

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／債券	
信託期間	2016年1月14日から2021年4月8日までです。	
運用方針	欧州のハイイールド債を主要投資対象とするユーロ売り／豪ドル買いの為替取引を行う、「ストラクチャラ-欧州ハイ・イールド・ボンド（I3シェアクラス、豪ドル）」を主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保と中長期的な投資信託財産の成長を目指して運用を行います。なお、「CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）」への投資も行います。	
主要運用対象	アムンディ・欧州ハイ・イールド債券ファンド（豪ドルコース）＜年2回決算型＞	ストラクチャラ-欧州ハイ・イールド・ボンド（I3シェアクラス、豪ドル） CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）
	ストラクチャラ-欧州ハイ・イールド・ボンド（I3シェアクラス、豪ドル）	欧州のハイイールド債
	CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）	本邦通貨表示の短期公社債 関投資家専用）
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2回、原則毎年4月および10月の各8日。休業日の場合は翌営業日）に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。分配金額は、委託者が基準価額水準および市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。	

アムンディ・欧州
 ハイ・イールド債券ファンド
 （豪ドルコース）＜年2回決算型＞

運用報告書（全体版）

第2期（決算日 2016年10月11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、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・欧州ハイ・イールド債券ファンド（豪ドルコース）＜年2回決算型＞

■設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額 (分配落)	騰 落 率			投 資 組 資 益 入 証 比	信 託 証 券 率	投 資 組 入 証 比	券 率	純資産総額
		税 分	込 配	み 金					
(設 定 日) 2016年1月14日	円 10,000		円 —	期 騰 落 中 率 —	% —	% —	% —	% —	百万円 1
1 期 (2016年4月8日)	10,073		10	0.8	0.2		95.6		4
2 期 (2016年10月11日)	10,270		0	2.0	0.1		97.5		13

(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。

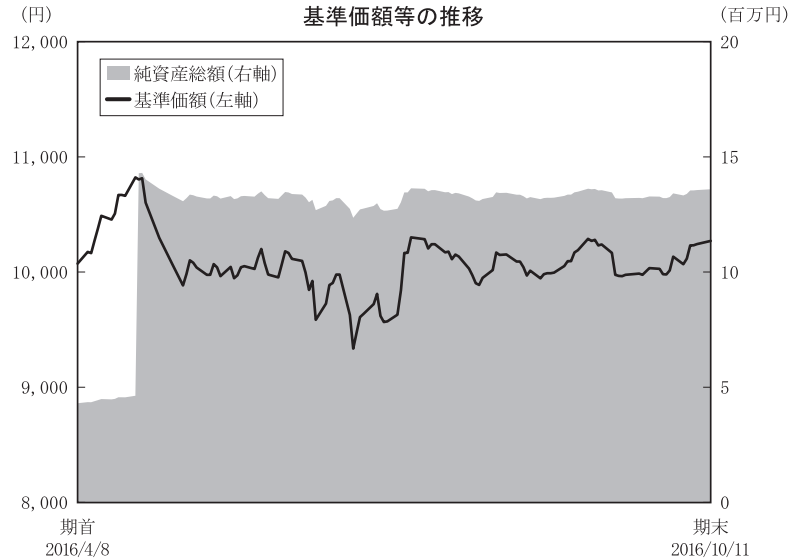
■当期中の基準価額等の推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率	投 資 組 資 益 入 証 比	信 託 証 券 率	投 資 組 入 証 比	券 率
4 月末	10,603	5.3		0.1	92.7	
5 月末	10,124	0.5		0.1	98.1	
6 月末	9,608	△4.6		0.1	97.9	
7 月末	10,135	0.6		0.1	98.3	
8 月末	10,094	0.2		0.1	97.6	
9 月末	10,134	0.6		0.1	97.8	
(期 末) 2016年10月11日	10,270	2.0		0.1	97.5	

(注) 騰落率は期首比です。

【基準価額等の推移】

第2期首	10,073円
第2期末	10,270円
既払分配金 (税込み)	0円
騰落率	2.0% (分配金再投資ベース)



【基準価額の主な変動要因】

上昇要因

- ①原油価格の回復を背景に、当期を通じて、エネルギーと素材セクターがそのけん引役となりハイイールド債市場が上昇傾向にあったこと
- ②3月上旬に行われたECB（欧州中央銀行）の追加金融緩和策により、投資家の利回り追求の動きが継続したこと
- ③組入れたハイイールド債からインカムゲインを得たこと
- ④ユーロ売り／豪ドル買いの為替取引により、プレミアム（金利差相当分の収益）を得たこと

下落要因

- ①主要中央銀行の金融政策や英国の国民投票を控えた5月上旬に、投資家の様子見姿勢から欧州ハイイールド債市場が調整したこと
- ②6月下旬に英国が国民投票でEU（欧州連合）離脱の選択をし、投資家のリスク回避的行動がみられたこと
- ③為替市場において、当期は豪ドル安・円高となったこと

【投資環境】

〈欧州ハイイールド債券市場〉

当期の欧州ハイイールド債市場は、3月にECB（欧州中央銀行）が決定した社債購入プログラムを含む大規模な追加金融緩和策を受けて堅調となっていた流れを引き継ぎ、上昇傾向で始まりしました。社債購入プログラムは投資適格社債が対象ではあったものの、低金利環境における投資家利回りの追及の動きが加速し、欧州ハイイールド債にとってもプラス要因となりました。ところが6月下旬に英国においてEU（欧州連合）離脱の是非を問う国民投票の結果が判明すると、金融市場は大きく混乱し、英ポンドが急落、ドイツ10年物国債利回りがマイナスになると共に、周縁国国債が乱高下しました。それでも主要中央銀行による金融政策対応を受け、ボラティリティ（価格変動性）はその後数日の間に低下しました。また、EU離脱に向けた不透明感の中、8月にBOE（英国中央銀行）が英国経済の下支えを目的として新たな景気刺激策を発表したことは市場にとりプラス要因となりました。加えて、原油価格の回復はエネルギーセクターを中心にハイイールド債市場の下支え要因となりました。このような状況下、当期間の欧州ハイイールド債市場は、プラスのリターンとなりました。セクター別では、エネルギーセクターが10%を超える良好なリターンとなるなど、多くのセクターがプラスのリターンを記録しました。一方、公益事業や不動産セクターのリターンはマイナスとなりました。

〈為替市場〉

当期初82円付近から始まった豪ドル／円相場は、日銀による追加緩和期待への高まりから円安基調になりましたが、追加緩和が見送られたことで円が急騰し、オーストラリア準備銀行（中央銀行）が政策金利を過去最低まで引き下げ、物価見通しを大きく下方修正したことで追加緩和期待が広がり、豪ドルは下落しました。6月に、英国のEU離脱という国民投票の結果、一気に円買いが進みました。その後、7月末の日銀の追加緩和期待の高まりや、オーストラリアの堅調な雇用増が豪ドル高・円安に作用しましたが、日銀の緩和策が期待以下だったことやオーストラリア準備銀行が利下げを決定したことで円高・豪ドル安となりました。8月下旬に、米国早期利上げ観測の高まりから円の独歩安商状の中で、豪ドルも上昇しました。9月には、日銀の新たな緩和策に対して懐疑的な見方や、米国利上げ見送りなどを受けた円高傾向の後、OPEC（石油輸出国機構）が減産で暫定合意すると豪ドルは反発し、オーストラリア準備銀行の追加利下げ期待の後退も支えとなり、78円台で当期末を迎えました。

〈日本の短期国債市場〉

当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政策のもと、TDB（国庫短期証券）3ヵ月物の利回りは-0.47%近辺で始まりました。TDBの需給が緩み、一時-0.20%近辺まで上昇しましたが、日銀の更なる追加金融緩和が期待される中で再び低下し、-0.31%近辺で当期末を迎えました。

