

**【表紙】**

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2024年9月25日提出
【計算期間】	第3期(自 2023年6月27日至 2024年6月25日)
【ファンド名】	D C 外国株式 E S G リーダーズインデックスファンド
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目 1 番 1 号
【事務連絡者氏名】	北添 道生
【連絡場所】	東京都港区芝公園一丁目 1 番 1 号
【電話番号】	03-6453-3610
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

## &lt;ファンドの目的&gt;

当ファンドは、確定拠出年金法（平成13年法律第88号）に基づく確定拠出年金制度のための専用ファンドとして、投資信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。

## &lt;信託金限度額&gt;

上限 5,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

## &lt;基本的性格&gt;

一般社団法人投資信託協会が定める分類方法における、当ファンドの商品分類及び属性区分は下記の通りです。

## 商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	独立区分	補足分類
単位型	国内	株式	MMF	インデックス型
追加型	海外	債券	MRF	特殊型
	内外	不動産投信	ETF	
		その他資産 ( )		
		資産複合		

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象 地域	投資形態	為替 ヘッジ	対象 インデックス	特殊型

株式	年1回	グローバル	ファミリー	あり	日経225	ブル・ベア型
一般		(日本を除く)	ファンド	( )		
大型株	年2回				TOPIX	条件付運用型
中小型株			ファンド・	なし		
債券	年4回	日本	オブ・ファンズ		その他	ロング・
一般	年6回	北米			(MSCIコクサ	ショート型/
公債	(隔月)	欧州			イESGリーダー	絶対収益追求
社債					ズ指数(配当	型
その他債券	年12回	アジア			込み、円換算	
クレジット属性	(毎月)	オセアニア			ベース))	その他
( )	日々					( )
不動産投信	その他	中南米				
	( )	アフリカ				
その他資産						
(投資信託証券		中近東				
(株式一般))		(中東)				
資産複合		エマージン				
( )		グ				
資産配分						
固定型						
資産配分						
変更型						

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

ファミリーファンド、ファンド・オブ・ファンズに該当する場合、投資信託証券を通じて投資収益の源泉となる資産に投資しますので商品分類表と属性区分表の投資対象資産は異なります。

属性区分表に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

なお、一般社団法人投資信託協会のホームページ (<https://www.toushin.or.jp/>) でもご覧いただけます。

一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」に基づくファンドの商品分類及び属性区分は以下の通りです。

< 商品分類表定義 >

## [ 単位型投信・追加型投信の区分 ]

- (1)単位型投信...当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われないファンドをいう。
- (2)追加型投信...一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。

## [ 投資対象地域による区分 ]

- (1)国内...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (2)海外...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (3)内外...目論見書又は投資信託約款において、国内及び海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

## [ 投資対象資産(収益の源泉)による区分 ]

- (1)株式...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (2)債券...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (3)不動産投信(リート)...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券及び不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (4)その他資産...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に上記(1)から(3)に掲げる資産以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、その他資産と併記して具体的な収益の源泉となる資産の名称記載も可とする。
- (5)資産複合...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(4)に掲げる資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

## [ 独立した区分 ]

- (1)MMF(マネー・マネージメント・ファンド)...「MRF及びMMFの運営に関する規則」に定めるMMFをいう。
- (2)MRF(マネー・リザーブ・ファンド)...「MRF及びMMFの運営に関する規則」に定めるMRFをいう。
- (3)ETF...投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号及び第2号に規定する証券投資信託並びに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいう。

## [ 補足分類 ]

- (1)インデックス型...目論見書又は投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2)特殊型...目論見書又は投資信託約款において、投資者に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。なお、下記の属性区分で特殊型の小分類において「条件付運用型」に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記す

るものとし、それ以外の小分類に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記できるものとする。

#### < 属性区分表定義 >

##### [ 投資対象資産による属性区分 ]

###### (1) 株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

大型株...目論見書又は投資信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいう。

中小型株...目論見書又は投資信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいう。

###### (2) 債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

公債...目論見書又は投資信託約款において、日本国又は各国の政府の発行する国債(地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含む。以下同じ。)に主として投資する旨の記載があるものをいう。

社債...目論見書又は投資信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいう。

その他債券...目論見書又は投資信託約款において、公債又は社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいう。

格付等クレジットによる属性...目論見書又は投資信託約款において、上記 から の「発行体」による区分のほか、特にクレジットに対して明確な記載があるものについては、上記 から に掲げる区分に加え「高格付債」「低格付債」等を併記することも可とする。

(3) 不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4) その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

(5) 資産複合...以下の小分類に該当する場合には当該小分類を併記することができる。

資産配分固定型...目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

資産配分変更型...目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

##### [ 決算頻度による属性区分 ]

(1) 年1回...目論見書又は投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。

(2) 年2回...目論見書又は投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいう。

(3) 年4回...目論見書又は投資信託約款において、年4回決算する旨の記載があるものをいう。

(4) 年6回(隔月)...目論見書又は投資信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいう。

(5) 年12回(毎月)...目論見書又は投資信託約款において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるものをいう。

(6)日々...目論見書又は投資信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいう。

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

#### [ 投資対象地域による属性区分(重複使用可能) ]

(1)グローバル...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。

(2)日本...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(3)北米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(4)欧州...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(5)アジア...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(6)オセアニア...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(7)中南米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(8)アフリカ...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(9)中近東(中東)...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(10)エマージング...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域(新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

#### [ 投資形態による属性区分 ]

(1)ファミリーファンド...目論見書又は投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいう。

(2)ファンド・オブ・ファンズ...「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいう。

#### [ 為替ヘッジによる属性区分 ]

(1)為替ヘッジあり...目論見書又は投資信託約款において、為替のフルヘッジ又は一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいう。

(2)為替ヘッジなし...目論見書又は投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

#### [ インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分 ]

(1)日経225

(2)TOPIX

(3)その他の指数...前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

[ 特殊型 ]

- (1)ブル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2)条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3)ロング・ショート型 / 絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨若しくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。
- (4)その他型...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(3)に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

ESG分類：当ファンドはESG投信です。

< ファンドの特色 >

**1.** わが国を除く世界主要国の金融商品取引所等に上場している株式(預託証券(DR)を含みます。)を主要投資対象とし、ファミリーファンド方式で運用を行います。

●原則として、為替ヘッジは行いません。



**?** 預託証券(DR)とは

ある国の企業の株式を海外でも流通させるために、その会社の株式を銀行等に預託し、その代替として海外で発行する証券のことで、株式と同様に取引所等で取引されます。

**?** ファミリーファンド方式とは

投資者の皆様からお預かりした資金をまとめてベビーファンドとし、その資金をマザーファンドに投資して、その実質的な運用はマザーファンドで行う仕組みです。

〈マザーファンドの概要〉

マザーファンド	主な投資対象・投資地域	運用の基本方針
外国株式ESGリーダーズインデックスマザーファンド	わが国を除く世界主要国の金融商品取引所等に上場している株式(預託証券(DR)を含みます。)	この投資信託は、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。



## 2. MSCIコクサイESGリーダーズ指数(配当込み、円換算ベース)\*1に連動する投資成果を目指します。

\*1 MSCIコクサイESGリーダーズ指数は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界主要国の株式の中から、相対的にESG評価の高い銘柄を選定することで構築される指数です。

「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。

「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算した指数です。

※指数構成銘柄の選定にあたってはESG\*2を主要な要素としています。

\*2 ESG:「Environment(環境)」「Social(社会)」「Governance(企業統治)」の頭文字をとったもの。

●株式への実質投資割合は、原則として高位を維持します。また指数に含まれない銘柄には原則として投資しません。

### MSCIコクサイESGリーダーズ指数とは

#### インデックスの概要

(2024年7月末現在)

国・地域	21カ国・地域
構成銘柄数	604銘柄

#### MSCIコクサイESGリーダーズ指数構成比率上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域名	業種	構成比率
1	マイクロソフト	米国	ソフトウェア・サービス	8.9%
2	エヌビディア	米国	半導体・半導体製造装置	8.8%
3	アルファベット(クラスA株)	米国	メディア・娯楽	3.0%
4	アルファベット(クラスC株)	米国	メディア・娯楽	2.7%
5	テスラ	米国	自動車・自動車部品	2.0%
6	イーライリリー	米国	医薬品/バイオテック/ロジック/ライフサイエンス	2.0%
7	ノボ・ノルディスク(クラスB株)	デンマーク	医薬品/バイオテック/ロジック/ライフサイエンス	1.3%
8	ビザ(クラスA株)	米国	金融サービス	1.3%
9	マスターカード(クラスA株)	米国	金融サービス	1.2%
10	ジョンソン・エンド・ジョンソン	米国	医薬品/バイオテック/ロジック/ライフサイエンス	1.1%

※上記構成比率は浮動株ベースの時価総額より算出しています。

※業種はGICS分類(産業グループ)に基づきます。

### ベンチマークの推移

(2014年7月末～2024年7月末)



(出所)MSCI Inc.及びBloombergのデータを基に三井住友トラスト・アセットマネジメント作成

※上記は過去のベンチマークデータをもとに作成したものであり、将来の運用成果を示唆あるいは保証するものではありません。また、ファンドの運用状況を表したものではありません。

### MSCIコクサイESGリーダーズ指数(配当込み、円換算ベース)について

当ファンドは、MSCI Inc.(以下「MSCI」)、その関連会社、情報提供会社又はMSCI指数の編集又は計算に関連するその他の第三者(総称して「MSCI当事者」)が支援、保証、販売又は販売促進するものではありません。MSCI指数は、MSCIが独占的に所有しています。MSCI及びMSCI指数の名称は、MSCI又はその関連会社のサービスマークであり、当社による特定の目的のための使用について許諾されているものです。

いかなるMSCI当事者も当ファンドの発行者、受益者、あるいはその他の個人もしくは法人に対して、ファンドの全般的又は当ファンドの特定の投資の妥当性、もしくはMSCI指数の株式市場のパフォーマンスに追従する能力に関して、明示・黙示を問わず一切の表明又は保証を行いません。MSCI又はその関連会社は特定の商標、サービスマーク、商号の所有者であり、当ファンドの発行者、受益者あるいはその他の個人もしくは法人とは無関係で、MSCIが決定、構成、計算するMSCI指数の所有者です。いかなるMSCI当事者も、MSCI指数について決定、構成又は計算するにあたり、当ファンドの発行者又は受益者、あるいはその他の個人もしくは法人の要求を考慮する義務を一切負いません。いかなるMSCI当事者も、当ファンドの設定時期、価格、数量に関する決定又は償還価格及び数式の決定及び算定に参加しておらず、目づその責任を負うものではありません。さらに、いかなるMSCI当事者も当ファンドの運営・管理、マーケティング又は募集に関連して、発行者、受益者、その他の個人もしくは法人に対して一切の義務又は責任を負いません。MSCIは、MSCIが信頼できると考える情報源からMSCI指数の算出に使用するための情報を入手するものとしますが、いずれのMSCI当事者も、いかなるMSCI指数又はそのデータの独創性、正確性、完全性について一切保証しません。MSCI当事者は、明示的、暗示的を問わず発行者、受益者、その他の個人もしくは法人がいかなるMSCI指数又はそのデータを使用して得られる結果に関して、いかなる保証もしません。MSCI当事者は、MSCI指数もしくはそのデータについての、もしくはそれらに関連する誤り、省略、中断について一切の責任を負いません。

さらに、MSCI当事者は、いかなる種類の明示的、黙示的な保証をするものではなく、MSCI指数もしくはそのデータに関して、商品性及び特定目的への適合性に関する保証をここに明確に否認します。上記のいずれをも制限することなく、いかなる場合もMSCI当事者は、直接的、間接的、特別的、懲罰的、派生的損害、及びその他の損害(逸失利益を含む)について、そのような損害の可能性について通知された場合においても、一切責任を負いません。

当ファンドの購入者、販売者、受益者、又はその他の個人もしくは法人も、MSCIの許諾が必要かどうかを判断するために最初にMSCIに問い合わせることなく、当ファンドを支援・保証、販売又は販売促進するためにMSCIの商号、商標又はサービスマークを使用又は言及することはできません。いかなる状況においても、MSCIの事前の書面による許諾なしに、いかなる個人も法人もMSCIとの関係を主張することはできません。

## MSCIコクサイESGリーダーズ指数について

## 【指数の特徴】

- ①MSCIのESGのリーサーチに基づいて、同社が公開情報を基に付与するESG格付けや不祥事調査等により、組入れ銘柄を決定する浮動株調整時価総額加重インデックスで、MSCI コクサイ インデックスの各セクターで同業他社比でESG評価の高い企業群のパフォーマンスを表すように設計されています。
- ②スクリーニング方法はポジティブ・スクリーニングとネガティブ・スクリーニングの組み合わせを考慮されています。

## ポジティブ・スクリーニング

## ESG格付け(ESG Ratings)

- ▶財務要因に関連のある長期的なESGリスクに対する企業の耐性を測定することを目的としています。
- ▶環境、社会、ガバナンスを統合したレーティングです。  
(評価には「キーイシュー」と呼ばれる評価項目を用います。各産業ごとに重視される項目が異なります。)
- ▶企業の開示情報を基に算出されます。

## ネガティブ・スクリーニング

## 不祥事調査(ESG Controversies)

- ▶不祥事の深刻度、性質等を評価してスコアを付与します。

ビジネス関与スクリーニング  
(Business Involvement Screening Research)  
(Climate Change Metrics)

- ▶特定の事業、制裁対象国等にかかわる企業を特定します。

## 指数の構築

MSCIが投資適格基準に適合した株式銘柄の中から、ESG格付けの高い企業を上位から順に時価総額の50%を目標に選定、ESG格付けが業種内で相対的に高い企業を選別します。この銘柄の中から、日本を除くMSCIが定義する先進国の銘柄を抽出し、浮動株調整時価総額に応じて構成銘柄のウェイトを決定します。

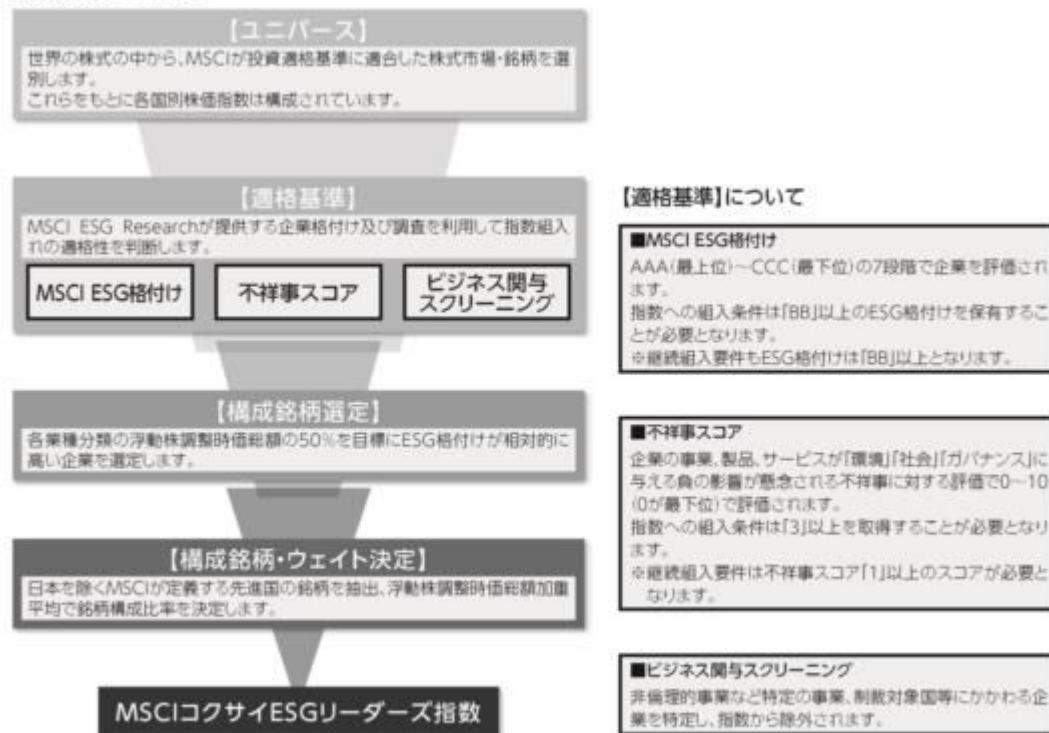
## ベンチマークとして選定した理由

- MSCIのESGリーサーチ機能である「MSCI ESG Research」のリーサーチ体制が充実しており、欧米をはじめとしてグローバルな機関投資家が同機関の商品を利用していること。
- MSCI ESGリーダーズ各指数は「MSCI ESG Research」が提供する「ESG格付け」「不祥事調査」「ビジネス関与スクリーニング」等を使用、指数とともにこれらのメソッドロジーも公表されており、透明性の高い指数であること。
- MSCIコクサイESGリーダーズ指数は日本を除く先進国の株式の中からESG評価が高い企業の株式を構成銘柄としており、日本を除く先進国の株式に投資を行う当社の外国株式インデックスプロダクトとの比較が容易であること。

