

■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、「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 CAマネーブルファンド（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
	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。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7期（決算日 2024年2月26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/>

< 3434029・3456369 >

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	税金 分	み 配 金	期 騰 落	中 率	投 資 組	信 益 入	信 証 比	託 券 率	投 資 組	資 入	証 比	券 率	純資産総額
3期 (2022年2月25日)	12,881		0		0.0			0.0				95.7		187
4期 (2022年8月25日)	14,087		0		9.4			0.0				97.7		265
5期 (2023年2月27日)	14,371		0		2.0			0.0				97.9		341
6期 (2023年8月25日)	15,932		0		10.9			0.0				97.6		455
7期 (2024年2月26日)	18,677		0		17.2			0.0				97.1		610

(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。

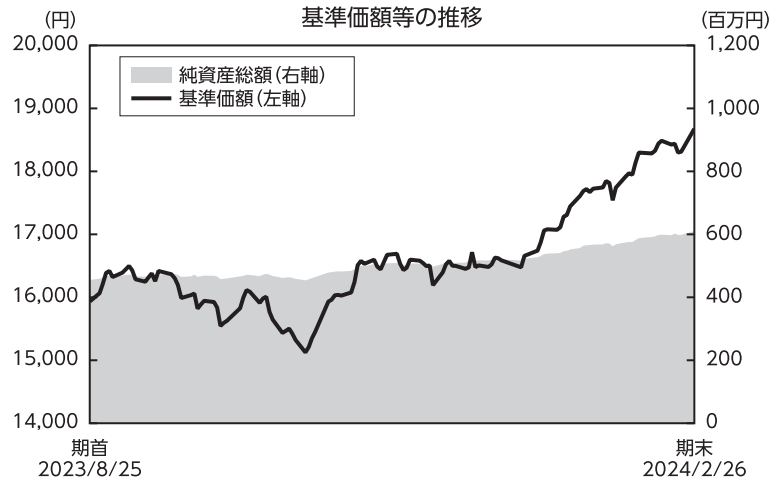
■当期中の基準価額等の推移

年月日	基準価額	騰落率	投 資 組	資 益 入	信 証 比	託 券 率	投 資 組	資 入	証 比	券 率
(期首) 2023年8月25日	15,932	—				0.0				97.6
8月末	16,419	3.1				0.0				98.4
9月末	15,943	0.1				0.0				97.7
10月末	15,211	△ 4.5				0.0				97.9
11月末	16,472	3.4				0.0				97.4
12月末	16,587	4.1				0.0				97.7
2024年1月末	17,817	11.8				0.0				98.0
(期末) 2024年2月26日	18,677	17.2				0.0				97.1

(注) 騰落率は期首比です。

【基準価額等の推移】

第7期首	15,932円
第7期末	18,677円
既払分配金 (税込み)	0円
騰落率	17.2%



【基準価額の主な変動要因】

上昇要因

- ① 2023年11月から当期末まで株式市場が全体として堅調に推移したこと
- ② 期を通じてパフォーマンスが良好であった情報技術や資本財・サービスセクターの高い組入れを保ち、銘柄選択も良好であったこと
- ③ 当期前半および2024年1月以降、主要通貨が円安傾向で推移したこと

下落要因

- ① 2023年9月から10月末にかけて、株式市場が全体として軟調に推移したこと
- ② 期を通じて素材および金融セクターで銘柄選択が足かせとなったこと
- ③ 2023年11月半ばから12月半ばにかけて、為替市場が一時的な円高となったこと

