIFTUNG CV 0.00 14-18 31/12U	EUR	300,000	43,723,023
	QIAGEN FINANCE CV 0.875 14-21 19/03S	USD	200,000	25,427,572	ノルウェー	MARINE HARVEST CV 0.875 14-19 06/05S	EUR	100,000	17,410,199
	SALZGITTER FIN CV 2.00 10-17 08/11A	EUR	150,000	24,939,507	バミューダ	BW GROUP LTD CV 1.75 14-19 10/09S	USD	200,000	19,757,018
	SIEMENS FIN CV 1.05 12-17 16/08S	USD	1,500,000	196,553,473	ハンガリー	MNV CV 3.375 13-19 02/04S	EUR	100,000	14,726,094
	SONAE INV CV 1.625 14-19 11/06S	EUR	200,000	26,863,979	フィンランド	NOKIA CV REGS 5.00 12-17 26/10S	EUR	100,000	39,420,562
	STMICROELECTRONICS NV 0.00 14-19 03/07U	USD	1,200,000	137,739,218		SOLIDIDIUM CV REGS 0.50 12-15 29/09A	EUR	300,000	43,639,022
	VW INTL FIN 5.50 12-15 09/11A	EUR	100,000	16,137,276	フランス	AIR FRANCE KLF CV 4.97 09-15 01/04A	EUR	87,550	150,778,297
	WERELDHAVE NV CV 1.00 14-19 22/05S	EUR	300,000	44,205,701		AIR FRANCE KLM CV 2.03 13-23 15/02A	EUR	70,145	116,847,296
キプロス	HOLDGROVE FINANCE 1.00 12-17 24 09S	USD	400,000	45,336,618		ALCATEL LUCENT 0.125 14-20 30/01S	EUR	146,811	87,373,339
ケイマン諸島	SIEM KAPITAL INC 1.00 12-19 12/09S	USD	800,000	87,979,914		ALCATEL LUCENT CV 0.00 14-19 30/01U	EUR	221,293	133,941,877

ストラクチャル-欧州コンバートブル

	銘柄	通貨	円	
			額面金額	換算評価額
フランス	AXA SA CV SUB 3.75 00-17 01/01A	EUR	3,950	157,923,671
	BNP PARIBAS CV 0.25 12-15 21/09A	EUR	600,000	93,796,153
	CGG VERITAS CV 1.25 13-19 01/01S	EUR	19,200	68,947,088
	CREDIT AGRICOLE CV 0.00 13-16 06/12U	EUR	5,800	63,289,415
	FAURECIA CV 3.25 12-18 01/01A	EUR	11,500	53,755,878
	FONCIERE DES REGIONS 3.34 11-17 01/01S	EUR	11,750	160,096,864
	GECINA SA CV 2.125 10-16 01/01A	EUR	650	12,709,144
	MAUREL & PROM CV 1.625 14-19 01/07U	EUR	12,346	27,757,369
	MISARTE CV 3.25 10-16 01/01A	EUR	7,210	182,188,722
	NEXANS SA CV 2.50 12-19 01/01A	EUR	2,500	25,572,154
	NEXITY SA CV 0.625 14-20 01/01S	EUR	6,200	39,508,277
	ORPEA CV 1.75 13-20 01/01S	EUR	2,600	22,924,079
	PEUGEOT SA 4.45 09-16 01/01S	EUR	24,478	92,490,791
	RALLYE CV 1.00 13-20 02/10A	EUR	2,750	42,962,660
	TECHNIP CV (SHS) 0.50 10-16 01/01A	EUR	5,726	68,990,461
	TECHNIP SA CV 0.25 11-17 01/01A	EUR	4,650	64,039,500
	UNIBAIL RODAMCO CV 0.00 14-21 01/07U	EUR	3,049	128,257,256

	銘柄	通貨	円	
			額面金額	換算評価額
フランス	UNIBAIL RODAMCO SE 0.75 12-18 01/01A	EUR	667	25,168,135
	ベルギー	BEKAERT NV SA CV 0.75 14-18 18/06A	EUR	400,000
ECONOCOM GRP SA 1.50 14-19 15/01A		EUR	5,800	8,759,185
FORTIS BK SUB CV FL. R 07-XX 19/12Q		EUR	750,000	82,736,349
SAGERPAR REGS CV 0.375 13-18 09/10A		EUR	300,000	46,612,126
ポルトガル	PARPUBLICA SGPS SA CV 5.25 10-17 28/09A	EUR	1,100,000	172,106,433
	ルクセンブルク	APERAM REGS CV 0.625 14-21 08/07S	USD	400,000
ARCELORMITTAL CV 6.00 13-16 15/01Q		USD	29,000	60,233,033
FF GROUP FINANCE CV 1.75 14-19 03/07S		EUR	200,000	27,637,250
FORTFINLUX SA REG-S FL. R 02-XX 29/11Q		EUR	1,000,000	94,301,317
ルクセンブルク	GBL VERWALTUNG CV 1.25 13-17 07/02A	EUR	700,000	118,202,204
	KLOECKNER & CO. CV 2.50 10-17 22/12A	EUR	350,000	50,251,068
	SUBSEA 7 INC CV 1.00 06-11 06/06S	USD	1,600,000	174,369,539
	TELECOM ITALIA 6.125 13-16 15/11A	EUR	100,000	17,063,896

