

■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	2011年1月31日から2026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／資源国通貨（ブラジルレアル、豪ドル、南アフリカランド）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-ブラジルレアル（I4シェアクラス、円）」「ストラクチャラ-欧州ハイ・イールド・ボンド（IH3シェアクラス、豪ドル）」「ストラクチャラ-欧州ハイ・イールド・ボンド（IH7シェアクラス、南アフリカランド）」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（資源国通貨コース）	ストラクチャラ-欧州ハイ・イールド・ボンド-ブラジルレアル（I4シェアクラス、円）、ストラクチャラ-欧州ハイ・イールド・ボンド（IH3シェアクラス、豪ドル）、ストラクチャラ-欧州ハイ・イールド・ボンド（IH7シェアクラス、南アフリカランド） 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-ブラジルレアル（I4シェアクラス、円）、ストラクチャラ-欧州ハイ・イールド・ボンド（IH3シェアクラス、豪ドル）、ストラクチャラ-欧州ハイ・イールド・ボンド（IH7シェアクラス、南アフリカランド）	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
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
（資源国通貨コース）運用報告書（全体版）
第27作成期

第154期（決算日 2023年11月8日）
第155期（決算日 2023年12月8日）
第156期（決算日 2024年1月9日）
第157期（決算日 2024年2月8日）
第158期（決算日 2024年3月8日）
第159期（決算日 2024年4月8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、よろしく申し上げます。

アムンディ・ジャパン株式会社

〒105-0021 東京都港区東新橋1丁目9番2号

お客様サポートライン：050-4561-2500

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：<https://www.amundi.co.jp/>

アムンディ・欧州ハイ・イールド債券ファンド（資源国通貨コース）

■最近5作成期の運用実績

	決算期	基準価額			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
		(分配落)	税込 分配 金	騰落 中率			
		円	円	%	%	%	百万円
第23 作成期	130期 (2021年11月8日)	3,157	40	2.1	0.1	98.2	637
	131期 (2021年12月8日)	3,003	40	△ 3.6	0.1	98.4	659
	132期 (2022年1月11日)	3,038	40	2.5	0.1	98.3	664
	133期 (2022年2月8日)	2,965	40	△ 1.1	0.1	98.9	636
	134期 (2022年3月8日)	2,936	40	0.4	0.1	98.9	617
	135期 (2022年4月8日)	3,292	40	13.5	0.1	98.7	577
第24 作成期	136期 (2022年5月9日)	3,076	40	△ 5.3	0.1	97.5	525
	137期 (2022年6月8日)	3,209	40	5.6	0.1	98.8	548
	138期 (2022年7月8日)	2,833	40	△ 10.5	0.2	98.8	506
	139期 (2022年8月8日)	2,995	20	6.4	0.1	98.6	535
	140期 (2022年9月8日)	3,018	20	1.4	0.1	98.4	534
	141期 (2022年10月11日)	2,841	20	△ 5.2	0.2	98.5	500
第25 作成期	142期 (2022年11月8日)	2,983	20	5.7	0.1	98.3	524
	143期 (2022年12月8日)	2,918	20	△ 1.5	0.2	98.7	502
	144期 (2023年1月10日)	2,854	20	△ 1.5	0.2	98.6	484
	145期 (2023年2月8日)	2,887	20	1.9	0.2	98.5	488
	146期 (2023年3月8日)	2,868	20	0.0	0.2	98.1	485
	147期 (2023年4月10日)	2,769	20	△ 2.8	0.2	98.0	467
第26 作成期	148期 (2023年5月8日)	2,840	20	3.3	0.2	98.0	477
	149期 (2023年6月8日)	2,927	20	3.8	0.2	98.4	489
	150期 (2023年7月10日)	2,980	20	2.5	0.2	98.5	495
	151期 (2023年8月8日)	3,001	20	1.4	0.2	98.3	487
	152期 (2023年9月8日)	3,016	20	1.2	0.2	98.4	487
	153期 (2023年10月10日)	2,962	20	△ 1.1	0.2	99.0	450
第27 作成期	154期 (2023年11月8日)	3,159	20	7.3	0.2	98.3	481
	155期 (2023年12月8日)	3,094	20	△ 1.4	0.2	98.5	467
	156期 (2024年1月9日)	3,172	20	3.2	0.2	98.3	481
	157期 (2024年2月8日)	3,214	20	2.0	0.2	98.4	482
	158期 (2024年3月8日)	3,260	20	2.1	0.2	97.8	486
	159期 (2024年4月8日)	3,307	20	2.1	0.2	98.0	490

(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。

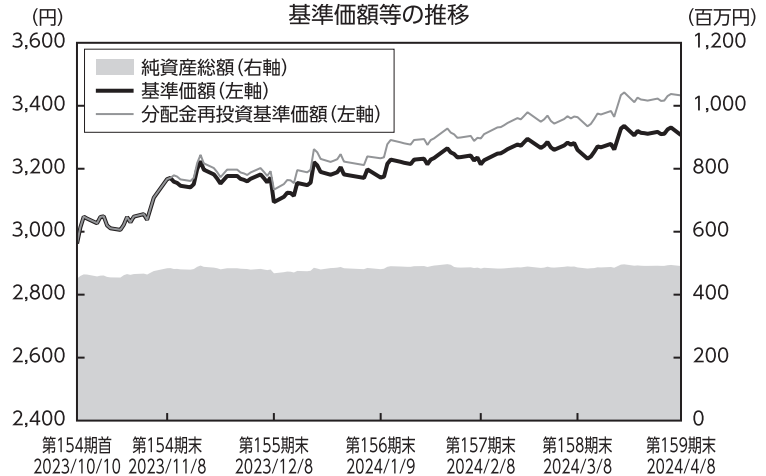
■ 当作成期中の基準価額等の推移

決算期	年 月 日	基 準 価 額		投資信託 受益証券 組入比率	投資証券 組入比率
		円	騰 落 率		
第154期	(期 首) 2023年10月10日	2,962	—	0.2	99.0
	10月末	3,038	2.6	0.2	97.9
	(期 末) 2023年11月8日	3,179	7.3	0.2	98.3
第155期	(期 首) 2023年11月8日	3,159	—	0.2	98.3
	11月末	3,160	0.0	0.2	98.6
	(期 末) 2023年12月8日	3,114	△1.4	0.2	98.5
第156期	(期 首) 2023年12月8日	3,094	—	0.2	98.5
	12月末	3,182	2.8	0.2	97.9
	(期 末) 2024年1月9日	3,192	3.2	0.2	98.3
第157期	(期 首) 2024年1月9日	3,172	—	0.2	98.3
	1月末	3,247	2.4	0.2	98.8
	(期 末) 2024年2月8日	3,234	2.0	0.2	98.4
第158期	(期 首) 2024年2月8日	3,214	—	0.2	98.4
	2月末	3,268	1.7	0.2	98.5
	(期 末) 2024年3月8日	3,280	2.1	0.2	97.8
第159期	(期 首) 2024年3月8日	3,260	—	0.2	97.8
	3月末	3,311	1.6	0.2	98.4
	(期 末) 2024年4月8日	3,327	2.1	0.2	98.0

(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。

【基準価額等の推移】

第154期首	2,962円
第159期末	3,307円
既払分配金 (税込み)	120円
騰落率	15.9% (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様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客様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、2023年10月10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 2023年11月後半以降、ECB（欧州中央銀行）の追加金融引き締め懸念が後退し、国債利回りが大きく低下（債券価格は上昇）したこと
- ② 2023年11月後半以降、ECBの追加金融引き締め懸念が後退し、安心感から欧州ハイイールド債市場に継続的な資金流入がみられ、クレジットスプレッド（国債との利回り格差）が縮小したこと
- ③ 為替市場において、当作成期は資源国通貨高・円安となったこと
- ④ ユーロ売り／資源国通貨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 2024年1月、利下げ開始時期の後ずれを背景に国債利回りが上昇（債券価格は下落）したこと

【投資環境】

<欧州ハイイールド債券市場>

当作成期の欧州ハイイールド債市場は、主に米欧の中央銀行の政策やマクロ経済指標による影響を受け、大きく変化しました。前作成期の投資環境ではECB（欧州中央銀行）は利上げを実施していましたが、当作成期中は政策金利を据え置きました。その結果、金融政策の緩和が見込まれ始め、国債利回りは低下（債券価格は上昇）しました。2023年12月のFOMC（米連邦公開市場委員会）で将来の利下げの可能性が示唆されたことも、グローバルな金利低下を後押ししました。2024年1月以降は、根強いインフレ懸念を背景に投資家は利下げ予想を修正し、国債利回りは上昇（債券価格は下落）しました。前作成期末比では、国債利回りは大きく低下しました。金融政策の転換を受けてクレジットスプレッド（国債との利回り格差）も2023年11月後半以降大きく縮小し、前作成期末比でも縮小しました。

<為替市場>

当作成期、資源国通貨（ブラジルレアル、豪ドル、南アフリカランド）の円相場は、それぞれブラジルレアル29円近辺、豪ドル95円台、南アフリカランド7円台後半で始まりしました。資源国通貨は、資源価格の上昇などを受け上昇した後、日銀の金融政策修正観測を受けた円高の動きなどから下落しました。その後は、資源価格の上昇や、日銀がマイナス金利政策を解除する一方で緩和的な金融環境を継続する見通しを示したことなどが支援材料となり上昇傾向で推移し、ブラジルレアル30円近辺、豪ドル99円台、南アフリカランド8円台前半で当作成期末を迎えました。

<日本の短期国債市場>

当作成期の短期国債市場では、マイナス圏での推移が続いていたTDB（国庫短期証券）3ヵ月物利回りが、当作成期末に向けて0%近辺まで上昇しました。TDB 3ヵ月物利回りは、日銀によるマイナス金利政策や海外投資家からの需要に支えられ、-0.20%前後での推移が続いていましたが、2024年3月に実施された日銀によるマイナス金利解除を背景に、当作成期末に向けては0%近辺まで上昇しました。

【ポートフォリオ】

<当ファンド>

当ファンドは、主として欧州のハイイールド債に投資しユーロの為替リスクをブラジルレアル、豪ドルおよび南アフリカランドの各為替リスクに変換した各投資信託証券「ストラクチャル-欧州ハイ・イールド・ボンド-ブラジルレアル（I4シェアクラス、円）」、「ストラクチャル-欧州ハイ・イールド・ボンド（IH3シェアクラス、豪ドル）」および「ストラクチャル-欧州ハイ・イールド・ボンド（IH7シェアクラス、南アフリカランド）」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した。また、当該3つのシェアクラスに均等に投資し、合計投資比率を高位に維持しました。なお、円建の国内籍投資信託「CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）」にも投資を行いました。

（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（資源国通貨コース）

<ストラクチャラ-欧州ハイ・イールド・ボンド（IH3シェアクラス、豪ドル）>※¹

<ストラクチャラ-欧州ハイ・イールド・ボンド（IH7シェアクラス、南アフリカランド）>※¹

<ストラクチャラ-欧州ハイ・イールド・ボンド-ブラジルレアル（I4シェアクラス、円）>※²

当作成期は、クレジット・エクスポージャーを中立からややポジティブ程度に保ち、低成長シナリオを反映させました。金利リスクに関しては市場の代表的な指数であるICE BofA European Currency High Yield Constrained Indexと同程度を維持しました。金融劣後債、サービス業および電気通信セクターの一部の発行体へのオーバー・エクスポージャーがプラスに寄与しました。