【投資環境】

<世界株式市場>

当期初から10月下旬にかけて、世界株式市場は高金利の継続や不透明な景気見通しが懸念されて軟調に推移しましたが、11月以降、インフレ圧力緩和の兆しとともに米国の金融政策が利下げに転換する可能性を織り込み始めて債券利回りが急低下すると、株価は急反発しました。年明け後は早期利下げ期待が剥落して債券利回りも再び上昇に転じ、金利敏感セクターには逆風となったものの、株式市場全体としては大型成長株の業績への安心感などから続伸し、最高値を更新して当期末を迎えました。セクター別にみると、当期初から10月下旬にかけては不動産、公益事業などの金利敏感セクターを筆頭にほとんどのセクターが下落した一方、エネルギーは値を保ちました。11月以降の株価反発局面では情報技術、金融、不動産などがけん引役となった一方、エネルギーが反落し、生活必需品や公益事業なども鈍い動きとなりました。年明け後は、情報技術やコミュニケーション・サービスの大型成長株が一段と上昇した一方、公益事業、不動産、素材などが反落しました。通期では情報技術、コミュニケーション・サービス、金融などの上昇率が大きく、公益事業、生活必需品、エネルギーなどは期初の水準近くで当期末を迎えました。

<為替市場>

米国では2023年7月を最後に利上げを停止しましたが、これが即座に利下げにつながるわけではなく、高金利が長引く可能性を市場が認識したことで、米ドル高傾向が11月半ばまで続きました。米ドル/円相場は1米ドル146円前後の期初の水準から、151円台まで上昇しました。その後は、米国の早期利下げ期待が徐々に高まった一方で、日銀のマイナス金利解除が視野に入りだしたことで、11月半ばから12月末にかけては急速な円高となり、12月末には141円台まで戻しました。年明け後は、米国の早期利下げ期待が剥落したことで再び米ドル高となり、1米ドル150円前後で当期末を迎えました。英ポンド、ユーロなど欧州通貨は、期前半は対円で比較的狭いレンジでの動きでしたが、当期末にかけては対円で強含み、円独歩安となりました。

<日本短期国債市場>

当期の短期国債市場では、TDB（国庫短期証券）3ヵ月物利回りが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、日銀によるマイナス金利政策や海外投資家からの需要に支えられ、-0.20%前後での推移が続きました。ただし、日銀によるマイナス金利解除が近づいているとの思惑から、当期末に向けては-0.10%近辺まで金利が上昇しました。

【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、「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)

<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積極的でESG^{*}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70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銘柄入れ替えや比率変更を行いました。セクター別では、素材、エネルギーなどの組入れを引き下げた一方、情報技術、資本財・サービスなどを引き上げました。市場別では、フランスなどの組入れが減少し、米国、デンマークなどが増加しました。

※ ESG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)

<CAマネープールファンド (適格機関投資家専用)>

当期、主として12ヵ月以内に償還を迎える地方債への投資により、安定した収益の確保を目指して運用を行いました。

(アムンディ・ジャパン株式会社)

【分配金】

収益分配金につきましては、基準価額水準および市況動向等を勘案した結果、見送りとさせていただきます(分配原資の内訳につきましては、後記の「分配金のお知らせ」をご覧ください)。なお、収益分配に充てず、信託財産内に留保した収益については、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

【今後の運用方針】

<当ファンド>

当ファンドが投資する「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、「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)

<CPR Invest - クライメート・アクション>

世界経済は緩やかな景気後退局面を迎えているとみられますが、株価上昇をけん引している大型成長株のバリュエーションは、足元の高成長が今後も支障なく続くことを前提としたものとなっており、反動安となるリスクに注意が必要であると思われます。また、景気減速に対応して金融緩和が予想されますが、様々な地政学的要因からインフレ圧力が十分に下がらず、利下げ時期がさらに先送りされる可能性にも注意が必要とみています。当ファンドではバリュエーションに配慮しながら、コスト管理に優れ、個別の好材料を提供する企業を臨機応変に選別し、全体としては景気感応度や企業の財務に関して慎重な姿勢を維持する方針です。

(CPRアセットマネジメント)

<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 7 期 (2023年 8月26日 ～2024年 2月26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)	40円 (11) (27) (2)	0.245% (0.067) (0.167) (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) (そ の 他)	7 (1) (6) (0)	0.042 (0.005) (0.036) (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	47	0.287	

