

■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 パイオニア・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、「CAマネーブルファンド（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・サステナブル・インカム・ファンド	Amundi Funds パイオニア・インカム・オポチュニティーズ CAマネーブルファンド (適格機関投資家専用)
	Amundi Funds パイオニア・インカム・オポチュニティーズ	世界の株式と債券等
	CAマネーブルファンド（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。	

愛称：みらい定期便  
アムンディ・サステナブル・  
インカム・ファンド

運用報告書(全体版)  
第8作成期

第42期（決算日 2023年2月27日）  
第43期（決算日 2023年3月27日）  
第44期（決算日 2023年4月25日）  
第45期（決算日 2023年5月25日）  
第46期（決算日 2023年6月26日）  
第47期（決算日 2023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)	税込み 分金	期騰落 中率			
第4作成期		円	円	%	%	%	百万円
	18期 (2021年2月25日)	11,066	30	4.4	0.0	98.5	7,934
	19期 (2021年3月25日)	11,505	30	4.2	0.0	98.4	8,587
	20期 (2021年4月26日)	11,628	30	1.3	0.0	98.7	8,647
	21期 (2021年5月25日)	11,985	30	3.3	0.0	98.6	9,218
	22期 (2021年6月25日)	12,178	30	1.9	0.0	97.1	10,829
第5作成期	23期 (2021年7月26日)	11,705	35	△3.6	0.0	99.0	11,075
	24期 (2021年8月25日)	11,775	35	0.9	0.0	98.7	11,495
	25期 (2021年9月27日)	11,846	35	0.9	0.0	96.6	12,329
	26期 (2021年10月25日)	12,326	35	4.3	0.0	98.6	12,944
	27期 (2021年11月25日)	12,256	35	△0.3	0.0	98.2	13,361
	28期 (2021年12月27日)	12,201	35	△0.2	0.0	98.7	13,741
第6作成期	29期 (2022年1月25日)	12,234	35	0.6	0.0	98.8	13,946
	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
第7作成期	35期 (2022年7月25日)	13,381	50	1.4	0.0	98.4	22,077
	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
第8作成期	41期 (2023年1月25日)	13,709	55	2.2	0.0	98.3	38,860
	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

(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。

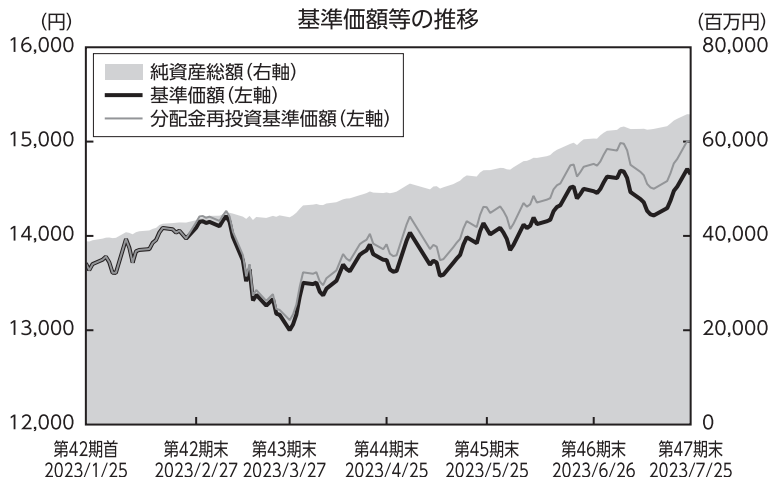
■ 当作成期中の基準価額等の推移

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42期	(期 首) 2023年1月25日	13,709	—	0.0	98.3
	1月末	13,780	0.5	0.0	98.2
	(期 末) 2023年2月27日	14,143	3.2	0.0	98.2
第43期	(期 首) 2023年2月27日	14,088	—	0.0	98.2
	2月末	14,150	0.4	0.0	98.3
	(期 末) 2023年3月27日	13,056	△7.3	0.0	97.9
第44期	(期 首) 2023年3月27日	13,001	—	0.0	97.9
	3月末	13,503	3.9	0.0	98.3
	(期 末) 2023年4月25日	13,798	6.1	0.0	98.5
第45期	(期 首) 2023年4月25日	13,743	—	0.0	98.5
	4月末	13,628	△0.8	0.0	98.3
	(期 末) 2023年5月25日	14,131	2.8	0.0	98.3
第46期	(期 首) 2023年5月25日	14,076	—	0.0	98.3
	5月末	13,969	△0.8	0.0	98.4
	(期 末) 2023年6月26日	14,529	3.2	0.0	98.1
第47期	(期 首) 2023年6月26日	14,474	—	0.0	98.1
	6月末	14,628	1.1	0.0	98.3
	(期 末) 2023年7月25日	14,708	1.6	0.0	98.5

(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42期首	13,709円
第47期末	14,653円
既払分配金 (税込み)	330円
騰落率	9.4% (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 2023年3月下旬以降、高水準の利回りと堅調な株式のリターンからエクイティリンク債がパフォーマンスに貢献したこと
- ② 3月下旬以降、エネルギーや金融、ヘルスケアなどの株式が好調なパフォーマンスとなったこと
- ③ 3月下旬以降、証券化クレジット資産が、住宅価格が底を打ったとみられることなどから恩恵を受けたこと

下落要因

- ① 3月下旬以降、株式市場が上昇したことから株式先物によるヘッジがマイナスとなったこと
- ② 2月および3月に、ハイイールド債の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 パイオニア・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 パイオニア・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>

2月はインフレ懸念、3月は欧米での金融機関の破綻などにより、株式、ハイイールド債市場は下落しました。しかし3月後半以降は、予想よりも底堅い経済指標を受け、望ましいインフレの動向を示しているとして投資家に受け止められたことから、堅調に推移しました。米国では、消費者信頼感指標の改善と、FRB（米連邦準備理事会）が年内の利上げを終了する可能性が高いとの見方から、投資家心理が好転しました。ユーロ圏では、ECB（欧州中央銀行）が利上げを継続するなか、株式市場は上昇しました。中国で経済再開後の景気回復が予想を下回っていることを受け、新たな景気刺激策が実施されることに対する期待から、投資家心理が改善しました。日本では、日銀は6月の金融政策決定会合で、金融政策の据え置きを決定しました。その結果円安基調が続き、株式市場は好調なパフォーマンスとなりました。輸出データも好調で、円安が引き続き国内製造業の競争力の支えになるとして、投資家の投資意欲を高める後押しとなりました。多くの先進国市場における金利の上昇（債券価格は下落）を受け、当作成期中の債券のリターンはやや後れをとりました。一方ハイイールド債は、スプレッド（国債との利回り格差）が縮小し市場のリスク選好が引き続き堅調であったため、好調となりました。

