

## HSBC ESG米国株式 インデックスファンド

### 運用報告書（全体版）

第3期（決算日 2023年11月6日）

#### ◎受益者の皆さまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

さて、「HSBC ESG米国株式インデックスファンド」は、2023年11月6日に第3期の決算を行いましたので、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

#### HSBCアセットマネジメント株式会社

東京都中央区日本橋3-11-1 HSBCビルディング

《お問い合わせ先（投信営業本部）》

電話番号：03-3548-5690

（営業日の午前9時～午後5時）

ホームページ：www.assetmanagement.hsbc.co.jp

◎当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／株式／インデックス型	
信託期間	無期限	
運用方針	HSBC ESG米国株式インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、米国企業においてESG等への取組みを評価する指数（FTSE USA ESG Low Carbon Select Index（円換算ベース））に概ね連動する投資成果をめざして運用を行います。	
主要運用対象	HSBC ESG米国株式インデックスファンド	HSBC ESG米国株式インデックスマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	HSBC ESG米国株式インデックスマザーファンド	米国株式を実質的な投資対象とするETF（上場投資信託証券）を主要投資対象とします。
組入制限	HSBC ESG米国株式インデックスファンド	株式への実質投資割合には制限を設けません。また、外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
	HSBC ESG米国株式インデックスマザーファンド	株式への投資には制限を設けません。また、外貨建資産への投資には制限を設けません。
分配方針	年1回の決算時（毎年11月6日、休業日の場合は翌営業日）に、以下の方針に基づき、分配を行います。 ①分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 ②分配金額は、委託者が基準価額水準・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等には分配を行わないことがあります。 ③留保益の運用については特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。	

## ○設定以来の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	標準価額			FTSE USA ESG Low Carbon Select Index (円換算ベース) (ベンチマーク)		投資信託 組入比率	純資産 総額
		税金 分配	み 期騰 落	中 率	期騰 落	中 率		
(設定日) 2020年11月27日	円 10,000	円 —	—	% —	10,000	% —	百万円 266	
1期(2021年11月8日)	14,003	0	40.0	14,074	40.7	99.3	1,680	
2期(2022年11月7日)	14,626	0	4.4	14,895	5.8	98.9	1,897	
3期(2023年11月6日)	17,276	0	18.1	17,420	17.0	98.6	2,175	

(注) 基準価額の期中騰落率は分配金込み。

(注) ベンチマークは設定日を10,000として指数化しております。(以下同じ。)

(注) 設定日の基準価額は1万口当たりの当初設定元本、設定日の純資産総額は当初設定元本です。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		FTSE USA ESG Low Carbon Select Index (円換算ベース) (ベンチマーク)		投 資 信 託 組 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	
(期 首) 2022年11月7日	円 14,626	% —	14,895	% —	% 98.9
11月末	14,657	0.2	14,847	△ 0.3	98.8
12月末	13,786	△ 5.7	13,902	△ 6.7	99.0
2023年1月末	14,063	△ 3.8	14,083	△ 5.5	99.2
2月末	14,447	△ 1.2	14,536	△ 2.4	99.1
3月末	14,418	△ 1.4	14,541	△ 2.4	98.9
4月末	14,716	0.6	14,968	0.5	99.4
5月末	15,591	6.6	15,734	5.6	99.5
6月末	16,844	15.2	17,021	14.3	99.3
7月末	17,097	16.9	17,241	15.8	99.0
8月末	17,297	18.3	17,486	17.4	99.3
9月末	16,872	15.4	17,046	14.4	99.3
10月末	16,411	12.2	16,666	11.9	98.9
(期 末) 2023年11月6日	17,276	18.1	17,420	17.0	98.6