【ポートフォリオ】

〈当ファンド〉

当ファンドは、欧州のハイイールド債を主要投資対象とする円建の外国籍投資信託「ストラクチャル-欧州ハイ・イールド・ボンド（I3シェアクラス、豪ドル）」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、高水準のインカムゲインの確保と中長期的な投資信託財産の成長を目指して運用を行いました。ファンドは「ストラクチャル-欧州ハイ・イールド・ボンド（I3シェアクラス、豪ドル）」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ました。

（アムンディ・ジャパン株式会社）

〈ストラクチャル-欧州ハイ・イールド・ボンド（I3シェアクラス、豪ドル）〉

当期は、ECBによる投資適格社債の購入プログラム導入により、投資家がハイイールド債の中では格付の高いBB+格債とBB格債への投資を拡大したため、割高となったこれらの債券のウェイトを若干削減しました。銘柄固有のリスクは依然として高いため、引き続き個別銘柄選択を重視した運用を継続しました。パフォーマンスについては、当ファンドは金融セクターに対して強気にみており、金融劣後債等への投資を行っていますが、当期は金融セクターが弱含んだ影響を受けてこのポジションがマイナス要因に働きました。また、現金等の比率を高めに維持していたこともパフォーマンスにとりややマイナス要因となりました。

（アムンディ アセットマネジメント）

アムンディ・欧州ハイ・イールド債券ファンド（豪ドルコース）〈年2回決算型〉

実質的なユーロ建資産に対し、ユーロ売り／豪ドル買いの為替取引を行い、当期を通じて豪ドルのエクスポージャーをおおむね100%に維持しました。

(アムンディ・ジャパン株式会社)

〈CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）〉

当期、主として6ヵ月以内に償還を迎える国債、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、見送りとさせていただきます（分配原資の内訳につきましては、後記の「分配金のお知らせ」をご覧ください）。なお、収益分配に充てず、信託財産内に留保した収益については、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

【今後の運用方針】

〈当ファンド〉

当ファンドが投資する「ストラクチャル-欧州ハイ・イールド・ボンド（I3シェアクラス、豪ドル）」の組入比率を引き続き高位に保ちます。

(アムンディ・ジャパン株式会社)

〈ストラクチャル-欧州ハイ・イールド・ボンド（I3シェアクラス、豪ドル）〉

英国のEU離脱によるマクロ経済的影響、欧州（特にイタリア）の銀行セクターの健全性、米国の大統領選挙等、今後も市場の波乱要因が数多く存在します。しかし、主要中央銀行はより一層の金融緩和の用意があることを示唆しており、ユーロ圏債券市場の45%以上はマイナスの利回りとなっています。このため、欧州ハイイールド債には依然として投資妙味が存在します。また欧州企業のファンダメンタルズ（基礎的条件）は堅調で、デフォルト（債務不履行）率は低位にとどまると予想され、引き続き投資家による利回り追求から恩恵を受けるとみられます。従って、当ファンドはこの資産クラスに対する楽観的な見方を維持します。ただし、銘柄固有のリスクは高い状態が続くとみられるため、パフォーマンスにおいては銘柄選択が重要な要素となるでしょう。当ファンドは引き続き、劣後債や低格付社債を対象に、選別的な形で利回りを追求する方針です。また、分散投資を徹底しつつ、流動性を重視し、市場の押し目を活用いたします。

(アムンディ アセットマネジメント)

今後もファンドの基本方針に従い、引き続き実質的なユーロ建資産に対し、ユーロ売り／豪ドル買いの為替取引を継続いたします。

(アムンディ・ジャパン株式会社)

〈CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）〉

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

(アムンディ・ジャパン株式会社)

アムンディ・欧州ハイ・イールド債券ファンド（豪ドルコース）＜年2回決算型＞

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	第2期 (2016年4月9日 ～2016年10月11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)	56円 (16) (39) (2)	0.556% (0.154) (0.385) (0.017)	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) (1)	0.011 (0.004) (0.006)	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	57	0.567	
期中の平均基準価額は10,116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。

■ 当期中の売買及び取引の状況（2016年4月9日から2016年10月11日まで）

投資信託受益証券、投資証券

決 算 期		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
外 国	(ルクセンブルク) ストラクチュラ-欧州ハイ・イールド・ボンド (I3シェアクラス、豪ドル)	口	千円	口	千円
		1,532	10,754	—	—

- (注1) 金額は受渡し代金です。
(注2) 単位未満は切捨てです。

アムンディ・欧州ハイ・イールド債券ファンド（豪ドルコース）＜年2回決算型＞

■利害関係人との取引状況等（2016年4月9日から2016年10月11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。

■自社による当ファンドの設定・解約状況（2016年4月9日から2016年10月11日まで）

期首残高 (元 本)	期中設定 元 本	期中解約 元 本	期末残高 (元 本)	取引の理由
百万円 1	百万円 0	百万円 -	百万円 1	当初設定時または当初運用時における取得等

（注）単位未満は切捨てです。

■組入資産の明細（2016年10月11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	口 数	口 数	評 価 額	評 価 額
CAマネーパールファンド（適格機関投資家専用）	口 9,924	口 9,924	口 9,924	口 9,924	千円 9	千円 9
合 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	9,924 1	9,924 1	9,924 1	9 <0.1%>	9 <0.1%>

（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	口 数	口 数	評 価 額	評 価 額
(ルクセンブルク) ストラクチャラ-欧州ハイ・イールド・ボンド (I3シェアクラス、豪ドル)	口 615	口 2,147	口 2,147	口 2,147	千円 13,256	千円 13,256
合 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	615 1	2,147 1	2,147 1	13,256 <97.5%>	13,256 <97.5%>

アムンディ・欧州ハイ・イールド債券ファンド（豪ドルコース）＜年2回決算型＞

■投資信託財産の構成（2016年10月11日現在）

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投 資 信 託 受 益 証 券	9	0.1
投 資 証 券	13,256	97.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	398	2.9
投 資 信 託 財 産 総 額	13,663	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10月11日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	13,663,401円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	396,663
投資信託受益証券(評価額)	9,992
投 資 証 券(評価額)	13,256,746
(B) 負 債	70,542
未 払 信 託 報 酬	69,115
そ の 他 未 払 費 用	1,427
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	13,592,859
元 本	13,236,064
次 期 繰 越 損 益 金	356,795
(D) 受 益 権 総 口 数	13,236,064口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,270円

(注記事項)

期首元本額	4,271,909円
期中追加設定元本額	8,964,155円
期中一部解約元本額	0円

■損益の状況

当期 自2016年4月9日 至2016年10月11日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	1,273,215円
受 取 配 当 金	1,273,466
支 払 利 息	△ 251
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△1,612,979
売 買 損 益	△1,612,979
(C) 信 託 報 酬 等	△ 70,542
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	△ 410,306
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 75,115
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	842,216
(配 当 等 相 当 額)	(487,870)
(売 買 損 益 相 当 額)	(354,346)
(G) 計 (D + E + F)	356,795
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)	356,795
追 加 信 託 差 損 益 金	842,216
(配 当 等 相 当 額)	(487,870)
(売 買 損 益 相 当 額)	(354,346)
分 配 準 備 積 立 金	1,334,987
繰 越 損 益 金	△1,820,408

(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。

■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却益）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 2 期 (2016年4月9日～2016年10月11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	1,377	

(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-欧州ハイ・イールド・ボンド

< 1. 補足情報 >

「ストラクチャラ-欧州ハイ・イールド・ボンド (I 3 シェアクラス、豪ドル)」は、「ストラクチャラ-欧州ハイ・イールド・ボンド」にて他のクラスと合わせた合同運用が行われています。

「ストラクチャラ-欧州ハイ・イールド・ボンド」の決算日(毎年12月31日)と当ファンドの決算日が異なっておりますので、以下2016年10月10日現在における「ストラクチャラ-欧州ハイ・イールド・ボンド」の補足情報を記載しております。

■有価証券明細 (評価額上位30銘柄)

