

■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・みらい定期便	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。	

アムンディ・みらい定期便

運用報告書(全体版)
第9作成期

第48期（決算日 2023年8月25日）
第49期（決算日 2023年9月25日）
第50期（決算日 2023年10月25日）
第51期（決算日 2023年11月27日）
第52期（決算日 2023年12月25日）
第53期（決算日 2024年1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/>

< 3367962・3396768 >

■最近5作成期の運用実績

	決算期	基準価額			投資信託 受益証券 組入比率	投資証券 組入比率	純資産 総額
		(分配落)	税込 分配 金	騰落 率			
		円	円	%	%	%	百万円
第5 作成期	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
	29期 (2022年1月25日)	12,234	35	0.6	0.0	98.8	13,946
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

(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。

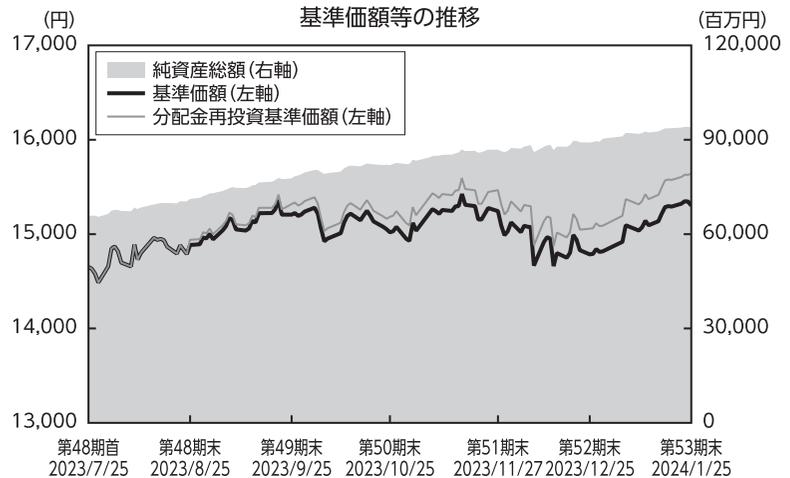
■ 当作成期中の基準価額等の推移

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48期	(期 首) 2023年7月25日	14,653	—	0.0	98.5
	7月末	14,657	0.0	0.0	98.7
	(期 末) 2023年8月25日	14,939	2.0	0.0	98.3
第49期	(期 首) 2023年8月25日	14,884	—	0.0	98.3
	8月末	15,003	0.8	0.0	98.0
	(期 末) 2023年9月25日	15,262	2.5	0.0	97.9
第50期	(期 首) 2023年9月25日	15,207	—	0.0	97.9
	9月末	15,239	0.2	0.0	98.1
	(期 末) 2023年10月25日	15,073	△0.9	0.0	98.7
第51期	(期 首) 2023年10月25日	15,018	—	0.0	98.7
	10月末	14,928	△0.6	0.0	98.4
	(期 末) 2023年11月27日	15,298	1.9	0.0	98.7
第52期	(期 首) 2023年11月27日	15,243	—	0.0	98.7
	11月末	15,029	△1.4	0.0	98.5
	(期 末) 2023年12月25日	14,840	△2.6	0.0	98.5
第53期	(期 首) 2023年12月25日	14,785	—	0.0	98.5
	12月末	14,817	0.2	0.0	97.4
	(期 末) 2024年1月25日	15,357	3.9	0.0	99.0

(注) 期末基準価額は当該期の分配金込み、騰落率は各期首比です。

【基準価額等の推移】

第48期首	14,653円
第53期末	15,302円
既払分配金 (税込み)	330円
騰落率	6.7% (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、2023年7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 当作成期半ば以降、株式とエクイティリンク債が、堅調な株式相場を背景にパフォーマンスに貢献したこと
- ② 当作成期後半の金利低下を受けて、米国政府系機関のモーゲージ担保証券（資産担保証券）や米国国債の価格が上昇したこと

