

■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／内外／資産複合	
信託期間	2019年8月23日から2029年7月25日までです。	
運用方針	「Amundi Funds インカム・オポチュニティーズ」への投資を通じて、主として世界の株式・債券等へ実質的に投資を行い、インカムゲインの確保と投資信託財産の中長期的な成長を図ることを目的として運用を行います。また、「C A マネーパブルファンド（適格機関投資家専用）」にも投資を行います。組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。	
主要運用対象	アムンディ・みらい定期便	Amundi Funds インカム・オポチュニティーズ C A マネーパブルファンド（適格機関投資家専用）
	Amundi Funds インカム・オポチュニティーズ	世界の株式と債券等
	C A マネーパブルファンド（適格機関投資家専用）	本邦通貨表示の短期公社債
組入制限	株式への直接投資は行いません。投資信託証券への投資割合には制限を設けません。外貨建資産への投資割合には制限を設けません。	
分配方針	毎決算時（年12回、原則毎月25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、繰越分も含めた経費控除後の配当等収益および売買益（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があります。留保益の運用については特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。	

アムンディ・みらい定期便

運用報告書(全体版) 第10作成期

第54期	(決算日 2024年2月26日)
第55期	(決算日 2024年3月25日)
第56期	(決算日 2024年4月25日)
第57期	(決算日 2024年5月27日)
第58期	(決算日 2024年6月25日)
第59期	(決算日 2024年7月25日)

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚くお礼申し上げます。

当ファンドはこの度、上記の決算を行いました。ここに作成期中の運用状況についてご報告申し上げます。

今後とも一層のお引き立てを賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

アムンディ・ジャパン株式会社
〒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/>

■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	期 騰 落 率			
		円	円	%	%	%	百万円
第6 作成期	30期 (2022年2月25日)	12,151	35	△0.4	0.0	98.7	14,295
	31期 (2022年3月25日)	12,935	35	6.7	0.0	98.0	15,612
	32期 (2022年4月25日)	13,501	35	4.6	0.0	98.0	17,337
	33期 (2022年5月25日)	13,062	35	△3.0	0.0	98.3	18,339
	34期 (2022年6月27日)	13,245	35	1.7	0.0	97.8	20,338
	35期 (2022年7月25日)	13,381	50	1.4	0.0	98.4	22,077
第7 作成期	36期 (2022年8月25日)	13,973	50	4.8	0.0	98.0	25,633
	37期 (2022年9月26日)	13,581	50	△2.4	0.0	98.5	28,049
	38期 (2022年10月25日)	14,271	50	5.4	0.0	98.3	32,233
	39期 (2022年11月25日)	14,082	50	△1.0	0.0	98.1	34,579
	40期 (2022年12月26日)	13,467	50	△4.0	0.0	98.1	35,999
	41期 (2023年1月25日)	13,709	55	2.2	0.0	98.3	38,860
第8 作成期	42期 (2023年2月27日)	14,088	55	3.2	0.0	98.2	43,321
	43期 (2023年3月27日)	13,001	55	△7.3	0.0	97.9	43,942
	44期 (2023年4月25日)	13,743	55	6.1	0.0	98.5	49,206
	45期 (2023年5月25日)	14,076	55	2.8	0.0	98.3	53,943
	46期 (2023年6月26日)	14,474	55	3.2	0.0	98.1	60,625
	47期 (2023年7月25日)	14,653	55	1.6	0.0	98.5	65,751
第9 作成期	48期 (2023年8月25日)	14,884	55	2.0	0.0	98.3	71,175
	49期 (2023年9月25日)	15,207	55	2.5	0.0	97.9	77,728
	50期 (2023年10月25日)	15,018	55	△0.9	0.0	98.7	81,902
	51期 (2023年11月27日)	15,243	55	1.9	0.0	98.7	86,842
	52期 (2023年12月25日)	14,785	55	△2.6	0.0	98.5	89,123
	53期 (2024年1月25日)	15,302	55	3.9	0.0	99.0	93,816
第10 作成期	54期 (2024年2月26日)	15,660	55	2.7	0.0	99.0	96,983
	55期 (2024年3月25日)	16,022	55	2.7	0.0	98.9	99,677
	56期 (2024年4月25日)	16,375	55	2.5	0.0	98.9	103,888
	57期 (2024年5月27日)	16,664	55	2.1	0.0	98.5	107,835
	58期 (2024年6月25日)	16,814	55	1.2	0.0	98.7	111,083
	59期 (2024年7月25日)	16,439	60	△1.9	0.0	98.6	110,923

(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。

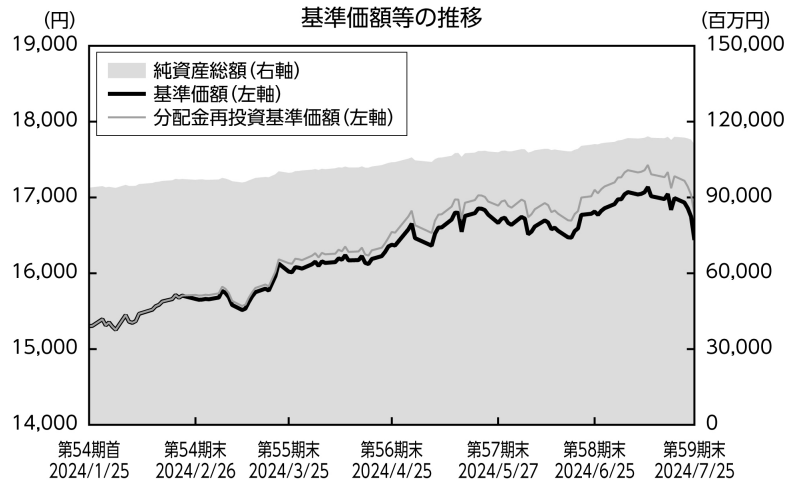
■ 当作成期中の基準価額等の推移

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54期	(期 首) 2024年1月25日	15,302	—	0.0	99.0
	1月末	15,352	0.3	0.0	99.0
	(期 末) 2024年2月26日	15,715	2.7	0.0	99.0
第55期	(期 首) 2024年2月26日	15,660	—	0.0	99.0
	2月末	15,661	0.0	0.0	99.0
	(期 末) 2024年3月25日	16,077	2.7	0.0	98.9
第56期	(期 首) 2024年3月25日	16,022	—	0.0	98.9
	3月末	16,061	0.2	0.0	98.7
	(期 末) 2024年4月25日	16,430	2.5	0.0	98.9
第57期	(期 首) 2024年4月25日	16,375	—	0.0	98.9
	4月末	16,579	1.2	0.0	99.0
	(期 末) 2024年5月27日	16,719	2.1	0.0	98.5
第58期	(期 首) 2024年5月27日	16,664	—	0.0	98.5
	5月末	16,638	△0.2	0.0	98.7
	(期 末) 2024年6月25日	16,869	1.2	0.0	98.7
第59期	(期 首) 2024年6月25日	16,814	—	0.0	98.7
	6月末	16,858	0.3	0.0	98.9
	(期 末) 2024年7月25日	16,499	△1.9	0.0	98.6

(注) 期末基準価額は当該期の分配金込み、騰落率は各期首比です。

【基準価額等の推移】

第54期首	15,302円
第59期末	16,439円
既払分配金 (税込み)	335円
騰落率	9.7% (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、2024年1月25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 おおむね当作成期を通じて株式相場が上昇し、金融、エネルギー、情報技術、ヘルスケア等のセクターで多くの株式が貢献したこと
- ② おおむね当作成期を通じて、高いインカムと参照する株価の上昇により、多くのエクイティリンク債が貢献したこと
- ③ 当作成期後半に、金利低下や落ち着いたクレジット市場の中、インカムや価格上昇により、資産担保証券、社債、新興国債券等の様々な債券が貢献したこと

