

アムンディ・
グラン・チャイナ・ファンド

■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／株式	
信託期間	2004年9月1日から無期限です。	
運用方針	「Amundi Funds チャイナ・エクイティ」（米ドル建）への投資を通じて、主として中国経済圏の株式に投資を行い、中長期的な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）」（円建）への投資も行います。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・グラン・チャイナ・ファンド	Amundi Funds チャイナ・エクイティ CAマネープールファンド (適格機関投資家専用)
	Amundi Funds チャイナ・エクイティ	中国経済圏の株式
	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等
組入制限	株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます）への直接投資は行いません。外貨建資産（外貨建資産を組入可能な投資信託証券を含みます）の投資割合には制限を設けません。	
分配方針	毎決算時（年2回、原則毎年1月15日および7月15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利子・配当収入と売買益（評価益を含みます）等の全額とします。分配金額は、委託会社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、分配対象収益額が少額の場合には分配を行わないこともあります。	

運用報告書（全体版）

第38期（決算日 2024年1月15日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚くお礼申し上げます。

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

今後とも一層のお引き立てを賜りますよう、よろしく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/>

<3343771・3373910>

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配額)		MSCIチャイナ10/40インデックス (税引後配当込み、円換算ベース)		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	
	税込み 分配金	期中 騰落率	(参考指数)	期中 騰落率				
	円	円	%		%	%	百万円	
34期(2022年1月17日)	10,003	0	△16.8	33,041	△13.5	0.1	98.4	4,060
35期(2022年7月15日)	9,947	0	△0.6	33,858	2.5	0.1	97.2	4,080
36期(2023年1月16日)	9,819	0	△1.3	32,190	△4.9	0.2	97.4	3,976
37期(2023年7月18日)	8,890	0	△9.5	30,907	△4.0	0.2	97.7	3,584
38期(2024年1月15日)	7,595	0	△14.6	27,701	△10.4	0.2	98.3	2,923

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注2) 参考指数は、MSCIチャイナ10/40インデックス(税引後配当込み、円換算ベース)です。ただし、設定日から2013年4月16日までの参考指数はハンセン指数(円換算ベース)、2013年4月17日から2019年6月21日までの参考指数はMSCIゴールデン・ドラゴン・インデックス(円換算ベース)でした。参考指数は連続させて指数化しております。参考指数は投資対象資産の相場を説明する代表的な指数として記載しております。MSCIゴールデン・ドラゴン・インデックスおよびMSCIチャイナ10/40インデックスは、MSCI Inc. が開発した株価指数です。同指数に関する著作権、その他知的財産権はMSCI Inc. に帰属しております。以下同じ。

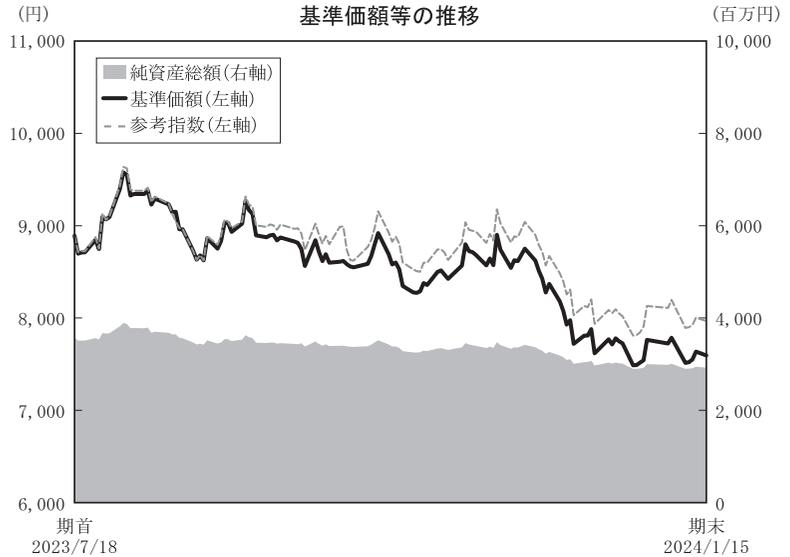
■当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		MSCIチャイナ10/40インデックス (税引後配当込み、円換算ベース)		投資信託 受益証券 組入比率	投資 証券 組入比率
	騰落率	(参考指数)	騰落率			
(期首)	円	%		%	%	%
2023年7月18日	8,890	—	30,907	—	0.2	97.7
7月末	9,398	5.7	32,777	6.1	0.2	97.1
8月末	9,031	1.6	31,437	1.7	0.2	98.6
9月末	8,599	△3.3	30,592	△1.0	0.2	97.7
10月末	8,515	△4.2	30,394	△1.7	0.2	98.5
11月末	8,276	△6.9	29,793	△3.6	0.2	98.6
12月末	7,764	△12.7	28,263	△8.6	0.2	98.4
(期末)						
2024年1月15日	7,595	△14.6	27,701	△10.4	0.2	98.3

