

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5作成期

第23期	（決算日	2016年2月18日）
第24期	（決算日	2016年3月18日）
第25期	（決算日	2016年4月18日）
第26期	（決算日	2016年5月18日）
第27期	（決算日	2016年6月20日）
第28期	（決算日	2016年7月19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、よろしくごお願い申し上げます。

アムンディ・ジャパン株式会社

〒100-0011 東京都千代田区内幸町1丁目2番2号

お客様サポートライン 0120-202-900（フリーダイヤル）

受付は委託会社の営業日の午前9時から午後5時まで

ホームページアドレス：<http://www.amundi.co.jp>

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 配 金	期 騰 落 中 率	投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 証 券 率	投 資 証 券 組 入 証 券 率	純資産総額
	(設 定 日)	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	△0.8	0.9	92.9	278
	2期(2014年5月19日)	9,794	0	△1.3	0.8	97.0	295
	3期(2014年6月18日)	9,791	5	0.0	0.8	95.6	305
第2 作成期	4期(2014年7月18日)	9,567	5	△2.2	0.8	97.0	309
	5期(2014年8月18日)	9,412	5	△1.6	0.8	97.2	304
	6期(2014年9月18日)	9,627	5	2.3	0.8	97.3	311
	7期(2014年10月20日)	9,014	5	△6.3	0.9	97.2	291
	8期(2014年11月18日)	9,804	5	8.8	0.9	97.3	278
	9期(2014年12月18日)	9,846	5	0.5	0.5	96.3	193
第3 作成期	10期(2015年1月19日)	9,367	5	△4.8	0.6	97.0	177
	11期(2015年2月18日)	9,729	5	3.9	0.6	96.6	178
	12期(2015年3月18日)	9,446	5	△2.9	0.6	96.5	173
	13期(2015年4月20日)	9,454	5	0.1	0.6	97.2	168
	14期(2015年5月18日)	10,078	5	6.7	0.6	97.4	171
	15期(2015年6月18日)	10,075	5	0.0	0.6	97.2	159
第4 作成期	16期(2015年7月21日)	9,923	5	△1.5	0.6	97.1	152
	17期(2015年8月18日)	9,914	5	△0.0	0.7	95.1	134
	18期(2015年9月18日)	9,606	5	△3.1	0.8	96.4	124
	19期(2015年10月19日)	9,485	5	△1.2	0.8	96.4	121
	20期(2015年11月18日)	9,475	5	△0.1	0.8	96.7	120
	21期(2015年12月18日)	9,332	5	△1.5	0.8	96.7	118
第5 作成期	22期(2016年1月18日)	8,640	5	△7.4	0.9	96.6	108
	23期(2016年2月18日)	8,333	5	△3.5	1.0	96.5	104
	24期(2016年3月18日)	8,472	5	1.7	1.2	96.2	80
	25期(2016年4月18日)	8,241	5	△2.7	1.3	96.0	78
	26期(2016年5月18日)	8,242	5	0.1	1.3	96.0	78
	27期(2016年6月20日)	7,694	5	△6.6	1.5	96.0	67
	28期(2016年7月19日)	7,708	5	0.2	1.6	95.8	61