「ストラクチャラ-欧州ハイ・イールド・ボンド-ブラジルレアル」につきましても、「ストラクチャラ-欧州ハイ・イールド・ボンド」と同様の運用を行いました。

（アムンディ・アセットマネジメント）

実質的なユーロ建資産に対し、ユーロ売り／資源国通貨（ブラジルレアル、豪ドルおよび南アフリカランドを均等に配分）買いの為替取引を行い、当作成期を通じて資源国通貨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）

※1 「ストラクチャラ-欧州ハイ・イールド・ボンド（IH3シェアクラス、豪ドル）」および「ストラクチャラ-欧州ハイ・イールド・ボンド（IH7シェアクラス、南アフリカランド）」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同運用が行われています。上記の欧州ハイイールド債の運用については「ストラクチャラ-欧州ハイ・イールド・ボンド」の内容を記載しております。

※2 「ストラクチャラ-欧州ハイ・イールド・ボンド-ブラジルレアル（I4シェアクラス、円）」は、「ストラクチャラ-欧州ハイ・イールド・ボンド-ブラジルレアル」にて運用が行われています。為替取引も「ストラクチャラ-欧州ハイ・イールド・ボンド-ブラジルレアル」にて行われています。

<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12ヵ月以内に償還を迎える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＞

引き続き「ストラクチャラ-欧州ハイ・イールド・ボンド-ブラジルリアル（I4シェアクラス、円）」、「ストラクチャラ-欧州ハイ・イールド・ボンド（IH3シェアクラス、豪ドル）」および「ストラクチャラ-欧州ハイ・イールド・ボンド（IH7シェアクラス、南アフリカランド）」の3つのシェアクラスに均等に投資し、合計の投資比率を高位に保ちます。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。

（アムンディ・ジャパン株式会社）

＜ストラクチャラ-欧州ハイ・イールド・ボンド（IH3シェアクラス、豪ドル）＞

＜ストラクチャラ-欧州ハイ・イールド・ボンド（IH7シェアクラス、南アフリカランド）＞

＜ストラクチャラ-欧州ハイ・イールド・ボンド-ブラジルリアル（I4シェアクラス、円）＞

当ファンドは、欧州では一定期間緩やかな成長が続き、インフレ圧力が徐々に緩和し、今後数ヵ月にわたり金融政策の緩和が促されると予想しています。一方でデフォルト（債務不履行）リスクについては、最も脆弱（ぜいじゃく）な発行体に限られるとみられることから、市場のファンダメンタルズ（基礎的条件）に関する評価は引き続き前向きであると考えます。スプレッドはこれまでの平均を下回る水準に縮小していますが、足元の利回りは引き続き高い水準にあることから、欧州ハイイールド債のキャリーは引き続き魅力的であり投資家の興味を惹きつけると考えています。ただし、現時点では限定的ではあるものの個別銘柄リスクが高まっていることから、当ファンドは発行体の選定に重点を置く方針です。

（アムンディ・アセットマネジメント）

引き続き実質的なユーロ建資産に対し、ユーロ売り／資源国通貨（ブラジルリアル、豪ドルおよび南アフリカランドを均等に配分）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、12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154期～第159期 (2023年10月11日 ～2024年4月8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)	18円 (5) (12) (1)	0.549% (0.152) (0.381) (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)	2 (0) (2) (0)	0.055 (0.005) (0.050) (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	20	0.604	

期中の平均基準価額は3,201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。

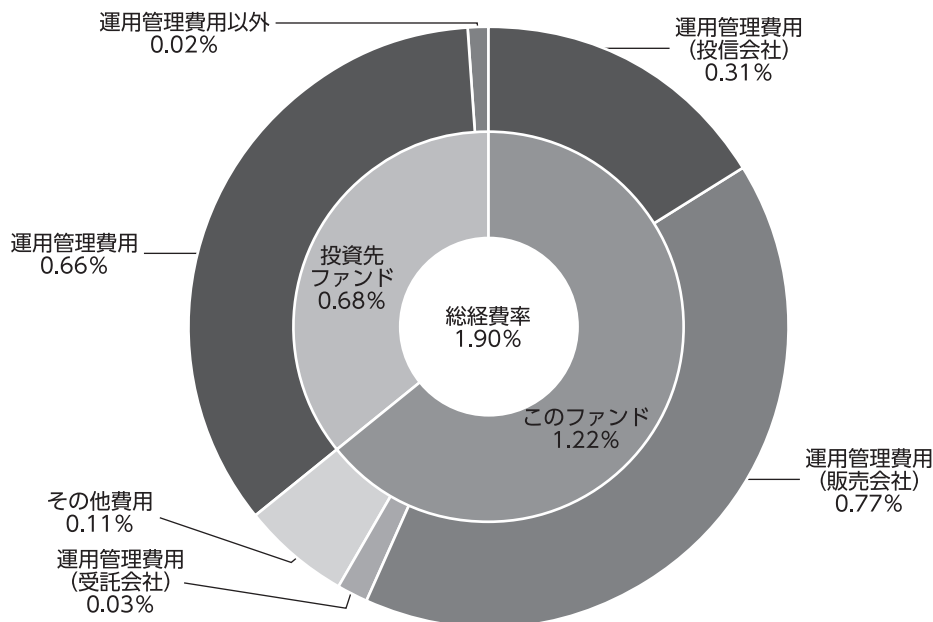
(注4) 各項目の費用は、このファンドが組入れている投資信託証券が支払った費用を含みません。

(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。

（参考情報）

●総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.90%です。



総経費率 (①+②+③)	1.90%
①このファンドの費用の比率	1.22%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.66%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.02%

(注1) ①の費用は、1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

(注4) 投資先ファンドとは、このファンドが組入れている投資信託証券です。

(注5) ①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注6) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率と異なります。

アムンディ・欧州ハイ・イールド債券ファンド（資源国通貨コース）

■売買及び取引の状況（2023年10月11日から2024年4月8日まで）

投資信託受益証券、投資証券

決 算 期		第 154 期 ～ 第 159 期			
		買 付		売 付	
		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
外	(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 -ブラジルリアル (I4シェアクラス、円)	口	千円	口	千円
		—	—	1,700	6,250
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 (IH3シェアクラス、豪ドル)	口	千オーストラリアドル	口	千オーストラリアドル
		1,000	31	700	23
	(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 (IH7シェアクラス、南アフリカランド)	口	千南アフリカランド	口	千南アフリカランド
		300	382	400	515

(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（2023年10月11日から2024年4月8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（2024年4月8日現在）

(1) 国内（邦貨建）投資信託受益証券

銘 柄		第26作成期末 (第153期末)	第27作成期末 (第159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	口	千円
		780,131	780,131	781
合 計	口 数・金 額	780,131	780,131	781
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	1	< 0.2% >

(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) 単位未満は切捨てです。以下同じ。

アムンディ・欧州ハイ・イールド債券ファンド（資源国通貨コース）

(2) 外国（邦貨建）投資証券

銘	柄	第26作成期末 (第153期末)	第27作成期末 (第159期末)	
		口数	口数	評価額
(ルクセンブルク)		口	口	千円
ストラクチュラ-欧州ハイ・イールド・ボンド -ブラジルリアル (I4シェアクラス、円)		43,500	41,800	157,669
合計		口数・金額	41,800	157,669
		銘柄数 < 比率 >	1	< 32.1% >

(3) 外国（外貨建）投資証券

銘	柄	第26作成期末 (第153期末)	第27作成期末 (第159期末)		
		口数	口数	評価額	組入比率
				外貨建金額 邦貨換算金額	
(ルクセンブルク)		口	口	千円	%
ストラクチュラ-欧州ハイ・イールド・ボンド (IH3シェアクラス、豪ドル)		49,700	50,000	1,617 161,103	32.8
(ルクセンブルク)				千南アフリカランド	
ストラクチュラ-欧州ハイ・イールド・ボンド (IH7シェアクラス、南アフリカランド)		15,620	15,520	20,041 162,336	33.1
合計		口数・金額	65,520	— 323,439	
		銘柄数 < 比率 >	2	— < 65.9% >	

(注) 邦貨換算金額は、当作成期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

■投資信託財産の構成 (2024年4月8日現在)

項	目	第27作成期末 (第159期末)	
		評価額	比率
投資信託受益証券		千円	%
投資証券		781	0.2
コール・ローン等、その他		481,109	97.3
投資信託財産総額		12,644	2.5
		494,534	100.0

(注1) 金額の単位未満は切捨てです。

(注2) 当作成期末における外貨建純資産 (323,439千円) の投資信託財産総額 (494,534千円) に対する比率は65.4%です。

(注3) 外貨建資産は、当作成期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

なお、2024年4月8日現在における邦貨換算レートは、1 オーストラリアドル=99.60円、1 南アフリカランド=8.10円です。

アムンディ・欧州ハイ・イールド債券ファンド（資源国通貨コース）

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第154期末 (2023年11月8日)	第155期末 (2023年12月8日)	第156期末 (2024年1月9日)	第157期末 (2024年2月8日)	第158期末 (2024年3月8日)	第159期末 (2024年4月8日)
(A) 資 産	492,152,891円	472,157,755円	490,587,747円	486,404,673円	489,919,653円	494,534,443円
コール・ローン等	14,477,253	10,474,175	14,046,259	10,540,100	13,201,825	12,643,372
投資信託受益証券(評価額)	782,003	781,691	781,769	781,691	781,613	781,535
投資証券(評価額)	473,814,160	460,901,889	472,798,365	475,082,882	475,936,215	481,109,534
未収入金	3,079,475	-	2,961,354	-	-	-
未収利息	-	-	-	-	-	2
(B) 負 債	10,494,042	4,170,106	9,582,729	3,625,734	3,630,139	3,697,847
未払金	6,163,612	-	5,922,291	-	-	-
未払収益分配金	3,049,866	3,024,718	3,033,219	3,004,027	2,983,243	2,968,053
未払解約金	829,403	619,879	29,004	10	10	3,338
未払信託報酬	409,037	439,622	465,740	445,406	428,276	462,495
未払利息	-	31	-	30	39	-
その他未払費用	42,124	85,856	132,475	176,261	218,571	263,961
(C) 純資産総額(A-B)	481,658,849	467,987,649	481,005,018	482,778,939	486,289,514	490,836,596
元 本	1,524,933,352	1,512,359,034	1,516,609,555	1,502,013,985	1,491,621,571	1,484,026,808
次期繰越損益金	△1,043,274,503	△1,044,371,385	△1,035,604,537	△1,019,235,046	△1,005,332,057	△ 993,190,212
(D) 受益権総口数	1,524,933,352口	1,512,359,034口	1,516,609,555口	1,502,013,985口	1,491,621,571口	1,484,026,808口
1万口当たり基準価額(C/D)	3.159円	3.094円	3.172円	3.214円	3.260円	3.307円

(注記事項)