### <為替市場>

当作成期の米ドル/円相場は130円台で始まり、日本の金融政策の追加修正がなかったことから、日本の金利先高観が後退し、米ドル優位の展開となりました。3月に入り、米国の中堅銀行の破綻や欧州金融大手の経営不安のニュースに金融システム不安が広がりました。その結果、質への逃避としての円買いの動きに加え、急激な金利先高観の後退にともない米ドルは一時売り込まれましたが、金融システム不安が後退すると米ドルは買い戻されました。また、日銀が金融緩和維持の姿勢を明確に示したことも円安圧力となり、米ドルは対円で強含みの展開が続きました。7月に入ると、米インフレ圧力の低下や米景気後退懸念、さらには金融当局による市場介入に対する警戒感が広がり、米ドルは対円で下落し、141円台で当作成期末を迎えました。

### <日本の短期国債市場>

当作成期の短期国債市場では、日銀によるマイナス金利政策のもと、TDB（国庫短期証券）3ヵ月物利回りが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、当作成期初に-0.20%から-0.15%近辺で推移しました。3月中旬から下旬にかけては、米欧の一部銀行に対する信用不安から金融市場への不透明感が高まり、一時-0.30%近辺まで低下しましたが、その後は-0.15%から-0.10%近辺まで上昇して当作成期末を迎えました。

## 【ポートフォリオ】

### <当ファンド>

当ファンドは、米ドル建のルクセンブルク籍投資信託である「Amundi Funds パイオニア・インカム・オプチュニティーズ」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 パイオニア・インカム・オポチュニティーズ>

当作成期、当ファンドは金利上昇をとまなう厳しい経営環境でも利益が期待できる企業の株式を選好しました。金融やエネルギー、ヘルスケア・セクターなどの株式がプラスに寄与しました。債券への配分は維持したものの、スプレッドが小さく、バリュエーションに魅力がなくなった社債への配分を削減しました。また、エクイティリンク債へのエクスポージャーを維持し、当作成期は堅調な株式のリターンと高い利回り特性からパフォーマンスにプラスに寄与しました。また証券化クレジット資産は、住宅などの裏付けとなる資産が良好となったことなどからプラスに寄与しました。金利が上昇するなか、当ファンドは米国国債のポジションによって、利回りと流動性を保ちつつ慎重な姿勢を強化しました。

(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 パイオニア・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 パイオニア・インカム・オポチュニティーズ>

金利上昇にもかかわらず、経済成長と金融市場はいずれもなお底堅さをみせています。しかしながら当ファンドは、市場における楽観は、少なくとも部分的には思惑による買いであり、また3月の米国の銀行セクターの混乱を受けて金融システムに注入された追加の流動性なども背景にあるとみています。金利操作は強力な金融調節手段ではありますが、タイムラグがあり、利上げの影響が十分に顕在化していないとみています。また、米金融当局が検討している米国銀行の自己資本規制強化は最終的には景気悪化につながると考えており、当ファンドは慎重な資産配分を行っています。

(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42期～第47期 (2023年1月26日 ～2023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 )	61円 (11) (47)  ( 2 )	0.436% (0.082) (0.338)  (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 ( 1 ) ( 1 ) ( 0 )	0.010 (0.005) (0.004) (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	62	0.446	

期中の平均基準価額は13,943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。

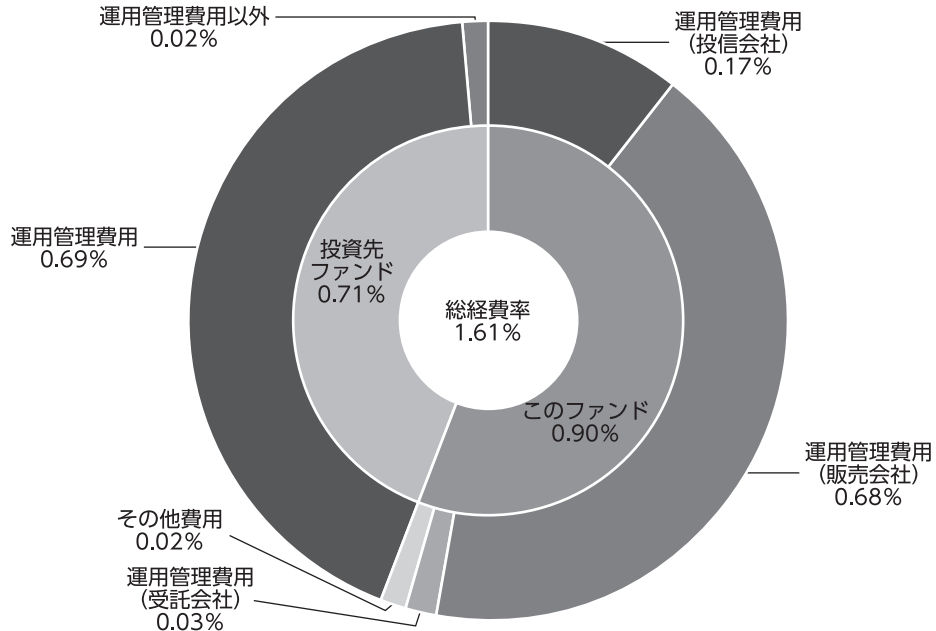
(注4) 各項目の費用は、このファンドが組入れている投資信託証券が支払った費用を含みません。

(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1.61%です。



総経費率 (①+②+③)	1.61%
①このファンドの費用の比率	0.90%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.69%
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。



■売買及び取引の状況（2023年1月26日から2023年7月25日まで）

投資信託受益証券、投資証券

決 算 期		第 42 期 ～ 第 47 期			
		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 パイオニア・インカム・オポチュニティーズ	千口 156	千米ドル 165,445	千口 -	千米ドル -

(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1月26日から2023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（2023年7月25日現在）

(1) 国内（邦貨建）投資信託受益証券

銘 柄		第7作成期末 (第41期末)	第8作成期末（第47期末）	
		口 数	口 数	評 価 額
C A 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7作成期末 (第41期末)	第8作成期末（第47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 パイオニア・インカム・オポチュニティーズ		千口 265	千口 421	千米ドル 457,301	千円 64,744,780
合 計	口 数・金 額	265	421	457,301	64,744,780
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	1	-	< 98.5% >

(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 (2023年7月25日現在)