(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

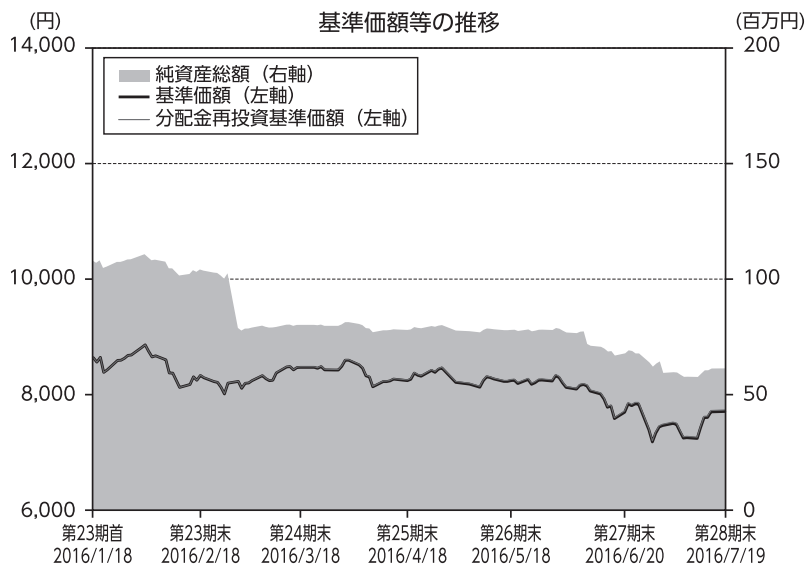
決算期	年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率	投 資 信 託 証 券 受 益 証 比 率	投 資 証 券 組 入 比 率
			%	%	%
第23期	(期 首) 2016年 1月18日	円 8,640	% -	% 0.9	% 96.6
	1月末	8,686	0.5	0.9	96.7
	(期 末) 2016年 2月18日	8,338	△3.5	1.0	96.5
第24期	(期 首) 2016年 2月18日	8,333	-	1.0	96.5
	2月末	8,228	△1.3	1.3	95.9
	(期 末) 2016年 3月18日	8,477	1.7	1.2	96.2
第25期	(期 首) 2016年 3月18日	8,472	-	1.2	96.2
	3月末	8,595	1.5	1.2	96.2
	(期 末) 2016年 4月18日	8,246	△2.7	1.3	96.0
第26期	(期 首) 2016年 4月18日	8,241	-	1.3	96.0
	4月末	8,462	2.7	1.2	96.2
	(期 末) 2016年 5月18日	8,247	0.1	1.3	96.0
第27期	(期 首) 2016年 5月18日	8,242	-	1.3	96.0
	5月末	8,328	1.0	1.3	96.1
	(期 末) 2016年 6月20日	7,699	△6.6	1.5	96.0
第28期	(期 首) 2016年 6月20日	7,694	-	1.5	96.0
	6月末	7,440	△3.3	1.5	96.0
	(期 末) 2016年 7月19日	7,713	0.2	1.6	95.8

(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23期首	8,640円
第28期末	7,708円
既払分配金 (税込み)	30円
騰落率	△10.5% (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、2016年1月18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 1月から2月前半にかけて、中国の成長減速懸念が強まり、原油価格が急落する中、政策当局の対応や金融機関の健全性に対する疑念から、株式市場と社債市場が世界的に急激に下落し、欧州CB市場も悪影響を受けたこと
- ② 6月には英国の国民投票をめぐる不透明感と実際の結果を受けて、欧州株式市場と社債市場が大きく動揺し、欧州CB市場も悪影響を受けたこと
- ③ 為替市場において、当作成期はユーロ安・円高となったこと

上昇要因

- ① 2月中旬から5月にかけて、原油価格が反発し、株式市場も原油・コモディティ関連銘柄を中心に買い戻され、欧州CB市場もその恩恵を受けたこと
- ② 同時期、ECB（欧州中央銀行）が社債の積極的な購入など追加緩和を強化し、CBの債券的価値を下支えたこと

【投資環境】

＜欧州CB市場＞

当作成期初は、中国の成長減速や原油価格の下落など、前作成期からの逆風が続く中、政策当局の対応能力や金融機関の健全性に対する疑念も強まって、欧州株式市場は大きく下落しました。安全資産の国債が買われて国債利回りは急低下（債券価格は上昇）しましたが、社債利回りはそれほど低下せずに信用スプレッド（国債との利回り格差）が拡大、欧州のCB市場も2月中旬まで調整が続きました。2月中旬以降は、需給改善を期待して原油価格が反発し、株式市場も原油・コモディティ関連銘柄を中心に買い戻されました。ECBは1月以降、追加緩和方針を示していましたが、実際に3月の会合で利下げと社債の積極的な購入を発表したことも好感されて信用スプレッドが縮小、欧州CB市場にとって恩恵となりました。しかし5月以降は原油価格も頭打ちとなり、各地で続発するテロや6月下旬に控える英国の国民投票をめぐる不透明感が重荷となりました。実際に英国国民がEU（欧州連合）離脱を選択すると、欧州株式市場が大きく動揺し、欧州CB市場も下落した一方、国債利回りは大幅に低下しました。その後も英国の不動産ファンドの解約の一時停止やイタリアの銀行の不良債権などが重荷となりましたが、緩やかな成長継続や政策協調姿勢が再確認され、株式とCB市場いずれも小反発して当作成期末を迎えました。欧州CBの新規発行市場は作成期を通じて全般に活発でしたが、既発流通市場では理論価格に対するプレミアムが縮小傾向となりました。