(注) 騰落率は期首比です。

【基準価額等の推移】

第38期首	8,890円
第38期末	7,595円
既払分配金 (税込み)	0円
騰落率	△14.6%



(注1) 参考指数は、MSCIチャイナ10/40 インデックス (税引後配当込み、円換算ベース) です。

(注2) 参考指数は、2023年7月18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】

下落要因

- ①2023年8月に中国恒大集団 (チャイナ・エバーグランデ・グループ) が米国の連邦破産法第15条の適用を申請したほか、10月には碧桂園 (カントリー・ガーデン) も米ドル建債に関してデフォルト (債務不履行) の一歩手前まで追い込まれるなど、中国不動産大手の経営危機が懸念されたこと
- ②2023年12月下旬に発表された、オンラインゲームの収益化を標的とした予想外の規制措置が、中国のオンラインゲーム銘柄全般にとどまらず、コミュニケーション・サービス・セクター全体的大幅な下落につながったこと

上昇要因

- ①2023年10月に発表された、中国の2023年第3四半期のGDP (国内総生産) 成長率が予想を上回ったこと
- ②2023年11月にバイデン米大統領と習近平国家主席の会談が行われたことによる地政学的緊張の緩和への期待から、中国株式市場が反騰したこと

【投資環境】

<中国・香港株式市場>

当期の中国株式市場は大幅に下落しました。2023年第3四半期の中国株式市場は値動きの激しい展開となり、7月は堅調に推移したものの、不動産セクターのボラティリティ（価格変動性）が株価に影響をおよぼし8月は低迷しました。9月は中国経済が底打ちしたことを示す兆しがみられ、8月の総合CPI（消費者物価指数）はデフレ傾向を脱して前年同月比で小幅な上昇となり、コンセンサス予想と一致しました。また、製造業PMI（購買担当者景気指数）も小幅ながらも景気拡大を示す水準に戻りました。そうした中でも、中国株式市場からの海外の証券投資資金流出が続きました。第4四半期は、海外投資家による中国の景気と低迷が続く不動産セクターに対する懸念から、中国株式市場は引き続き下落しました。ただ、その一方で、11月に米中間の対話再開と政治的和解に向けた継続的姿勢により、投資家心理は上向きとなりました。また、米国の金融当局がハト派的姿勢に転じたことや、中国政府の不動産セクターに焦点を当てた積極的な政策措置などの追い風を受け、11月前半の中国株式市場は上昇しました。その後、大手インターネット企業や消費関連銘柄を中心に、予想を下回る2023年第4四半期の業績見通しが発表されたため、同月後半は、それまでの上昇分を吐き出す形となりました。同様の動きは12月に入っても続き、さらに同月下旬に発表された中国のオンラインゲーム開発企業に対して一段と厳しい規制を課す予想外の措置により、騰訊控股（テンセント）や網易（ネットイーズ）などが大幅に下落し、市場の足かせとなりました。

<為替市場>

当期、米ドルは円に対して上昇しました。また、米ドルと連動する香港ドルも円に対して上昇したほか、中国元も上昇しました。米ドル・円相場は、日銀による長期金利操作の柔軟化を受けても日本の長期金利は大きく上昇せず、一方米国では再びインフレ懸念の頭領や長期金利の上昇がみられ、ほぼ一本調子で上昇を続けました。その後、米国でのインフレ鎮静化の兆しが米国金利の先高観を後退させ、米ドルは年末にかけて対円で弱含みました。しかし、米国の利下げを市場が織り込み過ぎとの見方が広がり、早期利下げ期待がやや後退したのに歩調を合わせ、米ドルは対円で反発し、そのまま当期末を迎えました。

<日本短期国債市場>

当期の短期国債市場では、日銀によるマイナス金利政策のもと、TDB（国庫短期証券）3ヵ月物利回りはマイナス圏での推移を継続しました。TDB 3ヵ月物利回りは、主に海外投資家からの需要に支えられ、-0.20%前後での推移が続きましたが、一時的に債券需要が高まりマイナス幅を広げる局面もみられました。

【ポートフォリオ】

<当ファンド>

当ファンドは、中国経済圏の株式を主要投資対象とする「Amundi Funds チャイナ・エクイティ」（米ドル建）と「CAマネーブルファンド（適格機関投資家専用）」（円建）に投資することにより、その実質的な運用はそれぞれの投資先ファンドが行い、中長期的な信託財産の成長を目指し運用しました。当ファンドは「Amundi Funds チャイナ・エクイティ」（米ドル建）に90%以上投資することを基本としていることから、基本方針に従い「Amundi Funds チャイナ・エクイティ」（米ドル建）の組入比率を高位に維持しました。

