

業務及び財産の状況に関する説明書 2023年12月期

この説明書は、金融商品取引法第47条の3に基づき、
公衆の縦覧に供するために作成したものです。

シュローダー・インベストメント・マネジメント株式会社

第三十三期事業報告書 〔 令和5年1月 1日から
令和5年12月31日まで 〕

令和6年 3 月 29日提出

商号又は名称 シュローダー・インベストメント・マネジメント株式会社
所在地 東京都千代田区丸の内一丁目8番3号
代表者の役職氏名
代表取締役社長 黒 瀬 憲 昭

1 業務の状況

(1) 登録年月日及び登録番号

平成19年9月30日（関東財務局長（金商）第90号）

(2) 行っている業務の種類

第二種金融商品取引業
投資運用業（投資一任業／投資信託委託業）
投資助言・代理業

(3) 苦情処理及び紛争解決の体制

① 第二種金融商品取引業

一般社団法人投資信託協会（F I N M A C に業務委託）を利用する措置

② 投資助言・代理業

一般社団法人日本投資顧問業協会（F I N M A C に業務委託）を利用する措置

③ 投資運用業

一般社団法人日本投資顧問業協会（F I N M A C に業務委託）もしくは一般社団法人投資信託協会（F I N M A C に業務委託）を利用する措置

(4) 加入している投資者保護基金、金融商品取引業協会及び金融商品取引所並びに対象事業者となっている認定投資者保護団体

一般社団法人投資信託協会（正会員）

一般社団法人日本投資顧問業協会

一般社団法人第二種金融商品取引業協会

(5) 当期の業務概要

2023年の主要国の株式市場は、米国の利上げの影響を強く受けた1年となりました。日本株については、景況感の回復やインバウンド需要による国内経済の後押し、またこれを受けての堅調な企業業績等により再評価が進み、日経平均株価は年間30%近い上昇となりました。

このような状況の下、当期の営業収益は8,723百万円（前期比7.9%増）、経常利益は364百万円（前期比128.5%増）、当期純利益は201百万円（前期比373.4%増）となりました。

(5-2) 第一種金融商品取引業を行わない金融商品取引業者が説明書類に記載する事項

1. 別紙様式第十五号の二に記載されている事項
2. 事業報告書に記載されている事項

(6) 株主総会決議事項の要旨

令和6年3月28日開催 定時株主総会

報告事項

1. 令和5年12月31日をもって終了した事業年度に関する事業報告の報告の件
2. 令和5年12月31日をもって終了した事業年度に関する計算書類の報告の件

(7) 役員及び使用人の状況

① 役員及び使用人の総数

	役員		使用人	計
		うち非常勤		
総数	5名	2名	91名	96名
うち外務員	0名	0名	0名	0名

② 役員 の 状 況

役職名	氏名又は名称	兼 職 の 状 況		
		商 号	役職名	代表権の有無
代表取締役 社長	黒瀬 憲昭	① エヌケイアンドカン パニー株式会社 ② 株式会社 NFCH	① 代表取締役 ② 非常勤取締 役	① 有 ② 無
取締役	豊田 一弘	該当なし		
取締役	杉浦 信吾	Schroders Korea Limited	Executive Director	無

役職名	氏名又は名称	兼 職 の 状 況		
		商 号	役職名	代表権の有無
取締役 (非常勤)	クリストファー・ジェームス・デュラック	① Schroder Investment Management (Singapore) Ltd	① Director	① 有
		② Axis Asset Management Company Limited	② Non-Executive Director	② 無
		③ Bank of Communications Schroder Fund Management Company Limited (FMC JV)	③ Director	③ 無
		④ Bush Poet P/LATF Durack Super Fund	④ Director	④ 有
		⑤ Bush Poet P/LATF Grass Castle Discretionary Trust	⑤ Director	⑤ 有
		⑥ Schroder Investment Management (Hong Kong) Limited	⑥ Director	⑥ 有
監査役 (非常勤)	箱田 順哉	—	—	—

③ 国内における代理人の状況

(該当事項なし)

④ 役員の業績連動報酬の状況

(該当事項なし)

(投資運用業を行う金融商品取引業者に限る。)

(8) 営業所の状況

名 称	所 在 地	役員及び使用人
シュローダー・インベストメント・マネジメント株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目8番3号	96名
計 1店		計 96名

(9) 株主の状況

氏名又は名称	住所又は所在地	割合
シュローダー・インターナショナル・ホールディングス・リミテッド	英国 EC2Y 5AU ロンドン、ロンドン・ウォール・プレイス 1	100.00%
計 1名		100.00%

(10) 業務の状況

当期における第一種金融商品取引業の状況について記載すること。なお、表示単位未満の端数があるときは、その端数を切り捨てること。

- ① 有価証券の売買の状況 (該当事項なし)
- ② 有価証券の売買の媒介等の状況 (該当事項なし)
- ③ 有価証券に関連する市場デリバティブ取引の状況 (該当事項なし)
- ④ 店頭デリバティブ取引等の状況 (該当事項なし)
- ⑤ 有価証券に関連する外国市場デリバティブ取引の状況 (該当事項なし)
- ⑥ 有価証券の引受け及び売出し並びに特定投資家向け売付け勧誘等並びに有価証券の募集、売出し及び私募の取扱い並びに特定投資家向け売付け勧誘等の取扱いの状況 (該当事項なし)
- ⑦ 有価証券の貸借等の状況 (該当事項なし)
- (10-2) 電子募集取扱業務の状況 (該当事項なし)
- (10-3) 電子記録移転有価証券表示権利等に関する業務の状況 (該当事項なし)
- (11) 自己資本規制比率の状況 (該当事項なし)
- (12) 分別管理の状況
 - ① 顧客分別金信託の状況 (該当事項なし)
 - ② 有価証券（電子記録移転有価証券表示権利等を除く。）の分別管理の状況
 - （保護預り等有価証券） (該当事項なし)
 - （受入保証金代用有価証券） (該当事項なし)
 - ③ 有価証券（電子記録移転有価証券表示権利等を除く。）の分別管理の状況（管理場所別） (該当事項なし)

- ④ 有価証券（電子記録移転有価証券表示権利等（令第1条の12第2号に規定する権利を除く。）に限る）の分別管理の状況 （該当事項なし）
- (12-2) 対象商品デリバティブ取引関連取引に係る区分管理の状況
（法第43条の2の2の規定に基づく区分管理の状況）
- ① 商品顧客区分管理信託の状況 （該当事項なし）
- ② 有価証券等の区分管理の状況 （該当事項なし）
- (13) 区分管理の状況（電子記録移転有価証券表示権利等に係るものを除く。）
（法第43条の3第1項の規定に基づく区分管理の状況） （該当事項なし）
（法第43条の3第2項の規定に基づく区分管理の状況） （該当事項なし）
- (13-2) 区分管理の状況（電子記録移転有価証券表示権利等に係るものに限る） （該当事項なし）
- (14) 特定有価証券等管理行為に係る分別管理の状況について、(12)及び(13)に準じて記載すること。
（該当事項なし）
- (15) 自ら行った委託者指図型投資信託及び外国投資信託の受益証券等の募集等に係る業務の状況
（電子記録移転有価証券表示権利等に関する業務に係るものを除く。）
- ① 委託者指図型投資信託の募集又は私募の状況 （該当事項なし）
- ② 外国投資信託の受益証券の募集又は私募の状況 （該当事項なし）
- ③ 抵当証券の募集又は私募の状況 （該当事項なし）
- ④ 外国抵当証券の募集又は私募の状況 （該当事項なし）
- ⑤ 法第2条第2項第5号又は第6号に係るみなし有価証券の募集または私募の状況
（該当事項なし）
- ⑥ 募集または私募を行った法第2条第2項第5号又は第6号に係るみなし有価証券一覧表
（該当事項なし）
- ⑦ 募集または私募を行った法第2条第2項第5号又は第6号に係るみなし有価証券の状況
（該当事項なし）
- ⑧ 令第1条の9の2第1号に掲げる有価証券の募集又は私募の状況 （該当事項なし）
- (16) みなし有価証券の売買等の状況
- ① みなし有価証券の売買又は売買の媒介等の状況 （該当事項なし）
- ② 売買又は売買の媒介等を行ったみなし有価証券一覧表 （該当事項なし）
- ③ みなし有価証券の売出し又は募集若しくは売出しの取扱又は私募の取扱状況（単位：百万円）

	売 出 高	募 集 の 取 扱 高	売 出 し の 取 扱 高	私 募 の 取 扱 高
法第2条第2項第1号	—	—	—	—
法第2条第2項第2号	—	—	—	—
法第2条第2項第3号	—	—	—	—
法第2条第2項第4号	—	—	—	—
法第2条第2項第5号	—	—	—	—
法第2条第2項第6号	—	—	—	—
法第2条第2項第7号	—	—	—	—
合計				

④ 売出し又は募集、売出し若しくは私募の取扱いを行ったみなし有価証券一覧表

権利の名称	設定年月日	存続期間の 終期	総出資額 (円)	純資産額 (円)	備考
Schroder Euro Enhanced Infra Debt Fund II - SCSp-SICAV- RAIF	令和2年 2月27日	令和15年 7月16日	143,096,369,088 (49,067,724,165)	138,800,796,528	2023年12月末時 点ユーロ円TTM レート141.82を 適用。
合計額			143,096,369,088 (49,067,724,165) うち暗号資産での 出資 -円	138,800,796,528	うち関係会社 以外の発行 -本 うち適格機関 投資家向け 1本