※MSCIの資料に基づき、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社が作成

※上記の内容については今後変更される可能性があります。

## 【指数構築プロセス】



※MSCIの資料に基づき、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社が作成

※上記の内容については今後変更される可能性があります。

## 【MSCI ESG格付けについて】

財務要因に関連のある長期的なESGリスクに対する企業の耐性を測定することを目的としています。同業他社との相対比較での評価となります。

- ①キー 이슈スコアにウェイトをかけて各企業のESG格付けが決定されます。
- ②ESG格付けでは各産業において重要であると認識されるESG課題についてのみフォーカス、キーイシューとして特定され、評価の対象としています。
- ③ESG格付けは原則年1回更新されます。
- ④格付けの高い企業は重要なESGリスクと機会に対するエクスポージャーの管理が優れていると評価されています。

## ●キーイシューについて

- ①各産業で重要度の高いESG課題がキーイシューとして特定されます。
- ②産業によってキーイシューは異なります。
- ③どの産業においても「環境」「社会」はそれぞれから1つ以上のキーイシューが選定されます。
- ④「ガバナンス」に関するキーイシューは全業種共通して選定されます。

## ●MSCI ESG格付けモデルの階層

## ➤環境(E)

テーマ	気候変動	自然資本	汚染 廃棄物管理	環境市場機会
キーイシュー	・炭素排出 ・製品カーボンフットプリント 等	・水資源枯渇 ・生物多様性と土地利用 等	・有害物質と廃棄物管理 ・包装材廃棄 等	・グリーンテクノロジー ・グリーンビルディング 等

## ➤社会(S)

テーマ	人的資本	製品サービスの 安全	ステークホルダー マネジメント	社会市場機会
キーイシュー	・労働マネジメント ・労働安全衛生 等	・製品安全・品質 ・製品化学物質安全 等	・紛争・タラ ・地域との関係	・金融へのアクセス ・ヘルスケアへのアクセス 等

## ➤ガバナンス(G)

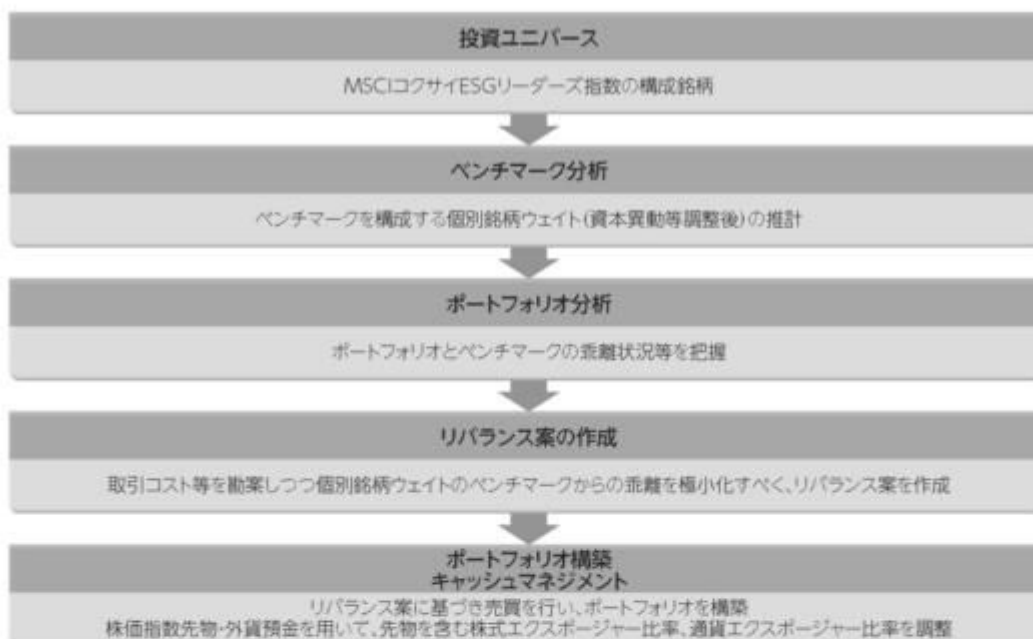
テーマ	コーポレート ガバナンス	企業行動
キーイシュー	・オーナーシップと支配 ・取締役会構成 等	・企業倫理 ・租税回避

※各テーマごとにキーイシューが2～5つ程度あります。全体のキーイシューの数は30～40程度です。

※上記の内容は今後変更になる場合があります。

※MSCIの資料に基づき、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社が作成

## マザーファンドの投資プロセス



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

## 分配方針

- 原則として毎年6月25日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、収益の分配を行います。
  - 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。
  - 分配金額については、委託会社が基準価額水準、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。
- ※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

## 主な投資制限

- 株式への実質投資割合には制限を設けません。
- 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

## &lt;ご参考情報&gt;

## 当社のスチュワードシップ活動

責任ある機関投資家として、投資リターンの最大化を目指します。スチュワードシップ活動は当ファンドのみならず当社の取り組みです。

当社は「責任ある機関投資家」として、エンゲージメント、議決権行使、投資の意思決定におけるESGの考慮を3つの柱としてスチュワードシップ活動を推進しています。投資先企業の企業価値向上に資するスチュワードシップ活動を行うことを通じ、お客さまからお預かりしている資産の中長期的な投資リターンの最大化を目指します。そして、その全ての基盤がフィデューシャリー・デューティーの実践です。当社は、スチュワードシップ活動に関する利益相反の適切な管理がフィデューシャリー・デューティーの向上につながると考え、利益相反管理を適切に行っております。



当社の責任ある機関投資家としての取り組みはスマートフォンで左記コードを読み取るかアドレスを入力することでご確認いただけます。  
[https://www.smtam.jp/institutional/stewardship\\_initiatives/](https://www.smtam.jp/institutional/stewardship_initiatives/)

※上記内容は、今後変更になる場合があります。

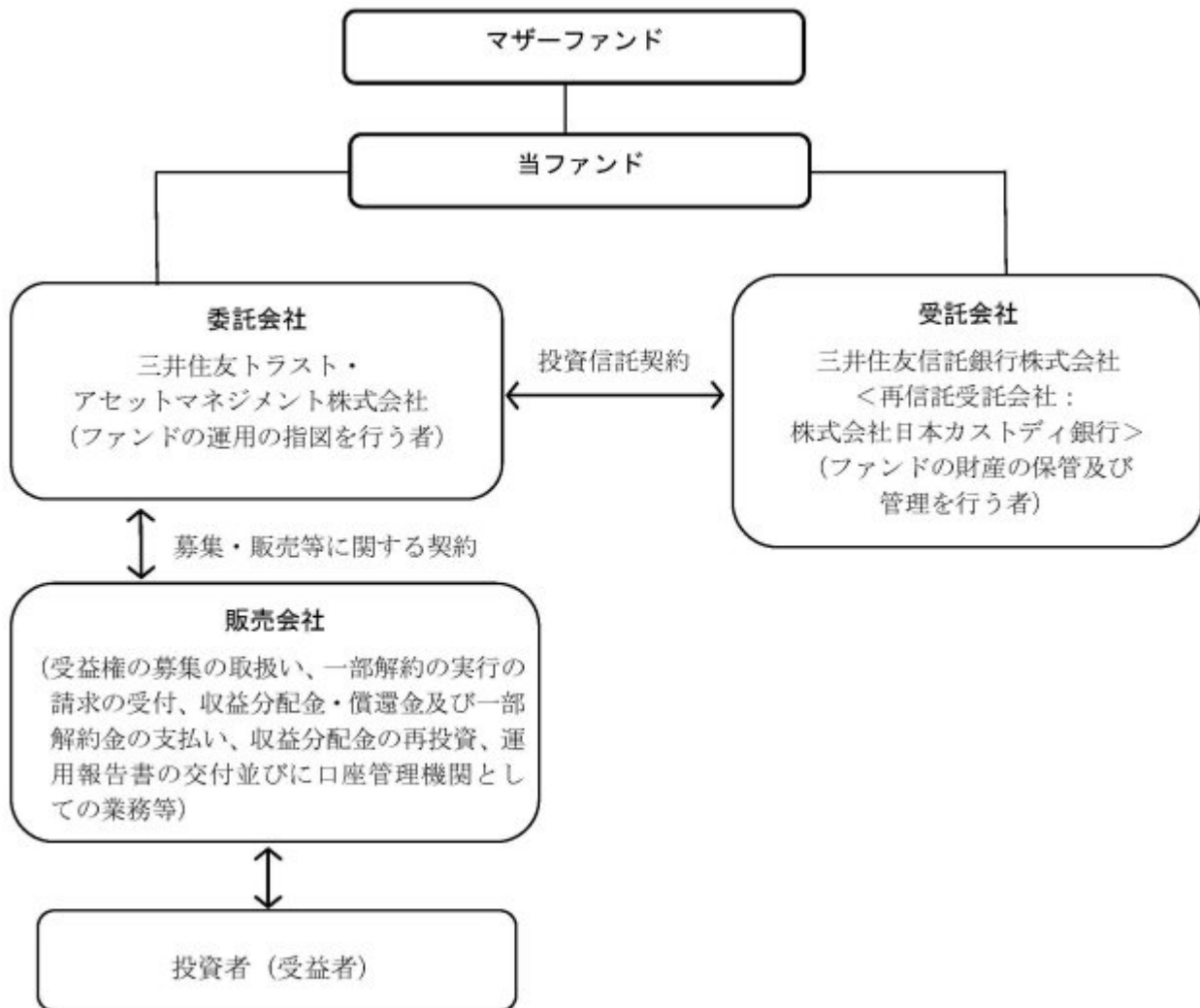
## (2) 【ファンドの沿革】

2021年 7月 8日

当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

## (3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



## 委託会社の概況（2024年 7月31日現在）

イ．資本金の額：20億円

## ロ．委託会社の沿革

- 1986年11月1日： 住信キャピタルマネジメント株式会社設立
- 1987年2月20日： 投資顧問業の登録
- 1987年9月9日： 投資一任契約に係る業務の認可
- 1990年10月1日： 住信投資顧問株式会社に商号変更
- 1999年2月15日： 住信アセットマネジメント株式会社に商号変更
- 1999年3月25日： 証券投資信託委託業の認可
- 2007年9月30日： 金融商品取引法施行に伴う金融商品取引業者の登録（登録番号：関東財務局長（金商）第347号）
- 2012年4月1日： 中央三井アセットマネジメント株式会社と合併し、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に商号変更
- 2018年10月1日： 三井住友信託銀行株式会社の運用事業に係る権利義務を承継

## ハ．大株主の状況

株主名	住所	持株数	持株比率
三井住友トラスト・ホールディングス株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番1号	3,000株	100%

## 2【投資方針】

## （１）【投資方針】

### 基本方針

当ファンドは、確定拠出年金法（平成13年法律第88号）に基づく確定拠出年金制度のための専用ファンドとして、投資信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。

### 投資対象

外国株式ESGリーダーズインデックスマザーファンド（以下「マザーファンド」ということがあります。）の受益証券を主要投資対象とします。

### 投資態度

- イ．マザーファンド受益証券への投資を通じて、主としてわが国を除く世界主要国の金融商品取引所等に上場している株式（預託証券（DR）を含みます。以下同じ。）に投資し、MSCIコクサイESGリーダーズ指数（配当込み、円換算ベース）に連動する投資成果を目指します。
- ロ．株式への実質投資割合は、原則として高位を維持します。
- ハ．実質組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。
- ニ．資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

## （２）【投資対象】

### 投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- イ．次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）
  - 1. 有価証券
  - 2. デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、投資信託約款第22条、第23条及び第24条に定めるものに限りません。）
  - 3. 金銭債権
  - 4. 約束手形
- ロ．次に掲げる特定資産以外の資産
  - 1. 為替手形

### 有価証券の指図範囲

委託会社は、信託金を、主として三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託「外国株式ESGリーダーズインデックスマザーファンド」の受益証券並びに次に掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

- 1. 株券又は新株引受権証券
- 2. 国債証券
- 3. 地方債証券
- 4. 特別の法律により法人の発行する債券
- 5. 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- 6. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）



8. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
  9. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券又は新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
  10. コマーシャル・ペーパー
  11. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）及び新株予約権証券
  12. 外国又は外国の者の発行する証券又は証書で、前各号の証券又は証書の性質を有するもの
  13. 投資信託又は外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
  14. 投資証券もしくは投資法人債券又は外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
  15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
  16. オプションを表示する証券又は証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
  17. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
  18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
  19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
  20. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
  21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
  22. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの
- なお、第1号の証券又は証書、第12号並びに第17号の証券又は証書のうち第1号の証券又は証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券及び第12号並びに第17号の証券又は証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するもの、及び第14号に記載する証券のうち投資法人債券及び外国投資証券で投資法人債券に類する証券を以下「公社債」といい、第13号の証券及び第14号の証券（「投資法人債券」及び「外国投資証券で投資法人債券に類する証券」を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

#### 金融商品の指図範囲

- イ. 委託会社は、信託金を、上記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。
1. 預金
  2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
  3. コール・ローン
  4. 手形割引市場において売買される手形
  5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
  6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの
- ロ. 上記 の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を上記イ. に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

#### (参考)マザーファンドの概要

「外国株式ESGリーダーズインデックスマザーファンド」の概要

## 1．基本方針

この投資信託は、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。

## 2．運用方法

### (1)投資対象

わが国を除く世界主要国の金融商品取引所等に上場している株式（預託証券（DR）を含みます。以下同じ。）を主要投資対象とします。

### (2)投資態度

主としてわが国を除く世界主要国の金融商品取引所等に上場している株式に投資し、MSCI コクサイESGリーダーズ指数（配当込み、円換算ベース）に連動する投資成果を目指します。

株式への投資割合は、原則として高位を維持します。

組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り。）を活用することがあります。このため、有価証券の組入総額とデリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り。）の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

### (3)運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

## （3）【運用体制】

ファンドの運用体制は以下の通りです。記載された体制、委員会等の名称、人員等は、今後変更されることがあります。



委託会社では社内規定を定めて運用に係る組織及びその権限と責任を明示するとともに、運用を行うに当たって遵守すべき基本的な事項を含め、運用とリスク管理を適正に行うことを目的とした運用等に係る業務規則を定めています。

委託会社は、受託会社又は再信託受託会社に対して、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行っています。また、外部監査法人による内部統制の整備及び運用状況の報告書を再信託受託会社より受け取っております。

#### (4) 【分配方針】

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行う方針です。

- ・ 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
- ・ 分配金額については、委託会社が基準価額水準、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、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

## （５）【投資制限】

### < 約款に定める投資制限 >

#### イ．株式への投資割合

株式への実質投資割合には制限を設けません。

#### ロ．投資信託証券への投資割合

投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

#### ハ．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

#### ニ．投資する株式等の範囲

（イ）委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券は、金融商品取引所等に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所等に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当又は社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券については、この限りではありません。

（ロ）上記（イ）の規定にかかわらず、上場予定又は登録予定の株式、新株引受権証券及び新株予約権証券で目論見書等において上場又は登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。

#### ホ．信用取引の指図範囲

（イ）委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、株券の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができます。

（ロ）上記（イ）の信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社が発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

1. 投資信託財産に属する株券及び新株引受権証券の権利行使により取得する株券
2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売出しにより取得する株券
5. 投資信託財産に属する転換社債の転換請求及び新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みません。）の新株予約権の行使により取得可能な株券
6. 投資信託財産に属する新株引受権証券及び新株引受権付社債券の新株引受権の行使、並びに投資信託財産に属する新株予約権証券及び新株予約権付社債券の新株予約権（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

#### ヘ．先物取引等の運用指図、目的及び範囲

（イ）委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所等における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）及び有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）並びに委託会社が適当と認める外国の金融商品取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。

す。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします。（以下同じ。）

- (ロ) 委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所等における通貨に係る先物取引及びオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の金融商品取引所等における通貨に係る先物取引及びオプション取引を行うことを指図することができます。
- (ハ) 委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所等における金利に係る先物取引及びオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の金融商品取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。

#### ト．スワップ取引の運用指図、目的及び範囲

- (イ) 委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことを指図することができます。
- (ロ) スワップ取引の指図に当たっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- (ニ) 委託会社は、スワップ取引を行うに当たり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

#### チ．金利先渡取引及び為替先渡取引の運用指図、目的及び範囲

- (イ) 委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことを指図することができます。
- (ロ) 金利先渡取引及び為替先渡取引の指図に当たっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) 金利先渡取引及び為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- (ニ) 委託会社は、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うに当たり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

#### リ．有価証券の貸付の指図、目的及び範囲

- (イ) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式及び公社債を次のa.及びb.の範囲内で貸付の指図をすることができます。
  - a. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、投資信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
  - b. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、投資信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- (ロ) 上記(イ) a.及びb.に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- (ハ) 委託会社は、有価証券の貸付に当たって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