（アムンディ・ジャパン株式会社）

<Amundi Funds チャイナ・エクイティ>

当ファンドの基準価額は大幅に下落しました。特に一般消費財・サービスでは景気敏感銘柄を中心に、銘柄選択がマイナスに働きました。個別銘柄では、中国最大のボルシェディーラーであるチャイナ・メイドン・オート・ホールディングスはボルシェの販売台数の大幅減少を嫌気して大きく下落したほか、スポーツウェア小売りのリー・ニンや、チャイナ・ツーリズム・グループ・デューティー・フリーなどの下落も足かせとなりました。一方で、サムソナイト・インターナショナルや、ニュー・オリエンタル・エデュケーション&テクノロジー・グループといった銘柄の堅調な株価推移がパフォーマンスを押し上げました。セクター別では、再生可能エネルギー関連の銘柄を多く組み入れている資本財・サービスでは、米国で2022年に成立したIRA（インフレ抑制法）が逆風となり、パフォーマンスの悪化につながりました。金融における配分効果もマイナスに働きました。特に、AIAグループとブルーデンシャルへのオーバーウェイトや、国営銀行である中国建設銀行や中国工商銀行などへのアンダーウェイトが足かせとなりました。

当期は、金融銘柄がファンダメンタルズ（基礎的条件）から完全にかけ離れた株価推移をみせる局面が目立ちました。利ざやが縮小し、資産の質に対する懸念もあったものの、政府の積極的な支援発言や株式市場での活発な買い支えを背景に、国営銀行銘柄はアウトパフォームしました。当期の投資行動としましては、2023年第3四半期初めに、昨今のマカオへのインバウンド旅客数が2019年の水準を上回って増加していることから、マカオを本拠とするカジノ銘柄への投資比率を引き上げました。また、市場シェアが拡大傾向にあり、割安な生活必需品銘柄への投資も増やしました。一方で、国営銀行銘柄の保有を圧縮するとともに、堅調な株価推移を受けて利益確定売りを進めたことで金融銘柄へ投資比率は縮小しました。また、OPEC（石油輸出国機構）の石油減産を背景とするエネルギー価格の値上がりを受けて、炭化水素価格の上昇持続からメリットを受けられるエネルギー銘柄への投資を拡大しました。一方でインターネット・プラットフォームとゲーム関連銘柄への投資比率を縮小しました。第4四半期初めには、新たな事業価値の伸展回復と中国のマクロ環境改善が追い風となっていた保険銘柄に注目し、投資比率を引き上げました。また、電気自動車銘柄のアンダーウェイト幅を縮小した一方で、携帯電話端末部品のサプライチェーン関係銘柄など、第4四半期の後半に向けて、若干の銘柄を新規に組み入れました。

(アムンディ・UK・リミテッド)

<CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）>

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

【今後の運用方針】

<当ファンド>

当ファンドが投資する「Amundi Funds チャイナ・エクイティ」（米ドル建）の組入比率を引き続き高位に保ちます。この目標比率は短期的な視点で判断するものではなく、継続性を重視しています。なお、「CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）」（円建）にも投資を行います。

(アムンディ・ジャパン株式会社)

<Amundi Funds チャイナ・エクイティ>

当ファンドは引き続き、一般消費財・サービス、資本財・サービス、不動産およびコミュニケーション・サービスのオーバーウェイトを継続しています。一方で、金融、情報技術、ヘルスケアおよびエネルギーをアンダーウェイトとしています。足元で続く中国の循環的な景気回復、企業の売上高や収益の上昇、海外投資家のポートフォリオにおけるポジションの低下、そして割安なバリュエーションなどの要因が、中国株式市場の上昇の呼び水となる可能性があるかと当ファンドはみています。一方で、景気回復の実現には、不動産と地方融資平台（公共性の高い都市インフラを整備する資金を調達するために、地方政府が出資・設立した投資会社）が引き続き抱える問題とそれに対する中国政府の政策対応には留意が必要と考えます。当ファンドは、中国株式市場に対して慎重な姿勢をとっていますが、オートメーション（自動化）やロボティクス（ロボット工学）、クリーンテクノロジー（地球環境問題の解決策となるような技術）のように、中国企業が世界の競合企業に対して技術上・競争上の大きな優位性を維持していると思われる銘柄に注目しています。

(アムンディ・UK・リミテッド)

<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38期 (2023年7月19日 ～2024年1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)	51円 (15) (33) (2)	0.588% (0.180) (0.381) (0.027)	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 (保 管 費 用) (監 査 費 用) (そ の 他)	1 (0) (0) (0)	0.007 (0.001) (0.005) (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 海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・ 資産の移転等に要する費用 監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 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	52	0.595	

