

2024. 4. 20

九州SDGs・グローバルバランス

愛称「九州コンチェルト」

追加型投信／内外／資産複合

◆この目論見書により行なう「九州SDGs・グローバルバランス」の募集については、委託会社は、金融商品取引法第5条の規定により有価証券届出書を2024年4月19日に関東財務局長に提出しており、2024年4月20日にその効力が発生しております。

有価証券届出書提出日 : 2024年4月19日
発行者名 : リそな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 西山 明宏
本店の所在の場所 : 東京都江東区木場一丁目5番65号
有価証券届出書（訂正届出書を含みます。） : 該当事項はありません。
の写しを縦覧に供する場所

リそなアセットマネジメント 株式会社

投資信託は、金融機関の預金や保険契約とは商品性が異なります。

- 投資信託は、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。
また、銀行など登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金の支払いの対象とはなりません。
- 投資信託は、元金および利回り保証のいずれもありません。
- 投資信託をご購入されたお客様は、投資した資産の価値の減少を含むリスクを負います。

－ 目 次 －

	頁
第一部【証券情報】	1
第二部【ファンド情報】	3
第1【ファンドの状況】	3
第2【管理及び運営】	65
第3【ファンドの経理状況】	70
第4【内国投資信託受益証券事務の概要】	246
第三部【委託会社等の情報】	247
約款	280

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

九州SDGs・グローバルバランス（以下「ファンド」といいます。）
・愛称として「九州コンチェルト」という名称を用いることがあります。

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

- ・追加型証券投資信託受益権です。（以下「受益権」といいます。）
 - ・信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付、または信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。
- ※ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後述の「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社債、株式等の振替に関する法律第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社は、やむを得ない事情などがある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

(3)【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

(4)【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。
・基準価額につきましては、販売会社または「(8) 申込取扱場所」の照会先にお問い合わせください。

(5)【申込手数料】

申込手数料につきましては、販売会社が定めるものとします。申込手数料率につきましては、販売会社にお問い合わせください。
・販売会社における申込手数料率は2.2%（税抜2.0%）が上限となっております。

(6)【申込単位】

販売会社にお問い合わせください。

(7)【申込期間】

2024年4月20日から2024年10月22日までとします。
・上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

(8)【申込取扱場所】

販売会社につきましては、委託会社の照会先にお問い合わせください。

委託会社の照会先 りそなアセットマネジメント株式会社 電話番号：0120-223351 （受付時間は営業日の午前9時～午後5時） ホームページ アドレス： https://www.resona-am.co.jp/

(9) 【払込期日】

- ・取得申込者は、申込金額を販売会社が指定する期日までに販売会社に支払うものとします。
- ・申込期間における各取得申込受付日の発行価額の総額（設定総額）は、販売会社によって、追加設定が行なわれる日に委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

(10) 【払込取扱場所】

申込金額は、販売会社にお支払いいただきます。

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、株式会社証券保管振替機構とします。

(12) 【その他】

該当事項はありません。

第二部【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】

- ① ファンドの目的
安定した収益の確保と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 ファンドの基本的性格
 - 1) 商品分類

単位型投信・ 追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単位型投信	国内	株式
	海外	債券
追加型投信		不動産投信
	内外	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。

2) 属性区分

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
株式 一般 大型株 中小型株	年1回 年2回 年4回	グローバル (含む日本) 日本		
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年6回 (隔月) 年12回 (毎月)	北米 欧州 アジア オセアニア	ファミリーファンド	あり (部分ヘッジ)
不動産投信	日々 その他 ()	中南米 アフリカ 中近東 (中東) エマージング	ファンド・オブ・ ファンズ	なし
その他資産 (投資信託証券(資 産複合(債券、株 式、不動産投信) 資産配分変更 型))				
資産複合 () 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。

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

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用されます。このため、組入れている資産を示す属性区分上の投資対象資産(その他資産(投資信託証券(資産複合(債券、株式、不動産投信)資産配分変更型)))と収益の源泉となる資産を示す商品分類上の投資対象資産(資産複合)とが異なります。

<商品分類の定義>

1. 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ぬファンドをいう。
- (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からの信託財産とともに運用されるファンドをいう。

2. 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。

3. 投資対象資産による区分

- (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。

4. 独立した区分

- (1) MMF(マネー・マネジメント・ファンド)：「MMF等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)：「MMF等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。

<補足として使用する商品分類>

- (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。

<属性区分の定義>

1. 投資対象資産による属性区分

(1)株式

- ①一般：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。
②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。
③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

- ①一般：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。
②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。
③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。
④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。
⑤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①から④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①から④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。

- ①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。
②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。

2. 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。

3. 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。

4. 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。

5. 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。

6. 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
- ②TOPIX
- 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。

7. 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。

※上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。また、商品分類および属性区分の定義は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」を基に委託会社が作成したものです。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/>) でもご覧頂けます。

③ ファンドの特色

1 各マザーファンドを通じて、世界各国の債券、株式およびリートなどの資産に分散投資します。

- 当ファンドは、特にESG/SDGsを重視した運用を行うマザーファンドを主要な投資対象としています。特にESG/SDGsを重視した運用を行うマザーファンドと、後述の九州に関連した運用を行うマザーファンドであるRM国内債券マザーファンド(九州重視型)の組入比率は合計80%以上とすることを目標としています。

※ 2024年1月31日現在、上記の組入比率は、以下の通りです。

	組入比率
①特にESG/SDGsを重視した運用を行うマザーファンド	69.8%
②九州に関連した運用を行うマザーファンド	10.3%
①と②の合計	80.1%

・上記組入比率は、ファンドの純資産総額に対する比率であり、四捨五入の関係で合計が「①と②の合計」と一致しない場合があります。

- 先進国債券、国内株式および先進国株式に投資を行う4つのマザーファンドにおいて、特にESG/SDGsを重視した運用*1を行います。
 - ◆ RM米ドル建SDGs債券マザーファンド(為替ヘッジあり)およびRMユーロ建SDGs債券マザーファンド(為替ヘッジあり)は、残存期間が10年程度までのSDGs債*2および先進国(日本を除く)の国債を、各残存期間の投資金額がほぼ同程度となるように組み入れることにより、金利変動に対するリスク分散効果や、利息収入の平準化を図り、安定した収益の確保を目指します。
 - ◆ RM国内株式ESGマザーファンドおよびRM先進国株式ESGマザーファンドは、ESG関連インデックス*3に連動する投資成果を目指します。
- 国内債券に投資を行うマザーファンドにおいて、九州に関連した運用を行い、九州の地方公共団体が発行する公募地方債も主要投資対象とします*4。
 - ◆ RM国内債券マザーファンド(九州重視型)は、投資するわが国の国債および九州の地方公共団体が発行する公募地方債の残存年限を幅広く分散させることにより、金利変動に対するリスク分散効果や、利息収入の平準化を図り、安定した収益の確保を目指します。

*1 ESG/SDGsを重視した運用の詳細は、「ESG/SDGsを重視した運用について」をご参照ください。

*2 マザーファンドにおける投資対象としてのSDGs債の詳細は、「ESG/SDGsを重視した運用について」をご参照ください。SDGs債の発行状況や市況状況および純資産総額の水準等により、SDGs債への投資比率が低位となる場合があります。

*3 ESG関連インデックスとは、MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数(配当込み)およびMSCI-KOKUSAI ESG リーダーズ指数(配当込み、円換算ベース)をいいます。詳細は、「ESG/SDGsを重視した運用について」をご参照ください。

*4 九州の地方公共団体が発行する公募地方債の発行状況や市況状況および純資産総額の水準等により、当該地方債に投資を行わない、もしくは投資比率が低位となる場合があります。

- その他の各マザーファンドは、以下の対象指数の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

		投資対象地域		
		国内	先進国	新興国
投資対象資産	債券	RM国内債券マザーファンド (九州重視型) 【主要投資対象】 わが国の国債および九州の地方公共団体が発行する公募地方債 【対象指数】 なし	RM米ドル建SDGs債券マザーファンド (為替ヘッジあり) 【主要投資対象】 米ドル建のSDGs債*および先進国(日本を除く)の国債 【対象指数】 なし RMユーロ建SDGs債券マザーファンド (為替ヘッジあり) 【主要投資対象】 ユーロ建のSDGs債*および先進国(日本を除く)の国債 【対象指数】 なし	RM新興国債券マザーファンド 【主要投資対象】 新興国の債券およびETF(上場投資信託証券) 【対象指数】 JPMorgan GBI-EM グローバル・ダイバーシファイド(円換算ベース)
	株式	RM国内株式ESGマザーファンド 【主要投資対象】 国内の株式 【対象指数】 MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数(配当込み)	RM先進国株式ESGマザーファンド 【主要投資対象】 先進国(日本を除く)の株式 【対象指数】 MSCI-KOKUSAI ESG リーダーズ指数(配当込み、円換算ベース)	RM新興国株式マザーファンド 【主要投資対象】 新興国の株式およびETF(上場投資信託証券) 【対象指数】 MSCI エマージング・マーケット指数(配当込み、円換算ベース)
	リート	RM国内リートマザーファンド 【主要投資対象】 国内の不動産投資信託証券 【対象指数】 東証REIT指数(配当込み)	RM先進国リートマザーファンド 【主要投資対象】 先進国(日本を除く)の不動産投資信託証券、不動産関連株式およびETF(上場投資信託証券) 【対象指数】 S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)	—

■ 特にESG/SDGsを重視した運用を行うマザーファンド ■ 九州に関連した運用を行うマザーファンド

* 発行国が先進国以外場合があります。

※ 各対象指数については、「各マザーファンドが対象とする指数の著作権等について」をご参照ください。

ESGとは

[ESG]とは、**E**nvironment(環境)、**S**ocial(社会)、**G**overnance(ガバナンス)の頭文字を取ったものです。

ESG評価の高い企業は、持続的な企業価値の向上が期待されています。

ESG投資は、従来の財務情報に加え、非財務情報であるESGの評価を重視して銘柄選別を行う運用手法です。

SDGsとは

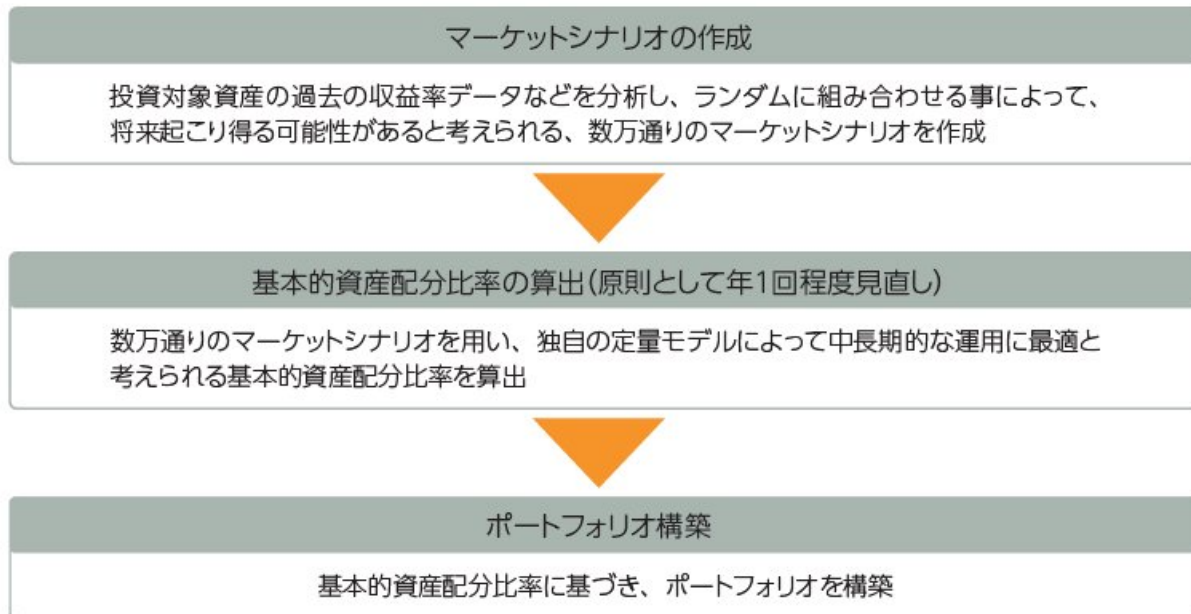
[SDGs]とは、“Sustainable Development Goals”(持続可能な開発目標)の略で、地球上の「誰一人取り残さない(leave no one behind)」持続可能でよりよい社会の実現を目指し、2015年9月に国連が採択し、2030年を期限として世界が共通して取り組む目標です。世界が直面する社会・経済・環境の3側面からなる課題解決を17のゴールとし、169のターゲットから構成されています。

2

中長期的な運用に理想的なポートフォリオ構築を目指します。

- 独自の定量モデルを用いて算出した基本的資産配分比率に基づき、ポートフォリオを構築します。基本的資産配分比率は、原則として年1回程度見直します。
当ファンドでは、過去に起きていなかった事象も今後起こり得ると考え、過去のデータをランダムに組み合わせ、将来起こり得る可能性のある数万通りのシナリオを作成します。このように作成されたマーケット・シナリオを用いてシミュレーションを行い、中長期的な運用に最適と考えられるポートフォリオを構築します。

運用プロセスのイメージ



※上記の運用プロセスおよびイメージ図は、今後変更になる場合があります。

3

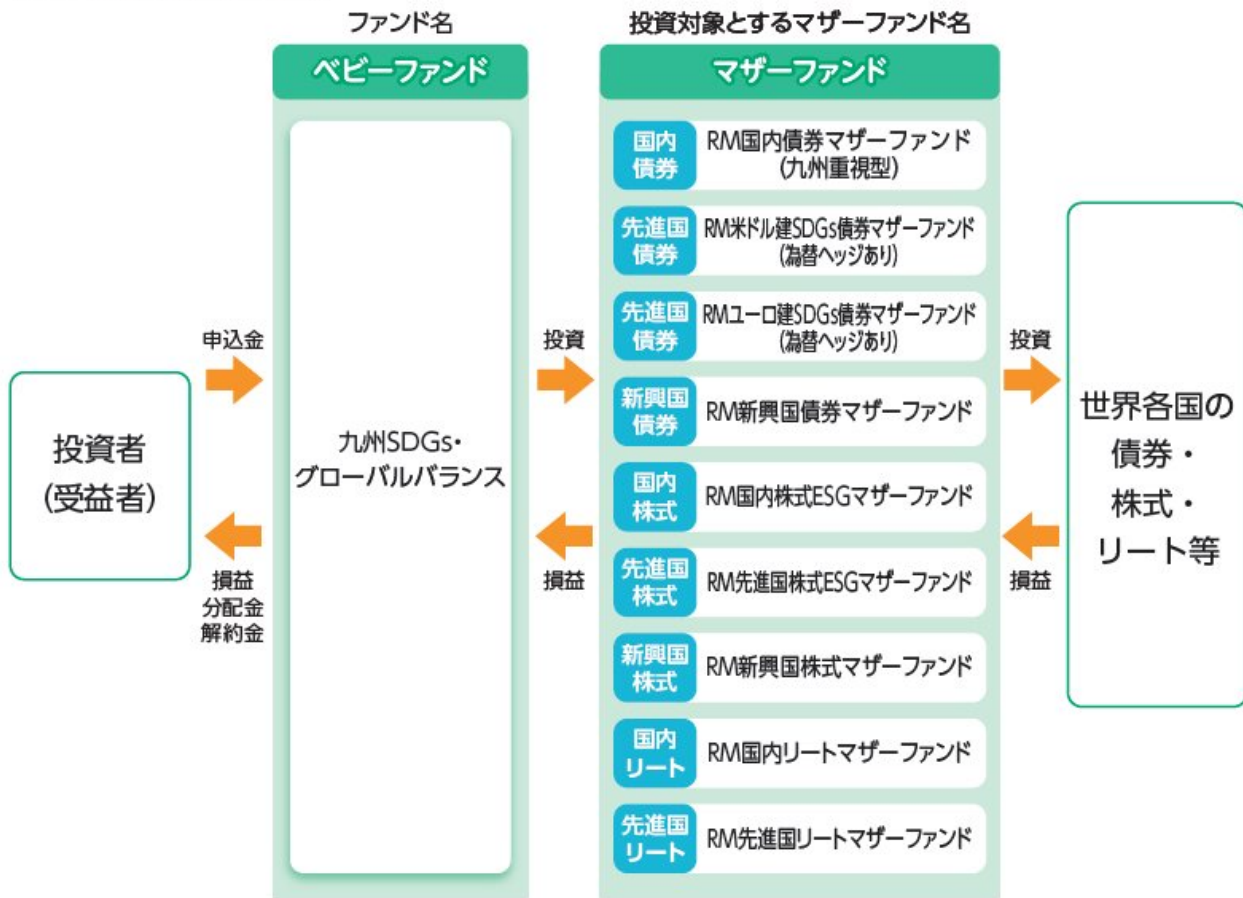
実質組入外貨建資産の一部について、対円での為替ヘッジを行います。

- 外貨建資産として組み入れるRM米ドル建SDGs債券マザーファンド(為替ヘッジあり)およびRMユーロ建SDGs債券マザーファンド(為替ヘッジあり)において為替ヘッジを行います。

資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。

■ ファンドの仕組み

当ファンドは各マザーファンドを通じて世界各国の債券、株式およびリートなどを実質的に投資を行う、ファミリーファンド方式で運用します。



■ 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。
- 投資信託証券(マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

■ 分配方針

原則、毎年7月20日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、以下の収益分配方針に基づいて分配を行います。

- ① 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等とします。
- ② 原則として、基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配金額を決定します。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。
- ③ 留保益は、運用の基本方針に基づいて運用します。

★将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

■ 各マザーファンドが対象とする指数の著作権等について

● RM新興国債券マザーファンド

「JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(円換算ベース)」は、JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(米ドルベース)をもとに、委託会社が円換算して計算したものです。JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(米ドルベース)は、J.P.モルガン・セキュリティー・エルエルシー(J.P.Morgan Securities LLC)が算出し公表している指数で、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数であり、指数に関する著作権はJ.P.Morgan Securities LLCに帰属します。

● RM国内株式ESGマザーファンド

MSCI Inc.が開発した「MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数(配当込み)」は、国内株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものであり、指数に関する著作権、知的財産権その他の権利はMSCI Inc.に帰属します。

● RM先進国株式ESGマザーファンド

「MSCI-KOKUSAI ESG リーダーズ指数(配当込み、円換算ベース)」は、MSCI Inc.が開発したMSCI-KOKUSAI ESG リーダーズ指数(米ドルベース)をもとに委託会社が円換算して計算したものです。MSCI-KOKUSAI ESG リーダーズ指数(米ドルベース)は、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものであり、指数に関する著作権、知的財産権その他の権利はMSCI Inc.に帰属します。

● RM新興国株式マザーファンド

「MSCIエマージング・マーケット指数(配当込み、円換算ベース)」は、MSCIエマージング・マーケット指数(米ドルベース)をもとに委託会社が円換算して計算したものです。MSCIエマージング・マーケット指数(米ドルベース)は、MSCI Inc.が開発した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものであり、指数に関する著作権、知的財産権その他の権利はMSCI Inc.に帰属します。

● RM国内リートマザーファンド

「東証REIT指数(配当込み)」は、東京証券取引所に上場している不動産投資信託(REIT)全銘柄を対象として算出した東証REIT指数に、分配金支払いによる権利落ちの修正を加えた指数です。なお、指数に関する著作権、知的財産権その他の一切の権利は株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社に帰属します。

● RM先進国リートマザーファンド

「S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)」は、S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み)をもとに委託会社が円換算して計算したものです。S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み)は、S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCが有するS&Pグローバル株価指数の採用銘柄の中から、不動産投資信託(REIT)および同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出される指数であり、指数に関する著作権、知的財産権その他の権利はS&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCに帰属します。

ESG/SDGsを重視した運用について

先進国債券、国内株式および先進国株式への投資において、特にESG/SDGsを重視します。

ー先進国債券の投資についてー

- RM米ドル建SDGs債券マザーファンド(為替ヘッジあり)およびRMユーロ建SDGs債券マザーファンド(為替ヘッジあり)は、SDGs債および先進国(日本を除く)の国債を主要投資対象とします。(以下、上記マザーファンドを総称して「SDGs債券マザーファンド」といいます。)

・SDGs債券マザーファンドにおける投資対象としてのSDGs債とは、調達資金がSDGsに貢献する事業に充当される債券であり、国際資本市場協会(ICMA)*によるグリーンボンド原則、ソーシャルボンド原則、サステナビリティボンド・ガイドライン等に沿って発行された債券および事業全体がSDGsに貢献すると考えられている機関が発行する債券(国際機関債等)等をいいます。

*国際資本市場協会(ICMA)は、国際資本と証券市場に関する諸論点の共同調査や議論を通じ、世界に多数存在する協会の良好な関係を促進することなどを目的とする非営利の国際組織です。