下落要因

- ① おおむね当作成期を通じて、株式市場が堅調だったことから、株式先物によるヘッジポジションがマイナスとなったこと

上記は、当ファンドの主要投資対象である「Amundi Funds インカム・オポチュニティーズ」の要因を記載しております。当ファンドは、「Amundi Funds インカム・オポチュニティーズ」への投資を米ドル建てのシェアクラスを通じて行い、原則として為替ヘッジを行っていません。米ドルが円に対して上昇した場合は、当ファンドの基準価額の上昇要因となり、米ドルが円に対して下落した場合は下落要因となります。

【投資環境】**<株式・債券市場等>**

当作成期の株式市場は上昇しましたが、市場センチメントが様々な要因の影響を受けて、スタイル、市場、地域などによってばらつきのある結果となりました。今後の金利とインフレの先行きが不透明であることから、投資家は世界の経済指標を注視しました。また、地政学的リスクの高まりは、多くの地域で株価へマイナスの影響をもたらしました。米国では、消費者物価指数と生産者物価指数がともにインフレの低下傾向を示しました。その一方で、経済全体の健全性に対する懸念が広がり始めました。また、市場ではAI（人工知能）への関心が急速に高まったことにより、投資家はバリュエーションに対する懸念を考慮することなく半導体関連銘柄等の一部のグロース株を選好しました。こうした状況を背景に、S&P時価総額加重指数がS&P均等加重指数をアウトパフォームするという極端に集中が進んだ相場となりました。欧州では、年初は経済活動が予想を上回ったものの、当作成期末にかけて、サービス業と製造業のPMI（購買担当者景気指数）が示すように企業活動が減速したため、株式市場の重しとなりました。また、日本の株式市場も、日銀の金融政策正常化の方向性をめぐる投資家の思惑が広がる環境下、年明けは堅調だった投資家の意欲が当作成期が進むにつれて影響を受けたことから、同様に推移しました。債券市場では、多くの市場で、当作成期前半は利回りが上昇（債券価格は下落）しましたが、後半は利回りが低下（債券価格は上昇）しました。クレジットスプレッド（国債との利回り格差）はおおむね落ち着いた動きで、ほとんどの債券市場のパフォーマンスはプラスとなりました。

<為替市場>

当作成期の米ドル／円相場は147円台で始まり、前作成期から上昇基調を維持するなか、3月に急落する場面がありました。しかしその後発表された米国のインフレ指標が予想外の伸びを示したことや日銀の金融緩和策修正が決定されたものの、日銀の引き続き緩和的な政策を維持するとの声明などを受け、米ドル高・円安基調に戻りました。米国の利下げ期待がさらに後退したことに加え、4月の日銀金融政策決定会合後の会見で植田日銀総裁の発言が円安容認と受け止められ、米ドル高・円安の動きは加速しました。しかし当局による為替介入とみられる動きにより、円は対米ドルで小幅反発しましたが、その効果は長続きせず、日米金利差は開いたままという見通しの下、ジリジリと米ドル高・円安が進行し一時161円台となりました。作成期末にかけては、米国の利下げ期待の高まり、当局による為替介入、日銀の追加利上げ観測などを材料に、急激な円高・米ドル安が進行し、153円台で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、TDB（国庫短期証券）3ヵ月物利回りが上昇し、マイナス圏からプラス圏に浮上しました。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、2016年以降マイナス圏での推移が続いてきましたが、2024年3月にマイナス金利政策が解除され、それともなつてTDB 3ヵ月物利回りもプラス圏に浮上しました。

【ポートフォリオ】

<当ファンド>

当ファンドは、米ドル建のルクセンブルク籍投資信託である「Amundi Funds インカム・オポチュニティーズ」を主要投資対象とし、インカムゲインの確保と投資信託財産の中長期的な成長を図ることを目的として運用を行います。当ファンドは、当該投資信託の投資比率を高位とすることを基本としていることから、この運用の基本方針に従い、当作成期を通して当該投資信託を高位に組み入れました。なお、円建の国内籍投資信託である「CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）」にも投資を行いました。

(アムンディ・ジャパン株式会社)

<Amundi Funds インカム・オポチュニティーズ>

当作成期、当ファンドは引き続き幅広い地域、資産クラスから魅力的なインカム獲得機会を柔軟に活用しました。バリュエーションが魅力的ではない低格付社債よりも、インカム獲得において魅力的なエクイティリンク債に引き続き注目しました。また、株式のポジションについては、高水準の金利とインフレという厳しい事業環境でも収益が期待できる企業を引き続き重視しました。当ファンドは、ディフェンシブなポジションを継続し、エクイティリンク債への配分にもなう株式リスクを低減する目的もあり、株式先物によるヘッジを維持しました。また、信用リスクが低く利回りが魅力的な政府系機関発行の資産担保証券への配分を引き上げました。

(アムンディ・アセットマネジメント・US・インク)

<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>

当ファンドが主要投資対象とする「Amundi Funds インカム・オポチュニティーズ」の組入比率を引き続き高位に保ちます。また、「CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）」にも投資を行います。

(アムンディ・ジャパン株式会社)

<Amundi Funds インカム・オポチュニティーズ>

米国および欧州のインフレが鈍化し、企業の業績改善への期待が高まれば、米国の超大型株以外での広範な上昇が持続する可能性があります。このような物色の転換の動きが継続するかどうかは、これら企業の収益成長の強さと経済見通し次第と考えます。当ファンドは、こうした環境においては、市場のファンダメンタルズ（基礎的條件）を見極め、バランスシートが健全で魅力的なバリュエーションの銘柄を選択することが重要だと考えています。現在の当ファンドの見方を踏まえ、当ファンドのポートフォリオは引き続き慎重な姿勢を維持しつつ、インカム獲得を目指して参ります。

(アムンディ・アセットマネジメント・US・インク)

<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54期～第59期 (2024年1月26日 ～2024年7月25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)	71円 (13) (55) (3)	0.438% (0.082) (0.339) (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)	1 (0) (0) (0)	0.004 (0.002) (0.002) (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	72	0.442	

期中の平均基準価額は16,191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。

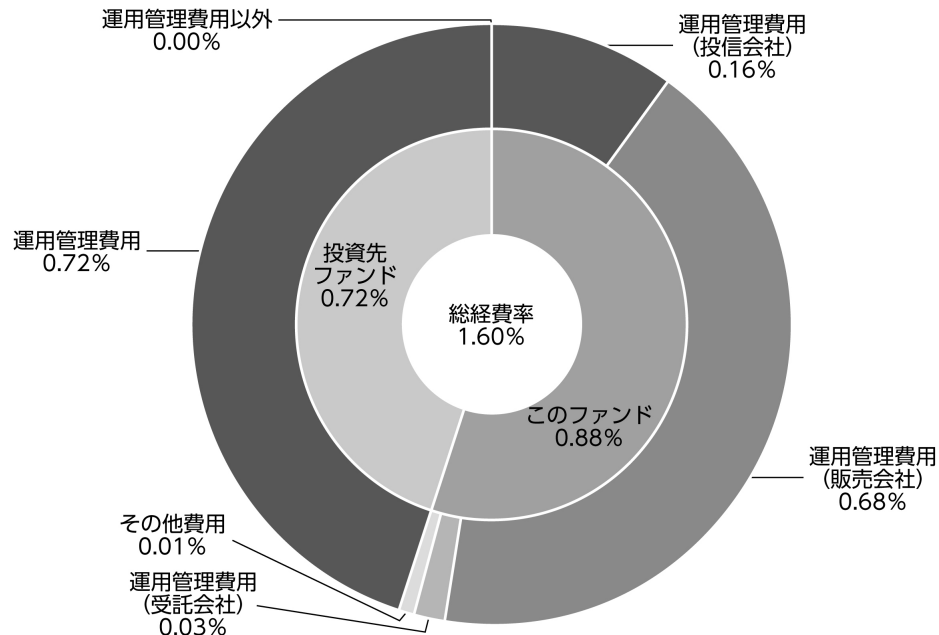
(注4) 各項目の費用は、このファンドが組入れている投資信託証券が支払った費用を含みません。