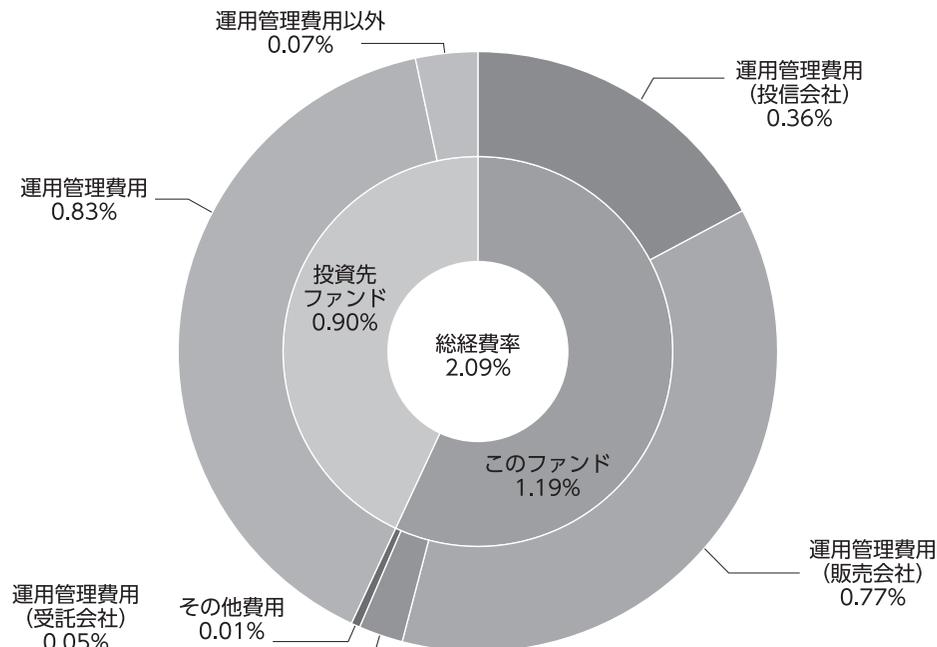
期中の平均基準価額は8,597円です。

- (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2.09%です。



総経費率 (①+②+③)	2.09%
①このファンドの費用の比率	1.19%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.83%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.07%

(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（2023年7月19日から2024年1月15日まで）

投資信託受益証券、投資証券

		買 付		売 付	
		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
外国	(ルクセンブルク) Amundi Funds チャイナ・エクイティ	千口 0.564	千米ドル 469	千口 1	千米ドル 1,479

(注1) 金額は受渡し代金です。

(注2) 単位未満は切捨てです。ただし、単位未満の場合は小数で記載しています。

■利害関係人との取引状況等（2023年7月19日から2024年1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1月15日現在）

(1) 国内（邦貨建）投資信託受益証券

銘 柄		期 首 (前期末)	当 期 末	
		口 数	口 数	評 価 額
CAマネープールファンド (適格機関投資家専用)		千口 5,967	千口 5,967	千円 5,980
合 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	5,967 1	5,967 1	5,980 <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。

(2) 外国（外貨建）投資証券

銘 柄		期 首 (前期末)	当 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) Amundi Funds チャイナ・エクイティ		千口 27	千口 26	千米ドル 19,806	千円 2,875,240
合 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	27 1	26 1	19,806 -	2,875,240 <98.3%>

(注) 邦貨換算金額は、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1月15日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投 資 信 託 受 益 証 券	5,980	0.2
投 資 証 券	2,875,240	97.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	68,316	2.3
投 資 信 託 財 産 総 額	2,949,536	100.0

(注1) 金額の単位未満は切捨てです。

(注2) 当期末における外貨建純資産 (2,889,879千円) の投資信託財産総額 (2,949,536千円) に対する比率は98.0%です。

(注3) 外貨建資産は、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1月15日現在における邦貨換算レートは、1米ドル=145.17円です。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

2024年1月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	2,963,939,221円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	68,315,962
投資信託受益証券(評価額)	5,980,342
投 資 証 券(評価額)	2,875,240,591
未 収 入 金	14,402,326
(B) 負 債	40,119,004
未 払 金	14,514,740
未 払 解 約 金	5,700,701
未 払 信 託 報 酬	19,729,551
未 払 利 息	160
そ の 他 未 払 費 用	173,852
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	2,923,820,217
元 本	3,849,472,036
次 期 繰 越 損 益 金	△ 925,651,819
(D) 受 益 権 総 口 数	3,849,472,036口
1万口当たり基準価額(C/D)	7,595円

(注記事項)

期首元本額	4,032,448,411円
期中追加設定元本額	190,142,575円
期中一部解約元本額	373,118,950円

■損益の状況

当期 自2023年7月19日 至2024年1月15日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	75,752円
受 取 利 息	99,727
支 払 利 息	△ 23,975
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 474,844,942
売 買 損 益	167,309,129
売 買 損 益	△ 642,154,071
(C) 信 託 報 酬 等	△ 19,950,572
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△ 494,719,762
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 280,368,310
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 150,563,747
(配 当 等 相 当 額)	(503,725,833)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 654,289,580)
(G) 計 (D+E+F)	△ 925,651,819
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	△ 925,651,819
追 加 信 託 差 損 益 金	△ 150,563,747
(配 当 等 相 当 額)	(503,725,833)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 654,289,580)
分 配 準 備 積 立 金	879,217,667
繰 越 損 益 金	△1,654,305,739

(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。

■分配金のお知らせ

当期の分配金につきましては、基準価額水準および市況動向等を勘案した結果、見送りとさせていただきます。

収益分配金に関する留意事項

- 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。
- 分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。
- 投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

【分配原資の内訳】

(単位：円・1万口当たり・税込み)

項 目	第38期
	(2023年7月19日～2024年1月15日)
当期分配金	—
(対基準価額比率)	(—%)
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	3,592

(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「Amundi Funds チャイナ・エクイティ」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1月12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1月12日現在）
株式

