

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6作成期

第29期	（決算日	2016年8月18日）
第30期	（決算日	2016年9月20日）
第31期	（決算日	2016年10月18日）
第32期	（決算日	2016年11月18日）
第33期	（決算日	2016年12月19日）
第34期	（決算日	2017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＞

■最近5作成期の運用実績

	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 比 率	投 資 証 券 組 入 比 率	純資産総額
		円	円	%	%	%	百万円
第2作成期	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
	10期 (2015年1月19日)	9,367	5	△4.8	0.6	97.0	177
第3作成期	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
	16期 (2015年7月21日)	9,923	5	△1.5	0.6	97.1	152
第4作成期	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
	22期 (2016年1月18日)	8,640	5	△7.4	0.9	96.6	108
第5作成期	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
第6作成期	29期 (2016年8月18日)	7,549	5	△2.0	1.9	95.3	53
	30期 (2016年9月20日)	7,576	0	0.4	1.9	95.4	53
	31期 (2016年10月18日)	7,612	0	0.5	1.8	95.3	53
	32期 (2016年11月18日)	7,693	0	1.1	1.5	95.8	44
	33期 (2016年12月19日)	8,218	0	6.8	1.4	96.0	47
	34期 (2017年1月18日)	8,113	0	△1.3	0.8	96.6	36

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注2) 当ファンドは運用成果の目標基準となるベンチマークを設けておりません。また、当ファンドと適切に対比できる参考指数はありません。以下同じ。

■当作成期中の基準価額等の推移

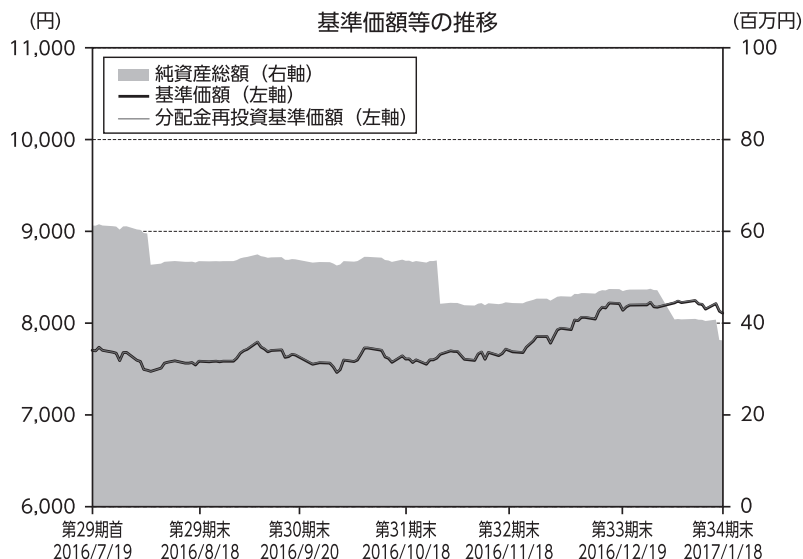
決算期	年 月 日	基準価額	騰 落 率	投 資 信 託	投 資 証 券
			組 入 比	組 入 比	
第29期	(期 首) 2016年 7 月 19日	円 7,708	% -	% 1.6	% 95.8
	7 月末	7,686	△0.3	1.6	95.8
	(期 末) 2016年 8 月 18日	7,554	△2.0	1.9	95.3
第30期	(期 首) 2016年 8 月 18日	7,549	-	1.9	95.3
	8 月末	7,677	1.7	1.8	95.4
	(期 末) 2016年 9 月 20日	7,576	0.4	1.9	95.4
第31期	(期 首) 2016年 9 月 20日	7,576	-	1.9	95.4
	9 月末	7,602	0.3	1.8	95.4
	(期 末) 2016年 10 月 18日	7,612	0.5	1.8	95.3
第32期	(期 首) 2016年 10 月 18日	7,612	-	1.8	95.3
	10 月末	7,702	1.2	1.5	96.0
	(期 末) 2016年 11 月 18日	7,693	1.1	1.5	95.8
第33期	(期 首) 2016年 11 月 18日	7,693	-	1.5	95.8
	11 月末	7,858	2.1	1.5	96.0
	(期 末) 2016年 12 月 19日	8,218	6.8	1.4	96.0
第34期	(期 首) 2016年 12 月 19日	8,218	-	1.4	96.0
	12 月末	8,178	△0.5	1.5	96.1
	(期 末) 2017年 1 月 18日	8,113	△1.3	0.8	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29期首	7,708円
第34期末	8,113円
既払分配金 (税込み)	5円
騰落率	5.3% (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、2016年7月19日の値を基準価額と同一となるように指数化しています。