(注) 期末基準価額は分配金込み。騰落率は期首比です。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

※FTSE USA ESG Low Carbon Select Indexとは、米国の大型・中型株で構成される親指数FTSE USA Indexから、米国企業における、ESG（環境 [E]・社会 [S]・企業統治 [G]）の取組評価、および温室効果ガス排出量や化石燃料埋蔵量に基づき、構成銘柄の組入比率をFTSE Russell社が決定し公表する株価指数です。当ファンドのベンチマークとしては、同指数を委託会社が円換算した数値を使用しています。

指数の著作権について

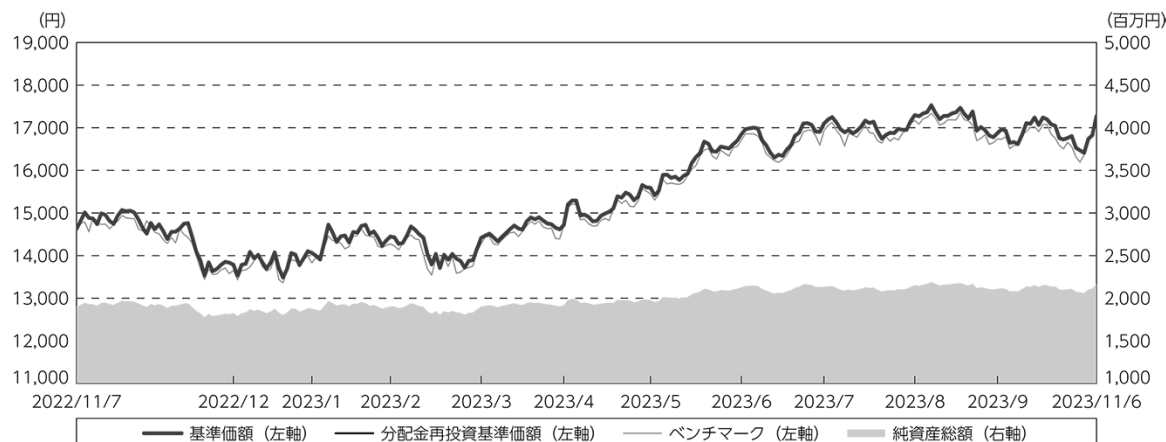
HSBC ESG米国株式インデックスファンド（以下、「ファンド」）は委託会社が設定、運用するファンドです。ファンドは、ロンドン証券取引所およびロンドン証券取引所グループ各社（以下、「LSE Group」）のいずれによっても、後援、推薦、販売または販売促進されるものではありません。FTSE RussellはLSE Group各社の商号です。

FTSE USA ESG Low Carbon Select Index（以下「本指数」）のすべての権利はLSE Groupに帰属します。「FTSE」はLSE Groupの商標であり、ライセンスに基づきFTSEによって使用されます。

本指数はFTSEまたはその代理人により編集、算出されますが、LSE Groupは本指数の誤差脱漏について何人に対しても責任を負わず（過失の有無を問わず）、かつ本指数の誤差脱漏に関して通知する義務を負いません。LSE Groupは、本指数の使用およびいかなる時点における本指数値の利用から生じるいかなる結果に対しても、明示的か黙示的かを問わず、何ら表明や保証を行うものではありません。

## ○当期の運用状況と今後の運用方針

### 基準価額等の推移について（第3期：2022年11月8日～2023年11月6日）



期 首：14,626円

期 末：17,276円（既払分配金（税込み）：0円）

騰落率： 18.1%（分配金再投資ベース）

- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) 分配金再投資基準価額およびベンチマークは、期首（2022年11月7日）の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。
- (注) 当ファンドのベンチマークは、FTSE USA ESG Low Carbon Select Index（円換算ベース）です。