	銘柄	通貨	株数	評価額（ユーロ）
ケイマン諸島	TENCENT HOLDINGS LTD	HKD	895,900	30,131,318.18
	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	HKD	3,215,700	26,456,712.79
	PINDUODUO INC ADR	USD	157,065	21,289,107.61
中国	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	HKD	2,465,500	9,401,910.19
ケイマン諸島	MEITUAN	HKD	806,320	7,075,828.13
ルクセンブルク	SAMSONITE INTERNATIONAL SA	HKD	2,300,100	6,357,090.63
香港	AIA GROUP LTD -H-	HKD	817,200	6,046,768.24
ケイマン諸島	NETEASE INC	HKD	353,549	5,796,932.89
中国	CHINA OILFIELD SERVICES-H	HKD	6,254,000	5,659,563.50
ケイマン諸島	NETEASE SP ADR SHS	USD	67,914	5,639,732.65
	TRIP COM GROUP LTD	HKD	159,700	5,505,194.72
イギリス	PRUDENTIAL PLC	HKD	541,900	5,235,703.00
香港	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L -H-	HKD	1,051,000	4,970,006.01
ケイマン諸島	CHINA RESOURCES LAND LTD	HKD	1,632,000	4,853,149.54
中国	CHINA MERCHANTS BANK-H	HKD	1,527,000	4,665,558.80
ケイマン諸島	H WORLD GROUP LIMITED	USD	147,890	4,453,356.25
中国	BYD CO LTD-H	HKD	178,500	4,392,219.29
	SUNGROW POWER SUPPLY CO LTD	CNY	359,237	4,020,058.69
ケイマン諸島	NEW ORIENTAL EDUCATION AND TECHNOLOGY GROUP INC	HKD	547,200	3,883,023.42
	SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	HKD	425,000	3,784,088.72
	WUXI BIOLOGICS INC	HKD	1,087,500	3,741,231.83
	BAIDU INC	HKD	267,150	3,539,132.72
	NEW ORIENTAL EDUCATION AND TECHNOLOGY GROUP INC	USD	45,996	3,260,470.64
	JD COM INC	HKD	278,005	3,186,907.54
中国	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	HKD	2,194,000	3,152,177.54
香港	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD -H-	HKD	308,500	3,104,769.07
中国	KWEICHOW MOUTAI CO LTD -A-	CNY	14,808	3,097,859.35
	INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA-H	HKD	6,903,375	2,970,647.84
ケイマン諸島	MGM CHINA HOLDINGS LTD	HKD	2,446,400	2,967,045.09
	SANDS CHINA LTD	HKD	1,158,400	2,951,707.57

(注) 通貨欄の表記は以下の通りです。

HKD(香港ドル)、USD(米ドル)、CNY(中国元)

< 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（2023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1月15日現在の情報を掲載しています。

■主要な売買銘柄（2023年2月16日から2024年1月15日まで）

公社債

買		付		売		付	
銘柄	柄	金額	金額	銘柄	柄	金額	金額
			千円				千円
第11回政府保証地方公共団体金融機構債券（4年）		50,023					
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139回共同発行市場公募地方債		150,810					

（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1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1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	
地方債証券	千円 350,000	千円 351,001	% 72.4	% —	% —	% —	% —	% 72.4
合計	350,000	351,001	72.4	—	—	—	—	72.4

（注1）組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

（注2）単位未満は切捨てです。

（注3）—印は組入れなしです。

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

(B) 個別銘柄開示

国内（邦貨建）公社債

種類	銘柄	2024年1月15日現在			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
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	千円 50,000	千円 50,000	2024/8/28
	第134回共同発行市場公募地方債	0.674	100,000	100,235	2024/5/24
	第137回共同発行市場公募地方債	0.566	50,000	50,168	2024/8/23
	第139回共同発行市場公募地方債	0.544	150,000	150,598	2024/10/25
合計			350,000	351,001	

（注）額面・評価額の単位未満は切捨てです。

Amundi Funds チャイナ・エクイティ
 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・作成しております。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 (2022年7月1日～2023年6月30日)

項目	当期
	ユーロ
(a)運用報酬	8,625,238
(b)成功報酬	88,564
(c)管理費用等	1,689,600
(d)その他の費用	1,461,766
合計	11,865,168

■純資産計算書 (2023年6月30日現在)

項目	当期末
	ユーロ
資産合計	481,320,069
有価証券	471,973,814
預金	1,523,905
未収配当金	1,589,351
有価証券売却未収入金	23,627
未収追加設定金	6,208,923
為替予約取引評価勘定	449
負債合計	3,427,028
未払解約金	273,974
未払運用報酬	2,041,339
その他の負債	1,111,715
純資産	477,893,041