期中の平均基準価額は16,408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。

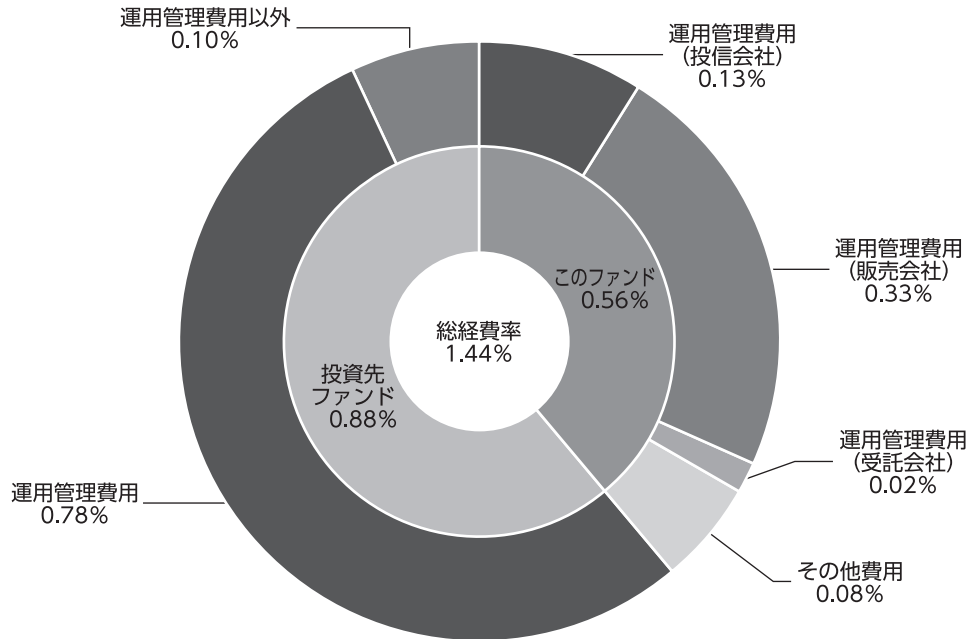
(注4) 各項目の費用は、このファンドが組入れている投資信託証券が支払った費用を含みません。

(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1.44%です。



総経費率 (①+②+③)	1.44%
①このファンドの費用の比率	0.56%
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	0.10%

(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8月26日から2024年2月26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	2	417	0.250	37

(注1) 金額は受渡し代金です。

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

■利害関係人との取引状況等（2023年8月26日から2024年2月26日まで）

当期中における利害関係人との取引等はありません。

(注) 利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

■組入資産の明細（2024年2月26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
		千口	千口	千円
C Aマネープールファンド（適格機関投資家専用）		5	5	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	口 数	評 価 額	
				外貨建金額	邦貨換算金額
		千口	千口	千ユーロ	千円
(ルクセンブルク)					
CPR Invest - クライメート・アクション		20	22	3,642	592,553
合 計	口 数・金 額	20	22	3,642	592,553
	銘 柄 数 <比 率>	1	1	-	<97.1%>

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

■投資信託財産の構成 (2024年2月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投 資 信 託 受 益 証 券	千円 5	% 0.0
投 資 証 券	592,553	96.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	19,283	3.2
投 資 信 託 財 産 総 額	611,841	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 (595,166千円) の投資信託財産総額 (611,841千円) に対する比率は97.3%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

なお、2024年2月26日現在における邦貨換算レートは、1ユーロ=162.67円です。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2024年2月26日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	614,453,642円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	16,668,990
投資信託受益証券(評価額)	5,009
投 資 証 券(評価額)	592,553,893
未 収 入 金	5,225,750
(B) 負 債	4,060,636
未 払 金	2,612,506
未 払 信 託 報 酬	1,240,767
未 払 利 息	49
そ の 他 未 払 費 用	207,314
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	610,393,006
元 本	326,818,258
次 期 繰 越 損 益 金	283,574,748
(D) 受 益 権 総 口 数	326,818,258口
1万口当たり基準価額(C/D)	18,677円

(注記事項)

期首元本額

285,654,889円

期中追加設定元本額

48,110,992円

期中一部解約元本額

6,947,623円

■損益の状況

当期 (自2023年8月26日 至2024年2月26日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 4,675円
支 払 利 息	△ 4,675
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	87,621,315
売 買 益	87,799,064
売 買 損	△ 177,749
(C) 信 託 報 酬 等	△ 1,450,094
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	86,166,546
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	63,407,200
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	134,001,002
(配 当 等 相 当 額)	(59,416,397)
(売 買 損 益 相 当 額)	(74,584,605)
(G) 計 (D+E+F)	283,574,748
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	283,574,748
追 加 信 託 差 損 益 金	134,001,002
(配 当 等 相 当 額)	(59,416,397)
(売 買 損 益 相 当 額)	(74,584,605)
分 配 準 備 積 立 金	149,578,421
繰 越 損 益 金	△ 4,675