### 基準価額の主な変動要因

#### <上昇要因>

米国株式市場の上昇および米ドルが対円で上昇したことが基準価額にプラスに寄与しました。

### 投資環境について

#### 【株式市況】

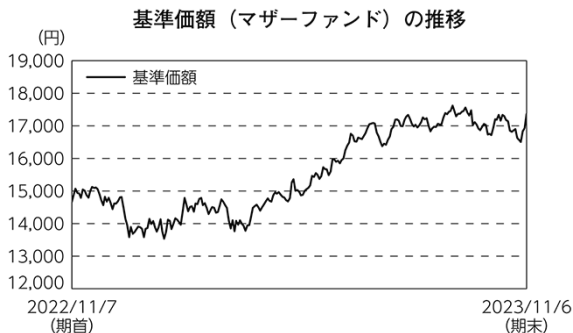
米国株式市場は、期を通じて上昇しました。株式市場は期初から2023年3月中旬にかけて一定範囲内で推移しました。その後、底堅い米国経済、ハイテク企業を中心とした好決算などから7月末にかけて上昇基調に転じましたが、根強いサービス価格の上昇や賃金上昇圧力などによる金融引き締め長期化観測から10月下旬にかけて途中上下動を見せながらも下落傾向となりました。期末にかけては景気減速を示す経済指標に伴う利上げ観測の後退から株式市場は反発しました。

## 【為替相場】

米ドルは対円で、期を通じて上昇しました。期初から2023年1月中旬にかけて日銀の大規模金融緩和の一部修正などから米ドルは円に対して途中上下に振れながらも下落傾向となったのち、期末にかけては米国の金融引き締め長期化観測に伴う日米金利差の拡大などから上昇基調を辿りました。

## ポートフォリオについて

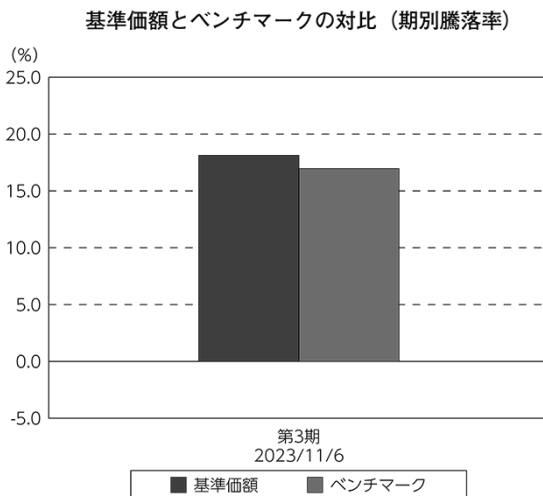
当ファンドは「HSBC ESG米国株式インデックスマザーファンド」への投資を通じて、主として米国の株式を実質的な投資対象資産とするETFに投資を行い、対象指数に概ね連動する投資成果をめざして運用を行いました。マザーファンドでは、期初よりETFの組入比率は可能な限り高位を維持しました。



## ベンチマークとの差異について

当ファンドは「FTSE USA ESG Low Carbon Select Index (円換算ベース)」をベンチマークとします。

当期の基準価額（分配金再投資ベース）の騰落率は18.1%の上昇となり、ベンチマークの騰落率(+17.0%)を上回りました。



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税込み）込みです。

(注) 当ファンドのベンチマークは、FTSE USA ESG Low Carbon Select Index (円換算ベース) です。

## 分配金について

当期につきましては、基準価額の水準・市況動向などを勘案し、分配なしとさせていただきます。

なお、留保益の運用につきましては特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

## ○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり、税込み)

項 目	第3期
	2022年11月8日～ 2023年11月6日
当期分配金	—
(対基準価額比率)	—%
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	7,275

(注) 対基準価額比率は当期分配金(税込み)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

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

## 今後の運用方針

米国ではこれまでの積極的な利上げを背景に景気減速懸念が強まっていると見ています。金融政策に関しても、当面は物価重視の姿勢を維持しながらも、2024年には景気重視の姿勢に移行し、利下げを開始すると見ており、これは株式市場の支援材料になると考えられます。