(2016年10月10日現在)

銘柄		利率	口数/額面金額	評価額	償還年月日	
フランス	投資証券		%	ユーロ	円	
			—	7,479,042	16,285,161,293	—
			—	124,942	15,305,082,087	—
日本	債券		4.75	25,800,000	3,303,821,760	2025/7/30
ルクセンブルク			7.25	26,540,000	3,254,529,061	2022/5/15
イタリア			8.047	25,000,000	3,108,353,002	2049/6/29
ルクセンブルク			6.75	23,500,000	3,103,065,619	2019/10/14
				英ボンド		
イギリス			6	22,981,500	3,061,674,603	2021/4/15
				ユーロ		
イタリア			6.5	24,300,000	3,055,577,621	2074/1/10
ルクセンブルク			4	25,300,000	2,977,047,347	2020/7/15
イタリア			6.625	21,788,000	2,971,471,497	2023/9/13
ルクセンブルク			7	22,850,000	2,770,928,997	2021/4/23
イタリア			6.95	20,750,000	2,711,862,200	2022/10/31
ルクセンブルク			8.125	21,000,000	2,705,028,066	2049/12/10
オランダ			6.375	20,800,000	2,553,075,902	2022/9/15
フランス			3	21,500,000	2,517,951,403	2022/4/30
イギリス			4.75	19,700,000	2,463,223,312	2023/2/15
フランス			9.375	17,000,000	2,386,509,274	2049/9/4
オランダ			7.125	17,400,000	2,253,514,036	2024/5/15
ドイツ			5.5	17,938,260	2,183,862,901	2022/9/15
ルクセンブルク			4.75	17,250,000	2,183,096,381	2022/7/15
フランス			7	17,410,000	2,093,939,616	2020/2/1
			4.125	17,800,000	2,080,186,537	2049/6/30
イタリア			8.375	15,600,000	2,043,700,989	2049/10/14
ルクセンブルク			3.875	17,500,000	2,025,228,022	2022/5/1
フランス			6.875	16,470,000	2,017,083,533	2021/8/15
オランダ			3.25	17,000,000	1,996,871,097	2019/5/15
フランス			5.375	16,500,000	1,992,347,556	2022/5/15
オランダ			6.75	13,800,000	1,922,628,626	2020/9/15
ルクセンブルク			7.75	15,700,000	1,922,473,084	2020/2/1
スウェーデン			4.2	15,300,000	1,844,691,399	2075/6/10

ストラクチャラ-欧州ハイ・イールド・ボンド

■外国為替先物契約（I 3 シェアクラス、豪ドル）

(2016年10月10日現在)

買 建	契 約 額	売 建	契 約 額	満 期 日	評 価 損 益	
					日本円	
ユーロ	27,749,716.06	オーストラリアドル	42,000,000.00	2016/12/2	△	97,465,654
ユーロ	26,311,386.49	オーストラリアドル	39,000,000.00	2016/12/2	△	27,458,970
ユーロ	39,435,259.88	オーストラリアドル	58,000,000.00	2016/12/2	△	5,417,505
				小計①	△	130,342,129
					評 価 損 益	
売 建	契 約 額	買 建	契 約 額	満 期 日	日本円	
ユーロ	585,790,116.48	オーストラリアドル	864,000,000.00	2016/12/2		272,232,844
ユーロ	577,589,785.80	オーストラリアドル	860,000,000.00	2016/12/2		905,197,234
				小計②		1,177,430,078
				合計①+②		1,047,087,949

CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）

< 2. 補足情報 >

「CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）」の決算日（2016年2月15日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、以下2016年10月11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2016年10月11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（2016年10月11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 10 月 11 日 現 在							
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	う ち B B 格 以 下 組 入 比 率	残 存 期 間 別 組 入 比 率			2 年 未 満
					5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満	
	千円	千円	%	%	%	%	%	%
地 方 債 証 券	500,000	506,865	62.4	—	—	—	—	62.4
合 計	500,000	506,865	62.4	—	—	—	—	62.4

(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	506,865	2017/6/28
合 計				500,000	506,865	

(注) 額面・評価額の単位未満は切捨てです。

ストラクチュラ-欧州ハイ・イールド・ボンド

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

「ストラクチュラ-欧州ハイ・イールド・ボンド (I 3 シェアクラス、豪ドル)」は、「ストラクチュラ-欧州ハイ・イールド・ボンド」にて既存の他のクラスと合わせた合同運用が行われております。

「ストラクチュラ-欧州ハイ・イールド・ボンド」は毎年12月31日を決算日としており、当該運用報告書の作成時点において入手可能な2015年12月31日を基準日とするデータおよび年次報告書(監査済み)に基づき、委託会社が抜粋・翻訳・作成したものです。

開示情報につきましては、各クラス別のものがないので、「ストラクチュラ-欧州ハイ・イールド・ボンド」を掲載しております。

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	ルクセンブルク籍会社型投資信託	
投資方針	欧州のハイイールド債を主要投資対象とし、インカムゲインの確保に加え、中長期的なキャピタルゲインの獲得を目指して運用を行います。 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 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・エス・エー
	保管銀行・管理事務代行会社	CACEIS・バンク・ルクセンブルク・エス・エー
費用	運用報酬等	純資産総額に対し年率0.67%
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」へ社名変更しました。

ストラクチュラ-欧州ハイ・イールド・ボンド

■費用の明細

項目	当期
	円
(a) 運用報酬	4,097,964,839
(b) 管理費用等	894,069,001
(c) その他の費用	1,388,752,624
合計	6,380,786,464

■純資産計算書

2015年12月31日現在

項目	当期末
	円
資産合計	561,377,338,327
有価証券	507,269,370,984
預金	26,825,143,301
未収利息	8,901,639,179
有価証券売却未収入金	3,199,489,166
未収追加設定金	301,079,000
為替予約取引評価勘定	8,137,909,744
スワップ取引評価勘定	4,227,280,353
為替未収入金	2,515,426,600
負債合計	20,452,975,422
借入金	595,000,000
未払配当金	11,136,985,000
有価証券買付未払金	2,515,426,600
未払解約金	2,816,505,600
未払運用報酬	816,387,930
未払管理費用	56,893,619
未払税	13,801,533
為替未払金	2,501,974,418
その他の負債	722
純資産	540,924,362,905

