







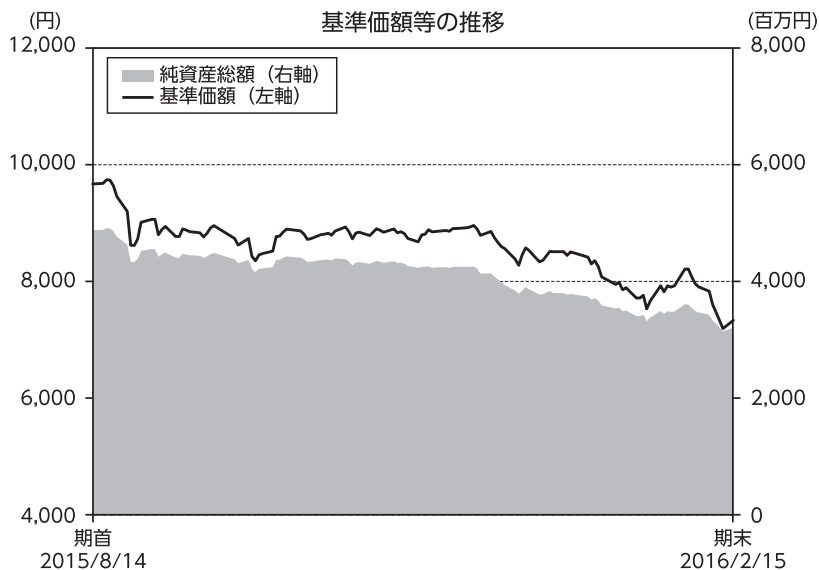




# アムンディ・USインカム・エクイティ・ファンド（年2回決算型）

## 【基準価額等の推移】

第2期首	9,671円
第2期末	7,330円
既払分配金 (税込み)	0円
騰落率	△24.2%



## 【基準価額の主な変動要因】

### 下落要因

- ① 原油価格が30%下落する中、当期を通して、MLP（マスター・リミテッド・パートナーシップ）が大幅に下落したこと
- ② 当期を通して、FRB（米連邦準備理事会）による金融引締め政策の開始時期およびその規模に関する懸念を背景に、高配当株が下落したこと
- ③ 2016年1月から当期末にかけて、景気後退懸念からリート（不動産投資信託）の短期的成長見通しが疑問視され、リートが下落したこと

### 上昇要因

- ① 2015年10月から12月にかけて、大きな信用危機の懸念が一時的に弱まる中、米国10年国債利回りが安定したため、優先株式／優先リートが上昇したこと
- ② 米国10年国債利回りの安定に加え、2015年第3四半期の企業収益が予想を上回ったことから、リートが上昇したこと
- ③ 信用スプレッドが縮小したことを受けて、BDC（ビジネス・ディベロップメント・カンパニー）が10月、11月に大きく上昇したこと

## 【投資環境】

<アムンディ・USインカム・エクイティ・ファンド（毎月決算型）／（年2回決算型）>

<インカム・エクイティ\*市場>

世界経済の成長見通しにおける中国経済の減速、原油価格の下落、ハイイールド債の信用スプレッド拡大、FRBの金利正常化への意向といったさまざまな懸念が存在しました。米国マクロ経済指標は、全般的にプラスの数値となりました。雇用統計は堅調で、米国の労働市場が引き続き底堅く推移していることを示しました。住宅関連指標も全般的に予想を上回りました。しかし、最近発表されたデータでは製造業、事業支出、消費者信頼感指数で軟化の兆候が見られるなど、経済指標は強弱が交錯しています。

このような環境下、株式市場は大きく下落し、ダウ・ジョーンズ好配当株式指数もやや下落しました。そして配当重視セクターのパフォーマンスも軟調なものとなりました。2016年初頭には、米国が景気後退リスクに直面しているとして市場の値動きが大きくなりました。

\*当ファンドにおいて、「インカム・エクイティ」とは米国の好配当株式・リート・優先株式／優先リート・MLP（マスター・リミテッド・パートナーシップ）・BDC（ビジネス・ディベロップメント・カンパニー）をさします。

