

■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／株式		
信 託 期 間	2020年7月22日から無期限です。		
運 用 方 針	「CPR Invest - クライメート・アクション」への投資を通じて、主に世界の気候変動対応に責任を持って取り組む企業の株式に実質的に投資を行い、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。また、「C Aマネーパールファンド（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を行いません。		
主要運用対象	アムンディ DCファンド 世界株式・ 気候変動対応	CPR Invest - クライメート・ アクション C Aマネーパールファンド (適格機関投資家専用)	
	CPR Invest - クライメート・ アクション		世界の株式等
	C Aマネーパール ファンド（適格機 関投資家専用）		本邦通貨表示の短期公社債
組 入 制 限	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2回決算、原則として毎年2月および8月の各25日。ただし、休業日の場合は翌営業日）に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益および売買益（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DCファンド 世界株式・気候変動対応

運用報告書（全体版）

第12期（決算日 2026年8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/>

< 5956534 >

■最近５期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額 (分 配 落)	税 込 分 配 金			期 騰 落 中 率	投 資 信 託 証 券 組 入 比 率	純資産総額
		円	円	円			
8 期（2024年 8 月 26 日）	19,297	円	0	円	%	%	百万円
9 期（2025年 2 月 25 日）	20,763		0		3.3	98.1	669
10期（2025年 8 月 25 日）	22,269		0		7.6	97.5	774
11期（2026年 2 月 25 日）	25,098		0		7.3	97.6	885
12期（2026年 8 月 25 日）	27,435		0		12.7	97.3	1,051
			0		9.3	98.3	1,190

（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。

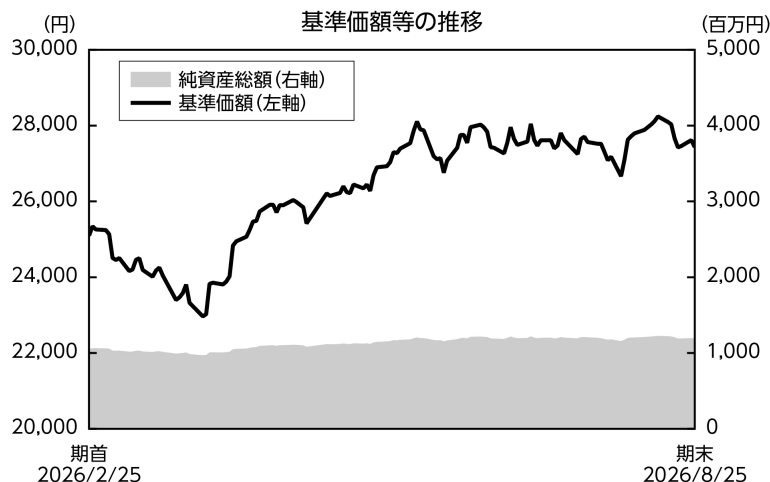
■当期中の基準価額等の推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率	投 資 信 託 証 券 組 入 比 率
(期 首) 2026年 2 月 25 日	円 25,098	% —	% 97.3
2 月 末	25,261	0.6	97.6
3 月 末	22,969	△8.5	98.0
4 月 末	25,843	3.0	97.5
5 月 末	27,394	9.1	97.7
6 月 末	27,557	9.8	98.0
7 月 末	27,180	8.3	98.3
(期 末) 2026年 8 月 25 日	27,435	9.3	98.3

（注）騰落率は期首比です。

【基準価額等の推移】

第12期首	25,098円
第12期末	27,435円
既払分配金 (税込み)	0円
騰落率	9.3%



【基準価額の主な変動要因】

当ファンドの基準価額は、前期末比で上昇しました。

上昇要因

4月から6月初めにかけての株価上昇が寄与して株価要因が通期でプラスとなりました。株価上昇をけん引したのが半導体を中心とするA I（人工知能）関連銘柄であったため、業種別では情報技術の寄与がかなりの部分を占め、情報技術に次ぐ上昇率となった金融もプラスに寄与しました。為替市場では市場介入にもかかわらず円安基調であったため、通貨要因もプラスに寄与しました。