(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 ユーロ	数量	評価額 ユーロ
株式	471,973,814	581,548 INNER MONGOLIA YILI INDUSTRIAL GROUP CO LTD	2,078,136
代替エネルギー	8,571,454	280,000 YIHAI INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	549,540
582,437 SUNGROW POWER SUPPLY CO LTD	8,571,454	ガス・水道・マルチユーティリティ	356,153
自動車・部品	12,988,547	875,000 TOWNGAS SMART ENERGY COMPANY LIMITED	356,153
38,738 BEIJING SINOHYTEC CO LTD	415,481	一般産業	6,699,541
207,000 BYD CO LTD-H	6,052,844	213,444 HANGZHOU FIRST APPLIED MATERIAL CO LTD	1,001,626
1,212,500 GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	1,272,106	12,900 HOYMILES POWER ELECTRONICS INC	578,092
88,097 LI AUTO INC SHS A ADR	2,834,285	4,144,000 TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLDINGS LIMITED	3,291,081
237,049 NINGBO TUOPU GROUP CO LTD	2,413,831	150,420 YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL CO LTD	1,828,742
銀行	19,929,333	ヘルスケアプロバイダー	2,124,878
1,697,500 CHINA MERCHANTS BANK-H	7,068,201	184,800 HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	965,101
15,635,375 INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA-H	7,644,230	233,862 HYGIEIA HEALTHCARE HOLDINGS CO LIMITED	1,159,777
1,213,370 INDUSTRIAL BANK	2,396,088	家庭用品・住宅建設用品	15,234,602
1,990,671 PING AN BANK CO LTD-A	2,820,814	561,018 MIDEA GROUP CO	4,170,948
飲料	14,264,207	3,091,500 SAMSONITE INTERNATIONAL SA	7,991,175
212,000 CHINA RESOURCES BEER HOLDING COMPANY LTD SHS -H-	1,279,483	308,500 TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD -H-	3,072,479
17,208 KWEICHOW MOUTAI CO LTD -A-	3,671,717	エンジニアリング	7,083,910
550,000 TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	4,580,279	859,660 HANGZHOU GREAT STAR INDUSTRIAL CO LTD	2,373,391
916,000 VITASOY INTERNATIONAL HOLDINGS LTD -H-	1,045,669	102,756 JIANGSU HENGLI HYDRAULIC CO LTD	834,096
178,641 WULIANGYE YIBIN CO LTD	3,687,059	1,015,236 ZHEJIANG SANHUA INTELLIGENT CO SHS -A-	3,876,423
化学	917,305	工業用金属・採鉱	3,207,351
111,124 SKSHU PAINT CO LTD A	917,305	3,384,000 CMOG GROUP LIMITED	1,622,794
建設・資材	7,361,356	3,304,000 MMG LTD -H-	877,233
1,139,948 BEIJING ORIENTAL YUHONG WATERPROOF TECHNOLOGY CO LTD	3,921,084	122,100 ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	707,324
910,638 SZ ENVICOOOL TECH CO LTD	3,440,272	サポートサービス	7,311,228
消費者サービス	71,341,567	1,967,014 CENTRE TESTING INTERNATIONAL GROUP CO LTD -A	4,839,910
4,006,500 ALIBABA GROUP HOLDING LTD	38,051,371	179,150 KANZHUN LIMITED ADR	2,471,318
61,454 ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	4,694,950	産業輸送	11,444,601
3,075,000 CHINA EDUCATION GROUP HOLDING	2,193,937	278,179 FULL TRUCK ALLIANCE COMPANY LIMITED ADR	1,583,402
1,599,320 MEITUAN	22,877,626	1,532,299 GUANGZHOU BAIYUN INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD	2,772,604
477,400 NEW ORIENTAL EDUCATION AND TECHNOLOGY GROUP INC HKD	1,717,025	396,000 MINTH GROUP	995,824
49,913 NEW ORIENTAL EDUCATION AND TECHNOLOGY GROUP INC USD	1,806,658	3,555,000 PACIFIC BASIN SHIPPING	989,614
電気・電子機器	3,318,078	2,161,056 SHENZHEN AIRPORT	1,895,161
180,000 CHERVON HOLDINGS LIMITED	652,654	1,918,000 SITC INTERNATIONAL HOLDINGS CO	3,207,996
97,957 HESAI GROUP ADR	945,451	投資銀行・仲介サービス	3,314,429
393,600 JI MAG RARE EARTH CO LTD	550,599	2,062,400 CHINA INTL CAPITAL -H	3,314,429
55,540 JIANGSU GOODWE POWER SUPPLY TECHNOLOGY CO LTD	1,169,374	レジャー用品	17,685,010
食品製造	4,760,032	34 GOERTEK INC -A	76
618,000 CHINA MENGNIU DAIRY CO	2,132,356	142,400 KINGSOFT CORP LTD	513,824
		366,949 NETEASE INC	6,549,518
		111,023 NETEASE SP ADR SHS	9,839,427
		64,705 OPPEIN HOME GROUP INC	782,165