項 目	第8作成期末 (第47期末)	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券	千円 498	% 0.0
投資証券	64,744,780	97.7
コール・ローン等、その他	1,501,508	2.3
投資信託財産総額	66,246,786	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 (64,589,974千円) の投資信託財産総額 (66,246,786千円) に対する比率は97.5%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、2023年7月25日現在における邦貨換算レートは、1米ドル=141.58円です。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第42期末 (2023年2月27日)	第43期末 (2023年3月27日)	第44期末 (2023年4月25日)	第45期末 (2023年5月25日)	第46期末 (2023年6月26日)	第47期末 (2023年7月25日)
(A) 資 産	43,598,604,767円	44,807,794,728円	49,744,995,531円	55,192,333,850円	61,987,870,724円	66,401,567,976円
コール・ローン等	1,062,936,427	1,482,736,724	1,160,777,371	1,814,201,512	2,017,138,525	1,501,506,661
投資信託受益証券(評価額)	498,856	498,856	498,856	498,856	498,856	498,806
投資証券(評価額)	42,534,132,759	43,014,604,419	48,461,600,933	53,010,347,807	59,469,284,636	64,744,780,632
未 収 入 金	-	309,954,729	122,118,371	367,285,675	500,948,707	154,781,877
そ の 他 未 収 収 益	1,036,725	-	-	-	-	-
(B) 負 債	276,836,098	864,934,291	538,188,576	1,249,076,873	1,361,955,889	649,686,789
未 払 金	-	619,791,035	244,480,942	733,312,406	1,002,826,001	309,761,398
未 払 収 益 分 配 金	169,132,641	185,900,726	196,924,384	210,771,840	230,370,592	246,792,513
未 払 解 約 金	74,349,506	27,969,200	61,606,759	265,244,247	81,233,770	44,556,974
未 払 信 託 報 酬	32,578,710	29,819,250	32,988,142	36,770,586	43,660,272	43,850,483
未 払 利 息	2,620	-	3,434	5,368	-	-
そ の 他 未 払 費 用	772,621	1,454,080	2,184,915	2,972,426	3,865,254	4,725,421
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	43,321,768,669	43,942,860,437	49,206,806,955	53,943,256,977	60,625,914,835	65,751,881,187
元 本	30,751,389,425	33,800,132,083	35,804,433,455	38,322,152,855	41,885,562,336	44,871,366,042
次 期 繰 越 損 益 金	12,570,379,244	10,142,728,354	13,402,373,500	15,621,104,122	18,740,352,499	20,880,515,145
(D) 受 益 権 総 口 数	30,751,389,425口	33,800,132,083口	35,804,433,455口	38,322,152,855口	41,885,562,336口	44,871,366,042口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,088円	13,001円	13,743円	14,076円	14,474円	14,653円

(注記事項)

作成期首元本額	28,347,429,482円
作成期中追加設定元本額	18,669,922,967円
作成期中一部解約元本額	2,145,986,407円

■ 損益の状況

項 目	第42期	第43期	第44期	第45期	第46期	第47期
	自 2023年1月26日 至 2023年2月27日	自 2023年2月28日 至 2023年3月27日	自 2023年3月28日 至 2023年4月25日	自 2023年4月26日 至 2023年5月25日	自 2023年5月26日 至 2023年6月26日	自 2023年6月27日 至 2023年7月25日
(A) 配 当 等 收 益	612,628,244円	△ 86,946円	△ 52,468円	788,347,307円	△ 76,932円	△ 83,976円
受 取 配 当 金	616,626,739	-	-	796,080,105	-	-
支 払 利 息	△ 3,998,495	△ 86,946	△ 52,468	△ 7,732,798	△ 76,932	△ 83,976
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	715,818,356	△ 3,337,734,775	2,769,142,972	723,904,452	1,898,439,081	1,095,899,136
売 買 益	1,817,037,756	1,988,123	2,780,310,103	1,953,936,738	1,905,487,721	1,917,676,903
売 買 損	△ 1,101,219,400	△ 3,339,722,898	△ 11,167,131	△ 1,230,032,286	△ 7,048,640	△ 821,777,767
(C) 信 託 報 酬 等	△ 33,371,247	△ 30,512,753	△ 33,741,664	△ 37,585,546	△ 44,615,293	△ 44,775,033
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	1,295,075,353	△ 3,368,334,474	2,735,348,840	1,474,666,213	1,853,746,856	1,051,040,127
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	2,588,156,423	3,690,476,397	135,167,010	2,644,953,105	3,844,634,108	5,418,131,625
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	8,856,280,109	10,006,487,157	10,728,782,034	11,712,256,644	13,272,342,127	14,658,135,906
(配 当 等 相 当 額)	( 10,345,024,167)	( 11,823,453,887)	( 12,798,598,251)	( 14,068,635,789)	( 15,854,564,223)	( 17,424,428,535)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 1,488,744,058)	(△ 1,816,966,730)	(△ 2,069,816,217)	(△ 2,356,379,145)	(△ 2,582,222,096)	(△ 2,766,292,629)
(G) 計 (D+E+F)	12,739,511,885	10,328,629,080	13,599,297,884	15,831,875,962	18,970,723,091	21,127,307,658
(H) 收 益 分 配 金	△ 169,132,641	△ 185,900,726	△ 196,924,384	△ 210,771,840	△ 230,370,592	△ 246,792,513
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	12,570,379,244	10,142,728,354	13,402,373,500	15,621,104,122	18,740,352,499	20,880,515,145
追 加 信 託 差 損 益 金	8,856,280,109	10,006,487,157	10,728,782,034	11,712,256,644	13,272,342,127	14,658,135,906
(配 当 等 相 当 額)	( 10,345,024,167)	( 11,823,453,887)	( 12,798,598,251)	( 14,068,635,789)	( 15,854,564,223)	( 17,424,428,535)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 1,488,744,058)	(△ 1,816,966,730)	(△ 2,069,816,217)	(△ 2,356,379,145)	(△ 2,582,222,096)	(△ 2,766,292,629)
分 配 準 備 積 立 金	4,291,946,415	4,078,747,676	3,849,664,608	4,366,410,779	5,468,087,304	6,222,463,215
繰 越 損 益 金	△ 577,847,280	△ 3,942,506,479	△ 1,176,073,142	△ 457,563,301	△ 76,932	△ 83,976

(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42期計算期間末における費用控除後の配当等収益 (597,237,425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 (10,345,024,167円) および分配準備積立金 (3,863,841,631円) より分配対象収益は14,806,103,223円 (10,000口当たり4,814円) であり、うち169,132,641円 (10,000口当たり55円) を分配金額としております。

第43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 (11,823,453,887円) および分配準備積立金 (4,264,648,402円) より分配対象収益は16,088,102,289円 (10,000口当たり4,759円) であり、うち185,900,726円 (10,000口当たり55円) を分配金額としております。

第44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 (12,798,598,251円) および分配準備積立金 (4,046,588,992円) より分配対象収益は16,845,187,243円 (10,000口当たり4,704円) であり、うち196,924,384円 (10,000口当たり55円) を分配金額としております。

第45期計算期間末における費用控除後の配当等収益 (768,753,962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 (14,068,635,789円) および分配準備積立金 (3,808,428,657円) より分配対象収益は18,645,818,408円 (10,000口当たり4,865円) であり、うち210,771,840円 (10,000口当たり55円) を分配金額としております。

第46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 (1,403,777,202円)、信託約款に規定する収益調整金 (15,854,564,223円) および分配準備積立金 (4,294,680,694円) より分配対象収益は21,553,022,119円 (10,000口当たり5,145円) であり、うち230,370,592円 (10,000口当たり55円) を分配金額としております。