下落要因

米国とイスラエルが2月末に大規模な軍事攻撃に踏み切り、イランもこれに報復して紛争が拡大したことから、世界景気やインフレに及ぼす影響への懸念が強まり、グローバル株式市場は3月に大きく下落しました。当ファンドの基準価額も3月に大きく下落しましたが、4月中旬にはマイナスは解消しました。

【投資環境】

＜世界株式市場＞

当期初のグローバル株式市場は、イラン周辺地域の紛争激化による世界景気悪化への懸念から、エネルギーを除いて全面安となりました。しかし、4月には一時停戦とA I（人工知能）関連銘柄の好決算を受けて市場は急反発しました。情報技術は6月初めまで大幅に続伸し、グローバル株式市場の高値更新に寄与しました。6月以降はA I 関連の過剰な投資への警戒に加え、米国の利上げ観測などから情報技術やコミュニケーションサービスは小反落したものの、金利上昇で恩恵を受ける金融や、出遅れ感の強かったヘルスケアなどが上昇し、全体としては緩やかな上昇基調を保って当期末を迎えました。通期では情報技術の上昇が大きく、エネルギー、金融がこれに続きました。一方、金利上昇が逆風となる公益事業は水面下にとどまり、コスト上昇が重荷となる生活必需品も当期初の水準を下回ったまま推移しました。地域別では、北米と新興国が4月以降の反発局面で大きく先行し、6月以降は欧州が追い上げる展開でした。

＜為替市場＞

為替市場ではペルシャ湾岸の地政学的リスクを受けて米ドルが3月に上昇しました。日銀は4月末に市場介入を実施しましたが円安抑制効果は一時的で、財政赤字など円への信認低下もあり、7月下旬には1986年以来の1米ドル164円台を記録しました。7月末には日米協調為替介入が実施され、8月初めに1米ドル155円台まで円高となりましたが、その後は日米金利差に大きな動きがなかったことから再び160円近くまで円安となって当期末を迎えました。

＜日本の短期国債市場＞

当期の短期国債市場では、T D B（国庫短期証券）3ヵ月物利回りが上昇しました。2026年6月に日銀が追加利上げを実施し、政策金利を1.00%へ引き上げたことに加え、その後も追加利上げや利上げペース加速への期待が高まりました。これを受け、T D B 3ヵ月物利回りは0.70%台から、当期末にかけて1.10%近辺まで上昇しました。

【ポートフォリオ】

＜当ファンド＞

当ファンドは、主に世界の気候変動対応に責任を持って取り組む企業の株式に投資する「CPR Invest - クライメート・アクション」に投資することにより、中長期的な信託財産の成長を目指した運用を行いました。「CPR Invest - クライメート・アクション」の組入比率は、基本方針に従い高位を維持しました。また、「C A 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）

＜CPR Invest - クライメート・アクション＞

当ファンドは、二酸化炭素排出量削減に向けて明確な目標を掲げ、E S G^{*}評価の優れた企業のなかでも、バリュエーションと業績見通しの優れた75前後の銘柄で構成される株式ポートフォリオ運用を行いました。期中、新しい投資アイデアやバリュエーション、景気や業績見通しの変化に応じて9銘柄を全売却、19銘柄に新規投資し、また比率も変更しました。セクター別では、金融、資本財サービスなどの組入れを引き下げた一方、情報技術、素材などを引き上げました。市場別では、英国、フランスなど欧州の組入れが減少し、韓国、中国、南アフリカなど新興国が増加しました。

※ E S Gは環境 (Environment)、社会 (Social)、ガバナンス (Governance) の頭文字を取ったもので、企業の持続的な成長性を判断するための評価軸です。

(CPRアセットマネジメント)