#### ヌ．公社債の空売りの指図、目的及び範囲

- (イ) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産において有しない公

社債又は下記ル．の規定により借り入れた公社債を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、売り付けた公社債の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

(ロ) 上記(イ)の売付の指図は、当該売付に係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。

(ハ) 投資信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の売付に係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付の一部を決済するための指図をするものとします。

#### ル．公社債の借入れの指図、目的及び範囲

(イ) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うに当たり、担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。

(ロ) 上記(イ)の借入れの指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。

(ハ) 投資信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

(ニ) 上記(イ)の借入れに係る品借料は、投資信託財産中から支弁します。

#### ヲ．特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

#### ワ．外国為替予約取引の指図、目的及び範囲

(イ) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、並びに為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

(ロ) 上記(イ)の予約取引の指図は、投資信託財産に係る為替の買予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額と投資信託財産に係る為替の売予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額との差額につき円換算した額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、投資信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの投資信託財産に係る外貨建資産のうち投資信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

(ハ) 上記(ロ)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は、所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

(ニ) 上記(ロ)においてマザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約の総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約の総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

#### カ．資金の借入れ

(イ) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用並びに運用の安定性に資するため、一部解約に伴

う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、又は再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

（ロ）一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間又は受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金及び有価証券等の償還金の合計額を限度とします。

（ハ）収益分配金の再投資に係る借入期間は、投資信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

（ニ）借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

ヨ．一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

タ．デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

#### < 関連法令に基づく投資制限 >

イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行う全ての委託者指図型投資信託につき、投資信託財産として有する当該株式に係る議決権の総数が当該株式に係る議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、投資信託財産をもって取得することを受託会社に指図しないものとします。

### 3【投資リスク】

#### (1) ファンドのリスク

当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。従って、投資者の皆様は投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

#### 株価変動リスク

株価は、発行者の業績、経営・財務状況の変化及びそれらに関する外部評価の変化や国内外の経済情勢等により変動します。株価が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

### 為替変動リスク

為替相場は、各国の経済状況、政治情勢等の様々な要因により変動します。投資先の通貨に対して円高となった場合には、基準価額の下落要因となります。

### 信用リスク

有価証券の発行体が財政難、経営不振、その他の理由により、利払い、償還金、借入金等をあらかじめ決められた条件で支払うことができなくなった場合、又はそれが予想される場合には、有価証券の価格は下落し、基準価額の下落要因となる可能性があります。

### ESGの投資リスク

ファンドは、ESGを投資対象選定の主要な要素としており、ESG評価が相対的に高い企業の発行する有価証券を選別して組み入れます。

ESG評価と短期的な有価証券の値動きには必ずしも関連性があるわけではありません。また、ESG評価がファンドの収益源となる場合もありますが、損失が発生する要因となる場合もあります。

### 流動性リスク

時価総額が小さい、取引量が少ない等流動性が低い市場、あるいは取引規制等の理由から流動性が低下している市場で有価証券等を売買する場合、市場の実勢と大きく乖離した水準で取引されることがあり、その結果、基準価額の下落要因となる可能性があります。

### カントリーリスク

投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化、外国為替規制、資本規制、税制の変更等の事態が生じた場合、又はそれが予想される場合には、方針に沿った運用が困難になり、基準価額の下落要因となる可能性があります。

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

### <その他の留意点>

ファンドは、MSCIコクサイESGリーダーズ指数（配当込み、円換算ベース）と連動する投資成果を目標として運用を行いますが、ファンドへの入出金、個別銘柄の実質組入比率の違い、売買コストや信託報酬等の影響等から、ファンドの基準価額騰落率と上記インデックスの騰落率は必ずしも一致しません。

同じマザーファンドに投資する他のベビーファンドの資金変動等に伴いマザーファンドにおいて有価証券の売買等が発生した場合、基準価額に影響を与えることがあります。

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及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、分配金の一部又は全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

ファンドは、大量の換金申込が発生し短期間で換金代金を手当てする必要性が生じた場合や組入資産の主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。



これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受付が中止、取り消しとなる可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。

確定拠出年金制度の加入者等はファンドの受益者ではありませんが、当該加入者等がファンドのリスクを実質的に負うこととなります。

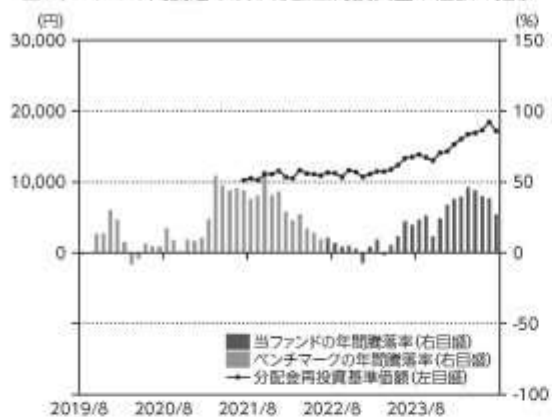
## (2) リスクの管理体制

### 委託会社におけるリスク管理体制

- ・運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 【参考情報】

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

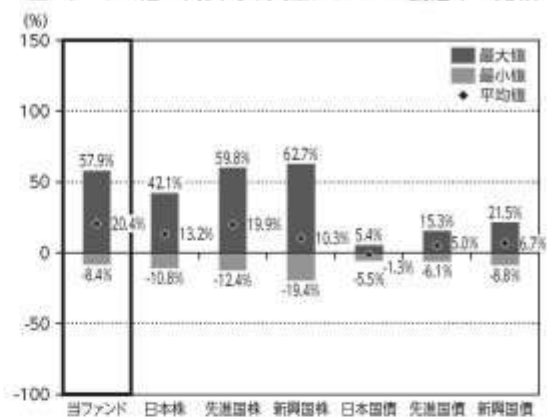


\*当ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

\*当ファンドの分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。

\*当ファンドの年間騰落率のうち、設定前については、ベンチマークの年間騰落率を用いて算出していますので、当ファンドの実績ではありません。

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



\*2019年8月～2024年7月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

\*当ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

\*当ファンドの年間騰落率のうち、設定前については、ベンチマークの年間騰落率を用いて算出していますので、当ファンドの実績ではありません。

### 各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX (東証1種指数) (配当込み)	TOPIX (東証1種指数)とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広く影響するとともに、投資対象としての選別性を有するマーケット・ベンチマークで、淨利ベースの株価指数加重方式により算出されます。(配当込み)指数は、普通収益を考慮して算出した株価指数です。同指数の指数値及び目録値に係る権利又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」といふ。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利、ノウハウ及び同指数に係る権利又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、移転及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても、JPXは責任を負いません。
先進国株 MSCIコクサイインデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイインデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)	MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMLRA-BPI指標	NOMLRA-BPI指標とは、野村フィデューシャリー・リサーチ・コンサルティング株式会社が公表する、国内で発行された公募債正利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された指数ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村フィデューシャリー・リサーチ・コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ・コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのリスクリカーターではなく、本ファンドの推薦、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、遅延又は中断につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他の一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 JPEI (J.P. Morgan Global Bond Index - Emerging Markets) (円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書翰による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

(注) 海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベース指数を使用しております。

## 4 【手数料等及び税金】

## (1) 【申込手数料】

ありません。

## (2) 【換金（解約）手数料】

<解約手数料>

ありません。

<信託財産留保額>

ご解約時に信託財産留保額（ ）の控除はありません。

「信託財産留保額」とは、償還時まで投資を続ける投資者との公平性の確保やファンド残高の安定的な推移を図るため、信託期間満了前の解約に対し解約者から徴収する一定の金額をいい、投資信託財産に繰り入れられます。

## (3) 【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率0.297%（税抜 0.27%）（ ）を乗じて得た額とします（信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率）。

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	年率 0.1485% （税抜 0.135%）	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
販売会社	年率 0.1155% （税抜 0.105%）	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	年率 0.033% （税抜 0.03%）	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

「税抜」における「税」とは、消費税及び地方消費税（以下「消費税等」といいます。）をいいます。

信託報酬は、毎日計上され、ファンドの基準価額に反映されます。信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

信託報酬に係る消費税等相当額を、信託報酬支弁のときに投資信託財産中から支弁します。

## (4) 【その他の手数料等】

投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用及び受託会社の立て替えた立替金の利息（「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、そのつど投資信託財産中から支弁します（マザーファンドにおいて負担する場合があります。）。

借入金の利息は、受益者の負担とし、原則として借入金返済時に投資信託財産中から支弁します。

当ファンドの組入る有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料（ ）、先物取引・オプション取引に要する費用（ ）、組入資産の保管に要する費用（ ）等は、受益者の負担とし、取引のつど投資信託財産中から支弁します（マザーファンドにおいて負担する場合があります。）。

投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用（ ）は、受益者の負担とし、日々計上のうえ毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

これらの手数料等は、運用状況等により変動するなどの理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料  
 先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料  
 組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料  
 財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用  
 上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、上限額等を事前に示すことができません。

#### （５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

確定拠出年金の課税上の取扱いは、下記の通りとなります。

受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関及び国民年金基金連合会である場合は、当ファンドの毎決算時の収益分配金、一部解約金及び償還金について、所得税及び地方税が課されることはありません。なお、確定拠出年金制度の加入者等については、確定拠出年金の積立金の運用に係る税制が適用されます。

上記は、2024年 7月31日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

#### （参考情報）ファンドの総経費率

直近の運用報告書作成対象期間におけるファンドの総経費率は以下の通りです。

総経費率(①+②)	運用管理費用の比率①	その他費用の比率②
0.40%	0.30%	0.10%

※対象期間は2023年6月27日～2024年6月25日です。

※対象期間中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、購入時手数料、売買委託手数料及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値(年率)です。

※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は異なります。

※詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

#### 5【運用状況】

以下は、2024年7月31日現在の状況について記載してあります。

#### 【DC外国株式ESGリーダーズインデックスファンド】

##### （１）【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	4,583,477,133	99.95
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,333,073	0.05
合計(純資産総額)		4,585,810,206	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、本ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

##### （２）【投資資産】

#### 【投資有価証券の主要銘柄】

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式ESGリーダーズインデックスマザーファンド	2,641,773,564	1.8356	4,849,239,555	1.7350	4,583,477,133	99.95

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、本ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### □ 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.95
合計	99.95

(注)投資比率は、本ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

#### (3) 【運用実績】

##### 【純資産の推移】

		純資産総額(円)		1万口当たりの純資産額(円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期計算期間末	(2022年 6月27日)	1,722,087,834	1,722,087,834	10,983	10,983
第2期計算期間末	(2023年 6月26日)	2,599,341,085	2,599,341,085	13,055	13,055
第3期計算期間末	(2024年 6月25日)	4,869,028,381	4,869,028,381	18,191	18,191
	2023年 7月末日	2,876,271,904		13,522	
	8月末日	3,027,522,377		13,858	
	9月末日	3,006,056,090		13,456	
	10月末日	2,987,224,936		13,004	
	11月末日	3,311,330,494		14,115	
	12月末日	3,451,734,354		14,299	
	2024年 1月末日	3,731,538,335		15,305	
	2月末日	4,032,743,737		16,026	
	3月末日	4,222,069,859		16,733	
	4月末日	4,397,418,493		16,905	
	5月末日	4,504,362,923		17,303	
	6月末日	4,971,697,258		18,422	
	7月末日	4,585,810,206		17,186	

##### 【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金(円)
第1期計算期間	2021年 7月 8日～2022年 6月27日	0
第2期計算期間	2022年 6月28日～2023年 6月26日	0
第3期計算期間	2023年 6月27日～2024年 6月25日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2021年 7月 8日～2022年 6月27日	9.8
第2期計算期間	2022年 6月28日～2023年 6月26日	18.9
第3期計算期間	2023年 6月27日～2024年 6月25日	39.3

(注1)収益率とは、各計算期間末の基準価額(分配付)から前計算期間末の基準価額(分配落)を控除した額を前計算期間末の基準価額(分配落)で除して得た数に100を乗じて得た数字です。

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

## (4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第1期計算期間	2021年 7月 8日～2022年 6月27日	1,586,047,544	18,133,637	1,567,913,907
第2期計算期間	2022年 6月28日～2023年 6月26日	566,857,313	143,634,569	1,991,136,651
第3期計算期間	2023年 6月27日～2024年 6月25日	1,201,868,688	516,400,190	2,676,605,149

(注1)第1期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

(注2)当該計算期間中において、本邦外における設定または解約の実績はありません。

(参考)

外国株式ESGリーダーズインデックスマザーファンド

## 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	11,371,255,866	69.81
	イギリス	602,277,020	3.70
	カナダ	508,429,715	3.12
	フランス	472,902,862	2.90
	アイルランド	431,894,345	2.65
	スイス	416,360,379	2.56
	オランダ	361,627,116	2.22
	デンマーク	285,321,230	1.75
	オーストラリア	229,125,349	1.41
	ドイツ	160,098,272	0.98
	スウェーデン	152,112,080	0.93
	イタリア	90,452,735	0.56
	スペイン	82,722,762	0.51
	香港	67,747,987	0.42
	フィンランド	60,096,634	0.37
	ノルウェー	42,272,465	0.26
	ジャージー	35,628,298	0.22
	キュラソー	31,897,453	0.20
	シンガポール	24,365,180	0.15
	バミューダ	21,788,435	0.13
リベリア	18,541,049	0.11	

	ベルギー	16,794,746	0.10
	ニュージーランド	12,654,833	0.08
	ルクセンブルク	8,030,626	0.05
	オーストリア	7,141,885	0.04
	ポルトガル	6,693,569	0.04
	ケイマン	3,360,387	0.02
	小計	15,521,593,278	95.29
投資信託受益証券	オーストラリア	4,135,327	0.03
投資証券	アメリカ	267,720,900	1.64
	オーストラリア	20,160,929	0.12
	イギリス	9,186,605	0.06
	シンガポール	6,726,961	0.04
	フランス	2,418,598	0.01
	ベルギー	2,322,297	0.01
	カナダ	1,100,189	0.01
	小計	309,636,479	1.90
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		453,979,872	2.79
合計(純資産総額)		16,289,344,956	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	291,979,765	1.79
	買建	ドイツ	64,267,526	0.39

(注1)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		39,765,184	0.24
	売建		81,154,990	0.50

(注1)評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

#### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
------	----	-----	----	----	-----------	-----------	----------	----------	---------

アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	22,429	68,242.81	1,530,618,093	64,469.92	1,445,995,943	8.88
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	79,440	18,004.68	1,430,292,446	15,812.60	1,256,153,039	7.71
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	18,725	27,320.29	511,572,557	25,959.00	486,082,417	2.98
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	16,218	27,559.62	446,962,040	26,198.33	424,884,652	2.61
アメリカ	株式	ELI LILLY & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2,568	135,688.36	348,447,730	120,459.61	309,340,285	1.90
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	9,108	27,832.49	253,498,366	33,936.19	309,090,844	1.90
デンマーク	株式	NOVO NORDISK A/S-B	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	10,356	21,843.64	226,212,736	19,810.44	205,156,917	1.26
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	5,026	42,119.17	211,690,958	40,106.96	201,577,601	1.24
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7,657	22,731.85	174,057,797	24,593.14	188,309,713	1.16
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	7,492	25,678.51	192,383,457	24,649.54	184,674,414	1.13
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	金融サービス	2,648	69,658.98	184,456,985	68,209.27	180,618,168	1.11
アメリカ	株式	HOME DEPOT	一般消費財・サービス流通・小売り	3,149	53,488.14	168,434,175	55,440.90	174,583,405	1.07
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	1,270	156,398.16	198,625,670	132,851.87	168,721,879	1.04
アメリカ	株式	MERCK & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8,048	20,268.42	163,120,263	17,568.70	141,392,978	0.87
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	13,014	9,751.58	126,907,151	10,317.13	134,267,250	0.82
アメリカ	株式	SALESFORCE INC	ソフトウェア・サービス	3,083	36,576.45	112,765,206	39,318.84	121,220,012	0.74
イギリス	株式	ASTRAZENECA	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	4,926	24,426.93	120,327,071	23,886.63	117,665,565	0.72
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	1,424	79,904.47	113,783,972	82,120.95	116,940,236	0.72
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	4,368	25,622.11	111,917,400	26,399.55	115,313,275	0.71
アメリカ	株式	ADVANCED MICRO DEVICES	半導体・半導体製造装置	5,135	24,428.51	125,440,399	21,103.79	108,367,980	0.67
スイス	株式	NOVARTIS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	6,263	16,595.32	103,936,542	17,022.26	106,610,464	0.65
アイルランド	株式	LINDE PLC	素材	1,534	67,552.26	103,625,170	68,727.57	105,428,099	0.65