<為替市場>

当（作成）期の米ドル／円為替市場は、1米ドル＝124円台で始まりしました。人民元の突如切り下げの余波や中国株急落を受けた投資家のリスク回避姿勢の強まりを背景に、米ドルは一時116円台半ばまで急落しました。しばらくは米国景気の強弱感やFRBの利上げ時期への思惑が交錯するなか、米ドル／円は狭いレンジでの取引が続きましたが、2015年10月後半からユーロ圏の緩和期待と米国の年内利上げ観測の高まりから米ドルは次第に下値を切り上げ、11月には123円台後半まで上昇しました。ところが原油急落が投資家のリスク許容度を低下させ、世界株式が大幅な調整を余儀なくされると一転して米ドル売りが優勢となりました。12月のFOMC（米連邦公開市場委員会）での9年半ぶりの利上げは事前に織り込まれていましたが、日銀の補完措置導入は意図や効果が不明確として円買い材料として意識されました。2016年になると中国景気不安、世界株安、急落する原油などを背景に急速に円高が進展し一時116円台となった後、日銀による予想外のマイナス金利政策決定直後は121円台前半になりました。米経済成長鈍化、FRBの利上げ観測の後退、世界金利の低下が進むとたちまち米ドルは売り込まれ、2月11日には110円台となり2014年10月末の日銀の追加量的緩和後の円安・米ドル高を帳消しにする水準まで下落幅を広げ、1米ドル＝114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。1月末の日銀によるマイナス金利導入後には利回りは一時-0.20%まで低下しましたが、当（作成）期末の利回りは-0.12%とやや戻りました。

# アムンディ・USインカム・エクイティ・ファンド

## 【ポートフォリオ】

### <アムンディ・USインカム・エクイティ・ファンド（毎月決算型）／（年2回決算型）>

当ファンドは、円建の外国籍の投資信託である「TCWファンズ-TCWマルチインカムUSエクイティ・ファンド（米ドル、XJシェアクラス）」と、円建の国内籍の投資信託である「CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）」を主要投資対象とし、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した。当ファンドは「TCWファンズ-TCWマルチインカムUSエクイティ・ファンド（米ドル、XJシェアクラス）」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み入れました。

（アムンディ・ジャパン株式会社）

### <TCWファンズ-TCWマルチインカムUSエクイティ・ファンド（米ドル、XJシェアクラス）>

当（作成）期、当ファンドは各インカム・エクイティ・セクターへの資産配分は大きく変更しませんでした。そうした中、原油価格下落によるMLPの事業環境悪化を受け、基本配分（15%）よりウェイトを小さくしていたMLPの組入比率を引き下げました。ノット・オフショア・パートナーズ、ティーケイなどを全売却しました。売却資金の大半は、次の魅力的な投資機会に備えるために現金として残し、現金の保有比率を若干高めました。また当ファンドは、特に高配当銘柄で積極的に入れ替えを行い、キンダー・モルガン、セラバンス、IBM、レナー、MDCホールディングズなどを全売却する一方、D.R. ホートン、アルトリア・グループ、ペプシコ、ロッキード・マーチンを新規に組み入れました。

（TCWインベストメント・マネジメント・カンパニー）

### <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】

### <アムンディ・USインカム・エクイティ・ファンド（毎月決算型）>

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。

### <アムンディ・USインカム・エクイティ・ファンド（年2回決算型）>

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、見送りとさせていただきました（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】

### <アムンディ・USインカム・エクイティ・ファンド（毎月決算型）／（年2回決算型）>

当ファンドが投資する「TCWファンズ-TCWマルチインカムUSエクイティ・ファンド（米ドル、XJシェアクラス）」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）

### <TCWファンズ-TCWマルチインカムUSエクイティ・ファンド（米ドル、XJシェアクラス）>

海外経済の成長減速とFRBの利上げペースをめぐる不透明感が存在しますが、当ファンドでは米国GDP（国内総生産）成長率が今後1.5～2.5%前後で推移すると考えます。今回の株価の大幅下落は、長期のマクロ指標等からみて行き過ぎであり、企業収益は悪くても1桁台半ばの伸びを期待しています。世界経済の成長見通しの不透明さ、経済指標次第のFRBの利上げ方針のため、当面ボラティリティ（価格変動性）の高止まりを予想します。当ファンドは、事業環境の悪化を鑑みMLPの組入れを引き続き基本配分より大きく削減した状態を維持する方針です。一方で、リートはオーバーウェイトを維持し、機会があればウェイトを引き上げる考えです。信用リスクに対する懸念が浮上しているBDCはより中立的なスタンスにする考えです。

（TCWインベストメント・マネジメント・カンパニー）

### <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）

# アムンディ・USインカム・エクイティ・ファンド（毎月決算型）

## ■ 1万口当たりの費用明細

項目	第6期～第11期 (2015年8月15日 ～2016年2月15日)		項目の概要
	金額	比率	
(a) 信託報酬 ( 投信会社 ) ( 販売会社 )  ( 受託会社 )	45円 ( 7 ) (37)	0.535% (0.082) (0.437)	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 )	1 (0)	0.014 (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 ファンドの法定開示資料に係る費用
合計	46	0.549	
期中の平均基準価額は8,476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8月15日から2016年2月15日まで）