＜C A 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短期国債への投資により、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「CPR Invest - クライメート・アクション」の組入比率を引き続き高位に保ちます。また、「C A 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)

＜CPR Invest - クライメート・アクション＞

グローバル株式市場は史上最高値圏で推移していますが、さらに上昇するためには、主要国の利上げや財政赤字の持続性に対する懸念、選挙とそれにもともなう政治的な混乱の可能性などを消化していく必要があると考えます。多額のA I 投資の収益性にも依然として未知数が多いと思われます。当ファンドは資本財・サービス、情報技術、素材などシクリカルなセクター（景気敏感なセクター）への配分を維持していますが、個別銘柄選択においては成長の持続性とバリュエーションに留意し、化石燃料を中心としたエネルギーからの転換という長期的なトレンドから恩恵を受ける銘柄を選別します。

(CPRアセットマネジメント)

＜C A 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

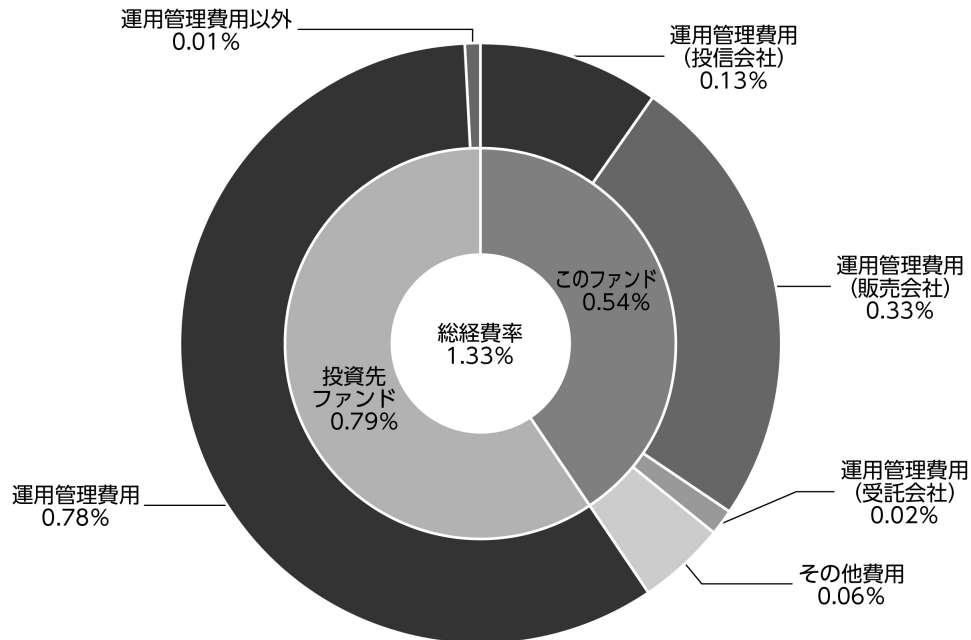
項 目	第 12 期 (2026年 2 月 26 日 ～2026年 8 月 25 日)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬 (投 信 会 社) (販 売 会 社) (受 託 会 社)	62円 (17) (43) (3)	0. 240% (0. 065) (0. 164) (0. 011)	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 委託した資金の運用の対価 交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、 購入後の情報提供等の対価 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) そ の 他 費 用 (監 査 費 用) (印 刷 費 用)	8 (1) (7)	0. 031 (0. 005) (0. 025)	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
合 計	70	0. 271	
期中の平均基準価額は26, 034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1.33%です



総経費率 (①+②+③)	1.33%
①このファンドの費用の比率	0.54%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.78%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.01%

(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（2026年２月26日から2026年８月25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)	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
	CPR Invest - クライメート・アクション	1	243	－	－