アイルランド	株式	ACCENTURE PLC-CL A	ソフトウェア・サービス	1,998	46,831.09	93,568,523	50,183.24	100,266,130	0.62
フランス	株式	LVMH	耐久消費財・アパレル	877	119,792.58	105,058,097	107,574.23	94,342,605	0.58
アメリカ	株式	DANAHER CORP	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2,236	39,140.49	87,518,146	41,949.96	93,800,119	0.58
アメリカ	株式	MCDONALD'S CORP	消費者サービス	2,291	39,692.32	90,935,121	40,616.11	93,051,516	0.57
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	3,474	24,472.71	85,018,221	25,530.65	88,693,482	0.54
アメリカ	株式	TEXAS INSTRUMENTS	半導体・半導体製造装置	2,892	29,559.64	85,486,480	30,638.91	88,607,744	0.54
アメリカ	株式	AMGEN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1,703	48,498.78	82,593,433	50,805.20	86,521,261	0.53
アメリカ	株式	INTUIT INC	ソフトウェア・サービス	890	95,104.26	84,642,798	96,921.35	86,260,003	0.53

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	2.79
		素材	3.63
		資本財	6.38
		商業・専門サービス	1.60
		運輸	1.76
		自動車・自動車部品	2.07
		耐久消費財・アパレル	1.90
		消費者サービス	1.74
		メディア・娯楽	7.31
		一般消費財・サービス流通・小売り	3.38
		生活必需品流通・小売り	0.84
		食品・飲料・タバコ	2.47
		家庭用品・パーソナル用品	2.67
		ヘルスケア機器・サービス	2.47
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.91
		銀行	3.45
		金融サービス	7.47
		保険	3.48
		エクイティ不動産投資信託(REIT)	0.06
		ソフトウェア・サービス	14.89
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	0.60		
電気通信サービス	0.90		
公益事業	1.60		



		半導体・半導体製造装置	11.70
		不動産管理・開発	0.20
		小計	95.29
投資信託受益証券			0.03
投資証券			1.90
合計			97.21

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券または当該業種の時価の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	S&P 500 EMIN	買建	7	アメリカドル	1,939,012.6	295,583,081	1,915,375	291,979,765	1.79
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	8	ユーロ	395,376	65,193,548	389,760	64,267,526	0.39

(注1)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	220,000.00	33,886,600	33,531,740	0.21
	ユーロ	買建	20,000.00	3,331,960	3,297,460	0.02
	イギリスポンド	買建	15,000.00	2,969,850	2,935,984	0.02
	アメリカドル	売建	470,000.00	71,623,300	71,625,180	0.44
	ユーロ	売建	40,000.00	6,594,200	6,594,240	0.04
	イギリスポンド	売建	15,000.00	2,935,500	2,935,570	0.02

(注1)評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

#### 参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績

## 運用実績

当初設定日：2021年7月8日  
作成基準日：2024年7月31日

### 基準価額・純資産の推移



基準価額	17,186円
純資産総額	45.86億円

### 分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2022年6月	0円
2023年6月	0円
2024年6月	0円
—	—
—	—
設定来 分配金合計額	0円

※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

### 主要な資産の状況

銘柄名	国/地域	種類	業種	実質投資比率
MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	8.9%
NVIDIA CORP	アメリカ	株式	半導体・半導体製造装置	7.7%
ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	メディア・娯楽	3.0%
ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	メディア・娯楽	2.6%
ELI LILLY & CO	アメリカ	株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1.9%
TESLA INC	アメリカ	株式	自動車・自動車部品	1.9%
NOVO NORDISK A/S-B	デンマーク	株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1.3%
VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	金融サービス	1.2%
JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1.2%
PROCTER & GAMBLE CO	アメリカ	株式	家庭用品・パーソナル用品	1.1%

※実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

### 年間収益率の推移（暦年ベース）



※2021年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2024年は年初から作成基準日までの収益率です。

※2015年～2020年は、ファンドのベンチマークである「MSCIコフサイESGリーダーズ指数(配当込み、円換算ベース)」の年間収益率です。

※ベンチマークの年間収益率は国内の取引所の営業日に準じて算出しております。

※ベンチマークはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

記載された運用実績は過去のものであり、将来の運用成果を約束するものではありません。

運用の内容等は、表紙に記載されている委託会社のホームページ等でご確認いただけます。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### < 申込手続 >

当ファンドは確定拠出年金制度のための専用ファンドです。従って、確定拠出年金法第8条第1項に規定する事業主による資産管理契約の相手方及び同法第55条に規定する個人型年金に係る規約を作

成した国民年金基金連合会（同法第61条に基づいて事務を委託された者を含みます。）による取得の申込みのみの取扱いとなります。

受益権取得申込者は、販売会社との間で、受益権の取引に関する契約を締結していただきます。

#### < 申込コース >

当ファンドは、「分配金再投資コース」（ ）専用ファンドです。

「分配金再投資コース」での受益権の取得申込者は、販売会社との間で、分配金再投資に関する契約を締結していただきます。

#### < 申込みの受付 >

お申込みの受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。なお、当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

2024年11月5日受付分からは、お申込みの受付は、原則として、営業日の午後3時半までにお申込みが行われ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込受付分とします。当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。なお、販売会社によっては対応が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

#### < 申込単位 >

1円以上1円単位とします。

#### < 申込価額 >

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

（注）分配金再投資に関する契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の申込価額は、各計算期間終了日の基準価額とします。

#### < 申込手数料 >

ありません。

#### < 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

#### < 受付不可日 >

収益分配金を再投資する場合を除き、申込日当日が下記のうちのいずれかの場合は、申込みを受け付けないものとします。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

#### < 申込受付の中止等 >

収益分配金を再投資する場合を除き、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

### < その他 >

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時に又はあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録を行うことができます。委託会社は、分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載又は記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとし、振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載又は記録を行います。受託会社は、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

### < 問い合わせ先 >

上記手続きの詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記の照会先までお問い合わせください。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

## 2【換金（解約）手続等】

### < 一部解約手続 >

受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。委託会社は、一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、この投資信託契約の一部を解約します。

### < 一部解約の受付 >

一部解約の実行の請求の受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日の受付とします。なお、当該時間を過ぎての受付は翌営業日の取扱いとさせていただきます。

2024年11月5日受付分からは、一部解約の実行の請求の受付は、原則として、営業日の午後3時半までにお申込みが行われ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日の受付とします。当該時間を過ぎての受付は翌営業日の取扱いとさせていただきます。なお、販売会社によっては対応が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

### < 一部解約単位 >

1口以上1口単位とします。

### < 解約価額 >

一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額（以下「解約価額」といいます。）とします。

解約価額は委託会社の営業日において日々算出されます。日々の解約価額は、販売会社へお問い合わせください。また、解約価額は原則として、委託会社ホームページ（<https://www.smtam.jp/>）でご覧いただけます。

#### < 一部解約代金の支払い >

受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、5営業日目から販売会社において当該受益者に支払われます。

なお、確定拠出年金制度の加入者等が一部解約金の支払を受ける日は確定拠出年金制度の定めにより拘束されます。

#### < 受付不可日 >

一部解約受付日当日が下記のうちのいずれかの場合は、一部解約の実行の請求を受け付けません。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

#### < 一部解約受付の中止等 >

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付を中止すること、及びすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができます。

一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして上記「解約価額」の規定に準じて計算された価額とします。

#### < 一部解約の制限 >

当ファンドの規模及び商品性格などに基づき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の一部解約には受付時間及び金額の制限を行う場合があります。詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。

#### < その他 >

一部解約の実行の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの投資信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載又は記録が行われます。

#### < お問い合わせ先 >

上記手続きの詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記の照会先までお問い合わせください。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

### 3【資産管理等の概要】

#### （1）【資産の評価】

##### < 基準価額の算出方法 >

基準価額とは、投資信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券及び借入公社債を除きます。）を法令及び一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た投資信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。ただし、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

##### < 基準価額の算出頻度 >

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

##### < 主要な投資対象資産の評価方法 >

###### マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

###### マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

外国上場株式（上場には店頭登録を含みます。）

原則として計算日に知りうる直近の日における外国金融商品市場の最終相場（店頭登録銘柄は海外店頭市場の最終相場又は最終買気配相場）で評価します。

###### 外貨建資産等の円換算

外貨建資産の円換算については、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算し、為替予約の評価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算します。

##### < 基準価額の照会方法 >

基準価額は、販売会社又は委託会社へお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記に記載の照会先までお問い合わせください。また、基準価額は原則として、委託会社ホームページ（<https://www.smtam.jp/>）でご覧いただけます。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

#### （2）【保管】

該当事項はありません。

#### （3）【信託期間】

無期限とします。（2021年 7月 8日設定）

ただし、下記「(5)その他 <投資信託契約の終了（償還）と手続き>」の事項に該当する場合は、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

#### (4)【計算期間】

原則として、毎年6月26日から翌年6月25日までとします。

ただし、第1計算期間は2021年7月8日から2022年6月27日までとします。

なお、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

#### (5)【その他】

<投資信託契約の終了（償還）と手続き>

##### (1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託契約に定める手続きに従い、受託会社と合意のうえ、この投資信託契約を解約し信託を終了（繰上償還）させることができます。

- ・受益権の口数が30億口を下回ることとなった場合
- ・投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合
- ・やむを得ない事情が発生した場合

委託会社は、監督官庁よりこの投資信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、ファンドを繰上償還させます。

委託会社は、監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したとき又は業務を廃止したときは、原則として、ファンドを繰上償還させます。

委託会社は、上記の場合においてファンドを繰上償還させる場合は、あらかじめ、その旨を監督官庁に届け出ます。

##### (2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

委託会社は上記（1）によりファンドの繰上償還を行おうとする場合、以下の手続きで行います。

委託会社は、ファンドの繰上償還について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びにファンドの繰上償還の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託契約に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

受益者（委託会社及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

上記の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

上記からまでの規定は、委託会社がファンドの繰上償還について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託契約に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記からまでの手続きを行うことが困難な場合にも

適用しません。

#### < 投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き >

##### (1) 投資信託約款の変更等

委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託約款に定める手続きに従い、受託会社と合意のうえ、この投資信託約款を変更すること又は受託会社を同一とする他のファンドとの併合を行うことができます。

- ・ 受益者の利益のため必要と認めるとき
- ・ やむを得ない事情が発生したとき

委託会社は、投資信託約款の変更又はファンドの併合を行う場合は、あらかじめ、その旨及びその内容を監督官庁に届け出ます。

委託会社は、監督官庁の命令に基づいて、投資信託約款を変更しようとするときは、本手続きに従います。

##### (2) 重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

委託会社はファンドの約款変更のうち重大な内容の変更（以下「重大な約款変更」といいます。）又はファンドの併合について、以下の手続きで行います。

委託会社は、ファンドの重大な約款変更又はファンドの併合（併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びに重大な約款変更又はファンドの併合の内容及びその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託約款に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

受益者（委託会社及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

上記の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

上記 から までの規定は、委託会社が重大な約款変更又はファンドの併合について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託約款に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合であっても、当該併合に係る他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

#### < 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に違反して投資信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社又は受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。受託会社が辞任した場合、又は裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、上記< 投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き > に従い、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。



委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

#### < 運用報告書 >

委託会社は、毎決算時及び償還時に交付運用報告書及び運用報告書（全体版）を作成し、交付運用報告書を販売会社を通じて知れている受益者に対して交付します。

#### < 関係法人との契約の更改手続き >

・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

当該契約の有効期間は、契約満了日の3ヶ月前までに委託会社及び販売会社から別段の意思表示のないときは、自動的に1年間延長され、その後も同様とします。

#### < 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### < 混蔵寄託 >

金融機関又は第一種金融商品取引業者等（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者及び外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下同じ。）から、売買代金及び償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書又はコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関又は第一種金融商品取引業者等が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関又は第一種金融商品取引業者等の名義で混蔵寄託することができるものとします。

#### < 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

信託の登記又は登録をすることができる投資信託財産については、信託の登記又は登録をすることとします。ただし、受託会社が認める場合は、信託の登記又は登録を留保することがあります。

上記 ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託会社又は受託会社が必要と認めるときは、速やかに登記又は登録をするものとします。

投資信託財産に属する旨の記載又は記録をすることができる投資信託財産については、投資信託財産に属する旨の記載又は記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託会社が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

## 4【受益者の権利等】

### (1) 収益分配金に対する請求権

受益者は、委託会社の決定した収益分配金を持分に応じて請求する権利を有します。

収益分配金は、原則として毎計算期間終了日（決算日）の翌営業日に、販売会社に交付されます。

販売会社は、毎決算日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（当該収益分配金に係る決算日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収

益分配金に係る決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とします。) に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付を行います。当該売付により増加した受益権は、振替口座簿に記載又は記録されます。

#### (2) 償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に、原則として償還日から起算して5営業日までに支払いを開始します。

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

受益者が償還金について支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

#### (3) 換金（解約）請求権

受益者は、自己に帰属する受益権について、一部解約の実行の請求をすることにより換金する権利を有します。

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

#### (4) 帳簿閲覧・謄写請求権

受益者は委託会社に対し、その営業時間内に当ファンドの投資信託財産に関する帳簿書類の閲覧又は謄写を請求することができます。

### 第3【ファンドの経理状況】

(1)当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則(昭和38年大蔵省令第59号)」並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期計算期間(2023年6月27日から2024年6月25日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【DC外国株式ESGリーダーズインデックスファンド】

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 (2023年 6月26日現在)	第3期 (2024年 6月25日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	4,715,356	17,061,337
親投資信託受益証券	2,598,032,432	4,866,580,318
未収利息	-	31
流動資産合計	2,602,747,788	4,883,641,686
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	140,577	8,384,754
未払受託者報酬	356,321	679,490
未払委託者報酬	2,850,468	5,435,874
未払利息	11	-
その他未払費用	59,326	113,187
流動負債合計	3,406,703	14,613,305
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,991,136,651	2,676,605,149
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	608,204,434	2,192,423,232
(分配準備積立金)	522,532,653	1,562,416,122
元本等合計	2,599,341,085	4,869,028,381
純資産合計	2,599,341,085	4,869,028,381
負債純資産合計	2,602,747,788	4,883,641,686

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期		第3期	
	自 至	2022年 6月28日 2023年 6月26日	自 至	2023年 6月27日 2024年 6月25日
<b>営業収益</b>				
受取利息		8		1,749
有価証券売買等損益		402,108,999		1,285,120,686
<b>営業収益合計</b>		<b>402,109,007</b>		<b>1,285,122,435</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		1,640		1,065
受託者報酬		663,234		1,179,099
委託者報酬		5,305,734		9,432,655
その他費用		110,410		196,392
<b>営業費用合計</b>		<b>6,081,018</b>		<b>10,809,211</b>
<b>営業利益又は営業損失（ ）</b>		<b>396,027,989</b>		<b>1,274,313,224</b>
経常利益又は経常損失（ ）		396,027,989		1,274,313,224
<b>当期純利益又は当期純損失（ ）</b>		<b>396,027,989</b>		<b>1,274,313,224</b>
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		9,129,270		136,547,298
<b>期首剰余金又は期首欠損金（ ）</b>		<b>154,173,927</b>		<b>608,204,434</b>
剰余金増加額又は欠損金減少額		81,911,331		623,268,191
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		81,911,331		623,268,191
剰余金減少額又は欠損金増加額		14,779,543		176,815,319
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		14,779,543		176,815,319
分配金		-		-
<b>期末剰余金又は期末欠損金（ ）</b>		<b>608,204,434</b>		<b>2,192,423,232</b>

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年6月26日から翌年6月25日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第3期計算期間は2023年6月27日から2024年6月25日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

	第2期 (2023年6月26日現在)	第3期 (2024年6月25日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	1,991,136,651口	2,676,605,149口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.3055円 (13,055円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.8191円 (18,191円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第2期 自 2022年6月28日 至 2023年6月26日			第3期 自 2023年6月27日 至 2024年6月25日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	37,760,096円	費用控除後の配当等収益額	A	63,617,269円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	349,138,623円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	1,074,148,657円
収益調整金額	C	85,671,781円	収益調整金額	C	630,007,110円
分配準備積立金額	D	135,633,934円	分配準備積立金額	D	424,650,196円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	608,204,434円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,192,423,232円
当ファンドの期末残存口数	F	1,991,136,651口	当ファンドの期末残存口数	F	2,676,605,149口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	3,054円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	8,191円
1万口当たり分配金額	H	-円	1万口当たり分配金額	H	-円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	-円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	-円

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	第3期 自 2023年6月27日 至 2024年6月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	第3期 (2024年6月25日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

第3期 (2024年 6月25日現在)	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	第2期 自 2022年 6月28日 至 2023年 6月26日	第3期 自 2023年 6月27日 至 2024年 6月25日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	1,567,913,907円	1,991,136,651円
期中追加設定元本額	566,857,313円	1,201,868,688円
期中一部解約元本額	143,634,569円	516,400,190円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	第2期 (2023年 6月26日現在)	第3期 (2024年 6月25日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	402,414,855	1,189,605,802
合計	402,414,855	1,189,605,802

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （4）【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	外国株式 ESGリーダーズインデックスマザーファンド	2,650,642,875	4,866,580,318	
合計		2,650,642,875	4,866,580,318	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## （参考）

当ファンドは親投資信託受益証券を投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上されている親投資信託受益証券の状況は次のとおりであります。