＜為替市場＞

当作成期初127円付近で始まったユーロ／円相場は、1月末に日銀がマイナス金利政策を決定したことで円が下落しました。しかし、原油価格のさらなる下落、イタリアの一部の大手銀行に対する信用不安の高まりなどからリスク回避の円買いが進みました。3月のECBの緩和策は予想以上に包括的なものでしたが、直後の会見でドラギ総裁が一段の利下げの可能性を否定したことでユーロは急上昇しました。4月になると、ドイツ製造業受注の大幅減少、ECBの追加緩和を示唆する発言を材料にユーロが下落した後、原油価格や株価の上昇を受けて円買いの動きに歯止めがかかったものの、4月末に予想に反して日銀が政策据え置きを決めたことで円高・米ドル安が進行し、円は対ユーロでも上昇しました。6月は英国のEU離脱をめぐる国民投票を控えて不透明感が広がる中で、ユーロも英ポンドに連れ安し、国民投票の結果離脱が支持されると、リスク回避の円買いが進みました。混乱が収まり市場が冷静さを取り戻すにつれてユーロも持ち直し、117円付近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-0.02%近辺の水準で始まり、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、利回りはゼロからマイナス圏での推移となりました。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、急速に需給がひっ迫し-0.48%まで低下しましたが、当作成期末には-0.28%まで上昇しました。

【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み入れました。

（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、2021年満期のLVMH、2021年満期のTelefonica、2021年満期のVeolia、2022年満期のENI、2021年満期のAirbus/Dassault、2023年満期のBPなど、様々な高格付の新発債を新たに組入れ、業種や銘柄の分散を図りました。また、転換価格と株価に差のある既存保有銘柄のいくつかについては、新発CBに入れ替えて、下げに強く株価上昇にも追従しやすいCB特性の改善を図りました。フランスの銘柄の新規発行が比較的多かったこともあり、市場別ではフランスの比率が上昇した一方、ベルギーでは理論価格からのかい離率が大きく、価格上昇が期待できない銘柄を売却、英国では不動産関連銘柄を中心に売却、スウェーデンも個別の材料による売却で比率が低下しました。

(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および政府保証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）〉

英国のEU離脱投票結果の余波や、欧米の選挙など、政治リスクに左右される市場展開が当面続くと見込まれます。当ファンドは、高格付の発行体に注目し、十分な取引流動性を確保するとともに、債券価値による下支えのある銘柄、最近の価格調整で割安感が強まった銘柄を中心に市場下落に対するポートフォリオの抵抗力を確保した上で、CBの理論価格からのかい離率を注視し、機動的に投資機会をとらえていく方針です。

(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債券への投資により安定的な運用を行います。

(アムンディ・ジャパン株式会社)

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	第23期～第28期 (2016年1月19日 ～2016年7月19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)	45円 (13) (31) (1)	0.545% (0.151) (0.378) (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) (その他)	7 (0) (6) (0)	0.082 (0.005) (0.077) (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 ファンドの法定開示資料の印刷に係る費用 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用等
合 計	52	0.627	

期中の平均基準価額は8,289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1月19日から2016年7月19日まで）

投資証券

決 算 期		第 23 期		第 28 期	
		買 付 額	買 付 額	売 付 額	売 付 額
外国	(ルクセンブルク)	口	千円	口	千円
	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)	—	—	4,460	35,469

- (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（2016年1月19日から2016年7月19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・欧州CBファンド（ユーロコース）〈毎月決算型〉

■組入資産の明細（2016年7月19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22期末)	第5作成期末（第28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）		984,915	984,915	992
合計	口数・金額 銘柄数〈比率〉	984,915 1	984,915 1	992 〈1.6%〉

(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22期末)	第5作成期末（第28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-欧州コンバーチブル (I10シェアクラス、ユーロ)		12,200	7,740	58,774
合計	口数・金額 銘柄数〈比率〉	12,200 1	7,740 1	58,774 〈95.8%〉

■投資信託財産の構成（2016年7月19日現在）

項	目	第5作成期末（第28期末）	
		評価額	比率
		千円	%
投資信託受益証券		992	1.6
投資証券		58,774	95.5
コール・ローン等、その他		1,761	2.9
投資信託財産総額		61,527	100.0