⑤ 売出し又は募集、売出し若しくは私募の取扱いを行ったみなし有価証券の状況

権利の名称	Schroder Euro Enhanced Infra Debt Fund II - SCSp-SICAV-RAIF			
事業の内容	商品分類	出資対象事業又は 信託財産の種類等	備考	
	社会投資	インフラデットフ ァンド		
出資者数	適格機関投資家		適格機関投資家以外の者	
	うち個人		うち個人	計
	1名	0名	0名	0名
有価証券の種類	外国の法令に基づ く権利で法第2条 第2項第5号に掲 げる権利に類する もの	The law of 12 July 2013 on alternative investment fund managers		
売出し・募集・私募の別	私募の取扱い			
発行者の名称	Schroder Euro Enhanced Infra Debt Fund II			
	外国の者である場合 国名、監督当局等	国：Luxembourg		
設定年月日	令和2年2月27日			
売出し・募集・私募の期 間	令和1年12月20日～令和3年7月20日			
存続期間の終期	令和15年7月16日			
出資額 (計算期間中に新規に出資 又は拠出を受けた分)	総出資額 (計算期間中に新 規に出資又は拠出 を受けた分)	総出資額 (1年前)	1口当たりの出資 額	
	143,096,369,088 円 口 (49,067,724,165 円)	94,028,644,922円 口	0円	
	うち暗号資産での 出資	うち暗号資産での 出資(1年前)	/	
-円	-円			
純資産額	純資産額	純資産額 (1年前)	増減率	
	138,800,796,528 円	87,859,955,613円	57.98%	

	1口当たり純資産額	1口当たり純資産額（1年前）	
	-円	-円	
総資産額	総資産額	総資産額（1年前）	増減率
	139,332,401,652円	88,513,593,287円	57.41%
ファンドの資産構成	区分	金額	備考
	現金・預金	5,933,885,869円	2023年12月末時点ユーロ円TTMレート141.82を適用
	有価証券	133,398,515,783円	2023年12月末時点ユーロ円TTMレート141.82を適用
	うち非上場株式	-円	-
	デリバティブ資産	-円	-
	暗号資産	-円	-
	その他種類	-円	
	合計	139,332,401,652円	
配当額（分配額）	配当等利回り	直近1年間の総支払配当等額	設定来総支払配当等累計額
	0.00%	15,765,999,942円	9,587,438,911円
想定配当等利回り	-%		
解約額	-円	-口	-名
償還額	-円	-口	-名
ファンドの財務諸表監査の有無	監査の有無	備考	
	有	PricewaterhouseCoopers	
発行者との関係	海外グループ運用会社		
出資金払込口座の所在地	国内又は海外の別	国・地域名等	
	海外	ルクセンブルク	
資金の流れ	投資家からの出資金は、CACEIS Bank, Luxembourg Branchで管理され、同口座から出資対象事業に投資されることとなる。		

(17) 有価証券に関連しない市場デリバティブ取引及び外国市場デリバティブ取引の状況

① 有価証券に関連しない市場デリバティブ取引の状況 (該当事項なし)

② 有価証券に関連しない外国市場デリバティブ取引の状況 (該当事項なし)

(18) 令第1条の12各号に掲げる行為に係る業務の状況

① 有価証券の転売を目的としない買取の状況

(該当事項なし)

② 預託を受けた電子記録移転権利から除かれた権利の状況

(該当事項なし)

(19) 投資運用業に係る経営の状況

① 投資運用業に係る内部管理の状況

<内部管理体制>

弊社の内部管理部門であるコンプライアンス部、法務部及びリスク管理部は各部門から独立して組織されており、それぞれ直接担当役員に報告する体制となっている。全社的なコンプライアンスやリスク管理上の諸事項は、取締役会もしくは経営会議から権限を委譲されて組織された、コンプライアンスコミッティおよびリスクコミッティで検討され、必要な対応はそれらのコミッティで決定される。

各部の業務は以下の通りである。

● コンプライアンス部

コンプライアンス部の主な役割は、業務運営が規制上の要件に沿って行われることを確保することであり、各業務に対してコンプライアンス上の助言を提供し、またコンプライアンス遵守状況のモニタリングを行っている。

コンプライアンス上の助言については、各種コンプライアンス・ポリシー等の策定・維持も重要な任務であり、これらポリシーや手続き等の遵守の徹底のために役職員への研修も行っている。

モニタリング業務においては、コンプライアンス機能が適正に働いているか確認するために、コンプライアンス・モニタリング・プログラムを策定し実施している。当該プログラムにおいては、モニタリングの対象に関連するリスクに応じて日次、四半期、半年次、年次、随時などの頻度で、またテーマ別のモニタリングも行っている。

● 法務部

法務部の主な責任は、弊社が不必要なリーガル・リスクにさらされないように監督することである。そのために、関連する法令・関連諸規則などについての最新かつ十分な知識・情報を入手し、社内に法的アドバイスを提供している。また、契約書の作成やレビューを通じて、契約上必要な条件を確保したり、契約違反による損害リスクを低減させたり、紛争リスクを避けるための法的アドバイスを提供している。コンプライアンスに対して法的側面からの支援も提供する。

● リスク管理部

リスク管理部の主な役割は、業務リスクおよび運用リスクを含む会社の業務全般のリスク管理を行うことである。特にオペレーショナル・リスクの管理については、違反行為・エラー&オMISSIONの取扱い、内部監査の指摘事項の改善計画の実施状況の確認等を行っている。その他、リスク管理体制の検証および改善策の提案・実施を行うと共に、リスク管理に関する社員への啓蒙・教育活動を行い堅牢な体制の構築・維持に努めている。

<内部監査>

グループ統括会社の内部監査部が定期的に弊社を訪問し、各部門・業務に対する監査を行っている。

<外部監査>

会計監査並びに投信法に基づく投信ファンド監査、シュローダー・グループの財務諸表監査および諸手続きの監査、グローバル投資パフォーマンス基準（GIPS）準拠の検証、投資一任契約に係る資産運用管理業務に係る内部統制についての検証が、各々監査法人により定期的に実施されている。

<情報管理>

内部者取引（インサイダー取引）の未然防止

以下の文言を織り込んだ社内規程を整備し、法令遵守を確保している。

1. 当社は金融商品取引法その他の法令等を遵守し、インサイダー取引の未然防止に努める。
2. 当社は、投資運用業又は投資助言・代理業に係る情報収集活動、契約締結等の際には、顧客等にインサイダー取引規制の意義と内容について、十分理解させるよう努める。
3. 当社は、未公表の金融商品取引法第 166 条に定める重要事実、金融商品取引業等に関する内閣府令第 1 条第 4 項第 14 号に定める法人関係情報、高蓋然性情報及び示唆情報（以下これらを総称して MNPI 等という。）を知りうる可能性のある者に対し、当該情報を提供するよう働きかけをしてはならない。
4. 当社は、有価証券等の取引に係る発注の相手方の評価・選択にあたって、MNPI 等又はそれに該当するおそれのある情報の提供の有無、内容を考慮してはならない。
5. 当社の役職員は、有価証券等の取引に係る発注の相手方の役職員から社会通念上妥当な範囲を超えた接待や金銭・物品の供与等を受けてはならない。
6. 当社は、プライベート部門（恒常的に MNPI 等を取得することが想定される部門をいう。）とパブリック部門（プライベート部門以外の部門をいう。）との間に、チャイニーズウォール（情報管理のための組織上、物理上又はシステム上の障壁をいう。）を構築する。

MNPI 等の管理

1. MNPI 等を入手した場合
 - その情報を利用していかなる取引も行わない。
 - その情報を他人に提供しない（所定の報告手続を除く）。
2. 社内での報告手続き
 - (1) 役職員は、MNPI 等を取得した場合、あるいは自らの有する情報が MNPI 等となる疑いがある場合には、直ちにその情報を情報管理責任者に報告するものとする。
 - (2) 上記の報告を行う場合、正確に記録を残すため、所定の「内部情報の取得報告」の様式を使用し、書面で情報管理責任者に提出する。

(3) 当該役職員は、当該 MNPI 等に基づく有価証券の取引を行ったり、また情報管理責任者が認めるときあるいはその情報が発表されて公開情報になったときを除き、第三者にその情報を漏らすことは禁じられている。

3. 情報管理責任者

当社における MNPI 等に関する情報管理責任者は、コンプライアンス部長とする。情報管理責任者は、役職員から MNPI 等の報告を受けたときは、当該情報が重要な情報を含む MNPI 等にあたるかどうかを判断し、当該役職員に対し当該情報の管理等に対し必要な指示を与える。情報管理責任者が行った判断については、その理由等を含めた判断の事跡を「内部情報の取得報告」により、適切に記録・保管する。

4. 重要情報を含む MNPI 等を取得したと判断された場合

情報管理責任者は、重要な情報を含む MNPI 等を取得したと判断した場合、当社および当社グループが運用する顧客資産、役職員の個人取引における当該銘柄の売買を必要な範囲で停止する。