【基準価額の主な変動要因】

上昇要因

- ① 英国のEU（欧州連合）離脱の決定後、2016年7月半ばから9月上旬にかけて株式市場が回復し、欧州CB市場も恩恵を受けたこと
- ② 2016年6月以降、ECB（欧州中央銀行）の資産購入プログラムが延長され、7月から9月にかけて社債市場が堅調に推移したこと
- ③ 米国大統領選挙でのトランプ氏の当選や、イタリアの国民投票の結果による一時的なショックを経て、12月上旬から1月半ばにかけて株式市場が上昇し、欧州CB市場も恩恵を受けたこと
- ④ 為替市場において、当作成期はユーロ高・円安となったこと

下落要因

- ① 11月前半の米国大統領選挙の結果を受けて米国金利が上昇し、保有する不動産、電気通信・サービス、公益事業など金利敏感セクターが調整したこと
- ② 11月後半は、間近に迫ったイタリアの国民投票に対する懸念から欧州株式市場の上値が重く、欧州社債市場では一時的に利回りが低下（債券価格は上昇）したものの、社債の大量発行が重しとなったこと

【投資環境】

＜欧州CB市場＞

当作成期には政治的なイベントが目白押しでしたが、これらは最終的には欧州CB市場にプラスの影響を及ぼしました。欧州株式市場では、英国のEU離脱の決定後、主要中央銀行が金融緩和策を打ち出したことなどから7月から9月上旬にかけて上昇しました。その後、11月の米国大統領選挙にてトランプ氏の予想外の勝利や、12月にイタリアの国民投票による一時的なショックを経て、12月から当作成期末まで欧州株式市場は上昇しました。欧州社債市場は、利回り追求の動きとECBの社債購入プログラムの延長を受けて7月以降堅調に推移しましたが、10月以降はリフレ観測を背景にユーロと米ドルの金利が再び著しく上昇しました。12月は、金融不安の後退や発行市場の需給好転などから社債利回りが低下（債券価格は上昇）しました。このような環境下、欧州CB市場は、株価上昇によるCBの理論価格が上昇したことや、CBの債券的価値が上昇したことなどの恩恵を受け、上昇して当作成期を終えました。欧州CBの発行市場については、全体的に高いボラティリティ（価格変動性）にもかかわらず、活発なペースを維持しましたが、投資適格および大型発行体の比率は2016年前半に比べて低下したものの、ビデオゲーム・メーカーのUbisoft、フランスの小売業者Rallye/Casino、英国の衛星通信会社Inmarsatといった中型発行体や、ドイツの化学薬品大手Bayerなどが特に注目されました。

＜為替市場＞

当作成期初117円付近で始まったユーロ/円相場は、期待されていた7月末の日銀の金融緩和が小幅にとどまったことで円高・ユーロ安が進行しました。ドイツ銀行が米司法省から多額の賠償金を要求されていることでユーロはさらに売られました。それでもECBの追加緩和期待が後退するにつれ欧州金利が上昇し、連れてユーロ買いが優勢となり、11月に行われた米国大統領選挙でトランプ候補が勝利すると、米国金利の上昇と折からの欧州金利の上昇により内外金利差が拡大し、円が急落しました。イタリアで現政権への信認投票という性格の国民投票が年末に実施され、否決されたことで一瞬ユーロは値を崩しましたが、ECBが国債買い入れの期間を予想以上に長期間延長したことから、金利上昇ペースは抑えられました。年明けはやや円高に振れ、121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、日銀の強力な金融緩和策を背景に非常に低い利回りで推移しました。日銀によるマイナス金利のもと、TDB（国庫短期証券）3ヵ月物の利回りは-0.27%近辺の水準で始まりました。日銀の追加金融緩和への期待に加え年末に向けてTDBの需要が高まったことからTDBの利回りは-0.45%まで低下した局面もありましたが、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マネーブルファンド（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〉