(注) 金額の単位未満は切捨てです。

アムンディ・欧州CBファンド（ユーロコース）〈毎月決算型〉

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	(2016年2月18日)	(2016年3月18日)	(2016年4月18日)	(2016年5月18日)	(2016年6月20日)	(2016年7月19日)現在
	第 23 期 末	第 24 期 末	第 25 期 末	第 26 期 末	第 27 期 末	第 28 期 末
(A) 資 産	104,345,018円	80,334,282円	78,155,747円	78,177,137円	68,062,152円	61,527,538円
コール・ローン等	2,843,376	2,240,243	2,251,468	2,272,957	1,885,548	1,760,504
投資信託受益証券(評価額)	992,498	992,400	992,400	992,301	992,104	992,104
投資証券(評価額)	100,509,144	77,101,639	74,911,879	74,911,879	65,184,500	58,774,930
(B) 負 債	172,433	145,766	154,496	162,315	174,656	160,824
未払収益分配金	62,503	47,324	47,322	47,325	44,116	39,804
未払信託報酬	98,349	76,176	73,557	70,396	73,912	53,822
未払利息	—	—	4	6	5	4
その他未払費用	11,581	22,266	33,613	44,588	56,623	67,194
(C) 純資産総額(A-B)	104,172,585	80,188,516	78,001,251	78,014,822	67,887,496	61,366,714
元 本	125,006,202	94,649,900	94,645,632	94,651,120	88,233,672	79,609,453
次期繰越損益金	△ 20,833,617	△ 14,461,384	△ 16,644,381	△ 16,636,298	△ 20,346,176	△ 18,242,739
(D) 受 益 権 総 口 数	125,006,202口	94,649,900口	94,645,632口	94,651,120口	88,233,672口	79,609,453口
1万口当たり基準価額(C/D)	8,333円	8,472円	8,241円	8,242円	7,694円	7,708円

(注記事項)

作成期首元本額	125,000,271円
作成期中追加設定元本額	47,240円
作成期中一部解約元本額	45,438,058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23期 自2016年1月19日 至2016年2月18日 第26期 自2016年4月19日 至2016年5月18日
 第24期 自2016年2月19日 至2016年3月18日 第27期 自2016年5月19日 至2016年6月20日
 第25期 自2016年3月19日 至2016年4月18日 第28期 自2016年6月21日 至2016年7月19日

項 目	第 23 期	第 24 期	第 25 期	第 26 期	第 27 期	第 28 期
(A) 配 当 等 收 益	183,012円	138,645円	137,999円	137,843円	132,752円	115,951円
受 取 配 当 金	183,010	138,645	138,003	138,010	132,982	116,110
受 取 利 息	2	—	—	—	—	—
支 払 利 息	—	—	△ 4	△ 167	△ 230	△ 159
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 3,843,212	1,285,152	△ 2,189,428	△ 98	△ 4,845,121	97,949
売 買 益	—	1,699,992	331	—	49,326	299,299
売 買 損	△ 3,843,212	△ 414,840	△ 2,189,759	△ 98	△ 4,894,447	△ 201,350
(C) 信 託 報 酬 等	△ 109,930	△ 86,861	△ 84,904	△ 81,371	△ 85,964	△ 64,393
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	△ 3,770,130	1,336,936	△ 2,136,333	56,374	△ 4,798,333	149,507
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 16,393,564	△ 15,290,316	△ 13,999,276	△ 16,182,930	△ 15,071,785	△ 17,958,354
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 607,420	△ 460,680	△ 461,450	△ 462,417	△ 431,942	△ 394,088
(配 当 等 相 当 額)	(40,769)	(30,926)	(30,996)	(31,072)	(29,034)	(26,457)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 648,189)	(△ 491,606)	(△ 492,446)	(△ 493,489)	(△ 460,976)	(△ 420,545)
(G) 計 (D+E+F)	△ 20,771,114	△ 14,414,060	△ 16,597,059	△ 16,588,973	△ 20,302,060	△ 18,202,935
(H) 収 益 分 配 金	△ 62,503	△ 47,324	△ 47,322	△ 47,325	△ 44,116	△ 39,804
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	△ 20,833,617	△ 14,461,384	△ 16,644,381	△ 16,636,298	△ 20,346,176	△ 18,242,739
追 加 信 託 差 損 益 金	△ 607,420	△ 460,680	△ 461,450	△ 462,417	△ 431,942	△ 394,088
(配 当 等 相 当 額)	(40,769)	(30,926)	(30,996)	(31,072)	(29,034)	(26,457)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 648,189)	(△ 491,606)	(△ 492,446)	(△ 493,489)	(△ 460,976)	(△ 420,545)
分 配 準 備 積 立 金	1,519,020	1,256,663	1,262,315	1,271,462	1,192,496	1,122,311
繰 越 損 益 金	△ 21,745,217	△ 15,257,367	△ 17,445,246	△ 17,445,343	△ 21,106,730	△ 18,970,962

(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23期計算期間末における費用控除後の配当等収益(73,082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(40,769円)および分配準備積立金(1,508,441円)より分配対象収益は1,622,292円(10,000口当たり129円)であり、うち62,503円(10,000口当たり5円)を分配金額としております。