その後、MNPI 等が公表されたことを確認した場合には、上記の売買停止措置を解除する。以上の措置について、措置が実施された日時等を記録し、所定の方法で保存する。

<顧客情報の管理>

当社は、顧客情報を含めた当社の情報セキュリティを確保するため、情報セキュリティ・ポリシー及びサービス規程などで、事前に許可のないもしくは個人的な顧客情報の利用を禁じている。

<利益相反防止管理態勢>

(1) 利益相反管理統括部署・責任者の設置

- ・ 当社のコンプライアンス部を利益相反管理統括部署として数名を配置し、その長を利益相反管理統括責任者としている。同部は運用部門・営業部門からの独立性を保障され、具体的な案件の処理について運用部門・営業部門から指揮命令を受けることはない。
- ・ 利益相反管理統括部署は、利益相反のおそれのある取引の特定及び利益相反管理に関する全社的な管理体制を統括する。

(2) 利益相反管理統括部署の職責

利益相反管理統括部署は、業務担当部署から独立した立場で以下の職責を担う。

- ・ 対象取引を特定するとともに、対象取引に関する適切な利益相反管理の実施を当社の業務担当部署に対して指示する。
- ・ 定期的に又はその都度対象取引の利益相反管理状況等の報告を受け、適切な管理が行われているかを検証し、新規業務を開始するとき、親子法人等が新たに増えるとき等必要に応じて、利益相反管理に係る手続や利益相反管理体制の見直しを行う。
- ・ お客様の利益が不当に害されるおそれがある場合は、必要に応じて、当社の業務担当部署に対する適切な利益相反管理の実施指示、対象取引の見直し等を行う。
- ・ 当社の役職員に対し、本方針及び利益相反規程を踏まえた利益相反の管理につい

て研修を定期的実施し、利益相反のおそれのある取引の管理について周知徹底する。

(3) 記録・保存

利益相反のおそれのある取引の特定及び管理方法の選定を行った場合、それぞれの具体例ごとに定められた記録の保存方法にしたがって、利益相反管理統括部署を含む各担当部門においてその措置について記録し、作成の日から5年間保存するものとする。

② 投資運用業を行う者に係る外部監査の状況

	監査人名	監査の内容
財務諸表監査	EY新日本有限責任監査法人	金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく法定監査 結果の概要：無限定適正意見

③ ファンド監査の状況

イ 投資一任契約に係る業務におけるファンド監査の状況

	国内籍		外国籍		財務諸表監査が実施されているファンド総数の投資先ファンド総数に占める割合
	公募	私募	公募	私募	
財務諸表監査が実施されているファンド数（うち法定監査）	一本 (-)	3本 (-)	一本 (-)	17本 (-)	100.0%
投資先ファンド数	一本	3本	一本	17本	

ロ 投資信託、外国投資信託及び投資法人に関する運用に係る業務におけるファンド監査の状況

	国内籍		外国籍		財務諸表監査が実施されているファンド総数のファンド総数に占める割合
	公募	私募	公募	私募	
財務諸表監査が実施されているファンド数（うち法定監査）	33本 (33)	21本 (-)	一本 (-)	一本 (-)	100.0%
ファンド数	33本	21本	一本	一本	

ハ 法第2条第8項第15号に掲げる行為に係る業務におけるファンド監査の状況

	国内籍		外国籍		財務諸表監査が実施されているファンド総数のファンド総数に占める割合
	公募	私募	公募	私募	
財務諸表監査が実施されているファンド数（うち法定	一本 (-)	一本 (-)	一本 (-)	一本 (-)	-%

監査)					
ファンド数	一本	一本	一本	一本	

④ 主要な経営指標等の推移

	当期	前期	前々期
全体収益	8,723百万円	8,083百万円	9,461百万円
うち投資運用部門収益	8,723百万円	8,083百万円	9,461百万円
当期純損益	201百万円	42百万円	338百万円
契約件数	55件	53件	55件
運用財産総額合計	1,359,977百万円	1,147,140百万円	1,746,345百万円
委託者報酬及び運用受託報酬	6,586百万円	5,911百万円	7,720百万円
年金受託割合	42.0%	56.3%	75.6%

(20) 投資一任契約に係る業務の状況

① 契約件数等

	国内			小計	海外		小計	合計
	公的年金	私的年金	その他		年金	その他		
契約件数	8件	22件	6件	36件	3件	16件	19件	55件
運用財産総額	423,699百万円	112,888百万円	12,428百万円	549,015百万円	35,102百万円	775,860百万円	810,962百万円	1,359,977百万円
割合	31.2%	8.3%	0.9%	40.4%	2.6%	57.0%	59.6%	

② 投資一任契約に係る投資の状況

イ 有価証券の売買状況（約定ベース・受渡しベース）

株式	公社債券	受益証券	信託受益権	その他有価証券
売買高	売買高	売買高	売買高	売買高
908,036百万円	166,192百万円	32,172百万円	0百万円	0百万円

ロ デリバティブ取引の状況（約定ベース・受渡しベース）

(イ) 市場デリバティブ取引高

先物取引高		オプション取引高		その他	
株式	公社債券	株式	公社債券		
232,553百万円	0百万円	0百万円	0百万円	0百万円	0百万円

(ロ) 店頭デリバティブ取引高

先 渡 取 引 高	オプション取引高	スワップ取引高	そ の 他
1,509,959 百万円	0 百万円	94,034 百万円	0 百万円

(ハ) 外国市場デリバティブ取引高

先 物 取 引 高		オプション取引高		そ の 他	
株 式	公 社 債 券	株 式	公 社 債 券		
0 百万円	342,008 百万円	0 百万円	0 百万円	0 百万円	0 百万円

ハ 金融商品取引行為の相手方の状況

相 手 方	取 引 額	備 考
モルガン・スタンレー証券	381,948 百万円	先物取引等
UBS 証券	368,782 百万円	先物取引等
シュローダー・インベストメント・マネージメント（ヨーロッパ）エス・エイ（関係外国法人等）	26,655 百万円	投資信託売買

③ 運用受託報酬 3,521 百万円

④ 自己又は関係会社が発行・設定する有価証券の組入れ状況

運用財産総額	うち自己発行有価証券	うち関係会社発行有価証券	うち自己設定投資信託の受益証券等	うち関係会社設定投資信託の受益証券等
1,359,977 百万円	0 百万円	0 百万円	11,568 百万円	47,336 百万円
割合	0.0%	0.0%	0.9%	3.5%

⑤ 運用財産のファンドへの投資の状況

投資先ファンドの種類	価額の算出者	ファンド関係者における関係会社の名称等
国内籍契約型投資信託	シュローダー・インベストメント・マネージメント株式会社	無
外国籍会社型投資信託	J.P. モルガン・エス・イー ルクセンブルグ ブランチ	シュローダー・インベストメント・マネージメント（ヨーロッパ）エス・エイ（管理会社、関係外国法人等に該当）
外国籍契約型投資信託	エイチエスビーシーバンク ピーエルシー	無

⑥ 運用財産の投資対象の時価に係る情報

イ 時価を把握することが困難である投資対象

運用財産が保有する 投資対象の区分	投資対象の保有額	左記のうち時価を把握 することが困難である 投資対象の保有額	割合
株式	1,245,236百万円	0百万円	0%
公社債券	24,239百万円	0百万円	0%
受益証券	83,839百万円	0百万円	0%
信託受益権	0百万円	0百万円	0%
その他の有価証券	0百万円	0百万円	0%
その他の資産 (現金・預金を含む。)	6,662百万円	0百万円	0%
全体	1,359,977百万円	0百万円	0%

ロ 時価を把握することが困難である理由

(該当なし)

⑦ 対象有価証券の名義人の状況

名義人の名称	関係内容	理由
-	-	-

(2) 投資信託、外国投資信託及び投資法人に関する運用に係る業務の状況

① 投資信託の設定、解約及び償還の状況

イ 募集

区分	設定		解約	償還		期中 増減	残存	
	ファン ド数	元本 額		ファン ド数	元本 額		ファン ド数	元本額
単位型投資信託	-	百万円 -	百万円 -	-	百万円 -	百万円 -	-	百万円 -
追加型投資信託	-	11,072	17,589	1	4	△6,521	33	100,244
株式投資信託計	-	11,072	17,589	1	4	△6,521	33	100,244
単位型投資信託	-	-	-	-	-	-	-	-
追加型投資信託	-	-	-	-	-	-	-	-
公社債投資信託計	-	-	-	-	-	-	-	-
単位型投資信託	-	-	-	-	-	-	-	-
追加型投資信託	-	-	-	-	-	-	-	-
不動産投資信託計	-	-	-	-	-	-	-	-
単位型投資信託	-	-	-	-	-	-	-	-
追加型投資信託	-	-	-	-	-	-	-	-

その他投資信託計		-	-	-	-	-	-	-
単位型投資信託	-	-	-	-	-	-	-	-
追加型投資信託	-	11,072	17,589	1	4	△6,521	33	100,244
投資信託計	-	11,072	17,589	1	4	△6,521	33	100,244

ロ 特定投資家私募

(該当事項なし)