作成期首元本額	1,521,939,564円
作成期中追加設定元本額	70,788,021円
作成期中一部解約元本額	108,700,777円

■損益の状況

項 目	第154期	第155期	第156期	第157期	第158期	第159期
	自 2023年10月11日 至 2023年11月8日	自 2023年11月9日 至 2023年12月8日	自 2023年12月9日 至 2024年1月9日	自 2024年1月10日 至 2024年2月8日	自 2024年2月9日 至 2024年3月8日	自 2024年3月9日 至 2024年4月8日
(A) 配 当 等 収 益	5,377,326円	5,249,003円	5,309,290円	5,314,306円	5,325,165円	5,393,033円
受 取 配 当 金	5,378,555	5,249,518	5,310,014	5,314,959	5,325,754	5,393,296
受 取 利 息	-	-	-	-	-	19
支 払 利 息	△ 1,229	△ 515	△ 724	△ 653	△ 589	△ 282
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	27,974,245	△ 11,446,853	9,710,970	4,532,093	4,940,252	5,102,010
売 買 益	28,094,902	7,382,784	9,816,587	4,938,637	5,314,965	6,457,924
売 買 損	△ 120,657	△ 18,829,637	△ 105,617	△ 406,544	△ 374,713	△ 1,355,914
(C) 信 託 報 酬 等	△ 451,488	△ 483,665	△ 512,679	△ 489,348	△ 470,725	△ 507,885
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	32,900,083	△ 6,681,515	14,507,581	9,357,051	9,794,692	9,987,158
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 384,658,774	△ 351,050,447	△ 355,591,464	△ 338,590,786	△ 327,957,373	△ 318,926,552
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 688,465,946	△ 683,614,705	△ 691,487,435	△ 686,997,284	△ 684,186,133	△ 681,282,765
(配 当 等 相 当 額)	(238,640,109)	(237,004,056)	(240,084,511)	(238,690,545)	(237,878,303)	(236,922,797)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 927,106,055)	(△ 920,618,761)	(△ 931,571,946)	(△ 925,687,829)	(△ 922,064,436)	(△ 918,205,562)
(G) 計 (D + E + F)	△ 1,040,224,637	△ 1,041,346,667	△ 1,032,571,318	△ 1,016,231,019	△ 1,002,348,814	△ 990,222,159
(H) 収 益 分 配 金	△ 3,049,866	△ 3,024,718	△ 3,033,219	△ 3,004,027	△ 2,983,243	△ 2,968,053
次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)	△ 1,043,274,503	△ 1,044,371,385	△ 1,035,604,537	△ 1,019,235,046	△ 1,005,332,057	△ 993,190,212
追 加 信 託 差 損 益 金	△ 688,465,946	△ 683,614,705	△ 691,487,435	△ 686,997,284	△ 684,186,133	△ 681,282,765
(配 当 等 相 当 額)	(238,640,109)	(237,004,056)	(240,084,511)	(238,690,545)	(237,878,303)	(236,922,797)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 927,106,055)	(△ 920,618,761)	(△ 931,571,946)	(△ 925,687,829)	(△ 922,064,436)	(△ 918,205,562)
分 配 準 備 積 立 金	140,753,454	141,009,692	141,093,972	140,883,766	141,174,577	142,367,277
繰 越 損 益 金	△ 495,562,011	△ 501,766,372	△ 485,211,074	△ 473,121,528	△ 462,320,501	△ 454,274,724

(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154期計算期間末における費用控除後の配当等収益（5,304,546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（238,640,109円）および分配準備積立金（138,498,774円）より分配対象収益は382,443,429円（10,000口当たり2,507円）であり、うち3,049,866円（10,000口当たり20円）を分配金額としております。

第155期計算期間末における費用控除後の配当等収益（4,765,338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（237,004,056円）および分配準備積立金（139,269,072円）より分配対象収益は381,038,466円（10,000口当たり2,519円）であり、うち3,024,718円（10,000口当たり20円）を分配金額としております。

第156期計算期間末における費用控除後の配当等収益（5,128,058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（240,084,511円）および分配準備積立金（138,999,133円）より分配対象収益は384,211,702円（10,000口当たり2,533円）であり、うち3,033,219円（10,000口当たり20円）を分配金額としております。

第157期計算期間末における費用控除後の配当等収益（5,050,205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（238,690,545円）および分配準備積立金（138,837,588円）より分配対象収益は382,578,338円（10,000口当たり2,547円）であり、うち3,004,027円（10,000口当たり20円）を分配金額としております。

第158期計算期間末における費用控除後の配当等収益（5,081,000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（237,878,303円）および分配準備積立金（139,076,820円）より分配対象収益は382,036,123円（10,000口当たり2,561円）であり、うち2,983,243円（10,000口当たり20円）を分配金額としております。

第159期計算期間末における費用控除後の配当等収益（5,132,031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（236,922,797円）および分配準備積立金（140,203,299円）より分配対象収益は382,258,127円（10,000口当たり2,575円）であり、うち2,968,053円（10,000口当たり20円）を分配金額としております。

■分配金のお知らせ

決 算 期	第154期	第155期	第156期	第157期	第158期	第159期
1 万口当たりの分配金（税込み）	20円	20円	20円	20円	20円	20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います。

◇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）を超過し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154期	第155期	第156期	第157期	第158期	第159期
	(2023年10月11日 ～2023年11月8日)	(2023年11月9日 ～2023年12月8日)	(2023年12月9日 ～2024年1月9日)	(2024年1月10日 ～2024年2月8日)	(2024年2月9日 ～2024年3月8日)	(2024年3月9日 ～2024年4月8日)
当期分配金	20	20	20	20	20	20
(対基準価額比率)	(0.629%)	(0.642%)	(0.627%)	(0.618%)	(0.610%)	(0.601%)
当期の収益	20	20	20	20	20	20
当期の収益以外	—	—	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額	2,487	2,499	2,513	2,527	2,541	2,555

（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. 補足情報 >

組入ファンド「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月末日）と当ファンドの決算日が異なっていますので、2024年4月5日現在の情報を掲載しています。

■有価証券明細（評価額上位30銘柄）（2024年4月5日現在）

(1) 債券

銘柄		通貨	額面金額	評価額 (ユーロ)
スペイン	LORCA TELECOM BONDCO 4 20-27 30/09S	EUR	3,000,000	2,924,471.98
フランス	EDF SA FL. R 22-XX 06/12A	EUR	2,600,000	2,905,775.81
アイルランド	DOLYA HOLDCO 4.875 20-28 15/07S	GBP	2,700,000	2,877,486.61
オランダ	TELEFONICA EUROPE BV FL. R 22-XX 23/11A	EUR	2,400,000	2,692,068.40
	TEVA PHARMACEUTICAL 3.75 21-27 09/05S	EUR	2,700,000	2,659,737.01
ギリシャ	ALPHA BANK SA FL. R 23-29 27/06A	EUR	2,300,000	2,626,847.26
メキシコ	PEMEX 2.75 15-27 21/04A	EUR	2,800,000	2,496,114.11
フランス	EDF FL. R 13-XX 29/01S	GBP	2,000,000	2,315,052.57
イタリア	UNIPOLSAI SPA FL. R 14-XX 18/06A	EUR	1,990,000	2,081,332.58
フランス	FAURECIA SE 3.75 20-28 15/06S	EUR	2,100,000	2,068,383.46
オランダ	ZIGGO BOND CO BV 3.375 20-30 28/02SS	EUR	2,400,000	2,053,729.56
イタリア	BANCO BPM SPA FL. R 20-31 14/01A	EUR	2,000,000	1,965,264.02
日本	SOFTBANK GROUP 5.00 18-28 15/04S	EUR	1,922,000	1,964,284.08
フランス	ILIAD HOLDING 5.625 21-28 15/10S	EUR	1,900,000	1,935,246.47
	BNP PARIBAS FL. R 22-99 31/12S	EUR	1,800,000	1,919,507.01
イタリア	NEXI SPA 2.125 21-29 30/04S	EUR	2,000,000	1,820,076.85
イギリス	PINNACLE BIDCO 8.25 23-28 11/10S	EUR	1,700,000	1,800,621.17
イタリア	TELECOM ITALIA SPA 7.875 23-28 31/07S	EUR	1,600,000	1,778,125.58
イギリス	BELLIS ACQUISITION 3.25 21-26 16/02S	GBP	1,600,000	1,764,958.37
フランス	KAPLA HOLDING SAS 3.375 19-26 15/12S/12S	EUR	1,780,000	1,743,099.44
スペイン	BBVA FL. R 23-XX 21/09Q	EUR	1,600,000	1,736,231.47
アメリカ	PANTHER BF AGGREGATOR 4.375 19-26 15/05S	EUR	1,700,000	1,720,106.29
オランダ	WP/AP TELECOM H 3.7500 21-29 15/01S	EUR	1,700,000	1,607,828.79
アメリカ	ORGANON COMPANY 2.875 21-28 30/04S	EUR	1,700,000	1,603,239.73
オランダ	NATURGY FINANCE BV 2.374 21-XX 23/02A	EUR	1,700,000	1,601,408.50
イタリア	TELECOM ITALIA SPA 2.375 17-27 12/10A	EUR	1,700,000	1,596,777.78
オランダ	RABOBANK FL. R 22-XX 29/06S	EUR	1,600,000	1,526,885.92
イギリス	PINEWOOD FIN 6.0 S/A 24-30 27/03U	GBP	1,300,000	1,513,856.00

(2) 投資証券

銘柄		通貨	口数	評価額 (ユーロ)
フランス	AMUNDI EURO LIQUIDITY SRI PART Z C	EUR	4	4,377,835.93
	AMUNDI EURO LIQUIDITY SHT TERM SRI Z C	EUR	26	2,714,937.13

(注1) 口数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。

EUR (ユーロ)、GBP (英ポンド)

■外国為替先物契約 (2024年4月5日現在)
(IH3シェアクラス、豪ドル)

買 建	契 約 額	売 建	契 約 額	満 期 日	評 価 損 益 ユーロ
ユーロ	1,204,389.03	オーストラリアドル	2,000,000.00	2024/6/4	△ 9,852.80
オーストラリアドル	158,800,000.00	ユーロ	95,780,067.73	2024/6/4	630,294.51
				合計	620,441.71

(IH7シェアクラス、南アフリカランド)

買 建	契 約 額	売 建	契 約 額	満 期 日	評 価 損 益 ユーロ
南アフリカランド	22,670,000.00	ユーロ	1,092,871.25	2024/6/4	21,235.51
				合計	21,235.51

< 2. 補足情報 >

組入ファンド「ストラクチュラ-欧州ハイ・イールド・ボンド-ブラジルリアル」の決算日（毎年12月末日）と当ファンドの決算日が異なっていますので、2024年4月5日現在の情報を掲載しています。