(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1.60%です。



総経費率 (①+②+③)	1.60%
①このファンドの費用の比率	0.88%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.72%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.00%

(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。

■売買及び取引の状況（2024年1月26日から2024年7月25日まで）

投資信託受益証券、投資証券

決 算 期		第 54 期 ～ 第 59 期			
		買 付		売 付	
		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
外国	(ルクセンブルク)	千口	千米ドル	千口	千米ドル
	Amundi Funds インカム・オポチュニティーズ	60	65,644	1	1,915

(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（2024年1月26日から2024年7月25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7月25日現在）

(1) 国内（邦貨建）投資信託受益証券

銘 柄		第9作成期末 (第53期末)	第10作成期末（第59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)		千口 497	千口 497	千円 498
合 計	口 数・金 額	497	497	498
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	1	<0.0%>

(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。

(2) 外国（外貨建）投資証券

銘 柄		第9作成期末 (第53期末)	第10作成期末（第59期末）		
		口 数	口 数	評 価 額	
				外貨建金額	邦貨換算金額
(ルクセンブルク)		千口	千口	千米ドル	千円
Amundi Funds インカム・オポチュニティーズ		581	640	713,094	109,360,248
合 計	口 数・金 額	581	640	713,094	109,360,248
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	1	-	<98.6%>

(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7月25日現在)

項 目	第10作成期末 (第59期末)	
	評 価 額	比 率
投 資 信 託 受 益 証 券	千円 498	% 0.0
投 資 証 券	109,360,248	97.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	2,327,728	2.1
投 資 信 託 財 産 総 額	111,688,474	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 (109,179,416千円) の投資信託財産総額 (111,688,474千円) に対する比率は97.8%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7月25日現在における邦貨換算レートは、1米ドル=153.36円です。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第54期末	第55期末	第56期末	第57期末	第58期末	第59期末
	(2024年2月26日)	(2024年3月25日)	(2024年4月25日)	(2024年5月27日)	(2024年6月25日)	(2024年7月25日)
(A) 資 産	97,835,035,926円	100,326,700,298円	104,699,387,970円	108,813,196,226円	111,707,163,517円	111,869,278,959円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,815,164,169	1,760,170,805	1,811,533,957	2,323,338,831	2,098,506,898	2,327,726,513
投資信託受益証券(評価額)	498,458	498,358	498,358	498,358	498,508	498,508
投 資 証 券(評価額)	96,019,373,299	98,541,066,246	102,785,087,868	106,271,070,083	109,608,157,537	109,360,248,641
未 収 入 金	-	24,964,407	102,267,539	218,288,318	-	180,804,660
未 収 利 息	-	482	248	636	574	637
(B) 負 債	851,395,522	649,467,890	810,536,555	977,925,850	623,548,560	946,100,526
未 払 金	-	49,986,402	204,395,081	437,342,812	-	363,443,250
未 払 収 益 分 配 金	340,628,676	342,168,294	348,943,803	355,911,214	363,362,047	404,846,809
未 払 解 約 金	436,251,835	189,484,025	178,546,265	99,789,163	180,787,956	92,532,958
未 払 信 託 報 酬	73,361,780	65,659,555	75,869,898	81,826,337	76,093,181	81,714,409
未 払 利 息	5,420	-	-	-	-	-
そ の 他 未 払 費 用	1,147,811	2,169,614	2,781,508	3,056,324	3,305,376	3,563,100
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	96,983,640,404	99,677,232,408	103,888,851,415	107,835,270,376	111,083,614,957	110,923,178,433
元 本	61,932,486,640	62,212,417,169	63,444,327,850	64,711,129,930	66,065,826,840	67,474,468,167
次 期 繰 越 損 益 金	35,051,153,764	37,464,815,239	40,444,523,565	43,124,140,446	45,017,788,117	43,448,710,266
(D) 受 益 権 総 口 数	61,932,486,640口	62,212,417,169口	63,444,327,850口	64,711,129,930口	66,065,826,840口	67,474,468,167口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D)	15,660円	16,022円	16,375円	16,664円	16,814円	16,439円

(注記事項)

作成期首元本額	61,309,927,119円
作成期中追加設定元本額	10,754,532,133円
作成期中一部解約元本額	4,589,991,085円

■ 損益の状況

項 目	第54期	第55期	第56期	第57期	第58期	第59期
	自 2024年1月26日 至 2024年2月26日	自 2024年2月27日 至 2024年3月25日	自 2024年3月26日 至 2024年4月25日	自 2024年4月26日 至 2024年5月27日	自 2024年5月28日 至 2024年6月25日	自 2024年6月26日 至 2024年7月25日
(A) 配 当 等 收 益	1,427,555,765円	△ 64,084円	7,183円	1,548,940,687円	12,749円	14,061円
受 取 配 当 金	1,405,302,112	-	-	1,563,427,049	-	-
受 取 利 息	-	1,203	7,183	△ 14,486,362	12,749	14,061
支 払 利 息	22,253,653	△ 65,287	-	-	-	-
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	1,173,697,782	2,656,822,873	2,639,119,195	704,141,432	1,431,473,952	△ 2,067,455,443
売 買 益	1,576,042,389	2,663,712,920	2,689,687,609	889,388,597	1,850,379,337	2,264,399,424
売 買 損	△ 402,344,607	△ 6,890,047	△ 50,568,414	△ 185,247,165	△ 418,905,385	△ 4,331,854,867
(C) 信 託 報 酬 等	△ 74,529,220	△ 66,681,358	△ 76,513,974	△ 82,101,153	△ 76,342,233	△ 81,972,133
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	2,526,724,327	2,590,077,431	2,562,612,404	2,170,980,966	1,355,144,468	△ 2,149,413,515
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	8,976,340,434	10,958,373,687	13,036,141,893	15,101,429,663	16,792,900,267	17,633,539,141
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	23,888,717,679	24,258,532,415	25,194,713,071	26,207,641,031	27,233,105,429	28,369,431,449
(配 当 等 相 当 額)	(27,892,906,257)	(28,273,493,823)	(29,265,010,251)	(30,344,646,946)	(31,457,633,200)	(32,658,712,627)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 4,004,188,578)	(△ 4,014,961,408)	(△ 4,070,297,180)	(△ 4,137,005,915)	(△ 4,224,527,771)	(△ 4,289,281,178)
(G) 計 (D + E + F)	35,391,782,440	37,806,983,533	40,793,467,368	43,480,051,660	45,381,150,164	43,853,557,075
(H) 收 益 分 配 金	△ 340,628,676	△ 342,168,294	△ 348,943,803	△ 355,911,214	△ 363,362,047	△ 404,846,809
次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)	35,051,153,764	37,464,815,239	40,444,523,565	43,124,140,446	45,017,788,117	43,448,710,266
追 加 信 託 差 損 益 金	23,888,717,679	24,258,532,415	25,194,713,071	26,207,641,031	27,233,105,429	28,369,431,449
(配 当 等 相 当 額)	(27,892,906,257)	(28,273,493,823)	(29,265,010,251)	(30,344,646,946)	(31,457,633,200)	(32,658,712,627)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 4,004,188,578)	(△ 4,014,961,408)	(△ 4,070,297,180)	(△ 4,137,005,915)	(△ 4,224,527,771)	(△ 4,289,281,178)
分 配 準 備 積 立 金	11,162,436,085	13,206,346,908	15,249,810,494	16,916,499,415	17,784,682,688	17,228,692,332
繰 越 損 益 金	-	△ 64,084	-	-	-	△ 2,149,413,515