下落要因

- ① 当作成期半ば以降、株式市場が堅調だったことから、株式先物によるヘッジがマイナスとなったこと
- ② 当作成期後半の長期金利が低下（債券価格は上昇）した場面で、日本国債先物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>**

先進国市場で長期金利が上昇（債券価格は下落）し、中国の景気減速懸念が市場センチメントを悪化させたため、当作成期は株式と債券のリターンの低迷で始まりました。先進国市場でデータが弱含みとなったことから、世界経済の成長速度をめぐる不透明感に投資家も身構えました。加えて、主要中央銀行の政策とインフレが注目される中、高金利長期化の見通しにより投資家の懸念が燃りました。しかし当作成期が進むにつれ、インフレの持続性の低下が報じられ、これに応じて主要中央銀行の金利政策が引き締めからより緩和的なものへと転換すると、投資家のセンチメントが改善して株式、債券が共に上昇しました。米国では、FRB（米連邦準備理事会）が12月に政策金利を据え置くとともに、2024年に0.75%の利下げを実施する予想を公表しました。ECB（欧州中央銀行）も政策金利を据え置いたものの、成長率とインフレ率の見通しを引き下げました。日本では好調な企業業績と円安を背景に、市場センチメントが押し上げられました。また、米国では長期金利が2023年10月に2007年以来の高水準に達した後、低下して当作成期末を迎えました。この金利の低下は国債のリターンを下支えし、投資家のリスク選好が再び強まったことから、ハイイールド債と投資適格債がともに堅調に推移しました。

<為替市場>

当作成期の米ドル／円相場は141円台で始まり、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台頭や長期金利の上昇がみられたことで、米ドルが上昇しました。米ドルは、そのままほぼ一本調子の上昇を続けましたが、米国でのインフレ鎮静化の兆しが米金利先高観を後退させ、米ドルは年末にかけて対円で弱含みました。しかしその後、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するのに歩調を合わせ、米ドルは対円で反発し、147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、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、年末前後には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、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 パイオニア・インカム・オポチュニティーズ>

当作成期、当ファンドはより質の高い国債や政府機関発行の債券への配分に重点を置き、信用リスクの低減

を維持しながら、株式エクスポージャーを引き下げました。株式エクスポージャーは、堅固なファンダメンタルズ（基礎的条件）と魅力的なバリュエーションを持つ高配当の銘柄に重点を置いています。パフォーマンスに貢献したのは、株式、エクイティリンク債、米国政府系機関のモーゲージ担保証券（資産担保証券）、米国国債などでした。一方、米国株式指数が堅調だったため、株式先物によるヘッジがマイナス要因となりました。株式先物によるヘッジは引き続きリスク削減の手段であり、エクイティリンク債のポジションにおけるリスクも低減するように調整を行いました。

（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>

2023年は景気後退に陥ることはなく、市場のリターンは好調でしたが、狭い部分に限定されるものでもありました。このことは特に米国株式市場に当てはまり、超大型7銘柄が時価総額加重平均指数のパフォーマンスをけん引しました。市場は経済的な観点から、過熱もせず冷え込みもしない適温相場シナリオを織り込んでいますが、当ファンドは、新たな年に入っても、引き続き景気後退のリスクは懸念要因であるとみています。また、世界経済が減速し、サプライチェーンの正常化が継続すれば、インフレはさらに沈静化する可能性が高いとみています。主要中央銀行が早期の利下げに消極的であること、およびインフレ再加速のリスクがあることから、利下げは今年の下半期にかけて実施されると予想しています。当ファンドはディフェンシブなポジションを維持しており、幅広い地域と資産クラスへの投資を通じて、引き続き魅力的なインカムを獲得する機会を柔軟に活用していきます。

（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48期～第53期 (2023年7月26日 ～2024年1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)	66円 (12) (51) (2)	0.442% (0.083) (0.343) (0.017)	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 委託した資金の運用の対価 交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、 購入後の情報提供等の対価 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) そ の 他 費 用 (監 査 費 用) (印 刷 費 用) (そ の 他)	1 (1) (0) (0)	0.008 (0.004) (0.002) (0.002)	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	67	0.450	