(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（2026年２月26日から2026年８月25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（2026年８月25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
C Aマネープールファンド（適格機関投資家専用）		千口 5	千口 5	千円 5
合 計	口 数・金 額	5	5	5
	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		期 首 (前期末)	当 期 末		
			口 数	評 価 額	
		口 数		外貨建金額	邦貨換算金額
(ルクセンブルク)		千口	千口	千ユーロ	千円
CPR Invest - クライメート・アクション		28	29	6,302	1,170,741
合 計	口 数・金 額	28	29	6,302	1,170,741
	銘 柄 数 <比 率>	1	1	－	<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 (2026年 8 月25日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投 資 信 託 受 益 証 券	5	0.0
投 資 証 券	1,170,741	98.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	23,809	2.0
投 資 信 託 財 産 総 額	1,194,555	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 (1,170,741千円) の投資信託財産総額 (1,194,555千円) 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、2026年 8 月25日現在における邦貨換算レートは、1ユーロ=185.76円です。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2026年 8 月25日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	1,194,555,451円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	23,808,401
投資信託受益証券(評価額)	5,038
投 資 証 券(評価額)	1,170,741,458
未 収 利 息	554
(B) 負 債	4,086,030
未 払 解 約 金	1,033,189
未 払 信 託 報 酬	2,711,532
そ の 他 未 払 費 用	341,309
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	1,190,469,421
元 本	433,926,175
次 期 繰 越 損 益 金	756,543,246
(D) 受 益 権 総 口 数	433,926,175口
1 万口当たり基準価額(C/D)	27,435円

(注記事項)
期首元本額 419,043,218円
期中追加設定元本額 32,233,955円
期中一部解約元本額 17,350,998円

■損益の状況

当期 (自2026年 2 月26日 至2026年 8 月25日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	98,845円
受 取 利 息	98,845
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	99,945,942
売 買 益	102,623,575
売 買 損	△ 2,677,633
(C) 信 託 報 酬 等	△ 3,052,841
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	96,991,946
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	340,968,294
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	318,583,006
(配 当 等 相 当 額)	(198,034,738)
(売 買 損 益 相 当 額)	(120,548,268)
(G) 計 (D+E+F)	756,543,246
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	756,543,246
追 加 信 託 差 損 益 金	318,583,006
(配 当 等 相 当 額)	(198,034,738)
(売 買 損 益 相 当 額)	(120,548,268)
分 配 準 備 積 立 金	437,960,240

(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

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。

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かさ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12期
	(2026年2月26日～2026年8月25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	17,434

(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》

- ・一般社団法人投資信託協会が一般社団法人資産運用業協会に名称を変更したことにともない、2026年4月1日付で投資信託約款に所要の変更を行いました。

CPR Invest - クライメート・アクション
決算日 2025年7月31日
(計算期間：2024年8月1日～2025年7月31日)

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

■費用の明細 (2024年8月1日～2025年7月31日)

項目	当期
	ユーロ
(a)運用報酬	19,069,571.62
(b)成功報酬	24.34
(c)管理費用等	4,211,404.75
(d)その他の費用	3,489,361.78
合計	26,770,362.49

■純資産計算書 (2025年7月31日現在)

項目	当期末
	ユーロ
資産合計	1,845,971,958.52
有価証券	1,826,859,821.45
預金	16,337,855.41
未収追加設定金	530,312.10
為替予約取引評価勘定	64,230.76
先物取引評価勘定	1,845,892.74
未収配当金	288,490.24
その他の未収利息	45,355.82
負債合計	10,119,126.59
借入金	1,922,343.24
未払解約金	1,491,718.72
未払運用報酬	1,565,968.02
未払管理費用	4,150,692.96
未払成功報酬	24.34
その他の未払利息	1,079.63
その他の負債	987,299.68
純資産	1,835,852,831.93

■有価証券明細 (2025年7月31日現在)