(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54期計算期間末における費用控除後の配当等収益 (1,386,654,129円)、費用控除後の有価証券等損益額 (1,139,949,932円)、信託約款に規定する収益調整金 (27,892,906,257円) および分配準備積立金 (8,976,460,700円) より分配対象収益は39,395,971,018円 (10,000口当たり6,361円) であり、うち340,628,676円 (10,000口当たり55円) を分配金額としております。

第55期計算期間末における費用控除後の配当等収益 (0円)、費用控除後の有価証券等損益額 (2,590,141,515円)、信託約款に規定する収益調整金 (28,273,493,823円) および分配準備積立金 (10,958,373,687円) より分配対象収益は41,822,009,025円 (10,000口当たり6,722円) であり、うち342,168,294円 (10,000口当たり55円) を分配金額としております。

第56期計算期間末における費用控除後の配当等収益 (7,183円)、費用控除後の有価証券等損益額 (2,562,541,962円)、信託約款に規定する収益調整金 (29,265,010,251円) および分配準備積立金 (13,036,205,152円) より分配対象収益は44,863,764,548円 (10,000口当たり7,071円) であり、うち348,943,803円 (10,000口当たり55円) を分配金額としております。

第57期計算期間末における費用控除後の配当等収益 (1,492,496,144円)、費用控除後の有価証券等損益額 (678,484,822円)、信託約款に規定する収益調整金 (30,344,646,946円) および分配準備積立金 (15,101,429,663円) より分配対象収益は47,617,057,575円 (10,000口当たり7,358円) であり、うち355,911,214円 (10,000口当たり55円) を分配金額としております。

第58期計算期間末における費用控除後の配当等収益 (12,749円)、費用控除後の有価証券等損益額 (1,355,131,719円)、信託約款に規定する収益調整金 (31,457,633,200円) および分配準備積立金 (16,792,900,267円) より分配対象収益は49,605,677,935円 (10,000口当たり7,508円) であり、うち363,362,047円 (10,000口当たり55円) を分配金額としております。

第59期計算期間末における費用控除後の配当等収益 (0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 (32,658,712,627円) および分配準備積立金 (17,633,539,141円) より分配対象収益は50,292,251,768円 (10,000口当たり7,453円) であり、うち404,846,809円 (10,000口当たり60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54期	第55期	第56期	第57期	第58期	第59期
1 万口当たりの分配金 (税込み)	55円	55円	55円	55円	55円	60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54期	第55期	第56期	第57期	第58期	第59期
	(2024年1月26日 ～2024年2月26日)	(2024年2月27日 ～2024年3月25日)	(2024年3月26日 ～2024年4月25日)	(2024年4月26日 ～2024年5月27日)	(2024年5月28日 ～2024年6月25日)	(2024年6月26日 ～2024年7月25日)
当期分配金	55	55	55	55	55	60
(対基準価額比率)	(0.350%)	(0.342%)	(0.335%)	(0.329%)	(0.326%)	(0.364%)
当期の収益	55	—	—	55	—	—
当期の収益以外	—	55	55	—	55	60
翌期繰越分配対象額	6,306	6,667	7,016	7,303	7,453	7,393

(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。

《お知らせ》

投資対象とする投資信託証券の名称が「Amundi Funds パイオニア・インカム・オポチュニティーズ」から「Amundi Funds インカム・オポチュニティーズ」に変更されることにもない、2024年3月15日付で投資信託約款に所要の変更を行いました。

< 1. 補足情報 >

組入ファンド「Amundi Funds インカム・オポチュニティーズ」の決算日（毎年6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7月24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7月24日現在）

(1) 株式等

	銘柄	通貨	株数	評価額（米ドル）
イギリス	SHELL PLC	EUR	1,306,613	46,828,889.71
アメリカ	INTL BUSINESS MACHINES CORP	USD	214,835	39,606,980.60
オランダ	ABN AMRO GROUP N.V.	EUR	2,057,984	36,912,484.65
アメリカ	PFIZER INC	USD	1,063,639	31,887,897.22
韓国	KB FINANCIAL GROUP	KRW	515,508	31,513,818.18
フランス	SANOFI	EUR	282,258	28,666,370.30
アメリカ	STATE STREET CORP	USD	256,911	21,318,474.78
	EVERSOURCE ENERGY	USD	336,432	21,205,308.96
韓国	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	KRW	339,012	20,087,420.74
イギリス	PERSIMMON PLC	GBP	926,743	18,221,373.35
韓国	HANA FINANCIAL GROUP	KRW	346,011	15,401,601.08
イタリア	UNICREDIT SPA	EUR	341,686	14,500,859.99
カナダ	BARRICK GOLD CORPORATION	CAD	706,900	13,062,083.75
アメリカ	NEWMONT CORPORAION	USD	271,554	12,955,841.34
ドイツ	DEUTSCHE TELEKOM AG-NOM	EUR	491,746	12,820,461.42
日本	SUBARU CORP	JPY	632,800	12,506,533.04
アイルランド	CRH PLC	GBP	140,466	11,308,520.77
ドイツ	HENSOLDT AG	EUR	302,453	10,938,372.44
スイス	UBS GROUP INC NAMEN AKT	CHF	358,076	10,877,578.87
オランダ	LYONDELLBASELL	USD	111,275	10,601,169.25

(2) 債券

	銘柄	通貨	額面金額	評価額（米ドル）
アメリカ	FN FS6369TF MTGE 01/11/2053	USD	22,400,000	21,166,881.54
	FN FS5917 MTGE TF 01/09/2053	USD	13,362,000	12,555,881.07
	LEVEL 3 FINANCING INC 10.5% 15/05/2030	USD	11,790,000	12,242,794.95
ハンガリー	REPUBLIC OF HUNGARY 4.5% 27/05/2032	HUF	4,547,010,000	11,168,319.14
アメリカ	FN FS5885 TF 01/09/2053	USD	10,887,000	10,633,808.31
	FN FS6667 TF 01/10/2053	USD	10,800,000	10,602,887.91
	FN FS5445 MTGE TF 01/11/2051	USD	13,804,656	10,477,677.62
スイス	UBS GROUP AG VAR PERP	USD	10,476,000	9,851,601.30
アメリカ	FN FS6699 TF 01/02/2052	USD	11,952,000	9,545,124.55
スイス	UBS GROUP AG VAR PERP	USD	9,817,000	9,446,089.20

(注) 通貨欄の表記は以下の通りです。

EUR（ユーロ）、USD（米ドル）、KRW（韓国ウォン）、GBP（英ポンド）、CAD（カナダドル）、JPY（円）、CHF（スイスフラン）、HUF（ハンガリーフォロント）

< 2. 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7月25日現在の情報を掲載しています。

■主要な売買銘柄（2024年2月16日から2024年7月25日まで）

公社債

買		付		売		付	
銘柄	金額	銘柄	金額	銘柄	金額	銘柄	金額
	千円		千円		千円		千円
第146回共同発行市場公募地方債	100,320	第137回共同発行市場公募地方債	50,029				

(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。

■組入資産の明細（2024年7月25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7月25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	300,000	300,442	70.7	—	—	—	70.7
合計	300,000	300,442	70.7	—	—	—	70.7

(注1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

(注2) 単位未満は切捨てです。

(注3) ー印は組入れなしです。

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

(B) 個別銘柄開示

国内（邦貨建）公社債

種類	銘柄	2024年7月25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	49,996	2024/8/28
	第139回共同発行市場公募地方債	0.544	150,000	150,163	2024/10/25
	第146回共同発行市場公募地方債	0.553	100,000	100,283	2025/5/23
合計			300,000	300,442	

(注) 額面・評価額の単位未満は切捨てです。

Amundi Funds インカム・オポチュニティーズ
決算日 2023年6月30日
(計算期間：2022年7月1日～2023年6月30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。

※2024年3月15日付で「Amundi Funds パイオニア・インカム・オポチュニティーズ」は「Amundi Funds インカム・オポチュニティーズ」に名称変更されました。