第24期計算期間末における費用控除後の配当等収益(130,185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(30,926円)および分配準備積立金(1,173,802円)より分配対象収益は1,334,913円(10,000口当たり141円)であり、うち47,324円(10,000口当たり5円)を分配金額としております。

第25期計算期間末における費用控除後の配当等収益(53,095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(30,996円)および分配準備積立金(1,256,542円)より分配対象収益は1,340,633円(10,000口当たり141円)であり、うち47,322円(10,000口当たり5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(56,472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(31,072円)および分配準備積立金(1,262,315円)より分配対象収益は1,349,859円(10,000口当たり142円)であり、うち47,325円(10,000口当たり5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(46,788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(29,034円)および分配準備積立金(1,189,824円)より分配対象収益は1,265,646円(10,000口当たり143円)であり、うち44,116円(10,000口当たり5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(81,044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(26,457円)および分配準備積立金(1,081,071円)より分配対象収益は1,188,572円(10,000口当たり149円)であり、うち39,804円(10,000口当たり5円)を分配金額としております。

■分配金のお知らせ

決 算 期	第23期	第24期	第25期	第26期	第27期	第28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23期	第24期	第25期	第26期	第27期	第28期
	(2016年1月19日 ～2016年2月18日)	(2016年2月19日 ～2016年3月18日)	(2016年3月19日 ～2016年4月18日)	(2016年4月19日 ～2016年5月18日)	(2016年5月19日 ～2016年6月20日)	(2016年6月21日 ～2016年7月19日)
当期分配金	5	5	5	5	5	5
（対基準価額比率）	(0.060%)	(0.059%)	(0.061%)	(0.061%)	(0.065%)	(0.065%)
当期の収益	5	5	5	5	5	5
当期の収益以外	—	—	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額	124	136	136	137	138	144

（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-欧州コンバチブル

< 1. 補足情報 >

「ストラクチャラ-欧州コンバチブル（I 10シエアクラス、ユーロ）」は、「ストラクチャラ-欧州コンバチブル」にて既存の他のクラスと合わせた合同運用が行われています。

「ストラクチャラ-欧州コンバチブル」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7月18日現在における「ストラクチャラ-欧州コンバチブル」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7月18日現在）

銘柄		利率	額面金額/口数	評価額	償還年月日	
		%	ユーロ 米ドル	円		
メキシコ	転換社債等	AMERICA MOVIL 0.00 15-20 28/05U	0	1,800,000	208,950,421	2020/5/28
オランダ		SIEMENS FIN CV 1.05 12-17 16/08S	1.05	1,500,000	165,940,189	2017/8/16
フランス		AIR FRANCE KLM CV 2.03 13-23 15/02A	2.03	71,437	88,254,179	2023/2/15
		TOTAL CV 0.50 15-22 02/12S	0.5	800,000	86,841,471	2022/12/2
アラブ首長国連邦		AABAR INVEST CV 1.00 15-22 27/03S	1	1,000,000	82,952,647	2022/3/27
ポルトガル		PARPUBLICA SGPS SA CV 5.25 10-17 28/09A	5.25	650,000	80,032,107	2017/9/28
ドイツ		RAG STIFTUNG CV 0.00 15-21 18/02U	0	600,000	76,434,939	2021/2/18
スペイン		INTL CONSOLIDATED CV 0.614 15-22 17/11S	0.625	700,000	73,429,001	2022/11/17
イギリス		J SAINSBURY PLC 1.25 14-19 21/11S	1.25	500,000	70,991,455	2019/11/21
				ユーロ		
ドイツ		DEUTSCHE POST CV 0.60 12-19 06/12A	0.6	400,000	62,546,473	2019/12/6
フランス		SAFRAN SA CV 0.00 16-20 31/10U	0	5,600	61,350,190	2020/12/31
				英ポンド		
イギリス		VODAFONE GROUP CV 0.00 15-20 26/11U	0	400,000	55,883,623	2020/11/26
				ユーロ		
ハンガリー		MNV CV 3.375 13-19 02/04S	3.375	400,000	52,491,692	2019/4/2
フランス		FONCIERE DES REGIONS 0.875 13-19 01/04S	0.875	4,237	50,237,962	2019/4/1
イタリア		ENI SPA CV 0.00 16-22 13/04U	0	400,000	49,745,347	2022/4/13
オランダ		AIRBUS GROUP SE 0.00 16-21 14/06U	0	400,000	49,476,851	2021/6/14
フランス		RALLYE CV 1.00 13-20 02/10A	1	4,377	49,164,907	2020/10/2
				米ドル		
		LVMH MOET HENNESSY CV 0.00 16-21 16/02U	0	1,837	49,025,140	2021/2/16
				ユーロ		
スペイン	投資証券 転換社債等	AMUNDI CASH INSTITUTIONS SRI - I (C)	-	1,832	47,228,442	-
		TELEFONICA PARTICI 0.00 16-21 09/03U	0	400,000	46,943,241	2021/3/9
		UNIBAIL RODAMCO CV 0.00 14-21 01/07U	0	1,203	45,390,212	2021/7/1
		FRESENIUS MED CARE CV 1.125 14-20 31/01S	1.125	300,000	44,105,055	2020/1/31
オランダ		QIAGEN FINANCE CV 0.375 14-19 19/03S	0.375	400,000	43,325,881	2019/3/19
				ユーロ		
フランス		VEOLIA ENVIRONNEMENT 0.00 16-21 15/03A	0	12,077	42,503,603	2021/3/15
		TECHNIP SA CV 0.875 16-21 25/01S	0.875	300,000	42,160,566	2021/1/25
				米ドル		
ルクセンブルク		SUBSEA 7 INC CV 1.00 06-11 06/06S	1	400,000	41,095,517	2017/10/5
				ユーロ		
オランダ		ACS ACTIVIDADES CV 2.625 13-18 22/10Q	2.625	300,000	40,202,724	2018/10/22
アラブ首長国連邦		AABAR INVEST CV 0.50 15-20 27/03S	0.5	400,000	35,536,140	2020/3/27
イタリア		TELECOM ITALIA CV 1.125 15-22 26/03S	1.125	300,000	33,893,769	2022/3/26
ルクセンブルク		TELECOM ITALIA 6.125 13-16 15/11A	6.125	300,000	32,811,700	2016/11/15