第47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 (1,051,047,874円)、信託約款に規定する収益調整金 (17,424,428,535円) および分配準備積立金 (5,418,207,854円) より分配対象収益は23,893,684,263円 (10,000口当たり5,324円) であり、うち246,792,513円 (10,000口当たり55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42期	第43期	第44期	第45期	第46期	第47期
1 万口当たりの分配金 (税込み)	55円	55円	55円	55円	55円	55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42期	第43期	第44期	第45期	第46期	第47期
	(2023年1月26日 ～2023年2月27日)	(2023年2月28日 ～2023年3月27日)	(2023年3月28日 ～2023年4月25日)	(2023年4月26日 ～2023年5月25日)	(2023年5月26日 ～2023年6月26日)	(2023年6月27日 ～2023年7月25日)
当期分配金	55	55	55	55	55	55
(対基準価額比率)	(0.389%)	(0.421%)	(0.399%)	(0.389%)	(0.379%)	(0.374%)
当期の収益	55	—	—	55	—	—
当期の収益以外	—	55	55	—	55	55
翌期繰越分配対象額	4,759	4,704	4,649	4,810	5,090	5,269

(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》

- 当ファンドが投資対象とするファンドの一部において運用管理費用が2023年4月14日に引上げとなり、お客様にご負担いただく費用の上限（当ファンドの運用管理費用に投資対象ファンドの運用管理費用のうち最大のものを加算したもの）についても引上げられました。運用管理費用の変動幅につきましては下記をご覧ください。

(年率、税込)

	変更後	変更前
当ファンドの運用管理費用	0.88%	0.88%
投資対象ファンドの運用管理費用 Amundi Funds パイオニア・インカム・オポチュニティーズ CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）	<b>0.75%</b> 0.385%以内	<b>0.70%</b> 0.385%以内
実質的な運用管理費用（上限）	<b>1.63%*</b>	<b>1.58%</b>

※当ファンドの運用管理費用（年率0.88%）に投資対象ファンドの運用管理費用のうち最大のもの（年率0.75%）を加算しています。

- 2023年10月26日付でファンドの名称が「アムンディ・みらい定期便」に変更となる予定です。ファンド名称変更に伴う運用方針および商品性等の変更はございません。

## &lt; 1. 補足情報 &gt;

組入ファンド「Amundi Funds パイオニア・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、2023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）（2023年7月24日現在）

## (1) 株式

	銘柄	通貨	株数	評価額（米ドル）
イギリス	SHELL PLC	EUR	1,187,467	37,603,090.00
アメリカ	PFIZER INC	USD	735,155	27,575,664.05
オランダ	ABN AMRO GROUP N.V.	EUR	1,439,685	24,956,449.99
フランス	SANOFI	EUR	155,574	16,922,151.13
韓国	KB FINANCIAL GROUP	KRW	439,836	16,376,141.34
アメリカ	STATE STREET CORP	USD	222,302	15,839,017.50
スイス	UBS GROUP INC NAMEN AKT	CHF	636,681	13,697,128.37
アメリカ	CARDINAL HEALTH INC	USD	144,087	13,408,736.22
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	USD	89,942	12,550,506.68
日本	INPEX CORPORATION	JPY	811,000	10,279,351.63
イギリス	PERSIMMON PLC	GBP	603,581	9,183,564.52
ドイツ	HENSOLDT AG	EUR	256,968	9,168,001.52
アメリカ	TRUIST FINANCIAL CORPORATION	USD	258,999	8,676,466.50
	CISCO SYSTEMS INC	USD	156,703	8,322,496.33
	THE CIGNA GROUP	USD	28,272	8,257,120.32
	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	USD	175,629	7,992,875.79
アイルランド	CRH PLC	EUR	125,136	7,370,670.57

## (2) 債券

	銘柄	通貨	額面金額	評価額（米ドル）
アメリカ	USA 0% 30/06/2024	USD	20,296,200	19,898,668.92
カナダ	CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 22/12/2023	USD	1,306,200	14,944,560.75
アメリカ	LEVEL 3 FINANCING INC 10.5% 15/05/2030	USD	11,790,000	12,559,061.70
	USA 3% 31/07/2024	USD	12,216,800	12,108,049.34
	UNITED STATES OF AMERICA 4.375% 31/10/2024	USD	12,035,100	12,021,088.72
	WI TREASURY SEC 4.375% 30/11/2024	USD	11,764,400	11,722,923.64
	USA 4.125% 30/09/2024	USD	11,055,100	11,062,571.76
カナダ	THE TORONTO DOMINION BANK 12/04/2024	USD	77,200	8,615,906.00
スイス	UBS GROUP AG VAR PERP	USD	10,476,000	8,539,796.58
	UBS GROUP AG VAR PERP	USD	9,817,000	8,283,756.40
キュラソー	MERRILL LYNCH INTL AND CO CV WARRANT MPLX LP 20/12/2023	USD	226,800	7,933,464.00
アメリカ	USA 4.125% 31/07/2025	USD	7,819,900	7,856,122.15
イタリア	REPUBLIC OF ITALY 4.5% 01/03/2024	EUR	6,464,000	7,319,255.74

(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)、CHF (スイスフラン)、JPY (円)、GBP (英ポンド)

## < 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、2023年7月25日現在の情報を掲載しています。

### ■組入資産の明細（2023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	2023 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	350,000	350,616	75.4	—	—	—	75.4
合 計	350,000	350,616	75.4	—	—	—	75.4

(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	2023 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128回共同発行市場公募地方債	0.66	250,000	250,537	2023/11/24
	第375回大阪府公募公債（10年）	0.835	100,000	100,079	2023/8/29
合 計			350,000	350,616	

(注) 額面・評価額の単位未満は切捨てです。

## Amundi Funds パイオニア・インカム・オポチュニティーズ

決算日 2022年6月30日

(計算期間：2021年7月1日～2022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。

## ■費用の明細 (2021年7月1日～2022年6月30日)

項目	当期
	米ドル
(a)運用報酬	6,211,472
(b)成功報酬	383,806
(c)管理費用等	887,010
(d)その他の費用	1,585,785
合計	9,068,073

## ■純資産計算書 (2022年6月30日現在)

項目	当期末
	米ドル
<b>資産合計</b>	484,343,328
有価証券	465,967,865
オプション取引評価勘定(買)	1,500
預金	11,248,289
未収利息	1,988,384
未収配当金	502,916
未収追加設定金	2,311,134
先物取引評価勘定	2,323,140
為替未収入金	100
<b>負債合計</b>	8,431,187
借入金	809,956
有価証券買付未払金	2,077,023
未払解約金	413,382
為替予約取引評価勘定	3,256,262
未払運用報酬	1,428,047
その他の負債	446,517
<b>純資産</b>	475,912,141

(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 (2022年6月30日現在)