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

## 外国株式ESGリーダーズインデックスマザーファンド

## 貸借対照表

2024年 6月25日現在	
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	564,371,755
コール・ローン	7,412,648
株式	16,468,560,382
投資信託受益証券	4,751,347
投資証券	299,704,511
派生商品評価勘定	3,488,304
未収入金	149,903
未収配当金	16,678,072
未収利息	13
差入委託証拠金	223,126,637
流動資産合計	17,588,243,572
資産合計	17,588,243,572
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	213,740
前受金	3,284,735
未払解約金	2,911
流動負債合計	3,501,386
負債合計	3,501,386
純資産の部	
元本等	
元本	9,577,609,205
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	8,007,132,981
元本等合計	17,584,742,186
純資産合計	17,584,742,186
負債純資産合計	17,588,243,572

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

2024年 6月25日現在	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(1) 先物取引</p>



2024年 6月25日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買取場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買取場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

2024年 6月25日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	9,577,609,205口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.8360円 (1万口当たり純資産額) (18,360円)

## (金融商品に関する注記)

## 1.金融商品の状況に関する事項

2024年 6月25日現在	
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 2.金融商品の時価等に関する事項

2024年 6月25日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券

	2024年 6月25日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## ( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( その他の注記 )

## 元本の移動

区分	2024年 6月25日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 6月27日
期首元本額	9,095,211,203円
期中追加設定元本額	2,345,349,058円
期中一部解約元本額	1,862,951,056円
期末元本額	9,577,609,205円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド(安定型)	140,997,633円
コア投資戦略ファンド(成長型)	345,177,988円
コア投資戦略ファンド(切替型)	150,284,295円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	84,973,097円
外国株式SMTBセレクション(SMA専用)	5,964,784,153円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	144,422,799円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	36,726,438円
DC外国株式ESGリーダーズインデックスファンド	2,650,642,875円
FOFs用 外国株式ESGリーダーズ・インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	59,599,927円

## ( 有価証券に関する注記 )

## 売買目的有価証券

種類	2024年 6月25日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	3,075,332,889
投資信託受益証券	542,204
投資証券	26,366,014
合計	3,101,156,699

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「外国株式ESGリーダーズインデックスマザーファンド」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

## ( デリバティブ取引に関する注記 )

## 株式関連

( 2024年 6月25日現在 )

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	811,003,158	-	814,287,893	3,284,735
合計		811,003,158	-	814,287,893	3,284,735

## (注)1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 計算日又は計算日に知りうる直近の日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 通貨関連

(2024年 6月25日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	12,183,090	-	12,172,919	10,171
	アメリカドル	10,060,330	-	10,050,065	10,265
	オーストラリアドル	2,122,760	-	2,122,854	94
合計		12,183,090	-	12,172,919	10,171

## (注)時価の算定方法

わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1)株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	BAKER HUGHES CO	3,429	34.41	117,991.89	
	CHENIERE ENERGY INC	711	165.96	117,997.56	
	HALLIBURTON CO	2,908	34.34	99,860.72	
	HF SINCLAIR CORP	505	53.81	27,174.05	
	KINDER MORGAN INC	6,619	20.11	133,108.09	
	MARATHON PETROLEUM CORP	1,145	173.99	199,218.55	
	ONEOK INC	1,824	80.89	147,543.36	
	PHILLIPS 66	1,360	138.55	188,428.00	
	SCHLUMBERGER	4,395	47.48	208,674.60	
	TARGA RESOURCES CORP	636	128.60	81,789.60	
	VALERO ENERGY CORP	1,047	150.73	157,814.31	

WILLIAMS COS	3,848	43.11	165,887.28
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	706	270.90	191,255.40
AVERY DENNISON CORP	251	229.52	57,609.52
BALL CORP	921	61.58	56,715.18
ECOLAB INC	818	244.64	200,115.52
INT'L PAPER CO	1,067	47.32	50,490.44
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	776	97.86	75,939.36
LINDE PLC	1,534	443.14	679,776.76
LYONDELLBASELL INDU-CL A	801	97.52	78,113.52
MARTIN MARIETTA MATERIALS	188	541.17	101,739.96
NEWMONT CORPORATION	3,602	42.60	153,445.20
NUCOR CORP	769	155.56	119,625.64
PPG INDUSTRIES INC	779	128.15	99,828.85
STEEL DYNAMICS INC	441	126.34	55,715.94
WESTROCK CO	968	51.09	49,455.12
3 M COMPANY	1,735	102.99	178,687.65
AERCAP HOLDINGS NV	651	93.31	60,744.81
ALLEGION PLC	283	118.39	33,504.37
AXON ENTERPRISE INC	219	292.70	64,101.30
CARRIER GLOBAL CORP	2,696	64.63	174,242.48
CATERPILLAR	1,587	330.00	523,710.00
CNH INDUSTRIAL NV	2,770	10.20	28,254.00
CUMMINS INC	448	283.96	127,214.08
DEERE&CO	840	378.17	317,662.80
DOVER CORP	416	184.40	76,710.40
EATON CORP	1,271	322.08	409,363.68
EMCOR GROUP INC	150	380.78	57,117.00
FERGUSON PLC	643	195.37	125,622.91
FORTIVE CORP	1,182	74.24	87,751.68
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	438	67.12	29,398.56
GENERAL ELECTRIC CO	3,474	160.54	557,715.96
GRACO INC	519	79.79	41,411.01
GRAINGER (WW) INC	138	915.50	126,339.00
IDEX CORP	216	204.50	44,172.00
ILLINOIS TOOL WORKS	950	242.59	230,460.50
INGERSOLL-RAND INC	1,247	92.92	115,871.24
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	2,151	68.77	147,924.27
LENNOX INTERNATIONAL INC	108	547.32	59,110.56
OWENS CORNING	245	178.24	43,668.80
PENTAIR PLC	479	80.00	38,320.00
QUANTA SERVICES INC	487	274.23	133,550.01
ROCKWELL AUTOMATION INC	382	265.87	101,562.34

TORO CO	322	94.98	30,583.56
TRANE TECHNOLOGIES PLC	739	338.14	249,885.46
UNITED RENTALS INC	216	645.37	139,399.92
XYLEM INC	752	138.34	104,031.68
AUTOMATIC DATA PROCESS	1,288	249.20	320,969.60
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	350	201.84	70,644.00
CINTAS CORP	291	711.00	206,901.00
DAYFORCE INC	453	50.21	22,745.13
PAYCHEX INC	1,012	126.08	127,592.96
PAYLOCITY HOLDING CORP	129	135.10	17,427.90
TRANSUNION	597	75.55	45,103.35
VERALTO CORP	783	99.75	78,104.25
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	374	88.49	33,095.26
CSX CORP	6,407	33.21	212,776.47
DELTA AIR LINES INC	457	49.40	22,575.80
EXPEDITORS INTL WASH INC	413	126.98	52,442.74
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	6,680	3.53	23,580.40
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	226	157.97	35,701.22
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	528	48.89	25,813.92
OLD DOMINION FREIGHT LINE	621	176.07	109,339.47
UNION PACIFIC CORP	1,938	226.36	438,685.68
UNITED PARCEL SERVICE B	2,364	138.60	327,650.40
APTIV PLC	915	76.09	69,622.35
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	2,859	11.01	31,477.59
TESLA INC	9,108	182.58	1,662,938.64
DECKERS OUTDOOR CORP	81	978.08	79,224.48
DR HORTON INC	949	144.05	136,703.45
LULULEMON ATHLETICA INC	397	312.28	123,975.16
NIKE B	3,851	97.17	374,201.67
NVR INC	10	7,740.78	77,407.80
PULTE GROUP INC	693	112.68	78,087.24
BOOKING HOLDINGS INC	109	3,981.20	433,950.80
DARDEN RESTAURANTS INC	379	154.13	58,415.27
DOMINO'S PIZZA INC	111	533.42	59,209.62
DOORDASH INC - A	898	110.70	99,408.60
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	799	217.04	173,414.96
MCDONALD'S CORP	2,291	260.38	596,530.58
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	775	154.52	119,753.00
YUM BRANDS INC	900	133.99	120,591.00
ALPHABET INC-CL A	18,725	179.22	3,355,894.50
ALPHABET INC-CL C	16,218	180.79	2,932,052.22
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	298	285.85	85,183.30

COMCAST CORP-CL A	12,594	38.48	484,617.12
ELECTRONIC ARTS INC	762	141.23	107,617.26
FOX CORP - CLASS A	918	34.46	31,634.28
FOX CORP- CLASS B	492	32.07	15,778.44
INTERPUBLIC GROUP OF COS	1,160	29.51	34,231.60
OMNICOM GROUP	623	90.73	56,524.79
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	565	159.71	90,236.15
THE WALT DISNEY CO	5,798	101.98	591,280.04
AUTOZONE INC	57	2,985.44	170,170.08
BATH & BODY WORKS INC	712	41.50	29,548.00
BEST BUY COMPANY INC	593	89.33	52,972.69
BURLINGTON STORES INC	211	242.53	51,173.83
CARMAX INC	544	73.18	39,809.92
DICK'S SPORTING GOODS INC	187	229.78	42,968.86
EBAY	1,615	54.01	87,226.15
ETSY INC	377	59.95	22,601.15
GENUINE PARTS CO	499	142.05	70,882.95
HOME DEPOT	3,149	350.88	1,104,921.12
LKQ CORP	787	41.97	33,030.39
LOWES COMPANIES	1,819	228.39	415,441.41
MERCADOLIBRE INC	149	1,582.86	235,846.14
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	188	1,083.52	203,701.76
POOL CORP	111	337.91	37,508.01
TJX COMPANIES INC	3,600	111.05	399,780.00
TRACTOR SUPPLY COMPANY	337	277.37	93,473.69
ULTA BEAUTY INC	149	389.72	58,068.28
WILLIAMS-SONOMA INC	194	307.55	59,664.70
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	1,098	19.79	21,729.42
KROGER CO	2,283	50.02	114,195.66
TARGET (DAYTON HUDSON)	1,521	149.69	227,678.49
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	2,330	15.91	37,070.30
BUNGE GLOBAL SA	425	108.17	45,972.25
CAMPBELL SOUP CO (US)	623	45.27	28,203.21
COCA-COLA CO	13,014	63.97	832,505.58
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	685	75.97	52,039.45
CONAGRA BRANDS INC	1,386	29.34	40,665.24
GENERAL MILLS INC	1,790	68.07	121,845.30
HORMEL FOODS CORP	878	30.96	27,182.88
JM SMUCKER CO	330	111.86	36,913.80
KELLANOVA	944	58.26	54,997.44
KEURIG DR PEPPER INC	3,592	34.67	124,534.64
LAMB WESTON HOLDINGS INC	450	84.95	38,227.50

MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	733	69.20	50,723.60
PEPSICO INC	4,368	168.08	734,173.44
CHURCH & DWIGHT CO INC	760	107.48	81,684.80
CLOROX COMPANY	452	136.12	61,526.24
COLGATE-PALMOLIVE CO	2,485	98.99	245,990.15
KIMBERLY-CLARK CORP	1,062	139.70	148,361.40
PROCTER & GAMBLE CO	7,492	168.45	1,262,027.40
ALIGN TECHNOLOGY INC	216	237.08	51,209.28
CENCORA INC	543	239.36	129,972.48
COOPER COS INC/THE	600	89.81	53,886.00
DAVITA INC	138	143.88	19,855.44
DEXCOM INC	1,251	110.57	138,323.07
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	1,946	90.17	175,470.82
ELEVANCE HEALTH INC	740	541.71	400,865.40
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	1,375	78.85	108,418.75
HCA HEALTHCARE INC	654	341.37	223,255.98
HENRY SCHEIN INC	408	67.27	27,446.16
HOLOGIC INC	714	72.48	51,750.72
HUMANA INC	378	358.04	135,339.12
IDEXX LABORATORIES INC	265	491.49	130,244.85
INSULET CORP	273	203.94	55,675.62
LABCORP HOLDINGS INC	246	208.00	51,168.00
MOLINA HEALTHCARE INC	173	308.98	53,453.54
QUEST DIAGNOSTICS	343	140.23	48,098.89
SOLVENTUM CORP	466	51.30	23,905.80
STERIS PLC	290	216.56	62,802.40
TELEFLEX INC	130	200.73	26,094.90
THE CIGNA GROUP	902	343.14	309,512.28
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	710	108.46	77,006.60
AGILENT TECHNOLOGIES	917	135.08	123,868.36
AMGEN	1,703	318.15	541,809.45
AVANTOR INC	2,087	22.50	46,957.50
BIO-TECHNE CORP	460	74.49	34,265.40
BIOGEN INC	457	226.60	103,556.20
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	6,440	42.23	271,961.20
CATALENT INC	575	56.47	32,470.25
DANAHER CORP	2,236	256.76	574,115.36
ELI LILLY & CO	2,568	890.11	2,285,802.48
GILEAD SCIENCES INC	4,033	70.73	285,254.09
IQVIA HOLDINGS INC	578	214.09	123,744.02
JOHNSON & JOHNSON	7,657	149.12	1,141,811.84
MERCK & CO	8,048	132.96	1,070,062.08

METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	68	1,453.98	98,870.64
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	316	133.62	42,223.92
REPLIGEN CORP	163	123.65	20,154.95
WATERS CORP	180	289.27	52,068.60
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	250	331.00	82,750.00
ZOETIS INC	1,474	171.84	253,292.16
CITIZENS FINANCIAL GROUP	1,443	35.39	51,067.77
HUNTINGTON BANCSHARES INC	4,109	12.98	53,334.82
KEY CORP	2,947	13.92	41,022.24
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	1,304	154.90	201,989.60
REGIONS FINL CORP	2,685	19.31	51,847.35
TRUIST FINANCIAL CORP	4,208	37.46	157,631.68
US BANCORP	4,896	40.55	198,532.80
ALLY FINANCIAL INC	1,015	40.40	41,006.00
AMERICAN EXPRESS	1,831	231.47	423,821.57
AMERIPRISE FINANCIAL INC	319	440.35	140,471.65
BANK NEW YORK CO	2,299	59.48	136,744.52
BLACKROCK INC	473	798.95	377,903.35
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	1,214	137.68	167,143.52
CBOE GLOBAL MARKETS INC	310	171.33	53,112.30
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	785	127.67	100,220.95
EQUITABLE HOLDINGS INC	1,127	41.43	46,691.61
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	109	424.89	46,313.01
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	1,883	75.55	142,260.65
FISERV INC	1,858	150.27	279,201.66
FRANKLIN RESOURCES INC	1,031	23.17	23,888.27
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	1,816	138.72	251,915.52
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	232	277.68	64,421.76
MARKETAXESS HOLDINGS INC	116	196.29	22,769.64
MASTERCARD INC-CLASS A	2,648	456.96	1,210,030.08
MOODY'S CORP	519	425.64	220,907.16
MORGAN STANLEY	3,897	97.10	378,398.70
NASDAQ INC	1,242	60.10	74,644.20
NORTHERN TRUST CORP	584	83.51	48,769.84
PAYPAL HOLDINGS INC	3,177	59.49	188,999.73
PRICE T ROWE GROUP INC	661	118.88	78,579.68
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	690	122.38	84,442.20
S&P GLOBAL INC	1,018	444.97	452,979.46
SCHWAB (CHARLES) CORP	4,762	74.53	354,911.86
STATE STREET CORP	1,059	72.94	77,243.46
SYNCHRONY FINANCIAL	1,453	45.52	66,140.56
VISA INC-CLASS A SHARES	5,026	276.30	1,388,683.80



AFLAC	1,791	90.43	161,960.13
ALLSTATE CORP	809	162.41	131,389.69
ARCH CAPITAL GROUP LTD	1,252	102.43	128,242.36
ASSURANT INC	127	169.24	21,493.48
HARTFORD FINANCIAL SVCS	952	104.42	99,407.84
MARSH & MCLENNAN COS	1,540	215.75	332,255.00
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	734	80.83	59,329.22
PROGRESSIVE CORP	1,858	210.68	391,443.44
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	1,104	119.16	131,552.64
TRAVELERS COS INC/THE	704	211.09	148,607.36
WILLIS TOWERS WATSON PLC	312	266.44	83,129.28
WEYERHAEUSER CO	2,132	29.04	61,913.28
ACCENTURE PLC-CL A	1,998	307.21	613,805.58
ADOBE INC	1,424	524.17	746,418.08
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	483	88.74	42,861.42
ANSYS INC	301	321.10	96,651.10
ASPEN TECHNOLOGY INC	91	200.03	18,202.73
ATLASSIAN CORP-CL A	500	164.75	82,375.00
AUTODESK INC	681	239.17	162,874.77
CADENCE DESIGN SYSTEMS	867	309.14	268,024.38
CONFLUENT INC-CLASS A	646	27.34	17,661.64
DOCUSIGN INC	624	51.69	32,254.56
FAIR ISAAC CORP	77	1,441.50	110,995.50
GARTNER INC	242	451.09	109,163.78
GEN DIGITAL INC	1,758	24.08	42,332.64
HUBSPOT INC	160	573.60	91,776.00
INTL BUSINESS MACHINES CORP	2,913	175.01	509,804.13
INTUIT INC	890	623.88	555,253.20
MANHATTAN ASSOCIATES INC	196	241.47	47,329.10
MICROSOFT CORP	22,429	447.67	10,040,790.43
PALO ALTO NETWORKS INC	1,027	316.68	325,230.36
PTC INC	352	177.60	62,515.20
SALESFORCE INC	3,083	239.94	739,735.02
SERVICENOW INC	652	739.59	482,212.68
SYNOPSYS INC	500	595.60	297,800.00
TWILIO INC - A	549	54.81	30,090.69
UIPATH INC - CLASS A	1,391	12.03	16,733.73
WORKDAY INC-CLASS A	654	218.70	143,029.80
ZSCALER INC	334	181.06	60,474.04
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	3,851	20.47	78,829.97
HP INC	3,046	36.30	110,569.80
JUNIPER NETWORKS INC	1,031	35.54	36,641.74

	KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	534	136.91	73,109.94
	NETAPP INC	661	126.38	83,537.18
	SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	591	103.33	61,068.03
	TRIMBLE IMS HOLDINGS	733	56.13	41,143.29
	WESTERN DIGITAL CORP	987	75.40	74,419.80
	VERIZON COMMUNICATIONS	13,359	41.17	549,990.03
	AMERICAN WATER WORKS CO INC	652	132.18	86,181.36
	ATMOS ENERGY CORP	528	118.02	62,314.56
	CMS ENERGY CORP	839	60.77	50,986.03
	CONSOLIDATED EDISON INC	1,035	91.27	94,464.45
	EDISON INTL	1,297	72.76	94,369.72
	ESSENTIAL UTILITIES INC	767	37.94	29,099.98
	EVERSOURCE ENERGY	1,194	58.00	69,252.00
	EXELON CORP	3,057	35.33	108,003.81
	NRG ENERGY INC	623	81.56	50,811.88
	SEMPRA	1,927	76.45	147,319.15
	ADVANCED MICRO DEVICES	5,135	160.25	822,883.75
	APPLIED MATERIALS	2,641	229.84	607,007.44
	ENPHASE ENERGY INC	431	108.02	46,556.62
	FIRST SOLAR INC	323	261.28	84,393.44
	INTEL CORP	13,410	30.57	409,943.70
	LAM RESEARCH CORP	412	1,024.42	422,061.04
	LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	437	56.65	24,756.05
	MARVELL TECHNOLOGY INC	2,801	67.77	189,823.77
	NVIDIA CORP	79,440	118.11	9,382,658.40
	NXP SEMICONDUCTORS NV	816	267.27	218,092.32
	TEXAS INSTRUMENTS	2,892	193.91	560,787.72
	CBRE GROUP INC-A	950	89.26	84,797.00
	アメリカドル 小計	564,224		79,411,386.05 (12,670,880,758)
カナダドル	CAMECO CORP	1,237	68.89	85,216.93
	ENBRIDGE	6,754	47.97	323,989.38
	IMPERIAL OIL	613	93.95	57,591.35
	KEYERA CORP	573	36.72	21,040.56
	PARKLAND CORP	413	37.67	15,557.71
	PEMBINA PIPELINE CORP	2,000	50.02	100,040.00
	AGNICO EAGLE MINES	1,640	89.69	147,091.60
	IVANHOE MINES LTD-CL A	1,594	18.04	28,755.76
	KINROSS GOLD CORP	3,375	10.46	35,302.50
	LUNDIN MINING CORP	1,764	15.06	26,565.84
	NUTRIEN LTD	1,453	71.89	104,456.17
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	257	105.80	27,190.60

	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	1,359	72.84	98,989.56	
	CAE INC	1,167	26.38	30,785.46	
	STANTEC INC	362	113.60	41,123.20	
	WSP GLOBAL INC	396	211.45	83,734.20	
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORPORATION	1,237	23.95	29,626.15	
	RB GLOBAL INC	570	106.88	60,921.60	
	THOMSON REUTERS CORP	488	225.74	110,161.12	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	1,761	161.58	284,542.38	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	546	52.20	28,501.20	
	CANADIAN TIRE CORP -CL A	143	138.28	19,774.04	
	DOLLARAMA INC	838	126.06	105,638.28	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	2,403	78.42	188,443.26	
	METRO INC	705	75.53	53,248.65	
	BANK MONTREAL	2,255	116.40	262,482.00	
	BANK NOVA SCOTIA	3,962	62.84	248,972.08	
	NATIONAL BANK OF CANADA	1,167	106.72	124,542.24	
	TORONTO-DOMINION BANK	5,619	75.41	423,728.79	
	BROOKFIELD CORP	4,194	56.63	237,506.22	
	IA FINANCIAL CORP INC	312	86.09	26,860.08	
	INTACT FINANCIAL CORP	597	227.79	135,990.63	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	1,748	67.07	117,238.36	
	CGI INC - CL A	656	136.08	89,268.48	
	OPEN TEXT CORP	1,049	40.12	42,085.88	
	SHOPIFY INC - CLASS A	3,906	87.82	343,024.92	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	1,342	51.93	69,690.06	
	TELUS CORP	1,700	21.64	36,788.00	
	FORTIS INC	1,705	53.78	91,694.90	
	HYDRO ONE LTD	1,129	39.32	44,392.28	
	FIRSTSERVICE CORP	81	208.36	16,877.16	
	カナダドル 小計	65,070		4,419,429.58 (516,366,152)	
ユーロ	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	1,436	19.08	27,406.06	
	NESTE OIL OYJ	1,576	16.78	26,453.16	
	OMV AG	448	39.66	17,767.68	
	REPSOL SA	4,227	14.80	62,559.60	
	TENARIS SA	1,751	14.50	25,389.50	
	TOTALENERGIES SE	6,826	62.51	426,693.26	
	AKZO NOBEL	535	57.88	30,965.80	
	COVESTRO AG	600	53.86	32,316.00	
	DSM-FIRMENICH AG	659	104.50	68,865.50	
	EVONIK INDUSTRIES AG	657	19.09	12,542.13	
	HEIDELBERG MATERIALS AG	367	95.96	35,217.32	

OCI NV	511	23.25	11,880.75
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	816	42.86	34,973.76
STORA ENSO OYJ R	2,074	12.58	26,090.92
SYMRISE AG	364	114.70	41,750.80
UMICORE	562	14.82	8,328.84
UPM KYMMENE OYJ	1,804	33.05	59,622.20
VOESTALPINE AG	498	25.78	12,838.44
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	766	40.90	31,329.40
BOUYGUES ORD	586	31.82	18,646.52
EIFFAGE	297	90.02	26,735.94
GEA GROUP AG	399	39.80	15,880.20
KINGSPAN GROUP PLC	591	80.20	47,398.20
KNORR-BREMSE AG	224	71.55	16,027.20
KONE OYJ-B	1,080	47.07	50,835.60
METSO CORPORATION	2,196	10.26	22,541.94
MTU AERO ENGINES AG	171	228.80	39,124.80
REXEL SA	717	24.80	17,781.60
SCHNEIDER ELECTRIC SE	1,730	227.15	392,969.50
WARTSILA OYJ	1,323	18.66	24,687.18
WOLTERS KLUWER	760	153.75	116,850.00
ADP	92	117.80	10,837.60
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	2,000	5.81	11,620.00
GETLINK	1,366	15.91	21,733.06
MICHELIN	2,056	37.38	76,853.28
ADIDAS AG	510	220.10	112,251.00
HERMES INTERNATIONAL	102	2,178.00	222,156.00
KERING	224	324.20	72,620.80
LVMH	877	726.50	637,140.50
MONCLER SPA	637	58.26	37,111.62
PUMA SE	276	44.65	12,323.40
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	1,403	64.02	89,820.06
PUBLICIS GROUPE	727	103.80	75,462.60
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	2,674	27.98	74,818.52
PROSUS	4,505	34.49	155,377.45
ZALANDO SE	648	21.67	14,042.16
CARREFOUR	2,101	13.80	29,004.30
JERONIMO MARTINS	863	19.44	16,776.72
KESKO OYJ-B SHS	689	16.89	11,640.65
KONINKLIJKE AHOLD NV	2,817	28.15	79,298.55
DANONE (GROUPE)	1,981	58.86	116,601.66
JDE PEET'S BV	322	19.87	6,398.14
KERRY GROUP PLC-A	457	75.95	34,709.15

LOTUS BAKERIES	1	10,020.00	10,020.00
BEIERSDORF AG	341	141.75	48,336.75
HENKEL AG & CO KGAA	380	73.75	28,025.00
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	525	83.24	43,701.00
LOREAL	762	442.10	336,880.20
EUROFINS SCIENTIFIC	429	44.22	18,970.38
MERCK KGAA	460	167.05	76,843.00
ORION OYJ-CLASS B	354	40.01	14,163.54
QIAGEN N.V.	703	39.20	27,557.60
SARTORIUS AG-VORZUG	83	224.80	18,658.40
BANCO DE SABADELL SA	17,286	1.81	31,287.66
BNP PARIBAS	3,283	61.27	201,149.41
COMMERZBANK AG	3,996	14.23	56,863.08
CREDIT AGRICOLE SA	3,742	13.28	49,712.47
FINECOBANK SPA	1,888	14.38	27,149.44
ING GROEP NV-CVA	10,393	15.80	164,292.54
INTESA SANPAOLO	46,473	3.53	164,142.63
KBC GROEP NV	872	67.12	58,528.64
MEDIOBANCA	1,829	13.93	25,487.11
DEUTSCHE BOERSE	610	194.00	118,340.00
EURAZEO SA	173	76.35	13,208.55
NEXI SPA	1,449	5.82	8,433.18
AGEAS	508	43.80	22,250.40
ASR NEDERLAND NV	504	45.00	22,680.00
ASSICURAZIONI GENERALI	3,503	23.66	82,880.98
AXA SA	5,630	30.90	173,967.00
MUENCHENER RUECKVERSICH.	429	467.10	200,385.90
NN GROUP NV	822	43.18	35,493.96
POSTE ITALIANE SPA	1,615	12.03	19,436.52
SAMPO OYJ-A SHS	1,434	40.39	57,919.26
DASSAULT SYSTEMES SA	2,343	34.82	81,583.26
NOKIA OYJ	16,046	3.52	56,530.05
CELLNEX TELECOM SA	1,446	31.47	45,505.62
ELISA A	400	42.86	17,144.00
KPN (KON.)	12,772	3.61	46,119.69
ENEL	25,031	6.54	163,752.80
IBERDROLA SA	18,369	12.32	226,306.08
REDEIA CORP SA	1,048	17.32	18,151.36
VERBUND AG	197	75.30	14,834.10
ASML HOLDING NV	1,270	948.50	1,204,595.00
STMICROELECTRONICS NV	2,041	37.76	77,068.16
LEG IMMOBILIEN SE	314	75.64	23,750.96

	ユーロ 小計	255,632		7,833,172.70 (1,341,744,151)
イギリスポンド	ANGLO AMERICAN PLC	4,038	25.00	100,950.00
	ANTOFAGASTA PLC	1,061	21.21	22,503.81
	CRH PLC	2,249	58.74	132,106.26
	CRODA INTERNATIONAL PLC	412	40.98	16,883.76
	ENDEAVOUR MINING PLC	600	16.83	10,098.00
	MONDI PLC	1,465	15.05	22,048.25
	ASHTREAD GROUP PLC	1,493	54.94	82,025.42
	BUNZL PLC	1,074	30.54	32,799.96
	DCC PLC	244	56.40	13,761.60
	SMITHS GROUP PLC	1,103	17.25	19,026.75
	SPIRAX GROUP PLC	247	87.30	21,563.10
	INTERTEK GROUP PLC	614	47.78	29,336.92
	RELX PLC	5,887	36.12	212,638.44
	RENTOKIL INITIAL PLC	8,021	4.57	36,720.13
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	2,612	4.75	12,427.89
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	284	46.32	13,154.88
	BURBERRY GROUP PLC	1,289	10.18	13,122.02
	TAYLOR WIMPEY PLC	9,184	1.44	13,224.96
	WHITBREAD PLC	586	29.61	17,351.46
	AUTO TRADER GROUP PLC	2,840	8.04	22,850.64
	INFORMA PLC	4,350	8.68	37,792.80
	WPP PLC	3,240	7.65	24,792.48
	KINGFISHER PLC	5,110	2.47	12,637.03
	SAINSBURY (J) PLC	4,524	2.60	11,771.44
	TESCO PLC	21,572	3.08	66,528.04
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	1,302	25.19	32,797.38
	COCA-COLA HBC AG-CDI	532	27.30	14,523.60
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	2,395	44.44	106,433.80
	UNILEVER PLC	7,961	44.37	353,229.57
	ASTRAZENECA	4,926	124.78	614,666.28
	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	59,993	6.90	414,371.65
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	208,150	0.55	115,897.92
3I GROUP PLC	3,000	31.28	93,840.00	
M&G PLC	7,183	2.09	15,026.83	
SCHRODERS PLC	2,334	3.78	8,831.85	
ADMIRAL GROUP PLC	1,040	25.69	26,717.60	
AVIVA PLC	8,603	4.84	41,664.32	
LEGAL & GENERAL GROUP	17,346	2.30	39,965.18	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	2,320	5.25	12,191.60	
PRUDENTIAL	8,456	7.59	64,181.04	

	SAGE GROUP PLC	3,200	10.66	34,128.00
	BT GROUP PLC	20,577	1.45	29,846.93
	VODAFONE GROUP PLC	74,642	0.72	53,966.16
	NATIONAL GRID PLC	15,180	8.88	134,919.84
	イギリスポンド 小計	533,239		3,205,315.59 (648,980,247)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	589	14.00	8,246.00
	GIVAUDAN-REG	29	4,349.00	126,121.00
	SIG GROUP AG	1,000	16.64	16,640.00
	SIKA AG-BR	477	257.20	122,684.40
	ABB LTD	5,270	50.12	264,132.40
	GEBERIT AG-REG	100	547.40	54,740.00
	VAT GROUP AG	83	501.40	41,616.20
	SGS SA	475	80.30	38,142.50
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	152	259.00	39,368.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	6	10,940.00	65,640.00
	ALCON INC	1,588	80.80	128,310.40
	SONOVA HOLDING AG-REG	157	273.20	42,892.40
	LONZA GROUP AG-REG	237	487.10	115,442.70
	NOVARTIS	6,263	96.01	601,310.63
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	144	96.75	13,932.00
	JULIUS BAER GROUP LTD	700	51.42	35,994.00
	BALOISE HOLDING AG - REG	160	158.60	25,376.00
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	88	656.00	57,728.00
	SWISS RE LTD	930	113.10	105,183.00
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	466	487.20	227,035.20
TEMENOS AG - REG	200	61.75	12,350.00	
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	508	87.38	44,389.04	
SWISSCOM	76	506.50	38,494.00	
SWISS PRIME SITE-REG	246	84.75	20,848.50	
	スイスフラン 小計	19,944		2,246,616.37 (401,784,871)
スウェーデンク ローナ	BOLIDEN AB	963	347.90	335,027.70
	HOLMEN AB-B SHARES	294	423.60	124,538.40
	SCA SV CELLULOSA B	2,552	156.35	399,005.20
	ALFA LAVAL AB	1,050	471.50	495,075.00
	ASSA ABLOY AB-B	3,026	297.20	899,327.20
	ATLAS COPCO A	8,406	202.30	1,700,533.80
	ATLAS COPCO B	4,756	173.65	825,879.40
	EPIROC AB-A	1,838	216.10	397,191.80
	EPIROC AB-B	1,045	197.30	206,178.50
	HUSQVARNA AB-B SHS	1,379	89.66	123,641.14