■費用の明細 (2022年7月1日～2023年6月30日)

項目	当期
	米ドル
(a)運用報酬	6,621,875
(b)成功報酬	357
(c)管理費用等	1,041,769
(d)その他の費用	1,881,613
合計	9,545,614

■純資産計算書 (2023年6月30日現在)

項目	当期末
	米ドル
資産合計	836,191,008
有価証券	798,659,490
オプション取引評価勘定(買)	375,819
預金	28,987,672
未収利息	3,464,709
未収配当金	509,462
未収追加設定金	1,938,442
為替予約取引評価勘定	2,254,344
為替未収入金	1,070
負債合計	7,502,222
借入金	1,818,351
未払解約金	477,481
先物取引評価勘定	2,616,061
未払運用報酬	1,932,588
その他の負債	657,741
純資産	828,688,786

(注) 各項目の金額の整数未満を四捨五入しているため、資産合計および負債合計並びに純資産が一致しない場合があります。

■ 有価証券明細 (2023年6月30日現在)

数量	評価額 米ドル	数量	評価額 米ドル
株式	356,202,232	ロシア	-
パミューダ	4,160,477	16,006 MAGNIT PJSC	-
415,798 BW LPG	4,160,477	201,545 MAGNIT SP GDR SPONSORED	-
カナダ	6,863,958	16,204 OIL COMPANY LUKOIL ADR 1 SH	-
98,915 BARRICK GOLD CORPORATION	1,674,769	426,925 ROSNEFT OIL COMPANY USD (ISIN US67812M2070)	-
42,400 POWER CORP OF CANADA	1,143,243	南アフリカ	635,592
96,069 TECK RESOURCES B	4,045,946	96,157 ROTAL BAFOKENG PLATINUM LIMITED	635,592
ケイマン諸島	743,255	韓国	24,015,833
1,770,387 HONMA GOLF LTD SHS UNITARY 144A/REGS	743,255	229,251 HANA FINANCIAL GROUP	6,820,202
フランス	16,667,607	429,328 KB FINANCIAL GROUP	15,558,314
155,574 SANOFI	16,667,607	36,259 SAMSUNG ELECTRONICS PREF SHS	1,637,317
ドイツ	12,821,456	スペイン	3,186,139
222,408 DEUTSCHE TELEKOM AG-NOM	4,847,119	118,330 DISTRIB.INTEGRAL LOGISTA HOLD.	3,186,139
242,992 HENSOLDT AG	7,974,337	スウェーデン	341,218
アイルランド	12,760,544	63,099 TELEFON AB LM ERICSSON	341,218
118,367 CRH PLC	6,521,489	スイス	13,396,235
53,846 MEDTRONIC PLC	4,742,217	603,551 UBS GROUP INC NAMEN AKT	12,207,458
6,356 WILLIS TOWERS — SHS	1,496,838	2,503 ZURICH INSURANCE GROUP AG	1,188,777
イタリア	12,882,942	台湾	2,071,313
242,005 FINECOBANK	3,251,498	103,000 ASUSTEK COMPUTER	1,040,104
2,000,092 INTESA SANPAOLO SPA	5,237,041	183,000 CATCHER	1,031,209
189,413 UNICREDIT SPA	4,394,403	イギリス	49,967,836
日本	28,681,839	62,064 ASSOCIATED BRITISH FOODS	1,570,987
86,600 BRIDGESTONE CORP	3,530,267	703,031 BP PLC	4,096,691
18,200 INABA DENKISANGYO	412,391	603,581 PERSIMMON PLC	7,869,240
729,800 INPEX CORPORATION	8,068,774	19,259 RECKITT BENCKISER GROUP PLC	1,447,537
344,500 MITSUBISHI ELECTRIC CORP	4,831,366	8,958 RIO TINTO PLC	567,782
256,100 PANASONIC HOLDINGS CORPORATION	3,107,007	1,143,142 SHELL PLC	34,415,599
367,800 SUBARU CORP	6,878,357	アメリカ	132,495,953
52,400 SUMITOMO MITSUI TRUST HLD	1,853,677	539,373 ABRDN ASIA PACIFIC INCOME FUND INC	1,450,913
ジャージー	186,183	4,414 ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES REIT	500,945
4,495 CLARIVATE PLC	186,183	236,544 AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	2,396,191
メキシコ	3,710,962	92,729 ANGEL OAK MORTGAGE REIT INC	764,087
451,959 GRUPO FIN BANORTE	3,710,962	175,629 BANK OF NEW YORK MELLON CORP	7,819,003
オランダ	30,612,890	42,225 BRIGHTSPHERE INVESTMENT GROUP	884,614
1,439,685 ABN AMRO GROUP N.V.	22,351,009	144,087 CARDINAL HEALTH INC	13,627,748
71,905 ARISTON HOLDING N V	759,380	156,703 CISCO SYSTEMS INC	8,107,813
81,600 EURONEXT	5,546,295	143,688 CITIZENS FINANCIAL GROUP	3,747,383
73,453 KONINKLIJKE PHILIPS N.V.	1,587,358	35,819 EBAY INC	1,600,751
9,970 NN GROUP NV	368,848	213,031 EQUITRANS MIDSTREAM CORPORATION	2,036,576
14,317 X 5 RETAIL GROUP NV REGS GDR	-	93,453 FIRSTENERGY CORP	3,632,518
		19,165 GREAT AJAX CORP REIT RG	117,290
		33,129 HARTFORD FINANCIAL SERVICES GRP	2,384,957
		106,487 HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	1,787,917
		89,942 INTL BUSINESS MACHINES CORP	12,032,441
		222,903 KOSMOS ENERGY LTD	1,335,189