数量	評価額 米ドル	数量	評価額 米ドル
<b>株式</b>	<b>247,611,862</b>		
ベルギー	872,051	9,599 NN GROUP NV	434,929
42,107 TELENET GROUP HOLDING	872,051	388,327 STELLANTIS NV	4,783,215
パミューダ	3,420,339	14,317 X 5 RETAIL GROUP NV REGS GDR	-
376,935 BW LPG	2,781,311	ロシア	-
19,717 LAZARD LTD-CLASS A	639,028	16,006 MAGNIT PJSC	-
カナダ	3,230,118	201,545 MAGNIT SP GDR SPONSORED	-
121,269 BARRICK GOLD CORP	2,134,086	16,204 OIL COMPANY LUKOIL ADR 1 SH	-
42,700 POWER CORP OF CANADA	1,096,032	426,925 ROSNEFT OIL COMPANY GDR	-
ケイマン諸島	764,673	南アフリカ	827,913
1,714,387 HONMA GOLF LTD SHS UNITARY 144A/REGS	764,673	92,582 ROYAL BAFOKENG PLATINUM LIMITED	827,913
中国	4,676,953	韓国	16,373,901
3,348,000 BANK OF CHINA -H-	1,335,453	112,358 HANA FINANCIAL GROUP	3,405,181
144,000 PING AN INSURANCE GROUP CO-H	979,029	349,711 KB FINANCIAL GROUP	12,968,720
5,149,500 SIPONEC ENGINEERING GROUP-H	2,362,471	スペイン	2,718,815
フランス	1,633,001	36,071 ATRESMEDIA CORPORACION DE MEDIOS DE COMUNICACION SA	124,218
34,432 BNP PARIBAS	1,633,001	133,001 DISTRIB.INTEGRAL LOGISTA HOLD.	2,594,597
ドイツ	10,727,780	スイス	1,537,953
4,408 ALLIANZ SE-NOM	839,272	37,238 UBS GROUP INC NAMEN AKT	598,601
271,274 DEUTSCHE TELEKOM AG-NOM	5,373,149	2,166 ZURICH INSURANCE GROUP AG	939,352
179,214 HENSOLDT AG	4,515,359	台湾	1,033,833
アイルランド	2,066,476	99,000 ASUSTEK COMPUTER	1,033,833
10,469 WILLIS TOWERS — SHS	2,066,476	イギリス	17,663,821
イタリア	1,307,722	89,367 ASSOCIATED BRITISH FOODS	1,712,715
137,989 UNICREDIT SPA	1,307,722	1,922,089 NATWEST GROUP PLC	5,095,986
日本	21,981,500	91,641 PERSIMMON PLC	2,073,498
17,500 INABA DENKISANGYO	343,289	24,914 RIO TINTO PLC	1,487,649
57,700 KOMATSU LTD	1,277,550	280,816 SHELL PLC	7,293,973
59,200 MITSUBISHI ELECTRIC CORP	632,286	アメリカ	143,894,908
1,856,400 MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP	9,966,933	62,467 ABBVIE INC	9,588,685
71,200 SEVEN & I HOLDINGS CO LTD	2,760,372	493,761 ABRDN ASIA PACIFIC INCOME FUND INC	1,441,782
297,100 SUBARU CORP	5,273,684	18,678 ACTIVISION BLIZZARD INC	1,454,269
49,400 SUMITOMO MITSUI TRUST HLD	1,519,944	170,691 AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	1,889,549
6,100 ULVAC INC	207,442	65,820 ANGEL OAK MORTGAGE INC	854,344
メキシコ	375,817	40,655 BRIGHTSPHERE INVESTMENT GROUP	733,010
67,459 GRUPO FIN BANORTE	375,817	114,126 CABOT OIL & GAS	2,942,168
オランダ	12,504,288	98,815 CARDINAL HEALTH INC	5,165,060
501,328 ABN AMRO GROUP N.V.	5,615,874	3,882 CIGNA CORPORATION	1,023,994
5,993 EURONEXT	488,073	33,880 CISCO SYSTEMS INC	1,444,643
13,517 LYONDELLBASELL-A	1,182,197	23,346 EBAY INC	972,828
		1,554,628 ENERGY TRANSFER LP	15,530,734
		21,486 EQT CORP	738,904
		72,103 FIRSTENERGY CORP	2,768,034
		12,786 GREAT AJAX CORP REIT RG	122,873
		41,956 HARTFORD FINANCIAL SERVICES GRP	2,745,601
		10,981 HASBRO INC	899,124
		577,284 HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	7,649,013
		73,567 INTL BUSINESS MACHINES CORP	10,392,810