ハ 適格機関投資家私募

区分	設定		解約	償還		期中増減	残存	
	ファンド数	元本額		ファンド数	元本額		ファンド数	元本額
単位型投資信託	3	百万円 18,000	百万円 -	-	百万円 -	百万円 18,000	3	百万円 18,000
追加型投資信託	1	30,648	34,059	1	12	△ 3,423	15	160,493
株式投資信託計	4	48,648	34,059	1	12	14,577	18	178,493
単位型投資信託	-	-	-	-	-	-	-	-
追加型投資信託	-	-	-	-	-	-	-	-
公社債投資信託計	-	-	-	-	-	-	-	-
単位型投資信託	-	-	-	-	-	-	-	-
追加型投資信託	-	-	-	-	-	-	-	-
不動産投資信託計	-	-	-	-	-	-	-	-
単位型投資信託	-	-	-	-	-	-	-	-
追加型投資信託	-	-	-	-	-	-	-	-
その他投資信託計	-	-	-	-	-	-	-	-
単位型投資信託	3	18,000	-	-	-	18,000	3	18,000
追加型投資信託	1	30,648	34,059	1	12	△ 3,423	15	160,493
投資信託計	4	48,648	34,059	1	12	14,577	18	178,493
シュローダー・ヨーロッパ・オープン・マザーファンド	-	-	11,709	1	8	△ 11,717	-	-
シュローダー日本株式マザーファンド	-	199	294	-	-	△ 95	1	1,318
シュローダー外国株式マザーファンド	-	989	1,239	-	-	△ 250	1	5,523
シュローダー日本マザーファンド	-	1,842	3,262	-	-	△1,420	1	15,150
シュローダー・グローバル・エマージング株式マザーファンド	-	1,575	975	-	-	600	1	7,272
シュローダーBRICs株式マザーファンド	-	83	400	-	-	△ 317	1	2,931
シュローダー・ラテンアメリカ株マザーファンド	-	7	767	-	-	△ 760	1	2,800

区分	設定		解約	償還		期中増減	残存	
	ファンド数	元本額		ファンド数	元本額		ファンド数	元本額
シュローダー厳選グ ロース・ジャパン・ マザーファンド	—	1	6	—	—	△ 5	1	87
シュローダー・イン カムアセット・アロ ケーション・マザー ファンド	—	117	486	—	—	△ 369	1	1,654
シュローダー・ユー ロ株式マザーファン ド (ユーロ)	—	30	241	—	—	△211	1	588
シュローダー・ユー ロ株式マザーファン ド (米ドル)	—	6	63	—	—	△57	1	387
シュローダー・アジ アパシフィック (除 く日本) 株式サステ ナブル投資マザーフ ァンド	—	13	181	—	—	△168	1	440
シュローダー日本株 式サステナブル投資 マザーファンド	—	9	89	—	—	△ 80	1	231
シュローダーYENタ ーゲット・マザーフ ァンド	—	33	1,156	—	—	△ 1,123	1	3,782
シュローダー・グロ ーバルリートESG フォーカス・マザー ファンド	—	1,141	2,473	—	—	△ 1,332	1	17,348
シュローダー・ツー シグマ・ダイバーシ ファイド・マザーフ ァンド	—	972	441	—	—	531	1	1,096
シュローダーPF日本 債券マザーファンド	—	1,207	3,802	—	—	△ 2,595	1	10,605
シュローダーPF日本 株式マザーファンド	—	846	1,139	—	—	△ 293	1	4,746
シュローダー日本株 バリューアップ・マ ザーファンド	—	1,457	146	—	—	1,311	1	4,574
シュローダー・マイ クロ日本株マザーフ ァンド	—	67	12	—	—	55	1	320
シュローダー日本小 型株マザーファンド	—	—	211	—	—	△211	1	1,845
シュローダー・グロ ーバルCBマザーファン ド	—	159	739	—	—	△ 580	1	2,490
シュローダー・マル チアセット・ストラ テジー・マザーファン ド	—	—	2,286	—	—	△ 2,286	1	34,725

区分	設定		解約	償還		期中増減	残存	
	ファンド数	元本額		ファンド数	元本額		ファンド数	元本額
親投資信託受益証券	—	10,753	32,117	1	8	△ 21,372	22	119,912

ニ 一般投資家私募

区分	設定		解約	償還		期中増減	残存	
	ファンド数	元本額		ファンド数	元本額		ファンド数	元本額
		百万円	百万円		百万円	百万円		百万円
単位型投資信託	—	—	—	—	—	—	—	—
追加型投資信託	—	121	1,749	—	—	△ 1,628	3	6,111
株式投資信託計	—	121	1,749	—	—	△ 1,628	3	6,111
単位型投資信託	—	—	—	—	—	—	—	—
追加型投資信託	—	—	—	—	—	—	—	—
公社債投資信託計	—	—	—	—	—	—	—	—
単位型投資信託	—	—	—	—	—	—	—	—
追加型投資信託	—	—	—	—	—	—	—	—
不動産投資信託計	—	—	—	—	—	—	—	—
単位型投資信託	—	—	—	—	—	—	—	—
追加型投資信託	—	—	—	—	—	—	—	—
その他投資信託計	—	—	—	—	—	—	—	—
単位型投資信託	—	—	—	—	—	—	—	—
追加型投資信託	—	121	1,749	—	—	△ 1,628	3	6,111
投資信託計	—	121	1,749	—	—	△ 1,628	3	6,111
親投資信託受益証券	—	—	—	—	—	—	—	—

②外国投資信託の設定、解約及び償還の状況

(該当事項なし)

③投資法人との資産運用委託契約の状況

(該当事項なし)

④投資信託財産、外国投資信託の信託財産及び投資法人運用資産の売買等の状況

イ 有価証券の売買状況 (単位：千株/百万円)

区分	売付		買付		合計		備考
	株数	金額	株数	金額	株数	金額	
株券	63,783	93,833	60,109	57,957	123,892	151,790	
新株予約権証券		—		—		—	
公社債券		120,822		144,854		265,676	

信託受益権		-		-		-	
その他		5,519		7,695		13,214	投資信託
計		220,174		210,506		430,680	
親投資信託受益証券		82,025		31,866		113,891	

ロ 市場デリバティブ取引の状況 (単位：百万円)

区分		売付	買付	合計	備考
先物取引	株券に係る取引	16,015	16,955	32,970	
	債券に係る取引	21,608	22,359	43,967	
	その他	-	-	-	
オプション取引	株券に係る取引	-	-	-	
	債券に係る取引	0	1	1	
	その他	-	-	-	
その他	()	-	-	-	
	()	-	-	-	
	()	-	-	-	

ハ 店頭デリバティブ取引の状況 (単位：百万円)

区分		売付	買付	合計	備考
先渡取引	株券に係る取引	-	-	-	
	債券に係る取引	-	-	-	
	その他	51,753	51,939	103,692	NDF (円建てを含む)
オプション取引	株券に係る取引	-	-	-	
	債券に係る取引	-	-	-	
	その他	-	-	-	
その他	()	-	-	-	
	()	-	-	-	
	()	-	-	-	

ニ 外国市場デリバティブ取引の状況 (単位：百万円)

区分		売付	買付	合計	備考
先物取引	株券に係る取引	73,172	72,330	145,502	
	債券に係る取引	89,933	84,139	174,072	
	その他	-	-	-	

オプション取引	株券に係る取引	310	867	1,177	
	債券に係る取引	-	-	-	
	その他	-	-	-	
その他	()	-	-	-	
	()	-	-	-	
	()	-	-	-	

ホ 不動産の売買の状況 (単位：百万円)

区分		売付	買付	合計	備考
賃貸用	建物	-	-	-	
	土地	-	-	-	
	その他	-	-	-	
賃貸用以外	建物	-	-	-	
	土地	-	-	-	
	その他	-	-	-	

ヘ その他の特定資産の売買の状況 (単位：百万円)

区分	売付	買付	合計	備考
	-	-	-	

ト 金融商品取引行為の相手方の状況

相手方	取引額	備考
シュローダー・インベストメント・マネジメント (ヨーロッパ) エス・エイ (関係外国法人等)	7,923,029,062	投資信託売買
UBS証券	332,393,998,005	外国先物取引、外国株式売買

⑤ 投資信託、外国投資信託及び投資法人運用資産一覧表

イ 投資信託

投資信託名	設定年月日	信託期間	当初設定額 (百万円)	純資産総額 (百万円)	特定資産組入比率		基準価格 (円)	過去1年間の収益込み基準価格の騰落率 (%)	設定年平均受利益回り (%)	備考
					特定資産	比率 (%)				
単位型株式投 シュローダー米国投資適格社債ファ	2023年3月13日	5年02ヶ月	10,000	9,899	有価証券	93.34%	9,900		△ 0.53	シュローダー・インベスト