(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7期
	(2023年8月26日～2024年2月26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	8,676

(注1) 「対基準価額比率」は当期分配金(税込み)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なる点にご留意ください。

(注2) 「当期の収益」「当期の収益以外」は小数点以下切捨てで算出しているため、合計が「当期分配金」と一致しない場合があります。

< 1. 補足情報 >

組入ファンド「CPR Invest - クライメート・アクション」の決算日（毎年7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2月23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2月23日現在）

株式等

	銘柄	通貨	株数	評価額（ユーロ）
アメリカ	MICROSOFT CORP - REG SHS	USD	242,815	92,072,916.97
	NVIDIA CORP	USD	84,687	61,680,684.55
	APPLE INC - REG SHS	USD	320,590	54,072,066.53
	ABBVIE INC	USD	263,388	43,345,902.99
	MASTERCARD INC -A- REG SHS	USD	93,563	40,932,029.26
	SandP GLOBAL INC - REG SHS	USD	99,961	40,484,135.72
	MERCK and CO INC - REG SHS	USD	332,520	39,777,030.91
	THE HOME DEPOT INC - REG SHS	USD	114,215	39,258,338.86
アイルランド	TJX COMPANIES INC - REG SHS	USD	385,378	35,391,457.41
	ACCENTURE PLC -A- REG SHS	USD	95,570	33,322,988.87
アメリカ	BOSTON SCIENTIF CORP	USD	528,165	32,700,693.06
	WASTE MANAGEMENT INC - REG SHS	USD	162,990	31,335,830.98
台湾	TAIWAN SEMICONDUCTOR - SADR REPR 5 SHS	USD	221,035	26,457,204.22
アメリカ	THE WALT DISNEY COMPANY - REG SHS	USD	253,485	25,237,235.04
	PROLOGIS INC - REG SHS	USD	201,551	24,810,431.75
イタリア	INTESA SANPAOLO SPA - AZ NOM	EUR	8,299,100	24,391,054.91
日本	HITACHI LTD - REG SHS	JPY	304,800	24,108,735.68
イギリス	ASTRAZENECA PLC - REG SHS	GBP	200,072	23,957,069.01
ドイツ	SIEMENS AG - NAMEN-AKT	EUR	135,966	23,834,839.80
イギリス	LINDE PLC - REG SHS	USD	57,332	23,711,601.83
ドイツ	DEUTSCHE TELEKOM AG - NAMEN-AKT	EUR	1,069,512	23,668,300.56
アメリカ	PARKER-HANNIFIN CORP - REG SHS	USD	48,179	23,644,061.85
デンマーク	NOVO NORDISK AS -B- BEARER/REG SHS	DKK	206,019	23,465,271.13
アメリカ	MARVELL TECHNOLOGY INC - REG SHS	USD	364,634	22,771,303.16
	IQVIA HOLDINGS INC - REG SHS	USD	98,961	22,611,557.42
	EMERSON ELECTRIC CO - REG SHS	USD	228,735	22,386,290.12
イギリス	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	GBP	313,999	21,418,889.02
フランス	SCHNEIDER ELECTRIC SE	EUR	96,172	20,176,885.60
日本	TOKYO ELECTRON LTD - REG SHS	JPY	89,500	20,097,488.39
アメリカ	SERVICENOW INC - REG SHS	USD	28,100	20,019,643.30

(注) 通貨欄の表記は以下の通りです。

USD (米ドル)、EUR (ユーロ)、JPY (円)、GBP (英ポンド)、DKK (デンマーククローネ)

< 2. 補足情報 >

組入ファンド「C A マネープールファンド（適格機関投資家専用）」の決算日（2024年2月15日）と当ファンドの決算日が異なっていますので、2024年2月26日現在の情報を掲載しています。