※SDGs債券マザーファンドそれぞれにおけるSDGs債の組入比率は合計90%以上とすることを目標としています。

※SDGs債の発行状況や市況状況および純資産総額の水準等により、SDGs債への投資比率が低位となる場合があります。

《 代表的なSDGs債の種類と特徴 》

代表的なSDGs債の種類	概要	特徴
グリーン・ボンド	温暖化問題、再生可能エネルギー等、環境プロジェクトに充当するために発行する債券です。	<ul style="list-style-type: none"> ● 以下の4要素の観点から、それぞれの債券の要件が設定されています。 <ul style="list-style-type: none"> ・資金調達の使途 ・プロジェクトの評価と選定のプロセス ・調達資金の管理 ・レポート ● 要件のほか、発行体に対する推奨項目も設定されています。 <ul style="list-style-type: none"> ・フレームワーク等によって、原則やガイドラインへの適合性等を説明すること ・外部評価機関を用いて、原則やガイドラインへの適合性を評価したり、資金管理の検証等を行うこと <p style="text-align: right;">など</p>
ソーシャル・ボンド	貧困問題、女性活躍の機会増進など、社会的課題解決のためのプロジェクトに充当するために発行する債券です。	
サステナブル・ボンド	グリーンとソーシャル両方のプロジェクト、両方の性格を持つプロジェクトに充当するために発行する債券です。	

※上記の記載内容については、今後変更される可能性があります。

ー国内株式および先進国株式の投資についてー

- RM国内株式ESGマザーファンドは、MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指します。また、RM先進国株式ESGマザーファンドは、MSCI-KOKUSAI ESG リーダーズ指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指します。

※ RM国内株式ESGマザーファンドおよびRM先進国株式ESGマザーファンドそれぞれにおけるESGを主要な要素として選定した投資銘柄の組入比率は合計100%とすることを目標としています。

- ・ MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数（配当込み）は、MSCI Inc.が開発し、国内株式を対象とした株価指数であるMSCI ジャパン IMI指数*1の構成銘柄から、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、配当を考慮したものです。
- ・ MSCI-KOKUSAI ESG リーダーズ指数（配当込み、円換算ベース）は、MSCI Inc.が開発したMSCI-KOKUSAI ESG リーダーズ指数（米ドルベース）をもとに委託会社が円換算して計算したものです。MSCI-KOKUSAI ESG リーダーズ指数（米ドルベース）は、日本を除く世界の先進国の株式から、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、配当を考慮したものです。

〈両指数の特徴〉

- ① MSCI Inc.独自のESG評価モデルを用います。当該モデルは、評価対象企業に対し、当該企業が属する業種が直面するESG上のリスクや機会が何か、当該企業にとってそれらがどの程度大きく、どの程度マネジメントを行っているかを測定・分析し、同業種他社と比較することを目的としています。
- ② 企業に対するESG評価は最終的にAAA～CCCの7段階のESG格付で表され、格付がBB以上（7段階のうち上位5段階目まで）の企業が選別されます。
- ③ E/S/Gそれぞれの要素に負の影響を与える可能性がある不祥事について分析し、11段階のうち上位8段階目までの企業が選別されます。
- ④ MSCI ジャパン IMI指数*1を構成する銘柄、またはMSCI-KOKUSAI指数*2を構成する日本を除く先進国の銘柄の中から、業種分類(GICS:Global Industry Classification Standard)ごとに時価総額50%を目標として、指数を構成する企業が選別されます。
- ⑤ MSCI-KOKUSAI ESG リーダーズ指数においては、非人道的兵器や核兵器製造などに関与する企業、アルコールやギャンブルなどから一定以上の収益を得ている企業は指数の構成銘柄から除外されます。

*1 MSCI ジャパン IMI指数は、MSCI Inc.が開発した、日本の上場株式を対象として算出した指数です。

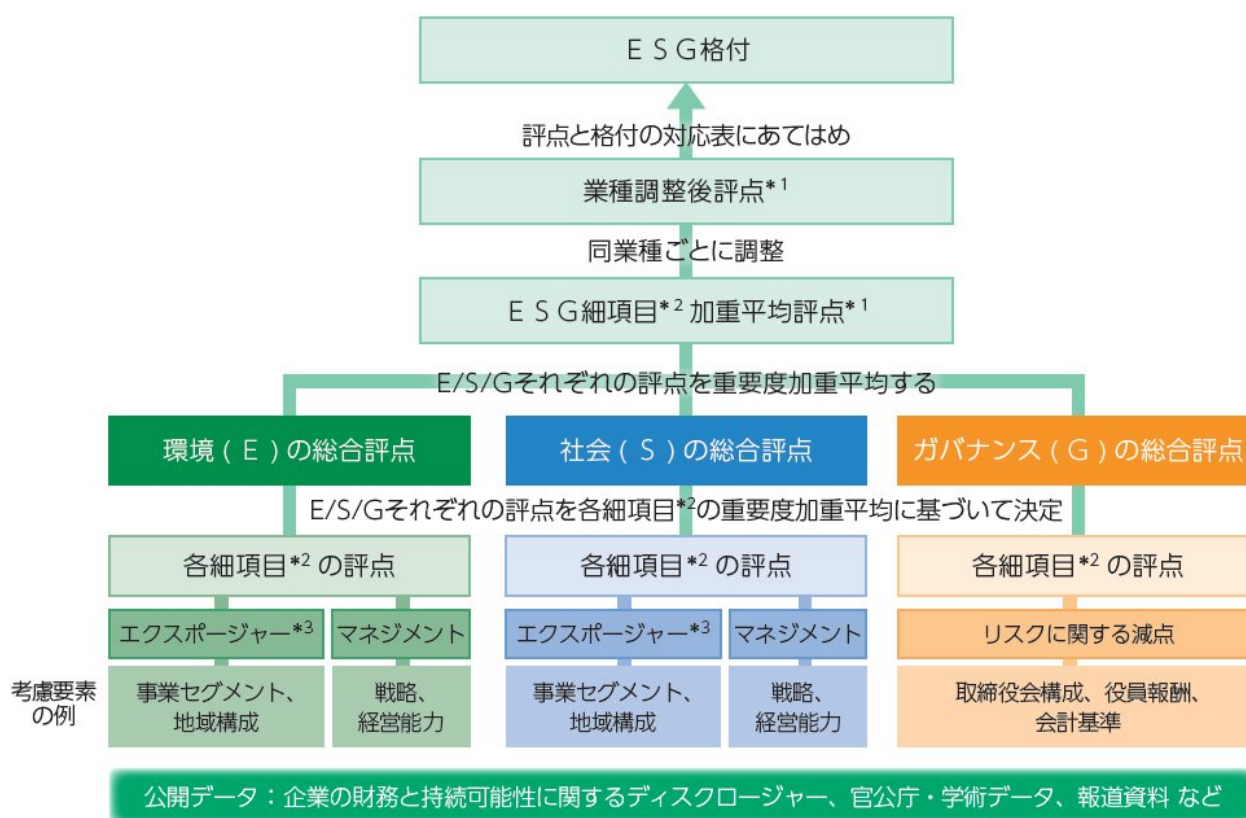
*2 MSCI-KOKUSAI指数は、MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数です。

※ MSCI Inc.の資料に基づき、リソナアセットマネジメントが作成。

※ 上記の記載内容については、今後変更される可能性があります。

〈ESG格付決定プロセス〉

1. 業種別に、MSCI Inc.が独自にE/S/Gそれぞれに設定している細項目 (Key Issue)のうち関連が深いものを選定し、それがリスクまたは機会として顕在化するまでの時間の長短および環境・社会に与える影響の大小の2軸をもとにウエイト配分を決定する。
2. E/S/Gそれぞれに選定された細項目をもとに、E/Sに対しては、エクスポージャー（経済的なリスクの程度）の大きさとそれに対するマネジメントがどの程度なされているかを、Gに対しては、企業統治上のリスクに関する評価を減点方式で勘案し、E/S/Gそれぞれに0～10の点数を付与する。
3. 上記1.で決定したウエイト配分をもとに、上記2.でE/S/Gそれぞれに付与した点数を、加重平均したうえで同業種他社との比較を踏まえ調整を行い、0～10の点数を算出する。
4. 算出された点数を格付表にあてはめ、格付を決定する。



*1 : 0～10の点数を算出

*2 : 業種別にMSCI Inc.が独自にE/S/Gそれぞれに設定している細項目 (Key Issue)

*3 : 経済的なリスクの程度

※ MSCI Inc.の資料に基づき、リソナアセットマネジメントが作成。

※ 上記の記載内容については、今後変更される可能性があります。

〈MSCI Inc.のESG細項目(Key Issue)の例〉(ご参考)

E	気候変動 ▷ 二酸化炭素排出 ▷ 環境インパクト金融 など	自然資本 ▷ 水資源の枯渇 ▷ 生物多様性と土地の利用 など
	環境汚染・廃棄物 ▷ 有害物質の排出と廃棄 ▷ 包装材の廃棄 など	環境に関する市場機会 ▷ クリーンテクノロジー ▷ 再生可能エネルギー など
	人的資本 ▷ 人材開発 ▷ サプライチェーン上の労働規範 など	製造物責任 ▷ 製品の安全性と品質 ▷ 金融商品の安全性 など
	利害関係者の対立 ▷ 希少資源 など	社会に関する市場機会 ▷ コミュニケーションの機会 ▷ 金融サービスの利用機会 など
G	企業統治 ▷ オーナーシップとコントロール ▷ 議決権行使 など	企業行動 ▷ 納税の透明性 など

※ MSCI Inc.の資料に基づき、リそなアセットマネジメントが作成。
 ※ 上記の記載内容については、今後変更される可能性があります。

④ 信託金限度額

- ・1兆円を限度として信託金を追加することができます。
- ・委託会社は受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

(2) 【ファンドの沿革】

2021年11月18日

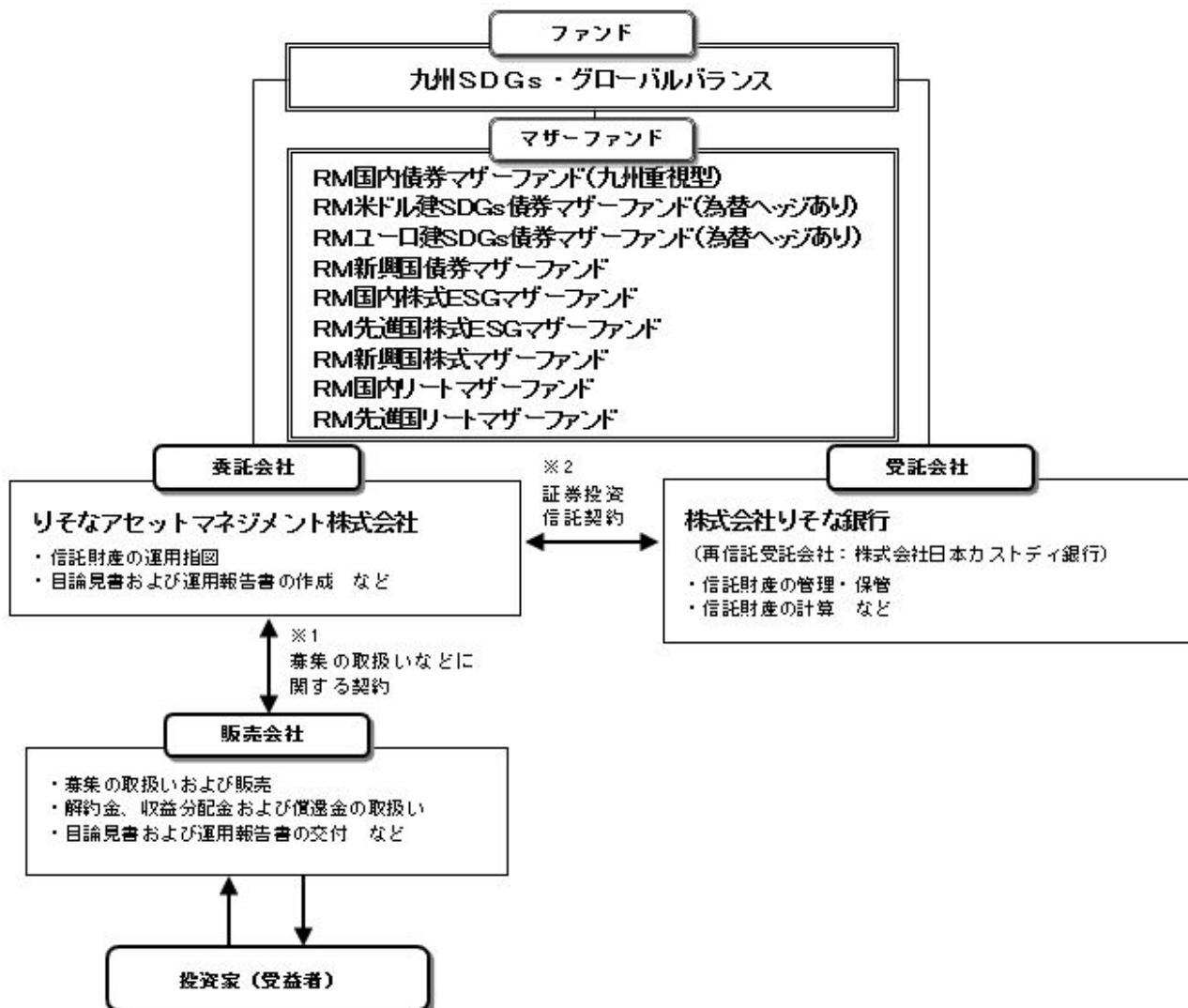
- ・ファンドの信託契約締結、運用開始

2023年4月21日

- ・信託期間を無期限に変更

(3) 【ファンドの仕組み】

① ファンドの仕組み



※1 投資信託を販売するルールを委託会社と販売会社の間で規定したものです。販売会社が行なう募集の取扱い、収益分配金・償還金の支払い、解約請求の受付の業務範囲の取決めの内容などが含まれています。

※2 投資信託を運営するルールを委託会社と受託会社の間で規定したものです。運用の基本方針、投資対象、投資制限、信託報酬、受益者の権利、募集方法の取決めの内容などが含まれています。

② 委託会社の概況 (2024年1月末現在)

1) 資本金

1,000百万円

2) 沿革

2015年8月3日：りそなアセットマネジメント株式会社設立

2020年1月1日：株式会社りそな銀行の資産運用事業に関する権利義務の一部を承継

3) 大株主の状況

名 称	住 所	所有株数	所有比率
株式会社りそなホールディングス	東京都江東区木場一丁目5番65号	3,960,000株	100%

2【投資方針】

(1)【投資方針】

RM国内債券マザーファンド（九州重視型）、RM米ドル建SDGs債券マザーファンド（為替ヘッジあり）、RMユーロ建SDGs債券マザーファンド（為替ヘッジあり）、RM新興国債券マザーファンド、RM国内株式ESGマザーファンド、RM先進国株式ESGマザーファンド、RM新興国株式マザーファンド、RM国内リートマザーファンド、RM先進国リートマザーファンド（以下、各々を「マザーファンド」といいます。）の各受益証券を主要投資対象とします。

- ① 主として、各マザーファンド受益証券への投資を通じ、実質的に国内、先進国および新興国の債券・株式ならびに国内および先進国の不動産投資信託証券（リート）等への分散投資を行います。また、株価指数先物取引、債券先物取引、不動産投信指数先物取引、ETF（上場投資信託証券）等を利用することがあります。
- ② 各マザーファンド受益証券への投資比率は、信託財産の中長期的な成長を目的に独自の定量モデルにて算出した基本的資産配分比率に基づき決定します。また、基本的資産配分比率は原則として年1回程度見直します。
- ③ 実質組入外貨建資産については、一部為替ヘッジを行います。
- ④ 各マザーファンド受益証券への投資比率の合計は、原則として高位を保ちますが、市場環境等を勘案して、投資比率を引き下げる場合があります。
- ⑤ 資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。

(2)【投資対象】

① 投資の対象とする資産の種類

この信託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。

- 1) 次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。）
 - イ) 有価証券
 - ロ) デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第21条、第22条、第23条および第24条に定めるものに限りません。）
 - ハ) 約束手形（イ）に掲げるものに該当するものを除きます。）
 - ニ) 金銭債権（イ）、ロ）およびハ）に掲げるものに該当するものを除きます。）
- 2) 次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ) 為替手形

② 有価証券の指図範囲

委託者は、信託金を、主として、各マザーファンドの受益証券、ならびに次の有価証券（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することができます。

- 1) 株券または新株引受権証書
- 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と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) 特定目的会社にかかる特定社債券（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かかる優先出資証券（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) 特定目的会社にかかる優先出資証券また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。）および新株予約権証券

- 12) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1) から 11) までの証券または証書の性質を有するもの
- 13) 投資信託また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、新投資口予約権証券、投資法人債券または外国投資証券（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または証書（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、有価証券にかかるものに限ります。）
- 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) 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 14 号で定めるものをいいます。）
- 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) 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって 19) の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

なお、1) の証券または証書ならびに 12) および 17) の証券または証書のうち 1) の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2) から 6) までの証券ならびに 14) の証券のうち投資法人債券ならびに 12) および 17) の証券または証書のうち 2) から 6) までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、13) の証券および 14) の証券（新投資口予約権証券および投資法人債券を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

③ 金融商品の指図範囲

委託者は、信託金を、上記②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 5) の権利の性質を有するもの

上記②の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときには、委託者は、信託金を、③に掲げる金融商品により運用することを指図することができます。

④ その他の投資対象と指図範囲

信用取引の運用指図、先物取引等の運用指図、スワップ取引の運用指図、金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図、直物為替先渡取引の運用指図、有価証券の貸付けの指図、外国為替予約取引の指図、資金の借入れの指図を行うことができます。

《参考情報》

◆投資対象とするマザーファンドの概要

<RM国内債券マザーファンド（九州重視型）>

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。
主な投資対象	わが国の国債および九州の地方公共団体が発行する公募地方債を主要投資対象とします。
投資方針	<ol style="list-style-type: none"> ① 主として、わが国の国債および九州の地方公共団体が発行する公募地方債に投資を行い、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長を目指します。なお、国内債券を対象とした債券先物取引を活用することがあります。 ② 投資する債券の残存年限を幅広く分散させることにより、金利変動に対するリスク分散効果や、利息収入の平準化を図り、安定した収益の確保を目指します。 ③ 債券の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。 ④ 資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> ① 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ② 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、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③ 外貨建資産への投資は行いません。 ④ デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。 ⑤ 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ⑥ 一般社団法人投資信託協会規則に規定す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およびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
決算日	毎年7月20日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

<RM米ドル建SDG s 債券マザーファンド（為替ヘッジあり）>

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。
主な投資対象	米ドル建のSDG s 債および先進国（日本を除く）の国債を主要投資対象とします。
投資方針	<p>① 主として、米ドル建のSDG s 債および先進国（日本を除く）の国債に投資し、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。なお、先進国債券（除く日本）を対象とした債券先物取引を活用することがあります。</p> <p>② 米ドル建のSDG s 債は、発行体の信用力・ESG評価および当該債券の流動性等を勘案して投資を行います。</p> <p>③ ポートフォリオの構築は、残存期間が10年程度までの米ドル建のSDG s 債および先進国（日本を除く）の国債を、各残存期間の投資金額がほぼ同程度となるように組み入れることにより、金利変動に対するリスク分散効果や、利息収入の平準化を図り、安定した収益の確保を目指します。</p> <p>④ 債券の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。</p> <p>⑤ 組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行います。</p> <p>⑥ 資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>① 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>② 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、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>③ 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>④ デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。</p> <p>⑤ 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。</p> <p>⑥ 一般社団法人投資信託協会規則に規定す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およびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
決算日	毎年5月10日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

< RMユーロ建SDG s 債券マザーファンド（為替ヘッジあり） >

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。
主な投資対象	ユーロ建のSDG s 債および先進国（日本を除く）の国債を主要投資対象とします。
投資方針	<ol style="list-style-type: none"> ① 主として、ユーロ建のSDG s 債および先進国（日本を除く）の国債に投資し、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。なお、先進国債券（除く日本）を対象とした債券先物取引を活用することがあります。 ② ユーロ建のSDG s 債は、発行体の信用力・ESG評価および当該債券の流動性等を勘案して投資を行います。 ③ ポートフォリオの構築は、残存期間が10年程度までのユーロ建のSDG s 債および先進国（日本を除く）の国債を、各残存期間の投資金額がほぼ同程度となるように組み入れることにより、金利変動に対するリスク分散効果や、利息収入の平準化を図り、安定した収益の確保を目指します。 ④ 債券の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。 ⑤ 組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行います。 ⑥ 資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> ① 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ② 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、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③ 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ④ デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。 ⑤ 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ⑥ 一般社団法人投資信託協会規則に規定す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およびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
決算日	毎年5月10日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

<RM新興国債券マザーファンド>

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、J PモルガンG B I—EMグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	次の有価証券を主要投資対象とします。 <ul style="list-style-type: none"> ・ J PモルガンG B I—EMグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）に採用されている新興国の債券 ・ 新興国債券の指数を対象指数としたE T F（上場投資信託証券）
投資方針	<ol style="list-style-type: none"> ① 主として、J PモルガンG B I—EMグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）に採用されている新興国の現地通貨建て債券または新興国債券の指数を対象指数としたE T F（上場投資信託証券）に投資し、J PモルガンG B I—EMグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、J PモルガンG B I—EMグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の債券先物取引を活用することがあります。 ② 債券またはE T F（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。 ③ 為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。 ④ 資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> ① 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り。）の行使等により取得したものに限りま す。 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ② 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、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ④ デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。 ⑤ 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ⑥ 一般社団法人投資信託協会規則に規定す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およびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入る有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
決算日	毎年1月25日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