	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	4,447	48.16	214,167.52	
	SANDVIK AB	3,167	217.30	688,189.10	
	SKF AB-B	1,022	213.00	217,686.00	
	VOLVO AB-A SHS	636	276.60	175,917.60	
	VOLVO B	5,047	271.30	1,369,251.10	
	EVOLUTION AB	590	1,105.50	652,245.00	
	HENNES & MAURITZ B	1,899	193.00	366,507.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	1,782	277.40	494,326.80	
	SVENSKA HANDELSBK A	4,600	100.65	462,990.00	
	EQT AB	1,233	320.00	394,560.00	
	TELE2 AB-B SHS	1,519	106.70	162,077.30	
	TELIA CO AB	7,952	28.04	222,974.08	
	スウェーデンクローナ 小計	59,203		10,927,289.64	(166,313,348)
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	772	265.90	205,274.80	
	EQUINOR ASA	2,746	293.95	807,186.70	
	NORSK HYDRO	4,021	66.38	266,913.98	
	YARA INTERNATIONAL ASA	556	305.50	169,858.00	
	MOWI ASA	1,979	184.90	365,917.10	
	ORKLA	2,110	88.15	185,996.50	
	SALMAR ASA	202	601.00	121,402.00	
	DNB BANK ASA	2,602	211.00	549,022.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	604	194.00	117,176.00	
	TELENOR ASA	2,114	122.60	259,176.40	
	ノルウェークローネ 小計	17,706		3,047,923.48	(46,115,082)
デンマーククローネ	NOVONESIS (NOVOZYMES) B	1,278	432.50	552,735.00	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	50	2,766.00	138,300.00	
	VESTAS WIND SYSSEMS A/S	2,987	178.20	532,283.40	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	8	11,460.00	91,680.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	18	11,690.00	210,420.00	
	DSV A/S	566	1,074.00	607,884.00	
	PANDORA A/S	231	1,067.00	246,477.00	
	COLOPLAST-B	468	848.60	397,144.80	
	GENMAB A/S	185	1,805.00	333,925.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	10,356	988.40	10,235,870.40	
	TRYG A/S	1,109	153.30	170,009.70	
ORSTED A/S	553	395.00	218,435.00		
	デンマーククローネ 小計	17,809		13,735,164.30	(315,359,372)
オーストラリアドル	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	5,865	26.97	158,179.05	
	BLUESCOPE STEEL LTD	1,217	19.61	23,865.37	



	FORTESCUE LTD	6,047	21.26	128,559.22
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	1,295	47.44	61,434.80
	MINERAL RESOURCES LTD	565	54.76	30,939.40
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	4,039	13.45	54,324.55
	ORICA LTD	1,151	17.82	20,510.82
	PILBARA MINERALS LTD	9,000	3.11	27,990.00
	BRAMBLES LTD	3,949	14.36	56,707.64
	COMPUTERSHARE LIMITED	1,618	26.55	42,957.90
	AURIZON HOLDINGS LTD	4,697	3.66	17,191.02
	TRANSURBAN GROUP	10,540	12.68	133,647.20
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	1,773	49.01	86,894.73
	CAR GROUP LTD	1,138	34.04	38,737.52
	REA GROUP LTD	218	197.29	43,009.22
	SEEK LTD	725	21.97	15,928.25
	COLES GROUP LTD	3,866	17.10	66,108.60
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	3,373	5.07	17,101.11
	COCHLEAR LIMITED	213	323.75	68,958.75
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	705	47.83	33,720.15
	CSL LIMITED	1,535	292.01	448,235.35
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	9,419	28.65	269,854.35
	ASX LTD	680	58.06	39,480.80
	MACQUARIE GROUP LIMITED	1,158	199.27	230,754.66
	QBE INSURANCE GROUP	4,340	17.57	76,253.80
	SUNCORP GROUP LIMITED	4,460	16.64	74,214.40
	WISETECH GLOBAL LTD	530	94.14	49,894.20
	XERO LTD	498	131.33	65,402.34
	オーストラリアドル 小計	84,614		2,380,855.20 (252,775,396)
ニュージーランドドル	SPARK NEW ZEALAND LTD	5,704	3.98	22,701.92
	MERCURY NZ LTD	2,339	6.62	15,484.18
	MERIDIAN ENERGY LTD	4,004	6.15	24,624.60
	ニュージーランドドル 小計	12,047		62,810.70 (6,133,464)
香港ドル	MTR CORP	4,000	24.50	98,000.00
	HANG SENG BANK	2,400	103.30	247,920.00
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	3,800	257.80	979,640.00
	AIA GROUP LTD	35,800	55.45	1,985,110.00
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	3,000	42.90	128,700.00
	HONG KONG & CHINA GAS	31,000	5.84	181,040.00
	SINO LAND CO	10,000	8.05	80,500.00
	SWIRE PACIFIC A	1,500	69.50	104,250.00
		91,500		3,805,160.00

香港ドル 小計				(77,777,470)
シンガポールドル	KEPPEL LTD	4,300	6.54	28,122.00
	UNITED OVERSEAS BANK	4,400	30.58	134,552.00
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	2,400	9.50	22,800.00
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	7,800	2.66	20,748.00
シンガポールドル 小計		18,900		206,222.00 (24,330,071)
合 計		1,739,888		16,468,560,382 (16,468,560,382)

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリアドル	APA GROUP	5,334	44,752.26	
	オーストラリアドル 小計		5,334	44,752.26 (4,751,347)	
投資信託受益証券合計			5,334	4,751,347 (4,751,347)	
投資証券	アメリカドル	AMERICAN TOWER CORPORATION	1,516	297,727.24	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	1,460	29,448.20	
		BOSTON PROPERTIES	522	32,463.18	
		CROWN CASTLE INC	1,449	141,176.07	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	1,033	151,861.33	
		EQUINIX INC	302	227,164.40	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	2,436	47,867.40	
		IRON MOUNTAIN INC	950	84,635.50	
		PROLOGIS INC	3,003	335,224.89	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	356	70,192.52	
		WELLTOWER INC	1,823	187,714.31	
	アメリカドル 小計		14,850	1,605,475.04 (256,169,597)	
	カナダドル	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	550	9,240.00	
	カナダドル 小計		550	9,240.00 (1,079,601)	
ユーロ	COVIVIO(FP)	80	3,700.80		
	GECINA SA	121	11,180.40		
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	558	14,262.48		
ユーロ 小計		759	29,143.68 (4,992,020)		
イギリスポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	2,248	14,151.16		
	SEGRO PLC	3,574	32,430.47		
イギリスポンド 小計		5,822	46,581.63 (9,431,382)		
オーストラリアドル	GOODMAN GROUP	5,159	181,493.62		

	GPT GROUP	4,863	20,375.97
	オーストラリアドル 小計	10,022	201,869.59 (21,432,494)
シンガポールドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	11,900	30,226.00
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	13,185	25,710.75
	シンガポールドル 小計	25,085	55,936.75 (6,599,417)
	投資証券合計	57,088	299,704,511 (299,704,511)
	合計		304,455,858 (304,455,858)

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

#### 有価証券明細表注記

- 1.通貨ごとの小計の欄における( )内は、邦貨換算額であります。
- 2.合計金額欄の記載は、邦貨額であります。( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。
- 3.通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。
- 4.外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 291銘柄	98.0%			75.5%
	投資証券 11銘柄			2.0%	1.5%
カナダドル	株式 41銘柄	99.8%			3.1%
	投資証券 1銘柄			0.2%	0.0%
ユーロ	株式 95銘柄	99.6%			8.0%
	投資証券 3銘柄			0.4%	0.0%
イギリスポンド	株式 44銘柄	98.6%			3.9%
	投資証券 2銘柄			1.4%	0.1%
スイスフラン	株式 24銘柄	100.0%			2.4%
スウェーデンクローナ	株式 22銘柄	100.0%			1.0%
ノルウェークローネ	株式 10銘柄	100.0%			0.3%
デンマーククローネ	株式 12銘柄	100.0%			1.9%
オーストラリアドル	株式 28銘柄	90.6%			1.5%
	投資信託受 益証券 1銘柄		1.7%		0.0%
	投資証券 2銘柄			7.7%	0.1%
ニュージーランドドル	株式 3銘柄	100.0%			0.0%
香港ドル	株式 8銘柄	100.0%			0.5%
シンガポールドル	株式 4銘柄	78.7%			0.1%
	投資証券 2銘柄			21.3%	0.0%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表  
注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 2【ファンドの現況】

## 【DC外国株式ESGリーダーズインデックスファンド】

## 【純資産額計算書】

(2024年7月31日現在)

資産総額	4,601,087,610円
負債総額	15,277,404円
純資産総額( - )	4,585,810,206円
発行済口数	2,668,386,547口
1口当たり純資産額( / )	1.7186円
(1万口当たり純資産額)	(17,186円)

(参考)

## 外国株式ESGリーダーズインデックスマザーファンド

## 純資産額計算書

(2024年7月31日現在)

資産総額	16,304,229,611円
負債総額	14,884,655円
純資産総額( - )	16,289,344,956円
発行済口数	9,388,713,219口
1口当たり純資産額( / )	1.7350円
(1万口当たり純資産額)	(17,350円)

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

## (1)名義書換等

該当事項はありません。

## (2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

## (3)譲渡制限

該当事項はありません。

## (4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

## 受益証券の不発行

委託会社は、当ファンドの受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合又は当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

## 受益権の譲渡

イ．受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

ロ．上記イ．の申請のある場合には、上記イ．の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少及び譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿

に記載又は記録するものとし、ただし、上記イ.の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載又は記録が行われるよう通知するものとし、

- ハ.上記イ.の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるとき又はやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

#### 受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載又は記録によらなければ、委託会社及び受託会社に対抗することができません。

#### 受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとし、

#### 償還金

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に支払います。

#### 質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載又は記録されている受益権に係る収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付、一部解約金及び償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等に従って取り扱われます。

## 第二部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1)資本金の額（2024年 7月31日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

##### (2)委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

会社が取締役（監査等委員である取締役を除く。）を10名以内、監査等委員である取締役を5名以内おきます。取締役は、株主総会において選任され、又は解任されます。ただし、監査等委員である取締役は、それ以外の取締役と区別するものとします。

取締役の選任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、取締役の選任決議は、累積投票によらないものとします。

また、監査等委員以外取締役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、監査等委員である取締役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の3分の2以上をもって行います。

取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとします。

監査等委員である取締役の任期は、選任後2年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとします。また、任期の満了前に退任した監査等委員である取締役の補欠として選任された監査等委員である取締役の任期は、退任した監査等委員である取締役の任期の満了する時までとします。

取締役会は、その決議をもって、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の中から代表取締役若干名を選定します。また、代表取締役の中から社長1名を選定し、必要あるときは、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の中から、会長、副会長、副社長、専務取締役、常務取締役各若干名を選定することができます。

取締役会は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役会においてあらかじめ定めた取締役が招集し、その議長となります。当該取締役に事故あるときは、取締役会においてあらかじめ定めた順位にしたがい、ほかの取締役がその職務を代行します。

取締役会を招集するには、各取締役に對して会日の3日前までに招集通知を發します。ただし、緊急の必要あるときは、この期間を短縮することができ、取締役の全員の同意があるときは、招集の手続を経ずに取締役会を開催することができます。

取締役会の決議は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役の過半数が出席し、出席した取締役の過半数をもって行います。

###### 投資運用の意思決定機構

###### [ PLAN（計画） ]

運用企画部担当役員を委員長とする運用・リスク委員会において、ファンドの運用戦略や運用スタイルなどを決定します。運用・リスク委員会で決定された運用の基本方針等に基づき、各運用部に

において、ファンドマネジャーが運用仕様・ガイドラインに基づき、運用の執行に関する方針を運用計画として策定します。

[ DO（実行） ]

各運用部のファンドマネジャーは、運用計画に沿った運用の執行、ファンドの運用状況管理を行います。

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

売買発注の執行は、各運用部からの運用の実行指図に基づき、各運用部から独立したトレーディング部のトレーダーが行います。

[ CHECK（検証・評価） ]

運用企画部は、運用部門において各運用部から独立した立場で、毎月開催される運用・リスク委員会（委員長は運用企画部担当役員）に運用パフォーマンスに係るモニタリング状況を報告します。

このモニタリング状況や討議内容は、各運用部の部長（委員会の構成員）からファンドマネジャーに速やかにフィードバックされ、ファンドの運用に反映されます。

また、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングについては、運用部門から独立した運用監理部が担当します。このモニタリング結果は、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告されます。

こうした牽制態勢のもと、PLAN - DO - CHECKのPDCサイクルによる一貫した運用プロセスにより、適切な運用体制を維持するよう努めています。

委託会社の機構は2024年 9月25日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

投資信託及び投資法人に関する法律に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに金融商品取引法に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また、金融商品取引法に定める投資助言業務等の関連する業務を行っています。

2024年 7月31日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	531	15,325,601
追加型公社債投資信託	0	0
単体型株式投資信託	62	212,279
単体型公社債投資信託	52	172,995
合計	645	15,710,875

## 3【委託会社等の経理状況】

- (1) 委託者である三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託者」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。  
なお、財務諸表の金額については、百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。

- (2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。



## ( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位：百万円 )

	前事業年度 ( 2023年3月31日 )	当事業年度 ( 2024年3月31日 )
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	23,067	14,909
金銭の信託	14,693	18,596
前払費用	198	429
未収委託者報酬	9,147	10,943
未収運用受託報酬	5,815	5,967
未収収益	176	185
短期差入証拠金	3,541	3,660
その他	1,566	4,074
流動資産合計	58,207	58,767
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 255	1 219
器具備品	1 560	1 436
有形固定資産合計	816	655
無形固定資産		
ソフトウェア	7,203	7,463
その他	40	61
無形固定資産合計	7,244	7,524
投資その他の資産		
投資有価証券	4,063	5,753
関係会社株式	5,636	6,077
繰延税金資産	1,181	1,196
その他	31	31
投資その他の資産合計	10,911	13,058
固定資産合計	18,972	21,238
資産合計	77,179	80,005

( 単位：百万円 )

	前事業年度 ( 2023年3月31日 )	当事業年度 ( 2024年3月31日 )
負債の部		
流動負債		

預り金	49	86
未払金	7,174	8,475
未払収益分配金	0	0
未払手数料	4,586	5,524
その他未払金	2,588	2,951
未払費用	1,089	797
未払法人税等	726	694
賞与引当金	613	719
その他	303	957
流動負債合計	9,958	11,730
固定負債		
退職給付引当金	904	975
資産除去債務	153	154
その他	27	42
固定負債合計	1,086	1,171
負債合計	11,044	12,902
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000	2,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	17,239	17,239
資本剰余金合計	17,239	17,239
利益剰余金		
利益準備金	500	500
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100	2,100
繰越利益剰余金	44,755	45,974
利益剰余金合計	47,355	48,574
株主資本合計	66,595	67,813
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	49	360
繰延ヘッジ損益	510	1,071
評価・換算差額等合計	460	710
純資産合計	66,134	67,103
負債・純資産合計	77,179	80,005

## (2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	40,724	44,551
運用受託報酬	10,918	11,077

その他営業収益	351	356
営業収益合計	51,993	55,985
営業費用		
支払手数料	20,123	22,341
広告宣伝費	307	342
公告費	2	0
調査費	5,309	5,796
調査費	1,104	1,172
委託調査費	4,191	4,610
図書費	13	14
営業雑経費	5,842	5,887
通信費	77	78
印刷費	419	439
協会費	58	56
諸会費	38	29
情報機器関連費	5,153	5,193
その他営業雑経費	94	89
営業費用合計	31,585	34,369
一般管理費		
給料	6,451	6,981
役員報酬	318	385
給料・手当	5,144	5,432
賞与	987	1,163
退職給付費用	252	278
福利費	671	747
交際費	7	13
旅費交通費	122	191
租税公課	289	276
不動産賃借料	327	328
寄付金	-	0
減価償却費	1,698	2,239
業務委託費	1,277	1,544
諸経費	1,454	1,637
一般管理費合計	12,553	14,239
営業利益	7,854	7,376

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
営業外収益		
受取利息	57	138
収益分配金	4	0
金銭の信託運用益	-	4,007
投資有価証券売却益	738	1
投資有価証券償還益	121	1
デリバティブ利益	565	-

その他	11	12
営業外収益合計	1,499	4,162
営業外費用		
金銭の信託運用損	158	-
投資有価証券売却損	16	33
投資有価証券償還損	-	1
為替差損	1,227	1,273
デリバティブ費用	-	3,613
その他	32	3
営業外費用合計	1,435	4,925
経常利益	7,918	6,613
税引前当期純利益	7,918	6,613
法人税、住民税及び事業税	2,350	1,931
法人税等調整額	119	95
法人税等合計	2,470	2,027
当期純利益	5,448	4,585

## （３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	2,000	17,239	17,239
当期変動額			
剰余金の配当			
当期純利益			
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			
当期変動額合計	-	-	-
当期末残高	2,000	17,239	17,239

	株主資本				株主資本合計
	利益準備金	利益剰余金		利益剰余金合計	
		別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	500	2,100	41,948	44,548	63,788
当期変動額					
剰余金の配当			2,641	2,641	2,641
当期純利益			5,448	5,448	5,448
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	-	-	2,807	2,807	2,807
当期末残高	500	2,100	44,755	47,355	66,595

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	941	509	431	64,219
当期変動額				
剰余金の配当				2,641
当期純利益				5,448
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	891	0	891	891
当期変動額合計	891	0	891	1,915
当期末残高	49	510	460	66,134

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	2,000	17,239	17,239
当期変動額			
剰余金の配当			
当期純利益			
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			
当期変動額合計	-	-	-
当期末残高	2,000	17,239	17,239

	株主資本				株主資本合計
	利益準備金	利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	500	2,100	44,755	47,355	66,595
当期変動額					
剰余金の配当			3,367	3,367	3,367
当期純利益			4,585	4,585	4,585
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	-	-	1,218	1,218	1,218
当期末残高	500	2,100	45,974	48,574	67,813