■組入資産の明細（2024年2月26日現在）

公社債

(A) 債券種類別開示

国内（邦貨建）公社債

区 分	2024 年 2 月 26 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	350,738	70.8	—	—	—	70.8
合 計	350,000	350,738	70.8	—	—	—	70.8

(注1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

(注2) 単位未満は切捨てです。

(注3) ー印は組入れなしです。

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

(B) 個別銘柄開示

国内（邦貨建）公社債

種 類	銘 柄	2024 年 2 月 26 日 現 在			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
		%	千円	千円	
地 方 債 証 券	第11回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.001	50,000	49,995	2024/8/28
	第134回共同発行市場公募地方債	0.674	100,000	100,160	2024/5/24
	第137回共同発行市場公募地方債	0.566	50,000	50,127	2024/8/23
	第139回共同発行市場公募地方債	0.544	150,000	150,456	2024/10/25
合 計			350,000	350,738	

(注) 額面・評価額の単位未満は切捨てです。

GPR Invest - クライメート・アクション
決算日 2023年7月31日
(計算期間：2022年8月1日～2023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 (2022年8月1日～2023年7月31日)

項目	当期
	ユーロ
(a)運用報酬	17,181,951.59
(b)成功報酬	561,582.46
(c)管理費用等	3,851,295.87
(d)その他の費用	2,931,189.49
合計	24,526,019.41

■純資産計算書 (2023年7月31日現在)

項目	当期末
	ユーロ
資産合計	1,504,259,516.48
有価証券	1,480,591,023.70
預金	9,424,428.90
有価証券売却未収入金	3,455,156.63
未収追加設定金	689,264.86
先物取引評価勘定	82,622.07
未収配当金	1,656,419.41
その他の未収利息	95,311.86
為替未収入金	8,265,289.05
負債合計	20,820,271.49
借入金	452,548.96
有価証券買付未払金	4,908,366.88
未払解約金	2,670,932.35
為替予約取引評価勘定	16,378.35
未払運用報酬	1,477,725.41
未払管理費用	2,149,153.18
未払成功報酬	38,741.65
為替未払金	8,274,147.04
その他の負債	832,277.67
純資産	1,483,439,244.99

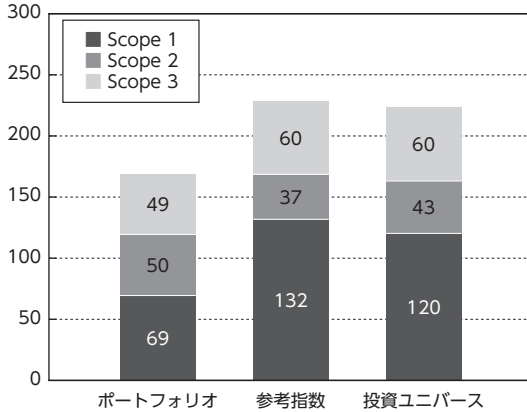
■ 有価証券明細 (2023年7月31日現在)