数量	評価額 米ドル	数量	評価額 米ドル
154,456 LADDER CAPITAL A REITS	1,627,966	500,000 MYSTIC RE IV LTD VAR 08/01/2025 USD (ISIN US62865LAB36)	484,425
21,810 LAS VEGAS SANDS	732,598	250,000 MYSTIC RE IV LTD VAR 08/01/2025 USD (ISIN US62865LAC19)	241,163
14,562 MAGELLAN MIDSTREAM PARTNERS	694,607	250,000 MYSTIC RE IV LTD VAR 10/01/2028	249,237
185,964 MARATHON OIL CORP	4,182,330	500,000 NORTHSHORE RE II LTD VAR 08/01/2027	488,000
20,266 MKS INSTRUMENTS INC	2,079,900	250,000 SAKURA RE LTD VAR 07/04/2029	246,054
302,590 MPLX PARTNERSHIP UNITS	8,817,473	500,000 SANDERS RE II LTD VAR 07/04/2028	491,450
87,015 NATL INSTRUMENTS	2,717,478	274 SECTOR RE V LTD VAR 01/03/2026 USD (ISIN US81369ADR05)	18,207
265,584 NEW RES INV	2,475,243	100,000 SECTOR RE V LTD 0% 01/03/2024 USD (ISIN US81369ACT79)	74,966
167,957 OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	9,887,629	25,000 SECTOR RE V LTD 0% 01/12/2024 USD (ISIN US81369ADB52)	71,183
3,782 OLD REPUB.INTL CORP	84,603	554 SECTOR RE V LTD 0% 01/12/2025 USD (ISIN US81369ADK51)	27,857
165,269 PBF LOGISTICS PART UNIT	2,550,101	499 SECTOR RE V LTD 0% 01/12/2025 USD (ISIN US81369ADL35)	25,091
460,486 PFIZER INC	24,170,910	ブラジル	5,099,660
2,068 PIONEER NATURAL RES	461,164	28,361 BRAZIL 10.00% 01/01/2025	5,099,660
2,763 QUALCOMM INC	352,946	カナダ	26,885,811
3,200 QURATE RETAIL INC PREFERRED	187,040	1,608,000 AAG FH LP 9.75% 144A 15/07/2024	1,928,298
47,489 RANGE RESOURCES CORPORATION	1,174,640	994,000 BOMBARDIER INC 7.875% 144A 15/04/2027	828,390
56,968 SHELL MIDSTREAM PARTNERS LP	801,255	26,300 ROYAL BANK OF CANADA 0% 01/08/2022	1,880,976
88,002 TAPESTRY INC	2,685,821	8,800 ROYAL BANK OF CANADA 0% 12/05/2023 USD (ISIN USC798406636)	1,590,952
379,201 TWO HARBORS INVESTMENT CORP REIT	1,884,629	18,600 ROYAL BANK OF CANADA 0% 12/05/2023 USD (ISIN USC798406719)	1,535,616
18,578 UNITED PARCEL SERVICE-B	3,393,365	2,700 ROYAL BANK OF CANADA 0% 15/08/2022	316,413
116,759 WELLS FARGO & CO	4,575,785	27,400 ROYAL BANK OF CANADA 0% 19/07/2022	1,140,388
<b>債券</b>	<b>165,133,492</b>	35,000 ROYAL BANK OF CANADA 0% 22/02/2023	715,050
パミュニダ	7,354,406	6,300 ROYAL BANK OF CANADA 0% 23/05/2023	1,659,609
24,550 ALTURAS RE LTD VAR 12/09/2023	679	37,000 ROYAL BANK OF CANADA 0% 23/06/2023	1,230,620
250,000 ALTURAS RE LTD 0% 31/12/2024	-	5,600 ROYAL BANK OF CANADA 0% 27/02/2023	919,296
300,000 BONANZA RE LTD VAR 22/02/2028	296,778	4,900 ROYAL BANK OF CANADA 0% 28/02/2023	1,133,174
250,000 BONANZA RE LTD VAR 23/12/2024	246,750	19,200 ROYAL BANK OF CANADA 0% 31/03/2023	875,520
500,000 CITRUS RE LTD VAR 07/06/2024	468,750	42,300 THE TORONTO DOMINION BANK (CANADA) 0% 02/05/2023	2,386,143
150,000 EDEN RE II LTD 0% 21/03/2025 USD (ISIN US27955HAA86)	122,400	9,700 THE TORONTO DOMINION BANK (CANADA) 0% 11/04/2023	1,702,156
2,500 EDEN RE II LTD 0% 22/03/2023 USD (ISIN US27954TAA34)	6,410	40,700 THE TORONTO DOMINION BANK (CANADA) 0% 20/12/2022	1,824,581
600,000 FLOODSMART RE LTD VAR 01/03/2024	553,620	63,300 THE TORONTO DOMINION BANK (CANADA) 0% 21/03/2023	4,532,849
250,000 FLOODSMART RE LTD VAR 27/02/2023	235,100	3,400 THE TORONTO DOMINION BANK (CANADA) 0% 22/02/2023	685,780
250,000 FOUR LAKES RE LTD VAR 05/01/2024	248,123	ケイマン諸島	12,554,392
250,000 FOUR LAKES RE LTD VAR 05/01/2027	247,875	34,700 MIZUHO MARKETS PLC 0% 05/06/2023	3,589,089
250,000 HERBIE RE LTD VAR 08/01/2030	253,062	8,200 MIZUHO MARKETS PLC 0% 07/07/2023	952,516
250,000 KILIMANJARO III RE LTD VAR 20/04/2026 USD (ISIN US49407PAH38)	244,075	43,000 MIZUHO MARKETS PLC 0% 16/06/2023	1,460,086
250,000 KILIMANJARO III RE LTD VAR 20/04/2026 USD (ISIN US49407PAK66)	245,050	11,500 MIZUHO MARKETS PLC 0% 23/05/2023 USD (ISIN XS2482411951)	1,405,760
250,000 KILIMANJARO III RE LTD VAR 21/04/2025 USD (ISIN US49407PAE07)	243,800	15,600 MIZUHO MARKETS PLC 0% 23/05/2023 USD (ISIN XS2482501868)	1,299,581
250,000 KILIMANJARO III RE LTD VAR 21/04/2025 USD (ISIN US49407PAF71)	243,375	13,500 MIZUHO MARKETS PLC 0% 30/06/2023	1,473,916
240,000 LIMESTONE RE LTD 0% 01/03/2024 USD (ISIN XS2096788455)	8,088		
10,000 LIMESTONE RE LTD 0% 09/09/2022 USD (ISIN XS1924351379)	-		
250,000 MATTERHORN RE LTD VAR 07/12/2024 USD (ISIN US577092AL35)	246,588		
500,000 MATTERHORN RE LTD VAR 07/12/2024 USD (ISIN US577092AM18)	492,275		
300,000 MERNA REINSURANCE II LTD VAR 10/07/2028	288,600		
250,000 MONA LISA RE LTD VAR 08/07/2025	245,375		