〈ストラクチャラー欧州コンバーチブル（I10シェアクラス、ユーロ）〉

当ファンドは利回りやプレミアム面で妙味がある新発債（2023年満期のInmarsat、2019年満期のTelecor/Vimpelcom）や、一定のセクター分散をもたらし、買収観測も聞かれる企業の新発債（2021年満期のUbisoft）を新たに組み入れました。また、債券と株式の特性をバランスよく備えた新発債（2019年満期のCASA/Eurazeo、2022年満期のRallye/Casino）のほか、Bayerが最近のMonsanto買収の費用を賄うために発行した大型の強制転換社債にも投資しました。当ファンドの相対パフォーマンスにプラス寄与した主な要因は、Aabar/Unicredito、Subsea 7 および Rallye/Casinoなどのオーバーウェイトでした。一方で、マイナス寄与した主な要因は、CGGのCBへの投資、Swiss LifeおよびMTUのCBのアンダーウェイトでした。

（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政府保証債、地方債への投資により、安定した収益の確保を目指して運用を行いました。

（アムンディ・ジャパン株式会社）

【分配金】

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「ストラクチャラー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）

〈ストラクチャラー欧州コンバーチブル（I10シェアクラス、ユーロ）〉

当面のCB市場において、パフォーマンスの主な原動力は株式になると考えており、当ファンドは控えめながらも従来よりも高いデルタ（株価感応度）を維持する方針です。加えて、社債市場のスプレッド（国債との利回り格差）縮小の可能性も依然として将来の良好なパフォーマンスの源泉です。欧州CB市場は現在、債券価値が強く株価下落への連動性が低下しており、市場下落に対する抵抗力が増えています。さらに、ECBの資産購入プログラムから恩恵を受ける投資適格発行体の増加や、ここ1年の金利の低下が、欧州CB市場をしっかりと支えています。これにデルタのオーバーウェイト、妥当なバリュエーション、十分な分散を組み合わせることで、リスクを管理しながら株式へのエクスポージャーを増やす方針です。

（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29期～第34期 (2016年7月20日～2017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)	43円 (12) (29) (1)	0.547% (0.152) (0.379) (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) (7) (0)	0.091 (0.005) (0.086) (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	50	0.638	

期中の平均基準価額は7,783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7月20日から2017年1月18日まで）

投資信託受益証券、投資証券

決 算 期		第 29 期 ～ 第 34 期			
		買 付		売 付	
		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
国内	CAマネーパブルファンド（適格機関投資家専用）	—	—	684,915	689
外国	(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)	—	—	3,340	25,591

- (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7月20日から2017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。

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（2017年1月18日現在）

(1) 国内（邦貨建）投資信託受益証券

銘	柄	第5作成期末 (第28期末)	第6作成期末（第34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	300,000	302
合計	口数・金額 銘柄数〈比率〉	984,915 1	300,000 1	302 〈0.8%〉

（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5作成期末 (第28期末)	第6作成期末（第34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）	7,740	4,400	35,090
合計	口数・金額 銘柄数〈比率〉	7,740 1	4,400 1	35,090 〈96.6%〉

■投資信託財産の構成（2017年1月18日現在）

項	目	第6作成期末（第34期末）	
		評価額	比率
		千円	%
投資信託受益証券		302	0.7
投資証券		35,090	86.7
コール・ローン等、その他		5,079	12.6
投資信託財産総額		40,471	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