数量	評価額 米ドル	数量	評価額 米ドル
167,326 LADDER CAPITAL A REITS	1,815,487	700,000 MERNA REINSURANCE II LTD VAR 07/07/2026 USD (ISIN US59013MAH51)	696,080
9,597 MKS INSTRUMENTS INC	1,037,436	800,000 MERNA REINSURANCE II LTD VAR 07/07/2026 USD (ISIN US59013MAJ18)	819,260
3,928 OLD REPUB.INTL CORP	98,907	300,000 MERNA REINSURANCE II LTD VAR 10/07/2028	272,063
120,189 ORGANON AND COMPANY	2,499,931	500,000 MONA LISA RE LTD VAR 08/01/2026	529,000
705,760 PFIZER INC	25,880,219	250,000 MONA LISA RE LTD VAR 08/07/2025	238,919
287,555 RITHM CAPITAL CORP	2,685,764	500,000 MYSTIC RE IV LTD VAR 08/01/2025 USD (ISIN US62865LAB36)	467,925
104,310 STATE STREET CORP	7,631,320	250,000 MYSTIC RE IV LTD VAR 08/01/2025 USD (ISIN US62865LAC19)	235,119
117,711 TAPESTRY INC	5,038,031	250,000 MYSTIC RE IV LTD VAR 10/01/2028	246,500
27,470 THE CIGNA GROUP	7,705,610	500,000 NORTHSHORE RE II LTD VAR 08/01/2027	494,913
258,999 TRUIST FINANCIAL CORPORATION	7,858,030	500,000 PURPLE REAL ESTATE LIMITED VAR 24/04/2026	501,575
191,200 TWO HARBORS INVESTMENT CORP	2,653,856	250,000 SAKURA RE LTD VAR 06/01/2030	267,156
18,777 UNITED PARCEL SERVICE-B	3,365,026	250,000 SAKURA RE LTD VAR 07/04/2029	245,398
債券	376,018,121	500,000 SANDERS RE II LTD VAR 07/04/2028	480,063
バミューダ	21,146,980	750,000 SANDERS RE III LTD VAR 05/06/2026	749,680
750,000 ALAMO RE LTD VAR 07/06/2026	737,005	500,000 SANDERS RE III LTD VAR 07/04/2027	493,763
24,550 ALTURAS RE LTD VAR 12/09/2023	304	250,000 SANDERS RE III LTD VAR 08/04/2030	256,294
250,000 ALTURAS RE LTD 0% 31/12/2024	-	500,000 SANDERS RE III LTD VAR 09/04/2029	468,413
500,000 AQUILA RE I LTD VAR 08/06/2026 USD (ISIN US03843AAB89)	498,738	274 SECTOR RE V LTD VAR 01/03/2026 USD (ISIN US81369ADR05)	19,192
250,000 AQUILA RE I LTD VAR 08/06/2026 USD (ISIN US03843AAC62)	251,244	100,000 SECTOR RE V LTD 0% 01/03/2024 USD (ISIN US81369ACT79)	50,384
250,000 BONANZA RE LTD VAR 08/01/2026	248,000	25,000 SECTOR RE V LTD 0% 01/12/2024 USD (ISIN US81369ADB52)	43,031
550,000 BONANZA RE LTD VAR 22/02/2028	504,528	554 SECTOR RE V LTD 0% 01/12/2025 USD (ISIN US81369ADK51)	14,204
250,000 BONANZA RE LTD VAR 23/12/2024	216,581	499 SECTOR RE V LTD 0% 01/12/2025 USD (ISIN US81369ADL35)	12,793
800,000 CITRUS RE LTD VAR 07/06/2026	791,760	500,000 SOLOMON RE LTD VAR 08/06/2026	500,750
750,000 COMMONWEALTH RE LTD VAR 08/07/2030	751,500	500,000 SUTTER RE LTD VAR 19/06/2026	501,750
700,000 CPAE LOOKOUT REAL ESTATE LTD VAR 28/04/2026	706,947	550,000 TITANIA RE LTD VAR 27/02/2026	579,205
150,000 EDEN RE II LTD 0% 21/03/2025 USD (ISIN US27955HAA86)	81,750	750,000 URSA RE LTD VAR 06/12/2025	756,993
250,000 FIRST COAST RE LTD VAR 07/04/2026	244,663	250,000 VERAISON REAL ESTATE LIMITED VAR 09/03/2026	263,994
600,000 FLOODSMART RE LTD VAR 01/03/2024	564,075	カナダ	69,030,837
500,000 FLOODSMART RE LTD VAR 11/03/2026	504,937	994,000 BOMBARDIER INC 7.875% 144A 15/04/2027	993,851
250,000 FOUR LAKES RE LTD VAR 05/01/2024	244,454	21,200 CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE CANADA 10.15% 24/04/2024	2,404,969
250,000 FOUR LAKES RE LTD VAR 05/01/2027	244,348	216,100 CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE CANADA 14.01% 07/02/2024	3,604,389
250,000 FOUR LAKES RE LTD VAR 07/01/2030	253,169	34,400 CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE CANADA 14.20% 19/03/2024	2,046,979
500,000 GATEWAY REAL ESTATE II LTD VAR 27/04/2026	495,775	1,306,200 CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE CANADA 16.80% 22/12/2023	16,254,951
250,000 GATEWAY REAL ESTATE LTD VAR 24/02/2026	258,744	93,500 CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE CANADA 28.90% 17/11/2023	1,383,581
250,000 HERBIE RE LTD VAR 08/01/2030	242,069	26,400 ROYAL BANK OF CANADA 0% 13/10/2023	1,187,736
650,000 INTEGRITY RE LTD VAR 06/06/2025	643,970	21,400 ROYAL BANK OF CANADA 0% 14/08/2023	2,364,272
250,000 KILIMANJARO III RE LTD VAR 20/04/2026 USD (ISIN US49407PAH38)	227,344	47,100 ROYAL BANK OF CANADA 0% 23/01/2024 USD (ISIN USC798521970)	3,764,703
250,000 KILIMANJARO III RE LTD VAR 20/04/2026 USD (ISIN US49407PAK66)	234,419	18,900 ROYAL BANK OF CANADA 0% 23/01/2024 USD (ISIN USC798522051)	1,319,031
250,000 KILIMANJARO III RE LTD VAR 21/04/2025 USD (ISIN US49407PAE07)	233,288	46,400 ROYAL BANK OF CANADA 10.01% 05/03/2024	2,786,526
250,000 KILIMANJARO III RE LTD VAR 21/04/2025 USD (ISIN US49407PAF71)	236,856	46,700 ROYAL BANK OF CANADA 12.15% 05/03/2024	2,114,653
700,000 LIGHTNING RE LIMITED VAR 31/03/2026	721,052		
240,000 LIMESTONE RE LTD 0% 01/03/2024 USD (ISIN XS2096788455)	3,528		
500,000 LOCKE TAVERN RE LTD VAR 09/04/2026	503,112		
300,000 LONG POINT REAL ESTATE IV LTD VAR 01/06/2026	298,403		