数量	評価額 米ドル	数量	評価額 米ドル
8,500 MIZUHO MARKETS PLC 13.12% 09/05/2023	1,141,104	19,168,000 RUSSIA 7.70% 23/03/2023	17,506
250,000 RESIDENTIAL REINS VAR 06/12/2024 USD (ISIN US76120AAC62)	250,663	18,298,000 RUSSIA 8.15% 03/02/2027	16,710
250,000 RESIDENTIAL REINSURANCE VAR 06/12/2025	243,563	シンガポール	1,421,043
250,000 RESIDENTIAL REINSURANCE 2021 LTD VAR 06/12/2025	244,263	700,000 EASTON RE PTE LTD VAR 08/01/2027	689,535
250,000 VITALITY RE X LTD VAR 10/01/2023	249,038	500,000 FIRST COAST RE II PTE LTD VAR 07/04/2025	484,258
250,000 VITALITY RE XI LTD VAR 09/01/2025 USD (ISIN US92851AAB08)	244,813	250,000 TORREY PINES RE PTE LTD VAR 07/06/2029	247,250
チェコ	4,252,733	南アフリカ	2,264,073
101,530,000 CZECH REPUBLIC 5.70% 25/05/2024	4,252,733	44,244,990 SOUTH AFRICA 8.25% 31/03/2032	2,264,073
エジプト	5,591,318	スペイン	1,278,000
4,420,000 EGYPT 5.875% 144A 16/02/2031	2,760,290	1,600,000 BANCO SANTANDER SA VAR 22/11/2032	1,278,000
4,345,000 EGYPT 7.053% 144A 15/01/2032	2,831,028	トリニダード・トバゴ	492,827
フランス	2,395,533	519,000 TRINIDAD ET TOBAGO 4.50% 04/08/2026	492,827
1,500,000 BPCE SA VAR 144A 19/10/2032	1,210,185	イギリス	30,727,452
1,200,000 BPCE SA 4.875% 144A 01/04/2026	1,185,348	58,700 GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL BANK 0% 20/01/2023	653,331
ハンガリー	980,464	12,100 GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL BANK 0% 20/12/2022	1,365,243
244,000,000 REPUBLIC OF HUNGARY 4.50% 27/05/2032	494,487	117,700 GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL BANK 0% 23/01/2023	2,471,700
237,000,000 REPUBLIC OF HUNGARY 4.75% 24/11/2032	485,977	62,100 GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL BANK 0% 23/12/2023	1,861,758
ルクセンブルク	1,305,911	40,400 GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL BANK 0% 26/08/2022	1,836,584
1,370,000 JBS USA LUX SA 5.75% 144A 01/04/2033	1,305,911	99,900 GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL BANK 0% 27/02/2023	1,843,155
マーシャル諸島	831,536	4,100 GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL 0% 12/05/2023	1,552,588
836,000 DANAOS CORP 8.50% 144A 01/03/2028	831,536	50,400 GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL 0% 13/03/2023	2,532,348
オランダ	17,472,279	4,600 GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL 0% 27/02/2023	2,124,165
11,700 BNP PARIBAS ISSUANCE BV 0% 02/06/2023	1,380,483	1,546,000 LLOYDS BANKING GRP PLC VAR PERPETUAL	1,514,415
22,700 BNP PARIBAS ISSUANCE BV 0% 30/06/2023	683,270	2,196,000 NATWEST GROUP PLC VAR PERPETUAL USD (ISIN US780099CK11)	2,184,691
25,200 BNP PARIBAS ISSUANCE BV 0% 31/01/2023	795,060	2,797,000 STANDARD CHARTERED PLC VAR 144A 12/01/2033	2,308,000
2,318,000 ING GROUP NV VAR PERPETUAL USD (ISIN US456837AF06)	2,190,440	45,100 THE TORONTO DOMINION BANK 0% 10/03/2023	2,001,087
19,700 JP MORGAN STRUCTURED PRODUCTS BV 0% 05/07/2022	624,687	83,900 UBS AG LONDON BRANCH 0% 20/01/2023	1,453,987
23,800 JP MORGAN STRUCTURED PRODUCTS BV 0% 05/10/2022	977,704	37,600 UBS AG LONDON BRANCH 0% 21/03/2023	1,214,480
115,200 JP MORGAN STRUCTURED PRODUCTS BV 0% 07/09/2022	1,811,474	8,400 UBS AG LONDON BRANCH 0% 23/05/2023 USD (ISIN XS2482399487)	1,335,516
22,000 JP MORGAN STRUCTURED PRODUCTS BV 0% 17/10/2022	694,760	3,700 UBS AG LONDON BRANCH 0% 23/05/2023 USD (ISIN XS2482401564)	1,372,996
16,000 JP MORGAN STRUCTURED PRODUCTS BV 0% 19/07/2022	1,268,640	61,600 UBS AG LONDON BRANCH 0% 29/11/2022	1,101,408
8,600 JP MORGAN STRUCTURED PRODUCTS BV 0% 20/01/2023	1,202,280	アメリカ	44,174,891
120,800 JP MORGAN STRUCTURED PRODUCTS BV 0% 22/02/2023	4,009,473	885,000 ALLIED UNIVERSAL HOLDCO LLC/ALLIED UNIVERSAL FINANCE CORP 9.75% 144A 15/07/2027	749,834
5,600 JP MORGAN STRUCTURED PRODUCTS BV 0% 22/11/2022	582,843	1,500,000 AMERICAN AIRLINES PASS THROUGH TRUST 3.95% 11/07/2030	1,233,570
1,500,000 LUNDIN ENERGY FINANCE BV 3.10% 144A 15/07/2031	1,251,165	540,000 AMERICAN AXLE AND MANUFACTURING INC 6.25% 15/03/2026	497,075
ロシア	51,163		
18,557,000 RUSSIA 7.00% 16/08/2023	16,947		