一方、近年では、年金基金などの機関投資家を中心に、企業経営のサステナビリティを評価するという概念が広がっています。こうしたなか、米国のESG関連株式は今後一段と投資家の注目を集めることが見込まれます。

### <HSBC ESG米国株式インデックスファンド>

引き続き「HSBC ESG米国株式インデックスマザーファンド」への投資を通じて、米国株式を実質的な投資対象とするETF(上場投資信託証券)を主要投資対象とします。

### <HSBC ESG米国株式インデックスマザーファンド>

米国企業においてESG等への取組みを評価する指数(FITSE USA ESG Low Carbon Select Index(円換算ベース))に概ね連動する投資成果をめざして、HSBC USA Sustainable Equity UCITS ETFの組入比率を高位に維持する方針です。

# ○ 1 万口当たりの費用明細

(2022年11月8日～2023年11月6日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 20	% 0.126	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	( 9 )	(0.055)	委託した資金の運用の対価
（ 販 売 会 社 ）	( 9 )	(0.055)	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（ 受 託 会 社 ）	( 3 )	(0.016)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料	1	0.004	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（ 投 資 信 託 証 券 ）	( 1 )	(0.004)	
(c) そ の 他 費 用	11	0.070	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ 保 管 費 用 ）	( 2 )	(0.013)	海外保管銀行等に支払う保管・送金・受渡費用
（ 監 査 費 用 ）	( 3 )	(0.020)	監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用
（ そ の 他 ）	( 6 )	(0.037)	振替制度にかかる費用、印刷業者等に支払う法定書類の作成、印刷、交付および届出にかかる費用等
合 計	32	0.200	
期中の平均基準価額は、15,516円です。			

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

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

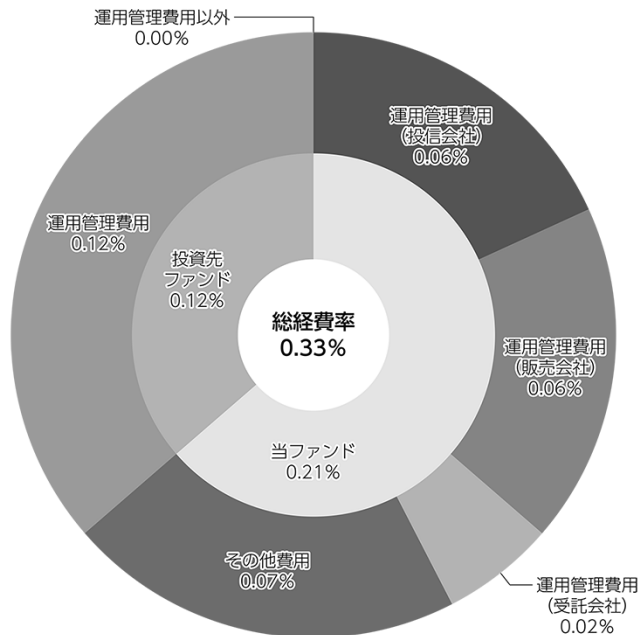
(注) 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

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

(参考情報)

○総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.33%です。



(単位: %)

総経費率(①+②+③)	0.33
①当ファンドの費用の比率	0.21
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.12
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.00

(注) 当ファンドの費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 投資先ファンドとは、当ファンドのマザーファンドが組み入れている投資信託証券です。

(注) 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注) 当ファンドの費用と投資先ファンドの費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注) ファンド名に「HSBC」を含まない投資先ファンドの費用については、②に計上しています。ファンド名に「HSBC」を含む投資先ファンドの費用は②、③に区分して計上していますが、②、③の区分なく費用が公表されている場合は②に計上しています。

(注) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。



## ○売買及び取引の状況

(2022年11月8日～2023年11月6日)

### 親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
HSBC ESG米国株式インデックスマザーファンド	千口 293,528	千円 454,596	千口 333,748	千円 519,371

(注) 単位未満は切捨て。

## ○利害関係人との取引状況等

(2022年11月8日～2023年11月6日)