■有価証券等明細

(1) 公社債

(2015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
アイルランド	ALLIED IRISH BK SUB FL R 15-25 26/11A	EUR	3,000,000.00	394,997,012	イタリア	NEW LOOK SENIOR IS 8.00 15-23 01/7S	GBP	4,300,000.00	745,458,216
	ARDAGH REGS 4.25 14-22 15/01S	EUR	16,300,000.00	2,153,903,727		OLD MUTUAL PLC 7.875 15-25 03/11S	GBP	635,000.00	113,262,210
	ARDEGH PKG REGS 9.25 10-20 15/10S	EUR	11,550,000.00	1,582,876,913		OLD MUTUAL REG-S FL R 05-XX 24/03A	GBP	5,100,000.00	873,785,840
	BANK IRELAND FL R 14-24 11/06A	EUR	920,000.00	124,688,594		PRIMO GROUP REGS 7.00 11-18 15/02S	GBP	1,959,049.13	356,522,830
	EIRCOM FIN REGS EMTN 9.25 13-20 15/05S	EUR	4,500,000.00	631,612,207		R&R ICE CREAM REGS 5.50 14-20 15/05S	GBP	13,000,000.00	2,385,802,160
	SMURFIT KAPPA ACQ 3.25 14-21 01/06S	EUR	10,000,000.00	1,372,560,092		RBS GRP PLC FL R 15-XX 30/09Q	USD	5,900,000.00	737,179,016
	SMURFIT KAPPA ACQ 4.125 13-20 30/01S	EUR	6,300,000.00	895,395,820		RBS SUB FL R 14-24 25/03A	EUR	33,000,000.00	4,439,838,237
	BALL 3.50 15-20 15/12S	EUR	6,650,000.00	893,773,536		ROYAL BK OF SCOT.SUB FL R 04-21 12/09A	EUR	17,900,000.00	2,373,469,958
	BALL CORP 4.375 15-23 15/12S	EUR	6,850,000.00	922,659,043		ROYAL BK OF SCOTL. FL R 07-XX 30/09A	EUR	9,950,000.00	1,372,068,423
	CELANESE CORP 3.25 14-19 15/10S	EUR	8,000,000.00	1,080,411,981		SANTANDER UK GROUP FL R 15-49 24/09Q	GBP	1,040,000.00	187,665,034
アメリカ	CEMEX FIN REGS 5.25 14-21 01/04S	EUR	13,880,000.00	1,775,554,451	TESCO 5.00 06-23 24/03A	GBP	4,000,000.00	694,229,608	
	FLASH DUTCH 2 REGS 6.75 15-23 01/02S	EUR	3,750,000.00	510,373,210	TESCO CORP 1.375 14-19 01/07A	EUR	5,100,000.00	641,884,552	
	PRESENTUS US FIN REGS 4.25 14-21 01/02S	USD	4,550,000.00	553,841,901	TESCO CORP 2.50 14-24 01/07A	EUR	5,400,000.00	629,287,081	
	HUNTSMAN INT 5.125 14-21 15/04A	EUR	6,700,000.00	812,073,640	TESCO EMTN 2.125 13-20 12/11A	EUR	9,880,000.00	1,247,690,016	
	HUNTSMAN INTL LLC 4.25 15-25 01/04S	EUR	4,850,000.00	514,946,886	TESCO EMTN 6.125 09-22 24/02A	GBP	11,695,000.00	2,173,301,083	
	IMS HEALTH REGS 4.125 15-23 01/04S	EUR	10,000,000.00	1,279,440,054	THOMAS COOK FIN 6.125 15-21 15/06S	EUR	1,000,000.00	136,865,286	
	JARDEN REGS 3.75 14-21 01/10S	EUR	14,500,000.00	1,997,279,770	THOMAS COOK GRP REGS 7.75 13-20 15/06S	EUR	22,500,000.00	3,075,058,620	
	MPT OPER PARTNERSHIP 4.00 15-22 19/08A	EUR	4,000,000.00	534,017,153	TWINKLE PIZZA REGS 6.875 14-21 01/08S	GBP	6,570,000.00	1,198,094,717	
	MPT OPER PARTNERSHIP 5.75 13-20 01/10S	EUR	4,000,000.00	558,202,751	VERGIN MEDIA SECURED 6.00 13-21 15/04S	GBP	28,291,500.00	5,201,527,726	
	PSPC ESCROW REGS 6.00 15-23 01/02S	EUR	5,350,000.00	600,801,901	VIRGIN MEDIA FIN 4.50 15-25 15/03S	EUR	4,720,000.00	589,043,334	
イギリス	VWR FUNDING INC 4.625 15-22 15/04S	EUR	16,000,000.00	2,050,428,496	VIRGIN MEDIA FIN 5.125 15-25 15/01S	GBP	2,900,000.00	491,773,571	
	ZF NA CAPITAL 2.75 15-23 27/04A	EUR	11,100,000.00	1,389,094,061	VIRGIN MEDIA REGS 5.50 14-25 15/01S	GBP	1,935,000.00	337,717,021	
	ZF NA CAPITAL 2.25 15-19 26/04A	EUR	12,200,000.00	1,596,628,126	VIRGIN MEDIA SECURED 6.25 14-29 28/03S	GBP	9,390,000.00	1,683,943,674	
	ANGLIAN WATER SVS FIN 5.00 15-23 30/04S	GBP	2,100,000.00	376,958,251	VOUGEOT BIDCO REGS 7.875 13-20 15/07S	GBP	5,200,000.00	972,437,029	
	ANGLIAN WATER SVS FIN 7.00 11-18 31/01S	GBP	3,808,000.00	736,455,357	WILLIAM HILL REGS 4.25 13-20 05/06S	GBP	12,000,000.00	2,172,939,877	
	ARROW GLOBAL FINANCE 7.875 13-20 01/03S	GBP	4,700,000.00	872,633,767	ASSICURAZIONI GEN. FL R 07-XX 08/02A	GBP	2,600,000.00	466,645,681	
	BAKKAHOR FIN. REG S 8.25 11-18 15/02S	GBP	6,591,626.92	1,202,178,808	BANCO POPOLARE 2.375 14-18 22/01A	EUR	2,000,000.00	263,033,400	
	BARCLAYS BK SUB FL R 14-XX 15/09Q	EUR	19,010,000.00	2,521,297,496	BANCO POPOLARE 3.50 14-19 14/03A	EUR	41,050,000.00	5,512,858,504	
	BOPARAN FIN REG S 5.50 14-21 15/07S	GBP	3,460,000.00	545,660,386	BANCO POPOLARE REGS 2.75 15-20 27/07A	EUR	7,540,000.00	985,714,259	
	BOPARAN FINANCE PLC 4.375 14-21 15/07S	EUR	10,770,000.00	1,249,504,876	BUZZI UNICEM 6.25 12-18 28/09A	EUR	11,080,000.00	1,613,606,656	
イタリア	BOPARAN FINANCE REGS 5.25 14-19 15/07S	GBP	350,000.00	58,223,224	CERVED TECHNO SPA 6.375 13-20 15/01S	EUR	2,000,000.00	269,886,072	
	EPHIOS BONDCO 8.25 15-23 01/07S	EUR	9,500,000.00	1,260,407,683	CERVED TECHNO SUB 8.00 13-16 15/01S	EUR	6,000,000.00	831,219,831	
	EPHIOS BONDCO 6.25 15-22 01/07S	EUR	9,200,000.00	1,254,544,100	ENEL FL. R 14-75 15/01A	EUR	4,450,000.00	609,742,522	
	HSBC HLDGS FL. R 14-XX 16/09S	EUR	16,100,000.00	2,079,107,011	ENEL SPA FL. R 13-74 10/01A	EUR	32,500,000.00	4,598,974,710	
	HSBC HLDGS FL. R 15-XX 29/09S	EUR	3,200,000.00	421,660,496	ENEL SUB FL. R 14-76 15/09A	GBP	11,000,000.00	2,028,487,483	
	INEOS FINANCE REGS 4.00 15-23 01/05S	EUR	13,020,000.00	1,630,747,931	FINMEC FINANCE 4.50 13-21 19/01A	EUR	21,000,000.00	2,994,806,292	
	INTER GAME TECH REGS 4.75 15-23 15/02S	EUR	17,500,000.00	2,150,062,102	FINMECCANICA FINANCE 5.25 09-22 21/01A	EUR	8,000,000.00	1,187,033,509	
	INTER GANE TECH REGS 4.125 15-20 15/02S	EUR	10,200,000.00	1,340,044,133	INTESA SAN PAOLO 5.15 10-20 16/07A	EUR	1,650,000.00	239,702,622	
	INTL PERS FIN 5.75 14-21 07/04A	EUR	5,807,000.00	700,415,197	INTESA SAN PAOLO 6.625 13-23 13/09A	EUR	26,088,000.00	4,117,938,735	
	INRN MOUNTAIN REGS 6.125 14-22 15/09S	GBP	10,000,000.00	1,826,385,331	INTESA SAN PAOLO 8.375 09-XX 14/10A	EUR	15,600,000.00	2,356,240,660	
イギリス	JAGUAR LAND ROV REGS 5.625 13-23 01/02S	USD	2,350,000.00	285,195,065	INTESA SANPAOLO SP FL R 15-49 17/03S	USD	5,400,000.00	659,914,986	
	JAGUAR LAND ROVER 3.875 15-23 01/03S	GBP	9,000,000.00	1,500,934,397	INTESA SANPAOLO SPA FL R 08-XX 20/06A	EUR	27,300,000.00	3,964,740,220	
	JAGUAR LAND ROVER 5.00 14-22 15/02S	GBP	6,600,000.00	1,208,363,115	INTESA SANPAOLO SUB FL R 10-XX 01/06A	EUR	4,000,000.00	539,531,700	
	KERLING PLC REG-S 10.625 10-17 28/01A	EUR	4,800,000.00	632,101,852	RHINO BONDCO REGS 7.25 13-20 15/11S	EUR	7,030,000.00	980,958,655	
	LLOYDS BANKING GR FL R 14-XX 27/06Q	GBP	11,218,000.00	2,026,165,454	SALINI 6.125 13-18 01/08A	EUR	2,000,000.00	278,356,519	
	LLOYDS BANKING GR FL R 14-XX 27/06Q	GBP	9,069,000.00	1,251,482,441	SNAI REGS 7.625 13-18 15/06S	EUR	14,000,000.00	1,755,376,753	
	LYNX II CORP REGS 7.00 13-23 15/04S	GBP	13,000,000.00	2,425,376,531	TELECOM ITALIA EMTN 3.75 15-23 16/01A	EUR	7,900,000.00	1,050,595,796	
	MERLIN ENTERTAINMENTS 2.75 15-22 15/03S	EUR	5,900,000.00	753,790,245	TELECOM ITALIA SPA 4.875 13-20 25/09A	EUR	1,500,000.00	221,661,235	
	MOY PARK BONDCO 6.25 14-21 29/05S	GBP	6,090,000.00	1,105,628,289	TELECOM ITALIA SPA 5.875 07-23 19/05A	GBP	9,600,000.00	1,834,381,407	
	NEW LOOK REGS REGS 6.50 15-22 01/07S	GBP	13,300,000.00	2,350,121,577	UNICREDIT FL. R 14-XX 10/09S	EUR	13,700,000.00	1,693,664,538	