<RM国内株式ESGマザーファンド>

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
主な投資対象	国内の金融商品取引所上場株式（上場予定を含みます。）のうち、MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数（配当込み）に採用されている株式を主要投資対象とします。
投資方針	<p>① 主として、国内の金融商品取引所上場株式（上場予定を含みます。）のうち、MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数（配当込み）に採用されている株式に投資し、MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数（配当込み）への連動性を高めるため、国内株式の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）、国内株式を対象とした株価指数先物取引を活用することがあります。</p> <p>② 株式（ETF（上場投資信託証券）、株価指数先物取引を含みます。）の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。</p> <p>③ 非株式割合（株式以外の資産への投資割合）は、原則として信託財産総額の50%以下を基本とします。</p> <p>④ 資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>① 株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>② 新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。</p> <p>③ 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、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>④ 外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>⑤ デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。</p> <p>⑥ 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。</p> <p>⑦ 一般社団法人投資信託協会規則に規定す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およびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入る有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
決算日	毎年11月25日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

<RM先進国株式ESGマザーファンド>

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、MSCI-KOKUSAI ESG リーダーズ指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
主な投資対象	金融商品取引所上場または店頭登録（上場予定および店頭登録予定を含みます。）されている日本を除く先進国の株式*のうち、MSCI-KOKUSAI ESG リーダーズ指数（配当込み、円換算ベース）に採用されている株式を主要投資対象とします。 *DR（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。
投資方針	① 主として、金融商品取引所に上場または店頭登録（上場予定および店頭登録予定を含みます。）されている日本を除く先進国の株式のうち、MSCI-KOKUSAI ESG リーダーズ指数（配当込み、円換算ベース）に採用されている株式に投資し、MSCI-KOKUSAI ESG リーダーズ指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、MSCI-KOKUSAI ESG リーダーズ指数（配当込み、円換算ベース）への連動性を高めるため、先進国株式の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）、海外の金融商品取引所に上場されている株価指数先物取引を活用することがあります。 ② 株式（ETF（上場投資信託証券）、株価指数先物取引を含みます。）の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。 ③ 組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。 ④ 資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	① 株式への投資割合には、制限を設けません。 ② 新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ③ 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、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ④ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ⑤ デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。 ⑥ 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ⑦ 一般社団法人投資信託協会規則に規定す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およびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
決算日	毎年11月25日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

<RM新興国株式マザーファンド>

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、MSC I エマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	次の有価証券を主要投資対象とします。 <ul style="list-style-type: none"> ・金融商品取引所に上場されているまたは店頭登録されている（上場予定および店頭登録予定を含みます。）新興国株式（*） <li style="padding-left: 20px;">（*）DR（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。 ・新興国株式の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ① 主として、新興国の株式または新興国株式の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）に投資し、MSC I エマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。なお、MSC I エマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の金融商品取引市場に上場する株価指数先物取引を活用することがあります。 ② 株式またはETF（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態での高位に維持することを基本とします。 ③ 為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。 ④ 資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ① 株式への投資割合には、制限を設けません。 ② 新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ③ 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、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ④ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ⑤ デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。 ⑥ 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ⑦ 一般社団法人投資信託協会規則に規定す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およびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入る有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
決算日	毎年1月25日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

<RM国内リートマザーファンド>

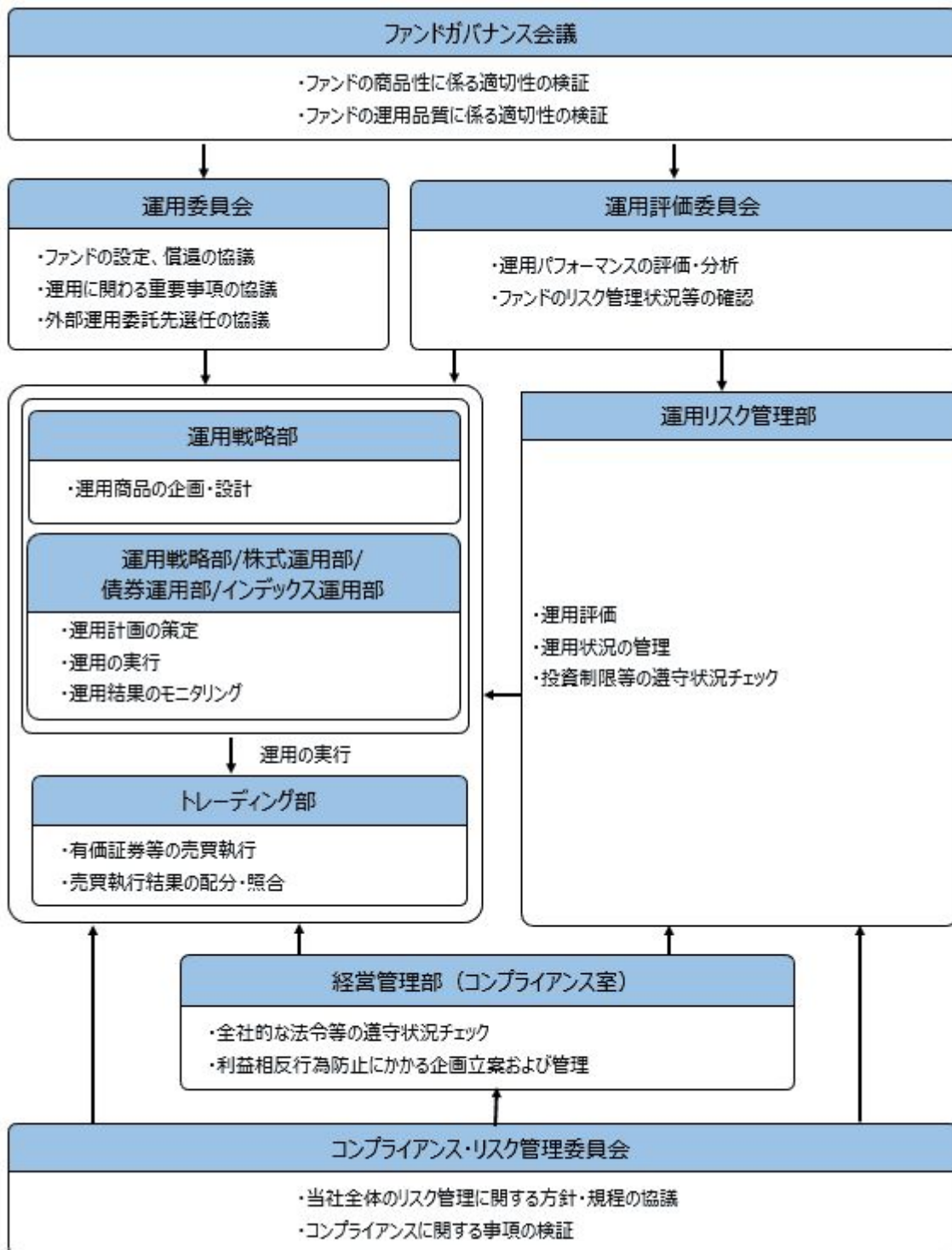
運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	次の有価証券を主要投資対象とします。 ・東証REIT指数（配当込み）に採用されている不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に規定する不動産投資信託証券をいいます。）
投資方針	① 主として、東証REIT指数（配当込み）に採用されている不動産投資信託証券に投資し、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。なお、東証REIT指数（配当込み）への連動性を高めるため、東証REIT指数（配当込み）を対象指数としたETF（上場投資信託証券）または不動産投信指数先物取引を活用することがあります。 ② 不動産投資信託証券またはETF（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。 ③ 資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	① 不動産投資信託証券および株式への投資割合には、制限を設けません。 ② 新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ③ 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、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ④ 外貨建資産への投資は、行いません。 ⑤ デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。 ⑥ 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ⑦ 一般社団法人投資信託協会規則に規定す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およびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
決算日	毎年1月25日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

<RM先進国リートマザーファンド>

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、S & P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	次の有価証券を主要投資対象とします。 <ul style="list-style-type: none"> ・先進国（除く日本）の金融商品取引所に上場（上場予定を含みます。）されているまたは店頭登録されている（登録予定を含みます。）不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に規定する不動産投資信託証券をいいます。） ・先進国（除く日本）の金融商品取引所に上場（上場予定を含みます。）されているまたは店頭登録されている（登録予定を含みます。）不動産関連株式 ・先進国の不動産投資信託証券に関する指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）
投資方針	<ol style="list-style-type: none"> ① 主として、先進国の不動産投資信託証券および不動産関連株式または先進国の不動産投資信託証券に関する指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）に投資し、S & P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、S & P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の金融商品取引市場に上場する指数先物取引を活用することがあります。 ② 不動産投資信託証券またはETF（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。 ③ 為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。 ④ 資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> ① 不動産投資信託証券および株式への投資割合には、制限を設けません。 ② 新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ③ 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、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ④ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ⑤ デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。 ⑥ 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ⑦ 一般社団法人投資信託協会規則に規定す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およびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入る有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
決算日	毎年1月25日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

(3) 【運用体制】

① ファンドの運用体制は以下のとおりです。



※ファンドガバナンス会議は 3 名程度、運用委員会は 5 名程度、運用評価委員会は 6 名程度、コンプライアンス・リスク管理委員会は 3 名程度で構成されています。

② りそなアセットマネジメント株式会社の運用体制に関する社内規則等は次の通りです。
委託会社では、運用に関する社内規程およびリスク管理規程を定め、適切な運用を行うとともに、流動性リスクを含む運用リスクの管理を行っています。

③ ファンドの関係法人に対する管理体制
委託会社は、受託会社また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および運用状況の報告書を受託会社より受け取っております。

※上記の運用体制は、2024 年 1 月末現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

(4) 【分配方針】

① 収益分配方針

原則として毎決算時に以下の収益分配方針に基づいて分配を行います。

- 1) 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。
- 2) 原則として、基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配金額を決定します。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。
- 3) 留保益は、運用の基本方針に基づいて運用します。
※委託会社の判断により分配を行わない場合もあります。また、将来の分配金の支払いおよびその金額について示唆、保証するものではありません。

② 収益分配金の支払い

＜分配金再投資コース（自動けいぞく投資コース）＞

原則として、収益分配金は税金を差し引いた後、無手数料で自動的に再投資されます。

＜分配金受取りコース（一般コース）＞

毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して5営業日まで）から収益分配金を支払います。支払いは販売会社において行なわれます。

(5) 【投資制限】

① 約款に定める投資制限

- 1) 株式への実質投資割合には、制限を設けません。
- 2) 新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。
- 3) 投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 4) 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- 5) デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。
- 6) 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 7) 一般社団法人投資信託協会規則に規定す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およびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

8) 投資する株式等の範囲

1. 委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所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、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
2. 前記1.の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとします。

9) 信用取引の指図範囲

1. 委託者は、信託財産に属する資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、当該売付けの決済については、株券の引渡しまた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。
2. 前記1.の信用取引の指図は、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
 - イ) 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
 - ロ) 株式分割により取得する株券
 - ハ) 有償増資により取得する株券
 - ニ) 売出しにより取得する株券
 - ホ) 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（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号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使により取得可能な株券
 - ヘ) 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（ホ）に定めるものを除きま

す。)の行使により取得可能な株券

10) 先物取引等の運用指図

1. 委託者は、わが国の金融商品取引所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。）およ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。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。
2. 委託者は、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。
3. 委託者は、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

11) スワップ取引の運用指図

1. 委託者は、異なった通貨、異なった受取金利また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。）を行うことの指図をすることができます。
2. スワップ取引の指図にあたっては、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。
3. スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。
4. 委託者は、スワップ取引を行うにあ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。

12) 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図

1. 委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
2. 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、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。
3. 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。
4. 委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあ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。

13) 直物為替先渡取引の運用指図

1. 委託者は、直物為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
2. 直物為替先渡取引の指図にあたっては、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。
3. 直物為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。
4. 委託者は、直物為替先渡取引を行うにあ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。

14) 有価証券の貸付けの指図および範囲

1. 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式、公社債および投資信託証券を次の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。
 - イ) 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、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。
 - ロ) 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、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。
 - ハ) 投資信託証券の貸付けは、貸付時点において、貸付投資信託証券の時価合計額が、信託財産で保有する投資信託証券の時価合計額を超えないものとします。
2. 前記1. に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は、すみ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。
3. 委託者は、有価証券の貸付けにあ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。

15) 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。

16) 外国為替予約取引の指図および範囲

委託者は、信託財産に属する外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

17) 資金の借入れ

1. 委託者は、信託財産の効率的な運用なら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入れた資金の返済を含みます。）を目的として、ま

たは再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。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。

2. 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から、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、または解約代金の入金日までの間、もしくは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、解約代金および償還金の合計額を限度とします。
3. 収益分配金の再投資にかかる借入期間は、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。
4. 借入金の利息は信託財産中から支弁します。

② 法令による投資制限

同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律）

同一法人の発行する株式について、委託会社が運用の指図を行なう投資信託全体で、当該株式の議決権の過半数を保有することとなる取引は行ないません。

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

当ファンドの基準価額は、実質的に組み入れている有価証券等の値動きにより影響を受けますが、運用により信託財産に生じた損益はすべて投資者のみなさまに帰属します。

したがって、投資者のみなさまの投資元本が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。また、投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの基準価額の変動要因として、主に以下のリスクがあります。このため、お申込みの際は、当ファンドのリスクを認識・検討し、慎重にご判断くださいますようお願いいたします。

① 市場リスク

・株価変動リスク

株価は、政治・経済情勢、発行企業の業績・財務状況、市場の需給、それらに関する外部評価の変化等を反映して変動します。株価が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

・金利（債券価格）変動リスク

金利（債券価格）は、金融・財政政策、市場の需給、それらに関する外部評価の変化等を反映して変動します。債券価格は、一般に金利が上昇（低下）した場合は値下がり（値上がり）します。債券価格が値下がりした場合は、基準価額の下落要因となります。

・リートの価格変動リスク

リートの価格は、不動産市況（不動産価格、賃貸料等）、金利・景気動向、社会情勢の変化、関係法令・各種規制等の変更、災害等の要因により変動します。リートの価格および分配金がその影響を受け下落した場合は、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、金利動向、政治情勢等のさまざまな要因により変動します。当ファンドは、実質的に外貨建資産に投資を行いますので、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。また当ファンドは原則として為替ヘッジにより為替変動リスクの一部低減を図ることとしていますが、当該部分の為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。なお、為替ヘッジを行う通貨の短期金利より円短期金利が低い場合には、その金利差相当分のコストがかかります。

② 資産配分リスク

複数資産（国内・外の株式、債券、リート等）への投資を行うため、投資割合が高い資産の価格が下落した場合、当ファンドの基準価額はより大きく影響を受け損失を被ることがあります。

③ 信用リスク

実質的に組み入れている有価証券等の発行体が倒産した場合、発行体の財務状況が悪化した場合またはそれらが予想された場合等には、当該有価証券等の価格が下落することやその価値がなくなることにより、基準価額の下落要因となります。

④ 流動性リスク

時価総額や取引量が少ない市場で流動性が低い場合、市場の混乱・取引規制等の理由から流動性が低下している場合、急激かつ多量の売買により市場が大きな影響を受けた場合等、市場実勢から期待できる価格よりも大幅に不利な価格で売買せざるを得ないことがあり、この場合、基準価額が下落する要因となります。

⑤ カントリーリスク

投資対象国・地域（特に新興国）において、政治や経済、社会情勢等の変化または金融取引等に関する規制の新設や変更により、実質的に組み入れている有価証券等の価格が大きく変動することがあります。そ

のため基準価額が予想以上に下落することや、投資方針に沿った運用が困難となることがあります。

※基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

(その他の留意点)

- ①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。
- ②当ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行います。そのため、当ファンドと同じマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドの追加設定・解約により資金の流出入が生じた場合、その結果として、当該マザーファンドにおいても組入有価証券の売買等が生じ、当ファンドの基準価額に影響をおよぼすことがあります。
- ③当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要がある場合や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およぼす可能性や、換金のお申込みの受け付けが中止となる可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性があります。
- ④分配金はファンドの純資産から支払われますので、分配金支払い後は純資産が減少し、基準価額が下落する要因となります。収益分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益の水準を示すものではありません。収益分配は、計算期間に生じた収益を超えて行われる場合があります。投資者の購入価額によっては、収益分配金の一部または全部が、実質的な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の方が小さかった場合も同様です。
- ⑤ファンドは、預金や保険契約ではなく、預金保険機構、保険契約者保護機構の対象ではありません。また、登録金融機関で取扱う場合、投資者保護基金の補償対象ではありません。
- ⑥当資料に記載している指数の知的財産権、その他の一切の権利は、その発行者および許諾者に帰属します。

(2) リスク管理体制

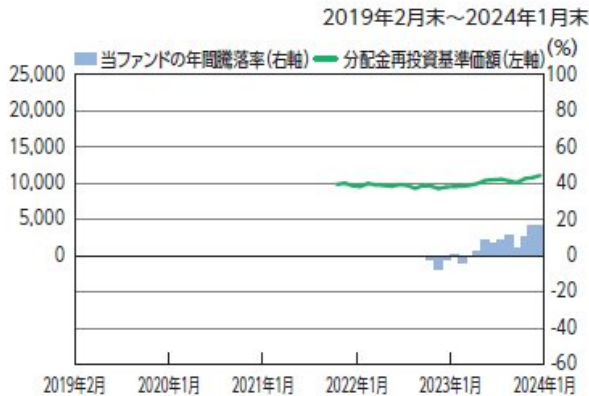
○委託会社における投資リスクに対する管理体制

- ①運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス評価を実施するとともに、流動性リスクを含む運用リスクの状況、法令・主な投資制限等の遵守状況および運用事務状況をモニタリングし、定期的に運用評価委員会に報告します。
 - ②運用評価委員会は、運用実績、流動性リスクを含む運用リスクの状況、主な投資制限等の遵守状況および運用事務状況等を確認することを通じ、信託財産の適切な運用に寄与することを目的に運用部門に対する管理・指導、改善提案等を行います。なお、流動性リスクについては、緊急時対応策の有効性検証結果や流動性リスク管理プロセスの見直し結果についても確認を行います。
- 運用リスクを管理する部門は、運用業務等に係る情報のうち、経営に重要な影響を与えるまたは受益者の利益が著しく阻害される一切の事案についてはすみやかに、また法令・主な投資制限等の遵守状況については定期的に取締役会等に報告します。

※上記体制は 2024 年 1 月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

[参考情報]

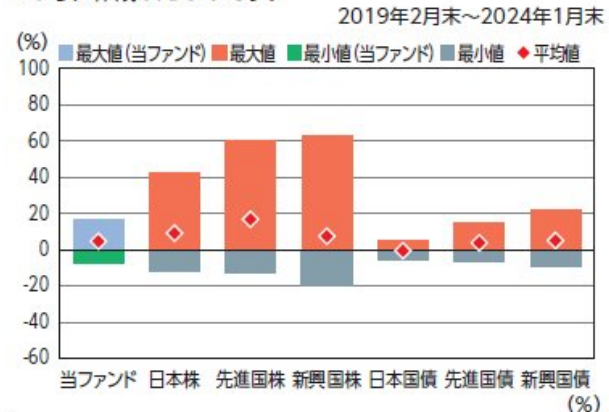
ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



- * 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ものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- * 年間騰落率は、2022年11月から2024年1月の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

グラフは、ファンドと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。



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	16.8	42.1	59.8	62.7	5.4	14.8	21.5
最小値	△7.5	△11.4	△12.4	△19.4	△5.5	△6.1	△8.8
平均値	4.7	9.1	16.8	7.6	△0.7	3.9	5.2

- * 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- * 2019年2月から2024年1月の5年間(当ファンドは2022年11月から2024年1月)の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- * 決算日に対応した数値とは異なります。
- * 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

※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ており、実際の基準価額と異なる場合があります。

各資産クラスの指数

- 日本株・・・東証株価指数(TOPIX、配当込み)
 - 先進国株・・・MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み、円ベース)
 - 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)
 - 日本国債・・・NOMURA-BPI国債
 - 先進国債・・・FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
 - 新興国債・・・JPモルガンGBI—EMグローバル・ダイバーシファイド(円ベース)
- (注)海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

○代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

騰落率は、データソースが提供する各指数をもとに株式会社野村総合研究所が計算しており、その内容について、信憑性、正確性、完全性、最新性、網羅性、適時性を含む一切の保証を行いません。また、当該騰落率に関連して資産運用または投資判断をした結果生じた損害等、当該騰落率の利用に起因する損害及び一切の問題について、何らの責任も負いません。

東証株価指数(TOPIX、配当込み)

東証株価指数(TOPIX、配当込み)は、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、配当を考慮したものです。なお、TOPIXに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社に帰属します。

MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み、円ベース)

MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み、円ベース)は、MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、MSCI Indexに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。

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(配当込み、円ベース)は、MSCI Inc.が開発した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、MSCI Indexに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。

NOMURA-BPI国債

NOMURA-BPI国債は、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発表している日本の国債市場の動向を的確に表すために開発された投資収益指数です。なお、NOMURA-BPI国債に関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、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。

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(除く日本、円ベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した指数です。なお、FTSE世界国債インデックスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利は、FTSE Fixed Income LLCに帰属します。