### 利害関係人との取引状況

#### <HSBC ESG米国株式インデックスファンド>

該当事項はございません。

#### <HSBC ESG米国株式インデックスマザーファンド>

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	%	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$	%
投資信託証券	百万円 70	百万円 53	75.7	百万円 146	百万円 100	68.5

平均保有割合 100.0%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該子ファンドの親投資信託所有口数の割合。

(注) 単位未満は切捨て。

### 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	77千円
うち利害関係人への支払額 (B)	77千円
(B) / (A)	100.0%

(注) 売買委託手数料総額は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものです。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは、ザ・ホンコン・アンド・シャンハイ・バンキング・コーポレーション・リミテッド（香港）です。

## ○組入資産の明細

(2023年11月6日現在)

### 親投資信託残高

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	口 数	評 価 額	口 数	評 価 額
HSBC ESG米国株式インデックスマザーファンド	千口 1,293,768	千円 2,177,288	千口 1,253,548	千円 2,177,288

(注) 口数・評価額の単位未満は切捨て。

## ○投資信託財産の構成

(2023年11月6日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
HSBC ESG米国株式インデックスマザーファンド	千円 2,177,288	% 100.0
コール・ローン等、その他	202	0.0
投資信託財産総額	2,177,490	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

(注) HSBC ESG米国株式インデックスマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産(2,145,869千円)の投資信託財産総額(2,177,467千円)に対する比率は98.5%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは、1米ドル=149.67円です。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年11月6日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	2,177,490,412
HSBC ESG米国株式インデックスマザーファンド(評価額)	2,177,288,639
未収入金	201,773
(B) 負債	1,962,269
未払解約金	201,773
未払信託報酬	1,322,877
その他未払費用	437,619
(C) 純資産総額(A-B)	2,175,528,143
元本	1,259,297,687
次期繰越損益金	916,230,456
(D) 受益権総口数	1,259,297,687口
1万口当たり基準価額(C/D)	17,276円

(注) 当ファンドの期首元本額は1,297,389,462円、期中追加設定元本額は294,878,085円、期中一部解約元本額は332,969,860円です。

(注) また、1口当たり純資産額は1,7276円です。

(注) 上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

## ○損益の状況 (2022年11月8日~2023年11月6日)

項 目	当 期
	円
(A) 有価証券売買損益	314,311,891
売買益	357,458,028
売買損	△ 43,146,137
(B) 信託報酬等	△ 3,651,847
(C) 当期損益金(A+B)	310,660,044
(D) 前期繰越損益金	199,672,805
(E) 追加信託差損益金	405,897,607
(配当等相当額)	( 181,487,476)
(売買損益相当額)	( 224,410,131)
(F) 計(C+D+E)	916,230,456
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F+G)	916,230,456
追加信託差損益金	405,897,607
(配当等相当額)	( 181,489,499)
(売買損益相当額)	( 224,408,108)
分配準備積立金	510,332,849

(注) (A) 有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

(注) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(102,786円)、費用控除後の有価証券等損益額(310,557,258円)、信託約款に規定する収益調整金(405,897,607円)および分配準備積立金(199,672,805円)より分配対象収益は916,230,456円(10,000口当たり7,275円)ですが、当期に分配した金額はありません。

## ○分配金のお知らせ

---

1 万口当たり分配金 (税込み)	0円
------------------	----

◇分配金をお支払いする場合：原則として決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始いたします。

◇分配金を再投資する場合：決算日現在の基準価額に基づいて、税金を差し引いた後、皆さまの口座に繰り入れて再投資いたします。

◇分配金は、分配後の基準価額と個々の受益者の個別元本との差により、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」に分かれます。

普通分配金 … 分配後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合は、全額普通分配金となります。

元本払戻金 … 分配後の基準価額が個別元本を下回る場合は、下回る部分に相当する金額が元本払戻金（特別分配金）となり、残りの部分（特別分配金）は普通分配金となります。元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時に個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。