### 投資信託受益証券、投資証券

決 算 期	第 6 期 ～ 第 11 期			
	買 付		売 付	
	口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
外国 (ルクセンブルク) TCWファンズ-TCWマルチインカムUSエクイティ・ファンド (米ドル、XJシェアクラス)	千口 7	千円 66,423	千口 162	千円 1,358,876

(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8月15日から2016年2月15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2月15日現在）

(1) 国内（邦貨建）投資信託受益証券

銘柄		第1作成期末 (第5期末)	第2作成期末(第11期末)	
		口数	口数	評価額
CAマネープールファンド(適格機関投資家専用)		口 53,587	千口 53,587	千円 54,000
合計	口数・金額	53,587	53,587	54,000
	銘柄数<比率>	1	1	<0.7%>

(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1作成期末 (第5期末)	第2作成期末(第11期末)	
		口数	口数	評価額
(ルクセンブルク) TCWファンズ-TCWマルチインカムUSエクイティ・ファンド (米ドル、XJシェアクラス)		千口 1,236	千口 1,081	千円 7,581,053
合計	口数・金額	1,236	1,081	7,581,053
	銘柄数<比率>	1	1	<97.8%>

# アムンディ・USインカム・エクイティ・ファンド（毎月決算型）

## ■投資信託財産の構成（2016年2月15日現在）

項 目	第 2 作 成 期 末 (第 11 期 末)	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投 資 信 託 受 益 証 券	54,000	0.7
投 資 証 券	7,581,053	96.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	194,145	2.5
投 資 信 託 財 産 総 額	7,829,198	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9月14日)	(2015年10月14日)	(2015年11月16日)	(2015年12月14日)	(2016年1月14日)	(2016年2月15日)現在
	第 6 期 末	第 7 期 末	第 8 期 末	第 9 期 末	第 10 期 末	第 11 期 末
(A) 資 産	10,936,204,236円	10,791,553,681円	10,431,112,342円	9,723,588,634円	8,515,276,812円	7,829,198,063円
コール・ローン等	210,911,379	205,266,425	199,803,288	391,715,927	171,624,265	194,145,058
投資信託受益証券(評価額)	54,000,000	54,000,000	54,000,000	54,000,000	54,000,000	54,000,000
投資証券(評価額)	10,657,440,000	10,524,468,000	10,156,945,000	9,229,008,800	8,287,347,000	7,581,053,000
未 収 入 金	13,852,800	7,819,200	20,364,000	48,863,800	2,305,500	—
未 収 利 息	57	56	54	107	47	5
(B) 負 債	60,736,714	50,405,014	62,280,945	293,688,532	46,133,933	75,540,843
未払収益分配金	31,102,441	30,874,974	30,347,709	28,654,831	27,548,154	27,115,466
未 払 解 約 金	19,266,591	9,757,142	21,042,066	255,742,982	9,196,787	39,342,312
未 払 信 託 報 酬	10,126,382	9,302,906	10,170,229	8,359,472	8,234,818	7,706,324
その他未払費用	241,300	469,992	720,941	931,247	1,154,174	1,376,741
(C) 純資産総額(A-B)	10,875,467,522	10,741,148,667	10,368,831,397	9,429,900,102	8,469,142,879	7,753,657,220
元 本	12,440,976,433	12,349,989,943	12,139,083,895	11,461,932,737	11,019,261,861	10,846,186,647
次期繰越損益金	△ 1,565,508,911	△ 1,608,841,276	△ 1,770,252,498	△ 2,032,032,635	△ 2,550,118,982	△ 3,092,529,427
(D) 受 益 権 総 口 数	12,440,976,433口	12,349,989,943口	12,139,083,895口	11,461,932,737口	11,019,261,861口	10,846,186,647口
1万口当たり基準価額(C/D)	8,742円	8,697円	8,542円	8,227円	7,686円	7,149円

(注記事項)

作成期首元本額	12,491,928,160円
作成期中追加設定元本額	147,528,037円
作成期中一部解約元本額	1,793,269,550円

# アムンディ・USインカム・エクイティ・ファンド（毎月決算型）

## ■ 損益の状況

第6期 自2015年8月15日 至2015年9月14日 第9期 自2015年11月17日 至2015年12月14日  
 第7期 自2015年9月15日 至2015年10月14日 第10期 自2015年12月15日 至2016年1月14日  
 第8期 自2015年10月15日 至2015年11月16日 第11期 自2016年1月15日 至2016年2月15日