■有価証券明細（評価額上位30銘柄）（2024年4月5日現在）

債券

銘柄		通貨	額面金額	評価額（円）
スペイン	LORCA TELECOM BONDCO 4 20-27 30/09S	EUR	600,000	95,894,724
イタリア	TELECOM ITALIA SPA 6.875 23-28 15/02S	EUR	500,000	87,390,233
アイルランド	DOLYA HOLDCO 4.875 20-28 15/07S	GBP	500,000	87,364,864
フランス	EDF FL. R 13-XX 29/01S	GBP	400,000	75,911,593
ギリシャ	ALPHA BANK SA FL. R 23-29 27/06A	EUR	400,000	74,900,415
イギリス	IRON MOUNTAIN 3.875 17-25 15/11S	GBP	390,000	73,628,455
オランダ	TELEFONICA EUROPE BV FL. R 22-XX 23/11A	EUR	400,000	73,561,757
フランス	EDF SA FL. R 22-XX 06/12A	EUR	400,000	73,293,590
スペイン	BBVA FL. R 23-XX 21/09Q	EUR	400,000	71,164,743
イタリア	UNIPOLSAI SPA FL. R 14-XX 18/06A	EUR	410,000	70,305,533
オランダ	ZIGGO BOND CO BV 3.375 20-30 28/02SS	EUR	500,000	70,148,642
フランス	BNP PARIBAS FL. R 22-99 31/12S	EUR	400,000	69,934,977
オランダ	WP/AP TELECOM H 3.7500 21-29 15/01S	EUR	450,000	69,778,342
ノルウェー	ADEVINTA ASA 3 20-27 15/11S	EUR	400,000	66,881,305
フランス	ILIAD HOLDING 5.125 21-26 15/10S	EUR	400,000	66,689,467
スペイン	BANCO DE SABADELL SA 2.5 21-31 15/01A	EUR	400,000	64,279,288
フランス	CONSTELLUM SE 4.25 17-26 15/02S	EUR	390,000	64,195,158
オランダ	ABERTIS INFRA FIN FL. R 20-XX 24/02A	EUR	400,000	64,061,192
	RABOBANK FL. R 22-XX 29/06S	EUR	400,000	62,584,076
アメリカ	ORGANON COMPANY 2.875 21-28 30/04S	EUR	400,000	61,848,161
オランダ	NATURGY FINANCE BV 2.374 21-XX 23/02A	EUR	400,000	61,777,517
イギリス	VODAFONE GROUP PLC FL. R 20-80 27/08A	EUR	400,000	60,835,672
イタリア	NEXI SPA 2.125 21-29 30/04S	EUR	400,000	59,681,121
メキシコ	PEMEX 2.75 15-27 21/04A	EUR	400,000	58,463,343
オランダ	TELEFONICA EUROPE BV FL. R 23-99 31/12A	EUR	300,000	55,580,781
イギリス	BELLIS ACQUISITION 3.25 21-26 16/02S	GBP	300,000	54,256,651
ドイツ	CHEPLAPHARM ARZ 7.5000 23-30 15/05S	EUR	300,000	53,364,218
イギリス	ALLWYN ENTERT FINAN 7.25 23/30 30-04S	EUR	300,000	52,532,923
	PINNACLE BIDCO 8.25 23-28 11/10S	EUR	300,000	52,096,907
アメリカ	COTY INC 5.75 23-28 15/09A	EUR	300,000	51,144,520

（注）通貨欄の表記は以下の通りです。
EUR（ユーロ）、GBP（英ポンド）

■外国為替取引 [N D F] （2024年4月5日現在）

買 建	契 約 額	売 建	契 約 額	満 期 日	評 価 損 益 円
ブラジルリアル	269,674,812.00	ユーロ	49,500,000.00	2024/6/4	△83,389,276
				合計	△83,389,276

< 3. 補足情報 >

組入ファンド「C A マネープールファンド（適格機関投資家専用）」の決算日（2024年2月15日）と当ファンドの決算日が異なっていますので、2024年4月8日現在の情報を掲載しています。

■組入資産の明細（2024年4月8日現在）

公社債

(A) 債券種類別開示

国内（邦貨建）公社債

区 分	2024 年 4 月 8 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	350,000	350,472	67.8	—	—	—	67.8
合 計	350,000	350,472	67.8	—	—	—	67.8

(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います。

(B) 個別銘柄開示

国内（邦貨建）公社債

種 類	銘 柄	2024 年 4 月 8 日 現 在			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
		%	千円	千円	
地 方 債 証 券	第11回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.001	50,000	49,978	2024/8/28
	第134回共同発行市場公募地方債	0.674	100,000	100,074	2024/5/24
	第137回共同発行市場公募地方債	0.566	50,000	50,080	2024/8/23
	第139回共同発行市場公募地方債	0.544	150,000	150,340	2024/10/25
合 計			350,000	350,472	

(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 2023年12月31日
 (計算期間：2023年1月1日～2023年12月31日)

作成時点において、入手可能な直前計算期間の年次報告書をもとに委託会社が翻訳・抜粋・作成しています。なお、開示情報につきましては各クラス別の情報がないため、全てのシェアクラスを含むファンド全体の情報を開示しています。

■費用の明細 (2023年1月1日～2023年12月31日)

項目	当期
	ユーロ
(a)運用報酬	1,410,775.18
(b)管理費用等	307,805.73
(c)その他の費用	776,707.55
合計	2,495,288.46

■純資産計算書 (2023年12月31日現在)

項目	当期末
	ユーロ
資産合計	240,245,571.78
有価証券	232,740,340.27
預金	147,290.68
未収利息	3,511,435.03
為替予約取引取引評価勘定	2,201,753.06
スワップ取引評価勘定	1,632,822.80
為替未収入金	11,929.94
負債合計	5,250,894.96
借入金	243,172.90
未払配当金	2,500,106.10
未払解約金	2,241,339.07
先物取引評価勘定	131,455.00
未払運用報酬	105,854.77
未払管理費用	23,095.61
未払税	5,871.51
純資産	234,994,676.82

■ 有価証券明細 (2023年12月31日現在)

数量	評価額 ユーロ	数量	評価額 ユーロ
債券	159,148,008.21		
ドイツ	14,557,960.31		
1,220,000 CHEPLAPHARM ARZ 7.5000 23-30 15/05S	1,301,869.19	1,320,000 SPECTRUM BRANDS 4.00 16-26 01/10S	1,307,525.71
500,000 CHEPLAPHARM ARZNEIMI 4.375 20-28 15/10S	489,114.68	600,000 WMG ACQUISITION 2.75 20-28 15/07S	573,168.68
1,400,000 DEUTSCHE LUFTHANSA 2.875 21-27 16/05A	1,349,663.29	フィンランド	626,265.17
800,000 DEUTSCHE LUFTHANSA 3 20-26 29/05A	780,574.38	600,000 HUHTAMAKI OYJ 5.1250 23-28 24/11A	626,265.17
1,000,000 GRUENENTHAL GMBH 3.625 21-26 05/05S	988,849.80	フランス	30,938,127.67
1,400,000 GRUENENTHAL GMBH 4.125 21-28 05/05S	1,387,418.06	800,000 AFFLELOU SAS 4.25 21-26 19/05S	798,528.33
800,000 HT TROPLAST 9.375 23-28 15/07S	815,164.94	800,000 AIR FRANCE - KLM 7.25 23-26 31/05A	855,201.14
900,000 IHO VERWALTUNGS 3.875 19-27 15/05S	883,279.45	500,000 AIR FRANCE - KLM 8.125 23-28 31/05A	568,753.68
930,000 NIDDA HEALTHCARE HOLDI 7.5 22-26 21/08S	960,197.28	2,120,000 ALTICE FRANCE SA 3.375 19-28 15/01S	1,687,180.74
1,800,000 NOVELIS SHEET INGOT 3.375 21-29 15/04S	1,701,573.30	600,000 ATOS SE 1.7500 18-25 07/05A	460,749.13
900,000 TK ELEVATOR MIDCO 4.375 20-27 15/07S/07S	872,267.27	300,000 ATOS SE 1 21-29 12/11A	163,879.10
1,300,000 ZF FINANCE GMBH 2.25 21-28 03/05S	1,196,910.44	400,000 ATOS SE 2.5000 18-28 07/11A	244,960.90
500,000 ZF FINANCE GMBH 2.75 20-27 25/11A	476,666.42	600,000 BANIJAY ENTERTAINMENT 7.00 23-29 01/05S	634,542.46
1,400,000 ZF FINANCE GMBH 3.75 20-28 21/09A	1,354,411.81	850,000 BANIJAY GROUP SAS 6.5 20-26 11/02S	850,527.73
オーストリア	962,380.81	900,000 CAB SELAS 3.375 21-28 09/02S	803,686.54
1,000,000 SAPPI PAPIER HOLDING 3.625 21-28 24/03S	962,380.81	700,000 CGG 7.75 21-27 01/04S	648,154.01
ベルギー	726,960.76	900,000 CHROME BIDCO SAS 3.5 21-28 24/05S	756,051.83
700,000 AZELIS GROUP 5.75 23-28 15/03S	726,960.76	1,000,000 CONSTELLUM SE 3.125 21-29 02/06S	921,521.06
デンマーク	928,381.41	1,070,000 CONSTELLUM SE 4.25 17-26 15/02S	1,066,919.06
900,000 TDC NET AS 5.618 23-30 06/02A	928,381.41	500,000 CROWN EUROPEAN HLDG 5.00 23-28 15/05S	519,677.77
スペイン	8,708,411.72	500,000 ELIOR GROUP SA 3.75 21-26 08/07S	463,613.09
1,200,000 BANCO DE SABADELL SA 2.5 21-31 15/01A	1,138,892.33	1,100,000 FONCIA MANAGEMENT SA 3.375 21-28 25/03S	948,313.75
600,000 BANKINTER SA 7.3750 23-49 31/12Q	610,038.96	700,000 FONCIA MANAGEMENT SA 7.750 23-28 31/03S	680,934.60
1,000,000 CELLNEX FINANCE CO SA 1.5 21-28 08/06A	917,727.76	300,000 FORVIA 2.375 19-27 15/06S	284,516.70
1,400,000 CELLNEX TELECOM SA 1.75 20-30 23/10A	1,229,645.80	2,600,000 FORVIA 3.75 20-28 31/07S	2,553,965.72
1,200,000 GRIFOLS ESCROW 3.8750 21-28 15/10S	1,101,362.96	600,000 GOLDSTORY SAS 5.375 21-26 04/02S	599,033.42
3,500,000 LORCA TELECOM BONDCO 4 20-27 30/09S	3,421,914.69	1,300,000 ILIAD HOLDING 5.125 21-26 15/10S	1,299,065.75
300,000 VIA CELERE DESARROLL 5.25 21-26 25/03S	288,829.22	1,900,000 ILIAD HOLDING 5.625 21-28 15/10S	1,912,437.48
アメリカ	15,984,319.52	600,000 IM GROUP SAS 8.0 23-28 01/03S	474,651.56
89,672 ADIENT GLOBAL HLDG 3.5 16-24 15/08S	89,086.45	1,780,000 KAPLA HOLDING SAS 3.375 19-26 15/12S/12S	1,728,534.13
600,000 BELDEN INC 3.875 18-28 15/03S	582,808.87	400,000 LOXAM SAS 3.75 19-26 15/07S	396,641.21
1,000,000 CARNIVAL CORP 7.625 20-26 01/03S	1,019,068.65	1,000,000 LOXAM SAS 6.3750 23-28 15/05S	1,044,615.34
1,000,000 COTY INC 5.75 23-28 15/09A	1,055,235.41	300,000 LOXAM SAS 6.375 23-29 31/05S	311,414.17
700,000 ENCORE CAPITAL GROUP 4.25 21-28 01/06S	696,423.89	300,000 MOBILUX FINANCE 4.25 21-28 15/07S	273,519.06
1,600,000 FORD MOTOR CREDIT 4.867 23-27 03/08A	1,646,751.03	300,000 NEXANS 5.5 23-28 05/04A	319,060.39
700,000 FORD MOTOR CREDIT CO 5.125 20-25 19/06S	626,267.79	400,000 PAPREC HOLDING SA 3.5 21-28 02/07S	386,573.33
580,000 GTCR W DUT/W-2 8.5000 23-31 15/01S	726,447.55	480,000 PAPREC HOLDING SA 6.50 23-27 17/11S	514,163.08
1,000,000 INTL GAME TECHNOLOGY 2.375 19-28 15/04A	932,034.93	700,000 PICARD GROUPE 3.875 21-26 07/07S	684,615.95
900,000 IQVIA INC 2.25 19-28 15/01S	847,760.05	500,000 RENAULT SA 1.1250 19-27 04/10A	458,195.17
1,400,000 IQVIA INC 2.875 20-28 24/06S	1,338,516.46	400,000 REXEL SA 5.25 23-30 15/09S	417,949.49
700,000 OLYMPUS WATER US HOL 9.625 23-28 15/11S	752,672.53	1,100,000 SECHE ENVIRONNEMENT 2.25 21-28 15/11S	991,227.67
1,700,000 ORGANON COMPANY 2.875 21-28 22/04S	1,565,044.02	1,300,000 SPCM SA 2.6250 20-29 01/02S	1,197,945.37
1,700,000 PANTHER BF AGGREGATOR 4.375 19-26 15/05S	1,690,151.42	1,000,000 TEREOS FINANCE GROUP 7.25 23-28 15/04S	1,063,041.52
500,000 SCIL IV LLC SCIL USA 9.5 23-28 15/07A	535,356.08	500,000 VALEO 5.875 23-29 12/04A	537,569.75
		400,000 VALEO SA 5.375 22-27 28/05A	416,196.49
		アイルランド	3,198,031.71
		3,000,000 DOLYA HOLDCO 4.875 20-28 15/07S	3,198,031.71
		マン島	899,392.97
		900,000 PLAYTECH PLC 5.8750 23-28 28/06S	899,392.97
		イタリア	15,434,650.55