## ○お知らせ

---

ありません。

◆親投資信託「HSBC ESG米国株式インデックスマザーファンド」の運用状況  
第3期（2022年11月8日～2023年11月6日）

◎当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	主として米国企業においてESG等への取組みを評価する指数（FTSE USA ESG Low Carbon Select Index（円換算ベース））に概ね連動する投資成果をめざして運用を行います。
主要運用対象	米国株式を実質的な投資対象とするETF（上場投資信託証券）を主要投資対象とします。
組入制限	株式への投資には制限を設けません。また、外貨建資産への投資には制限を設けません。

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額		FTSE USA ESG Low Carbon Select Index （円換算ベース） （ベンチマーク）		投資信託 組入比率	純資産額
	期騰落	中率	期騰落	中率		
（設定日） 2020年11月27日	円 10,000	% —	円 10,000	% —	% —	百万円 266
1期(2021年11月8日)	14,029	40.3	14,074	40.7	99.2	1,681
2期(2022年11月7日)	14,679	4.6	14,895	5.8	98.8	1,899
3期(2023年11月6日)	17,369	18.3	17,420	17.0	98.5	2,177

（注）設定日の基準価額は、設定時の価額です。

（注）ベンチマークは設定日を10,000として指数化しております。（以下同じ。）

（注）設定日の純資産は、設定元本を表示しております。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		FTSE USA ESG Low Carbon Select Index (円換算ベース) (ベンチマーク)		投 資 信 託 組 入 比 率
		騰 落 率		騰 落 率	
(期 首) 2022年11月7日	円 14,679	% —	14,895	% —	% 98.8
11月末	14,712	0.2	14,847	△ 0.3	98.8
12月末	13,840	△ 5.7	13,902	△ 6.7	99.0
2023年1月末	14,121	△ 3.8	14,083	△ 5.5	99.2
2月末	14,509	△ 1.2	14,536	△ 2.4	99.1
3月末	14,482	△ 1.3	14,541	△ 2.4	98.9
4月末	14,783	0.7	14,968	0.5	99.3
5月末	15,665	6.7	15,734	5.6	99.5
6月末	16,927	15.3	17,021	14.3	99.3
7月末	17,185	17.1	17,241	15.8	99.0
8月末	17,389	18.5	17,486	17.4	99.2
9月末	16,966	15.6	17,046	14.4	99.2
10月末	16,507	12.5	16,666	11.9	98.7
(期 末) 2023年11月6日	17,369	18.3	17,420	17.0	98.5

(注) 騰落率は期首比です。

## ○当期の運用状況と今後の運用方針

前述の3～5ページをご覧ください。

## ○1万口当たりの費用明細

(2022年11月8日～2023年11月6日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 ( 投 資 信 託 証 券 )	円 1 (1)	% 0.004 (0.004)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) そ の 他 費 用 ( 保 管 費 用 ) ( そ の 他 )	2 (2) (0)	0.013 (0.013) (0.000)	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数  保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用  信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	3	0.017	
期中の平均基準価額は、15,590円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

## ○売買及び取引の状況

(2022年11月8日～2023年11月6日)

### 投資信託証券

銘 柄		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	米 国	口	千 米 ド ル	口	千 米 ド ル
	HSBC USA Sustainable Equity UCITS ETF	24,000	520	46,000	1,055

(注) 金額は受渡し代金。

(注) 単位未満は切捨て。

## ○利害関係人との取引状況等

(2022年11月8日～2023年11月6日)

### 利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
投資信託証券	百万円 70	百万円 53	% 75.7	百万円 146	百万円 100	% 68.5

(注) 単位未満は切捨て。

### 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	77千円
うち利害関係人への支払額 (B)	77千円
(B) / (A)	100.0%

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは、ザ・ホンコン・アンド・シャンハイ・バンキング・コーポレーション・リミテッド（香港）です。