項 目	第 6 期	第 7 期	第 8 期	第 9 期	第 10 期	第 11 期
(A) 配 当 等 収 益	46,875,142円	46,568,193円	45,814,788円	43,459,275円	41,656,082円	41,065,494円
受 取 配 当 金	46,873,372	46,566,640	45,813,062	43,457,538	41,654,440	41,064,696
受 取 利 息	1,770	1,553	1,726	1,737	1,642	798
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△1,066,793,139	△ 60,875,582	△ 193,927,378	△ 366,906,220	△ 602,234,229	△ 588,463,750
売 買 損 益	6,677,947	959,903	1,146,050	7,827,359	3,975,202	3,075,126
売 買 損	△1,073,471,086	△ 61,835,485	△ 195,073,428	△ 374,733,579	△ 606,209,431	△ 591,538,876
(C) 信 託 報 酬 等	△ 10,367,682	△ 9,531,598	△ 10,421,178	△ 8,569,778	△ 8,457,745	△ 7,928,891
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	△1,030,285,679	△ 23,838,987	△ 158,533,768	△ 332,016,723	△ 569,035,892	△ 555,327,147
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 474,253,100	△1,522,468,572	△1,548,926,166	△1,638,578,353	△1,919,604,062	△2,474,047,744
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 29,867,691	△ 31,658,743	△ 32,444,855	△ 32,782,728	△ 33,930,874	△ 36,039,070
(配 当 等 相 当 額)	( 13,170,225)	( 13,205,881)	( 13,074,329)	( 12,510,306)	( 12,165,810)	( 12,092,975)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 43,037,916)	(△ 44,864,624)	(△ 45,519,184)	(△ 45,293,034)	(△ 46,096,684)	(△ 48,132,045)
(G) 計 (D+E+F)	△1,534,406,470	△1,577,966,302	△1,739,904,789	△2,003,377,804	△2,522,570,828	△3,065,413,961
(H) 収 益 分 配 金	△ 31,102,441	△ 30,874,974	△ 30,347,709	△ 28,654,831	△ 27,548,154	△ 27,115,466
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	△1,565,508,911	△1,608,841,276	△1,770,252,498	△2,032,032,635	△2,550,118,982	△3,092,529,427
追 加 信 託 差 損 益 金	△ 29,867,691	△ 31,658,743	△ 32,444,855	△ 32,782,728	△ 33,930,874	△ 36,039,070
(配 当 等 相 当 額)	( 13,170,225)	( 13,205,881)	( 13,074,329)	( 12,510,306)	( 12,165,810)	( 12,092,975)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 43,037,916)	(△ 44,864,624)	(△ 45,519,184)	(△ 45,293,034)	(△ 46,096,684)	(△ 48,132,045)
分 配 準 備 積 立 金	103,343,547	108,618,691	111,718,609	111,574,111	112,779,418	116,911,762
繰 越 損 益 金	△1,638,984,767	△1,685,801,224	△1,849,526,252	△2,110,824,018	△2,628,967,526	△3,173,402,119

(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6期計算期間末における費用控除後の配当等収益(36,507,460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(13,170,225円)および分配準備積立金(97,938,528円)より分配対象収益は147,616,213円(10,000口当たり118円)であり、うち31,102,441円(10,000口当たり25円)を分配金額としております。

第7期計算期間末における費用控除後の配当等収益(37,036,595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(13,205,881円)および分配準備積立金(102,457,070円)より分配対象収益は152,699,546円(10,000口当たり123円)であり、うち30,874,974円(10,000口当たり25円)を分配金額としております。

第8期計算期間末における費用控除後の配当等収益(35,393,610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(13,074,329円)および分配準備積立金(106,672,708円)より分配対象収益は155,140,647円(10,000口当たり127円)であり、うち30,347,709円(10,000口当たり25円)を分配金額としております。

第9期計算期間末における費用控除後の配当等収益(34,889,497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(12,510,306円)および分配準備積立金(105,339,445円)より分配対象収益は152,739,248円(10,000口当たり133円)であり、うち28,654,831円(10,000口当たり25円)を分配金額としております。

第10期計算期間末における費用控除後の配当等収益(33,198,337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(12,165,810円)および分配準備積立金(107,129,235円)より分配対象収益は152,493,382円(10,000口当たり138円)であり、うち27,548,154円(10,000口当たり25円)を分配金額としております。