	(2016年8月18日)	(2016年9月20日)	(2016年10月18日)	(2016年11月18日)	(2016年12月19日)	(2017年1月18日)現在
項 目	第 29 期 末	第 30 期 末	第 31 期 末	第 32 期 末	第 33 期 末	第 34 期 末
(A) 資 産	53,397,920円	53,489,097円	53,743,463円	44,545,647円	47,587,184円	40,471,710円
コール・ローン等	1,600,532	1,541,214	1,590,458	1,236,071	1,276,770	4,693,127
投資信託受益証券(評価額)	991,710	991,710	991,612	688,651	688,651	302,010
投資証券(評価額)	50,805,678	50,956,173	51,161,393	42,620,925	45,621,763	35,090,000
未 収 入 金	—	—	—	—	—	386,573
(B) 負 債	94,635	69,310	68,056	74,779	81,317	4,145,679
未払収益分配金	35,307	—	—	—	—	—
未払解約金	—	—	—	—	—	4,059,724
未払信託報酬	51,675	53,273	44,910	43,818	42,555	39,582
未払利息	3	4	3	3	3	11
その他未払費用	7,650	16,033	23,143	30,958	38,759	46,362
(C) 純資産総額(A-B)	53,303,285	53,419,787	53,675,407	44,470,868	47,505,867	36,326,031
元 本	70,614,221	70,516,125	70,516,125	57,805,900	57,805,900	44,776,383
次期繰越損益金	△17,310,936	△17,096,338	△16,840,718	△13,335,032	△10,300,033	△ 8,450,352
(D) 受 益 権 総 口 数	70,614,221口	70,516,125口	70,516,125口	57,805,900口	57,805,900口	44,776,383口
1万口当たり基準価額(C/D)	7,549円	7,576円	7,612円	7,693円	8,218円	8,113円

(注記事項)

作成期首元本額	79,609,453円
作成期中追加設定元本額	9,653円
作成期中一部解約元本額	34,842,723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29期 自2016年7月20日 至2016年8月18日 第32期 自2016年10月19日 至2016年11月18日
 第30期 自2016年8月19日 至2016年9月20日 第33期 自2016年11月19日 至2016年12月19日
 第31期 自2016年9月21日 至2016年10月18日 第34期 自2016年12月20日 至2017年1月18日

項 目	第 29 期	第 30 期	第 31 期	第 32 期	第 33 期	第 34 期
(A) 配 当 等 收 益	107,207円	102,424円	102,520円	84,478円	84,517円	69,905円
受 取 配 当 金	107,339	102,536	102,610	84,610	84,610	70,071
支 払 利 息	△ 132	△ 112	△ 90	△ 132	△ 93	△ 166
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 1,147,667	149,737	205,122	429,154	3,000,838	△ 504,047
売 買 益	204,751	150,492	205,220	442,732	3,000,838	30,490
売 買 損	△ 1,352,418	△ 755	△ 98	△ 13,578	—	△ 534,537
(C) 信 託 報 酬 等	△ 59,325	△ 61,656	△ 52,022	△ 51,637	△ 50,356	△ 47,191
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	△ 1,099,785	190,505	255,620	461,995	3,034,999	△ 481,333
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 15,825,332	△ 16,935,648	△ 16,745,143	△ 13,509,133	△ 13,047,138	△ 7,746,015
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 350,512	△ 351,195	△ 351,195	△ 287,894	△ 287,894	△ 223,004
(配 当 等 相 当 額)	(23,528)	(23,566)	(23,566)	(19,318)	(19,318)	(14,963)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 374,040)	(△ 374,761)	(△ 374,761)	(△ 307,212)	(△ 307,212)	(△ 237,967)
(G) 計 (D+E+F)	△ 17,275,629	△ 17,096,338	△ 16,840,718	△ 13,335,032	△ 10,300,033	△ 8,450,352
(H) 収 益 分 配 金	△ 35,307	0	0	0	0	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	△ 17,310,936	△ 17,096,338	△ 16,840,718	△ 13,335,032	△ 10,300,033	△ 8,450,352
追 加 信 託 差 損 益 金	△ 350,512	△ 351,195	△ 351,195	△ 287,894	△ 287,894	△ 223,004
(配 当 等 相 当 額)	(23,528)	(23,566)	(23,566)	(19,318)	(19,318)	(14,963)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 374,040)	(△ 374,761)	(△ 374,761)	(△ 307,212)	(△ 307,212)	(△ 237,967)
分 配 準 備 積 立 金	1,013,730	1,089,675	1,174,861	1,047,307	1,130,444	907,764
繰 越 損 益 金	△ 17,974,154	△ 17,834,818	△ 17,664,384	△ 14,094,445	△ 11,142,583	△ 9,135,112