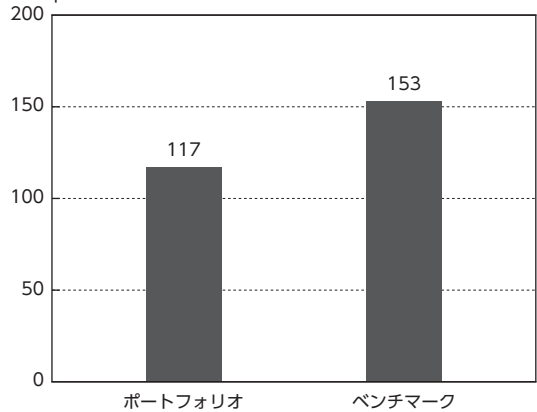
	通貨	数量	評価額 (ユーロ)
株式等			1,806,150,151.42
ベルギー			18,347,744.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	EUR	356,960	18,347,744.00
カナダ			5,913,419.49
LUNDIN MINING CORP	CAD	661,300	5,913,419.49
デンマーク			11,908,416.51
NOVO NORDISK A/S-B	DKK	282,557	11,908,416.51
フランス			171,742,834.63
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	EUR	261,400	26,218,420.00
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	EUR	15,649	7,391,805.15
ORANGE	EUR	1,924,190	25,678,315.55
PUBLICIS GROUPE	EUR	185,232	14,855,606.40
RENAULT SA	EUR	526,621	17,225,772.91
SANOFI	EUR	271,503	21,405,296.52
SCHNEIDER ELECTRIC SE	EUR	109,732	25,046,329.00
THALES SA	EUR	48,294	11,387,725.20
VEOLIA ENVIRONNEMENT	EUR	456,319	13,552,674.30
VINCI SA	EUR	73,856	8,980,889.60
ドイツ			137,736,140.63
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	EUR	67,354	5,649,653.52
COMMERZBANK AG	EUR	503,527	16,133,005.08
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	EUR	428,106	13,476,776.88
E.ON SE	EUR	1,528,027	24,379,670.79
INFINEON TECHNOLOGIES AG	EUR	416,216	14,415,641.16
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	EUR	48,191	27,738,739.60
SIEMENS AG-REG	EUR	68,984	15,514,501.60
SIEMENS ENERGY AG	EUR	200,276	20,428,152.00
香港			26,572,129.81
PRUDENTIAL PLC	GBP	2,384,544	26,572,129.81
アイルランド			81,297,489.02
ACCENTURE PLC-CL A	USD	45,216	10,551,914.38
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	USD	349,814	32,091,625.53
KERRY GROUP PLC-A	EUR	92,347	7,493,959.05
LINDE PLC	USD	77,487	31,159,990.06
イタリア			51,413,379.66
INTESA SANPAOLO	EUR	5,662,795	29,984,499.54
PRYSMIAN SPA	EUR	304,474	21,428,880.12
日本			85,899,407.29
HITACHI LTD	JPY	996,500	27,173,215.18
MIZUHO FINANCIAL GROUP INC	JPY	982,300	25,559,900.62
NOMURA RESEARCH INSTITUTE LT	JPY	609,200	21,287,634.39
SONY GROUP CORP	JPY	555,700	11,878,657.10
オランダ			31,429,834.08
ASM INTERNATIONAL NV	EUR	30,344	12,972,060.00
PROSUS NV	EUR	367,392	18,457,774.08
スペイン			19,373,111.71
BANCO SANTANDER SA	EUR	2,570,742	19,373,111.71