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	49	510	460	66,134
当期変動額				
剰余金の配当				3,367
当期純利益				4,585
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	310	560	250	250
当期変動額合計	310	560	250	968
当期末残高	360	1,071	710	67,103

## 注記事項

### （重要な会計方針）

#### 1．有価証券の評価基準及び評価方法

##### （1）子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

##### （2）その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

時価法によっております。

（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。）

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法によっております。

なお、投資事業有限責任組合への出資については、組合契約に規定される決算報告日に応じて入手可能な最近の決算書を基礎とし、持分相当額を純額で取り込む方法によっております。

#### 2．デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

#### 3．金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

#### 4．固定資産の減価償却の方法

##### （1）有形固定資産

定額法によっております。

##### （2）無形固定資産

定額法によっております。

ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、社内における利用可能期間（5年）に基づいて償却しております。

#### 5．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として計上しております。

#### 6．引当金の計上基準

##### （1）賞与引当金

従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、支給見込額のうち当事業年度の負担額を計上しております。

##### （2）退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。また、退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については給付算定式基準によっております。過去勤務費用及び数理計算上の差異の損益処理方法は次のとおりであります。

過去勤務費用：発生事業年度に損益処理

数理計算上の差異：各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から損益処理

なお、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る当事業年度末の自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を一部適用しております。

#### 7．収益及び費用の計上基準

当社は投資運用、投資助言・代理を業として行っており、当該事業において顧客との契約から生じる主な履行義務の内容及び当履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。

## (1) 投資信託委託業務

当社は、投資信託契約に基づき投資信託委託サービスを提供し、商品の運用資産残高（以下「AUM」という。）に応じて手数料を受領しております。当該収益は、日次等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。

## (2) 投資一任業務

当社は、投資一任契約に基づき投資一任サービスを提供し、ファンドのAUMに応じて手数料を受領しております。当該収益は、年4回等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。

## (3) 投資助言業務

当社は、投資顧問（助言）契約に基づき投資助言サービスを提供し、ファンドのAUMに応じて手数料を受領しております。当該収益は、年4回等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。

## (4) 成功報酬

当社がファンドの運用成果に応じて受領する成功報酬は、投資一任契約のもと、報酬を受領することが確実であり、将来返還する可能性が無いと合理的に判断した時点で収益を認識しております。

## 8. ヘッジ会計の会計処理

## (1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

## (2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

## (3) ヘッジ方針

自己勘定運用管理規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。

## (4) ヘッジ有効性評価の方法

ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間において、ヘッジ対象とヘッジ手段の相場変動の累計額を比較して有効性を判定しております。

## 9. グループ通算制度の適用

グループ通算制度を適用しております。

## (貸借対照表関係)

## 1有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (2023年3月31日)		当事業年度 (2024年3月31日)	
建 物	184	百万円	220	百万円
器具備品	681	"	823	"
計	866	"	1,044	"

## (株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

## 1. 発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式（株）	3,000	-	-	3,000

## 2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

## 3. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の 総額(百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2022年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,641	880,447	2022年3月31日	2022年6月24日

## (2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

決議	株式の種類	配当金の 総額(百万円)	配当金の 原資	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2023年6月23日 定時株主総会	普通株式	3,367	利益剰余金	1,122,459	2023年3月31日	2023年6月26日

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

## 1. 発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式（株）	3,000	-	-	3,000

## 2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

## 3. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の 総額(百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2023年6月23日 定時株主総会	普通株式	3,367	1,122,459	2023年3月31日	2023年6月26日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの  
2024年6月20日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

決議	株式の種 類	配当金の 総額(百万円)	配当金の 原資	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2024年6月20日 定時株主総会	普通株式	2,943	利益剰余金	981,032	2024年3月31日	2024年6月21日

## (リ・ス取引関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

## (金融商品関係)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、資金運用については、自らが運用する投資信託の商品性維持を目的として、当該投資信託を金銭の信託及び投資有価証券として保有しているほか、短期的な預金を中心とする安全性の高い金融資産で運用しております。また、デリバティブ取引については、保有する投資信託に係る将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため金銭の信託及び投資有価証券の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

未収委託者報酬については、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクは極めて低いものと考えております。また、未収運用受託報酬については、信託財産から運用受託者に対して支払われる場合は、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクは極めて低いものと考えており、顧客から直接運用受託者に対して支払われる場合は、当該顧客の信用リスクに晒されておりますが、顧客ごとに決済期日及び残高を管理することにより回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。金銭の信託及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引によりリスクの軽減を図っております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針8・ヘッジ会計の会計処理」をご参照ください。未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

当社では、リスク管理に係る基本方針を「リスク管理規程」として定め、以下のとおり、リスク・カテゴリー毎に管理しております。

## 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

営業債権の管理については、顧客ごとに決済期日及び残高を管理し、また自己査定要領に基づき定期的に債権内容の検討を行うことにより回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。デリバティブ取引は、取引相手先として高格付けを有する金融機関に限定しております。

## 市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

有価証券投資については、自己勘定運用方針にて投資限度額や投資期間等を定めており、投資後も適宜時価を把握し、保有状況を継続的に見直しております。投資信託の為替変動リスクに対しては、それらの一部について為替予約を利用してヘッジしております。また、価格変動リスクを軽減するために、株価指数先物等のデリバティブ取引を利用しております。

## 資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

当社は、年度事業計画を策定し、これに基づいて必要となる資金を検討し、充足する十分な手元流動性を維持することで、流動性リスクを管理しております。

## (4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## 2. 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日）第24-16項を適用した組合出資金等及び、市場価格のない株式等は、次表には含まれておりません（(1)\*2、\*3及び(注2)参照）。

また、金融商品の時価を、時価の算定に係るインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

- レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産または負債に関する相場価格により算定した時価
- レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価
- レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価  
時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

（１）時価をもって貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債  
前事業年度（2023年3月31日）

区 分	貸借対照表計上額（百万円）（*1）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託(*2)	1,029	12,703	-	13,733
投資有価証券(*3)				
其他有価証券	-	3,844	-	3,844
資産計	1,029	16,547	-	17,577
デリバティブ取引(*4)				
株式関連取引	(10)	-	-	(10)
通貨関連取引	-	(136)	-	(136)
デリバティブ取引計	(10)	(136)	-	(147)

(\*1) 負債に計上されているものについては、( )で示しております。

(\*2) 金銭の信託の信託財産のうち、組合出資金等（貸借対照表計上額960百万円）は上記に含めておりません。組合出資金等も含めた金銭の信託の貸借対照表計上額は14,693百万円であります。

(\*3) 投資有価証券のうち、組合出資金等（貸借対照表計上額218百万円）は上記に含めておりません。

(\*4) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

当事業年度（2024年3月31日）

区 分	貸借対照表計上額（百万円）（*1）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託(*2)	1,530	16,048	-	17,579
投資有価証券(*3)				
其他有価証券	-	4,517	-	4,517
資産計	1,530	20,565	-	22,096
デリバティブ取引(*4)				
株式関連取引	(268)	(262)	-	(530)
通貨関連取引	-	21	-	21
デリバティブ取引計	(268)	(241)	-	(509)

(\*1) 負債に計上されているものについては、( )で示しております。

(\*2) 金銭の信託の信託財産のうち、組合出資金等（貸借対照表計上額1,017百万円）は上記に含めておりません。組合出資金等も含めた金銭の信託の貸借対照表計上額は18,596百万円であります。

(\*3) 投資有価証券のうち、非上場株式（貸借対照表計上額876百万円）及び組合出資金等（貸借対照表計上額359百万円）は上記に含めておりません。

(\*4) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

（２）時価をもって貸借対照表計上額としない金融資産及び金融負債

現金及び預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、短期差入証拠金、未払金は、短期間（1年以内）で決済されるものが大半を占めており、時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

（注1）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

金銭の信託の信託財産のうち、上場投資信託は、取引所の価格を時価としており、市場の活発性に基づき、レベル1の時価に分類しております。金銭の信託の信託財産のうち、私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、レベル2の時価に分類しております。金銭の信託の信託財産のうち、銀行勘定貸については取引先金融機関から提供された価格により算定しており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。

投資有価証券

私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、レベル2の時価に分類しております。

デリバティブ取引

株価指数先物の時価は、金融商品取引所が定める清算指数を用いて評価しております。株価指数先物は活発な市場で取引されているため、その市場価格をレベル1の時価に分類しております。為替予約及びトータルリターンスワップの時価は、為替レートや金利や株価等の観察可能なインプットを用いた割引現在価値法等により取引先金融機関が算定した価格を時価の算定に用いており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。

（注2）市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

（単位：百万円）



区分	前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
投資有価証券	0	876
関係会社株式	5,636	6,077

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額  
前事業年度(2023年3月31日)

(単位:百万円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	23,067	-	-	-
未収委託者報酬	9,147	-	-	-
未収運用受託報酬	5,815	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	594	2,144	38

当事業年度(2024年3月31日)

(単位:百万円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	14,909	-	-	-
未収委託者報酬	10,943	-	-	-
未収運用受託報酬	5,967	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	1,829	807	-

(有価証券関係)

## 1. 子会社株式

市場価格のある子会社株式はありません。

なお、市場価格のない子会社株式の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

(単位:百万円)

区分	前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
子会社株式	5,636	6,077

## 2. その他有価証券

前事業年度(2023年3月31日)

(単位:百万円)

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	986	622	364
小計	986	622	364
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,857	3,150	292
小計	2,857	3,150	292
合計	3,844	3,772	71

当事業年度(2024年3月31日)

(単位:百万円)

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	3,394	2,593	800
小計	3,394	2,593	800
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	1,123	1,410	287
小計	1,123	1,410	287
合計	4,517	4,004	513

非上場株式及び組合出資金等は、市場価格のない株式等のため、上表の「その他有価証券」に含めておりませ

ん。  
なお、市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

(単位:百万円)

区分	前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
非上場株式	0	876
組合出資金等	218	359

## 3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

(単位:百万円)

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	3,429	738	16

当事業年度(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

(単位:百万円)

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	185	1	33

(デリバティブ取引関係)

## 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

前事業年度(2023年3月31日)

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
店頭	為替予約取引 売建				
	米ドル	5,923	-	21	21
	英ポンド	256	-	6	6
	カナダドル	109	-	1	1
	スイスフラン	163	-	2	2
	香港ドル	202	-	0	0
	ユーロ	651	-	19	19
	買建				
	米ドル	152	-	3	3
合計		7,458	-	48	48

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

当事業年度(2024年3月31日)

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
店頭	為替予約取引 売建				
	米ドル	6,735	-	4	4
	英ポンド	288	-	0	0
	カナダドル	145	-	0	0
	スイスフラン	180	-	0	0
	香港ドル	217	-	0	0
	ユーロ	664	-	3	3
	合計	8,231	-	10	10

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

## (2) 株式関連

前事業年度(2023年3月31日)

種類	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
----	---------------	-------------------------	-------------	---------------

市場取引	株価指数先物取引 売建	12,195	-	9	9
	債券先物取引 売建	182	-	0	0
	合計	12,378	-	10	10

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

当事業年度（2024年3月31日）

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	10,306	-	268	268
店頭	トータルリターンスワップ取引 売建	4,184	-	262	262
合計		14,490	-	530	530

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

### (1) 通貨関連

前事業年度（2023年3月31日）

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 関係会社株式			
	米ドル		1,729	-	6
	英ポンド		3,228	-	81
	スイスフラン		20	-	0
	香港ドル		83	-	0
	ユーロ		21	-	0
合計			5,082	-	88

当事業年度（2024年3月31日）

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 関係会社株式			
	米ドル		2,126	-	1
	英ポンド		4,586	-	7
	スイスフラン		28	-	0
	香港ドル		83	-	0
	ユーロ		63	-	0
	シンガポールドル		448	-	1
合計			7,337	-	10

### (退職給付関係)

#### 1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。

#### 2. 確定給付制度

##### (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
退職給付債務の期首残高	820	911
勤務費用	133	149
利息費用	3	3
数理計算上の差異の発生額	6	11
退職給付の支払額	57	85
簡便法で計算した退職給付費用	6	1
退職給付債務の期末残高	911	993

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表  
該当事項はありません。

(3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

(単位：百万円)

	前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	911	993
未認識数理計算上の差異	6	17
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	904	975
退職給付引当金	904	975
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	904	975

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
勤務費用	133	149
利息費用	3	3
数理差異償却	-	0
簡便法で計算した退職給付費用	6	1
確定給付制度に係る退職給付費用	142	155

(5) 年金資産に関する事項  
該当事項はありません。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
割引率	0.4%	0.4%

### 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度109百万円、当事業年度122百万円であります。

(税効果会計関係)

#### 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
繰延税金資産		
未払事業税	58 百万円	63 百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	187 "	220 "
退職給付引当金損金算入限度超過額	277 "	298 "
税務上の費用認識差額	412 "	256 "
繰延ヘッジ損益	225 "	472 "
その他	75 "	78 "
繰延税金資産 合計	1,236 "	1,390 "
繰延税金負債		

			有価証券報告書(内国投資信託受益証券)	
有価証券評価差額	21	"	159	"
その他	32	"	35	"
繰延税金負債 合計	54	"	194	"
繰延税金資産の純額	1,181	"	1,196	"

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳  
法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

3. 法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

当社は、グループ通算制度を適用しております。また、「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」(実務対応報告第42号 2021年8月12日)に従って、法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理並びに開示を行っております。

(資産除去債務関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(収益認識関係)

1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

2. 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報は、「重要な会計方針7.収益及び費用の計上基準」に記載の通りです。

3. 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当事業年度末において

存在する顧客との契約から翌事業年度以降に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

当社は資産運用に関する事業の単一セグメントであるため記載を省略しております。

[関連情報]

1. 製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区分の営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

内国籍投資信託又は本邦顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

前事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	9,887百万円

当事業年度(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	10,223百万円

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

## 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

- (ア) 財務諸表提出会社の親会社  
重要性が乏しいため、記載を省略しております。
- (イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等  
重要性が乏しいため、記載を省略しております。
- (ウ) 財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

前事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
親会社の子会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引 役員の兼任	運用受託報酬	9,593	未収運用受託報酬	5,271
							投信販売代行手数料等	9,445	未払手数料	2,029

- (注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。  
2. 取引条件及び取引条件の決定方針等  
運用受託報酬  
各運用受託案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。  
投信販売代行手数料等  
ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
親会社の子会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引 役員の兼任	運用受託報酬	9,926	未収運用受託報酬	5,520
							投信販売代行手数料等	10,187	未払手数料	2,482

- (注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。  
2. 取引条件及び取引条件の決定方針等  
運用受託報酬  
各運用受託案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。  
投信販売代行手数料等  
ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

- (エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等  
該当事項はありません。

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

前事業年度（2023年3月31日）

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

当事業年度（2024年3月31日）

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

## (1株当たり情報)

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
1株当たり純資産額	22,044,962円63銭	22,367,677円92銭
1株当たり当期純利益金額	1,816,227円49銭	1,528,527円02銭

- (注) 1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。  
2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
当期純利益	5,448百万円	4,585百万円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	5,448百万円	4,585百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

#### 4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、金融商品取引法の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

##### (1)自己又はその役員との取引

自己又はその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

##### (2)運用財産相互間の取引

運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

##### (3)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行うこと。

##### (4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

##### (5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

上記(3)及び(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

#### 5【その他】

##### (1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

##### (2)訴訟事件その他の重要事項

2024年9月25日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

#### 第2【その他の関係法人の概況】

##### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

###### (1)受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（2024年3月末日現在）

事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

## (2) 販売会社

名称	資本金の額（百万円） （2024年3月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

## 2【関係業務の概要】

### (1) 受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

### (2) 販売会社

当ファンドの販売会社として、受益権の募集の取扱い、一部解約の実行の請求の受付、収益分配金・償還金及び一部解約金の支払い、収益分配金の再投資、運用報告書の交付並びに口座管理機関としての業務等を行います。

## 3【資本関係】

### (1) 受託会社

該当事項はありません。

### (2) 販売会社

該当事項はありません。

### (参考)再信託受託会社

名称：株式会社日本カストディ銀行

設立年月日：2000年6月20日

資本金の額：51,000百万円（2024年3月末日現在）

事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

再信託の目的：原信託契約に係る信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（株式会社日本カストディ銀行）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

## 第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2023年 9月26日	有価証券届出書
2023年 9月26日	有価証券報告書
2024年 3月26日	有価証券届出書
2024年 3月26日	半期報告書



**独立監査人の監査報告書**

2024年6月3日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 三 上 和 彦指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 田 中 洋 一**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2023年4月1日から2024年3月31日までの第38期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2024年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

**その他の記載内容**

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

**財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任**

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査等委員会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

**財務諸表監査における監査人の責任**

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

- ・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査等委員会に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

---

(注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の監査報告書

2024年9月4日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 百瀬和政  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDC外国株式ESGリーダーズインデックスファンドの2023年6月27日から2024年6月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DC外国株式ESGリーダーズインデックスファンドの2024年6月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

#### 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファン드는継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 利害関係

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

(注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。