ストラクチャラ-欧州ハイ・イールド・ボンド

	銘柄	通貨	額面金額	円換算評価額
イタリア	UNICREDIT SPA 6.125 11-21 19/04A	EUR	7,000,000.00	1,054,296,292
	UNICREDIT SPA EMTN FL.R 13-25 28/10A	EUR	19,000,000.00	2,695,235,757
オーストリア	UNICREDIT SPA REGS 6.95 12-22 31/10A	EUR	20,000,000.00	3,065,512,705
	UNIPOLSAI SPA EMTN FL.R 14-XX 18/06A	EUR	11,000,000.00	1,395,798,286
オランダ	SAPPI PAPIER HOLDNG G 3.375 15-22 01/04S	EUR	10,500,000.00	1,319,894,216
	WIENERBERGER 4.00 13-20 17/04A	EUR	6,085,000.00	852,521,536
オランダ	WIENERBERGER REGS FL.R 14-XX 09/02A	EUR	500,000.00	66,716,862
	ABN AMRO FL.R 15-XX 22/03S	EUR	10,200,000.00	1,336,022,092
オランダ	ABN AMRO BANK NV FL.R 06-XX 10/03A	EUR	10,740,000.00	1,411,408,686
	CABLE COMM SYS REGS 7.50 13-20 01/11S	EUR	11,500,000.00	1,592,359,842
オランダ	DARLING GLOBAL FINAN 4.75 15-22 30/05S	EUR	4,000,000.00	507,939,361
	DT ANNINGTON FI SUB FL.R 14-XX 17/12A	EUR	200,000.00	25,482,692
オランダ	DT ANNINGTON FIN SUB FL.R 14-74 08/04A	EUR	4,000,000.00	531,168,407
	EDP FINANCE 5.25 14-21 14/01S	USD	8,000,000.00	999,545,521
オランダ	EDP FINANCE REGS 8.625 08-24 04/01A	GBP	2,000,000.00	458,425,147
	FRESENIUS REGS 3.00 14-21 01/02S	EUR	5,500,000.00	773,659,468
オランダ	FRESENIUS REGS 4.00 14-24 01/02S	EUR	5,500,000.00	816,308,341
	GAS NAT PENOSA REGS FL.R 14-XX 30/11A	EUR	15,700,000.00	1,963,790,401
オランダ	GENERALI FIN SUB FL.R 14-XX 21/11A	EUR	4,000,000.00	507,244,163
	GOODYEAR DUNLOP TI 3.75 15-23 15/12S	EUR	3,460,000.00	460,080,104
オランダ	GRUPO ANTOLIN DUTCH 4.75 14-21 01/04S	EUR	14,000,000.00	1,895,569,062
	GRUPO ANTOLIN DUTCH 5.125 15-22 30/06S	EUR	4,550,000.00	619,657,141
オランダ	ING GROEP SUB 6.00 15-XX 30/04S	USD	8,650,000.00	1,042,559,942
	KPN FL.R 13-XX 14/09A	EUR	20,000,000.00	2,783,042,491
オランダ	LGE HOLDCO VI BV 7.125 14-24 15/05S	EUR	20,900,000.00	2,969,784,626
	01 EUROPEAN GROUP BV 4.875 13-21 31/03S	EUR	550,000.00	78,449,778
オランダ	01 EUROPEAN GROUP BV 6.75 10-20 15/09S	EUR	17,000,000.00	2,586,336,537
	PETROBRAS GLOBAL FIN 2.75 14-18 15/01A	EUR	4,200,000.00	449,874,064
オランダ	PETROBRAS INTL FIN 3.25 12-19 01/04A	EUR	14,667,000.00	1,417,636,483
	PETROBRAS INTL FIN 4.875 11-18 07/03A	EUR	6,800,000.00	744,984,351
オランダ	PHOENIX PIB DUTCH 3.625 14-21 30/07A	EUR	5,200,000.00	719,289,702
	PHOENIX PIB DUTCH EMTN3.125 13-20 27/05A	EUR	4,300,000.00	588,992,736
オランダ	RABOBANK NEDERLAND FL.R 15-XX 31/12S	EUR	18,000,000.00	2,387,364,654
	REPSOL INTL FINANCE FL.R 15-49 29/12A	EUR	8,000,000.00	904,207,855
オランダ	REPSOL INTL FINANCE FL.R 15-75 25/03A	EUR	14,300,000.00	1,472,308,955
	SCAHEFFLER FIN REGS 3.25 15-25 15/05S	EUR	5,000,000.00	637,152,235
オランダ	SCHAEFFLER FIN 3.25 14-19 15/05S	EUR	25,500,000.00	3,382,699,733
	SCHAEFFLER FIN 6.875 13-18 15/08S	EUR	11,000,000.00	1,490,036,915
オランダ	SCHAEFFLER FIN REGS 4.25 13-18 15/05S	EUR	7,000,000.00	934,648,935
	SCHAEFFLER FINANCE 2.50 15-20 15/04S	EUR	2,000,000.00	263,914,159
オランダ	SCHAEFFLER FINANCE 3.50 14-22 15/05S	EUR	7,400,000.00	989,759,375
	SM MTH AUTO GRP REGS 4.125 14-21 15/07S	EUR	12,800,000.00	1,633,016,552
オランダ	SNS BANK 3.75 15-25 05/11A	EUR	5,200,000.00	676,955,759
	TELE EUR REGS SUB FL.R 14-XX 31/03A	EUR	8,000,000.00	1,055,269,832
オランダ	TELEFONICA EUROPA SUB 7.625 13-XX 18/09A	EUR	23,700,000.00	3,422,467,973
	TELEFONICA EUROPA SUB FL.R 13-XX 26/11A	GBP	11,000,000.00	2,004,089,699
オランダ	TELEFONICA EUROPE BV FL.R 13-XX 18/09A	EUR	15,500,000.00	2,136,400,533
	UPC HOLDING REGS 6.375 12-22 15/09S	EUR	24,000,000.00	3,337,455,625
オランダ	UPC HOLDING REGS 6.75 13-23 15/03S	EUR	7,000,000.00	989,651,959
	ZIGGO BOND CO 4.625 15-25 15/01S	EUR	2,450,000.00	298,143,287
オランダ	ZIGGO FIN REGS 3.75 15-25 15/01S	EUR	16,700,000.00	2,024,123,849
	CS GUERNESEY FL.R 11-41 24/02S	USD	7,000,000.00	869,086,805