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（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7月19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（2016年2月16日から2016年7月19日まで）

公社債

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
第591回国庫短期証券	500,071	—	—
第189回政府保証預金保険機構債	500,269	—	—

(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7月19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7月19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	%	%	%	%	%
特殊債券（除く金融債）	500,000	500,045	61.2	—	—	—	61.2
合 計	500,000	500,045	61.2	—	—	—	61.2

(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) ー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	
特殊債券（除く金融債）	第189回政府保証預金保険機構債	0.1	500,000	500,045	2016/8/12
合 計			500,000	500,045	

(注) 額面・評価額の単位未満は切捨てです。

ストラクチュラ-欧州コンバーチブル

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2015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。

ファンドの形態	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。	
主な関係法人	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 アセットマネジメント (*)
	管理会社	アムンディ・ルクセンブルク
	保管銀行・ 管理事務代行会社	CACEIS・バンク・ルクセンブルク
管理報酬等	信託報酬	純資産総額に対し年率0.67%
	申込手数料	なし
	その他の費用	ルクセンブルクの年次税（年率0.01%）の他、有価証券売買委託手数料等がかかります。

(*) 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」へ社名変更しました。

■費用の明細

項目	当期
	円
(a) 運用報酬	29,578,780
(b) 管理費用等	6,453,556
(c) その他の費用	7,082,565
合計	43,114,901

■純資産計算書

2015年12月31日現在

項目	当期末
	円
資産合計	4,274,840,791
有価証券	3,902,309,411
買いオプション（評価額）	38,111,003
預金	308,189,045
未収利息	13,576,869
有価証券売却未収入金	3,500,700
為替予約取引評価勘定	5,653,063
為替未収入金	3,500,700
負債合計	81,123,852
売りオプション（評価額）	197,648
借入金	2,461,249
未払配当金	20,366,752
有価証券買付未払金	3,500,700
未払解約金	3,500,700
先物取引評価勘定	40,678,326
未払運用報酬	6,372,741
未払管理費用	436,952
未払税	105,352
為替未払金	3,479,305
その他の負債	24,127
純資産	4,193,716,939

(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。

ストラクチャラ-欧州コンバーチブル

■有価証券等明細 (2015年12月31日現在)