	通貨	数量	評価額 (ユーロ)
スイス			29,175,124.43
COCA-COLA HBC AG-DI	GBP	639,472	29,175,124.43
台湾			45,428,908.76
TAIWAN SEMICONDUCTOR-SP ADR	USD	215,196	45,428,908.76
イギリス			107,092,617.58
ANGLO AMERICAN PLC	GBP	739,873	18,374,924.31
ASTRAZENECA PLC	GBP	185,268	24,256,848.56
BARCLAYS PLC	GBP	3,512,418	15,078,746.71
NATIONAL GRID PLC	GBP	2,040,552	25,008,499.48
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	GBP	371,663	24,373,598.52
アメリカ			982,819,593.82
ABBVIE INC	USD	185,125	30,573,000.31
ANALOG DEVICES INC	USD	53,481	10,496,209.89
APPLE INC	USD	328,715	59,614,147.53
BOSTON SCIENTIFIC CORP	USD	398,568	36,536,415.68
DANAHER CORP	USD	122,370	21,079,436.63
DIGITAL REALTY TRUST INC	USD	176,586	27,221,907.16
ELI LILLY & CO	USD	21,138	13,667,904.12
EMERSON ELECTRIC CO	USD	201,322	25,594,656.61
HOME DEPOT INC	USD	105,714	33,944,303.12
HUBSPOT INC	USD	40,889	18,564,474.12
HUNTINGTON BANCSHARES INC	USD	2,207,633	31,690,542.30
INTUIT INC	USD	31,485	21,597,848.98
MCKESSON CORP	USD	33,004	19,998,771.71
METLIFE INC	USD	430,203	28,547,392.29
MICROSOFT CORP	USD	257,627	120,085,627.10
NVIDIA CORP	USD	628,445	97,664,158.10
ORACLE CORP	USD	197,783	43,852,511.39
OWENS CORNING	USD	105,069	12,799,589.94
PALO ALTO NETWORKS INC	USD	99,080	15,027,991.79
PARKER HANNIFIN CORP	USD	30,895	19,756,280.20
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	USD	191,617	13,030,056.45
QUALCOMM INC	USD	139,173	17,845,467.20
S&P GLOBAL INC	USD	101,776	49,005,070.64
SERVICENOW INC	USD	32,807	27,033,277.57
SYNOPSYS INC	USD	49,070	27,158,597.61
TJX COMPANIES INC	USD	432,193	47,023,716.12
VISA INC-CLASS A SHARES	USD	155,279	46,869,281.49
WALT DISNEY CO/THE	USD	259,883	27,045,270.31
WASTE MANAGEMENT INC	USD	197,263	39,495,687.46
投資証券			20,709,670.03
フランス			11,100,175.98
AMUNDI EURO LIQUIDITY SHORT TERM RESPONSIBLE PART Z C	EUR	102	11,100,175.98
ルクセンブルク			9,609,494.05
CPR INVEST - CLIMATE ACTION EURO - O EUR - ACC	EUR	65	9,609,494.05
合計			1,826,859,821.45

《ご参考》

炭素強度 (2026年 7 月末現在)

(tCO₂eq/100万ユーロ)



- ・炭素強度は2026年 7 月末現在取得可能なデータで作成しています。
- ・これは 1 年間に100万ユーロの売上げを実現するためにどれだけ温室効果ガスが排出されるかを示す指標で、数値が低い方が望ましいものです。温室効果ガス排出量（二酸化炭素換算、トン）を売上高（100万ユーロ単位）で割った値を銘柄ごとに算出し、加重平均しています。
- ・データの出所はTrucost社です。京都議定書で定められた 6 種類の温室効果ガス排出量を対象とし、それぞれのGWP（地球温暖化係数）に基づいて二酸化炭素に換算しています。
- ・ベンチマークはMSCIオール・カンントリー・ワールド・インデックスです。

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19期》

決算日：2026年2月16日

（計算期間：2025年2月18日～2026年2月16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			債券組入比率	純資産総額
		税込み 分配金	期中 騰落率		
	円	円	%	%	百万円
15期（2022年2月15日）	10,035	0	△0.1	70.8	552
16期（2023年2月15日）	10,027	0	△0.1	74.3	473
17期（2024年2月15日）	10,020	0	△0.1	70.8	495
18期（2025年2月17日）	10,022	0	0.0	75.8	421
19期（2026年2月16日）	10,052	0	0.3	76.5	403