ガンジー、
チャネル諸島

	銘柄	通貨	額面金額	円換算評価額
カナダ	BOMBARDIER REGS EMTN 6.125 10-21 15/05S	EUR	9,000,000.00	1,029,371,066
	ENTERTAINM ONE 6.875 15-22 15/12S	GBP	3,600,000.00	637,737,950
クロアチア	VRX ESCROW 4.50 15-23 15/05S	EUR	8,600,000.00	984,745,058
	AGROKOR DD REGS 9.125 12-20 01/02S	EUR	16,860,000.00	2,360,888,325
ジャージー、 チャネル諸島	AGROKOR DD REGS 9.875 12-19 01/05S	EUR	3,640,000.00	510,637,726
	ASTON MARTIN CAP REGS 9.25 11-18 15/07S	GBP	4,047,000.00	731,166,504
スイス	AVIS BUDGET CAR 6.00 13-21 01/03S	EUR	10,500,000.00	1,424,366,118
	HBO5 PERP. SUB FL.R 01-XX 29/11S	GBP	5,000,000.00	945,052,862
スイス	MERCURY BONDCO 8.25 15-21 30/05S	EUR	15,000,000.00	1,956,755,696
	CREDIT SUISSE FL.R 13-25 18/09A	EUR	7,170,000.00	1,022,606,129
スウェーデン	UBS GROUP SUB FL.R 15-XX 19/02A	EUR	9,400,000.00	1,290,673,263
	EILEME 2 AB REGS 11.75 12-20 31/01S	EUR	12,078,000.00	1,684,946,099
スウェーデン	NORDEA BANK FL.R 15-XX 12/03A	USD	10,800,000.00	1,233,044,355
	SHB SUB FL.R 15-XX 01/03A	USD	18,400,000.00	2,146,228,177
スウェーデン	SWEDBANK SUB FL.R 15-XX 17/03S	USD	5,200,000.00	625,946,809
	TYN FIN. CORP III REGS 7.75 13-20 15/12S	EUR	14,360,000.00	2,028,229,965
スウェーデン	VERISURE HLDG REGS 6.00 15-22 01/11S	EUR	13,550,000.00	1,845,759,839
	VOLVO TREAS REGS SUB FL.R 14-75 10/06A	EUR	21,100,000.00	2,709,461,979
スペイン	VOLVO TREASURY SUB FL.R 14-78 10/03A	EUR	1,000,000.00	126,115,842
	ALMIRALL EMTN REGS 4.625 14-21 01/04S	EUR	2,623,000.00	359,148,463
スペイン	BANCO SANTANDER SA FL.R 14-XX 12/03A	EUR	17,000,000.00	2,111,468,773
	BCO BILBAO VIZCAYA FL.R 15-XX 18/05Q	EUR	16,400,000.00	2,101,646,347
スペイン	CAIXABANK EMTN FL.R 13-23 14/11A	EUR	2,100,000.00	287,310,078
	CAMPOFRIO REGS 3.375 15-22 15/03S	EUR	8,000,000.00	1,053,199,917
スペイン	CELLNEX TELECOM 3.125 15-22 27/07A	EUR	5,600,000.00	703,994,807
	ENCE ENERGIA REGS 5.375 15-22 01/11S	EUR	2,600,000.00	351,555,194
スペイン	NH HOTELES REGS 6.875 13-19 15/11S	EUR	3,500,000.00	504,668,530
	CE ENERGY REGS 7.00 14-21 01/02S	EUR	5,420,000.00	719,981,084
デンマーク	DANSKE BANK EMTN FL.R 15-XX 06/04S	EUR	14,500,000.00	1,923,458,030
	TDC FL.R 15-15 26/02A	EUR	3,680,000.00	452,968,901
ドイツ	COMMERZBANK AG 7.75 11-21 16/03A	EUR	27,500,000.00	4,389,513,429
	COMMERZBANK AG 8.125 13-23 19/09S	USD	7,800,000.00	1,078,558,158
ドイツ	DEUTSCHE RASTSTATTEN 6.75 13-20 30/12S	EUR	5,900,000.00	822,925,012
	RWE AG FL.R 12-XX 20/03A	GBP	2,400,000.00	419,622,725
ドイツ	RWE SUB REGS FL.R 15-XX 21/04A	EUR	8,300,000.00	933,039,654
	TECHEM EMTN REGS 6.125 12-19 01/10S	EUR	7,076,000.00	971,621,128
ドイツ	TECHEM ENER REGS 7.875 12-20 01/10S	EUR	11,000,000.00	1,547,563,302
	THYSSENKRUPP 3.125 14-19 25/10A	EUR	16,500,000.00	2,227,077,575
ドイツ	THYSSENKRUPP AG 1.75 15-20 25/11A	EUR	12,500,000.00	1,587,049,151
	THYSSENKRUPP AG 4.00 13-18 27/08A	EUR	18,000,000.00	2,474,677,432
ドイツ	TRIONISTA HOLDCO REGS 5.00 13-20 30/04S	EUR	9,200,000.00	1,242,822,422
	TRIONISTA HOLDCO REGS 6.875 13-21 30/04S	EUR	15,000,000.00	2,074,109,682
ドイツ	UNITY MEDIA REGS 5.125 13-23 21/01S	EUR	117,900.00	16,182,637
	UNITYMEDIA HESSEN REGS 5.50 12-22 15/09S	EUR	19,211,400.00	2,666,353,102
ドイツ	UNITYMEDIA KABEL SUB 3.75 15-27 15/01S	EUR	18,600,000.00	2,109,963,902
	UNITYMEDIA NRW REGS 5.75 12-23 15/01S	EUR	12,906,000.00	1,795,796,129
ドイツ	UNITYMEDIA NRW/HESSEN 6.25 13-29 15/01S	EUR	14,840,000.00	2,134,267,735
	WEPA HYGIENPROD REGS 6.50 13-20 15/05S	EUR	4,300,000.00	598,163,087
日本	SOFTBANK GROUP 4.00 15-27 30/01S	EUR	2,100,000.00	279,143,323
	SOFTBANK GROUP 5.25 15-27 30/07S	EUR	4,100,000.00	512,468,294
日本	SOFTBANK GROUP CORP 4.75 15-25 30/07S	EUR	29,100,000.00	3,707,047,175
	SOFTBANK REGS 4.625 13-20 15/04S	EUR	9,673,000.00	1,338,194,135
ノルウェー	LINDOR REGS 7.00 14-21 15/08S	EUR	17,000,000.00	2,325,821,274