期中の平均基準価額は14,945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。

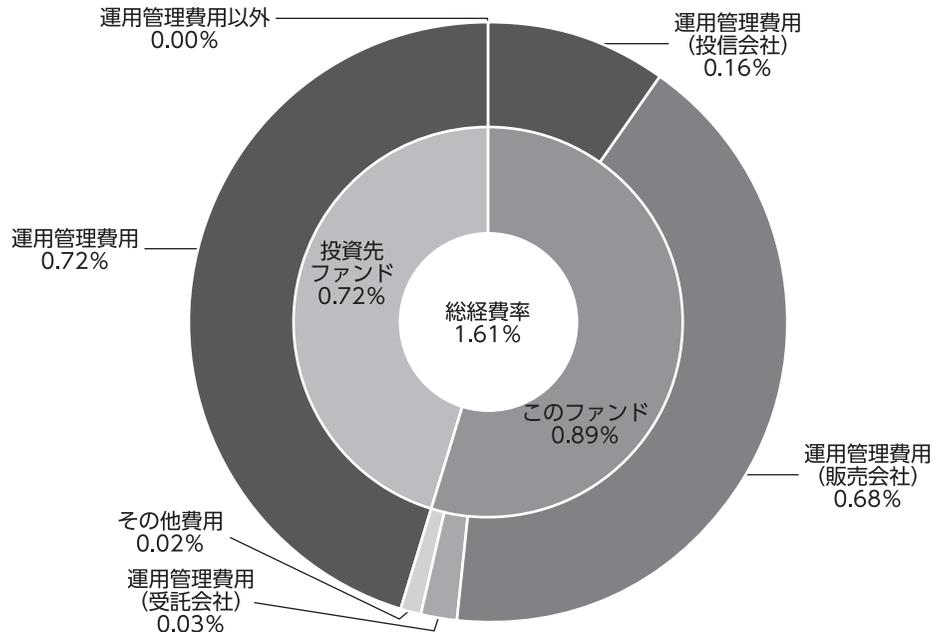
(注4) 各項目の費用は、このファンドが組入れている投資信託証券が支払った費用を含みません。

(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	0.89%
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（2023年7月26日から2024年1月25日まで）

投資信託受益証券、投資証券

決 算 期		第 48 期 ～ 第 53 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 161	千米ドル 170,764	千口 1	千米ドル 1,077

(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7月26日から2024年1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1月25日現在）

(1) 国内（邦貨建）投資信託受益証券

銘 柄		第8作成期末 (第47期末)	第9作成期末（第53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8作成期末 (第47期末)	第9作成期末（第53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 421	千口 581	千米ドル 628,262	千円 92,894,920
合 計	口 数・金 額	421	581	628,262	92,894,920
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	1	-	<99.0%>

(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1月25日現在)