(1) 転換社債等

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
アメリカ	NATIONAL GRIDS CV 0.90 15-20 02/11S	GBP	200,000	36,251,124	ジャージー	BRITISH LAND CV 1.50 12-17 10/09S	GBP	400,000	83,544,279
アラブ首長国 連邦	AABAR INVEST CV 1.00 15-22 27/03S	EUR	1,100,000	135,250,257		BRITISH LND JER CV 0.00 15-20 09/06U	GBP	100,000	17,560,518
	AABAR INVEST CV 0.50 15-20 27/03S	EUR	600,000	73,886,556		CARILLION FINANCE CV 2.50 14-19 19/12S	GBP	100,000	17,815,293
イギリス	IMMARSAT CV 1.75 07-17 16/11S	USD	100,000	18,363,512		CPTL SHOPPING CENTER 2.50 12-18 04/10S	GBP	100,000	19,311,322
	J SAINSBURY PLC 1.25 14-19 21/11S	GBP	600,000	113,541,443		DERWENT LONDON CAP CV 1.125 13-19 24/07S	GBP	100,000	21,126,307
	J SAINSBURY PLC FL. R 15-49 30/01S	GBP	100,000	17,162,132		GABRIEL FINANCE CV 2.00 13-16 26/11S	EUR	200,000	26,549,796
	PRYSMIAN CV 1.25 13-18 08/03S	EUR	100,000	14,697,573		GREAT PORTLAND 1.00 13-18 10/09S	GBP	100,000	21,546,499
イタリア	BENI STABILI CV 2.625 13-19 17/04S	EUR	100,000	15,744,814	スウェーデン	AB INDUSTRIVARDEN 0.00 14-19 15/05U	SEK	4,000,000	65,218,438
	BUZZI UNICEM CV 1.375 13-19 17/07S	EUR	100,000	16,144,292		INDUSTRIVAERDEN CV 1.875 11-17 27/02S	EUR	200,000	28,293,804
	TELECOM ITALIA CV 1.125 15-22 26/03S	EUR	1,300,000	191,990,886	スペイン	CAIXABANK 4.50 13-16 22/11A	EUR	100,000	7,821,117
	VODAFONE GROUP CV 0.00 15-20 26/11U	GBP	400,000	71,694,485		INTL CONSOLIDATED CV 0.25 15-20 17/11S	EUR	100,000	13,361,275
オーストリア	IMMOFINANZ AG CV 4.25 11-18 08/03S	EUR	36,179	21,466,133		INTL CONSOLIDATED CV 0.614 15-22 17/11S	EUR	800,000	106,953,970
オランダ	ACS ACTIVIDADES CV 1.625 14-19 27/03Q	EUR	200,000	29,943,201		LA CAXA CV 1.00 13-17 25/11S	EUR	900,000	120,087,999
	ACS ACTIVIDADES CV 2.625 13-18 22/10Q	EUR	200,000	31,996,390		MELIA HOTELS INTL SA 4.50 13-18 04/04Q	EUR	100,000	21,816,303
	AIRBUS GROUP CV 0.00 15-22 01/07U	EUR	200,000	28,238,658	ドイツ	DEUTSCHE POST CV 0.60 12-19 06/12A	EUR	100,000	17,222,503
	AMORIM ENERGY CV 3.375 13-18 03/06S	EUR	200,000	26,138,688		DEUTSCHE WOHNEN 0.875 14-21 08/09S	EUR	100,000	18,457,133
	AMPLITER NV 2.875 13-18 14/11S	EUR	100,000	21,735,806		FRESENIS REGS CV 0.00 14-19 24/09U	EUR	500,000	92,707,101
	BRENTNAG FINANCE CV 1.875 15-22 02/12S	USD	250,000	31,587,059		FRESENIUS MED CARE CV 1.125 14-20 31/01S	EUR	200,000	32,771,562
	IBERDROLA INTL CV 0.00 15-22 11/11A	EUR	400,000	52,979,892		HANIEL FIN DEUTSC CV 0.00 15-20 12/05U	EUR	300,000	42,132,570
	QIAGEN FINANCE CV 0.375 14-19 19/03S	USD	400,000	55,443,961		RAG STIFTUNG CV 0.00 14-18 31/12U	EUR	200,000	28,663,357
	QIAGEN FINANCE CV 0.875 14-21 19/03S	USD	200,000	28,555,385		RAG STIFTUNG CV 0.00 15-21 18/02U	EUR	600,000	88,566,487
	SALZGITTER FIN CV 2.00 10-17 08/11A	EUR	50,000	7,186,682	ノルウェー	MARINE HARVEST CV 0.875 14-19 06/05S	EUR	100,000	17,141,614
	SALZGITTER REG S 0.00 15-22 05/06U	EUR	100,000	10,981,134	ハンガリー	MNV CV 3.375 13-19 02/04S	EUR	100,000	14,755,985
	SIEMENS FIN CV 1.05 12-17 16/08S	USD	1,750,000	221,924,110	フランス	AIR FRANCE KLM CV 2.03 13-23 15/02A	EUR	85,165	118,315,941
	SONAE INV CV 1.625 14-19 11/06S	EUR	200,000	25,894,584		BIM CV 2.50 15-20 13/11A	EUR	2,220	7,359,058
	STMICROELECTRONICS NV 0.00 14-19 03/07U	USD	600,000	69,237,226		CGG CV 1.75 15-20 01/01S	EUR	40,000	34,034,246
	WERELDHAVE NV CV 1.00 14-19 22/05S	EUR	200,000	27,522,029		CREDIT AGRICOLE CV 0.00 13-16 06/12U	EUR	3,200	31,304,223
ケイマン 諸島	SIEM KAPITAL INC 1.00 12-19 12/09S	USD	200,000	22,554,589		FONCIERE DES REGIONS 0.875 13-19 01/04S	EUR	569	7,494,725