第11期計算期間末における費用控除後の配当等収益(33,136,603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(12,092,975円)および分配準備積立金(110,890,625円)より分配対象収益は156,120,203円(10,000口当たり143円)であり、うち27,115,466円(10,000口当たり25円)を分配金額としております。

# アムンディ・USインカム・エクイティ・ファンド（毎月決算型）

## ■分配金のお知らせ

決 算 期	第6期	第7期	第8期	第9期	第10期	第11期
1万口当たりの分配金（税込み）	25円	25円	25円	25円	25円	25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6期	第7期	第8期	第9期	第10期	第11期
	(2015年8月15日 ～2015年9月14日)	(2015年9月15日 ～2015年10月14日)	(2015年10月15日 ～2015年11月16日)	(2015年11月17日 ～2015年12月14日)	(2015年12月15日 ～2016年1月14日)	(2016年1月15日 ～2016年2月15日)
当期分配金	25	25	25	25	25	25
（対基準価額比率）	(0.285%)	(0.287%)	(0.292%)	(0.303%)	(0.324%)	(0.348%)
当期の収益	25	25	25	25	25	25
当期の収益以外	—	—	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額	93	98	102	108	113	118

（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。

■ 1万口当たりの費用明細

項目	第2期 (2015年8月15日 ～2016年2月15日)		項目の概要
	金額	比率	
(a) 信託報酬 ( 投 信 会 社 ) ( 販 売 会 社 ) ( 受 託 会 社 )	46円 ( 7 ) (38)	0.535% (0.082) (0.437)	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 )	2 ( 0 ) ( 2 )	0.026 (0.005) (0.021)	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	48	0.561	

期中の平均基準価額は8,600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。

■ 期中の売買及び取引の状況（2015年8月15日から2016年2月15日まで）

投資信託受益証券、投資証券

		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
外国	(ルクセンブルク)	千口	千円	千口	千円
	TCWファンズ-TCWマルチインカムUSエクイティ・ファンド (米ドル、XJシェアクラス)	10	89,783	67	559,122

- (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8月15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。

# アムンディ・USインカム・エクイティ・ファンド（年2回決算型）

## ■組入資産の明細（2016年2月15日現在）

### (1) 国内（邦貨建）投資信託受益証券

銘	柄	期首（前期末）	当 期 末	
		口 数	口 数	評 価 額
		千口	千口	千円
CAマネープールファンド(適格機関投資家専用)		23,816	23,816	24,000
合 計	口 数 ・ 金 額	23,816	23,816	24,000
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	1	<0.7%>

(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	期首（前期末）	当 期 末	
		口 数	口 数	評 価 額
		千口	千口	千円
(ルクセンブルク) TCWファンズ-TCWマルチインカムUSエクイティ・ファンド (米ドル、XJシェアクラス)		502	445	3,127,096
合 計	口 数 ・ 金 額	502	445	3,127,096
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	1	<97.7%>



■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	%
投 資 信 託 受 益 証 券	24,000	0.7
投 資 証 券	3,127,096	96.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	81,427	2.6
投 資 信 託 財 産 総 額	3,232,523	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	3,232,523,274円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	74,280,572
投資信託受益証券(評価額)	24,000,000
投 資 証 券(評価額)	3,127,096,700
未 収 入 金	7,146,000
未 収 利 息	2
(B)負 債	31,844,043
未 払 解 約 金	8,842,214
未 払 信 託 報 酬	21,946,294
そ の 他 未 払 費 用	1,055,535
(C)純 資 産 総 額(A - B)	3,200,679,231
元 本	4,366,722,695
次 期 繰 越 損 益 金	△1,166,043,464
(D)受 益 権 総 口 数	4,366,722,695口
1万口当たり基準価額(C / D)	7,330円

(注記事項)

期首元本額 5,045,262,451円

期中追加設定元本額 15,841,111円

期中一部解約元本額 694,380,867円

■損益の状況

当期 自2015年8月15日 至2016年2月15日

項 目	当 期
(A)配 当 等 収 益	102,293,564円
受 取 配 当 金	102,290,284
受 取 利 息	3,280
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△1,100,065,370
売 買 益	75,778,680
売 買 損	△1,175,844,050
(C)信 託 報 酬 等	△ 23,001,829
(D)当 期 損 益 金(A + B + C)	△1,020,773,635
(E)前 期 繰 越 損 益 金	△ 133,527,140
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	△ 11,742,689
(配 当 等 相 当 額)	( 2,197,426)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 13,940,115)
(G)計 (D + E + F)	△1,166,043,464
(H)収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G + H)	△1,166,043,464
追 加 信 託 差 損 益 金	△ 11,742,689
(配 当 等 相 当 額)	( 2,197,426)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 13,940,115)
分 配 準 備 積 立 金	139,826,762
繰 越 損 益 金	△1,294,127,537