数量	評価額 米ドル	数量	評価額 米ドル
25,600 ROYAL BANK OF CANADA 13.57% 05/03/2024	2,142,233		
40,000 ROYAL BANK OF CANADA 14.35% 14/08/2023	2,544,676		
121,200 ROYAL BANK OF CANADA 20.37% 05/07/2024	1,660,714		
297,000 ROYAL BANK OF CANADA 20.57% 05/07/2024	1,784,027		
61,700 ROYAL BANK OF CANADA 9.58% 05/07/2024	3,355,607		
34,900 THE TORONTO DOMINION BANK CANADA 10.25% 21/05/2024	3,945,876		
77,200 THE TORONTO DOMINION BANK CANADA 10.51% 12/04/2024	8,558,650		
7,400 THE TORONTO DOMINION BANK CANADA 14.70% 08/02/2024	1,487,476		
59,700 THE TORONTO DOMINION BANK CANADA 21.21% 14/08/2023	2,465,186		
12,500 THE TORONTO DOMINION BANK CANADA 22.50% 01/09/2023	860,751		
ケイマン諸島	23,464,072		
74,200 MIZUHO FINANCIAL GROUP CAYMAN LTD 0% 01/04/2024	1,355,597		
8,200 MIZUHO MARKETS PLC 0% 07/07/2023	684,692		
47,200 MIZUHO MARKETS PLC 0% 25/07/2023	1,849,862		
59,600 MIZUHO MARKETS PLC 11.89% 26/06/2024	1,996,454		
158,300 MIZUHO MARKETS PLC 14.35% 26/06/2024	2,002,970		
20,200 MIZUHO MARKETS PLC 15.31% 05/07/2024	1,684,882		
14,800 MIZUHO MARKETS PLC 18.54% 08/02/2024	1,781,630		
18,100 MIZUHO MARKETS PLC 19.80% 08/03/2024	1,291,136		
104,300 MIZUHO MARKETS PLC 20.20% 29/01/2024	1,622,804		
33,400 MIZUHO MARKETS PLC 20.80% 23/01/2024	2,292,609		
14,000 MIZUHO MARKETS PLC 22.45% 21/11/2023	1,022,294		
35,500 MIZUHO MARKETS PLC 8.74% 02/05/2024	3,078,942		
250,000 RESIDENTIAL REINS VAR 06/12/2024 USD (ISIN US76120AAB89)	238,556		
250,000 RESIDENTIAL REINS VAR 06/12/2024 USD (ISIN US76120AAC62)	239,313		
375,000 RESIDENTIAL REINS 2022 LIMITED VAR 06/12/2029	373,856		
250,000 RESIDENTIAL REINSURANCE VAR 06/12/2028	223,669		
250,000 RESIDENTIAL REINSURANCE 2021 LTD VAR 06/12/2028	224,225		
500,000 VITALITY RE VIII LTED VAR 06/01/2026	490,250		
500,000 VITALITY RE XI LTD VAR 05/01/2027	512,950		
250,000 VITALITY RE XI LTD VAR 09/01/2025 USD (ISIN US92851AAB08)	247,100		
250,000 VITALITY RE XIV LIMITED VAR 05/01/2027	250,281		
キュラソー	11,510,659		
23,800 MERRILL LYNCH INTL AND CO CV 0% 11/03/2024 USD (ISIN CWN5655G6437)	3,088,121		
52,700 MERRILL LYNCH INTL AND CO CV 0% 11/03/2024 USD (ISIN CWN5655G6502)	1,533,307		
35,600 MERRILL LYNCH INTL AND CO CV 13.75% 01/02/2024	2,201,884		
28,700 MERRILL LYNCH INTL AND CO CV 16.29% 01/02/2024	2,424,094		
38,500 MERRILL LYNCH INTL AND CO CV 16.45% 13/10/2023	2,263,253		
		チェコ	4,657,963
		101,530,000 CZECH 5.70% 25/05/2024	4,657,963
		フランス	2,884,290
		1,500,000 BPCE SA VAR 144A 19/10/2032	1,162,680
		1,200,000 BPCE SA 4.875% 144A 01/04/2026	1,150,656
		615,000 SOCIETE GENERALE SA VAR 144A 15/06/2033	570,954
		アイルランド	1,510,631
		750,000 ATLAS CAPITAL DAC VAR 05/06/2029	757,462
		750,000 QUEEN STREET 2023 RE DAC VAR 08/12/2025	753,169
		イタリア	44,100,218
		1,624,000 INTESA SANPAOLO PRIVATE BANKING SPA VAR 144A 20/06/2054	1,618,040
		6,700,000 ITALY BTP 1.45% 15/11/2024	7,087,120
		6,610,000 ITALY BTP 1.85% 15/05/2024	7,093,890
		6,570,000 ITALY BTP 2.50% 01/12/2024	7,044,009
		6,485,000 ITALY BTP 3.75% 01/09/2024	7,071,385
		6,464,000 ITALY BTP 4.50% 01/03/2024	7,082,831
		6,633,000 ITALY 1.75% 30/05/2024	7,102,943
		ルクセンブルク	1,293,143
		1,370,000 JBS USA LUX SA 5.75% 144A 01/04/2033	1,293,143
		マーシャル諸島	837,856
		836,000 DANAOS CORP 8.50% 144A 01/03/2028	837,856
		オランダ	15,427,761
		1,600,000 ABN AMRO BANK NV VAR PERPETUAL EUR (ISIN XS1693822634)	1,478,872
		1,500,000 ABN AMRO BANK NV VAR PERPETUAL EUR (ISIN XS2131567138)	1,476,876
		1,500,000 AKER BP ASA 3.10% 144A 15/07/2031	1,242,510
		62,400 BNP PARIBAS ISSUANCE BV 11.85% 01/04/2024	2,090,478
		198,600 BNP PARIBAS ISSUANCE BV 20.04% 24/04/2024	1,277,637
		84,500 BNP PARIBAS ISSUANCE BV 21.08% 08/03/2024	554,086
		2,318,000 ING GROUP NV VAR PERPETUAL USD (ISIN USA56837AF06)	2,158,290
		87,000 MERRILL LYNCH BV 14.28% 26/02/2024	2,923,582
		70,800 MORGAN STANLEY BV 14.07% 09/02/2024	2,225,430
		ロシア	-
		18,298,000 RUSSIA 0% 03/02/2027	-
		18,557,000 RUSSIA 0% 16/08/2023	-
		19,168,000 RUSSIA 0% 23/03/2033	-
		シンガポール	1,386,680
		700,000 EASTON RE PTE LTD VAR 08/01/2027	696,710
		500,000 FIRST COAST RE II PTE LTD VAR 07/04/2025	444,767
		250,000 TORREY PINES RE PTE LTD VAR 07/06/2029	245,203
		南アフリカ	1,972,784
		44,244,990 SOUTH AFRICA 8.25% 31/03/2032	1,972,784

数量	評価額 米ドル	数量	評価額 米ドル
		26,100 CITIGROUP GLOBAL MARKET LTD 10.45% 07/03/2024	1,572,778
1,600,000 BANCO SANTANDER SA VAR 22/11/2032	1,269,600	21,000 CITIGROUP GLOBAL MARKET LTD 18.44% 12/10/2023	1,361,640
		42,400 CITIGROUP GLOBAL MARKET LTD 26.39% 19/12/2023	2,166,857
2,274,000 UBS GROUP INC VAR PERPETUAL	1,986,635	26,000 CITIGROUP GLOBAL MARKETS INC 12.39% 20/11/2023	1,487,442
10,476,000 UBS GROUP INC VAR 144A PERPETUAL USD (ISIN US902613AG32)	8,151,270	114,800 CITIGROUP GLOBAL MARKETS INC 14.74% 26/01/2024	1,972,187
9,817,000 UBS GROUP INC VAR 144A PERPETUAL USD (ISIN US902613AJ70)	7,885,211	34,500 CITIGROUP GLOBAL MARKETS INC 15.31% 10/11/2023	1,444,090
		54,500 CITIGROUP GLOBAL MARKETS INC 15.43% 21/09/2023	2,922,114
トリニダード・トバゴ	505,880	51,600 CITIGROUP GLOBAL MARKETS INC 16.10% 01/02/2024	2,111,662
519,000 TRINIDAD ET TOBAGO 4.50% 04/08/2026	505,880	33,700 CITIGROUP GLOBAL MARKETS INC 17.68% 26/10/2023	1,941,443
		85,600 CITIGROUP GLOBAL MARKETS INC 20.23% 09/11/2023	2,958,099
イギリス	28,101,600	24,500 CITIGROUP GLOBAL MARKETS INC 23.01% 26/10/2023	1,723,540
17,600 GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL BANK 13.48% 26/03/2024	1,902,096	675,000 CLEAR CHANNEL OUTDOOR HOLDINGS INC 7.50% 144A 01/06/2029	503,024
68,500 GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL BANK 14.49% 10/10/2023	2,273,349	195,000 CLEAR CHANNEL OUTDOOR HOLDINGS INC 7.75% 144A 15/04/2028	153,769
185,000 GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL BANK 18.47% 10/10/2023	2,257,356	696,000 DEALER TIRE LIC DT ISSUER LIC 8.00% 144A 01/02/2028	638,295
22,300 GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL 12.45% 24/04/2024	2,458,894	1,020,000 DELEK LOGISTICS PARTNERS LP 6.75% 15/05/2025	1,006,250
271,800 GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL 14.14% 04/03/2024	3,411,654	11,790,000 LEVEL 3 FINANCING INC 10.50% 144A 15/05/2030	11,980,879
24,000 GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL 16.21% 29/03/2024	1,406,978	1,028,000 LSF11 A5 HOLDCO LLC 6.625% 144A 15/10/2029	870,737
95,600 GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL 18.72% 29/03/2024	1,276,063	1,056,000 MINERVA MERGER 6.50% 144A 15/02/2030	889,015
130,800 GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL 20.28% 29/03/2024	4,131,877	2,560,000 MORGAN STANLEY VAR 20/04/2037	2,422,144
104,500 GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL 21.33% 29/03/2024	667,365	1,711,000 PAR PHARMACEUTICAL COS INC 0% 144A 01/04/2027	1,276,885
17,100 GOLDMAN SACHS LONDON BRANCH 11.13% 26/03/2024	1,853,136	1,150,000 PROVIDENT FUNDING ASSOCIATES LP PFG FINANCE CORP 6.375% 144A 15/06/2025	1,017,957
1,546,000 LLOYDS BANKING GROUP PLC VAR PERPETUAL	1,441,444	18,400 ROYAL BANK OF CANADA NEWYORK BRANCH 0% 26/02/2024	2,557,968
2,196,000 NATWEST GROUP PLC VAR PERPETUAL USD (ISIN US780099CK11)	2,148,786	20,296,200 USA T-BONDS 3.00% 30/06/2024	19,820,903
2,797,000 STANDARD CHARTERED PLC VAR 144A 12/01/2033	2,244,173	12,216,800 USA T-BONDS 3.00% 31/07/2024	11,911,617
250,000 SUSSEX CAP UK PPC LTD VAR 08/01/2025	240,056	11,055,100 USA T-BONDS 4.125% 30/09/2024	10,911,297
306,940 UK GILT 4.25% 07/06/2032	388,373	7,819,900 USA T-BONDS 4.125% 31/01/2025	7,698,325
		11,764,400 USA T-BONDS 4.375% 30/11/2024	11,641,929
アメリカ	128,894,051	12,035,100 USA T-BONDS 4.375% 31/10/2024	11,891,712
885,000 ALLIED UNIVERSAL HOLDCO LLC/ALLIED UNIVERSAL FINANCE CORP 9.75% 144A 15/07/2027	781,013	992,000 WINDSTREAM ESCROW LLC 7.75% 144A 15/08/2028	823,916
1,500,000 AMERICAN AIRLINES PASS THROUGH TRUST 3.95% 11/07/2030	1,263,365		
540,000 AMERICAN AXLE AND MANUFACTURING INC 6.25% 15/03/2026	526,397	その他債券	7,757,242
1,490,000 AUTONATION INC 3.85% 01/03/2032	1,269,376	アメリカ	7,757,242
1,220,000 BOEING CO 5.15% 01/05/2030	1,208,898	1,363,000 PENNYMAC CORP 5.50% 15/03/2026 CV	1,212,470
390,000 BRITISH AIRWAYS PASS THRU CERTIFICATES SERIES 2020 1B 8.375% 144A 15/11/2028	173,566	7,722,900 REDWOOD TRUST INC 7.75% 15/06/2027 CV	6,544,772
1,496,000 BROADCOM INC 2.45% 144A 15/02/2031	1,217,235		
500,000 CAPE LOOKOUT RE LTD VAR 22/03/2028	486,163	その他証券	39,277,202
2,444,000 CAPITAL ONE FINANCIAL CORP VAR 10/05/2033	2,289,564	パミューダ	4,235,099
		1,000,000 BELLEMEADE RE LTD FRN 25/10/2030 USD (ISIN US07877KAG58)	1,045,618