数量	評価額 米ドル	数量	評価額 米ドル
1,909,000 APX GROUP INC 6.75% 144A 15/02/2027	1,796,503	150,000 HOME RE 2020 LTD FRN 25/10/2028 USD (ISIN USG4581MAA11)	17,786
1,490,000 AUTONATION INC 3.85% 01/03/2032	1,285,825	200,000 HOME RE 2020 LTD FRN 25/10/2030	202,247
390,000 BRITISH AIRWAYS PASS THRU CERTIFICATES SERIES 2020 1B 8.375% 144A 15/11/2028	210,173	1,080,000 HOME RE 2021 2 LTD VAR 25/01/2034 USD (ISIN US43730VAE83)	981,875
500,000 CAPE LOOKOUT RE LTD VAR 22/03/2028	496,750	500,000 OAKTOWN RE II LTD FRN 25/07/2028 USD (ISIN BMG6713GAA06)	103,002
1,970,000 CAPITAL ONE FINANCIAL CORP VAR 10/05/2033	1,938,026	730,000 OAKTOWN RE LTD FRN 25/10/2030 USD (ISIN US67401JAC62)	743,388
14,900 CHESAPEAKE ENERGY CORP 0% 06/03/2023	1,027,237	150,000 RADNOR RE 2018-1 LTD FRN 25/03/2028 USD (ISIN USG73412AA90)	5,888
12,100 CITIGROUP GLOBAL MARKETS INC 0% 06/07/2022	471,295	ケイマン諸島	8,015,654
22,800 CITIGROUP GLOBAL MARKETS INC 0% 17/10/2022	701,556	1,000,000 ABPCI DIRECT LENDING FUND CO LLC VAR 20/04/2031	926,148
7,300 CITIGROUP GLOBAL MARKETS INC 0% 18/10/2022	1,617,534	500,000 CHENANG PARK CLO LTD FRN 15/04/2030	450,489
675,000 CLEAR CHANNEL OUTDOOR HOLDINGS INC 7.50% 144A 01/06/2029	488,336	1,000,000 GOLDENTREE LOAN MANAGEMENT FRN 20/04/2034	931,122
195,000 CLEAR CHANNEL OUTDOOR HOLDINGS INC 7.75% 144A 15/04/2028	142,114	1,000,000 ICG US CLO LTD VAR 28/07/2034	875,355
696,000 DEALER TIRE LIC DT ISSUER LIC 8.00% 144A 01/02/2028	602,423	1,000,000 NEUBERGER BERMAN CLO VAR 17/07/2035	927,758
1,020,000 DELEK LOGISTICS PARTNERS LP 6.75% 15/05/2025	955,679	1,000,000 OCEAN TRAILS CLO VAR 15/10/2034	898,473
768,000 ENERGY TRANSFER LP VAR PERPETUAL	580,209	1,000,000 OCEAN TRAILS CLO VAR 20/07/2035	949,013
1,028,000 LSF11 A5 HOLDCO LLC 6.625% 144A 15/10/2029	867,262	1,000,000 SOUNDPOINT CLO LTD FRN 25/07/2030	879,598
1,445,000 LUMEN TECHNOLOGIES INC 5.625% 01/04/2025	1,372,577	1,250,000 TRINITAS CLO I LTD VAR 20/07/2034	1,177,698
11,265,000 LUMEN TECHNOLOGIES INC 7.60% 15/09/2039	8,906,446	ルクセンブルク	500,000
11,193,000 LUMEN TECHNOLOGIES INC 7.65% 15/03/2042	8,625,661	500,000 ROSY BLUE CARAT 6.25% 15/12/2025	500,000
1,056,000 MINERVA MERGER 6.50% 144A 15/02/2030	882,330	オランダ	792,189
19,000 MIZUHO BANK LTD NEY YORK BRANCH 0% 21/03/2023	2,095,025	17,800 BNP PARIBAS ISSUANCE BV 0% 03/04/2023	792,189
1,980,000 MORGAN STANLEY VAR 20/04/2037	1,922,917	アメリカ	23,217,547
1,711,000 PAR PHARMACEUTICAL COS INC 7.50% 144A 01/04/2027	1,302,465	300,000 BELLEMADE RE LT FRN 25/06/2030 USD (ISIN US07876UAC36)	294,199
980,000 PARTY CITY HOLDINGS 8.75% 144A 15/02/2026	660,941	150,000 BELLEMADE RE LT FRN 25/10/2030 USD (ISIN US07877KAJ97)	150,244
1,150,000 PROVIDENT FUNDING ASSOCIATES LP PFG FINANCE CORP 6.375% 144A 15/06/2025	1,036,495	150,000 BELLEMADE RE 2018 3 LTD FRN 25/10/2027 USD (ISIN USU0729PAB77)	48,149
976,000 SYLVAMO CORPORATION 7.00% 144A 01/09/2029	908,188	750,000 CASCADE FUNDING MORTGAGE TRUST 2018 VAR 25/10/2068 USD (ISIN US14727QAA31)	330,082
992,000 WINDSTREAM ESCROW LLC 7.75% 144A 15/08/2028	800,445	265,000 CG CCRE COML MTGE TR 2014 F22 FRN 15/11/2031	46,800
その他債券	3,086,031	1,810,000 FEDERAL NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION FRN 25/07/2029	1,935,365
カナダ	2,121,940	1,190,000 FEDERAL NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION FRN 25/08/2028 USD (ISIN US30711XBM56)	393,721
13,800 ROYAL BANK OF CANADA 10.51% 20/12/2022 CV	1,520,140	940,000 FEDERAL NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION VAR 25/10/2041	790,684
5,100 ROYAL BANK OF CANADA 13.89% 18/10/2022 CV	601,800	310,000 FEDERAL NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION VAR 25/11/2041	259,895
アメリカ	964,091	820,000 FEDERAL NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION VAR 25/12/2041 USD (ISIN US20754LAJ89)	675,426
1,100,900 REDWOOD TRUST INC 7.75% 15/06/2027 CV	964,091	1,840,000 FREDDIE MAC FRN 25/06/2050	1,666,629
その他証券	39,576,250	2,000,000 FREDDIE MAC FRN 25/10/2048 USD (ISIN US35563XBE13)	2,151,920
バミューダ	7,050,860	1,470,000 FREDDIE MAC VAR 25/01/2034 USD (ISIN US35564KJB61)	1,100,654
1,000,000 BELLEMADE RE LTD FRN 25/10/2030 USD (ISIN US07877KAG58)	1,013,718	1,050,000 FREDDIE MAC VAR 25/01/2051 USD (ISIN US35564KBE82)	823,268
1,280,000 EAGLE RE 2021-1 LTD FRN 25/10/2030 USD (ISIN US269820AD87)	600,025		
2,110,000 EAGLE RE 2021-1 LTD FRN 25/10/2030 USD (ISIN US269820AH91)	2,142,816		
500,000 EAGLE RE 2021-1 LTD FRN 25/11/2028	171,426		
1,100,000 EAGLE RE 2021-1 LTD VAR 25/10/2033	1,068,689		

数量		評価額 米ドル
790,000	FREDDIE MAC VAR 25/02/2042 USD (ISIN US35564KSQ30)	684,524
1,270,000	FREDDIE MAC VAR 25/08/2033 USD (ISIN US35564KCP21)	984,021
830,000	FREDDIE MAC VAR 25/10/2033	692,742
510,000	FREDDIE MAC VAR 25/10/2050 USD (ISIN US35566ABD00)	517,023
1,090,000	FREDDIE MAC VAR 25/10/2050 USD (ISIN US35566ABE82)	1,289,942
1,110,000	FREDDIE MAC VAR 25/11/2041 USD (ISIN US35564KNE54)	935,238
880,000	FREDDIE MAC VAR 25/11/2050 USD (ISIN US35565TBE82)	842,046
500,000	FREDDIE MAC VAR 25/12/2050 USD (ISIN US35566CBD65)	420,485
850,000	FREDDIE MAC VAR 25/12/2050 USD (ISIN US35566CBE49)	727,391
200,000	GENWORTH MORTGAGE INSURANCE CORP FRN 25/10/2030 USD (ISIN US89600MAE84)	202,334
800,000	HOME RE LTD FRN 25/10/2030 USD (ISIN US43731WAD74)	810,684
540,000	MOSAIC SOLAR LOANS 2017 20LLC 6.91% 20/04/2046	262,523
130,000	MULTIFAMILY CONNECTICUT AVENUE VAR 25/01/2051 USD (ISIN US35563FAC59)	127,033
1,382,000	MULTIFAMILY CONNECTICUT AVENUE VAR 25/11/2051 USD (ISIN US35563GAA76)	1,214,250
2,000,000	OCTANE RECEIVABLES TRUST 2022 1 7.33% 20/12/2029	1,953,541
570,000	TRICON AMERN HOMES 2017-SFR2 TRUST 4.882% 17/07/2038	555,507
200,000	VERUS SECURITIZATION TRUST 2020 1 6.00% 25/04/2060	194,250
140,000	VERUS SECURITIZATION TRUST 5.75% 25/04/2060	136,977
	<b>ワラント、権利</b>	<b>8,563,651</b>
	キュラソー	8,563,651
6,000	MERRILL LYNCH INTERNATIONAL & CO CV WARRANT 01/08/2022	2,252,580
12,600	MERRILL LYNCH INTERNATIONAL CO CV WARRANT 01/08/2022	2,237,004
72,100	MERRILL LYNCH INTERNATIONAL CO CV WARRANT 28/09/2022	1,363,411
13,500	MERRILL LYNCH INTERNATIONAL WARRANT ON ALNYLAM 23/02/2023	1,863,000
7,200	MERRILL LYNCH INTL AND CO CV WARRANT DARDEN RESTAU 17/02/23	847,656
	<b>投資証券</b>	<b>1,996,579</b>
	アメリカ	1,996,579
53,964	COHEN STERS TAX ADVANTAGED PREFERRED	1,028,014
86,248	HIGHLAND INCOME FUND	968,565
	<b>合計</b>	<b>465,967,865</b>

## 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 騰 落 中 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	率	
(期 首) 2022年 2月15日	円 10,035		% —	% 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	
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
1万口当たり基準価額(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 損 益	364,823
売 買 損 益	△ 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。