(注1) (B) 有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

分配金の計算過程

第29期計算期間末における費用控除後の配当等収益（47,882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（23,528円）および分配準備積立金（1,001,155円）より分配対象収益は1,072,565円（10,000口当たり151円）であり、うち35,307円（10,000口当たり5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（77,379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（23,566円）および分配準備積立金（1,012,296円）より分配対象収益は1,113,241円（10,000口当たり157円）ですが、当計算期間に分配した金額はありません。

第31期計算期間末における費用控除後の配当等収益（85,186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（23,566円）および分配準備積立金（1,089,675円）より分配対象収益は1,198,427円（10,000口当たり169円）ですが、当計算期間に分配した金額はありません。

第32期計算期間末における費用控除後の配当等収益（75,984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（19,318円）および分配準備積立金（971,323円）より分配対象収益は1,066,625円（10,000口当たり184円）ですが、当計算期間に分配した金額はありません。

第33期計算期間末における費用控除後の配当等収益（83,137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（19,318円）および分配準備積立金（1,047,307円）より分配対象収益は1,149,762円（10,000口当たり198円）ですが、当計算期間に分配した金額はありません。

第34期計算期間末における費用控除後の配当等収益（22,714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（14,963円）および分配準備積立金（885,050円）より分配対象収益は922,727円（10,000口当たり206円）ですが、当計算期間に分配した金額はありません。

■分配金のお知らせ

決 算 期	第29期	第30期	第31期	第32期	第33期	第34期
1 万口当たりの分配金（税込み）	5円	0円	0円	0円	0円	0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29期	第30期	第31期	第32期	第33期	第34期
	(2016年7月20日 ～2016年8月18日)	(2016年8月19日 ～2016年9月20日)	(2016年9月21日 ～2016年10月18日)	(2016年10月19日 ～2016年11月18日)	(2016年11月19日 ～2016年12月19日)	(2016年12月20日 ～2017年1月18日)
当期分配金	5	—	—	—	—	—
（対基準価額比率）	(0.066%)	(—%)	(—%)	(—%)	(—%)	(—%)
当期の収益	5	—	—	—	—	—
当期の収益以外	—	—	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額	146	157	169	184	198	206

（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-欧州コンバーチブル

< 1. 補足情報 >

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

「ストラクチュラ-欧州コンバーチブル」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2017年1月17日現在における「ストラクチュラ-欧州コンバーチブル」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）