投資信託名	設定年月日	信託期間	当初設定額 (百万円)	純資産総額 (百万円)	特定資産組入比率		基準価格 (円)	過去1年間の収益込み基準価格の騰落率 (%)	設定年平均受益者利回り (%)	備考
					特定資産	比率 (%)				
資信託	ンド2023-03 (適格機関投資家専用)									ト・マネジ メント・ノース リカ・イク 設定来1 年未滿
単位型 株式投 資信託	シュローダー日本 株バリューアッ プ・ファンド2023- 06 (適格機関投資 家専用)	2023年6 月12日	10年08ヵ 月	5,000	5,203	有価 証券 証券	98.92%	10,407	9.19	設定来1 年未滿
単位型 株式投 資信託	シュローダー日本 株バリューアッ プ・ファンド2023- 10 (適格機関投資 家専用)	2023年10 月12日	10年04ヵ 月	3,000	3,022	有価 証券	49.93%	10,073	3.38	設定来1 年未滿
追加型 株式投 資信託	シュローダー日本ファンド	1998年2 月27日	無期限	1,485	4,461	有価 証券	100.10	26,060	26.73	
追加型 株式投 資信託	シュローダー日本株式ホ ブ	1998年12 月1日	無期限	1,200	512	有価 証券	98.82	20,089	19.91	
追加型 株式投 資信託	シュローダーPF日本債 券ファンド (適格機関 投資家向け)	1999年5 月19日	無期限	200	4,285	有価 証券	96.11	14,737	0.93	
追加型 株式投 資信託	シュローダーDCアクティブ 日本株式	2001年11 月1日	無期限	1	3,857	有価 証券	98.92	22,316	19.92	
追加型 株式投 資信託	シュローダーDCアクティブ 外国株式	2001年11 月1日	無期限	1	9,008	有価 証券	98.74	42,997	32.43	
追加型 株式投 資信託	シュローダー年金運用フ ント日本株式	2001年11 月1日	無期限	1	13,915	有価 証券	99.33	22,881	20.08	
追加型 株式投 資信託	シュローダー年金運用フ ント日本債券	2001年11 月1日	無期限	1	11,770	有価 証券	96.19	12,604	0.36	

投資信託名	設定年月日	信託期間	当初設定額 (百万円)	純資産総額 (百万円)	特定資産組入比率		基準価格 (円)	過去1年間の収益込み基準価格の騰落率 (%)	設定年平均受益者利回り (%)	備考
					特定資産	比率 (%)				
追加型 株式投資信託	シュローダー-日本ファンド [®] (確定拠出年金向け)	2001年11月22日	無期限	1	19,854	有価証券	100.02	40,876	26.99	
追加型 株式投資信託	シュローダー-日本ファンド [®] VA (適格機関投資家専用)	2002年6月27日	無期限	1	29,055	有価証券	99.84	50,723	27.63	
追加型 株式投資信託	シュローダー-日本株式オプションVA (適格機関投資家専用)	2002年9月30日	無期限	0	256	有価証券	98.76	29,810	20.49	
追加型 株式投資信託	日興・シュローダー-日本株ハブ・リユアアップ・ファンド [®] (適格機関投資家専用)	2005年6月30日	19年08ヶ月	3,000	14,521	有価証券	99.24	21,804	29.86	
追加型 株式投資信託	シュローダー・マイクロ日本株ファンド [®] (適格機関投資家専用)	2005年10月12日	19年10ヶ月	300	2,381	有価証券	98.51	35,543	19.42	
追加型 株式投資信託	シュローダー- BRICS 株式ファンド [®]	2006年1月31日	無期限	3,328	7,782	有価証券	97.63	6,815	△1.08	
追加型 株式投資信託	シュローダー-日本ファンド [®] (野村SMA向け)	2006年4月7日	無期限	1	6,226	有価証券	99.85	28,543	27.60	
追加型 株式投資信託	シュローダー・グローバル・エマージング株式ファンド [®] F (適格機関投資家専用)	2007年3月29日	無期限	607	12,417	有価証券	97.67	16,148	15.68	
追加型 株式投資信託	シュローダー・エマージング株式ファンド [®] (3ヶ月決算型)	2007年4月27日	無期限	741	276	有価証券	97.86	10,435	14.39	
追加型 株式投資信託	シュローダー・エマージング株式ファンド [®] (1年決算型)	2007年4月27日	無期限	577	11,561	有価証券	97.85	15,823	14.53	
追加型 株式投資信託	シュローダー・ラテンアメリカ株投資	2007年9月27日	20年00ヶ月	49,465	4,432	有価証券	98.68	11,211	34.59	
追加型	シュローダー-厳選グロー	2010年5	17年09ヶ月	3,816	414	有価	97.29	30,290	17.80	

投資信託名	設定年月日	信託期間	当初設定額 (百万円)	純資産総額 (百万円)	特定資産組入比率		基準価格 (円)	過去1年間の収益込み基準価格の騰落率 (%)	設定年平均受益者利回り (%)	備考
					特定資産	比率 (%)				
株式投資信託	ス・ジャパン	月 28 日	月			証券				
追加型株式投資信託	シュローダー・日本ファンド PF ホブチエティ (適格機関投資家専用)	2012 年 10 月 24 日	19 年 10 月	650	2,843	有価証券	99.53	50,376	28.60	
追加型株式投資信託	シュローダー・インカムセツト・アロケーション (毎月決算型)A コース (為替ヘッジなし)	2013 年 6 月 4 日	20 年 00 月	1	2,539	有価証券	97.56	7,353	18.41	
追加型株式投資信託	シュローダー・インカムセツト・アロケーション (毎月決算型)B コース (為替ヘッジあり)	2013 年 6 月 4 日	20 年 00 月	1	110	有価証券	94.17	5,738	5.35	
追加型株式投資信託	シュローダー・インカムセツト・アロケーション (1 年決算型)A コース (為替ヘッジなし)	2013 年 8 月 13 日	19 年 10 月	1	468	有価証券	97.56	17,896	18.98	
追加型株式投資信託	シュローダー・インカムセツト・アロケーション (1 年決算型)B コース (為替ヘッジあり)	2013 年 8 月 13 日	19 年 10 月	1	202	有価証券	94.10	10,328	5.88	
追加型株式投資信託	シュローダー・PF 日本小型株ファンド (適格機関投資家専用)	2014 年 9 月 25 日	10 年 00 月	1,750	4,438	有価証券	97.68	23,979	18.17	
追加型株式投資信託	シュローダー日本ファンド (野村 S MA・EW 向け)	2015 年 3 月 12 日	無期限	1	11,329	有価証券	99.57	20,108	27.71	
追加型株式投資信託	シュローダー・ユーロ株式ファンド 為替リスク軽減型	2015 年 6 月 8 日	10 年 00 月	1	264	有価証券	95.84	9,881	1.43	
追加型株式投資信託	シュローダー・ユーロ株式ファンド 為替ヘッジなし	2015 年 6 月 8 日	10 年 00 月	1	179	有価証券	98.22	11,818	16.48	
追加型株式投資信託	シュローダー・ユーロ株式ファンド 米ドル投資型	2015 年 6 月 8 日	10 年 00 月	1	739	有価証券	97.01	12,845	14.82	

投資信託名	設定年月日	信託期間	当初設定額 (百万円)	純資産総額 (百万円)	特定資産組入比率		基準価格 (円)	過去1年間の収益込み基準価格の騰落率 (%)	設定年平均受益者利回り (%)	備考
					特定資産	比率 (%)				
追加型 株式投資信託	シュローダー・アジアパシフィックESGフォーカス・ファンド(資産成長型)	2016年6月30日	10年00ヶ月	9,509	1,472	有価証券	97.14	20,824	12.32	
追加型 株式投資信託	シュローダー・マルチアセット・ファンド(適格機関投資家専用)	2016年12月9日	10年00ヶ月	25,000	48,731	有価証券	76.27	9,769	1.65	シュローダー・インベストメント・マネージメント(香港)リミテッド
追加型 株式投資信託	シュローダー先進外国国株式ファンド(適格機関投資家専用)	2016年12月20日	10年00ヶ月	0	18,328	有価証券	98.52	26,112	33.66	
追加型 株式投資信託	シュローダーYENターゲット(年2回決算型)	2017年4月5日	無期限	557	430	有価証券	83.50	9,578	1.90	
追加型 株式投資信託	シュローダーYENターゲット(1年決算型)	2017年4月5日	無期限	557	683	有価証券	83.50	10,209	1.90	
追加型 株式投資信託	シュローダー・ユーロ・エクイティ・ファンド 為替リスク軽減型	2018年1月22日	9年11ヶ月	1	84	有価証券	95.93	9,618	1.22	
追加型 株式投資信託	シュローダー・ユーロ・エクイティ・ファンド 為替ヘッジなし	2018年1月22日	9年11ヶ月	1	463	有価証券	98.22	10,987	16.49	
追加型 株式投資信託	シュローダー・グローバルCBファンド(少人数私募) 為替ヘッジあり	2019年7月1日	9年10ヶ月	522	1,389	有価証券	93.67	9,755	1.57	
追加型 株式投資信託	シュローダー・グローバルCBファンド(少人数私募)	2019年7月1日	9年10ヶ月	518	2,062	有価証券	96.48	13,370	13.71	