数量	評価額 ユーロ	数量	評価額 ユーロ
生命保険	38,718,636	不動産投資・サービス	23,014,208
758,200 AIA GROUP LTD -H-	7,014,705	1,699,500 CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD -H-	3,395,144
1,632,638 CHINA LIFE INSURANCE CO H	2,493,918	2,060,000 CHINA RESOURCES LAND LTD	7,999,345
2,818,500 PING AN INSURANCE GROUP CO-H	16,433,585	560,031 CHINA RESOURCES MIXC LIFESTYLE SERVICES LIMITED	2,548,067
548,600 PRUDENTIAL PLC	6,872,178	608,000 GREENTOWN SERVICE GROUP CO LTD	266,676
457,080 PRUDENTIAL PLC	5,904,250	671,000 HANG LUNG PROPERTIES LTD -H-	949,636
メディア	18,374,096	349,014 KE HOLDINGS INC ADR	4,750,557
313,944 CATHAY MEDIA AND EDUCATION GROUP INC	45,900	1,552,000 KWG LIVING GROUP HOLDINGS LIMITED	163,374
168,836 DADA NEXUS LTD ADR	821,741	557,000 LONGFOR GROUP HOLDINGS LIMITED	1,240,427
2,054,063 EAST MONEY INFORMATION CO LTD A	3,680,420	807,800 MIDEA REAL ESTATE HOLDING LIMITED	666,104
218,169 PINDUODUO INC ADR	13,826,035	226,000 WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	1,034,878
医療機器・サービス	297,796	小売	19,288,427
66,000 MICROPORT CARDIO FLOW MEDTECH CORPORATION	13,664	3,846,000 CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS LTD	4,071,055
395,000 VENUS MEDTECH HANGZHOU INC H	284,132	118,600 CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORPORATION LIMITED	1,470,414
石油・ガス・石炭	8,286,176	295,955 JD COM INC	4,583,136
394,600 CHINA GAS HLDGS LTD	413,998	213,291 JD.COM ADR	6,672,431
7,346,000 CHINA OILFIELD SERVICES-H	6,951,021	160,077 MINISO GROUP HOLDING LIMITED ADR	2,491,391
290,500 YANTAI JEREH	921,157	ソフトウェア・コンピューターサービス	66,425,875
パーソナルケア・薬品・食料品店	1,259,429	24,860 BAIDU ADS	3,119,691
217,750 JD HEALTH INTERNATIONAL INC	1,259,429	283,500 BAIDU INC	4,403,523
パーソナル用品	19,833,125	14,016 BILIBILI INC ADR	193,989
323,000 ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	3,024,217	812,000 CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	468,222
5,808,000 BOSIDENG INTERNATIONAL HLDGS	2,241,763	968,000 KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	1,186,549
1,170,521 LI NING CO LTD	5,770,667	365,900 KUAISHOU TECHNOLOGY	2,291,770
432,500 PRADA	2,655,795	1,199,184 LONGSHINE TECHNOLOGY CO LTD SHS A	3,522,606
162,316 PROYA COSMETICS CO LTD A	2,302,093	40,765 SEA LTD ADR	2,168,280
382,200 SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	3,341,573	305,330 SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD	1,957,555
532,500 XTEP INTERNATIONAL	497,017	1,202,300 TENCENT HOLDINGS LTD	46,631,189
医薬・バイオテクノロジー	12,022,904	19,545 WEIBO SP ADS-A REPRS.1 ACT.	234,862
1,074,500 ANTENGENE CORPORATION LIMITED	194,799	240,155 ZHIHU INCORPORATION ADR	247,639
75,000 BEIGENE LTD	942,138	テクノロジーハードウェア・機器	5,698,215
2,786,000 CHINA ANIMAL HEALTHCARE LTD	-	411,640 ESTUN AUTOMATION CO LTD	1,454,356
306,000 HUTCHMED CHINA LTD	673,938	261,884 LONGI GREEN ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	947,397
253,000 INNOVENT BIOGIGICS INC	875,914	1,588,403 SHANGHAI LIANGXIN ELECTRICAL CO LTD	2,254,803
2,034,500 KINDSTAR GLOBALGENE TECHNOLOGY INC	418,812	51,400 SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY	469,831
652,500 MEDLIVE TECHNOLOGY CO LTD	533,466	112,600 WUXI LEAD INTELLIGENT EQUIPMENT CO LTD	513,904
254,400 PHARMARON BEIJING CO LTD H	720,081	2,444 YUNENG TECHNOLOGY CO LTD	57,924
3,389,000 SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,351,684	通信機器	2,466,885
1,124,500 WUXI BIOLOGICS INC	4,938,768	431,631 LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	1,767,350
260,300 ZAI LAB LTD	639,356	9,080 WILL SEMICONDUCTOR CO LTD SHANGHAI -A	112,327
975,000 ZHAOKE OPHTHALMOLOGY LIMITED	420,804	132,697 YEALINK NETWORK TECHNOLOGY CORP LTD	587,208
213,500 ZYLOX TONBRIDGE MEDICAL TECHNOLOGY CO LTD	313,144	旅行・レジャー	33,809,271
貴金属・鉱業	4,565,189	94,386 CTRIP COM INTERNATIONAL LTD	3,027,965
3,394,000 ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	4,565,189	1,429,000 GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L -H-	8,306,877
		825,494 H WORLD GROUP LIMITED HKD	2,920,710
		108,750 H WORLD GROUP LIMITED USD	3,865,559
		1,326,000 JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLDINGS LIMITED	1,991,396
		994,000 SANDS CHINA LTD	3,104,179
		207,950 TRIP COM GROUP LTD	6,630,311
		76,524 YUM CHINA HOLDINGS INC	3,962,274
		合計	471,973,814

CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）

運用報告書

《第16期》

決算日：2023年2月15日

（計算期間：2022年2月16日～2023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 比	純 資 産 額
		税 込 分 配 金	期 中 騰 落 率		
12期（2019年2月15日）	円	円	%	%	百万円
12期（2019年2月15日）	10,055	0	△0.1	59.0	763
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

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

■ 当期中の基準価額等の推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率		債 券 組 入 率
		騰	落	
(期 首) 2022年 2月15日	円 10,035	% —	% 70.8	% 70.8
2月末	10,035	0.0		72.7
3月末	10,034	△0.0		70.4
4月末	10,033	△0.0		72.0
5月末	10,033	△0.0		76.0
6月末	10,033	△0.0		71.3
7月末	10,033	△0.0		71.8
8月末	10,032	△0.0		71.7
9月末	10,031	△0.0		71.8
10月末	10,031	△0.0		72.0
11月末	10,028	△0.1		77.3
12月末	10,024	△0.1		67.3
2023年 1月末	10,026	△0.1		70.8
(期 末) 2023年 2月15日	10,027	△0.1		74.3

(注) 騰落率は期首比です。

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	第16期 (2022年 2月16日 ～2023年 2月15日)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	1円	0.011%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（投 信 会 社）	(1)	(0.009)	委託した資金の運用の対価
（販 売 会 社）	(0)	(0.001)	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、 購入後の情報提供等の対価
（受 託 会 社）	(0)	(0.002)	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	1	0.007	その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（そ の 他）	(1)	(0.007)	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	0.018	

期中の平均基準価額は10,031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 (2022年2月16日から2023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	724,687	100,031 (660,000)

(注1) 金額は受渡し代金です。経過利子分は含まれておりません。

(注2) 単位未満は切捨てです。

(注3) ()内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

■主要な売買銘柄 (2022年2月16日から2023年2月15日まで)

公社債

買付		売付	
銘柄	金額	銘柄	金額
千円		千円	
第128回共同発行市場公募地方債	251,715	第715回東京都公募公債	100,031
第116回共同発行市場公募地方債	150,919		
第715回東京都公募公債	120,642		
第375回大阪府公募公債(10年)	100,821		
平成24年度第13回愛知県公募公債(10年)	100,590		

(注1) 金額は受渡し代金です。経過利子分は含まれておりません。

(注2) 国内の現先取引によるものは含まれておりません。

■利害関係人との取引状況等 (2022年2月16日から2023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 (2023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	当			期				末		
	額面金額	評価額	組入比率	うちBB格 以下組入比率	残存期間別組入比率					
					5年以上	2年以上	2年未満			
千円	千円	%	%	%	%	%	%			
地方債証券	350,000 (350,000)	351,667 (351,667)	74.3 (74.3)	—	—	—	—	74.3 (74.3)		
合計	350,000 (350,000)	351,667 (351,667)	74.3 (74.3)	—	—	—	—	74.3 (74.3)		

(注1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

(注2) 単位未満は切捨てです。

(注3) 一印は組入れなしです。

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

(B) 個別銘柄開示

国内(邦貨建)公社債

種類	銘柄	当			期			償還年月日
		利率	額面金額	評価額	利率	額面金額	評価額	
		%	千円	千円	%	千円	千円	
地方債証券	第375回大阪府公募公債(10年)	0.835	100,000	100,435			2023/8/29	
	第128回共同発行市場公募地方債	0.66	250,000	251,232			2023/11/24	
合計			350,000	351,667				

(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 (2023年2月15日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公 社 債	351,667	74.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	121,795	25.7
投 資 信 託 財 産 総 額	473,462	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

2023年2月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	473,462,230円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	120,619,388
公 社 債(評価額)	351,667,500
未 収 利 息	667,316
前 払 費 用	508,026
(B) 負 債	73,719
未 払 信 託 報 酬	67,433
未 払 利 息	346
そ の 他 未 払 費 用	5,940
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	473,388,511
元 本	472,090,843
次 期 繰 越 損 益 金	1,297,668
(D) 受 益 権 総 口 数	472,090,843口
1 万 口 当 り 基 準 価 額 (C/D)	10,027円

(注記事項)

期首元本額	550,147,769 円
期中追加設定元本額	168,597,032 円
期中一部解約元本額	246,653,958 円

■損益の状況

当期 自2022年2月16日 至2023年2月15日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	2,428,904円
受 取 利 息	2,536,785
支 払 利 息	△ 107,881
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 2,670,152
売 買 益	364,823
売 買 損	△ 3,034,975
(C) 信 託 報 酬 等	△ 111,094
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△ 352,342
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 506,244
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	2,156,254
(配 当 等 相 当 額)	(14,497,773)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△12,341,519)
(G) 計 (D+E+F)	1,297,668
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	1,297,668
追 加 信 託 差 損 益 金	2,156,254
(配 当 等 相 当 額)	(14,497,773)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△12,341,519)
分 配 準 備 積 立 金	6,399,260
繰 越 損 益 金	△ 7,257,846

(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。