ストラクチャラ-欧州ハイ・イールド・ボンド

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
ノルウェー フィンランド フランス	SILK BIDCO REGS 7.50 15-22 01/02S	EUR	5,000,000.00	677,080,424	ベルギー	SMCP SAS 8.875 13-20 15/06S	EUR	10,000,000.00	1,402,354,323
	STORA ENSO OYJ 5.50 12-19 07/03A	EUR	9,000,000.00	1,318,241,813		SOCIETE GEN. REG-S SUB FL R 05-XX 16/06A	GBP	3,000,000.00	587,536,068
	ACCOR FL. R 14-XX 30/06A	EUR	20,500,000.00	2,642,970,404		SOCIETE GENE SA SUB FL R 09-XX 04/09A	EUR	21,000,000.00	3,367,304,739
AREVA 3.25 13-20 04/09A	EUR	4,800,000.00	609,075,615	SOCIETE GENERALE REGS FL R 14-XX 07/04S	EUR	18,300,000.00	2,449,465,631		
AREVA EMTN 3.50 10-21 22/03A	EUR	7,950,000.00	1,018,183,333	SOGECAP SA FL. R 14-49 29/12A	EUR	13,500,000.00	1,673,967,285		
AREVA EMTN 4.375 09-19 06/11A	EUR	4,250,000.00	579,505,952	SOLVAY FIN SUB FL R 13-XX 12/05A	EUR	2,000,000.00	258,836,072		
AREVA SA 3.125 14-23 20/03A	EUR	4,000,000.00	478,594,658	SOLVAY FINANCE FL R 13-XX 12/11A	EUR	1,884,000.00	242,275,016		
ARKEMA SA FL. R 14-XX 29/10A	EUR	5,000,000.00	647,371,133	SOLVAY FINANCE SUB FL R 15-XX 02/06A	EUR	4,800,000.00	626,105,370		
BFCM 3.00 15-25 11/09A	EUR	4,000,000.00	538,632,645	SOLVAY FINANCE SUB FL R 15-XX 03/06A	EUR	3,000,000.00	390,445,552		
BFCM(BQ FED. CM) OIS 0.12 190416	EUR	10,000,000.00	1,306,794,500	SPCM REGS 2.875 15-23 15/06S	EUR	19,000,000.00	2,388,231,039		
BFCM(BQ FED. CM) OIS 0.12 250416	EUR	15,000,000.00	1,960,146,750	THOM EUOPE REGS 7.375 14-19 15/07S	EUR	10,700,000.00	1,458,725,791		
BFCM(BQ FED. CM) OIS 0.16 160516	EUR	15,000,000.00	1,960,146,750	VEOLIA ENVIRONNEMENT FL R 13-XX 16/04A	EUR	22,400,000.00	3,040,872,354		
BNP PAR FL. R 15-XX 19/08S	USD	2,300,000.00	284,680,023	BELGIER	KBC GROEP SUB FL R 14-XX 19/03Q	EUR	15,400,000.00	2,014,671,237	
BNP PARIBAS 4.032 14-XX 25/11A	EUR	2,000,000.00	249,978,822	PORTUGAL	ONTEX GROUP REGS 4.75 14-21 15/11S	EUR	4,500,000.00	627,037,225	
BNP PARIBAS OIS 0.08 250416	EUR	15,000,000.00	1,960,146,750	BANCO ESPIRITO SANTO 2.625 14-17 08/05A	EUR	6,000,000.00	112,222,321		
BNP PARIBAS SUB FL. R 15-XX 17/06S	EUR	13,700,000.00	1,838,067,504	BANCO ESPIRITO SANTO 4.75 13-18 15/01A	EUR	2,900,000.00	55,949,906		
BPCE FL. R 06-XX 01/02A	EUR	7,350,000.00	964,150,515	BCO ESPIRITO SANTO 4.00 14-19 21/01A	EUR	12,000,000.00	219,787,334		
BUT SA REGS 7.375 14-19 15/09S	EUR	3,000,000.00	411,434,803	PORTUCEL SA REGS 5.375 13-20 15/06S	EUR	1,714,285.72	235,495,392		
CA ASSURANCES SUB FL R 14-XX 14/10A	EUR	11,500,000.00	1,444,005,482	CEMEX REGS 4.75 14-22 11/01S	EUR	1,000,000.00	122,348,440		
CASA TIER 1 EUR FL. R 14-45 08/04Q	EUR	14,900,000.00	2,004,089,581	CEMEX SAB DE CV 4.375 15-23 05/03S	EUR	7,060,000.00	839,071,736		
CASINO GUICHARD FL. R 13-XX 31/01A	EUR	15,000,000.00	1,762,387,544	CEMEX SAB DE CV 6.125 15-25 05/05S	USD	3,400,000.00	352,127,018		
CEGEDIM 6.75 13-20 01/04S	EUR	16,000,000.00	2,224,949,508	ALBEA BEAUTY HOLDINGS 8.75 12-19 01/11S	EUR	6,000,000.00	836,755,285		
CERBA ASSURANCES LAB 7.00 13-20 01/02S	EUR	19,110,000.00	2,595,392,951	ALTICE FINANCE REGS 5.25 15-23 15/02S	EUR	9,700,000.00	1,269,044,612		
CNP ASSURANCES SUB FL R 14-45 05/06A	EUR	5,800,000.00	748,426,629	ALTICE FINANCING REGS 6.50 13-22 15/01S	EUR	6,100,000.00	839,071,133		
CREDIT AGRICOLE FL. R 09-XX 26/10A	EUR	13,000,000.00	1,999,208,554	ALTICE FINANCING REGS 8.00 12-19 15/12S	EUR	4,400,000.00	601,206,803		
CREDIT AGRICOLE SUB FL. R 14-XX 23/12Q	USD	8,890,000.00	1,053,616,411	ALTICE REGS 7.25 14-22 15/05S	EUR	31,540,000.00	3,861,837,298		
CROWN EURO HLDG REGS 4.00 14-22 15/07S	EUR	18,000,000.00	2,440,241,573	ARCELORMITTAL REGS 3.00 14-19 25/03A	EUR	15,500,000.00	1,766,790,034		
CROWN EURO HOLDINGS 3.375 15-25 15/05S	EUR	8,700,000.00	1,066,057,172	ARDAGH FINANCIAL REGS 8.375 14-19 15/06S	EUR	6,134,151.00	816,386,411		
DARTY FINANCE REGS 5.875 14-21 01/03S	EUR	8,500,000.00	1,177,483,674	CIRSA FUNDING 5.875 15-23 15/05S	EUR	5,800,000.00	719,746,808		
ELECT. DE FRANCE FL. R 13-XX 29/01S	GBP	2,700,000.00	460,897,903	CIRSA FUNGING 8.75 10-18 15/05S	EUR	5,841,902.77	776,644,089		
EUROPCAR 5.75 15-22 15/06S	EUR	9,300,000.00	1,265,385,280	CNH IND FIN 2.875 14-21 27/09A	EUR	12,000,000.00	1,552,075,559		
FAURECIA 3.125 15-22 15/06S	EUR	16,000,000.00	2,063,956,121	CNH INDUSTRIAL FIN 2.75 14-19 18/03A	EUR	10,200,000.00	1,327,408,360		
GROUPAMA SA FL. R 14-XX 28/05A	EUR	16,000,000.00	2,024,251,389	CONVATEC HEALTHCARE 10.875 10-18 15/12S	EUR	4,400,000.00	591,150,465		
GROUPAMA SA PERP FL. R 07-49 22/10A	EUR	7,000,000.00	926,763,917	DUFREY FIN SCA 4.50 14-22 15/07S	EUR	18,000,000.00	2,465,480,423		
GROUPAMA SUB FL. R 09-39 27/10A	EUR	14,000,000.00	1,964,229,082	DUFREY FINANCE SCA REGS4.50 15-23 01/08S	EUR	5,300,000.00	712,756,873		
HOMEVI REGS 6.875 14-21 15/08S	EUR	18,070,000.00	2,493,864,536	ELIOR FINANCE REGS 6.50 13-20 01/05S	EUR	10,247,250.00	1,429,461,763		
ITALCEMENTI FINANCE 6.625 10-20 19/03A	EUR	12,350,000.00	1,883,383,941	EMPARK FUNDING REGS 6.75 13-19 15/12S	EUR	3,300,000.00	464,704,535		
LA FINANCIERE ITALIAN 7.25 13-20 15/01S	EUR	8,315,000.00	1,175,065,324	FIAT FIN TRADE 6.75 13-19 14/10A	EUR	41,000,000.00	6,054,400,661		
LABEYRIE FINE FOODS 5.625 14-21 15/03S	EUR	11,500,000.00	1,584,365,057	FIAT FIN TRADE 6.875 13-18 15/03A	EUR	15,000,000.00	2,135,403,471		
LOXAM SAS 7.375 13-20 24/01S	EUR	8,350,000.00	1,155,067,828	FIAT FINANCE REGS 4.75 14-21 22/03A	EUR	4,700,000.00	658,332,666		
MEDI-PARTENAIRE 7.00 13-20 15/05S	EUR	9,800,000.00	1,365,701,408	FIAT FINANCE TRADE 4.75 14-22 15/07A	EUR	22,950,000.00	3,211,565,396		
NATIXIS OIS 0.17 160516	EUR	15,000,000.00	1,960,146,750	FIAT FINANCE TRADE 7.375 11-18 09/07A	EUR	14,500,000.00	2,106,136,520		
NATIXIS PERPETUAL FL. R 07-49 18/10A	EUR	6,000,000.00	843,451,147	FIAT INDUSTRIAL EMTN 6.25 11-18 09/03A	EUR	14,500,000.00	2,034,323,276		
NOVAFIVES SAS REGS 4.50 14-21 30/06S	EUR	4,700,000.00	519,405,305	FMC FIN VII REG S 5.25 11-21 15/02S	EUR	13,250,000.00	2,014,020,403		
NOVALIS SAS REGS 3.00 15-22 30/04S	EUR	25,300,000.00	3,252,026,157	GARFUNKELUX REGS 8.50 15-22 01/11S	GBP	7,800,000.00	1,400,393,403		
NUMERICABLE GRP REGS 5.375 14-22 15/05S	EUR	19,000,000.00	2,543,310,009	GARFUNKELUX REGS 11.00 15-23 01/11S	GBP	2,000,000.00	358,323,494		
NUMERICABLE REGS 5.625 14-24 15/05S	EUR	14,500,000.00	1,925,239,150	GAZPROM 3.389 13-20 20/03A	EUR	1,900,000.00	238,554,956		
PAPREC HOLDING REGS 5.25 15-22 01/04S	EUR	16,850,000.00	2,196,459,494	GAZPROM OAO REG-S 3.755 12-17 15/03A	EUR	5,000,000.00	654,891,563		
PEUGEOT 6.50 13-19 18/01A	EUR	9,000,000.00	1,353,230,432	GAZPROM REGS 3.70 13-18 25/07A	EUR	3,900,000.00	509,622,866		
PEUGEOT 7.375 13-18 06/03A	EUR	2,000,000.00	294,544,718	GCS HOLDCO FINANCE I 6.50 13-18 15/11S	EUR	8,500,000.00	1,152,125,256		
REXEL 3.25 15-22 15/06S	EUR	13,370,000.00	1,729,672,895	GESTAMP FUND LUX REGS 5.875 13-20 31/05S	EUR	16,000,000.00	2,165,026,516		
REXEL SA 5.125 13-20 15/06S	EUR	12,000,000.00	1,644,547,442	HEIDELBERGCEMENT 7.50 10-20 03/04S	EUR	32,500,000.00	5,210,540,497		
SGD GROUP SAS REGS 5.625 14-19 15/04S	EUR	1,600,000.00	214,411,829	HEIDELBERGCEMENT FIN 8.50 09-19 31/10S	EUR	3,500,000.00	569,939,456		