投資信託名	設定年月日	信託期間	当初設定額 (百万円)	純資産総額 (百万円)	特定資産組入比率		基準価格 (円)	過去1年間の収益込み基準価格の騰落率 (%)	設定年平均受益者利回り (%)	備考
					特定資産	比率 (%)				
	為替ヘッジなし									
追加型 株式投資信託	シュローダー日本株 ESG フォークス・ファンド	2019年 7月26日	9年11ヶ月	1	30	有価証券	99.63	16,215	22.17	
追加型 株式投資信託	2020 シュローダー・マルチアセット・ストラテジー・ファンド (適格機関投資家専用)	2020年6月22日	9年11ヶ月	5,000	26,285	有価証券	63.47	8,959	0.62	
追加型 株式投資信託	シュローダー先進国好利回りCBファンド2020-07 (限定追加型)	2020年7月28日	5年00ヶ月	16,701	8,731	有価証券	95.53	11,512	2.96	シュローダー・インベストメント・マネージメント(スイス)AG
追加型 株式投資信託	シュローダー・マルチアセット・ターゲット・ファンド (少人数私募)	2020年10月13日	10年02ヶ月	0	3,077	有価証券	83.33	9,789	2.53	
追加型 株式投資信託	シュローダー・マルチアセット・ストラテジー・ファンド (適格機関投資家専用)	2021年1月28日	10年04ヶ月	0	8,511	有価証券	63.48	8,938	0.51	
追加型 株式投資信託	シュローダー・アジアパシフィック ESG フォークス・ファンド (予想分配金提示型)	2021年2月25日	10年04ヶ月	1	94	有価証券	97.18	10,344	12.38	
追加型 株式投資信託	シュローダー・グローバル・リート ESG フォークス・ファンド (予想分配金提示型)	2021年5月25日	10年04ヶ月	309	5,997	有価証券	98.40	10,516	17.33	
追加型 株式投資	シュローダー・グローバル・リート	2021年5月25日	10年04ヶ月	658	14,195	有価証券	98.81	11,163	17.39	

投資信託名	設定年月日	信託期間	当初設定額 (百万円)	純資産総額 (百万円)	特定資産組入比率		基準価格 (円)	過去1年間の収益込み基準価格の騰落率 (%)	設定年平均受益者利回り (%)	備考	
					特定資産	比率 (%)					
資信託	ESGフォーカス・ファンド(資産成長型)										
追加型株式投資信託	シュローダー先進国債券ファンド 2021-07 (限定追加型)	2021年7月12日	5年01ヶ月	6,527	9,042	有価証券	123.40	10,274	2.84		シュローダー・インベストメント・マネジメント・ノースアトランタ
追加型株式投資信託	シュローダー先進国好利回りCBファンド 2022-12 (適格機関投資家専用)	2022年12月12日	5年00ヶ月	7,682	14,073	有価証券	111.37	10,557	6.06		シュローダー・インベストメント・マネジメント(スイス)AG
追加型株式投資信託	シュローダー・ツリーシグマ・ダイバーシファイド・ファンド	2022年12月15日	9年11ヶ月	379	1,264	有価証券	95.95	11,456	19.25		
追加型株式投資信託	シュローダー日本ファンド (適格機関投資家専用)	2022年12月16日	10年02ヶ月	1	1,234	有価証券	99.79	12,486	27.74		
追加型株式投資信託	シュローダー先進国好利回りCBファンド 2023-02 (適格機関投資家専用)	2023年2月28日	5年00ヶ月	14,897	24,592	有価証券	107.76	10,141	-		シュローダー・インベストメント・マネジメント(スイス)AG 設定来1年未満
親投資信託	日本株式マサ・ファンド	1998年12月1日	無期限	1,200	4,639	有価証券	98.64	35,192	21.83		
親投資信託	PF 日本株式マサ・ファンド	1999年4月6日	無期限	1,650	13,956	有価証券	99.04	29,404	22.05		
親投資信託	PF 日本債券マサ・ファンド	1999年5月19日	無期限	200	16,072	有価証券	96.08	15,155	1.06		マニライフ・アセット・マネジメント株式会社
親投資	外国株式マサ・ファンド	2000年7	無期限	202	27,381	有価	98.43	49,574	34.77		シュローダー・

投資信託名	設定年月日	信託期間	当初設定額 (百万円)	純資産総額 (百万円)	特定資産組入比率		基準価格 (円)	過去1年間の収益込み基準価格の騰落率 (%)	設定年平均受益者利回り (%)	備考	
					特定資産	比率 (%)					
信託		月7日				証券					インベストメント・マネジメント・リミテッド
親投資信託	日本マザーファンド	2001年6月8日	無期限	670	75,259	有価証券	99.51	46,673	28.67		
親投資信託	日本株ハブ・リュアップ・マザーファンド	2005年6月30日	無期限	3,000	21,313	有価証券	99.85	46,589	31.72		
親投資信託	シュローダー・マイクロ日本株マザーファンド	2005年10月12日	無期限	300	2,403	有価証券	97.61	74,983	22.78		
親投資信託	シュローダー・グローバル・エマージェンシズ株式マザーファンド	2005年11月30日	無期限	24,990	24,293	有価証券	97.60	33,405	16.86		シュローダー・インベストメント・マネジメント・リミテッド
親投資信託	シュローダー・BRICs 株式マザーファンド	2006年1月31日	無期限	3,328	7,810	有価証券	97.28	26,644	0.79		シュローダー・インベストメント・マネジメント・リミテッド
親投資信託	シュローダー・ラテンアメリカ株マザーファンド	2007年9月27日	無期限	49,465	4,453	有価証券	98.20	15,905	37.50		シュローダー・インベストメント・マネジメント・リミテッド
親投資信託	シュローダー・厳選グローバル・アジア・マザーファンド	2010年5月28日	無期限	3,816	416	有価証券	96.81	47,484	19.71		
親投資信託	インカムアセット・アロケーション・マザーファンド	2013年6月4日	無期限	2	3,312	有価証券	97.46	20,021	20.73		
親投資信託	シュローダー・日本小型株マザーファンド	2014年9月25日	無期限	1,750	4,439	有価証券	97.67	24,051	18.22		
親投資信託	シュローダー・ユーロ株式マザーファンド (ユーロ)	2015年6月8日	無期限	2	984	有価証券	98.13	16,722	18.67		
親投資	シュローダー・ユ	2015年6	無期限	1	740	有価	96.93	19,114	16.86		

投資信託名	設定年月日	信託期間	当初設定額 (百万円)	純資産総額 (百万円)	特定資産組入比率		基準価格 (円)	過去1年間の収益込み基準価格の騰落率 (%)	設定年平均受益者利回り (%)	備考	
					特定資産	比率 (%)					
信託	一ロ株式マザーファンド(米ドル)	月8日			証券						
親投資信託	アジアパシフィック(除く日本)株式サステナブルマザーファンド	2016年6月30日	無期限	5,662	1,020	有価証券	95.76	23,191	9.82		シュローダー・インベストメント・マネージメント(香港)リミテッド
親投資信託	シュローダー日本株式サステナブル投資マザーファンド	2016年6月30日	無期限	3,847	577	有価証券	99.60	24,943	23.78		
親投資信託	シュローダーYENターゲット・マザーファンド	2017年4月5日	無期限	1,115	4,196	有価証券	83.29	11,094	3.17		シュローダー・インベストメント・マネージメント(香港)リミテッド
親投資信託	シュローダー・グローバルCBマザーファンド	2019年7月1日	無期限	1,040	3,414	有価証券	96.41	13,708	14.34		シュローダー・インベストメント・マネージメント(スイス)AG
親投資信託	シュローダー・マルチアセット・ストラテジー・マザーファンド	2020年6月22日	無期限	5,000	34,818	有価証券	63.43	10,027	1.19		シュローダー・インベストメント・マネージメント(香港)リミテッド
親投資信託	シュローダー・グローバル・リートESGフォーカス・マザーファンド	2021年5月25日	無期限	967	20,262	有価証券	98.35	11,679	19.40		
親投資信託	シュローダー・ツースigma・ダイバ	2022年12月15日	無期限	379	1,265	有価証券	95.86	11,539	20.08		

投資信託名	設定年月日	信託期間	当初設定額 (百万円)	純資産総額 (百万円)	特定資産組入比率		基準価格 (円)	過去1年間の収益込み基準価格の騰落率 (%)	設定年平均受益者利回り (%)	備考
					特定資産	比率 (%)				
ーシファイド・マザーファンド										

ロ 外国投資信託 (該当事項なし)

ハ 投資法人 (該当事項なし)

⑥ 委託者報酬及び運用受託報酬 6,586 百万円

⑦ 自己又は関係会社が発行・設定する有価証券の組入れ状況

運用財産総額	うち自己発行有価証券	うち関係会社発行有価証券	うち自己設定投資信託の受益証券等	うち関係会社設定投資信託の受益証券等
400,067 百万円	- 百万円	- 百万円	0 百万円	31,274 百万円
割合	-%	-%	0.0%	7.8%

⑧ 運用財産のファンドへの投資の状況

投資先ファンドの種類	価額の算出者	ファンド関係者における関係会社の名称等
外国籍会社型投資信託	J. P. モルガン・エスイー、ルクセンブルグ支店	シュローダー・インベストメント・マネージメント（ヨーロッパ）エス・エイ（管理会社、関係外国法人等に該当）
外国籍会社型投資信託	ブラウン・ブラザーズ・ハリマン（ルクセンブルグ）エス・シー・エイ	シュローダー・インベストメント・マネージメント（ヨーロッパ）エス・エイ（管理会社、関係外国法人等に該当）

⑨ 運用財産の投資対象の時価に係る情報

イ 時価を把握することが困難である投資対象

運用財産が保有する投資対象の区分	投資対象の保有額 (百万円)	左記のうち時価を把握することが困難である投資対象の保有額 (百万円)	割合 (%)