(注1) 額面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)
GBP (英ポンド)
EUR (ユーロ)
SEK (スウェーデンクローナ)

(2) 投資証券

(2014年12月31日現在)

	銘柄	通貨	口数	円換算評価額
フランス	AMUNDI TRESO EONIA ISR FCP CAP	EUR	2.194	69,986,410

(注) 通貨欄の表記は以下の通りです。
EUR (ユーロ)

CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）

運用報告書

《第8期》

決算日：2015年2月16日

（計算期間：2014年2月18日～2015年2月16日）

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

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近5期の運用実績

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

（注）当ファンドは安定した収益の確保を目指すファンドであり、ベンチマークおよび参考指数はございません。以下同じ。

■当期中の基準価額等の推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率	債 券 組 入 率 比
（期首） 2014年2月17日	10,076	—	79.5
2月末	10,076	0.0	75.4
3月末	10,076	0.0	74.7
4月末	10,076	0.0	75.3
5月末	10,076	0.0	70.7
6月末	10,076	0.0	70.0
7月末	10,077	0.0	88.2
8月末	10,077	0.0	77.4
9月末	10,077	0.0	59.3
10月末	10,077	0.0	78.4
11月末	10,077	0.0	81.2
12月末	10,077	0.0	79.3
2015年1月末	10,077	0.0	79.2
（期末） 2015年2月16日	10,077	0.0	79.2

（注）騰落率は期首比です。

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	第 8 期 (2014年2月18日 ～2015年2月16日)		項 目 の 概 要
	金額	比率	
信託報酬 (投信会社) (販売会社)	2円 (2)	0.024% (0.020)	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 委託した資金の運用の対価
(受託会社)	(0)	(0.001)	
合計	2	0.024	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

期中の平均基準価額は10,076円です。

- (注1) 費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
 (注2) 消費税は報告日の税率を採用しています。
 (注3) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
 (注4) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

■ 期中の売買及び取引の状況（2014年2月18日から2015年2月16日まで）

公社債

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

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

■ 主要な売買銘柄（2014年2月18日から2015年2月16日まで）

公社債

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

- (注1) 金額は受渡し代金です。経過利子分は含まれておりません。
 (注2) 国内の現先取引によるものは含まれておりません。

■ 利害関係人との取引状況等（2014年2月18日から2015年2月16日まで）

当期中における利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細（2015年2月16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	う ち B B 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	4,500,000	4,500,045	79.2	—	—	—	79.2
合 計	4,500,000	4,500,045	79.2	—	—	—	79.2

(注1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

(注2) 単位未満は切捨てです。

(注3) —印は組入れなしです。

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

(B) 公社債銘柄別

国内（邦貨建）公社債

種 類	銘 柄	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
国 債 証 券	第498回国庫短期証券※	—	4,500,000	4,500,045	—
合 計			4,500,000	4,500,045	

(注1) 額面・評価額の単位未満は切捨てです。

(注2) ※印は現先で保有している債券です。

■投資信託財産の構成（2015年2月16日現在）

項 目	当 期	末
	評 価 額	比 率
	千円	%
公 社 債	4,500,045	79.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,184,051	20.8
投 資 信 託 財 産 総 額	5,684,096	100.0

(注) 金額の単位未満は切捨てです。

CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

2015年2月16日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	5,684,096,609円
コール・ローン等	1,184,051,285
公 社 債(評価額)	4,500,045,000
未 収 利 息	324
(B) 負 債	1,033,707
未 払 信 託 報 酬	1,033,707
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	5,683,062,902
元 本	5,639,658,154
次 期 繰 越 損 益 金	43,404,748
(D) 受 益 権 総 口 数	5,639,658,154口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,077円

(注記事項)

期首元本額	3,432,509,342円
期中追加設定元本額	2,967,255,880円
期中一部解約元本額	760,107,068円

■損益の状況

当期 自2014年2月18日 至2015年2月16日

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

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

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

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