## ○組入資産の明細

(2023年11月6日現在)

### 外国投資信託証券

銘 柄	期首(前期末)		当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額		比 率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(米国) HSBC USA Sustainable Equity UCITS ETF	口 631,000	口 609,000	千米ドル 14,334	千円 2,145,420	% 98.5
合 計	口 数 ・ 金 額 631,000	口 数 609,000	14,334	2,145,420	
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	1	-	< 98.5% >

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

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

## ○投資信託財産の構成

(2023年11月6日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投資証券	千円 2,145,420	% 98.5
コール・ローン等、その他	32,047	1.5
投資信託財産総額	2,177,467	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

(注) 期末における外貨建純資産（2,145,869千円）の投資信託財産総額（2,177,467千円）に対する比率は98.5%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは、1米ドル=149.67円です。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年11月6日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	2,177,467,213
コール・ローン等	32,046,920
投資証券(評価額)	2,145,420,293
(B) 負債	202,119
未払解約金	201,773
未払利息	94
その他未払費用	252
(C) 純資産総額(A-B)	2,177,265,094
元本	1,253,548,644
次期繰越損益金	923,716,450
(D) 受益権総口数	1,253,548,644口
1万口当たり基準価額(C/D)	17,369円

(注) 上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

### ≪注記事項≫

※期首元本額	1,293,768,692円
期中追加設定元本額	293,528,527円
期中一部解約元本額	333,748,575円

※当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末保有元本額  
 H S B C E S G米国株式インデックスファンド  
 1,253,548,644円

## ○損益の状況 (2022年11月8日～2023年11月6日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	107,092
受取利息	120,282
その他収益金	3,498
支払利息	△ 16,688
(B) 有価証券売買損益	343,106,492
売買益	353,011,672
売買損	△ 9,905,180
(C) 保管費用等	△ 263,610
(D) 当期損益金(A+B+C)	342,949,974
(E) 前期繰越損益金	605,321,094
(F) 追加信託差損益金	161,068,132
(G) 解約差損益金	△185,622,750
(H) 計(D+E+F+G)	923,716,450
次期繰越損益金(H)	923,716,450

(注) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。  
 (注) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。  
 (注) (G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

## ○お知らせ

ありません。



## HSBC USA Sustainable Equity UCITS ETF

ファンドはHSBCアセットマネジメントが運用する外国籍のETFです。以下はHSBCアセットマネジメントが作成したアニュアル・レポートに基づき、その一部を抜粋したものです。

### HSBC USA SUSTAINABLE EQUITY UCITS ETF

#### Statement of Comprehensive Income for the year ended 31 December 2022

	<b>2022 USD</b>
<b>Income</b>	
Dividend income	12,068,869
Other income	6,262
Net (loss)/gain on financial assets and liabilities at fair value through profit or loss and foreign exchange	(120,792,181)
<b>Total (loss)/income</b>	<b>(108,717,050)</b>
<b>Expenses</b>	
Management fees	747,664
Other expenses	35,602
<b>Total operating expenses</b>	<b>783,266</b>
<b>Operating (loss)/profit</b>	<b>(109,500,316)</b>
<b>(Loss)/profit for the financial year after distribution and before withholding tax</b>	<b>(109,500,316)</b>
Less: Withholding tax	(1,739,472)
<b>(Decrease)/increase in net assets attributable to holders of Redeemable Participating Shares from operations</b>	<b>(111,239,788)</b>

#### 組入上位10銘柄 (2022年12月31日現在)

(組入銘柄数：463)

	銘柄名	組入比率 (%)
1	Johnson & Johnson	10.94
2	Microsoft	9.14
3	Apple	6.11
4	Visa	3.38
5	Cisco Systems	2.62
6	BlackRock	2.45
7	Merck	2.37
8	International Business Machines	1.96
9	Home Depot	1.53
10	Citigroup	1.47