ストラクチャラ-欧州コンバーチブル

銘柄	通貨	額面金額	円換算 評価額
フランス FONCIERE DES REGIONS 3.34 11-17 01/01S	EUR	7,764	101,645,105
INGENICO CV 0.00 15-22 26/06U	EUR	877	21,369,036
MAUREL PROM CV 2.75 15-21 01/07S	EUR	3,500	3,277,039
MAUREL & PROM CV 2.68 14-19 01/07U	EUR	12,346	17,253,099
NEOPOST SA (SHS) CV 1.00 15-22 26/12S	EUR	2,019	12,401,888
NEXANS SA CV 2.50 12-19 01/01A	EUR	2,500	24,588,239
NEXITY SA CV 0.625 14-20 01/01S	EUR	5,480	36,408,309
ORPEA CV 1.75 13-20 01/01S	EUR	1,139	11,558,874
ORPEA CV (REMY COINT.) 0.00 15-19 15/07U	EUR	100,000	13,322,464
PEUGEOT SA 4.45 09-16 01/01S	EUR	12,169	39,959,587
RALLYE CV 1.00 13-20 02/10A	EUR	3,511	37,472,160
TECHNIP SA CV 0.25 11-17 01/01A	EUR	3,882	48,556,490
TOTAL CV 0.50 15-22 02/12S	USD	1,000,000	117,413,926
UNIBAIL RODAMCO CV 0.00 14-21 01/07U	EUR	1,015	43,109,415

銘柄	通貨	額面金額	円換算 評価額
ベルギー BEKAERT NV SA CV 0.75 14-18 18/06A	EUR	200,000	25,962,797
ECONOCOM GRP SA 1.50 14-19 15/01A	EUR	5,800	8,761,242
FORTIS BK SUB CV FL.R 07-XX 19/12Q	EUR	500,000	49,462,343
SAGERPAR REGS CV 0.375 13-18 09/10A	EUR	300,000	43,624,242
ポルトガル PARPUBLICA SGPS SA CV 5.25 10-17 28/09A	EUR	400,000	56,405,182
メキシコ AMERICA MOVIL 0.00 15-20 28/05U	EUR	1,900,000	255,145,377
ルクセンブルク APERAM REGS CV 0.625 14-21 08/07S	USD	200,000	26,790,897
FORTFINLUX SA REG-S FL.R 02-XX 29/11Q	EUR	750,000	61,922,996
GBL VERWALTUNG CV 1.25 13-17 07/02A	EUR	800,000	111,132,480
SUBSEA 7 INC CV 1.00 06-11 06/06S	USD	600,000	67,436,410
TELECOM ITALIA 6.125 13-16 15/11A	EUR	100,000	19,313,849

(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。

GBP (英ポンド)

EUR (ユーロ)

USD (米ドル)

SEK (スウェーデンクローナ)

(2) 投資証券

銘柄	通貨	口数	円換算評価額
フランス AMUNDI CASH INSTITUTIONS SRI - I (C)	EUR	3.754	107,969,939

(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	税 込 分 配 金		債 券 組 入 率 比	純 資 産 額
		円	円		
5期（2012年2月15日）	10,068	0	0	84.3	1,007
6期（2013年2月15日）	10,072	0	0	77.0	1,882
7期（2014年2月17日）	10,076	0	0	79.5	3,458
8期（2015年2月16日）	10,077	0	0	79.2	5,683
9期（2016年2月15日）	10,077	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。

■ 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)	2円 (2)	0.024% (0.019)	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
(販 売 会 社)	(0)	(0.001)	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、 購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(0)	(0.004)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
合 計	2	0.024	

期中の平均基準価額は10,077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。

CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）

■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			
					5年以上	2年以上	2年未満	
	千円	千円	%	%	%	%	%	
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。

■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 收 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) 收 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。