(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。

■分配金のお知らせ

当期の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、見送りとさせていただきます。

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2期
	(2015年8月15日～2016年2月15日)
当期分配金	—
（対基準価額比率）	（—%）
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	325

（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。

TCWファンズ-TCWマルチインカムUSエクイティ・ファンド

<補足情報>

「TCWファンズ-TCWマルチインカムUSエクイティ・ファンド (XJシェアクラス、米ドル)」は、「TCWファンズ-TCWマルチインカムUSエクイティ・ファンド」にて既存の他のクラスと合わせた合同運用が行われています。

「TCWファンズ-TCWマルチインカムUSエクイティ・ファンド」の決算日 (毎年9月末) 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2月12日現在における「TCWファンズ-TCWマルチインカムUSエクイティ・ファンド」の補足情報を掲載しております。

■有価証券明細 (評価額上位30銘柄)

(2016年2月12日現在)

銘柄		株数	評価額			
			通貨	現地通貨建金額	米ドル建評価額	
アメリカ スイス アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	50,500	USD	2,530,555.00	2,530,555.00
		CHUBB LIMITED	18,500	USD	2,114,735.00	2,114,735.00
		PUBLIC STORAGE DEPOSIT PFD SHS A	78,500	USD	2,061,410.00	2,061,410.00
		COCA-COLA CO	46,600	USD	2,008,926.00	2,008,926.00
		LOCKHEED MARTIN CORP	9,500	USD	1,957,760.00	1,957,760.00
		MORGAN STANLEY PFD SHS SER - F	75,500	USD	1,947,900.00	1,947,900.00
		JP MORGAN CHASE & CO PFD SHS	75,000	USD	1,920,000.00	1,920,000.00
		ALTRIA GROUP INC	29,000	USD	1,739,130.00	1,739,130.00
		PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC	18,900	USD	1,683,234.00	1,683,234.00
		H&R BLOCK INC	48,300	USD	1,628,676.00	1,628,676.00
		WAL-MART STORES INC	24,500	USD	1,621,410.00	1,621,410.00
		BB&T CORP 5.625% 31/12/49 PREFERRED	65,800	USD	1,616,048.00	1,616,048.00
		GOLUB CAPITAL BDC	101,000	USD	1,576,610.00	1,576,610.00
		VEREIT INC	66,000	USD	1,564,200.00	1,564,200.00
		HEALTHCARE SVCS GR	44,800	USD	1,529,024.00	1,529,024.00
		PPL CORP	42,600	USD	1,522,524.00	1,522,524.00
		BANK OF AMERICA CORP PFD SHS SERIES Y	57,800	USD	1,458,872.00	1,458,872.00
		REPUBLIC SERVICES INC	33,000	USD	1,458,600.00	1,458,600.00
		SIMON PROPERTY GROUP INC	7,900	USD	1,449,887.00	1,449,887.00
		PEPSICO INC	14,700	USD	1,447,803.00	1,447,803.00
		WELLS FARGO & COMPANY PREFERRED PERPETUAL	58,676	USD	1,445,189.88	1,445,189.88
		OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	20,200	USD	1,354,612.00	1,354,612.00
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES DEPOSIT SHS D	51,700	USD	1,337,479.00	1,337,479.00
		KRAFT HEINZ CO/THE	17,700	USD	1,272,984.00	1,272,984.00
		WASTE MANAGEMENT INC	23,400	USD	1,263,132.00	1,263,132.00
		MACERICH CO	15,900	USD	1,197,111.00	1,197,111.00
		TPG SPECIALTY LENDING	77,500	USD	1,179,550.00	1,179,550.00
		PUBLIC STORAGE	4,900	USD	1,144,689.00	1,144,689.00
		TRIPLEPOINT VENTURE GROWTH	122,300	USD	1,130,052.00	1,130,052.00
		NEXTERA ENERGY INC	10,000	USD	1,116,700.00	1,116,700.00

(注) 通貨欄の表記は以下の通りです。

USD(米ドル)

## TCWファンズ-マルチインカムUSエクイティ・ファンド

決算日 2015年9月30日

(計算期間：2015年3月20日～2015年9月30日) (\*)