	通貨	数量	評価額 (ユーロ)
株式等			1,445,009,559.40
デンマーク			10,712,361.54
ORSTED	DKK	135,037	10,712,361.54
フィンランド			13,477,152.64
NESTE	EUR	402,784	13,477,152.64
フランス			116,982,441.34
AIR LIQUIDE SA	EUR	100,055	16,344,984.80
BNP PARIBAS SA	EUR	346,106	20,773,282.12
CIE DE SAINT-GOBAIN	EUR	267,560	16,449,588.80
SANOFI	EUR	329,306	31,972,319.54
SCHNEIDER ELECTRIC SE	EUR	96,172	15,583,710.88
VEOLIA ENVIRONNEMENT SA	EUR	535,762	15,858,555.20
ドイツ			79,131,252.35
DEUTSCHE TELEKOM AG REG SHS	EUR	1,069,512	21,221,257.10
E.ON SE	EUR	1,165,464	13,408,663.32
SIEMENS AG PREFERENTIAL SHARE	EUR	140,827	21,825,368.46
SIEMENS ENERGY RG	EUR	518,067	7,973,051.13
THYSSENKRUPP NUCERA AG & CO	EUR	219,407	5,006,867.74
WACKER CHEMIE AG	EUR	68,596	9,696,044.60
アイルランド			53,306,842.61
ACCENTURE - SHS CLASS A	USD	87,596	25,133,549.13
EATON CORPORATION PUBLIC LIMITED COMPANY	USD	92,061	17,143,861.52
KERRY GROUP -A-	EUR	122,061	11,029,431.96
イタリア			21,818,333.91
INTESA SANPAOLO	EUR	8,299,100	21,818,333.91
日本			128,019,588.85
HITACHI LTD	JPY	306,200	18,174,542.91
MIZUHO FINANCIAL GROUP INC	JPY	681,100	10,452,354.07
NOMURA RESEARCH INSTITUTE	JPY	691,500	17,794,006.78
SONY CORP	JPY	311,700	26,493,951.81
TERUMO CORP.	JPY	540,100	16,035,750.33
TOKYO ELECTRON LTD	JPY	129,900	17,617,109.57
TOYOTA MOTOR CORP	JPY	1,408,400	21,451,873.38
ジャージー			14,299,192.41
APTIV PLC	USD	143,991	14,299,192.41
オランダ			27,259,371.40
ASM INTERNATIONAL NV	EUR	34,264	14,827,746.00
STMICROELECTRONICS	EUR	255,595	12,431,625.40
ポルトガル			11,949,342.50
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA - REG.SHS	EUR	2,811,610	11,949,342.50
シンガポール			11,556,678.85
CAPITALAND INV --- REGISTERED SHS	SGD	4,976,000	11,556,678.85
スイス			14,450,863.29
CIE FINANCIERE RICHEMONT NAMEN AKT	CHF	98,442	14,450,863.29
台湾			38,146,437.23
DELTA ELECTRONIC INCS	TWD	940,000	9,915,640.43
TAIWAN SEMICONDUCTOR CO ADR (REPR 5 SHS)	USD	202,593	18,218,761.92
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO LTD	TWD	614,000	10,012,034.88

	通貨	数量	評価額 (ユーロ)
イギリス			123,799,272.01
ANGLO AMERICAN PLC	GBP	671,137	18,750,168.95
ASTRAZENECA PLC	GBP	188,213	24,569,385.20
CNH INDUSTRIAL REG SHS (USD)	EUR	1,376,671	18,048,156.81
LINDE PLC	USD	57,285	20,297,973.75
NATIONAL GRID PLC	GBP	862,441	10,381,700.22
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	GBP	313,999	21,392,533.10
VODAFONE GROUP PLC	GBP	11,926,549	10,359,353.98
アメリカ			780,100,428.47
ABBVIE INC	USD	286,637	38,887,272.65
ADOBE INC	USD	43,985	21,788,841.73
ALBEMARLE - REGISTERED SHS	USD	59,064	11,371,915.94
ANALOG DEVICES INC	USD	132,332	23,948,305.26
APPLE INC	USD	373,490	66,547,649.09
ARRAY TECH PREFERENTIAL SHARE	USD	584,621	10,101,156.44
BOSTON SCIENTIF CORP	USD	604,971	28,450,180.35
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	USD	250,983	14,156,848.01
DIGITAL REALTY TRUST INC	USD	170,567	19,278,998.27
EMERSON ELECTRIC CO	USD	192,261	15,929,474.72
HOME DEPOT INC	USD	108,208	32,764,190.94
IQVIA HOLDINGS INC	USD	110,183	22,361,387.76
MARVELL TECH --- REGISTERED SHS	USD	400,270	23,644,809.85
MASTERCARD INC -A-	USD	85,756	30,666,977.17
MERCK & CO INC	USD	290,189	28,070,071.06
METLIFE INC	USD	242,603	13,855,798.75
MICROSOFT CORP	USD	263,727	80,351,162.16
NVIDIA CORP	USD	62,358	26,428,978.11
PALO ALTO NETWORKS	USD	120,281	27,269,002.55
PARKER-HANNIFIN CORP	USD	44,356	16,494,856.07
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP INC	USD	219,334	15,888,809.20
PROLOGIS	USD	184,734	20,902,060.23
REGIONS FINANCIAL CORP	USD	736,913	13,614,727.50
S&P GLOBAL INC	USD	108,550	38,840,923.77
SALESFORCE INC	USD	102,892	20,998,348.30
SERVICENOW INC	USD	29,189	15,434,390.28
TJX COS INC	USD	390,238	30,626,542.23
UNITEDHEALTH GROUP INC	USD	23,510	10,797,477.39
WALT DISNEY CO	USD	232,334	18,731,276.82
WASTE MANAGEMENT	USD	149,391	22,192,872.79
ZIMMER BIOMET HLDGS SHS	USD	157,263	19,705,123.08
投資証券			35,581,464.30
フランス			27,337,248.60
AMUNDI EURO LIQUIDITY-RATED SRI FCP Z	EUR	13	13,270,225.08
AMUNDI EURO LIQUIDITY SHORT TERM SRI Z C	EUR	138	13,990,941.49
CPR MONETAIRE ISR Z	EUR	4	76,082.03
ルクセンブルク			8,244,215.70
CPR INVEST - CLIMATE ACTION EURO - CLASS O EUR - ACC	EUR	70	8,244,215.70
合計			1,480,591,023.70