数量	評価額 ユーロ	数量	評価額 ユーロ
500.000	BANCO BPM 6.00 23-28 14/06A	524,381.75	
500.000	BC POP EMILIA ROMAGNA 3.875 22-32 25/0A7	469,468.77	
500.000	DOVALUE SPA 3.375 21-26 31/07S	452,186.44	
1,090.000	FIBER BIDCO 11.00 22-27 25/10S	1,193,396.86	
1,200.000	GAMENET GROUP 7.125 23-28 01/06S	1,268,918.24	
1,400.000	IMA SPA 3.75 20-28 15/01SS 20-28 29/12S	1,310,112.16	
800.000	INTERNATIONAL DESIGN 10.00 23-28 15/11S	833,151.31	
500.000	INTESA SANPAOLO 2.9250 20-30 14/10A	456,816.43	
500.000	ITALMATCH CHEMICALS SP 10.0 23-28 06/02S	517,451.25	
500.000	LOTTOMATICA SPA 9.7500 22-27 30/09S	542,464.12	
2,400.000	NEXI SPA 2.125 21-29 30/04S/04S	2,125,654.92	
1,000.000	SPACE4 GUALA CLOSURES 3.25 21-28 15/06S	943,985.75	
1,700.000	TELECOM ITALIA SPA 2.375 17-27 12/10A	1,592,342.67	
1,000.000	TELECOM ITALIA SPA 6.875 23-28 15/02S	1,066,518.73	
1,600.000	TELECOM ITALIA SPA 7.875 23-28 31/07S	1,781,764.83	
400.000	UNICREDIT SPA 4.4500 21-XX XX/XXS	356,036.32	
日本		2,366,134.24	
1,922.000	SOFTBANK GROUP 5.00 18-28 15/04S	1,910,188.42	
500.000	SOFTBANK GROUP CORP 4 17-29 19/09S19/09S	455,945.82	
ルクセンブルク		10,195,647.37	
700.000	ALTICE FINANCING S.A 3 20-28 22/01S	627,011.60	
600.000	ARENA LUXEMBOURG 1.875 20-28 01/02S	537,733.89	
500.000	BK LC LUX FINCO 1 5.25 21-29 30/04S/04S	498,592.79	
1,110.000	CIDRON AIDA FINCO SA 5 21-28 01/04S	1,072,044.53	
1,080.000	CIRSA FINANCE INT 4.7500 19-25 22/05S	1,081,185.49	
1,400.000	CIRSA FINANCE INTE 4.5 21-27 15/03A	1,352,646.85	
700.000	CIRSA FIN INTL SARL 10 3.75 22-27 30/11S	764,806.79	
800.000	CPI PROPERTY GROUP 4.875 19-XX 16/10A	239,082.07	
1,100.000	CPI PROPERTY GROUP FL.R 21-XX 27/07A	275,737.38	
400.000	DANA FINANCING LUX 8.5 23-31 15/07S	439,182.54	
900.000	EPHIOS SUBCO S.A R.L. 7.875 23-31 31/01S	932,880.32	
1,300.000	HERENS MIDCO SARL 5.25 21-29 15/05S/05S	786,504.09	
500.000	MATTERHORN TELECOM 4.00 17-27 15/11S	493,791.12	
1,100.000	PLT VII FINANCE S.A 4.625 20-26 16/07S	1,094,447.91	
メキシコ		3,690,571.33	
1,200.000	NEMAK SAB CV 2.25 21-28 20/07A	1,067,292.74	
2,800.000	PEMEX 2.75 15-27 21/04A	2,361,175.30	
300.000	PEMEX 4.875 17-28 21/02A	262,103.29	
ノルウェー		697,782.73	
700.000	ADEVINTA ASA 3 20-27 05/11S	697,782.73	
オランダ		19,017,029.21	
500.000	ABERTIS FINANCE BV 2.625 21-49 31/12A	456,907.59	
1,100.000	DUFREY ONE B.V. 3.375 21-28 22/04S	1,052,779.77	
800.000	DUFREY ONE BV 2.0000 19-27 15/02S	750,591.35	
1,500.000	ENERGIZER GAMMA ACQU 3.5 21-29 23/06S	1,298,069.98	
1,700.000	NATURGY FINANCE 2.3740 21-49 31/12A	1,553,724.16	
800.000	OI EUROPEAN GROUP 6.25 23-28 15/05S	839,658.07	
480.000	Q PARK HOLDING BV 2.0 20-27 01/03S	445,565.75	
2,700.000	TEVA PHARMACEUTICAL 3.75 21-27 09/05S	2,611,287.45	
1,000.000	TEVA PHARMACEUTICAL 7.375 23-29 15/09S	1,095,934.53	
700.000	TEVA PHARMACEUTICAL I 4.375 21-30 09/05S	659,362.38	
400.000	UNITED GROUP BV 4.00 20-27 15/11S	379,048.66	
600.000	UNITED GROUP BV 5.25 22-30 01/02S	569,429.53	
1,000.000	WINTERSHALL DEA FIN 2.4985 21-99 31/12A	911,996.89	
900.000	WINTERSHALL DEA FINA 3.5 21-99 31/12A	788,160.73	
1,700.000	WPI/AP TELECOM H 3.7500 21-29 15/01S	1,617,329.94	
900.000	WPI/AP T HLD IV 5.50 21-30 15/01S	824,334.16	
300.000	ZF EUROPE FINANCE BV 3 19-29 23/10A0A	276,999.86	
800.000	ZF EUROPE FINANCE BV 6.125 23-29 13/03A	851,959.29	
2,400.000	ZIGGO BOND CO BV 3.375 20-30 28/02SS	2,033,889.12	
ポーランド		2,407,668.23	
1,300.000	CANPACK SA 2.375 20-27 01/11S	1,196,170.20	
1,300.000	INPOST SA 2.25 21-27 15/07S06S	1,211,498.03	
イギリス		21,287,134.99	
1,100.000	ALLWYN ENTERT FINAN 7.25 23/30 30-04S	1,160,777.89	
920.000	AVIS BUDGET FINANCE 4.75 18-26 04/10S	920,586.07	
1,500.000	AVIS BUDGET FINANCE 7.25 23-30 31/07S	1,611,321.12	
590.000	B&M EUROPEAN VALUE 8.125 23-30 15/11A	725,548.03	
1,100.000	BCP V MOD SERV FIN II 4.75 21-28 30/1S	1,023,631.80	
1,600.000	BELLIS ACQUISITION 3.25 21-26 16/02S	1,716,468.51	
400.000	DEUCE FINCO PLC 5.5 21-27 18/06S	432,011.61	
600.000	EC FINANCE PLC 3.0000 21-26 15/10S	580,743.44	
300.000	INEOS QUATTRO FINANC 3.5 21-26 29/01S	291,350.87	
720.000	INEOS QUATTRO FINANC 3.75 21-26 29/01S	696,626.12	
937.000	IRON MOUNTAIN 3.875 17-25 15/11S	1,044,418.36	
500.000	JAGUAR LAND ROVER 6.8750 19-26 15/11S	535,313.63	
800.000	JERROLD FINCO PLC 4.875 20-26 15/01S	891,647.34	
1,300.000	NOMAD FOODS BONDDO 2.50 21-28 24/06S	1,224,847.28	
500.000	OCADO GROUP PLC 3.875 21-26 08/10S	499,258.17	
1,700.000	PINNACLE BID 8.25 23-28 11/10S	1,773,120.88	
800.000	PREMIER FOODS FINANCE 3.5 21-26 15/10S	864,015.26	
900.000	SHERWOOD FINANCING PLC 4.5 21-26 15/11S	832,209.85	
950.000	STONEGATE PUB COMPAN 8.25 20-25 31/07S	1,076,095.61	
900.000	TI AUTOMOTIVE FIN 3.75 21-29 15/04S/04S	826,744.04	
400.000	VIRGIN MEDIA SEC FIN 5.25 19-29 15/05S	430,489.81	
290.000	VIRGIN MEDIA SEC FIN 5 17-27 15/04S	326,698.18	
1,800.000	VMED O2 UK FIN I PLC 4.5 21-31 15/07SS	1,803,211.12	
スウェーデン		6,521,157.51	
400.000	DOMETIC GROUP AB 2.000 21-28 29/09A	349,674.86	
1,100.000	HEIMSTADEN BOSTAD FL.R 21-XX 29/01A	387,268.96	
1,960.000	INTRUM AB 3.5000 19-26 15/07S	1,671,394.59	
700.000	INTRUM AB 4.875 20-25 05/08S	656,447.68	
500.000	INTRUM AB 9.25 22-28 15/03S	458,784.21	
700.000	SAMHALLSBYGGNAD FL.R 21-XX 30/01A	115,135.11	
500.000	VERISURE HOLDING AB 7.125 23-28 01/02S	527,519.43	
1,000.000	VERISURE HOLDING AB 9.25 22-27 15/10S	1,078,007.78	
700.000	VERISURE MIDHOLDING 5.25 21-29 25/01S	670,721.05	
600.000	VOLVO CAR AB 4.25 22-28 31/05A	606,203.84	
変動利付債		66,968,455.61	
ドイツ		5,561,855.86	
1,200.000	BAYER AG FL.R 23-83 25/09A	1,241,807.28	
500.000	CMZB FRANCFORT FL.R 22-32 06/12A	527,681.52	