（2017年1月17日現在）

銘柄		利率	額面金額	評価額	償還年月日	
		%	米ドル	円		
オランダ	債券	SIEMENS FIN CV 1.05 12-17 16/08S	1.05	1,250,000	160,130,967	2017/8/16
ポルトガル		PARPUBLICA SGPS SA CV 5.25 10-17 28/09A	5.25	800,000	104,275,490	2017/9/28
		MNV CV 3.375 13-19 02/04S	3.375	700,000	100,935,004	2019/4/2
アラブ首長国連邦		AABAR INVEST CV 1.00 15-22 27/03S	1	1,000,000	94,605,833	2022/3/27
フランス		TOTAL CV 0.50 15-22 02/12S	0.5	800,000	94,087,255	2022/12/2
オランダ		AIRBUS GROUP SE 0.00 16-21 14/06U	0	600,000	79,867,133	2021/6/14
		STMICROELECTRONICS 1.00 14-21 03/07S	1	600,000	77,229,710	2021/7/3
フランス		AIR FRANCE KLM CV 2.03 13-23 15/02A	2.03	59,593	74,450,190	2023/2/15
		UNIBAIL RODAMCO CV 0.00 14-21 01/07U	0	1,957	73,736,504	2021/7/1
		SAFRAN SA CV 0.00 16-20 31/10U	0	6,112	70,721,410	2020/12/31
スペイン		INTL CONSOLIDATED CV 0.614 15-22 17/11S	0.625	600,000	66,385,058	2022/11/17
フランス		RALLYE CV 1.00 13-20 02/10A	1	4,965	60,469,886	2020/10/2
		LVMH MOET HENNESSY CV 0.00 16-21 16/02U	0	1,837	55,896,324	2021/2/16
		FONCIERE DES REGIONS 0.875 13-19 01/04S	0.875	4,750	55,238,537	2019/4/1
ドイツ		RAG STIFTUNG CV 0.00 15-21 18/02U	0	400,000	52,371,233	2021/2/18
オーストリア		STEINHOFF FIN HLDG CV 4.00 14-21 30/01S	4	300,000	51,578,560	2021/1/30
イギリス		TECHNIP SA CV 0.875 16-21 25/01S	0.875	300,000	49,846,984	2021/1/25
メキシコ		AMERICA MOVIL 0.00 15-20 28/05U	0	400,000	47,187,139	2020/5/28
キプロス		AROUNDTOWN PROPERTY 3.00 15-20 05/05S	3	300,000	46,141,643	2020/5/5
ドイツ		FRESENIUS MED CARE CV 1.125 14-20 31/01S	1.125	300,000	44,213,924	2020/1/31
オランダ		AMERICA MOVIL CV 5.50 15-18 17/09Q	5.5	400,000	42,110,847	2018/9/17
		ACS ACTIVIDADES CV 2.625 13-18 22/10Q	2.625	300,000	41,949,750	2018/10/22
ドイツ		RAG STIFTUNG CV 0.00 14-18 31/12U	0	300,000	37,244,113	2018/12/31
フランス		WENDEL CV 0.00 16-19 31/07U	0	5,356	36,886,917	2019/7/31
イタリア		TELECOM ITALIA CV 1.125 15-22 26/03S	1.125	300,000	35,366,063	2022/3/26
フランス		INGENICO CV 0.00 15-22 26/06U	0	1,591	32,066,526	2022/6/26
アラブ首長国連邦		AABAR INVEST CV 0.50 15-20 27/03S	0.5	300,000	31,202,087	2020/3/27
ルクセンブルク		FORTFINLUX SA REG-S FL R 02-XX 29/11Q	1.037	500,000	31,182,388	—
オランダ		BRENTAG FINANCE CV 1.875 15-22 02/12S	1.875	250,000	29,099,387	2022/12/2
アメリカ		NATIONAL GRIDS CV 0.90 15-20 02/11S	0.9	200,000	28,646,553	2020/11/2

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2017年1月18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。

■主要な売買銘柄（2016年2月16日から2017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591回国庫短期証券	500,071		
第303回大阪府公募公債（10年）	509,911		
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（2017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	2017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	%	%	%	%	%
地方債証券	500,000	504,255	61.0	—	—	—	61.0
合 計	500,000	504,255	61.0	—	—	—	61.0

（注1）組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

（注2）単位未満は切捨てです。

（注3）—印は組入れなしです。

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

(B) 公社債銘柄別

国内（邦貨建）公社債

種 類	銘 柄	利 率	額面金額	評 価 額	償還年月日
		%	千円	千円	
地方債証券	第303回大阪府公募公債（10年）	1.93	500,000	504,255	2017/6/28
合 計			500,000	504,255	

（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
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。
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
信託報酬率 (年率)	0.67%
申込手数料	ありません。

■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) (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。

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 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。