「TCWファンズ-マルチインカムUSエクイティ・ファンド (米ドル、XJシェアクラス)」 (円建) は、「TCWファンズ-マルチインカムUSエクイティ・ファンド」にて、他のクラスと合わせた合同運用が行われています。

「TCWファンズ-マルチインカムUSエクイティ・ファンド」は毎年9月30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9月30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ため、「TCWファンズ-マルチインカムUSエクイティ・ファンド」を掲載しております。

(\*) ファンドの計算期間は、設定日の2015年3月20日から2015年9月30日までとなっております。

■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	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図ることを目的として運用を行います。	
収益分配方針	原則として、毎月分配します。	
ファンドの関係法人	投資顧問会社	TCWインベストメント・マネジメント・カンパニー
	副投資顧問会社	アムンディ・ジャパン株式会社
	保管銀行・ 管理事務代行会社	ソシエテ・ジェネラル・バンク・アンド・トラスト
費用	運用報酬等	年率0.82%(XJシェアクラス)
	申込手数料	ありません。

## ■費用の明細

項目	当期
	米ドル
(a) 運用報酬	288,529
(b) 管理費用等	113,076
(c) その他の費用	479,137
合計	880,742

## ■純資産計算書

2015年9月30日現在

項目	当期末
	米ドル
<b>資産合計</b>	121,042,306
有価証券	112,264,677
預金	2,675,147
有価証券売却未収入金	4,810,405
為替未収入金	705,081
未収配当金	586,739
為替予約取引評価勘定	257
<b>負債合計</b>	1,491,800
未払解約金	151,400
未払配当金	548,115
為替未払金	705,298
未払運用報酬	41,715
未払投資顧問料	25,930
未払税	2,992
未払管理費用	16,346
為替予約取引評価勘定	4
<b>純資産</b>	119,550,506

(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

## 株式

(2015年9月30日現在)

	銘柄	株数	現地通貨	米ドル換算評価額
アメリカ	ABBVIE INC	25,000	USD	1,360,250.00
	AMERICAN CAPITAL AGENCY	38,900	USD	727,430.00
	AMERICAN CAPITAL LTD	80,200	USD	975,232.00
	AMERICAN CAPITAL MORTGAGE INVESTMENT	35,800	USD	527,692.00
	AMERICAN TOWER CORP	14,500	USD	1,433,325.00
	APOLLO INVESTMENT	230,100	USD	1,260,948.00
	APPLE INC	12,000	USD	1,323,600.00
	ARES CAPITAL	123,500	USD	1,788,280.00
	AVALONBAY COMMUNITIE	4,000	USD	699,280.00
	BANK OF AMERICA CORP PFD SHS SERIES Y	78,800	USD	2,003,096.00
	BB&T CORP 5.625% 31/12/49 PREFERRED	79,000	USD	1,959,990.00
	BOSTON PROPERTIES INC	4,200	USD	497,280.00
	CHIMERA INVESTMENT CORP	91,800	USD	1,227,366.00
	COCA-COLA CO	63,400	USD	2,543,608.00
	DIGITAL REALTY TRUST	10,900	USD	711,988.00
	DIGITAL REALTY TRUST INC	63,900	USD	1,705,491.00
	DUKE ENERGY CORP 73 JRSN PERF	36,794	USD	922,793.52
	EQUINIX INC COMMON STOCK REIT	2,900	USD	792,860.00
	EQUITY RESIDENTIAL	7,700	USD	578,424.00
	EXTERRAN HOLDINGS	57,500	USD	1,035,000.00
	FS INVESTMENT CORP	68,700	USD	640,284.00
	GAM & LEIR PRPR	36,200	USD	1,075,140.00
	GEN GROWTH PROP	23,500	USD	610,295.00
	GOLDMAN SACHS BDC INC	45,800	USD	843,178.00
	GOLUB CAPITAL BDC	68,900	USD	1,101,022.00
	HCP INC	26,300	USD	979,675.00
	HERCULES TECHNOLOGY GROWTH CPT	62,400	USD	630,864.00
	HORIZON TECHNOLOGY FINANCE CORP	44,000	USD	398,200.00
	HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	18,100	USD	462,998.00
	HOST HOTELS & RESORTS INC	38,600	USD	610,266.00
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	21,800	USD	3,160,346.00
	JP MORGAN CHASE & CO PFD SHS	79,200	USD	2,045,736.00
	KINDER MORGAN	39,600	USD	1,096,128.00
	LENNAR A	39,900	USD	1,920,387.00
	M&T BANK CORPORATION	32,500	USD	3,963,375.00
	MACERICH CO	15,900	USD	1,221,438.00
	MAIN STREET CAPITAL	14,200	USD	378,572.00
	MDC HOLD. (DEL.)	101,300	USD	2,652,034.00
	MEDLEY CAPITAL CORP	51,800	USD	385,392.00
	MERCK AND CO INC	16,700	USD	824,813.00
	MFA FINANCIAL SHS	88,200	USD	600,642.00
	MORGAN STANLEY PFD SHS SER - F	75,500	USD	2,018,115.00
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES DEPOSIT SHS D	64,700	USD	1,639,498.00
	NEW MOUNTAIN FIN	60,500	USD	822,195.00
	NORTHSTAR REALTY FINANCE	41,600	USD	513,760.00
	NORTHSTAR REALTY FINANCE PFD SER E	50,100	USD	1,213,923.00
	NRG YIELD INC A	27,100	USD	302,165.00
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	20,200	USD	1,336,230.00