数量	評価額 ユーロ	数量	評価額 ユーロ
1.400.000	COMMERZBANK AG FL.R 20-99 31/12A		1.356.564,89
500.000	COMMERZBANK AG FL.R 21-31 29/12A		448.283,32
500.000	DEUTSCHE BANK AG FL.R 20-31 19/05A		507.189,43
200.000	DEUTSCHE BANK AG FL.R 21-49 31/12A		166.725,75
800.000	DEUTSCHE BANK AG FL.R 21-XX 30/04A2A		658.507,56
600.000	IHO VERWALTUNGS FL.R 23-28 15/05S		655.096,11
	ベルギー		1.193.189,29
600.000	KBC GROUPE SA FL.R 23-49 31/12S		638.627,14
600.000	KBC GROUP NV FL.R 18-XX 24/04S		554.562,15
	スペイン		8.581.432,42
800.000	ABANCA CORP BANCA FL.R 21-49 31/12Q		759.988,97
400.000	BANCO BILBAO FL.R 19-XX 29/09Q		399.444,35
1.000.000	BANCO DE BADELL FL.R 23-XX 18/04Q		1.071.383,38
700.000	BANCO DE CREDIT FL.R 22-26 22/09A		729.097,42
1.100.000	BANCO DE CREDITO SOC FL.R 23-29 14/09A		1.155.744,98
1.200.000	BANCO SANTANDER SA FL.R 20-XX 14/01A		1.108.068,66
1.600.000	BBVA FL.R 23-XX 21/09Q		1.736.748,60
600.000	CAIXABANK SA FL.R 18-XX 23/03Q		559.391,72
1.000.000	CAIXABANK SA FL.R 23-49 31/12Q		1.061.564,34
	フランス		14.698.205,81
2.000.000	BNP PARIBAS FL.R 22-99 31/12S		2.076.603,00
1.800.000	CREDIT AGRICOLE FL.R 23-XX 23/03Q		1.909.865,97
2.500.000	EDF FL.R 13-XX 29/01S		2.815.695,69
2.600.000	EDF FL.R 22-XX 06/12A		2.846.726,01
1.400.000	ELECTRICITE DE FL.R 20-XX 15/09A		1.230.028,70
600.000	LA BANQUE POSTALE FL.R 19-XX 20/05S		538.854,24
1.440.000	LOUVRE BIDCO SAS FL.R 23-27 15/02Q		1.261.792,96
600.000	RCI BANQUE SA FL.R 19-30 18/02A		583.215,58
900.000	TOTALENERGIES SE FL.R 21-XX 25/01A		807.429,63
700.000	VEOLIA ENVIRONNEMENT FL.R 20-XX 20/04A4A		627.994,03
	ギリシャ		4.247.894,91
2.300.000	ALPHA BANK AE FL.R 23-29 27/06A		2.450.385,78
800.000	EFG EUROBANK FL.R 23-29 26/01A		865.059,96
900.000	EFG EUROBANK SA FL.R 23-29 28/11A		932.449,17
	アイルランド		1.234.821,88
860.000	AIB GROUP PLC FL.R 19-XX 09/04S		850.900,90
400.000	AIB GROUP PLC FL.R 20-31 30/09A		383.920,98
	イタリア		10.279.113,37
600.000	BANCA POPOLARE FL.R 22-33 20/01A		655.682,49
3.000.000	BANCO BPM SPA FL.R 20-31 14/01A		2.933.245,35
300.000	BANCO BPM SPA FL.R 22-28 21/01A		314.632,41
790.000	BPER BANCA S.P.A. FL.R 23-29 11/09A		818.014,68
900.000	ENEL FL.R 23-XX 16/07A		942.349,46
400.000	INTESA SANPAOLO FL.R 20-49 31/12S		371.818,09
1.150.000	INTESA SANPAOLO FL.R 23-XX 07/03S		1.267.572,34
1.000.000	UNICREDIT SPA FL.R 17-XX 03/06S		981.889,63
1.990.000	UNIPOLSAI SPA FL.R 14-XX 18/06A		1.993.908,92
	日本		810.345,07
1.200.000	RAKUTEN GROUP INC FL.R 21-XX 21/04A		810.345,07
	ルクセンブルク		1.550.142,33
1.700.000	SES SA FL.R 21-XX 27/08A		1.550.142,33
	ノルウェー		853.280,76
800.000	VAR ENERGI A FL.R 23-83 15/11A		853.280,76
	オランダ		9.139.868,97
1.500.000	ABERTIS FINANCE BV 3.248 20-XX 24/02A		1.442.742,06
300.000	KPN 6.00 PE FL.R 22-XX 21/12		311.257,38
200.000	RABOBANK FL.R 20-XX 29/06S		187.727,35
1.600.000	RABOBANK FL.R 22-XX 29/06S		1.448.014,18
1.800.000	TELEFONICA EUROPE BV FL.R 13-XX 22/09A		1.748.335,01
2.400.000	TELEFONICA EUROPE BV FL.R 22-XX 23/11A		2.597.111,14
600.000	TELEFONICA EUROPE BV FL.R 23-99 31/12A		642.175,72
700.000	VOLKSWAGEN INTL FIN FL.R 23-99 31/12A		762.506,13
	ポルトガル		2.951.551,64
900.000	EDP SA FL.R 21-82 14/03ALR 21-82 14/03A		760.420,43
900.000	ENERGIAS DE PORTUGAL FL.R 21-81 02/08A		839.781,16
1.300.000	ENERGIAS DE PORTUGAL FL.R 23-83 23/04A		1.351.350,05
	イギリス		4.236.223,19
500.000	BRITISH TELECOM FL.R 23-83 20/12A		610.564,57
500.000	HSBC HOLDINGS PLC FL.R 23-99 31/12S		469.280,67
1.530.000	VODAFONE GROUP PLC FL.R 18-78 03/10A		1.382.281,25
1.500.000	VODAFONE GROUP PLC FL.R 20-80 27/08A/08A		1.345.038,56
400.000	VODAFONE GROUP PLC FL.R 23-84 30/08A		429.058,14
	スウェーデン		908.013,97
500.000	CASTELLUM AB FL.R 21-XX 02/03A		380.784,48
1.510.000	HEIMSTADEN BOSTAD FL.R 21-XX 01/05A		527.229,49
	スイス		722.516,14
800.000	JULIUS BAER GRUPPE AG FL.R 23-XX 15/08S		722.516,14
	投資証券		6.623.876,45
	フランス		6.623.876,45
49	AMUNDI EURO LIQUIDITY SHT TERM SRI Z C		5.027.532,27
2	AMUNDI EURO LIQUIDITY SRI PART Z C		1.596.344,18
	合計		232.740.340,27

■外国為替先物契約（2023年12月31日現在）
 (IH3シェアクラス、豪ドル)

買 建	契 約 額	売 建	契 約 額	満 期 日	評 価 損 益 ユーロ
オーストラリアドル	163,300,000.00	ユーロ	98,483,249.40	2024/2/2	2,365,722.31
				合計	2,365,722.31

(IH7シェアクラス、南アフリカランド)

買 建	契 約 額	売 建	契 約 額	満 期 日	評 価 損 益 ユーロ
南アフリカランド	21,370,000.00	ユーロ	1,035,585.30	2024/2/2	17,992.77
南アフリカランド	500,000.00	ユーロ	24,218.93	2024/2/2	431.94
南アフリカランド	200,000.00	ユーロ	9,950.76	2024/2/2	△ 90.41
				合計	18,334.30

ストラクチュラ-欧州ハイ・イールド・ボンド-ブラジルリアル

決算日 2023年12月31日

(計算期間：2023年1月1日～2023年12月31日)

作成時点において、入手可能な直前計算期間の年次報告書をもとに委託会社が翻訳・抜粋・作成しています。
 なお、開示情報につきましては各クラス別の情報がないため、全てのシェアクラスを含むファンド全体の情報を開示しています。

■費用の明細 (2023年1月1日～2023年12月31日)

項目	当期
	円
(a)運用報酬	43,448,305
(b)管理費用等	9,479,622
(c)その他の費用	20,362,101
合計	73,290,028

■純資産計算書 (2023年12月31日現在)

項目	当期末
	円
資産合計	7,950,398,418
有価証券	7,613,619,879
預金	106,962,322
未収利息	113,131,304
為替予約取引評価勘定	66,929,591
スワップ取引評価勘定	49,163,255
為替未収入金	592,067
負債合計	207,539,900
未払配当金	94,789,867
未払解約金	105,644,000
先物取引評価勘定	2,609,316
未払運用報酬	3,532,272
未払管理費用	770,677
未払税	193,768
純資産	7,742,858,518

■ 有価証券明細 (2023年12月31日現在)

数量	評価額 円	数量	評価額 円
債券	5,277,492,853		
ドイツ	524,732,435	フィンランド	31,901,346
300.000 CHEPLAPHARM ARZ 7.5000 23-30 15/05S	49,855,257	100.000 HUHTAMAKI OY 4.25 22-27 09/06A	15,646,264
100.000 CHEPLAPHARM ARZNEIMI 4.375 20-28 15/10S	15,234,312	100.000 HUHTAMAKI OYJ 5.1250 23-28 24/11A	16,255,082
200.000 DEUTSCHE LUFTHANSA 2.875 21-27 16/05A	30,026,837	フランス	1,059,069,818
400.000 DEUTSCHE LUFTHANSA 3.20-26 29/05A	60,780,811	100.000 AFFLELOU SAS 4.25 21-26 19/05S	15,544,707
200.000 GRUENENTHAL GMBH 3.625 21-26 05/05S	30,799,418	100.000 AIR FRANCE - KLM 7.25 23-26 31/05A	16,647,940
300.000 GRUENENTHAL GMBH 4.125 21-28 05/05S	46,300,187	100.000 AIR FRANCE - KLM 8.125 23-28 31/05A	17,714,806
120.000 HT TROPLAST 9.375 23-28 15/07S	19,042,279	400.000 ALTICE FRANCE SA 3.375 19-28 15/01S	49,575,593
200.000 IHO VERWALTUNGS 3.75 16-26 15/09S	30,795,330	100.000 ATOS SE 1.7500 18-25 07/05A	11,959,016
200.000 IHO VERWALTUNGS 3.875 19-27 15/05S	30,568,054	100.000 ATOS SE 1 21-29 12/11A	8,507,157
200.000 NIDDA HEALTHCARE HOLDI 7.5 22-26 21/08S	32,158,050	100.000 ATOS SE 2.5000 18-28 07/11A	9,537,158
200.000 NOVELIS SHEET INGOT 3.375 21-29 15/04S	29,443,561	140.000 BANIJAY ENTERTAINMENT 7.00 23-29 01/05S	23,057,895
200.000 TECHEM VERVAL 675 2.00 20-25 15/07S	30,530,742	100.000 BANIJAY GROUP SAS 6.5 20-26 11/02S	15,583,023
200.000 TK ELEVATOR MIDCO 4.375 20-27 15/07S/07S	30,186,952	230.000 CAB SELAS 3.375 21-28 09/02S	31,985,578
100.000 ZF FINANCE GMBH 2.25 21-28 03/05S	14,338,392	200.000 CGG 7.75 21-27 01/04S	28,839,807
300.000 ZF FINANCE GMBH 2.75 20-27 25/11A	44,539,773	110.000 CHROME BIDCO SAS 3.5 21-28 24/05S	14,390,766
200.000 ZF FINANCE GMBH 3.75 20-28 21/09A	30,132,480	200.000 CONSTELLUM SE 3.125 21-29 02/06S	28,702,349
オーストリア	29,974,997	390.000 CONSTELLUM SE 4.25 17-26 15/02S	60,561,203
200.000 SAPPY PAPIER HOLDING 3.625 21-28 24/03S	29,974,997	200.000 CROWN EUROPEAN HLDG 5.00 23-28 15/05S	32,372,506
ベルギー	21,025,120	100.000 ELIOR GROUP SA 3.75 21-26 08/07S	14,440,023
130.000 AZELIS GROUP 5.75 23-28 15/03S	21,025,120	200.000 FONCIA MANAGEMENT SA 3.375 21-28 25/03S	26,851,684
スペイン	310,741,727	120.000 FONCIA MANAGEMENT SA 7.750 23-28 31/03S	18,179,033
400.000 BANCO DE SABADELL SA 2.5 21-31 15/01A	59,121,249	200.000 FORVIA 2.375 19-27 15/06S	29,539,197
200.000 BANKINTER SA 7.3750 23-49 31/12Q	31,667,844	100.000 FORVIA 3.125 19-26 15/06S	15,297,174
300.000 CELLNEX FINANCE CO 1.0000 21-27 15/09A	42,841,071	300.000 FORVIA 3.75 20-28 31/07S	45,892,863
300.000 CELLNEX FINANCE CO SA 1.5 21-28 08/06A	42,876,299	100.000 GETLINK SE 3.5 20-25 30/10S	15,459,975
300.000 GRIFOLS ESCROW 3.8750 21-28 15/10S	42,879,791	120.000 GOLDSTORY SAS 5.375 21-26 04/02S	18,657,920
600.000 LORCA TELECOM BONDCO 4.20-27 30/09S	91,355,473	400.000 ILIAD HOLDING 5.125 21-26 15/10S	62,248,653
アメリカ	532,841,111	200.000 ILIAD HOLDING 5.625 21-28 15/10S	31,350,598
14.945 ADIENT GLOBAL HLDG 3.5 16-24 15/08S	2,312,292	110.000 IM GROUP SAS 8.0 23-28 01/03S	13,551,849
200.000 BELDEN INC 3.875 18-28 15/03S	30,254,298	300.000 KAPLA HOLDING SAS 3.375 19-26 15/12S/12S	45,369,229
200.000 CARNIVAL CORP 7.625 20-26 01/03S	31,740,635	200.000 LOXAM SAS 3.75 19-26 15/07S	30,885,171
200.000 COTY INC 5.75 23-28 15/09A	32,867,111	200.000 LOXAM SAS 6.3750 23-28 15/05S	32,536,332
200.000 ENCORE CAPITAL GROUP 4.25 21-28 01/06S	30,987,591	100.000 LOXAM SAS 6.375 23-29 31/05S	16,165,877
200.000 FORD MOTOR CREDIT 3.25 20-25 15/09A	30,797,764	100.000 MOBILUX FINANCE 4.25 21-28 15/07S	14,198,698
300.000 FORD MOTOR CREDIT 4.867 23-27 03/08A	48,085,197	100.000 NEXANS 5.5 23-28 05/04A	16,562,803
200.000 GTCR W DUT/W-2 8.5000 23-31 15/01S	39,011,122	200.000 PAPREC HOLDING SA 3.5 21-28 02/07S	30,101,220
100.000 INTL GAME TECHNOLOGY 2.375 19-28 15/04A	14,514,911	100.000 PAPREC HOLDING SA 6.50 23-27 17/11S	16,681,759
300.000 IQVIA INC 2.25 19-28 15/01S	44,008,227	200.000 PICARD GROUPE 3.875 21-26 07/07S	30,462,192
200.000 IQVIA INC 2.875 20-28 24/06S	29,778,846	100.000 RENAULT SA 2.0000 18-26 28/09A	14,889,629
150.000 OLYMPUS WATER US HOL 9.625 23-28 15/11S	25,117,793	100.000 RENAULT SA 2.5 21-28 01/04A	14,966,966
400.000 ORGANON COMPANY 2.875 21-28 22/04S	57,348,202	120.000 REXEL SA 2.1250 21-28 15/12S	17,446,710
300.000 PANTHER BF AGGREGATOR 4.375 19-26 15/05S	46,449,402	100.000 REXEL SA 5.25 23-30 15/09S	16,272,189
100.000 SCIL IV LLC SCIL USA 9.5 23-28 15/07A	16,674,581	200.000 SECHE ENVIRONNEMENT 2.25 21-28 15/11S	28,066,802
150.000 SPECTRUM BRANDS 4.00 16-26 01/10S	23,139,274	200.000 SPCM SA 2.6250 20-29 01/02S	28,701,583
200.000 WMG ACQUISITION 2.75 20-28 15/07S	29,753,865	200.000 TEREOS FINANCE GROUP 7.25 23-28 15/04S	33,110,246
		100.000 VALEO SA 5.375 22-27 28/05A	16,203,939
		ケイマン諸島	14,939,580
		100.000 UPCB FINANCE VII LTD 3.625 17-29 15/06S	14,939,580
		アイルランド	114,793,133
		600.000 DOLYA HOLDCO 4.875 20-28 15/07S	99,608,167