JPモルガンGBI—EMグローバル・ダイバーシファイド(円ベース)

JPモルガンGBI—EMグローバル・ダイバーシファイド(円ベース)は、J.P.Morgan Securities LLCが算出、公表している、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数です。なお、JPモルガンGBI—EMグローバル・ダイバーシファイドに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、J.P.Morgan Securities LLCに帰属します。

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

申込手数料につきましては、販売会社が定めるものとします。申込手数料率につきましては、販売会社にお問い合わせください。

- ・販売会社における申込手数料率は2.2%（税抜2.0%）が上限となっております。
- ・申込手数料の額（1口当たり）は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に申込手数料率を乗じて得た額とします。
- ・＜分配金再投資コース（自動けいぞく投資コース）＞の場合、収益分配金の再投資により取得する口数については、申込手数料はかかりません。

※申込手数料は、商品および関連する投資環境の説明や情報提供など、ならびに購入に関する事務コストの対価です。

(2) 【換金（解約）手数料】

- ① 換金手数料
ありません。
- ② 信託財産留保額
ありません。

(3) 【信託報酬等】

- ① 信託報酬
信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年 1.1%（税抜 1.0%）の率を乗じて得た額とします。
- ② 信託報酬の配分
信託報酬の配分（年率）は、以下の通りとします。

信託報酬＝日々の純資産総額×信託報酬率		
委託会社	販売会社	受託会社
0.485%	0.485%	0.030%

※表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

支払先	主な役務
委託会社	ファンドの運用・調査、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
販売会社	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	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

③ 支払時期

信託報酬（信託報酬に係る消費税等相当額を含みます。）は、日々計上され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（当該終了日が休業日の場合はその翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のときに、信託財産から支払います。

(4) 【その他の手数料等】

- ① 監査法人に支払うファンドの監査費用および当該監査費用にかかる消費税等に相当する金額は、計算期間を通じて日々計上され毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（当該終了日が休業日の場合は翌営業日）、および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支払われます。
- ② 有価証券等の売買の際に発生する売買委託手数料、先物取引・オプション取引等に要する費用は証券会社等に信託財産中から都度支払われます。また、外貨建資産の保管等に要する費用は海外の保管機関に信託財産中から都度支払われます。（消費税等相当額を含みます。）
- ③ 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、信託財産中から都度支払われます。信託財産において資金借入れを行った場合、当該借入金の利息

は信託財産中から都度支払われます。

- ④ 信託財産に属する有価証券等に関連して発生した訴訟係争物たる権利その他の権利に基づいて益金が生じた場合、当該支払いに際して特別に必要となる費用（データ処理費用、郵送料等）は、受益者の負担とし、当該益金から支払われます。
- ⑤ その他諸費用（法律・税務顧問への報酬、法定書類の作成・印刷・交付費用、公告費用等）および当該諸費用にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁することができます（現在、その他諸費用として受益者負担項目はありません。）。

※これらのその他の手数料等は、信託財産の運用状況等により変動するため、事前に料率、上限額またはその計算方法の概要等を記載することができません。

- 上場投資信託証券、上場不動産投資信託証券は市場の需給により価格形成されるため、これら費用を表示することができません。
- 上記の手数料等の合計額については、購入金額や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。

- ・公募株式投資信託は税法上、一定の要件を満たした場合に少額投資非課税制度（NISA）の適用対象となります。
- ・当ファンドは、NISAの「成長投資枠（特定非課税管理勘定）」の対象ですが、販売会社により取扱いが異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

① 個人受益者の場合

1) 収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については配当所得として、20.315%（所得税 15.315%および地方税 5%）の税率による源泉徴収（原則として、確定申告は不要です。）が行なわれます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用はありません。）のいずれかを選択することもできます。

2) 解約金および償還金に対する課税

解約時および償還時の差益（譲渡益）*については譲渡所得として、20.315%（所得税 15.315%および地方税 5%）の税率による申告分離課税の対象となり、確定申告が必要となります。なお、源泉徴収ありの特定口座（源泉徴収選択口座）を選択している場合は、20.315%（所得税 15.315%および地方税 5%）の税率による源泉徴収（原則として、確定申告は不要です。）が行なわれます。

*解約価額および償還価額から取得費用（申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額を含みます。）を控除した利益

※確定申告等により、解約時および償還時の差損（譲渡損失）については、上場株式等の譲渡益、上場株式等の配当等および特定公社債等の利子所得（申告分離課税を選択したものに限り）と損益通算が可能です。また、解約時および償還時の差益（譲渡益）、普通分配金および特定公社債等の利子所得（申告分離課税を選択したものに限り）については、上場株式等の譲渡損失と損益通算が可能です。

※少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

NISAは、少額上場株式等に関する非課税制度です。

NISAをご利用の場合、一定の額を上限として、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が無期限で非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設し、税法上の要件を満たした商品を購入するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。なお、他の口座で生じた配当所得・譲渡所得との損益通算はできません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

② 法人受益者の場合

1) 収益分配金、解約金、償還金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については配当所得として、15.315%（所得税のみ）の税率による源泉徴収が行なわれます。源泉徴収された税金は、所有期間に応じて法人税から控除される場合があります。

2) 益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

※買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

③ 個別元本

1) 各受益者の買付時の基準価額（申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が個別元本になります。

2) 受益者が同一ファンドを複数回お申込みの場合、1口当たりの個別元本は、申込口数で加重平均した値とな

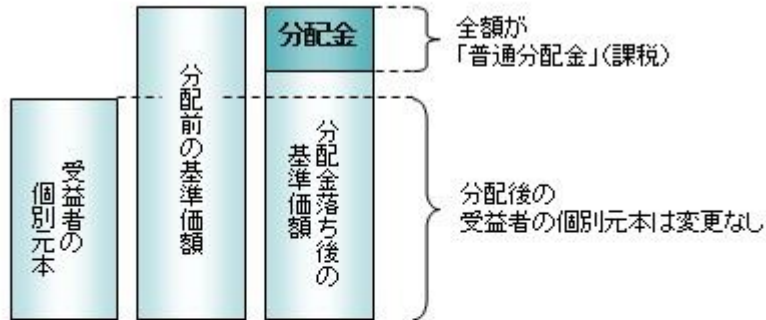
ります。ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。

④ 普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

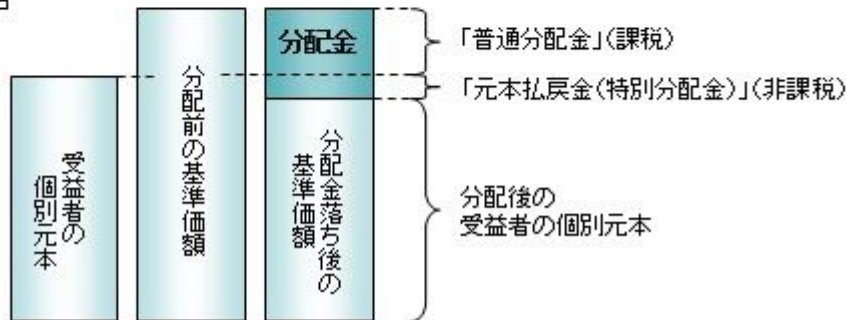
- 1) 収益分配金には課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」(元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。
- 2) 受益者が収益分配金を受け取る際
 - イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。
 - ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。
 - ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

<分配金に関するイメージ図>

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



※外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

※上記は 2024 年 1 月末現在のものですので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家など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

総経費率(①+②)	①	②
	運用管理費用の比率	その他費用の比率
1.17%	1.09%	0.08%

※対象期間は2022年7月21日～2023年7月20日です。

※対象期間中の運用・管理にかかった費用の額(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口あたり)を乗じた数で除した値(年率)です。

※その他費用とは監査費用や有価証券の保管費用等です。

※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】

【九州SDGs・グローバルバランス】

以下の運用状況は2024年1月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(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	2,024,523,113	99.74
コール・ローン等・その他資産（負債控除後）	—	5,243,365	0.26
合計（純資産総額）		2,029,766,478	100.00

(2) 【投資資産】

① 【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	数量又は額面総額	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
日本	親投資信託受益証券	RM先進国株式ESGマザーファンド	323,284,584	1.8582	600,727,414	2.1269	687,593,981	33.88
日本	親投資信託受益証券	RM米ドル建SDGs債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	337,251,906	0.8793	296,558,450	0.8680	292,734,654	14.42
日本	親投資信託受益証券	RM国内株式ESGマザーファンド	139,702,592	1.4942	208,743,613	1.7149	239,575,975	11.80
日本	親投資信託受益証券	RM国内債券マザーファンド（九州重視型）	213,123,625	0.9834	209,605,888	0.9799	208,839,840	10.29
日本	親投資信託受益証券	RMユーロ建SDGs債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	222,640,560	0.8724	194,240,306	0.8831	196,613,878	9.69
日本	親投資信託受益証券	RM先進国リートマザーファンド	95,523,097	1.5158	144,793,911	1.6172	154,479,952	7.61
日本	親投資信託受益証券	RM新興国株式マザーファンド	71,299,628	1.7307	123,398,267	1.7694	126,157,561	6.22
日本	親投資信託受益証券	RM国内リートマザーファンド	54,989,214	1.4542	79,965,315	1.4266	78,447,612	3.86
日本	親投資信託受益証券	RM新興国債券マザーファンド	29,457,343	1.2952	38,153,151	1.3606	40,079,660	1.97

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	99.74
合計	99.74

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【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】

① 【純資産の推移】

期別	純資産総額 (百万円)		1口当たり純資産額 (円)	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第1計算期間末 (2022年7月20日)	2,698	2,698	0.9719	0.9719
第2計算期間末 (2023年7月20日)	2,347	2,347	1.0411	1.0411
2023年1月末日	2,574	—	0.9488	—
2月末日	2,566	—	0.9553	—
3月末日	2,562	—	0.9583	—
4月末日	2,588	—	0.9729	—
5月末日	2,599	—	0.9976	—
6月末日	2,480	—	1.0398	—
7月末日	2,337	—	1.0475	—
8月末日	2,298	—	1.0558	—
9月末日	2,206	—	1.0328	—
10月末日	2,129	—	1.0077	—
11月末日	2,064	—	1.0626	—
12月末日	2,000	—	1.0767	—
2024年1月末日	2,029	—	1.1079	—

② 【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金 (円)
第1期	2021年11月18日～2022年7月20日	0.0000
第2期	2022年7月21日～2023年7月20日	0.0000
当中間期	2023年7月21日～2024年1月20日	—

③ 【収益率の推移】

期	期間	収益率 (%)
第1期	2021年11月18日～2022年7月20日	△2.81
第2期	2022年7月21日～2023年7月20日	7.12
当中間期	2023年7月21日～2024年1月20日	5.15

(注)各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額(分配落ち)に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額(分配落ち。以下「前期末基準価額」といいます。)を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。

(4) 【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数 (口)	解約口数 (口)
第1期	2021年11月18日～2022年7月20日	2,879,487,008	103,252,540

第2期	2022年7月21日～2023年7月20日	30,165,358	551,988,172
当中間期	2023年7月21日～2024年1月20日	45,730,638	448,542,798

(注)第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

(参考)

RM国内債券マザーファンド（九州重視型）

以下の運用状況は2024年1月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	395,959,360	33.37
地方債証券	日本	782,374,000	65.94
コール・ローン等・その他資産（負債控除後）	—	8,208,624	0.69
合計（純資産総額）		1,186,541,984	100.00

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	数量又は額面総額	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	利率（％）	償還期限	投資比率（％）
日本	国債証券	第148回利付国債（5年）	100,000,000	100.14	100,145,000	99.85	99,857,000	0.005	2026/6/20	8.42
日本	地方債証券	令和4年度第1回宮崎県公募公債	100,000,000	100.15	100,151,000	99.69	99,696,000	0.210	2027/11/30	8.40
日本	地方債証券	令和3年度第1回鹿児島県公募公債	100,000,000	99.67	99,678,000	99.48	99,484,000	0.001	2026/10/29	8.38
日本	地方債証券	令和4年度第1回鹿児島県公募公債	100,000,000	99.89	99,893,000	99.48	99,481,000	0.145	2027/10/29	8.38
日本	地方債証券	令和4年度第3回熊本県公募公債	100,000,000	98.50	98,501,000	97.57	97,570,000	0.444	2032/10/28	8.22
日本	地方債証券	令和4年度第2回大分県公募公債	100,000,000	98.50	98,500,000	97.56	97,569,000	0.444	2032/10/29	8.22
日本	地方債証券	令和3年度第4回熊本県公募公債	100,000,000	96.64	96,640,000	96.24	96,241,000	0.135	2031/10/28	8.11
日本	地方債証券	令和3年度第2回大分県公募公債	100,000,000	96.63	96,639,000	96.24	96,240,000	0.135	2031/10/29	8.11
日本	地方債証券	令和3年度第1回宮崎県公募公債	100,000,000	96.52	96,529,000	96.09	96,093,000	0.130	2031/11/28	8.10
日本	国債証券	第450回利付国債（2年）	80,000,000	100.01	80,014,400	100.00	80,000,000	0.005	2025/7/1	6.74
日本	国債証券	第353回利付国債（10年）	80,000,000	99.78	79,827,200	99.06	79,248,800	0.100	2028/12/20	6.68
日本	国債証券	第143回利付国債（5年）	78,000,000	100.28	78,218,400	100.15	78,118,560	0.100	2025/3/20	6.58
日本	国債証券	第360回利付国債（10年）	50,000,000	98.73	49,367,500	98.09	49,046,500	0.100	2030/9/20	4.13
日本	国債証券	第367回日本国債（10年）	10,000,000	98.10	9,810,900	96.88	9,688,500	0.200	2032/6/20	0.82

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
----	---------

国債証券	33.37
地方債証券	65.94
合 計	99.31

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。

RM米ドル建SDGs債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

以下の運用状況は2024年1月31日現在です。

- ・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	アメリカ	76,823,115	3.28
特殊債券	ドイツ	135,616,498	5.80
	国際機関	2,046,494,672	87.47
	小計	2,182,111,170	93.27
コール・ローン等・その他資産（負債控除後）	—	80,688,534	3.45
合計（純資産総額）		2,339,622,819	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	売建	—	2,249,883,698	△96.16

(注) 為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

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	数量又は額面総額	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	利率（%）	償還期限	投資比率（%）
国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000	15,286.47	152,864,751	15,412.92	154,129,287	4.750	2033/11/14	6.59
国際機関	特殊債券	EUROPEAN BK RECON & DEV	1,000,000	14,188.67	141,886,702	14,420.90	144,209,018	1.625	2024/9/27	6.16
国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000	14,424.04	144,240,424	14,409.84	144,098,448	2.875	2025/6/13	6.16
国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000	14,718.87	147,188,784	14,382.57	143,825,730	3.625	2029/9/21	6.15
国際機関	特殊債券	INTER-AMERICAN DEVEL BK	1,000,000	14,610.26	146,102,601	14,288.66	142,886,662	3.500	2029/9/14	6.11
国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000	14,450.96	144,509,626	14,268.71	142,687,153	3.125	2027/6/15	6.10
国際機関	特殊債券	INTL FINANCE CORP	1,000,000	14,069.56	140,695,600	14,075.94	140,759,423	2.125	2026/4/7	6.02
国際機関	特殊債券	INTER-AMERICAN DEVEL BK	1,000,000	14,445.33	144,453,354	13,944.73	139,447,360	3.500	2033/4/12	5.96
国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000	13,586.68	135,866,871	13,765.39	137,653,944	0.500	2025/10/28	5.88
ドイツ	特殊債券	KFW	1,000,000	13,488.03	134,880,387	13,561.64	135,616,498	1.000	2026/10/1	5.80
国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000	13,257.81	132,578,138	13,187.69	131,876,948	1.375	2028/4/20	5.64
国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000	13,435.64	134,356,436	13,068.44	130,684,462	2.500	2032/3/29	5.59
国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000	12,959.49	129,594,937	12,901.99	129,019,902	1.125	2028/9/13	5.51

国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000	12,560.80	125,608,061	12,304.16	123,041,640	1.625	2031/11/3	5.26
国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000	12,305.65	123,056,505	12,133.44	121,334,479	0.875	2030/5/17	5.19
国際機関	特殊債券	INTER-AMERICAN DEVEL BK	1,000,000	12,302.20	123,022,022	12,084.02	120,840,216	1.125	2031/1/13	5.16
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	340,000	12,265.83	41,703,827	12,555.87	42,689,961	1.625	2031/5/15	1.82
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	100,000	14,674.88	14,674,880	14,660.47	14,660,475	3.875	2027/12/31	0.63
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	90,000	14,566.13	13,109,522	14,840.30	13,356,271	4.125	2032/11/15	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	40,000	15,194.70	6,077,880	15,291.02	6,116,408	4.500	2033/11/15	0.26

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	3.28
特殊債券	93.27
合計	96.55

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	名称	建別	数量	契約額等 (円)	評価額 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	米ドル	売建	15,300,200.00	2,264,480,088	2,249,883,698	△96.16

(注) 為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

RMユーロ建SDGs債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

以下の運用状況は2024年1月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	フランス	79,051,667	4.94
特殊債券	ドイツ	142,085,674	8.88
	国際機関	1,323,330,069	82.70
	小計	1,465,415,743	91.58
コール・ローン等・その他資産（負債控除後）	—	55,739,025	3.48
合計（純資産総額）		1,600,206,435	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	売建	—	1,533,039,404	△95.80

（注）為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

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	数量又は額面総額	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	利率（%）	償還期限	投資比率（%）
国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000	15,762.59	157,625,960	16,143.82	161,438,205	2.900	2033/1/19	10.09
国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000	15,913.33	159,133,357	15,896.49	158,964,909	2.750	2034/1/16	9.93
国際機関	特殊債券	ASIAN DEVELOPMENT BANK	1,000,000	15,054.21	150,542,168	15,386.79	153,867,944	0.350	2025/7/16	9.62
国際機関	特殊債券	EUROPEAN UNION	1,000,000	14,905.60	149,056,047	15,257.39	152,573,947	0.000	2025/11/4	9.53
国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000	14,374.34	143,743,443	14,814.40	148,144,058	0.000	2027/1/15	9.26
国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000	14,115.81	141,158,168	14,539.52	145,395,293	0.000	2027/11/15	9.09
ドイツ	特殊債券	KFW	1,000,000	13,799.38	137,993,801	14,208.56	142,085,674	0.000	2028/9/15	8.88
国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000	13,349.73	133,497,334	13,815.60	138,156,011	0.050	2029/11/15	8.63
国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000	12,884.30	128,843,037	13,407.48	134,074,856	0.010	2030/11/15	8.38
国際機関	特殊債券	INTL DEVELOPMENT ASSOC	1,000,000	12,522.93	125,229,315	13,071.48	130,714,846	0.000	2031/7/15	8.17
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	160,000	15,864.92	25,383,879	15,917.36	25,467,787	2.250	2024/5/25	1.59
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	110,000	13,875.79	15,263,377	14,435.05	15,878,558	0.500	2029/5/25	0.99
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	100,000	15,735.74	15,735,748	15,786.38	15,786,380	1.750	2024/11/25	0.99
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	110,000	12,634.22	13,897,650	13,084.47	14,392,921	0.000	2031/11/25	0.90
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	10,000	16,923.23	1,692,323	16,986.48	1,698,648	3.500	2033/11/25	0.11

フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	10,000	15,008.39	1,500,839	15,259.73	1,525,973	0.500	2026/5/25	0.10
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	10,000	15,009.98	1,500,998	15,252.21	1,525,221	1.000	2027/5/25	0.10
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	10,000	14,592.46	1,459,246	14,885.69	1,488,569	0.750	2028/5/25	0.09
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	10,000	12,922.38	1,292,238	12,876.10	1,287,610	0.000	2032/5/25	0.08

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	4.94
特殊債券	91.58
合 計	96.52

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	名称	建別	数量	契約額等 (円)	評価額 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	ユーロ	売建	9,607,900.00	1,550,410,584	1,533,039,404	△95.80

(注) 為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

RM新興国債券マザーファンド

以下の運用状況は2024年1月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資信託受益証券	アメリカ	2,334,427,881	18.95
	アイルランド	9,951,867,660	80.80
	小計	12,286,295,541	99.75
コール・ローン等・その他資産（負債控除後）	—	30,244,130	0.25
合計（純資産総額）		12,316,539,671	100.00

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	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アイルランド	投資信託受益証券	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	1,523,547	6,536.28	9,958,330,587	6,532.03	9,951,867,660	80.80
アメリカ	投資信託受益証券	VANECK J.P.MORGAN EM LOCAL	630,832	3,690.22	2,327,912,333	3,700.55	2,334,427,881	18.95

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	99.75
合計	99.75

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。

RM国内株式ESGマザーファンド

以下の運用状況は2024年1月31日現在です。

- ・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	4,213,032,360	96.63
投資証券	日本	32,982,400	0.76
コール・ローン等・その他資産（負債控除後）	—	113,880,002	2.61
合計（純資産総額）		4,359,894,762	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	日本	120,014,500	2.75