項 目	第9作成期末 (第53期末)	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券	千円 498	% 0.0
投資証券	92,894,920	98.2
コール・ローン等、その他	1,657,309	1.8
投資信託財産総額	94,552,727	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 (92,974,516千円) の投資信託財産総額 (94,552,727千円) に対する比率は98.3%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1月25日現在における邦貨換算レートは、1米ドル=147.86円です。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第48期末 (2023年8月25日)	第49期末 (2023年9月25日)	第50期末 (2023年10月25日)	第51期末 (2023年11月27日)	第52期末 (2023年12月25日)	第53期末 (2024年1月25日)
(A) 資 産	71,947,866,664円	78,159,881,567円	82,709,959,917円	87,367,409,408円	90,171,378,888円	94,632,110,201円
コール・ローン等	1,767,088,309	2,040,578,641	1,749,266,536	1,674,494,886	2,111,945,732	1,577,712,355
投資信託受益証券(評価額)	498,806	498,756	498,707	498,557	498,557	498,557
投資証券(評価額)	69,975,424,518	76,117,862,680	80,829,812,627	85,692,415,965	87,793,826,125	92,894,920,215
未 収 入 金	204,855,031	-	130,382,047	-	265,108,474	158,979,074
そ の 他 未 収 収 益	-	941,490	-	-	-	-
(B) 負 債	772,405,449	430,990,669	807,502,748	525,154,760	1,048,100,006	815,407,482
未 払 金	408,811,293	-	260,547,683	-	530,948,461	79,583,560
未 払 収 益 分 配 金	263,014,886	281,133,935	299,949,565	313,346,855	331,541,560	337,204,599
未 払 解 約 金	48,924,371	92,437,976	186,181,658	140,768,034	121,852,539	325,081,844
未 払 信 託 報 酬	50,788,046	55,631,872	58,097,567	67,239,875	59,021,538	68,505,979
未 払 利 息	5,277	6,093	5,223	5,000	6,249	4,711
そ の 他 未 払 費 用	861,576	1,780,793	2,721,052	3,794,996	4,729,659	5,026,789
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	71,175,461,215	77,728,890,898	81,902,457,169	86,842,254,648	89,123,278,882	93,816,702,719
元 本	47,820,888,470	51,115,261,037	54,536,284,684	56,972,155,547	60,280,283,799	61,309,927,119
次 期 繰 越 損 益 金	23,354,572,745	26,613,629,861	27,366,172,485	29,870,099,101	28,842,995,083	32,506,775,600
(D) 受 益 権 総 口 数	47,820,888,470口	51,115,261,037口	54,536,284,684口	56,972,155,547口	60,280,283,799口	61,309,927,119口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,884円	15,207円	15,018円	15,243円	14,785円	15,302円

(注記事項)

作成期首元本額 44,871,366,042円

作成期中追加設定元本額 19,635,724,102円

作成期中一部解約元本額 3,197,163,025円

■損益の状況

項 目	第48期	第49期	第50期	第51期	第52期	第53期
	自 2023年7月26日 至 2023年8月25日	自 2023年8月26日 至 2023年9月25日	自 2023年9月26日 至 2023年10月25日	自 2023年10月26日 至 2023年11月27日	自 2023年11月28日 至 2023年12月25日	自 2023年12月26日 至 2024年1月25日
(A) 配 当 等 收 益	1,037,725,953円	857,286円	850,272円	1,295,240,328円	△ 94,480円	△ 122,158円
受 取 配 当 金	1,048,375,040	-	-	1,305,126,211	-	-
そ の 他 収 益 金	-	941,490	939,927	-	-	-
支 払 利 息	△ 10,649,087	△ 84,204	△ 89,655	△ 9,885,883	△ 94,480	△ 122,158
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	329,791,996	1,906,436,332	△ 652,089,582	321,306,892	△ 2,264,322,066	3,537,041,820
売 買 益	2,190,273,754	1,913,926,274	783,516,021	596,658,142	2,014,252,643	3,538,562,630
売 買 損	△ 1,860,481,758	△ 7,489,942	△ 1,435,605,603	△ 275,351,250	△ 4,278,574,709	△ 1,520,810
(C) 信 託 報 酬 等	△ 51,682,209	△ 56,597,174	△ 60,068,979	△ 68,371,480	△ 60,012,194	△ 68,856,510
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	1,315,835,740	1,850,696,444	△ 711,308,289	1,548,175,740	△ 2,324,428,740	3,468,063,152
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	6,150,085,143	7,117,874,672	8,627,301,892	7,554,164,473	8,719,258,759	5,986,731,301
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	16,151,666,748	17,926,192,680	19,750,128,447	21,081,105,743	22,779,706,624	23,389,185,746
(配 当 等 相 当 額)	(19,121,830,609)	(21,020,367,573)	(23,068,812,195)	(24,599,189,194)	(26,633,874,774)	(27,349,692,339)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 2,970,163,861)	(△ 3,094,174,893)	(△ 3,318,683,748)	(△ 3,518,083,451)	(△ 3,854,168,150)	(△ 3,960,506,593)
(G) 計 (D + E + F)	23,617,587,631	26,894,763,796	27,666,122,050	30,183,445,956	29,174,536,643	32,843,980,199
(H) 収 益 分 配 金	△ 263,014,886	△ 281,133,935	△ 299,949,565	△ 313,346,855	△ 331,541,560	△ 337,204,599
次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)	23,354,572,745	26,613,629,861	27,366,172,485	29,870,099,101	28,842,995,083	32,506,775,600
追 加 信 託 差 損 益 金	16,151,666,748	17,926,192,680	19,750,128,447	21,081,105,743	22,779,706,624	23,389,185,746
(配 当 等 相 当 額)	(19,121,830,609)	(21,020,367,573)	(23,068,812,195)	(24,599,189,194)	(26,633,874,774)	(27,349,692,339)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 2,970,163,861)	(△ 3,094,174,893)	(△ 3,318,683,748)	(△ 3,518,083,451)	(△ 3,854,168,150)	(△ 3,960,506,593)
分 配 準 備 積 立 金	7,202,905,997	8,687,437,181	8,327,352,327	9,186,807,702	8,782,375,160	9,117,712,012
繰 越 損 益 金	-	-	△ 711,308,289	△ 397,814,344	△ 2,719,086,701	△ 122,158