数量	評価額 円	数量	評価額 円
100.000 EIRCOM FINANCE DAC 3.5 19-26 15/05S	15,184,966	200.000 TEVA PHARMA 1.875 15-27 31/03A	28,462,089
マン島	29,569,417	260.000 TEVA PHARMACEUTICAL 3.75 21-27 09/05S	39,160,339
190.000 PLAYTECH PLC 5.8750 23-28 28/06S	29,569,417	190.000 TEVA PHARMACEUTICAL 7.375 23-29 15/09S	32,428,017
イタリア	462,220,924	100.000 TEVA PHARMACEUTICAL I 4.375 21-30 09/05S	14,669,262
150.000 BANCO BPM 6.00 23-28 14/06A	24,499,151	130.000 UNITED GROUP BV 5.25 22-30 01/02S	19,213,845
100.000 DOVALUE SPA 3.375 21-26 31/07S	14,084,120	200.000 WINTERSHALL DEA FIN 2.4985 21-99 31/12A	28,405,701
200.000 FIBER BIDCO 11.00 22-27 25/10S	34,101,271	100.000 WINTERSHALL DEA FINA 3.5 21-99 31/12A	13,638,118
240.000 GAMENET GROUP 7.125 23-28 01/06S	39,522,627	450.000 WPI/AP TELECOM H 3.7500 21-29 15/01S	66,672,140
300.000 IMA SPA 3.75 20-28 15/01S5 20-28 29/12S	43,720,376	100.000 WPI/AP T HLD IV 5.50 21-30 15/01S	14,264,054
170.000 INTERNATIONAL DESIGN 10.00 23-28 15/11S	27,571,792	100.000 ZF EUROPE FINANCE BV 3 19-29 23/10A0A	14,379,391
100.000 INTESA SANPAOLO 2.9250 20-30 14/10A	14,228,328	200.000 ZF EUROPE FINANCE BV 6.125 23-29 13/03A	33,169,663
100.000 ITALMATCH CHEMICALS SP 10.0 23-28 06/02S	16,116,904	500.000 ZIGGO BOND CO BV 3.375 20-30 28/02SS	65,988,494
100.000 LOTTOMATICA SPA 9.7500 22-27 30/09S	16,895,972	ポーランド	57,868,961
400.000 NEXI SPA 2.125 21-29 30/04S/04S	55,172,631	100.000 CANPACK SA 2.375 20-27 01/11S	14,329,525
200.000 SPACEA GUALA CLOSURES 3.25 21-28 15/06S	29,402,051	300.000 INPOST SA 2.25 21-27 15/07S06S	43,539,436
200.000 TELECOM ITALIA SPA 2.375 17-27 12/10A	29,174,256	イギリス	739,919,244
500.000 TELECOM ITALIA SPA 6.875 23-28 15/02S	83,046,375	200.000 ALLWYN ENTERT FINAN 7.25 23/30 30-04S	32,867,647
200.000 TELECOM ITALIA SPA 7.875 23-28 31/07S	34,685,070	270.000 AVIS BUDGET FINANCE 4.75 18-26 04/10S	42,074,843
日本	74,835,375	300.000 AVIS BUDGET FINANCE 7.25 23-30 31/07S	50,187,351
300.000 SOFTBANK GROUP 5.00 18-28 15/04S	46,432,950	100.000 B&M EUROPEAN VALUE 8.125 23-30 15/11A	19,151,215
200.000 SOFTBANK GROUP CORP 4 17-29 19/09S19/09S	28,402,425	300.000 BCP V MOD SERV FIN II 4.75 21-28 30/1S	43,476,495
ルクセンブルク	338,828,441	300.000 BELLIS ACQUISITION 3.25 21-26 16/02S	50,120,951
200.000 ALTICE FINANCING S.A 3 20-28 22/01S	27,899,071	100.000 DEUCE FINCO PLC 5.5 21-27 18/06S	16,819,676
180.000 ARAMARK INTL FINANCE 3.125 17-25 01/04S	27,942,479	200.000 EC FINANCE PLC 3.0000 21-26 15/10S	30,147,080
200.000 ARENA LUXEMBOURG 1.875 20-28 01/02S	27,914,402	230.000 INEOS QUATTRO FINANC 3.5 21-26 29/01S	34,655,907
100.000 BK LC LUX FINCO 1 5.25 21-29 30/04S/04S	15,529,523	390.000 IRON MOUNTAIN 3.875 17-25 15/11S	67,698,915
200.000 CIDRON AIDA FINCO SA 5 21-28 01/04S	30,081,677	200.000 JAGUAR LAND ROVER 4.50 18-26 15/01S	31,266,079
400.000 CIRSA FINANCE INT 4.7500 19-25 22/05S	62,361,798	100.000 JAGUAR LAND ROVER 6.8750 19-26 15/11S	16,673,257
100.000 CIRSA FINANCE INTE 4.5 21-27 15/03A	15,046,606	100.000 JERROLD FINCO PLC 4.875 20-26 15/01S	17,357,427
100.000 CPI PROPERTY GROUP 4.875 19-XX 16/10A	4,654,136	200.000 NOMAD FOODS BONDCO 2.50 21-28 24/06S	29,346,125
200.000 CPI PROPERTY GROUP FL.R 21-XX 27/07A	7,807,556	100.000 OCADO GROUP PLC 3.875 21-26 08/10S	15,550,249
160.000 DANA FINANCING LUX 8.5 23-31 15/07S	27,358,183	300.000 PINNACLE BID 8.25 23-28 11/10S	48,729,601
170.000 EPHIOS SUBCO S.A R.L. 7.875 23-31 31/01S	27,441,922	100.000 PREMIER FOODS FINANCE 3.5 21-26 15/10S	16,819,521
200.000 HERENS MIDCO SARL 5.25 21-29 15/05S/05S	18,843,857	130.000 SHERWOOD FINANCING PLC 4.5 21-26 15/11S	18,720,433
200.000 PLT VII FINANCE S.A 4.625 20-26 16/07S	30,989,502	200.000 STONEGATE PUB COMPAN 8.25 20-25 31/07S	35,280,882
100.000 SUMMER BC HOLDC 5.75 19-26 31/10S	14,957,729	100.000 SYNTHOMER PLC 3.875 20-25 25/06S	15,427,485
メキシコ	108,968,836	200.000 TI AUTOMOTIVE FIN 3.75 21-29 15/04S/04S	28,611,507
200.000 NEMAK SAB CV 2.25 21-28 20/07A	27,702,216	100.000 VIRGIN MEDIA SEC 4.2500 19-30 15/01S	15,769,163
400.000 PEMEX 2.75 15-27 21/04A	52,530,602	200.000 VMED O2 UK FINANCING 4.0 20-29 31/01S	31,965,160
200.000 PEMEX 3.75 14-26 16/04A	28,736,018	200.000 VMED O2 UK FIN I PLC 4.5 21-31 15/07SS	31,202,275
ノルウェー	62,096,104	スウェーデン	200,259,496
400.000 ADEVINTA ASA 3 20-27 05/11S	62,096,104	100.000 DOMETIC GROUP AB 2.000 21-28 29/09A	13,614,026
オランダ	562,906,788	200.000 HEIMSTADEN BOSTAD FL.R 21-XX 29/01A	10,965,595
200.000 DUFYR ONE B.V. 3.375 21-28 22/04S	29,809,660	200.000 INTRUM AB 3.5000 19-26 15/07S	26,560,430
100.000 DUFYR ONE BV 2.0000 19-27 15/02S	14,611,532	200.000 INTRUM AB 4.875 20-25 05/08S	29,208,835
300.000 ENERGIZER GAMMA ACQU 3.5 21-29 23/06S	40,430,610	200.000 INTRUM AB 9.25 22-28 15/03S	28,579,237
400.000 NATURGY FINANCE 2.3740 21-49 31/12A	56,933,408	200.000 SAMHALLSBYGGNAD FL.R 21-XX 30/01A	5,122,972
140.000 OI EUROPEAN GROUP 6.25 23-28 15/05S	22,883,514	200.000 VERISURE HOLDING AB 7.125 23-28 01/02S	32,860,989
100.000 Q PARK HOLDING BV 2.0 20-27 01/03S	14,456,152	140.000 VERISURE HOLDING AB 9.25 22-27 15/10S	23,503,477
100.000 TEVA PHARMA 1.625 16-28 15/10A	13,330,799	200.000 VERISURE MIDHOLDING S 5.25 21-29 25/01S	29,843,935
		変動利付債	2,151,713,950