(注)先物取引は、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

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	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	123,100	2,795.97	344,184,114	3,000.00	369,300,000	8.47
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	14,600	13,029.51	190,230,874	14,695.00	214,547,000	4.92
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	5,500	24,475.45	134,614,976	27,865.00	153,257,500	3.52
日本	株式	日立製作所	電気機器	10,800	10,517.10	113,584,700	11,675.00	126,090,000	2.89
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	14,700	7,489.38	110,093,910	7,700.00	113,190,000	2.60
日本	株式	任天堂	その他製品	12,100	7,008.94	84,808,287	8,310.00	100,551,000	2.31
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	16,700	5,548.17	92,654,500	5,927.00	98,980,900	2.27
日本	株式	第一三共	医薬品	21,500	4,048.65	87,046,100	4,423.00	95,094,500	2.18
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	13,800	6,002.48	82,834,300	6,752.00	93,177,600	2.14
日本	株式	KDDI	情報・通信業	17,400	4,675.74	81,357,890	4,897.00	85,207,800	1.95
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	20,900	3,733.02	78,020,265	3,930.00	82,137,000	1.88
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	2,000	37,307.00	74,614,000	39,740.00	79,480,000	1.82
日本	株式	HOYA	精密機器	4,100	16,704.43	68,488,200	18,945.00	77,674,500	1.78
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	28,000	2,579.78	72,234,032	2,702.00	75,656,000	1.74
日本	株式	ダイキン工業	機械	3,100	22,937.51	71,106,300	23,885.00	74,043,500	1.70
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	12,700	5,114.30	64,951,688	5,502.00	69,875,400	1.60
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	33,400	1,799.35	60,098,370	1,963.50	65,580,900	1.50

日本	株式	村田製作所	電気機器	20,000	2,920.45	58,409,045	3,015.00	60,300,000	1.38
日本	株式	アドバンテスト	電気機器	8,900	4,677.77	41,632,193	5,823.00	51,824,700	1.19
日本	株式	ファナック	電気機器	11,100	4,166.54	46,248,628	4,117.00	45,698,700	1.05
日本	株式	小松製作所	機械	10,700	3,828.98	40,970,135	4,245.00	45,421,500	1.04
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	6,600	6,042.34	39,879,483	6,444.00	42,530,400	0.98
日本	株式	丸紅	卸売業	16,600	2,354.21	39,079,950	2,541.50	42,188,900	0.97
日本	株式	ルネサスエレクトロニクス	電気機器	17,000	2,565.84	43,619,395	2,472.00	42,024,000	0.96
日本	株式	富士通	電気機器	2,000	21,141.75	42,283,500	20,840.00	41,680,000	0.96
日本	株式	富士フイルムホールディングス	化学	4,300	8,682.19	37,333,440	9,410.00	40,463,000	0.93
日本	株式	オリックス	その他金融業	13,600	2,745.81	37,343,040	2,868.50	39,011,600	0.89
日本	株式	三井不動産	不動産業	10,300	3,493.31	35,981,138	3,728.00	38,398,400	0.88
日本	株式	三菱重工業	機械	3,700	8,513.97	31,501,700	9,942.00	36,785,400	0.84
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	21,000	1,812.71	38,067,018	1,725.00	36,225,000	0.83

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率 (%)
株式	国内	鉱業	0.53
		建設業	1.70
		食料品	3.19
		繊維製品	0.36
		化学	5.82
		医薬品	4.41
		石油・石炭製品	0.46
		ゴム製品	0.99
		ガラス・土石製品	0.45
		鉄鋼	1.36
		非鉄金属	0.56
		金属製品	0.15
		機械	5.52
		電気機器	21.94
		輸送用機器	8.95
		精密機器	2.17
		その他製品	2.98
		電気・ガス業	1.08
		陸運業	2.28
		海運業	0.65
		空運業	0.14
		倉庫・運輸関連業	0.02
情報・通信業	4.96		
卸売業	3.45		
小売業	3.97		
銀行業	5.33		

		証券、商品先物取引業	0.99
		保険業	3.52
		その他金融業	0.96
		不動産業	2.42
		サービス業	5.34
投資証券	—	—	0.76
合 計			97.39

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	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等 (円)	評価額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物	買建	3	日本円	74,181,650	76,605,000	1.76
	大阪取引所	ミニTOPIX先物	買建	17	日本円	42,804,620	43,409,500	1.00

(注) 先物取引は、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

RM先進国株式ESGマザーファンド

以下の運用状況は2024年1月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

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	6,607,618,127	69.11
	カナダ	319,974,225	3.35
	ドイツ	124,964,368	1.31
	イタリア	44,326,117	0.46
	フランス	332,396,115	3.48
	オランダ	217,737,852	2.28
	スペイン	45,421,595	0.48
	ベルギー	6,923,641	0.07
	オーストリア	3,959,836	0.04
	ルクセンブルク	2,487,759	0.03
	フィンランド	27,567,375	0.29
	アイルランド	265,941,030	2.78
	ポルトガル	4,174,949	0.04
	イギリス	339,995,376	3.56
	スイス	239,204,025	2.50
	スウェーデン	77,614,696	0.81
	ノルウェー	28,349,541	0.30
	デンマーク	161,924,462	1.69
	ケイマン	2,797,878	0.03
	オーストラリア	125,261,449	1.31
	バミューダ	11,050,215	0.12
	ニュージーランド	8,522,777	0.09
	香港	41,820,291	0.44
	シンガポール	15,546,475	0.16
	イスラエル	4,028,905	0.04
	キュラソー	22,383,615	0.23
ジャージー	27,941,330	0.29	
小計		9,109,934,024	95.29
投資証券	アメリカ	165,282,089	1.73
	カナダ	1,190,090	0.01
	フランス	3,554,558	0.04
	イギリス	4,118,472	0.04
	オーストラリア	22,310,706	0.23

	シンガポール	2,385,647	0.02
	小計	198,841,562	2.08
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	—	251,876,549	2.63
合計(純資産総額)		9,560,652,135	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	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	230,113,811	2.41
	買建	ドイツ	50,607,302	0.53

(注)先物取引は、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建	—	131,733,644	1.38

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

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	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	15,200	55,878.84	849,358,513	60,287.45	916,369,308	9.58
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	5,319	71,464.64	380,120,472	92,623.03	492,661,934	5.15
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	12,776	20,238.58	258,568,179	22,347.92	285,517,064	2.99
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	11,249	20,470.27	230,270,113	22,582.52	254,030,852	2.66
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	6,158	34,555.31	212,791,607	28,269.10	174,081,146	1.82
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	1,738	88,891.52	154,493,475	95,166.79	165,399,897	1.73
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	3,463	37,671.35	130,455,908	40,893.48	141,614,130	1.48
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	5,187	22,587.78	117,162,842	23,426.51	121,513,326	1.27
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	金融サービス	1,814	61,077.82	110,795,177	65,687.78	119,157,641	1.25
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	5,078	22,311.60	113,298,339	23,237.64	118,000,784	1.23
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	一般消費財・サービス流通・小売	2,155	46,294.54	99,764,749	52,690.10	113,547,176	1.19

			り						
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	7,033	15,388.95	108,230,492	16,056.37	112,924,464	1.18
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	868	101,620.97	88,207,002	128,183.96	111,263,678	1.16
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	5,466	15,177.07	82,957,870	17,950.93	98,119,800	1.03
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	981	91,300.52	89,565,812	92,655.49	90,895,044	0.95
アメリカ	株式	SALESFORCE INC	ソフトウェア・サービス	2,096	33,679.61	70,592,482	42,454.56	88,984,761	0.93
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	8,865	8,652.30	76,702,727	8,838.24	78,351,042	0.82
フランス	株式	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	耐久消費財・アパレル	595	112,658.60	67,031,867	125,096.53	74,432,441	0.78
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	2,967	24,956.23	74,045,139	25,027.43	74,256,388	0.78
アイルランド	株式	ACCENTURE PLC-CL A	ソフトウェア・サービス	1,352	49,536.04	66,972,737	54,785.31	74,069,746	0.77
スイス	株式	NOVARTIS AG-REG	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	4,417	14,917.84	65,892,121	15,848.63	70,003,400	0.73
アメリカ	株式	MCDONALD'S CORP	消費者サービス	1,571	41,836.73	65,725,517	43,475.60	68,300,179	0.71
イギリス	株式	ASTRAZENECA PLC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	3,341	19,110.26	63,847,393	19,830.75	66,254,548	0.69
アイルランド	株式	LINDE PLC	素材	1,052	61,059.28	64,234,371	60,178.26	63,307,537	0.66
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア・娯楽	8,883	6,287.64	55,853,111	6,883.20	61,143,532	0.64
アメリカ	株式	INTUIT INC	ソフトウェア・サービス	604	83,740.37	50,579,185	95,571.08	57,724,936	0.60
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	9,019	6,524.32	58,842,887	6,332.84	57,115,938	0.60
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	9,077	5,539.65	50,283,405	6,266.44	56,880,553	0.59
アメリカ	株式	WALT DISNEY CO/THE	メディア・娯楽	3,950	14,135.29	55,834,420	14,303.49	56,498,813	0.59
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	1,511	32,756.59	49,495,218	36,142.37	54,611,125	0.57

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／国外	業種	投資比率 (%)
株式	国外	エネルギー	3.01
		素材	3.84
		資本財	5.85
		商業・専門サービス	1.80
		運輸	2.39
		自動車・自動車部品	2.24
		耐久消費財・アパレル	2.29
		消費者サービス	1.63
		メディア・娯楽	7.53
		一般消費財・サービス流通・小売り	3.22
		生活必需品流通・小売り	0.87
		食品・飲料・タバコ	2.68
		家庭用品・パーソナル用品	2.86
		ヘルスケア機器・サービス	2.45
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.70
		銀行	3.43
		金融サービス	7.45
		保険	3.41
		ソフトウェア・サービス	16.30
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	0.58
電気通信サービス	1.11		
公益事業	1.66		
半導体・半導体製造装置	8.72		
不動産管理・開発	0.27		
投資証券	—	—	2.08
合計			97.37

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	名称	建別	数量	通貨	契約額等 (各通貨)	契約額等 (円)	評価額 (各通貨)	評価額 (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	SP500MIN2403	買建	3	米ドル	733,525	108,231,614	742,650	109,578,006	1.15
	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP500MIC2403	買建	33	米ドル	808,437.5	119,284,951	816,915	120,535,805	1.26
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	STX E6002403	買建	13	ユーロ	312,240	49,949,029	316,355	50,607,302	0.53

(注)先物取引は、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等 (円)	評価額 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	米ドル	買建	693,000.00	102,312,399	102,213,635	1.07
	カナダドル	買建	40,000.00	4,401,884	4,400,538	0.05
	ユーロ	買建	80,000.00	12,809,937	12,794,064	0.13
	英ポンド	買建	25,000.00	4,694,383	4,682,272	0.05
	スイスフラン	買建	15,000.00	2,566,026	2,567,281	0.03
	スウェーデンクローナ	買建	100,000.00	1,417,050	1,416,720	0.01
	デンマーククローネ	買建	80,000.00	1,714,488	1,716,416	0.02
	オーストラリアドル	買建	20,000.00	1,951,308	1,942,718	0.02

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

RM新興国株式マザーファンド

以下の運用状況は2024年1月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

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	96,599,557	0.30
	メキシコ	815,533,002	2.56
	ブラジル	1,716,656,804	5.39
	チリ	145,060,285	0.46
	コロンビア	34,949,688	0.11
	ペルー	15,640,586	0.05
	オランダ	18,182,872	0.06
	ルクセンブルク	34,227,256	0.11
	ギリシャ	156,215,265	0.49
	イギリス	32,849,086	0.10
	トルコ	216,248,822	0.68
	チェコ	45,458,698	0.14
	キプロス	0	0.00
	ハンガリー	82,769,325	0.26
	ポーランド	265,190,731	0.83
	ロシア	0	0.00
	ケイマン	4,248,700,008	13.34
	バミューダ	127,834,456	0.40
	香港	260,130,837	0.82
	シンガポール	6,710,738	0.02
	マレーシア	417,133,781	1.31
	タイ	510,984,275	1.60
	フィリピン	194,692,880	0.61
	インドネシア	587,157,935	1.84
	韓国	3,714,193,142	11.66
	台湾	4,931,522,069	15.48
	中国	3,069,499,533	9.63
	インド	5,399,365,571	16.95
	カザフスタン	0	0.00
	カタール	271,045,672	0.85
	エジプト	28,098,401	0.09
	南アフリカ	839,087,711	2.63
英ヴァージン諸島	0	0.00	

	アラブ首長国連邦	398,183,410	1.25
	クウェート	258,421,459	0.81
	サウジアラビア	1,326,964,084	4.17
	小計	30,265,307,939	95.00
投資証券	メキシコ	40,231,330	0.13
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	—	1,552,935,671	4.87
合計(純資産総額)		31,858,474,940	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	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	1,586,904,657	4.98

(注)先物取引は、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建	—	93,939,154	0.29

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

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	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	746,000	2,969.72	2,215,413,209	3,040.76	2,268,413,525	7.12
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	144,760	8,206.60	1,187,987,416	8,239.86	1,192,803,581	3.74
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	202,000	5,317.56	1,074,148,332	5,166.60	1,043,654,412	3.28
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	一般消費財・サービス流通・小売り	493,240	1,369.96	675,720,057	1,342.60	662,224,271	2.08
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	92,326	4,811.07	444,187,080	5,039.29	465,258,181	1.46
ケイマン	株式	PDD HOLDINGS INC	一般消費財・サービス流通・小売り	18,115	21,320.97	386,229,462	18,485.06	334,856,934	1.05
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	100,802	2,998.96	302,301,771	2,956.09	297,980,339	0.94
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	157,276	1,788.56	281,298,820	1,820.25	286,281,796	0.90
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	2,912,000	86.42	251,668,435	87.74	255,514,896	0.80
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	16,574	15,692.35	260,085,009	15,182.21	251,629,949	0.79
インド	株式	HDFC BANK LIMITED	銀行	85,145	2,606.06	221,893,064	2,585.29	220,125,113	0.69
ブラジル	株式	VALE SA	素材	103,404	2,082.65	215,355,015	2,049.28	211,904,405	0.67

台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	45,800	4,433.27	203,043,785	4,561.15	208,900,817	0.66
サウジアラビア	株式	AL RAJHI BANK	銀行	59,527	3,464.13	206,209,802	3,472.02	206,678,994	0.65
ケイマン	株式	MEITUAN	消費者サービス	153,810	1,326.56	204,038,347	1,234.09	189,816,613	0.60
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	27,802	6,876.82	191,189,405	6,802.98	189,136,575	0.59
台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	378,800	476.00	180,311,906	483.11	183,003,129	0.57
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	エネルギー	144,500	1,128.62	163,086,605	1,201.32	173,591,656	0.54
ケイマン	株式	NETEASE INC	メディア・娯楽	58,600	2,939.94	172,280,836	2,877.67	168,631,755	0.53
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	25,017	6,720.53	168,127,749	6,631.82	165,908,241	0.52
インドネシア	株式	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	銀行	1,682,000	89.53	150,597,870	90.71	152,574,220	0.48
サウジアラビア	株式	THE SAUDI NATIONAL BANK	銀行	89,368	1,700.54	151,973,993	1,659.16	148,275,900	0.47
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	銀行	147,100	965.35	142,003,209	966.24	142,134,693	0.45
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	エネルギー	113,000	1,169.14	132,113,719	1,256.44	141,978,479	0.45
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	一般消費財・サービス流通・小売り	5,667	25,041.49	141,910,180	25,006.88	141,713,997	0.44
中国	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	1,971,000	70.57	139,100,960	71.89	141,704,454	0.44
インド	株式	BHARTI AIRTEL LTD	電気通信サービス	68,294	2,130.01	145,466,937	2,073.98	141,640,629	0.44
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	2,405,000	55.47	133,424,108	55.66	133,877,932	0.42
インド	株式	LARSEN & TOUBRO LTD	資本財	20,521	6,424.66	131,840,612	6,503.60	133,460,519	0.42
ケイマン	株式	BAIDU INC-CLASS A	メディア・娯楽	68,280	1,983.23	135,415,422	1,951.15	133,225,068	0.42

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／国外	業種	投資比率 (%)
株式	国外	エネルギー	5.30
		素材	7.06
		資本財	4.46
		商業・専門サービス	0.06
		運輸	1.91
		自動車・自動車部品	3.42
		耐久消費財・アパレル	1.14
		消費者サービス	1.97
		メディア・娯楽	5.53

		一般消費財・サービス流通・小売り	4.99
		生活必需品流通・小売り	1.42
		食品・飲料・タバコ	3.43
		家庭用品・パーソナル用品	0.77
		ヘルスケア機器・サービス	1.00
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.44
		銀行	16.61
		金融サービス	2.82
		保険	2.39
		ソフトウェア・サービス	2.65
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8.56
		電気通信サービス	2.80
		公益事業	2.68
		半導体・半導体製造装置	10.22
		不動産管理・開発	1.37
投資証券	—	—	0.13
合 計			95.13

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	名称	建別	数量	通貨	契約額等 (各通貨)	契約額等 (円)	評価額 (各通貨)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	インターコンチネンタル取引所	MSCIEMG 2403	買建	218	米ドル	10,818,695	1,596,298,453	10,755,030	1,586,904,657	4.98

(注) 先物取引は、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	買建	637,000.00	94,099,345	93,939,154	0.29

(注) 為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

RM国内リートマザーファンド

以下の運用状況は2024年1月31日現在です。

- ・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	日本	50,062,893,400	98.77
コール・ローン等・その他資産（負債控除後）	—	622,190,049	1.23
合計（純資産総額）		50,685,083,449	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
不動産投信指数先物取引	買建	日本	648,318,000	1.28

(注)先物取引は、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

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	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	5,700	591,032.18	3,368,883,426	597,000	3,402,900,000	6.71
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	5,019	562,031.11	2,820,834,164	566,000	2,840,754,000	5.60
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	15,800	160,011.23	2,528,177,560	161,400	2,550,120,000	5.03
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	23,420	99,899.23	2,339,640,010	100,200	2,346,684,000	4.63
日本	投資証券	KDX不動産投資法人	14,061	163,657.95	2,301,194,512	160,200	2,252,572,200	4.44
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	8,512	272,154.62	2,316,580,188	262,600	2,235,251,200	4.41
日本	投資証券	GLP投資法人	16,504	133,577.32	2,204,560,188	131,700	2,173,576,800	4.29
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	7,365	253,744.64	1,868,829,298	260,700	1,920,055,500	3.79
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	9,735	169,021.12	1,645,420,656	170,600	1,660,791,000	3.28
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	10,930	150,100.9	1,640,602,865	149,400	1,632,942,000	3.22
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	4,794	328,516.86	1,574,909,855	325,000	1,558,050,000	3.07
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	23,657	61,099.34	1,445,427,168	60,700	1,435,979,900	2.83
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	16,356	75,308.42	1,231,744,676	75,900	1,241,420,400	2.45
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	3,341	351,517.79	1,174,420,950	353,500	1,181,043,500	2.33
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	14,682	78,005.59	1,145,278,100	78,500	1,152,537,000	2.27
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	1,687	609,027.06	1,027,428,653	614,000	1,035,818,000	2.04
日本	投資証券	アクティビア・プロパティーズ投資法人	2,563	407,976.82	1,045,644,612	402,000	1,030,326,000	2.03
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	7,455	138,783.01	1,034,627,389	133,600	995,988,000	1.97
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	6,246	149,204.75	931,932,925	149,400	933,152,400	1.84
日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	2,032	461,954.58	938,691,713	442,500	899,160,000	1.77
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法	3,130	281,881.05	882,287,693	272,800	853,864,000	1.68

		人						
日本	投資証券	イオンリート投資法人	5,993	141,498.52	848,000,666	138,900	832,427,700	1.64
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	1,813	438,962.99	795,839,906	436,000	790,468,000	1.56
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	5,745	139,501.32	801,435,122	137,200	788,214,000	1.56
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	7,195	106,599.06	766,980,245	106,100	763,389,500	1.51
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	2,403	316,483.14	760,508,989	309,500	743,728,500	1.47
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	4,571	156,596.63	715,803,238	155,300	709,876,300	1.40
日本	投資証券	森トラストリート投資法人	9,418	74,007.16	696,999,474	74,900	705,408,200	1.39
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	1,012	618,021.93	625,438,197	629,000	636,548,000	1.26
日本	投資証券	三菱地所物流リート投資法人	1,687	375,982.31	634,282,168	369,500	623,346,500	1.23

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率 (%)
投資証券	98.77
合計	98.77

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	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等 (円)	評価額 (円)	投資比率 (%)
不動産投信指数先物取引	大阪取引所	東証REIT指数先物	買建	363	日本円	648,862,500	648,318,000	1.28

(注) 先物取引は、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

RM先進国リートマザーファンド

以下の運用状況は2024年1月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

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	525,770,834	0.79
	オーストラリア	43,376,314	0.07
	小計	569,147,148	0.85
投資証券	アメリカ	51,075,866,159	76.56
	カナダ	1,034,621,095	1.55
	ドイツ	26,455,643	0.04
	イタリア	5,069,688	0.01
	フランス	1,202,871,137	1.80
	オランダ	119,436,448	0.18
	スペイン	273,812,514	0.41
	ベルギー	746,098,698	1.12
	アイルランド	27,409,631	0.04
	イギリス	3,191,714,884	4.78
	オーストラリア	4,488,079,069	6.73
	ニュージーランド	197,153,404	0.30
	香港	705,309,651	1.06
	シンガポール	2,289,772,056	3.43
	韓国	117,833,755	0.18
	イスラエル	83,036,464	0.12
	ガンジー	193,658,474	0.29
小計	65,778,198,770	98.60	
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	—	365,020,943	0.55
合計 (純資産総額)		66,712,366,861	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	買建	—	145,408,242	0.22