株式	219,144	-	-
公社債券	138,321	-	-
受益証券	6,639	-	-
信託受益権	-	-	-
その他の有価証券	-	-	-
その他の資産 (現金・預金を含む。)	35,962	-	-
全体	400,067	-	-

ロ 時価を把握することが困難である理由

(該当なし)

(22) 法第2条第8項第15号に掲げる行為に係る業務の状況

- ① 設定及び償還の状況 (該当事項なし)
- ② ファンドの保有資産の売買等の状況 (該当事項なし)
- ③ 運用するファンド一覧表 (該当事項なし)
- ④ 運用受託報酬その他の法第2条第8項第15号に掲げる行為に係る報酬 (該当事項なし)
- ⑤ 自己又は関係会社が発行・設定する有価証券の組入れ状況 (該当事項なし)
- ⑥ 運用財産のファンドへの投資の状況 (該当事項なし)
- ⑦ 運用財産の投資対象の時価に係る情報 (該当事項なし)

(23) 適格投資家向け投資運用業等の状況

- ① 運用財産の状況 (該当事項なし)
- ② 顧客の状況 (該当事項なし)
- ③ 法第29条の5第2項の規定により第二種金融商品取引業とみなされる業務の状況 (該当事項なし)

(24) 投資助言業務の状況

① 契約件数等

投資顧問契約 (投資一任契約を除く)		うち、顧客の資産の額を前提とした契約	
投資家の区分	契約件数 (件)	契約件数 (件)	資産総額 (百万円)
適格機関投資家	1	1	40,977

適格機関投資家以外の者	19	19	105,464
うち個人	0	0	0
合計	20	20	146,441

② 助言を行った有価証券及びデリバティブ取引に係る権利の種類等

投資者の区分	助言を行った有価証券及びデリバティブ取引に係る権利の種類等
適格機関投資家	有価証券及び権利の種類等：外国投資証券（2条1項11号） 助言の方法：書面 ※経済的利益を直接又は間接に受領していない。
適格機関投資家以外の者	有価証券及び権利の種類等：株券（2条1項9号） 助言の方法：システム ※経済的利益を直接又は間接に受領していない。

③助言を行った主な有価証券の内容

名称	発行者等
SCHRODER ISF GLOBAL DIVIDEND MAXIMISER JPY CLASS J DISTRIBUTION (ルクセンブルグ)	発行者： シュローダー・インベストメント・マネージメント (ヨーロッパ) エス・エー (ルクセンブルグ) 運用会社： シュローダー・インベストメント・マネージメント・ リミテッド (英国) 管理会社： シュローダー・インベストメント・マネージメント (ヨーロッパ) エス・エー (ルクセンブルグ)

④ 内部管理の状況

<p><内部管理体制></p> <p>弊社の内部管理部門であるコンプライアンス部、法務部及びリスク管理部は各部門から独立して組織されており、それぞれ直接担当役員に報告する体制となっている。全社的なコンプライアンスやリスク管理上の諸事項は、取締役会もしくは経営会議から権限を委譲されて組織された、コンプライアンスコミッティおよびリスクコミッティで検討され、必要な対応はそれらのコミッティで決定される。</p> <p>各部の業務は以下の通りである。</p> <ul style="list-style-type: none"> ● コンプライアンス部 コンプライアンス部の主な役割は、業務運営が規制上の要件に沿って行われることを確保することであり、各業務に対してコンプライアンス上の助言を提供し、またコンプライアンス遵守状況のモニタリングを行っている。

コンプライアンス上の助言については、各種コンプライアンス・ポリシー等の策定・維持も重要な任務であり、これらポリシーや手続き等の遵守の徹底のために役職員への研修も行っている。

モニタリング業務においては、コンプライアンス機能が適正に働いているか確認するために、コンプライアンス・モニタリング・プログラムを策定し実施している。当該プログラムにおいては、モニタリングの対象に関連するリスクに応じて日次、四半期、半年次、年次、随時などの頻度で、またテーマ別のモニタリングも行っている。

- 法務部

法務部の主な責任は、弊社が不必要なリーガル・リスクにさらされないように監督することである。そのために、関連する法令・関連諸規則などについての最新かつ十分な知識・情報入手し、社内に法的アドバイスを提供している。また、契約書の作成やレビューを通じて、契約上必要な条件を確保したり、契約違反による損害リスクを低減させたり、紛争リスクを避けるための法的アドバイスを提供している。コンプライアンスに対して法的側面からの支援も提供する。

- リスク管理部

リスク管理部の主な役割は、業務リスクおよび運用リスクを含む会社の業務全般のリスク管理を行うことである。特にオペレーショナル・リスクの管理については、違反行為・エラー&オMISSIONの取扱い、内部監査の指摘事項の改善計画の実施状況の確認等を行っている。その他、リスク管理体制の検証および改善策の提案・実施を行うと共に、リスク管理に関する社員への啓蒙・教育活動を行い堅牢な体制の構築・維持に努めている。

<内部監査>

グループ統括会社の内部監査部が定期的に弊社を訪問し、各部門・業務に対する監査を行っている。

<外部監査>

会計監査並びに投信法に基づく投信ファンド監査、シュローダー・グループの財務諸表監査および諸手続きの監査、グローバル投資パフォーマンス基準（GIPS）準拠の検証、投資一任契約に係る資産運用管理業務に係る内部統制についての検証が、各々監査法人により定期的実施されている。

<情報管理>

内部者取引（インサイダー取引）の未然防止

以下の文言を織り込んだ社内規程を整備し、法令遵守を確保している。

1. 当社は金融商品取引法その他の法令等を遵守し、インサイダー取引の未然防止に努める。
2. 当社は、投資運用業又は投資助言・代理業に係る情報収集活動、契約締結等に際しては、顧客等にインサイダー取引規制の意義と内容について、十分理解させるよう努める。
3. 当社は、未公表の金融商品取引法第 166 条に定める重要事実、金融商品取引業等に関する内閣府令第 1 条第 4 項第 14 号に定める法人関係情報、高蓋然性情報及び示唆情報（以下これらを総称して MNPI 等という。）を知りうる可能性のある者に対し、当該情報を提供

するよう働きかけをしてはならない。

4. 当社は、有価証券等の取引に係る発注の相手方の評価・選択にあたって、MNPI 等又はそれに該当するおそれのある情報の提供の有無、内容を考慮してはならない。
5. 当社の役職員は、有価証券等の取引に係る発注の相手方の役職員から社会通念上妥当な範囲を超えた接待や金銭・物品の供与等を受けてはならない。
6. 当社は、プライベート部門（恒常的に MNPI 等を取得することが想定される部門をいう。）とパブリック部門（プライベート部門以外の部門をいう。）との間に、チェーンズウォール（情報管理のための組織上、物理上又はシステム上の障壁をいう。）を構築する。

MNPI 等の管理

1. MNPI 等を入手した場合

- その情報を利用していかなる取引も行わない。
- その情報を他人に提供しない（所定の報告手続を除く）。

2. 社内での報告手続き

- (1) 役職員は、MNPI 等を取得した場合、あるいは自らの有する情報が MNPI 等となる疑いがある場合には、直ちにその情報を情報管理責任者に報告するものとする。
- (2) 上記の報告を行う場合、正確に記録を残すため、所定の「内部情報の取得報告」の様式を使用し、書面で情報管理責任者に提出する。
- (3) 当該役職員は、当該 MNPI 等に基づく有価証券の取引を行ったり、また情報管理責任者が認めるときあるいはその情報が発表されて公開情報になったときを除き、第三者にその情報を漏らすことは禁じられている。

⑤ 投資助言報酬 623 百万円

(25) 代理・媒介業務の状況

① 代理・媒介を行う金融商品取引業者等 (該当事項なし)

② 投資顧問契約又は投資一任契約の締結の代理・媒介の状況 (該当事項なし)

③ 代理・媒介手数料の状況 (該当事項なし)

④ 内部管理の状況

<内部管理体制>

弊社の内部管理部門であるコンプライアンス部、法務及びリスク管理部は各部門から独立して組織されており、それぞれ、直接担当役員に報告する体制となっている。全社的なコンプライアンスやリスク管理上の諸事項は、取締役会もしくは経営会議から権限を委譲されて組織された、コンプライアンスコミッティおよびリスクコミッティで検討され、必要な対応はそれらのコミッティで決定される。

各部の業務は以下の通りである。

- **コンプライアンス部**

コンプライアンス部の主な役割は、業務運営が規制上の要件に沿って行われることを確保することであり、各業務に対してコンプライアンス上の助言を提供し、またコンプライアンス遵守状況のモニタリングを行っている。

コンプライアンス上の助言については、各種コンプライアンス・ポリシー等の策定・維持も重要な任務であり、これらポリシーや手続き等の遵守の徹底のために役職員への研修も行っている。

モニタリング業務においては、コンプライアンス機能が適正に働いているか確認するために、コンプライアンス・モニタリング・プログラムを策定し実施している。当該プログラムにおいては、モニタリングの対象に関連するリスクに応じて日次、四半期、半年次、年次、随時などの頻度で、またテーマ別のモニタリングも行っている。

- **法務部**

法務部の主な責任は、弊社が不必要なリーガル・リスクにさらされないように監督することである。そのために、関連する法令・関連諸規則などについての最新かつ十分な知識・情報を入手し、社内に法的アドバイスを提供している。また、契約書の作成やレビューを通じて、契約上必要な条件を確保したり、契約違反による損害リスクを低減させたり、紛争リスクを避けるための法的アドバイスを提供している。コンプライアンスに対して法的側面からの支援も提供する。