数量	評価額 円	数量	評価額 円
ドイツ	181,327,409	ルクセンブルク	42,601,618
300,000 BAYER AG FL.R 23-83 25/09A	48,347,764	300,000 SES SA FL.R 21-XX 27/08A	42,601,618
100,000 CMZB FRANCFORT FL.R 22-32 06/12A	16,435,543	ノルウェー	26,576,888
200,000 COMMERZBANK AG FL.R 20-99 31/12A	30,180,380	160,000 VAR ENERGI A FL.R23-83 15/11A	26,576,888
200,000 COMMERZBANK AG FL.R 21-31 29/12A	27,925,101	オランダ	356,799,786
100,000 DEUTSCHE BANK AG FL.R 20-31 19/05A	15,797,283	400,000 ABERTIS FINANCE BV 3.248 20-XX 24/02A	59,915,559
200,000 DEUTSCHE BANK AG FL.R 21-XX 30/04A2A	25,637,930	100,000 KPN 6.00 PE FL.R 22-XX 21/12	16,157,739
100,000 IHO VERWALTUNGS FL.R 23-28 15/05S	17,003,408	400,000 RABOBANK FL.R 22-XX 29/06S	56,376,096
ベルギー	33,151,890	300,000 REPSOL INTL FINANCE FL.R 20-49 31/12A	45,839,419
200,000 KBC GROUPE SA FL.R 23-49 31/12S	33,151,890	400,000 TELEFONICA EUROPE BV FL.R 13-XX 22/09A	60,505,428
スペイン	237,321,625	400,000 TELEFONICA EUROPE BV FL.R 22-XX 23/11A	67,409,555
200,000 ABANCA CORP BANCA FL.R 21-49 31/12Q	29,588,945	100,000 TELEFONICA EUROPE BV FL.R 23-99 31/12A	16,668,050
200,000 BANCO DE BADELL FL.R 23-XX 18/04Q	33,370,067	200,000 VOLKSWAGEN INTL FIN FL.R 23-99 31/12A	33,927,940
100,000 BANCO DE CREDIT FL.R 22-26 22/09A	16,220,703	ポルトガル	87,755,912
200,000 BANCO DE CREDITO SOC FL.R 23-29 14/09A	32,725,140	200,000 EDP SA FL.R 21-82 14/03ALR 21-82 14/03A	26,316,215
200,000 BANCO SANTANDER SA FL.R 20-XX 14/01A	28,760,578	200,000 ENERGIAS DE PORTUGAL FL.R 21-81 02/08A	29,062,690
400,000 BBVA FL.R 23-XX 21/09Q	67,617,507	200,000 ENERGIAS DE PORTUGAL FL.R 23-83 23/04A	32,377,007
200,000 CAIXABANK SA FL.R 18-XX 23/03Q	29,038,685	イギリス	91,579,797
フランス	459,065,021	100,000 BRITISH TELECOM FL.R 23-83 20/12A	19,017,078
400,000 BNP PARIBAS FL.R 22-99 31/12S	64,679,352	400,000 VODAFONE GROUP PLC FL.R 20-80 27/08A/08A	55,858,033
400,000 CREDIT AGRICOLE FL.R 23-XX 23/03Q	66,095,601	100,000 VODAFONE GROUP PLC FL.R 23-84 30/08A	16,704,686
500,000 EDF FL.R 13-XX 29/01S	87,699,657	スウェーデン	22,735,326
400,000 EDF FL.R 22-XX 06/12A	68,204,729	100,000 CASTELLUM AB FL.R 21-XX 02/03A	11,860,184
200,000 ELECTRICITE DE FL.R 20-XX 15/03A	28,935,032	200,000 HEIMSTADEN BOSTAD FL.R 21-XX 01/05A	10,875,142
200,000 ELECTRICITE DE FL.R 20-XX 15/09A	27,365,247	スイス	28,130,000
200,000 LA BANQUE POSTALE FL.R 19-XX 20/05S	27,972,561	200,000 JULIUS BAER GRUPPE AG FL.R 23-XX 15/08S	28,130,000
330,000 LOUVRE BIDCO SAS FL.R 23-27 15/02Q	45,032,050	投資証券	184,413,076
100,000 RCI BANQUE SA FL.R 19-30 18/02A	15,137,706	フランス	184,413,076
200,000 TOTALENERGIES SE FL.R 21-XX 25/01A	27,943,086	10 AMUNDI EURO LIQUIDITY SHT TERM SRI Z C	155,611,391
ギリシャ	132,315,889	1 AMUNDI EURO LIQUIDITY SRI FCP PART Z C	28,801,685
400,000 ALPHA BANK AE FL.R 23-29 27/06A	66,366,483	合計	7,613,619,879
200,000 EFG EUROBANK FL.R 23-29 26/01A	33,679,714		
200,000 EFG EUROBANK SA FL.R 23-29 28/11A	32,269,692		
アイルランド	94,090,038		
200,000 AIB GROUP PLC FL.R 19-29 19/11A	30,296,467		
220,000 AIB GROUP PLC FL.R 19-XX 09/04S	33,898,883		
200,000 AIB GROUP PLC FL.R 20-31 30/09A	29,894,688		
イタリア	337,229,764		
200,000 BANCA POPOLARE FL.R 22-33 20/01A	34,037,254		
100,000 BANCO BPM FL.R 21-31 29/06A	14,784,055		
400,000 BANCO BPM SPA FL.R 20-31 14/01A	60,907,295		
150,000 BANCO BPM SPA FL.R 22-28 21/01A	24,499,411		
170,000 BPER BANCA S.P.A. FL.R 23-29 11/09A	27,413,540		
250,000 INTESA SANPAOLO FL.R 23-XX 07/03S	42,913,814		
250,000 UNICREDIT SPA FL.R 17-XX 03/06S	38,228,288		
200,000 UNICREDIT SPA FL.R 19-29 23/09A	30,469,932		
410,000 UNIPOLSAI SPA FL.R 14-XX 18/06A	63,976,175		
日本	21,032,987		
200,000 RAKUTEN GROUP INC FL.R 21-XX 21/04A	21,032,987		

■外国為替取引 [N D F] (2023年12月31日現在)

買 建	契 約 額	売 建	契 約 額	満 期 日	評 価 損 益 円
ブラジルリアル	274,193,638.50	ユーロ	50,500,000.00	2024/2/2	69,207,283
				合計	69,207,283

C A 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17期》

決算日：2024年2月15日

（計算期間：2023年2月16日～2024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。

■投資対象ファンドの概要

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	純資産総額
		税込み 分配金	期中 騰落率		
	円	円	%	%	百万円
13期（2020年2月17日）	10,048	0	△0.1	61.1	788
14期（2021年2月15日）	10,042	0	△0.1	64.6	773
15期（2022年2月15日）	10,035	0	△0.1	70.8	552
16期（2023年2月15日）	10,027	0	△0.1	74.3	473
17期（2024年2月15日）	10,020	0	△0.1	70.8	495

（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		債券組入 比 率
		騰 落 率	
(期 首) 2023年2月15日	円	%	%
	10,027	—	74.3
2月末	10,027	0.0	74.3
3月末	10,027	0.0	71.0
4月末	10,027	0.0	72.1
5月末	10,027	0.0	73.6
6月末	10,027	0.0	73.9
7月末	10,026	△0.0	75.4
8月末	10,026	△0.0	65.4
9月末	10,025	△0.0	67.0
10月末	10,024	△0.0	65.9
11月末	10,020	△0.1	69.2
12月末	10,020	△0.1	71.6
2024年1月末	10,020	△0.1	74.6
(期 末) 2024年2月15日	10,020	△0.1	70.8

(注) 騰落率は期首比です。

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	第 17 期 (2023年2月16日 ～2024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)	1円 (1) (0) (0)	0.011% (0.009) (0.001) (0.002)	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 (そ の 他)	1 (1)	0.012 (0.012)	その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 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	2	0.023	

期中の平均基準価額は10,024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。

■ 売買及び取引の状況（2023年2月16日から2024年2月15日まで）

公社債

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国 内	地 方 債 証 券	351,475	— (350,000)

(注1) 金額は受渡し代金です。経過利子分は含まれていません。

(注2) 単位未満は切捨てです。

(注3) ()内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

■ 主要な売買銘柄（2023年2月16日から2024年2月15日まで）

公社債

銘 柄	買 付	売 付	
	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
第139回共同発行市場公募地方債	150,810		
第134回共同発行市場公募地方債	100,353	—	—
第137回共同発行市場公募地方債	50,289		
第11回政府保証地方公共団体金融機構債券（4年）	50,023		

(注1) 金額は受渡し代金です。経過利子分は含まれていません。

(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いません。

■利害関係人との取引状況等（2023年2月16日から2024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（2024年2月15日現在）

公社債

(A) 債券種類別開示

国内（邦貨建）公社債

区 分	2024 年 2 月 15 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	350,000	350,832	70.8	—	—	—	70.8
合 計	350,000	350,832	70.8	—	—	—	70.8

（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います。

(B) 個別銘柄開示

国内（邦貨建）公社債

種 類	銘 柄	2024 年 2 月 15 日 現 在			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
地 方 債 証 券	第134回共同発行市場公募地方債	0.674	100,000	100,178	2024/5/24
	第137回共同発行市場公募地方債	0.566	50,000	50,143	2024/8/23
	第139回共同発行市場公募地方債	0.544	150,000	150,511	2024/10/25
	第11回政府保証地方公共団体金融機構債券（4年）	0.001	50,000	50,000	2024/8/28
合 計			350,000	350,832	

（注）額面・評価額の単位未満は切捨てです。

■投資信託財産の構成（2024年2月15日現在）

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公 社 債	350,832	70.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	144,454	29.2
投 資 信 託 財 産 総 額	495,286	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

2024年2月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	495,286,649円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	143,608,953
公 社 債(評価額)	350,832,500
未 収 利 息	452,737
前 払 費 用	392,459
(B) 負 債	59,852
未 払 信 託 報 酬	53,488
未 払 利 息	424
そ の 他 未 払 費 用	5,940
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	495,226,797
元 本	494,224,101
次 期 繰 越 損 益 金	1,002,696
(D) 受 益 権 総 口 数	494,224,101口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額 (C / D)	10,020円

(注記事項)

期首元本額	472,090,843円
期中追加設定元本額	134,248,238円
期中一部解約元本額	112,114,980円

■損益の状況

当期 自2023年2月16日 至2024年2月15日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	1,811,835円
受 取 利 息	1,905,211
支 払 利 息	△ 93,376
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 2,019,533
売 買 益	146,041
売 買 損	△ 2,165,574
(C) 信 託 報 酬 等	△ 113,341
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	△ 321,039
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 683,574
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	2,007,309
(配 当 等 相 当 額)	(17,080,817)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△15,073,508)
(G) 計 (D + E + F)	1,002,696
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)	1,002,696
追 加 信 託 差 損 益 金	2,007,309
(配 当 等 相 当 額)	(17,080,817)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△15,073,508)
分 配 準 備 積 立 金	6,793,356
繰 越 損 益 金	△ 7,797,969

(注1) (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) (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。