(注) 為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

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	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
------	----	-----	--------------	-----------------	-----------------	-----------------	-----------------	-----------------

アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	312,774	18,508.67	5,789,031,376	18,669.50	5,839,334,662	8.75
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	31,782	117,334.71	3,729,131,785	124,175.12	3,946,533,950	5.92
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	187,386	12,856.03	2,409,040,319	12,826.52	2,403,510,558	3.60
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	281,567	8,113.77	2,284,571,145	8,141.80	2,292,464,735	3.44
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	110,458	20,876.84	2,306,015,042	20,544.86	2,269,344,367	3.40
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	53,588	42,599.16	2,282,803,813	42,016.33	2,251,571,521	3.38
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	102,534	20,351.57	2,086,728,032	21,279.66	2,181,888,761	3.27
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	350,343	4,476.66	1,568,368,947	4,461.91	1,563,199,636	2.34
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	71,559	21,676.57	1,551,153,708	21,477.37	1,536,899,692	2.30
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	585,336	2,405.68	1,408,132,045	2,456.20	1,437,705,093	2.16
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	48,090	25,973.22	1,249,052,462	26,328.82	1,266,153,050	1.90
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	117,024	8,670.03	1,014,602,527	8,749.71	1,023,926,648	1.53
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	98,932	9,887.32	978,172,886	10,071.76	996,419,657	1.49
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	194,819	4,886.85	952,052,399	4,880.95	950,902,577	1.43
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	52,981	17,819.61	944,100,943	17,883.06	947,462,402	1.42
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	136,285	7,016.00	956,175,900	6,934.84	945,116,032	1.42
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	42,151	18,395.05	775,370,111	18,337.51	772,944,553	1.16
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	39,524	19,780.55	781,806,577	19,177.07	757,954,653	1.14
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	21,741	34,624.08	752,762,188	34,596.04	752,152,690	1.13
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	239,042	2,871.32	686,366,793	2,903.78	694,126,335	1.04
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	415,782	1,591.93	661,895,980	1,642.13	682,770,083	1.02
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	74,090	9,400.41	696,476,414	9,199.74	681,608,922	1.02
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	225,313	2,981.98	671,880,099	3,020.34	680,523,782	1.02
香港	投資証券	LINK REIT	868,100	747.25	648,689,461	743.47	645,413,252	0.97
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	63,145	9,671.90	610,732,283	10,017.16	632,534,168	0.95
アメリカ	投資証券	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	90,494	6,772.54	612,874,687	6,763.69	612,073,544	0.92
アメリカ	投資証券	REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	71,514	7,901.30	565,053,747	7,849.65	561,360,585	0.84
アメリカ	投資証券	AMERICAN HOMES 4 RENT- A	107,758	5,170.15	557,125,239	5,207.03	561,100,162	0.84
アメリカ	投資証券	UDR INC	102,528	5,416.56	555,349,114	5,382.62	551,869,673	0.83
アメリカ	投資証券	REGENCY CENTERS CORP	55,676	9,179.08	511,054,764	9,322.20	519,023,308	0.78

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／国外	業種	投資比率 (%)
株式	国外	エクイティ不動産投資信託 (REIT)	0.85
投資証券	—	—	98.60
合計			99.45

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	名称	建別	数量	契約額等 (円)	評価額 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	米ドル	買建	770,000.00	113,787,359	113,577,185	0.17

	カナダドル	買建	30,000.00	3,299,670	3,299,472	0.00
	ユーロ	買建	60,000.00	9,591,975	9,592,614	0.01
	英ポンド	買建	60,000.00	11,231,034	11,231,418	0.02
	シンガポールドル	買建	70,000.00	7,707,014	7,707,553	0.01

(注) 為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

運用実績

2024年1月31日現在

基準価額・純資産の推移



※基準価額は1万口当たり、運用管理費用(信託報酬)控除後の価額です。
※分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

2022年7月20日	0円
2023年7月20日	0円
—	—
—	—
—	—
設定来累計	0円

主要な資産の状況

■ 資産の組入比率

資産	比率(%)
RM国内債券マザーファンド(九州重視型)	10.3
RM米ドル建SDGs債券マザーファンド(為替ヘッジあり)	14.4
RMユーロ建SDGs債券マザーファンド(為替ヘッジあり)	9.7
RM新興国債券マザーファンド	2.0
RM国内株式ESGマザーファンド	11.8
RM先進国株式ESGマザーファンド	33.9
RM新興国株式マザーファンド	6.2
RM国内リートマザーファンド	3.9
RM先進国リートマザーファンド	7.6
その他	0.3
合計	100.0

※比率はファンドの純資産総額に対する組入比率であり、四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。
※その他には未収・未払項目が含まれるためマイナスとなる場合があります。

■ 通貨別組入比率

通貨	比率(%)
日本円	50.3
米ドル	32.3
ユーロ	3.3
英ポンド	1.7
香港ドル	1.3
その他	11.1
合計	100.0

※比率はファンドの純資産総額に対する組入比率であり、四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。
※上記通貨別組入比率は、各マザーファンドが実質的に保有している株式・債券等の通貨を基準に算出しています。
※為替ヘッジをかけている外貨建資産については、日本円に含めています。

■ 各マザーファンドにおける組入上位銘柄

	国・地域	銘柄名	償還期限	比率(%)
国内債券(九州重視型)	日本	第148回利付国債(5年)	2026/6/20	8.42
	日本	令和4年度第1回宮崎県公債	2027/11/30	8.40
	日本	令和3年度第1回鹿児島県公債	2026/10/29	8.38
米ドル建SDGs債券(為替ヘッジあり)	国際機関	INTL BK RECON & DEVELOP	2033/11/14	6.59
	国際機関	EUROPEAN BK RECON & DEV	2024/9/27	6.16
ユーロ建SDGs債券(為替ヘッジあり)	国際機関	EUROPEAN INVESTMENT BANK	2025/6/13	6.16
	国際機関	INTL BK RECON & DEVELOP	2033/1/19	10.09
新興国債券	国際機関	EUROPEAN INVESTMENT BANK	2034/1/16	9.93
	国際機関	ASIAN DEVELOPMENT BANK	2025/7/16	9.62
国内株式ESG	アイルランド	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	—	80.80
	アメリカ	VANECK J.P.MORGAN EM LOCAL	—	18.95
先進国株式ESG	日本	トヨタ自動車	—	8.47
	日本	ソニーグループ	—	4.92
新興国株式	日本	東京エレクトロン	—	3.52
	アメリカ	MICROSOFT CORP	—	9.58
国内リート	アメリカ	NVIDIA CORP	—	5.15
	アメリカ	ALPHABET INC-CL A	—	2.99
先進国リート	台湾	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	—	7.12
	韓国	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	—	3.74
国内リート	ケイマン	TENCENT HOLDINGS LTD	—	3.28
	日本	日本ビルファンド投資法人	—	6.71
先進国リート	日本	ジャパンリアルエステイト投資法人	—	5.60
	日本	野村不動産マスターファンド投資法人	—	5.03
先進国リート	アメリカ	PROLOGIS INC	—	8.75
	アメリカ	EQUINIX INC	—	5.92
	アメリカ	WELLTOWER INC	—	3.60

※比率は、各マザーファンドの純資産総額に対する組入比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)



※ファンドにベンチマークはありません。
※2021年11月18日が設定期のため、2020年以前の実績はありません。2021年は11月18日から12月末までの騰落率です。2024年は1月末までの騰落率です。
※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※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。
※運用実績については、別途、委託会社のホームページで開示しています。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

(1) 申込方法

販売会社所定の方法でお申し込みください。

(2) コースの選択

収益分配金の受取方法によって、＜分配金再投資コース（自動けいぞく投資コース）＞と＜分配金受取りコース（一般コース）＞の2通りがあります。ただし、販売会社によって取扱コースは異なります。

＜分配金再投資コース（自動けいぞく投資コース）＞

収益分配金を自動的に再投資するコースです。

＜分配金受取りコース（一般コース）＞

収益分配金を再投資せず、その都度受け取るコースです。

(3) 申込みの受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(4) 取扱時間

原則として、午後3時までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の取扱いとなります。

(5) 取得申込不可日

販売会社の営業日であっても、取得申込日が下記のいずれかに該当する場合は、取得の申込みの受付は行ないません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

- ・ニューヨークの銀行の休業日
- ・ニューヨーク証券取引所の休業日
- ・ロンドンの銀行の休業日
- ・ロンドン証券取引所の休業日

(6) 申込金額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額に、申込手数料と当該手数料に係る消費税等相当額を加算した額です。

(7) 申込単位

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

(8) 申込代金の支払い

取得申込者は、申込金額を販売会社が指定する日までに販売会社へお支払いください。

(9) 受付の中止および取消

委託会社は、金融商品取引所*における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得の申込みの受付を中止すること、および既に受け付けた取得の申込みの受付を取り消すことができます。

※金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。

2【換金（解約）手続等】

(1) 解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(2) 取扱時間

原則として、午後3時までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の取扱いとなります。

(3) 解約請求不可日

販売会社の営業日であっても、解約請求日が下記のいずれかに該当する場合は、解約請求の受付は行ないません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

- ・ニューヨークの銀行の休業日
- ・ニューヨーク証券取引所の休業日
- ・ロンドンの銀行の休業日
- ・ロンドン証券取引所の休業日

(4) 解約制限

ファンドの規模および商品性格などに基つき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の解約には受付時間制限および金額制限を行なう場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

(5) 解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

- ・基準価額につきましては、販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

委託会社の照会先
 りそなアセットマネジメント株式会社
 電話番号：0120-223351
 (受付時間は営業日の午前9時～午後5時)
 ホームページ アドレス：https://www.resona-am.co.jp/

(6) 手取額

1口当たりの手取額は、解約価額から解約に係る所定の税金を差し引いた金額となります。
 ※税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。
 詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

(7) 解約単位

販売会社が定める単位とします。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

(8) 解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

(9) 受付の中止および取消

- ・委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止すること、および既に受け付けた解約請求の受付を取り消すことができます。
- ・解約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なった当日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日（この計算日が解約請求を受け付けない日であるときは、この計算日以降の最初の解約請求を受け付けることができる日とします。）に解約請求を受け付けたものとして取り扱います。

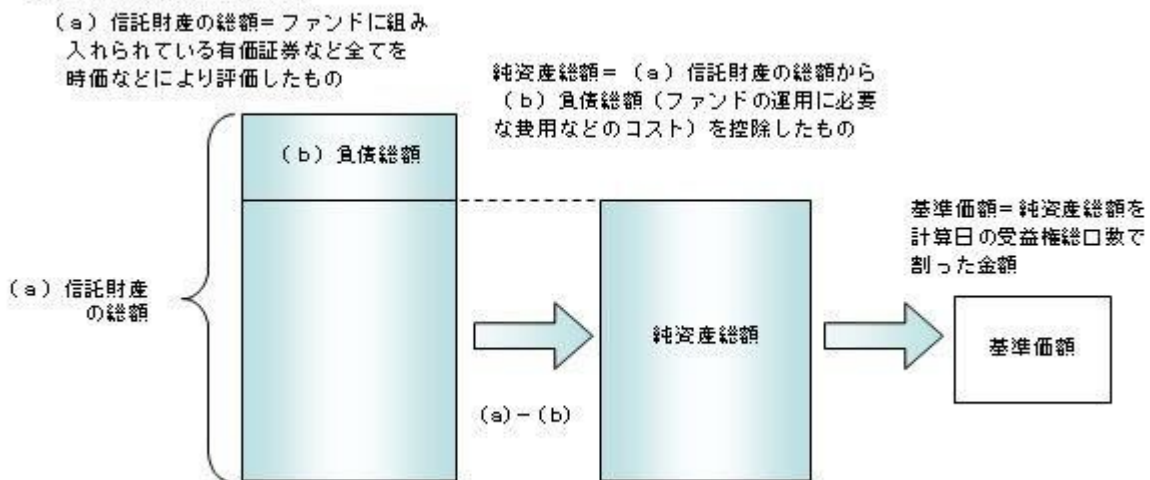
3 【資産管理等の概要】

(1) 【資産の評価】

① 基準価額の算出

- ・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。
- ・基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）を評価して得た信託財産の総額から負債総額を控除した金額（純資産総額）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。なお、ファンドは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。

<基準価額算出の流れ>



② 有価証券などの評価基準

- ・信託財産に属する資産については、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価します。

＜主な資産の評価方法＞

◇マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

◇国内上場株式

原則として、基準価額計算日におけるわが国の金融商品取引所の最終相場で評価します。

◇外国株式

原則として、基準価額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で評価します。

◇公社債（国内・外国）

原則として、基準価額計算日*における以下のいずれかの価額で評価します。

- ・日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）
- ・金融商品取引業者（第一種金融商品取引業者およ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。）、銀行などの提示する価額（売気配相場を除きます。）
- ・価格情報会社の提供する価額

※残存期間1年以内の公社債などについては、一部償却原価法により評価することができます。

*外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

◇国内上場不動産投信

原則として、基準価額計算日におけるわが国の金融商品取引所の最終相場で評価します。

◇海外上場不動産投信

原則として、基準価額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で評価します。

- ・外貨建資産（外国通貨表示の有価証券、預金その他の資産をいいます。）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相場の仲値によって計算します。

③ 基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

委託会社の照会先

りそなアセットマネジメント株式会社

電話番号：0120-223351

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時）

ホームページ アドレス：<https://www.resona-am.co.jp/>

(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11月18日設定）。ただし、約款の規定に基づき、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】

毎年7月21日から翌年7月20日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

(5) 【その他】

① 信託の終了（繰上償還）

- 1) 委託会社は、次のいずれかの場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し繰上償還させることができます。

イ) 信託財産の純資産総額が20億円を下回ることとなったとき

ロ) 繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき

ハ) やむを得ない事情が発生したとき

- 2) この場合、委託会社は書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行いません。（後述の「書面決議」をご覧ください。）

- 3) 委託会社は、次のいずれかの場合には、後述の「書面決議」の規定は適用せず、信託契約を解約し繰上償還

させます。

イ) 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、書面決議が困難な場合

ロ) 監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき

ハ) 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したとき（監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引き継ぐことを命じたときは、書面決議で可決された場合、存続します。）

ニ) 受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合またはその任務に違反するなどして解任された場合に、委託会社が新受託会社を選任できないとき

4) 繰上償還を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

② 償還金について

・償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日（償還日が休業日の場合は翌営業日）から起算して5営業日まで）から受益者に支払います。

・償還金の支払いは、販売会社において行なわれます。

③ 信託約款の変更など

1) 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、この信託約款を変更すること、または当ファンドと他のファンドとの併合（以下「併合」といいます。）を行なうことができます。信託約款の変更または併合を行なう際には、委託会社は、その旨および内容をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

2) この変更事項のうち、その内容が重大なものまたは併合（受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものを除きます。）については、書面決議を行いません。（後述の「書面決議」をご覧ください。）

3) 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、後述の「書面決議」の規定を適用します。

④ 書面決議

1) 繰上償還、信託約款の重大な変更または併合に対して、委託会社は書面決議を行いません。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびにその内容および理由などの事項を定め、決議の日の2週間前までに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発送します。

2) 受益者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、書面決議について賛成するものとみなします。

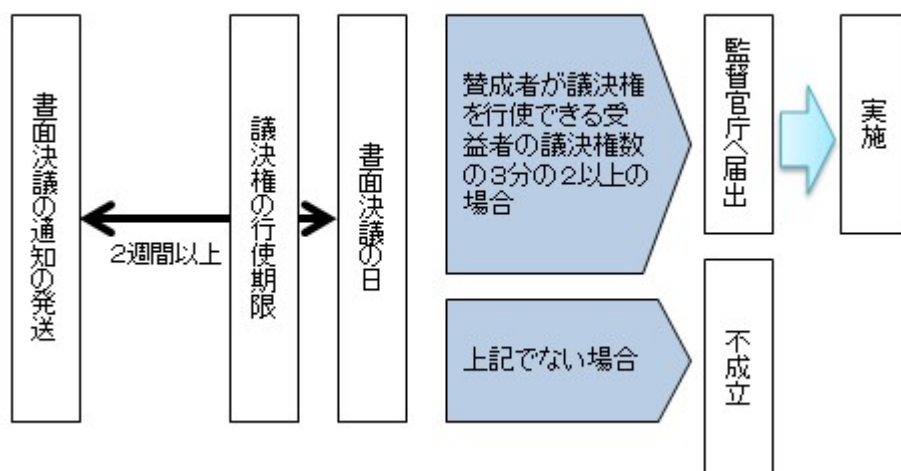
3) 書面決議は、議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。

4) 繰上償還、信託約款の重大な変更または併合に関する委託会社の提案に対して、すべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときは、書面決議を行いません。

5) 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、併合にかかる他のファンドにおいて併合の書面決議が否決された場合は、当該他のファンドとの併合を行なうことはできません。

6) 当ファンドは、受益者からの換金請求に対して、投資信託契約の一部を解約することにより応じることができるため、受益者の保護に欠けるおそれがないものとして、書面決議において反対した受益者からの買取請求は受け付けません。

<書面決議の主な流れ>



⑤ 公告

公告は電子公告により行ない、委託会社のホームページに掲載します。

ホームページアドレス <https://www.resona-am.co.jp/>

※なお、やむを得ない事由によって公告を電子公告によって行なうことができない場合には、公告は日本経済新聞に掲載します。

⑥ 運用報告書の作成

- ・委託会社は、毎期決算後および償還後に期中の運用経過、組入有価証券の内容および有価証券の売買状況などを記載した運用報告書を作成します。
- ・交付運用報告書は、原則として知れている受益者に対して交付されます。
- ・運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページに掲載されます。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の交付請求があった場合には、交付します。

ホームページアドレス <https://www.resona-am.co.jp/>

⑦ 関係法人との契約について

販売会社との募集の取扱いなどに関する契約の有効期間は契約日より1年間とします。ただし、期間満了の3ヵ月前までに、販売会社、委託会社いずれからも別段の意思表示がないときは、自動的に1年間延長されるものとし、以後も同様とします。

⑧ 他の受益者の氏名などの開示の請求の制限

受益者は、委託会社または受託会社に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行なうことはできません。

1. 他の受益者の氏名または名称および住所
2. 他の受益者が有する受益権の内容

4 【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金・償還金受領権

- ・受益者は、ファンドの収益分配金・償還金を、自己に帰属する受益権の口数に応じて受領する権利を有します。
- ・ただし、受益者が収益分配金については支払開始日から5年間、償還金については支払開始日から10年間請求を行わない場合はその権利を失い、その金銭は委託会社に帰属します。

(2) 解約請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき販売会社を通じて、委託会社に解約の請求をすることができます。

(3) 帳簿閲覧権

受益者は、委託会社に対し、その営業時間内にファンドの信託財産に関する帳簿書類の閲覧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)ならびに同規則第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2期計算期間(2022年7月21日から2023年7月20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。

独立監査人の監査報告書

2023年10月3日

りそな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 松崎 雅則
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」に掲げられている九州SDGs・グローバルバランスの2022年7月21日から2023年7月20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、九州SDGs・グローバルバランスの2023年7月20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、りそな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、ファンド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、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

りそな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) 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。

1 【財務諸表】

【九州SDGs・グローバルバランス】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 2022年7月20日現在	第2期 2023年7月20日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	19,048,993	20,280,397
親投資信託受益証券	2,684,332,713	2,341,698,863
未収入金	-	25,689,000
流動資産合計	2,703,381,706	2,387,668,260
資産合計	2,703,381,706	2,387,668,260
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	26,635,393
未払受託者報酬	152,708	418,258
未払委託者報酬	4,937,563	13,523,502
未払利息	51	55
その他未払費用	39,675	84,947
流動負債合計	5,129,997	40,662,155
負債合計	5,129,997	40,662,155
純資産の部		
元本等		
元本	2,776,234,468	2,254,411,654
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△77,982,759	92,594,451
(分配準備積立金)	8,734,406	104,309,026
元本等合計	2,698,251,709	2,347,006,105
純資産合計	2,698,251,709	2,347,006,105
負債純資産合計	2,703,381,706	2,387,668,260

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第1期 自 2021年11月18日 至 2022年7月20日	第2期 自 2022年7月21日 至 2023年7月20日
営業収益		
有価証券売買等損益	△48,285,287	204,315,150
営業収益合計	△48,285,287	204,315,150
営業費用		
支払利息	17,856	13,791
受託者報酬	568,859	854,895
委託者報酬	18,393,004	27,641,389
その他費用	148,755	174,152
営業費用合計	19,128,474	28,684,227
営業利益又は営業損失(△)	△67,413,761	175,630,923
経常利益又は経常損失(△)	△67,413,761	175,630,923
当期純利益又は当期純損失(△)	△67,413,761	175,630,923
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(△)	△3,024,388	19,614,449
期首剰余金又は期首欠損金(△)	-	△77,982,759
剰余金増加額又は欠損金減少額	298,788	15,536,530
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	298,788	15,536,530
剰余金減少額又は欠損金増加額	13,892,174	975,794
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	13,892,174	975,794
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△77,982,759	92,594,451