(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48期計算期間末における費用控除後の配当等収益(998,509,493円)、費用控除後の有価証券等損益額(317,243,247円)、信託約款に規定する収益調整金(19,121,830,609円)および分配準備積立金(6,150,168,143円)より分配対象収益は26,587,751,492円(10,000口当たり5,559円)であり、うち263,014,886円(10,000口当たり55円)を分配金額としております。

第49期計算期間末における費用控除後の配当等収益(834,647円)、費用控除後の有価証券等損益額(1,849,861,797円)、信託約款に規定する収益調整金(21,020,367,573円)および分配準備積立金(7,117,874,672円)より分配対象収益は29,988,938,689円(10,000口当たり5,866円)であり、うち281,133,935円(10,000口当たり55円)を分配金額としております。

第50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(23,068,812,195円)および分配準備積立金(8,627,301,892円)より分配対象収益は31,696,114,087円(10,000口当たり5,811円)であり、うち299,949,565円(10,000口当たり55円)を分配金額としております。

第51期計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,240,461,098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(24,599,189,194円)および分配準備積立金(8,259,693,459円)より分配対象収益は34,099,343,751円(10,000口当たり5,985円)であり、うち313,346,855円(10,000口当たり55円)を分配金額としております。

第52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(26,633,874,774円)および分配準備積立金(9,113,916,720円)より分配対象収益は35,747,791,494円(10,000口当たり5,930円)であり、うち331,541,560円(10,000口当たり55円)を分配金額としております。

第53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(783,430,729円)、信託約款に規定する収益調整金(27,349,692,339円)および分配準備積立金(8,671,485,882円)より分配対象収益は36,804,608,950円(10,000口当たり6,003円)であり、うち337,204,599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48期	第49期	第50期	第51期	第52期	第53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48期	第49期	第50期	第51期	第52期	第53期
	(2023年7月26日 ～2023年8月25日)	(2023年8月26日 ～2023年9月25日)	(2023年9月26日 ～2023年10月25日)	(2023年10月26日 ～2023年11月27日)	(2023年11月28日 ～2023年12月25日)	(2023年12月26日 ～2024年1月25日)
当期分配金	55	55	55	55	55	55
(対基準価額比率)	(0.368%)	(0.360%)	(0.365%)	(0.360%)	(0.371%)	(0.358%)
当期の収益	55	0	—	55	—	—
当期の収益以外	—	54	55	—	55	55
翌期繰越分配対象額	5,504	5,811	5,756	5,930	5,875	5,948