■炭素強度 (2023年7月31日現在)

(tCO₂e/100万ユーロ)



(注1) 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(百万ユーロ単位)で割った値を銘柄ごとに算出し、加重平均しています。排出量は企業のバリューチェーンごとに以下の3つの区分に分けられます。

- Scope 1: 当該企業自らによる温室効果ガスの直接排出(燃料の燃焼、工業プロセス)
- Scope 2: 他社から当該企業に供給された電気、熱・蒸気の使用に伴う間接排出
- Scope 3: Scope1、Scope2以外の間接排出(事業者の活動に関連する他社の排出)。
ただし、当レポートでは、当該企業が直接影響を与えることができる一次サプライヤーに関連する上流部門での排出量のみを使用しています。

(注2) 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。

(注3) 参考指数はMSCIオール・カンントリー・ワールド・インデックスです。

C A マネープールファンド（適格機関投資家専用）

運用報告書

《第17期》

決算日：2024年2月15日

（計算期間：2023年2月16日～2024年2月15日）

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

■投資対象ファンドの概要

運用方針	主として本邦通貨表示の短期公社債に投資し、安定した収益の確保をめざして運用を行うとともに、あわせてコール・ローンなどで運用を行うことで流動性の確保を図ります。
主要運用対象	本邦通貨表示の短期公社債を主要投資対象とします。
組入制限	外貨建資産への投資は行いません。

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額			債券組入率	純資産総額
		税込み 分配金	期中 騰落率		
	円	円	%	%	百万円
13期（2020年2月17日）	10,048	0	△0.1	61.1	788
14期（2021年2月15日）	10,042	0	△0.1	64.6	773
15期（2022年2月15日）	10,035	0	△0.1	70.8	552
16期（2023年2月15日）	10,027	0	△0.1	74.3	473
17期（2024年2月15日）	10,020	0	△0.1	70.8	495

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

■当期中の基準価額等の推移

年 月 日	基 準 価 額		債券組入 比 率
		騰 落 率	
(期 首) 2023年2月15日	円	%	%
	10,027	—	74.3
2月末	10,027	0.0	74.3
3月末	10,027	0.0	71.0
4月末	10,027	0.0	72.1
5月末	10,027	0.0	73.6
6月末	10,027	0.0	73.9
7月末	10,026	△0.0	75.4
8月末	10,026	△0.0	65.4
9月末	10,025	△0.0	67.0
10月末	10,024	△0.0	65.9
11月末	10,020	△0.1	69.2
12月末	10,020	△0.1	71.6
2024年1月末	10,020	△0.1	74.6
(期 末) 2024年2月15日	10,020	△0.1	70.8