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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。
-----------------	---------------------------------------

(貸借対照表に関する注記)

第1期 2022年7月20日現在	第2期 2023年7月20日現在
1. 投資信託財産に係る元本の状況	1. 投資信託財産に係る元本の状況
期首元本額 2,064,524,277円	期首元本額 2,776,234,468円
期中追加設定元本額 814,962,731円	期中追加設定元本額 30,165,358円
期中一部解約元本額 103,252,540円	期中一部解約元本額 551,988,172円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 2,776,234,468口	2. 計算期間の末日における受益権の総数 2,254,411,654口
3. 元本の欠損 純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額 77,982,759円	
4. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 0.9719円 1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (9,719円)	3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1.0411円 1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,411円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自2021年11月18日 至2022年7月20日	第2期 自2022年7月21日 至2023年7月20日
分配金の計算過程	分配金の計算過程
A 費用控除後の配当等収益額 8,734,406円	A 費用控除後の配当等収益額 33,956,316円
B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 0円	B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 63,338,605円
C 収益調整金額 625,896円	C 収益調整金額 615,987円
D 分配準備積立金額 0円	D 分配準備積立金額 7,014,105円
E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D) 9,360,302円	E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D) 104,925,013円
F 当ファンドの期末残存口数 2,776,234,468口	F 当ファンドの期末残存口数 2,254,411,654口
G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000) 33円	G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000) 465円
H 10,000口当たり分配金額 0円	H 10,000口当たり分配金額 0円
I 収益分配金金額 (I=F×H/10,000) 0円	I 収益分配金金額 (I=F×H/10,000) 0円

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

第1期 自2021年11月18日 至2022年7月20日	第2期 自2022年7月21日 至2023年7月20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。	1. 金融商品に対する取組方針 同左
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 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。	2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左

<p>これらは、株価変動リスク、金利変動リスク、リートの価格変動リスク、投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。</p> <p>また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。</p>	<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p>
--	------------------------------------

II 金融商品の時価等に関する事項

第1期 2022年7月20日現在	第2期 2023年7月20日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべ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。</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>親投資信託受益証券 (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>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> <p>3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明</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。</p>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>親投資信託受益証券 同左</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左</p> <p>3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>同左</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

第1期 自 2021年11月18日 至 2022年7月20日	第2期 自 2022年7月21日 至 2023年7月20日
該当事項はありません。	同左

(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)

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	第1期 自 2021年11月18日 至 2022年7月20日	第2期 自 2022年7月21日 至 2023年7月20日
	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	△43,727,140	169,154,134
合計	△43,727,140	169,154,134

2 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

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	RM国内債券マザーファンド（九州重視型）	248,049,358	243,956,543	
	RM米ドル建SDGs債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	386,146,040	339,654,056	
	RMユーロ建SDGs債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	263,687,720	230,041,166	
	RM新興国債券マザーファンド	35,686,190	46,224,321	
	RM国内株式ESGマザーファンド	182,517,280	272,607,809	
	RM先進国株式ESGマザーファンド	425,895,319	791,356,092	
	RM新興国株式マザーファンド	83,565,205	144,626,300	
	RM国内リートマザーファンド	62,415,293	90,764,319	
	RM先進国リートマザーファンド	120,203,068	182,468,257	
合計		1,808,165,473	2,341,698,863	

(注) 券面総額欄の数値は口数を表しております。

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「RM国内債券マザーファンド（九州重視型）」、「RM米ドル建SDGs債券マザーファンド（為替ヘッジあり）」、「RMユーロ建SDGs債券マザーファンド（為替ヘッジあり）」、「RM新興国債券マザーファンド」、「RM国内株式ESGマザーファンド」、「RM先進国株式ESGマザーファンド」、「RM新興国株式マザーファンド」、「RM国内リートマザーファンド」および「RM先進国リートマザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同親投資信託の受益証券です。
なお、以下に記載した状況は監査意見の対象外となっております。

RM国内債券マザーファンド（九州重視型）

貸借対照表

(単位：円)

2023年7月20日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	12,904,636
国債証券	425,432,340
地方債証券	786,531,000
未収利息	398,536
流動資産合計	1,225,266,512
資産合計	1,225,266,512
負債の部	
流動負債	
未払利息	35
流動負債合計	35
負債合計	35
純資産の部	
元本等	
元本	1,245,851,646
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△20,585,169
元本等合計	1,225,266,477
純資産合計	1,225,266,477
負債純資産合計	1,225,266,512

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額、又は価格情報会社の提供する価額で評価しております。
-----------------	---

(貸借対照表に関する注記)

2023年7月20日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年7月21日
期首元本額	1,335,668,450円
期中追加設定元本額	10,612,535円
期中一部解約元本額	100,429,339円
期末元本額	1,245,851,646円
期末元本の内訳※	
九州SDGs・グローバルバランス	248,049,358円
りそな国内債券ファンド(九州重視型)(適格機関投資家専用)	997,802,288円
2. 計算日における受益権の総数	1,245,851,646口
3. 元本の欠損	
純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	20,585,169円
4. 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	0.9835円
(10,000口当たり純資産額)	(9,835円)

(注) ※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

2023年7月20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金融商品に係るリスク	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、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

II 金融商品の時価等に関する事項

2023年7月20日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべ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	国債証券、地方債証券 (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。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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)

2023年7月20日現在

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)

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2023年7月20日現在	
	損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		△821,460
地方債証券		△7,363,000
合計		△8,184,460

(注) 損益に含まれた評価差額は、親投資信託受益証券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。

2 デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

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

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第4 2 7 回利付国債 (2年)	88,000,000	88,004,400	
	第1 4 3 回利付国債 (5年)	98,000,000	98,277,340	
	第1 4 8 回利付国債 (5年)	100,000,000	100,145,000	
	第3 5 3 回利付国債 (10年)	80,000,000	79,827,200	
	第3 6 0 回利付国債 (10年)	50,000,000	49,367,500	
	第3 6 7 回日本国債 (10年)	10,000,000	9,810,900	
国債証券合計		426,000,000	425,432,340	
地方債証券	令和3年度第2回大分県公募公債	100,000,000	96,639,000	
	令和4年度第2回大分県公募公債	100,000,000	98,500,000	
	令和3年度第4回熊本県公募公債	100,000,000	96,640,000	
	令和4年度第3回熊本県公募公債	100,000,000	98,501,000	
	令和3年度第1回宮崎県公募公債	100,000,000	96,529,000	
	令和4年度第1回宮崎県公募公債	100,000,000	100,151,000	
	令和3年度第1回鹿児島県公募公債	100,000,000	99,678,000	
	令和4年度第1回鹿児島県公募公債	100,000,000	99,893,000	
地方債証券合計		800,000,000	786,531,000	
合計			1,211,963,340	

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。

RM米ドル建SDGs債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

貸借対照表

（単位：円）

2023年7月20日現在

資産の部	
流動資産	
預金	4,520,478
コール・ローン	30,450,525
国債証券	127,050,230
特殊債券	2,168,065,097
派生商品評価勘定	26,510
未収利息	11,618,718
前払費用	868,912
流動資産合計	2,342,600,470
資産合計	2,342,600,470
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	85,811,466
未払金	1,359,268
未払解約金	1,853,000
未払利息	82
流動負債合計	89,023,816
負債合計	89,023,816
純資産の部	
元本等	
元本	2,562,031,575
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△308,454,921
元本等合計	2,253,576,654
純資産合計	2,253,576,654
負債純資産合計	2,342,600,470

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	国債証券、特殊債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額、又は価格情報会社の提供する価額で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則としてわが国における計算日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	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の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
4. 収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 原則として、約定日基準で計上しております。
5. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 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して整理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。

(貸借対照表に関する注記)

2023 年 7 月 20 日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022 年 7 月 21 日
期首元本額	844,224,449 円
期中追加設定元本額	1,947,417,180 円
期中一部解約元本額	229,610,054 円
期末元本額	2,562,031,575 円
期末元本の内訳※	
埼玉りそな・グローバルバランス・プラス ESG	1,560,489,292 円
九州 SDGs・グローバルバランス	386,146,040 円
ラップ型ファンド・プラス ESG (安定型)	62,803,933 円
ラップ型ファンド・プラス ESG (安定成長型)	230,537,150 円
ラップ型ファンド・プラス ESG (成長型)	23,036,299 円
りそな米ドル建 SDGs 債券ファンド (為替ヘッジあり) (適格機関投資家専用)	299,018,861 円
2. 計算日における受益権の総数	2,562,031,575 口
3. 元本の欠損	
純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	308,454,921 円
4. 計算日における 1 単位当たりの純資産の額	
1 口当たり純資産額	0.8796 円
(10,000 口当たり純資産額)	(8,796 円)

(注) ※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

2023 年 7 月 20 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金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、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。

これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。

デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。

3. 金融商品に係るリスク管理体制

運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。

また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

II 金融商品の時価等に関する事項

2023年7月20日現在

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

貸借対照表上の金融商品は原則としてすべ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

国債証券、特殊債券

(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。

デリバティブ取引

(その他の注記)の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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。

また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算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。

(関連当事者との取引に関する注記)

2023年7月20日現在

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)

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2023年7月20日現在	
	損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		△671,754
特殊債券		△30,168,486
合計		△30,840,240

(注) 損益に含まれた評価差額は、親投資信託受益証券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。

2 デリバティブ取引に関する注記

(通貨関連)

(2023年7月20日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等	時価		評価損益
			うち1年超		

市場取引以外の 取引	為替予約取引 売建	2,211,886,485	—	2,297,671,441	△85,784,956
	米ドル	2,211,886,485	—	2,297,671,441	△85,784,956
合計		2,211,886,485	—	2,297,671,441	△85,784,956

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

1) 計算日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については以下のように評価しております。

① 計算日において為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます）の対顧客先物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で評価しております。

② 計算日において当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、当該日に最も近い前後二つの対顧客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。
- ・ 計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

2) 計算日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については計算日の対顧客相場の仲値で評価しております。

※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

該当事項はありません。

(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
国債証券	米ドル	US TREASURY N/B	170,000.00	169,164.93	
		US TREASURY N/B	420,000.00	359,879.29	
		US TREASURY N/B	370,000.00	380,406.25	
		米ドル 小計	960,000.00	909,450.47 (127,050,230)	
国債証券合計				127,050,230 (127,050,230)	
特殊債券	米ドル	EUROPEAN BK RECON & DEV	1,000,000.00	958,337.65	
		EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000.00	964,135.32	
		EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000.00	865,033.79	
		EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000.00	819,269.94	
		INTER-AMERICAN DEVEL BK	1,000,000.00	973,245.96	
		INTER-AMERICAN DEVEL BK	1,000,000.00	817,185.99	
		INTER-AMERICAN DEVEL BK	1,000,000.00	966,034.34	
		INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000.00	978,170.59	
		INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000.00	911,271.83	
		INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000.00	958,817.34	
		INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000.00	883,058.35	
		INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000.00	862,457.39	
		INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000.00	979,796.64	
		INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000.00	843,333.93	
		INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000.00	898,577.23	
		INTL FINANCE CORP	1,000,000.00	940,084.99	
		KFW	1,000,000.00	900,623.92	
			米ドル 小計	17,000,000.00	15,519,435.20 (2,168,065,097)
	特殊債券合計				2,168,065,097 (2,168,065,097)
合計				2,295,115,327	

	(2, 295, 115, 327)
--	--------------------

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	国債証券 3 銘柄	5.5%	5.5%
	特殊債券 17 銘柄	94.5%	94.5%

(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(その他の注記)の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

RMユーロ建SDGs債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

貸借対照表

（単位：円）

2023年7月20日現在

資産の部	
流動資産	
預金	4,048,721
コール・ローン	32,984,788
国債証券	138,956,263
特殊債券	1,544,453,319
未収利息	3,313,716
前払費用	1,203,652
流動資産合計	1,724,960,459
資産合計	1,724,960,459
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	110,027,474
未払金	966,094
未払解約金	808,000
未払利息	89
流動負債合計	111,801,657
負債合計	111,801,657
純資産の部	
元本等	
元本	1,849,111,108
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△235,952,306
元本等合計	1,613,158,802
純資産合計	1,613,158,802
負債純資産合計	1,724,960,459

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	国債証券、特殊債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額、又は価格情報会社の提供する価額で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則としてわが国における計算日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	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の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
4. 収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 原則として、約定日基準で計上しております。
5. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 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して整理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。

(貸借対照表に関する注記)

2023 年 7 月 20 日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022 年 7 月 21 日
期首元本額	775, 039, 813 円
期中追加設定元本額	1, 366, 824, 450 円
期中一部解約元本額	292, 753, 155 円
期末元本額	1, 849, 111, 108 円
期末元本の内訳※	
埼玉りそな・グローバルバランス・プラス ESG	1, 071, 853, 404 円
九州 SDGs・グローバルバランス	263, 687, 720 円
ラップ型ファンド・プラス ESG (安定型)	42, 702, 010 円
ラップ型ファンド・プラス ESG (安定成長型)	156, 758, 850 円
ラップ型ファンド・プラス ESG (成長型)	15, 450, 545 円
りそなユーロ建 SDGs 債券ファンド (為替ヘッジあり) (適格機関投資家専用)	298, 658, 579 円
2. 計算日における受益権の総数	1, 849, 111, 108 口
3. 元本の欠損	
純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	235, 952, 306 円
4. 計算日における 1 単位当たりの純資産の額	
1 口当たり純資産額	0. 8724 円
(10, 000 口当たり純資産額)	(8, 724 円)

(注) ※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

2023 年 7 月 20 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金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、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。

これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。

デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。

3. 金融商品に係るリスク管理体制

運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。

また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

II 金融商品の時価等に関する事項

2023年7月20日現在

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

貸借対照表上の金融商品は原則としてすべ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

国債証券、特殊債券

(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。

デリバティブ取引

(その他の注記)の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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。

また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算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。

(関連当事者との取引に関する注記)

2023年7月20日現在

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)

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2023年7月20日現在	
	損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		△495,223
特殊債券		△2,675,970
合計		△3,171,193

(注) 損益に含まれた評価差額は、親投資信託受益証券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。

2 デリバティブ取引に関する注記

(通貨関連)

(2023年7月20日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等	時価		評価損益
			うち1年超		

市場取引以外の 取引	為替予約取引 売建	1,574,292,852	—	1,684,320,326	△110,027,474
	ユーロ	1,574,292,852	—	1,684,320,326	△110,027,474
合計		1,574,292,852	—	1,684,320,326	△110,027,474

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

1) 計算日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については以下のように評価しております。

① 計算日において為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます）の対顧客先物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で評価しております。

② 計算日において当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、当該日に最も近い前後二つの対顧客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。
- ・ 計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

2) 計算日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については計算日の対顧客相場の仲値で評価しております。

※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

該当事項はありません。

(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
国債証券	ユーロ	GOV OF FRANCE	160,000.00	158,308.48	
		GOV OF FRANCE	150,000.00	146,871.30	
		GOV OF FRANCE	110,000.00	102,553.44	
		GOV OF FRANCE	100,000.00	93,151.70	
		GOV OF FRANCE	120,000.00	108,730.68	
		GOV OF FRANCE	110,000.00	96,467.85	
		GOV OF FRANCE	110,000.00	87,051.80	
		GOV OF FRANCE	120,000.00	93,461.21	
			ユーロ 小計	980,000.00	886,596.46 (138,956,263)
		国債証券合計		138,956,263 (138,956,263)	
特殊債券	ユーロ	ASIAN DEVELOPMENT BANK	1,000,000.00	938,985.55	
		EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000.00	990,970.00	
		EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000.00	879,208.00	
		EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000.00	833,118.00	
		EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000.00	954,997.00	
		EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000.00	805,724.00	
		EUROPEAN UNION	1,000,000.00	930,337.00	
		INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000.00	894,718.50	
		INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000.00	983,979.00	
		INTL DEVELOPMENT ASSOC	1,000,000.00	783,323.00	
	KFW	1,000,000.00	858,869.00		
		ユーロ 小計	11,000,000.00	9,854,229.05 (1,544,453,319)	
		特殊債券合計		1,544,453,319 (1,544,453,319)	
		合計		1,683,409,582 (1,683,409,582)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
ユーロ	国債証券 8 銘柄	8.3%	8.3%
	特殊債券 11 銘柄	91.7%	91.7%

(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(その他の注記)の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

RM新興国債券マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2023年7月20日現在

資産の部	
流動資産	
預金	6,751,420
コール・ローン	34,495,053
投資信託受益証券	10,132,519,198
未収配当金	212,695,680
流動資産合計	10,386,461,351
資産合計	10,386,461,351
負債の部	
流動負債	
未払解約金	2,707,400
未払利息	93
流動負債合計	2,707,493
負債合計	2,707,493
純資産の部	
元本等	
元本	8,016,360,322
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	2,367,393,536
元本等合計	10,383,753,858
純資産合計	10,383,753,858
負債純資産合計	10,386,461,351

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	投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則としてわが国における計算日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	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の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
4. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 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。 為替予約取引による為替差損益 原則として、約定日基準で計上しております。
5. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 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して整理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。

(貸借対照表に関する注記)

2023 年 7 月 20 日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022 年 7 月 21 日
期首元本額	8,217,837,630 円
期中追加設定元本額	1,908,647,534 円
期中一部解約元本額	2,110,124,842 円
期末元本額	8,016,360,322 円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド(安定型)	796,807,353 円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	923,908,425 円
りそなラップ型ファンド(成長型)	574,429,492 円
DCりそな グローバルバランス	21,325,951 円
つみたてバランスファンド	1,372,083,901 円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	303,158,851 円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	218,805,194 円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	149,121,741 円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	76,956,662 円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	52,390,313 円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	28,867,198 円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	59,940,132 円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	111,489,487 円
九州SDGs・グローバルバランス	35,686,190 円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定型)	3,320,596 円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定成長型)	22,440,648 円
ラップ型ファンド・プラスESG(成長型)	28,436,162 円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定型)	6,900,032 円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定成長型)	7,131,514 円
りそな つみたてラップ型ファンド(成長型)	4,962,069 円
ターゲットリターンバランスファンド(目標2%)	15,642 円

ターゲットリターンバランスファンド (目標3%)	16,302円
ターゲットリターンバランスファンド (目標4%)	16,779円
ターゲットリターンバランスファンド (目標5%)	17,089円
ターゲットリターンバランスファンド (目標6%)	17,324円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2065	37,433円
FWりそな先進国+新興国債券アクティブファンド	51,802,522円
FWりそな新興国債券インデックスファンド	2,477,907,702円
Smart-i 8資産バランス 安定型	76,595,370円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	245,376,010円
Smart-i 8資産バランス 成長型	318,983,804円
りそなVIグローバル・バランスファンド (安定型) (適格機関投資家専用)	9,532,998円
りそなVIグローバル・バランスファンド (安定成長型) (適格機関投資家専用)	4,749,077円
りそなVIグローバル・バランスファンド (成長型) (適格機関投資家専用)	13,150,387円
りそなFT マルチアセットファンド (適格機関投資家専用)	14,899,990円
りそなDAAマルチアセットファンド (適格機関投資家専用)	5,079,982円
2. 計算日における受益権の総数	8,016,360,322口
3. 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.2953円
(10,000口当たり純資産額)	(12,953円)

(注) ※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

2023年7月20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金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、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。 これらは、投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析及び評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

II 金融商品の時価等に関する事項

2023年7月20日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべ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	投資信託受益証券 (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。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	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)

2023年7月20日現在

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)

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2023年7月20日現在	
	損益に含まれた評価差額(円)	
投資信託受益証券		284,201,317
合計		284,201,317

(注) 損益に含まれた評価差額は、親投資信託受益証券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。

2 デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

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	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	米ドル	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	1,275,247	58,355,302.72	
		VANECK J.P.MORGAN EM LOCAL	545,832	14,175,257.04	
	米ドル 小計		1,821,079	72,530,559.76 (10,132,519,198)	
合計				10,132,519,198 (10,132,519,198)	

(注1) 通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

(注2) 合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

(注3) 券面総額欄の数値は口数を表しております。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入投資信託 受益証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	投資信託受益証券 2銘柄	100.0%	100.0%

(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

該当事項はありません。

RM国内株式ESGマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2023年7月20日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	258,270,997
株式	3,221,661,810
投資証券	42,656,700
派生商品評価勘定	1,702,320
未収配当金	3,681,923
差入委託証拠金	10,177,500
流動資産合計	3,538,151,250
資産合計	3,538,151,250
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	426,500
前受金	4,333,000
未払金	940
未払解約金	8,600,000
未払利息	700
流動負債合計	13,361,140
負債合計	13,361,140
純資産の部	
元本等	
元本	2,359,889,618
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	1,164,900,492
元本等合計	3,524,790,110
純資産合計	3,524,790,110
負債純資産合計	3,538,151,250

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	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の取引所の発表する清算値段で評価しております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 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。 派生商品取引等損益 原則として、約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