(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》

ファンドの名称を「アムンディ・サステナブル・インカム・ファンド」から「アムンディ・みらい定期便」に変更するため、2023年10月26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 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、2024年1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1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	1,128,960	34,663,672.23
アメリカ	PFIZER INC	USD	1,125,061	31,872,978.13
オランダ	ABN AMRO GROUP N.V.	EUR	1,850,803	27,450,167.58
アメリカ	INTL BUSINESS MACHINES CORP	USD	152,699	26,566,572.02
韓国	KB FINANCIAL GROUP	KRW	482,624	18,806,111.11
フランス	SANOFI	EUR	185,360	18,701,597.38
アメリカ	STATE STREET CORP	USD	207,961	15,357,919.85
イギリス	PERSIMMON PLC	GBP	674,985	12,517,888.63
ドイツ	DEUTSCHE TELEKOM AG-NOM	EUR	454,476	11,524,097.49
アメリカ	PAYPAL HOLDINGS INC	USD	178,009	11,218,127.18
	CARDINAL HEALTH INC	USD	107,254	11,193,027.44
	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	USD	197,401	10,841,262.92
スイス	UBS GROUP INC NAMEN AKT	CHF	331,092	9,805,816.37
ドイツ	HENSOLDT AG	EUR	322,652	9,778,346.36
イタリア	UNICREDIT SPA	EUR	321,357	9,457,086.37
アイルランド	CRH PLC	GBP	127,772	8,875,358.10
アメリカ	CISCO SYSTEMS INC	USD	171,199	8,784,220.69

(2) 債券

	銘柄	通貨	額面金額	評価額（米ドル）
アメリカ	UNITED STATES OF AMERICA 4.375% 31/10/2024	USD	12,035,100	12,103,285.41
	WI TREASURY SEC 4.375% 30/11/2024	USD	11,764,400	11,798,919.04
	LEVEL 3 FINANCING INC 10.5% 15/05/2030	USD	11,790,000	11,608,728.75
	USA 3% 31/07/2024	USD	11,000,000	11,040,789.60
	FN FS5445 MTGE TF 01/11/2051	USD	13,804,656	11,014,606.40
	FN FS6667 TF 01/10/2053	USD	10,800,000	10,834,654.03
	FN FS5885 TF 01/09/2053	USD	10,887,000	10,816,057.31
	USA 4.125% 30/09/2024	USD	10,000,000	10,078,393.70
	FN FS6699 TF 01/02/2052	USD	11,952,000	10,057,816.29
カナダ	THE TORONTO DOMINION BANK CANADA 22/10/2024	USD	164,400	9,713,574.00
スイス	UBS GROUP AG VAR PERP	USD	10,476,000	9,385,209.78
	UBS GROUP AG VAR PERP	USD	9,817,000	9,029,553.89
カナダ	THE TORONTO DOMINION BANK 12/04/2024	USD	77,200	8,989,940.00

(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）、CHF（スイスフラン）

< 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25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25日まで）

公社債

買		付		売		付	
銘柄	柄	金	額	銘柄	柄	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）単位未满是切捨てです。

（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 1 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	350,946	74.6	—	—	—	74.6
合計	350,000	350,946	74.6	—	—	—	74.6

（注1）組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

（注2）単位未满是切捨てです。

（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 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	50,001	2024/8/28
	第134回共同発行市場公募地方債	0.674	100,000	100,218	2024/5/24
	第137回共同発行市場公募地方債	0.566	50,000	50,161	2024/8/23
	第139回共同発行市場公募地方債	0.544	150,000	150,565	2024/10/25
合計			350,000	350,946	

（注）額面・評価額の単位未满是切捨てです。

Amundi Funds パイオニア・インカム・オポチュニティーズ

決算日 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。

■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 PEF 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 US81369ADRO5)	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 US30711XBM56)	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 US35565TBE82)	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			

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		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	0.66	250,000	251,232	2023/8/29
	第128回共同発行市場公募地方債							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
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 益 損	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。