- **リスク管理部**

リスク管理部の主な役割は、業務リスクおよび運用リスクを含む会社の業務全般のリスク管理を行うことである。特にオペレーショナル・リスクの管理については、違反行為・エラー&オMISSIONの取扱い、内部監査の指摘事項の改善計画の実施状況の確認等を行っている。その他、リスク管理体制の検証および改善策の提案・実施を行うと共に、リスク管理に関する社員への啓蒙・教育活動を行い堅牢な体制の構築・維持に努めている。

<内部監査>

グループ統括会社の内部監査部が定期的に弊社を訪問し、各部門・業務に対する監査を行っている。

<外部監査>

会計監査並びに投信法に基づく投信ファンド監査、シュローダー・グループの財務諸表監査および諸手続きの監査、グローバル投資パフォーマンス基準（GIPS）準拠の検証、投資一任契約に係る資産運用管理業務に係る内部統制についての検証が、各々監査法人により定期的実施されている。

<情報管理>

内部者取引（インサイダー取引）の未然防止

以下の文言を織り込んだ社内規程を整備し、法令遵守を確保している。

1. 当社は金融商品取引法その他の法令等を遵守し、インサイダー取引の未然防止に努める。
2. 当社は、投資運用業又は投資助言・代理業に係る情報収集活動、契約締結等に際しては、顧客等にインサイダー取引規制の意義と内容について、十分理解させるよう努める。
3. 当社は、未公表の金融商品取引法第 166 条に定める重要事実、金融商品取引業等に関する内閣府令第 1 条第 4 項第 14 号に定める法人関係情報、高蓋然性情報及び示唆情報（以下これらを総称して MNPI 等という。）を知りうる可能性のある者に対し、当該情報を提供するよう働きかけをしてはならない。
4. 当社は、有価証券等の取引に係る発注の相手方の評価・選択にあたって、MNPI 等又はそれに該当するおそれのある情報の提供の有無、内容を考慮してはならない。
5. 当社の役職員は、有価証券等の取引に係る発注の相手方の役職員から社会通念上妥当な範囲を超えた接待や金銭・物品の供与等を受けてはならない。
6. 当社は、プライベート部門（恒常的に MNPI 等を取得することが想定される部門をいう。）とパブリック部門（プライベート部門以外の部門をいう。）との間に、チャイニーウォール（情報管理のための組織上、物理上又はシステム上の障壁をいう。）を構築する。

MNPI 等の管理

1. MNPI 等入手した場合
 - その情報を利用していかなる取引も行わない。
 - その情報を他人に提供しない（所定の報告手続を除く）。
2. 社内での報告手続き
 - (1) 役職員は、MNPI 等を取得した場合、あるいは自らの有する情報が MNPI 等となる疑いがある場合には、直ちにその情報を情報管理責任者に報告するものとする。
 - (2) 上記の報告を行う場合、正確に記録を残すため、所定の「内部情報の取得報告」の様式を使用し、書面で情報管理責任者に提出する。
 - (3) 当該役職員は、当該 MNPI 等に基づく有価証券の取引を行ったり、また情報管理責任者が認めるときあるいはその情報が発表されて公開情報になったときを除き、第三者にその情報を漏らすことは禁じられている。
3. 情報管理責任者

当社における MNPI 等に関する情報管理責任者は、コンプライアンス部長とする。情報管理責任者は、役職員から MNPI 等の報告を受けたときは、当該情報が重要な情報を含む MNPI 等にあたるかどうかを判断し、当該役職員に対し当該情報の管理等に対し必要な指示を与える。情報管理責任者が行った判断については、その理由等を含めた判断の事跡を「内部情報の取得報告」により、適切に記録・保管する。
4. 重要情報を含む MNPI 等を取得したと判断された場合

情報管理責任者は、重要な情報を含む MNPI 等を取得したと判断した場合、当社および当社グループが運用する顧客資産、役職員の個人取引における当該銘柄の売買を必要な範囲で停止する。

その後、MNPI 等が公表されたことを確認した場合には、上記の売買停止措置を解除する。以上の措置について、措置が実施された日時等を記録し、所定の方法で保存する。

<顧客情報の管理>

当社は、顧客情報を含めた当社の情報セキュリティを確保するため、情報セキュリティ・ポリシー及びサービス規程などで、事前に許可のないもしくは個人的な顧客情報の利用を禁じている。

<利益相反防止管理態勢>

(1) 利益相反管理統括部署・責任者の設置

- ・ 当社のコンプライアンス部を利益相反管理統括部署として数名を配置し、その長を利益相反管理統括責任者としています。同部は運用部門・営業部門からの独立性を保證され、具体的な案件の処理について運用部門・営業部門から指揮命令を受けることはない。
- ・ 利益相反管理統括部署は、利益相反のおそれのある取引の特定及び利益相反管理に関する全社的な管理体制を統括する。

(2) 利益相反管理統括部署の職責

利益相反管理統括部署は、業務担当部署から独立した立場で以下の職責を担う。

- ・ 対象取引を特定するとともに、対象取引に関する適切な利益相反管理の実施を当社の業務担当部署に対して指示する。
- ・ 定期的に又はその都度対象取引の利益相反管理状況等の報告を受け、適切な管理が行われているかを検証し、新規業務を開始するとき、親子法人等が新たに増えるとき等必要に応じて、利益相反管理に係る手続や利益相反管理体制の見直しを行う。
- ・ お客様の利益が不当に害されるおそれがある場合は、必要に応じて、当社の業務担当部署に対する適切な利益相反管理の実施指示、対象取引の見直し等を行う。
- ・ 当社の役職員に対し、本方針及び利益相反規程を踏まえた利益相反の管理について研修を定期的実施し、利益相反のおそれのある取引の管理について周知徹底する。

(3) 記録・保存

利益相反のおそれのある取引の特定及び管理方法の選定を行った場合、それぞれの具体例ごとに定められた記録の保存方法にしたがって、利益相反管理統括部署を含む各担当部門においてその措置について記録し、作成の日から5年間保存するものとする。

<兼業業務における優位的地位の濫用を防止するための態勢>

当社は投資運用業を主たる業務とする金融商品取引業者であり、顧客に対し優位的地位に立つ兼業業務（他業）を行う立場になく、かつそのような兼業業務の承認申請を行うことも企図していない。なお、当社が行う業務間における利益相反防止に関しては、当社のサービス規程において次のように規定し、管理している。

業務間における利益相反の防止

(利益相反の防止)

1. 役職員は、当社が行う投資助言・代理業、投資一任契約に係る業務、投資信託委託業に係る業務、第二種金融商品取引業、金融商品取引業に付随する業務及び情報提供

業務もしくはサービス提供業務等の承認業務（以上の各業務すべてについて以下「当社業務」という。）のいずれかを遂行する際には、当該業務とそれ以外の当社業務との間に利益相反が発生しないよう、関係法令及び当社の社内規程等を遵守するものとする。

2. 役職員のうち、当社業務のいずれかを遂行するものは、他の当社業務の遂行状況に合わせて、当該業務についての遂行状況をも遅滞なく上司に報告しなければならない。

3. 上司は、当社業務のいずれかの間で利益相反となりうる事象を発見した場合には、ただちにコンプライアンス部長及び代表取締役等に報告し、その対応につき協議しなければならないものとする。

(26) 高速取引行為に係る業務の状況

① 有価証券の売買の状況

(該当事項なし)

② 市場デリバティブ取引の状況

(該当事項なし)

2 経理の状況

(1) 貸借対照表

(2023年12月31日現在)

(単位：千円)

(3)株主資本等変動計算書

(単位：千円)

	株主資本								自己株式	株主資本 合計	評価・換算差額等				新株予約 権	純資産合 計
	資本金	資本剰余金			利益剰余金			利益剰余 金合計			その他有 価証券評 価差額金	繰越ヘッ ジ損益	土地再評 価差額金	評価・換 算差額等 合計		
		資本準備 金	その他資 本剰余金	資本剰余 金合計	利益準備 金	その他利益剰余金										
						××積立 金	繰越利益 剰余金									
当期末首残高	490,000	500,000		500,000			1,077,100	1,077,100		2,067,100	△ 94			△ 94		2,067,006
当期変動額																
新株の発行																
剰余金の配当																
当期純利益							184,818	184,818		184,818						184,818
自己株式の処分																
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）											164			164		164
当期変動額合計							184,818	184,818		184,818	164			164		184,983
当期末残高	490,000	500,000		500,000			1,261,918	1,261,918		2,251,918	70			70		2,251,989

注記事項

貸借対照表関係

1 有形固定資産の減価償却累計額

建物附属設備	173,078 千円
器具備品	125,345 千円

2 関係会社項目

その他未払金	19,184 千円
長期未払金	188,816 千円

損益計算書関係

1 関係会社項目

関係会社との取引に係るものが次のとおり含まれております。

一般管理費	75,534 千円
-------	-----------

株主資本等変動計算書関係

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

	期首株式数	増加株式数	減少株式数	期末株式数
発行済株式				
普通株式	9,800株	-	-	9,800株
合計	9,800株	-	-	9,800株