ストラクチュラ-欧州ハイ・イールド・ボンド

銘柄		通貨	額面金額	円換算評価額
ルクセンブルク	INEOS FIN REGS 6.50 13-18 15/08S	EUR	15,000,000.00	1,986,608,731
	INEOS GRP REGS 5.75 14-19 15/02S	EUR	6,150,000.00	808,883,959
	KION FIN REGS 6.75 13-20 15/02S	EUR	5,000,000.00	682,085,332
	MAGNOLIA BC REGS 9.00 13-20 01/08S	EUR	9,816,000.00	1,369,919,341
	MATTEH TEL HOL REGS 4.875 15-23 01/05S	EUR	7,500,000.00	824,045,693
	MATTERHORN REGS 3.875 15-22 01/05S	EUR	21,000,000.00	2,509,493,558
	ONEX WIZARD AC II 7.75 15-23 15/02S	EUR	13,300,000.00	1,825,852,522
	PICARD BONDCO REGS 7.75 15-20 01/02S	EUR	20,500,000.00	2,872,924,366
	PLAY FINANCE 2 SA 5.25 14-19 01/02S	EUR	17,500,000.00	2,342,202,220
	PLAY FINANCE 2 SA 6.50 14-19 01/08S	EUR	8,700,000.00	1,188,238,215
	PLAY TOPCO REGS 7.75 14-20 28/02S	EUR	8,100,000.00	1,084,750,700
	TELENET FIN V REGS 6.75 12-24 15/08S	EUR	6,700,000.00	962,997,883
	TELENET FINANCE 6.625 11-21 15/02S	EUR	13,000,000.00	1,762,498,619
	TELENET FINANCE REGS 6.25 12-22 15/08S	EUR	8,500,000.00	1,204,408,250
	UNICREDIT F REGS SUB 6.00 07-17 31/10S	USD	1,000,000.00	126,442,066
	UNICREDIT FINANCE FL. R 09-XX 10/12A	EUR	23,000,000.00	3,404,425,999
	WIND ACQUI. FIN 4.00 14-20 15/07S	EUR	32,000,000.00	4,184,657,185
	WIND ACQUI. FIN REGS 7.00 14-21 23/04S	EUR	31,000,000.00	4,033,429,250
	ZINC CAPITAL REGS 8.875 11-18 11/05S	EUR	8,338,000.00	1,071,874,561

(注) 通貨欄の表記は以下の通りです。
EUR(ユーロ)、USD(米ドル)、GBP(英ポンド)

(2) 投資証券

(2015年12月31日現在)

銘柄		口数	現地通貨	円換算評価額
フランス	AMUNDI 3 M I (C)	178	EUR	24,662,725,303
	AMUNDI TRESO CT C 3D -C- CAP 3 DEC	10,119.439	EUR	24,945,748,010

(注) 通貨欄の表記は以下の通りです。
EUR(ユーロ)

■外国為替先物契約（I 3 シェアクラス、豪ドル）

(2015年12月31日現在)

買 建	契 約 額	売 建	契 約 額	満 期 日	評 価 損 益
					日本円
ユーロ	92,962,784.12	オーストラリアドル	139,000,000	2016/2/2	8,130,621
ユーロ	29,413,437.23	オーストラリアドル	45,000,000	2016/2/2	△ 86,734,486
				小計①	△ 78,603,865
					評 価 損 益
売 建	契 約 額	買 建	契 約 額	満 期 日	日本円
ユーロ	800,996,679.05	オーストラリアドル	1,219,000,000.00	2016/2/2	1,797,000,550
ユーロ	803,456,378.38	オーストラリアドル	1,219,000,000.00	2016/2/2	1,474,893,058
ユーロ	61,015,280.56	オーストラリアドル	89,000,000.00	2016/2/2	△ 200,634,742
				小計②	3,071,258,866
				合計①+②	2,992,655,001

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	
(期 首) 2015年 2月16日	円 10,077	% —	% —	% 79.2
2月末	10,077	0.0	0.0	79.2
3月末	10,077	0.0	0.0	18.4
4月末	10,077	0.0	0.0	78.9
5月末	10,077	0.0	0.0	78.9
6月末	10,077	0.0	0.0	18.2
7月末	10,077	0.0	0.0	—
8月末	10,077	0.0	0.0	78.7
9月末	10,077	0.0	0.0	—
10月末	10,077	0.0	0.0	59.0
11月末	10,078	0.0	0.0	82.7
12月末	10,077	0.0	0.0	66.4
2016年 1月末	10,077	0.0	0.0	88.6
(期 末) 2016年 2月15日	10,077	0.0	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)	0.024% (0.019) (0.001) (0.004)	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
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			末		
	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
国債証券	第582回国庫短期証券 第583回国庫短期証券※	%	千円 500,000	千円 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。