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

■当期中の基準価額等の推移

年 月 日	基 準 価 額		債券組入 比 率
		騰 落 率	
(期 首) 2025年 2 月17日	円 10,022	% —	% 75.8
2 月末	10,023	0.0	75.8
3 月末	10,024	0.0	73.5
4 月末	10,027	0.0	64.7
5 月末	10,029	0.1	68.6
6 月末	10,032	0.1	53.9
7 月末	10,035	0.1	62.6
8 月末	10,038	0.2	61.3
9 月末	10,039	0.2	71.2
10月末	10,044	0.2	72.8
11月末	10,048	0.3	76.3
12月末	10,047	0.2	73.6
2026年 1 月末	10,050	0.3	75.7
(期 末) 2026年 2 月16日	10,052	0.3	76.5

(注) 騰落率は期首比です。

■ 1 万口当たりの費用明細

項 目	第 19 期 (2025年 2 月18日 ～2026年 2 月16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)	24円 (19) (1) (4)	0.240% (0.192) (0.012) (0.036)	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 委託した資金の運用の対価 交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、 購入後の情報提供等の対価 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) そ の 他 費 用 (そ の 他)	0 (0)	0.001 (0.001)	その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用等
合 計	24	0.241	

期中の平均基準価額は10,036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（2025年 2 月18日から2026年 2 月16日まで）

公社債

		買 付 額	売 付 額
国 内		千円	千円
	国 債 証 券	1,107,327	779,357 (160,000)
	地 方 債 証 券	—	— (180,000)

(注 1) 金額は受渡し代金です。経過利子分は含まれていません。
(注 2) 単位未満は切捨てです。
(注 3) () 内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

■利害関係人との取引状況等（2025年 2 月18日から2026年 2 月16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（2026年 2 月16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B B 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
国 債 証 券	千円	千円	%	%	%	%	%
	310,000	308,895	76.5	—	—	—	76.5
合 計	310,000	308,895	76.5	—	—	—	76.5

(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	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
国 債 証 券		%	千円	千円	
	第1300回国庫短期証券	—	50,000	49,941	2026/ 4 /20
	第1307回国庫短期証券	—	100,000	99,813	2026/ 5 /20
	第1332回国庫短期証券	—	160,000	159,140	2026/ 9 /24
合 計			310,000	308,895	

(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（2026年 2 月16日現在）

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 308,895	% 76.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	95,964	23.7
投 資 信 託 財 産 総 額	404,859	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

2026年2月16日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	404,859,045円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	95,962,028
公 社 債(評価額)	308,895,440
未 収 利 息	1,577
(B) 負 債	903,792
未 払 信 託 報 酬	897,852
そ の 他 未 払 費 用	5,940
(C) 純 資 産 総 額(A－B)	403,955,253
元 本	401,878,675
次 期 繰 越 損 益 金	2,076,578
(D) 受 益 権 総 口 数	401,878,675口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額 (C／D)	10,052円

(注記事項)	
期首元本額	420,645,270円
期中追加設定元本額	1,757,803,933円
期中一部解約元本額	1,776,570,528円

■損益の状況

当期 自2025年2月18日 至2026年2月16日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	811,770円
受 取 利 息	811,770
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	935,199
売 買 益	1,332,060
売 買 損	△ 396,861
(C) 信 託 報 酬 等	△ 903,792
(D) 当 期 損 益 金(A＋B＋C)	843,177
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 86,609
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	1,320,010
(配 当 等 相 当 額)	(19,848,091)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△18,528,081)
(G) 計 (D＋E＋F)	2,076,578
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G＋H)	2,076,578
追 加 信 託 差 損 益 金	1,320,010
(配 当 等 相 当 額)	(19,848,091)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△18,528,081)
分 配 準 備 積 立 金	1,263,818
繰 越 損 益 金	△ 507,250

- (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。

《お知らせ》

- ・投資信託及び投資法人に関する法律第14条の改正に伴い、2025年4月1日付けで投資信託約款に所要の変更を行いました。