## TCWファンズ-マルチインカムUSエクイティ・ファンド

	銘柄	株数	現地通貨	米ドル換算評価額
アメリカ	ONEOK INC	25,100	USD	808,220.00
	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC	23,000	USD	1,824,590.00
	PLAINS GP	80,355	USD	1,406,212.50
	PLUM CREEK TIMBER	21,300	USD	841,563.00
	PROLOGIS	29,400	USD	1,143,660.00
	PUBLIC STORAGE	4,900	USD	1,036,987.00
	PUBLIC STORAGE DEPOSIT PFD SHS A	78,500	USD	1,989,975.00
	QUALCOMM INC	58,200	USD	3,127,086.00
	QWEST CORP 6.125%	61,100	USD	1,466,400.00
	REDWOOD TRUST INC.	37,200	USD	514,848.00
	SIMON PROPERTY GROUP INC	7,800	USD	1,433,016.00
	SOLAR CAPITAL	56,800	USD	898,576.00
	SOLAR SENIOR CAPITAL LTD	44,700	USD	635,634.00
	SPECTRA ENERGY	30,300	USD	795,981.00
	TCP CAPITAL CORP	81,900	USD	1,110,564.00
	THERAVANCE	125,400	USD	900,372.00
	TICC CAPITAL CORP	73,500	USD	493,185.00
	TPG SPECIALTY LENDING	92,900	USD	1,526,347.00
	TRIANGLE CAPITAL	45,900	USD	756,432.00
	TRIPLEPOINT VENTURE GROWTH	89,700	USD	909,558.00
	TWO ARBORS INVESTMENT CORP	147,100	USD	1,297,422.00
	US BANCORP	32,000	USD	1,312,320.00
	VENTAS INC	20,800	USD	1,166,048.00
	VEREIT INC	75,400	USD	1,824,680.00
	VERIZON COMMUNICATION INC	24,442	USD	635,492.00
	VERIZON COMMUNICATIONS INC	66,800	USD	2,906,468.00
	VORNADO REALTY TRUST	6,500	USD	587,730.00
	WAL-MART STORES INC	49,100	USD	3,183,644.00
	WASTE MANAGEMENT INC	16,500	USD	821,865.00
	WELLS FARGO & CO	62,700	USD	3,219,645.00
	WELLS FARGO & COMPANY PREFERRED PERPETUAL	79,076	USD	2,016,438.00
	WELLTOWER INC	18,700	USD	1,266,364.00
	WEYERHAEUSER CO	29,500	USD	806,530.00
WILLIAMS COMPANIES INC	39,200	USD	1,444,520.00	
WP GLIMCHER	95,898	USD	1,118,170.68	
カナダ	ENBRIDGE USD	32,700	USD	1,214,151.00
	TARGA RESOURCES	20,300	USD	1,045,856.00
	TRANSCANADA USD	22,000	USD	694,760.00
ケイマン諸島	COLONY CAPITAL INC	55,000	USD	1,075,800.00
	SEAGATE TECHNOLOGY	29,900	USD	1,339,520.00
マーシャル諸島	GOLAR LNG PARTNERS LP UNITS	28,329	USD	415,586.43
	KNOT OFFSHORE PARTNERS LP	13,337	USD	197,387.60
	TEEKAY OFFSHORE PARTNERS	57,200	USD	823,108.00
	TEEKAY SHS	24,000	USD	711,360.00

(注) 通貨欄の表記は以下の通りです。

USD (米ドル)

# 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		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。



## ■ 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			
	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) —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
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。

**Amundi**  
**ASSET MANAGEMENT**  
アムンディ アセットマネジメント