数量		評価額 米ドル	数量		評価額 米ドル
500,000	EAGLE RE 2021-1 LTD FRN 25/11/2028	172,264	800,000	HOME RE LTD FRN 25/10/2030	639,808
1,100,000	EAGLE RE 2021-1 LTD VAR 25/10/2033	1,134,531	130,000	MULTIFAMILY CONNECTICUT AVENUE VAR 25/01/2051 USD (ISIN US35563FAC59)	125,108
200,000	HOME RE 2020 LTD FRN 25/10/2030	204,586	1,382,000	MULTIFAMILY CONNECTICUT AVENUE VAR 25/11/2051 USD (ISIN US35563GAA76)	976,742
1,080,000	HOME RE 2021 2 LTD VAR 25/01/2034 USD (ISIN US43730VAE83)	1,036,450	2,000,000	OCTANE RECEIVABLES TRUST 2022 1 7.33% 20/12/2029	1,894,163
500,000	OAKTOWN RE II LTD FRN 25/07/2028 USD (ISIN BMG6713GAA06)	44,003	2,070,000	PNMAC GMSR ISSUER TRUST FRN 25/02/2023	2,068,628
730,000	OAKTOWN RE LTD FRN 25/10/2030	597,647	570,000	TRICON AMERN HOMES 2017-SFR2 TRUST 4.882% 17/07/2038	531,063
	ケイマン諸島	7,947,492	2,000,000	UNITED AUTO CREDIT SECURITIZATION TRUST 10.00% 10/04/2029	1,904,691
1,000,000	ABPCI DIRECT LENDING FUND CO LLC VAR 20/04/2031	931,475		ワラント、権利	17,850,825
500,000	CHENANGO PARK CLO LTD FRN 15/04/2030	402,732		キュラソー	17,850,825
1,000,000	GOLDENTREE LOAN MANAGEMENT FRN 20/04/2034	943,146	10,500	MERRILL LYNCH INTERNAL WARRANT ON GENERAC HOLDING UNIT 17/11/2023	1,301,958
1,000,000	ICG US CLO LTD VAR 28/07/2034	873,331	8,100	MERRILL LYNCH INTERNATIONAL AND CO CV WARRANT 07/02/2024	2,235,762
1,000,000	NEUBERGER BERMAN CLO VAR 17/07/2035	937,406	61,400	MERRILL LYNCH INTERNATIONAL WARRANT 22/05/2024	4,939,937
1,000,000	OCEAN TRAILS CLO VAR 15/10/2034	859,745	226,800	MERRILL LYNCH INTL AND CO CV WARRANT MPLX LP 20/12/2023	7,770,168
1,000,000	OCEAN TRAILS CLO VAR 20/07/2035	940,885	20,000	MERRILL LYNCH WARRANT ON MKS INSTRUMENTS 10/11/2023	1,603,000
1,000,000	SOUNDPOINT CLO LTD FRN 25/07/2030	878,556		投資証券	1,553,868
1,250,000	TRINITAS CLO I LTD VAR 20/07/2034	1,180,216		アメリカ	1,553,868
	アメリカ	27,094,611	47,364	COHEN STERS TAX ADVANTAGED PREFERRED SECURITIES SICAV	810,871
300,000	BELLEMADE RE LT FRN 25/06/2030 USD (ISIN US07876UAC36)	308,169	81,648	HIGHLAND OPPORTUNITIES AND INCOME FUND	742,997
150,000	BELLEMADE RE LT FRN 25/10/2030	155,936			
750,000	CASCADE FUNDING MORTGAGE TRUST 2018 VAR 25/10/2068 USD (ISIN US14727QAA31)	240,526			
265,000	CG CCRE COML MTGE TR 2014 F22 FRN 15/11/2031	46,422			
1,190,000	FANNIE MAE FRN 25/08/2028 USD (ISIN US30711XBMS6)	277,380			
940,000	FANNIE MAE VAR 25/10/2041	928,810			
820,000	FANNIE MAE VAR 25/12/2041 USD (ISIN US20754LAJ89)	806,728			
310,000	FEDERAL NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION VAR 25/11/2041	297,108			
1,120,000	FREDDIE MAC FRN 25/02/2047 USD (ISIN US35564ACC36)	1,251,290			
1,840,000	FREDDIE MAC FRN 25/06/2050	1,461,327			
1,680,000	FREDDIE MAC FRN 25/07/2049	1,812,333			
2,000,000	FREDDIE MAC FRN 25/10/2048	2,386,800			
1,470,000	FREDDIE MAC VAR 25/01/2034	1,332,604			
1,050,000	FREDDIE MAC VAR 25/01/2051	963,266			
790,000	FREDDIE MAC VAR 25/02/2042 USD (ISIN US35564KSQ30)	794,115			
1,270,000	FREDDIE MAC VAR 25/08/2033 USD (ISIN US35564KCP21)	1,145,417			
830,000	FREDDIE MAC VAR 25/10/2033	821,122			
510,000	FREDDIE MAC VAR 25/10/2050 USD (ISIN US35566ABD00)	550,018			
1,110,000	FREDDIE MAC VAR 25/11/2041	1,095,283			
880,000	FREDDIE MAC VAR 25/11/2050 USD (ISIN US35566TBE82)	944,951			
500,000	FREDDIE MAC VAR 25/12/2050 USD (ISIN US35566CBD65)	493,666			
850,000	FREDDIE MAC VAR 25/12/2050 USD (ISIN US35566CBE49)	841,137			

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	銘 柄	売 付
	金 額		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。