(注) 騰落率は期首比です。

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	第 17 期 (2023年2月16日 ～2024年2月15日)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬 (投 信 会 社) (販 売 会 社) (受 託 会 社)	1円 (1) (0) (0)	0.011% (0.009) (0.001) (0.002)	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 委託した資金の運用の対価 交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、 購入後の情報提供等の対価 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) そ の 他 費 用 (そ の 他)	1 (1)	0.012 (0.012)	その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用等
合 計	2	0.023	

期中の平均基準価額は10,024円です。

(注1) 費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注2) 消費税は報告日の税率を採用しています。

(注3) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注4) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

■ 売買及び取引の状況（2023年2月16日から2024年2月15日まで）

公社債

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国 内	地 方 債 証 券	351,475	— (350,000)

(注1) 金額は受渡し代金です。経過利子分は含まれていません。

(注2) 単位未満は切捨てです。

(注3) ()内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

■ 主要な売買銘柄（2023年2月16日から2024年2月15日まで）

公社債

銘 柄	買 付	銘 柄	売 付
	金 額		金 額
	千円		千円
第139回共同発行市場公募地方債	150,810		
第134回共同発行市場公募地方債	100,353	—	—
第137回共同発行市場公募地方債	50,289		
第11回政府保証地方公共団体金融機構債券（4年）	50,023		

(注1) 金額は受渡し代金です。経過利子分は含まれていません。

(注2) 単位未満は切捨てです。

(注3) 国内の現先取引によるものは含まれていません。

■利害関係人との取引状況等（2023年2月16日から2024年2月15日まで）

当期中における利害関係人との取引等はありません。

（注）利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

■組入資産の明細（2024年2月15日現在）

公社債

(A) 債券種類別開示

国内（邦貨建）公社債

区 分	2024 年 2 月 15 日 現 在						
	額面金額	評 価 額	組入比率	うちBB格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
地 方 債 証 券	350,000	350,832	70.8	—	—	—	70.8
合 計	350,000	350,832	70.8	—	—	—	70.8

（注1）組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

（注2）単位未満は切捨てです。

（注3）—印は組入れなしです。

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

(B) 個別銘柄開示

国内（邦貨建）公社債

種 類	銘 柄	2024 年 2 月 15 日 現 在			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
		%	千円	千円	
地 方 債 証 券	第134回共同発行市場公募地方債	0.674	100,000	100,178	2024/5/24
	第137回共同発行市場公募地方債	0.566	50,000	50,143	2024/8/23
	第139回共同発行市場公募地方債	0.544	150,000	150,511	2024/10/25
	第11回政府保証地方公共団体金融機構債券（4年）	0.001	50,000	50,000	2024/8/28
	合 計		350,000	350,832	

（注）額面・評価額の単位未満は切捨てです。

■投資信託財産の構成（2024年2月15日現在）

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公 社 債	350,832	70.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	144,454	29.2
投 資 信 託 財 産 総 額	495,286	100.0

(注) 金額の単位未満は切捨てです。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

2024年2月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	495,286,649円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	143,608,953
公 社 債(評価額)	350,832,500
未 収 利 息	452,737
前 払 費 用	392,459
(B) 負 債	59,852
未 払 信 託 報 酬	53,488
未 払 利 息	424
そ の 他 未 払 費 用	5,940
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	495,226,797
元 本	494,224,101
次 期 繰 越 損 益 金	1,002,696
(D) 受 益 権 総 口 数	494,224,101口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額 (C / D)	10,020円

(注記事項)

期首元本額	472,090,843円
期中追加設定元本額	134,248,238円
期中一部解約元本額	112,114,980円

■損益の状況

当期 自2023年2月16日 至2024年2月15日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	1,811,835円
受 取 利 息	1,905,211
支 払 利 息	△ 93,376
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 2,019,533
売 買 益	146,041
売 買 損	△ 2,165,574
(C) 信 託 報 酬 等	△ 113,341
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	△ 321,039
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 683,574
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	2,007,309
(配 当 等 相 当 額)	(17,080,817)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△15,073,508)
(G) 計 (D + E + F)	1,002,696
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)	1,002,696
追 加 信 託 差 損 益 金	2,007,309
(配 当 等 相 当 額)	(17,080,817)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△15,073,508)
分 配 準 備 積 立 金	6,793,356
繰 越 損 益 金	△ 7,797,969

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。