2023年7月20日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年7月21日
期首元本額	1,950,746,165円
期中追加設定元本額	1,432,968,206円
期中一部解約元本額	1,023,824,753円
期末元本額	2,359,889,618円
期末元本の内訳※	
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	404,943,794円
国内株式ESGインデックス・オープン	93,491,642円
九州SDGs・グローバルバランス	182,517,280円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定型)	11,787,954円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定成長型)	121,766,225円
ラップ型ファンド・プラスESG(成長型)	163,519,559円
Smart-i 国内株式ESGインデックス	790,570,789円
国内株式ESGインデックスファンド(適格機関投資家専用)	591,292,375円
2. 計算日における受益権の総数	2,359,889,618口
3. 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.4936円
(10,000口当たり純資産額)	(14,936円)

(注) ※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

2023年7月20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金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、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。

これらは、株価変動リスク、リートの価格変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。

デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。

3. 金融商品に係るリスク管理体制

運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。

また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

II 金融商品の時価等に関する事項

2023年7月20日現在

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

貸借対照表上の金融商品は原則としてすべ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

株式、投資証券

(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。

デリバティブ取引

(その他の注記)の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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。

また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算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。

(関連当事者との取引に関する注記)

2023年7月20日現在

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)

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2023年7月20日現在	
	損益に含まれた評価差額(円)	
株式		331,506,758
投資証券		△1,091,232
合計		330,415,526

(注)損益に含まれた評価差額は、親投資信託受益証券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。

2 デリバティブ取引に関する注記

(株式関連)

(2023年7月20日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等	時価	評価損益
			うち1年超	

市場取引	株価指数先物取引				
	買建	253,934,680	—	255,210,500	1,275,820
	合計	253,934,680	—	255,210,500	1,275,820

(注) 時価の算定方法

先物取引

国内先物取引について

先物取引の評価においては、原則として計算日の取引所の発表する清算値段で評価しております。

※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

(単位：円)

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
I N P E X	9,700	1,726.00	16,742,200	
大林組	6,500	1,252.00	8,138,000	
清水建設	5,500	913.40	5,023,700	
大和ハウス工業	6,000	3,706.00	22,236,000	
積水ハウス	6,100	2,910.00	17,751,000	
高砂熱学工業	400	2,485.00	994,000	
大気社	200	4,135.00	827,000	
明治ホールディングス	2,200	3,340.00	7,348,000	
サッポロホールディングス	600	3,603.00	2,161,800	
アサヒグループホールディングス	4,800	5,487.00	26,337,600	
麒麟ホールディングス	7,800	2,070.50	16,149,900	
サントリー食品インターナショナル	1,400	5,021.00	7,029,400	
伊藤園	400	3,985.00	1,594,000	
キッコーマン	1,400	7,951.00	11,131,400	
味の素	4,500	5,546.00	24,957,000	
キューピー	1,000	2,365.00	2,365,000	
カゴメ	800	3,157.00	2,525,600	
ニチレイ	1,100	3,186.00	3,504,600	
日清食品ホールディングス	600	11,855.00	7,113,000	
東洋紡	800	1,058.50	846,800	
帝人	1,800	1,465.00	2,637,000	
東レ	13,800	780.10	10,765,380	
クラレ	2,800	1,373.00	3,844,400	
旭化成	12,500	947.50	11,843,750	
住友化学	14,000	433.20	6,064,800	
東ソー	2,600	1,791.00	4,656,600	
デンカ	800	2,706.00	2,164,800	
カネカ	500	4,123.00	2,061,500	
三井化学	1,700	4,027.00	6,845,900	

J S R	1,800	4,070.00	7,326,000
東京応化工業	300	8,663.00	2,598,900
三菱ケミカルグループ	12,800	828.30	10,602,240
ダイセル	2,600	1,276.50	3,318,900
積水化学工業	3,600	2,027.00	7,297,200
U B E	900	2,486.50	2,237,850
花王	4,600	5,158.00	23,726,800
日本ペイントホールディングス	9,500	1,182.50	11,233,750
関西ペイント	1,600	2,193.50	3,509,600
D I C	800	2,616.00	2,092,800
富士フイルムホールディングス	3,700	8,161.00	30,195,700
日東電工	1,500	10,115.00	15,172,500
信越ポリマー	400	1,444.00	577,600
ニフコ	800	4,052.00	3,241,600
ユニ・チャーム	4,000	5,213.00	20,852,000
協和キリン	2,700	2,670.00	7,209,000
アステラス製薬	18,100	2,070.50	37,476,050
塩野義製薬	2,600	5,842.00	15,189,200
エーザイ	2,500	9,085.00	22,712,500
小野薬品工業	3,900	2,531.50	9,872,850
第一三共	18,500	3,970.00	73,445,000
E N E O S ホールディングス	28,700	494.20	14,183,540
ブリヂストン	5,700	5,771.00	32,894,700
住友理工	400	814.00	325,600
太平洋セメント	1,200	2,764.50	3,317,400
T O T O	1,300	4,244.00	5,517,200
日本特殊陶業	1,500	2,903.00	4,354,500
日本製鉄	8,100	3,065.00	24,826,500
神戸製鋼所	3,600	1,386.50	4,991,400
J F E ホールディングス	4,900	2,089.00	10,236,100
日本軽金属ホールディングス	600	1,436.00	861,600
三井金属鉱業	500	3,225.00	1,612,500
三菱マテリアル	1,200	2,469.00	2,962,800
住友金属鉱山	2,500	4,733.00	11,832,500
D O W A ホールディングス	500	4,449.00	2,224,500
U A C J	300	2,683.00	804,900

L I X I L	2,900	1,865.50	5,409,950
三浦工業	900	3,499.00	3,149,100
アマダ	3,400	1,377.00	4,681,800
ナブテスコ	1,100	3,021.00	3,323,100
小松製作所	9,200	3,835.00	35,282,000
日立建機	1,100	4,051.00	4,456,100
クボタ	10,100	2,028.50	20,487,850
荏原製作所	900	6,817.00	6,135,300
ダイキン工業	2,600	28,470.00	74,022,000
栗田工業	1,000	5,532.00	5,532,000
ダイフク	3,000	2,939.00	8,817,000
グローリー	400	2,759.50	1,103,800
セガサミーホールディングス	1,600	3,080.00	4,928,000
N T N	4,000	305.60	1,222,400
日立造船	1,600	907.00	1,451,200
三菱重工業	3,200	6,561.00	20,995,200
イビデン	1,100	8,454.00	9,299,400
コニカミノルタ	4,500	504.60	2,270,700
ブラザー工業	2,300	2,207.00	5,076,100
日立製作所	9,400	8,862.00	83,302,800
富士電機	1,300	6,039.00	7,850,700
安川電機	2,400	6,190.00	14,856,000
オムロン	1,700	8,397.00	14,274,900
日本電気	2,500	6,801.00	17,002,500
富士通	1,800	18,100.00	32,580,000
ルネサスエレクトロニクス	12,700	2,737.50	34,766,250
セイコーエプソン	2,900	2,234.50	6,480,050
アルバック	500	6,174.00	3,087,000
パナソニック ホールディングス	22,000	1,687.50	37,125,000
シャープ	2,300	803.30	1,847,590
アンリツ	1,400	1,227.50	1,718,500
ソニーグループ	12,600	13,075.00	164,745,000
TDK	3,900	5,373.00	20,954,700
アルプスアルパイン	1,900	1,236.00	2,348,400
横河電機	2,300	2,631.00	6,051,300
アズビル	1,100	4,468.00	4,914,800

アドバンテスト	1,900	20,990.00	39,881,000
シスメックス	1,700	9,363.00	15,917,100
スタンレー電気	1,300	2,681.50	3,485,950
ファナック	9,600	4,720.00	45,312,000
太陽誘電	1,200	4,285.00	5,142,000
村田製作所	5,700	8,231.00	46,916,700
リコー	5,500	1,237.50	6,806,250
東京エレクトロン	4,500	20,450.00	92,025,000
川崎重工業	1,500	3,623.00	5,434,500
トヨタ自動車	105,800	2,287.00	241,964,600
ヤマハ発動機	3,000	4,080.00	12,240,000
島津製作所	2,400	4,315.00	10,356,000
ニコン	3,000	1,819.00	5,457,000
HOYA	3,600	15,660.00	56,376,000
前田工織	200	3,105.00	621,000
大日本印刷	2,200	3,974.00	8,742,800
N I S S H A	400	1,673.00	669,200
アシックス	1,600	4,198.00	6,716,800
ヤマハ	1,400	5,273.00	7,382,200
リンテック	400	2,297.50	919,000
任天堂	10,400	6,426.00	66,830,400
コクヨ	800	2,009.00	1,607,200
美津濃	200	3,665.00	733,000
東北電力	4,500	856.30	3,853,350
九州電力	4,000	885.60	3,542,400
電源開発	1,500	2,158.00	3,237,000
レノバ	400	1,508.00	603,200
東京瓦斯	3,900	3,154.00	12,300,600
大阪瓦斯	3,700	2,148.50	7,949,450
東邦瓦斯	700	2,418.00	1,692,600
西部ガスホールディングス	200	1,996.00	399,200
東武鉄道	1,900	3,605.00	6,849,500
相鉄ホールディングス	800	2,469.00	1,975,200
東急	5,300	1,701.00	9,015,300
京王電鉄	1,000	4,380.00	4,380,000
西日本旅客鉄道	2,200	5,775.00	12,705,000

西武ホールディングス	2,300	1,480.50	3,405,150
西日本鉄道	600	2,425.00	1,455,000
阪急阪神ホールディングス	2,300	4,562.00	10,492,600
南海電気鉄道	1,000	2,954.50	2,954,500
京阪ホールディングス	1,000	3,721.00	3,721,000
名古屋鉄道	1,900	2,210.00	4,199,000
ヤマトホールディングス	2,800	2,603.50	7,289,800
山九	500	4,738.00	2,369,000
センコーグループホールディングス	1,100	1,018.00	1,119,800
九州旅客鉄道	1,300	3,068.00	3,988,400
S Gホールディングス	3,200	2,138.50	6,843,200
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	700	8,165.00	5,715,500
日本郵船	4,800	3,443.00	16,526,400
A N Aホールディングス	1,600	3,340.00	5,344,000
トランコム	100	6,990.00	699,000
T I S	2,200	3,499.00	7,697,800
S H I F T	100	32,210.00	3,221,000
ティーガイア	200	1,745.00	349,000
オーブンドア	100	1,252.00	125,200
マネーフォワード	400	5,637.00	2,254,800
ビジョナル	200	7,800.00	1,560,000
野村総合研究所	3,800	3,934.00	14,949,200
メルカリ	1,100	3,502.00	3,852,200
Zホールディングス	26,700	390.30	10,421,010
伊藤忠テクノソリューションズ	1,000	3,557.00	3,557,000
B I P R O G Y	800	3,390.00	2,712,000
ビジョン	400	1,744.00	697,600
K D D I	14,900	4,261.00	63,488,900
ソフトバンク	28,700	1,539.00	44,169,300
N T Tデータグループ	6,300	1,951.50	12,294,450
カプコン	1,700	5,732.00	9,744,400
S C S K	1,600	2,216.50	3,546,400
T O K A Iホールディングス	1,000	888.00	888,000
アズワン	300	5,478.00	1,643,400
伊藤忠商事	11,900	5,539.00	65,914,100

丸紅	15,300	2,431.50	37,201,950
三井物産	13,100	5,312.00	69,587,200
キャノンマーケティングジャパン	500	3,666.00	1,833,000
モスフードサービス	200	3,220.00	644,000
ローソン	500	6,875.00	3,437,500
ゲオホールディングス	200	1,847.00	369,400
アダストリア	200	2,849.00	569,800
ジーンズホールディングス	100	3,610.00	361,000
DCMホールディングス	1,100	1,197.00	1,316,700
J. フロント リテイリング	2,400	1,355.00	3,252,000
マツキヨココカラ&カンパニー	1,100	8,103.00	8,913,300
ZOZO	1,200	2,779.00	3,334,800
オイシックス・ラ・大地	300	2,263.00	678,900
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	500	1,112.00	556,000
イオン北海道	400	852.00	340,800
スギホールディングス	300	6,294.00	1,888,200
日本瓦斯	1,000	1,910.00	1,910,000
マックスバリュ東海	100	2,755.00	275,500
丸井グループ	1,800	2,444.00	4,399,200
イオン	6,500	2,864.00	18,616,000
平和堂	300	2,329.00	698,700
ヤオコー	200	7,492.00	1,498,400
ヤマダホールディングス	5,800	427.70	2,480,660
ファーストリテイリング	1,700	34,160.00	58,072,000
サンドラッグ	700	4,113.00	2,879,100
りそなホールディングス	21,300	709.80	15,118,740
三井住友トラスト・ホールディングス	3,300	5,280.00	17,424,000
三井住友フィナンシャルグループ	13,000	6,443.00	83,759,000
みずほフィナンシャルグループ	24,100	2,245.50	54,116,550
大和証券グループ本社	13,300	738.70	9,824,710
野村ホールディングス	29,000	557.80	16,176,200
SOMPOホールディングス	3,100	6,460.00	20,026,000
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	4,300	5,099.00	21,925,700
東京海上ホールディングス	18,000	3,163.00	56,934,000
T&Dホールディングス	5,000	2,082.00	10,410,000

東京センチュリー	400	5,247.00	2,098,800	
オリックス	11,700	2,594.00	30,349,800	
ビューリック	3,800	1,216.50	4,622,700	
野村不動産ホールディングス	1,100	3,437.00	3,780,700	
三井不動産	9,000	2,832.50	25,492,500	
三菱地所	11,200	1,721.00	19,275,200	
平和不動産	300	3,840.00	1,152,000	
東京建物	1,900	1,874.00	3,560,600	
住友不動産	2,800	3,663.00	10,256,400	
ディップ	400	3,615.00	1,446,000	
H. U. グループホールディングス	500	2,763.50	1,381,750	
オリエンタルランド	10,900	5,407.00	58,936,300	
ダスキン	400	3,189.00	1,275,600	
リゾートトラスト	800	2,169.00	1,735,200	
サイバーエージェント	4,300	1,009.00	4,338,700	
楽天グループ	14,900	534.10	7,958,090	
テクノプロ・ホールディングス	1,100	3,431.00	3,774,100	
リクルートホールディングス	14,400	4,798.00	69,091,200	
エラン	300	879.00	263,700	
インソース	500	1,183.00	591,500	
カーブスホールディングス	500	744.00	372,000	
LITALICO	200	2,238.00	447,600	
乃村工藝社	800	896.00	716,800	
セコム	2,100	9,214.00	19,349,400	
ベネッセホールディングス	700	1,824.50	1,277,150	
合 計	1,020,000		3,221,661,810	

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	森ヒルズリート投資法人	15	2,211,000	
	日本プロロジスリート投資法人	22	6,454,800	
	ビューリックリート投資法人	13	2,133,300	
	積水ハウス・リート投資法人	42	3,624,600	
	日本ビルファンド投資法人	15	9,195,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	13	7,436,000	

	日本プライムリアルティ投資法人	8	2,840,000	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	29	4,413,800	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	9	2,745,000	
	ジャパンエクセレント投資法人	12	1,603,200	
	合計	178	42,656,700	

(注) 券面総額欄の数値は口数を表しております。

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

注記表（その他の注記）の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

RM先進国株式ESGマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2023年7月20日現在

資産の部	
流動資産	
預金	197,382,588
コール・ローン	32,831,751
株式	6,294,341,572
投資証券	140,578,266
派生商品評価勘定	6,578,945
未収配当金	4,092,995
差入委託証拠金	43,417,524
流動資産合計	6,719,223,641
資産合計	6,719,223,641
負債の部	
流動負債	
未払解約金	33,579,000
未払利息	89
流動負債合計	33,579,089
負債合計	33,579,089
純資産の部	
元本等	
元本	3,598,118,896
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	3,087,525,656
元本等合計	6,685,644,552
純資産合計	6,685,644,552
負債純資産合計	6,719,223,641

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	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。 為替予約取引 個別法に基づき、原則としてわが国における計算日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	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の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
4. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 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。 派生商品取引等損益 原則として、約定日基準で計上しております。 為替予約取引による為替差損益 原則として、約定日基準で計上しております。
5. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 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して整理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。

(貸借対照表に関する注記)

2023年7月20日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年7月21日
期首元本額	2,713,754,291円
期中追加設定元本額	1,706,218,051円
期中一部解約元本額	821,853,446円
期末元本額	3,598,118,896円
期末元本の内訳※	
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	853,032,291円
先進国株式ESGインデックス・オープン	34,306,198円
九州SDGs・グローバルバランス	425,895,319円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定型)	16,425,328円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定成長型)	239,654,743円
ラップ型ファンド・プラスESG(成長型)	585,277,377円
S m a r t e r i 先進国株式ESGインデックス	1,443,527,640円
2. 計算日における受益権の総数	3,598,118,896口
3. 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.8581円
(10,000口当たり純資産額)	(18,581円)

(注) ※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

2023年7月20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金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、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。 これらは、株価変動リスク、リートの価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

II 金融商品の時価等に関する事項

2023年7月20日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべ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	株式、投資証券 (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。 デリバティブ取引 (その他の注記)の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	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。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算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。

(関連当事者との取引に関する注記)

2023年7月20日現在	
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)

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2023年7月20日現在	
	損益に含まれた評価差額(円)	
株式		717,471,326
投資証券		630,509
合計		718,101,835

(注) 損益に含まれた評価差額は、親投資信託受益証券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。

2 デリバティブ取引に関する注記

(株式関連)

(2023年7月20日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	229,686,745	—	236,265,690	6,578,945
合計		229,686,745	—	236,265,690	6,578,945

(注) 時価の算定方法

先物取引

外国先物取引について

先物取引の評価においては、原則として計算日の取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

※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	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	BAKER HUGHES COMPANY	1,724	35.20	60,684.80	
	CHENIERE ENERGY INC	409	157.38	64,368.42	
	HALLIBURTON CO	1,481	37.01	54,811.81	
	HF SINCLAIR CORP	270	47.40	12,798.00	
	KINDER MORGAN INC	3,479	17.29	60,151.91	
	MARATHON PETROLEUM CORP	745	122.11	90,971.95	
	ONEOK INC	769	64.77	49,808.13	
	PHILLIPS 66	776	102.46	79,508.96	
	SCHLUMBERGER LTD	2,354	57.36	135,025.44	
	TARGA RESOURCES CORP	372	78.74	29,291.28	
	VALERO ENERGY CORP	619	118.02	73,054.38	
	WILLIAMS COS INC	2,007	33.32	66,873.24	
	AMCOR PLC	2,580	9.98	25,748.40	
	AVERY DENNISON CORP	133	177.42	23,596.86	
	BALL CORP	544	57.00	31,008.00	
	ECOLAB INC	423	187.28	79,219.44	
	INTERNATIONAL PAPER CO	545	31.56	17,200.20	
	INTL FLAVORS & FRAGRANCES	440	84.07	36,990.80	
	LINDE PLC	817	374.71	306,138.07	
	LYONDELLBASELL INDU-CL A	434	91.25	39,602.50	
	MARTIN MARIETTA MATERIALS	107	454.26	48,605.82	
	NEWMONT CORP	1,366	45.18	61,715.88	
	NUCOR CORP	415	167.12	69,354.80	
	PPG INDUSTRIES INC	387	150.26	58,150.62	
	SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	407	268.01	109,080.07	
	STEEL DYNAMICS INC	269	105.30	28,325.70	
WESTROCK CO	414	30.22	12,511.08		
3M CO	913	103.48	94,477.24		
AECOM	231	88.70	20,489.70		
ALLEGION PLC	139	125.80	17,486.20		

AXON ENTERPRISE INC	113	189.53	21,416.89
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	227	144.32	32,760.64
CARRIER GLOBAL CORP	1,379	55.23	76,162.17
CATERPILLAR INC	859	262.75	225,702.25
CUMMINS INC	243	258.85	62,900.55
DOVER CORP	243	150.13	36,481.59
EATON CORP PLC	661	209.81	138,684.41
EMERSON ELECTRIC CO	960	91.67	88,003.20
FASTENAL CO	940	57.29	53,852.60
FERGUSON PLC	343	157.92	54,166.56
FORTIVE CORP	581	74.36	43,203.16
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS I	207	73.30	15,173.10
GENERAC HOLDINGS INC	101	146.93	14,839.93
GRACO INC	273	87.42	23,865.66
IDEX CORP	131	211.18	27,664.58
ILLINOIS TOOL WORKS	515	254.96	131,304.40
INGERSOLL-RAND INC	700	65.72	46,004.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	1,136	69.47	78,917.92
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	318	198.83	63,227.94
LENNOX INTERNATIONAL INC	51	334.25	17,046.75
MASCO CORP	343	60.57	20,775.51
OTIS WORLDWIDE CORP	681	88.08	59,982.48
OWENS CORNING	152	136.34	20,723.68
PENTAIR PLC	260	66.33	17,245.80
QUANTA SERVICES INC	247	199.95	49,387.65
ROCKWELL AUTOMATION INC	189	344.00	65,016.00
TORO CO	183	103.80	18,995.40
TRANE TECHNOLOGIES PLC	378	195.85	74,031.30
UNITED RENTALS INC	120	460.49	55,258.80
WW GRAINGER INC	75	766.05	57,453.75
XYLEM INC	412	111.46	45,921.52
AUTOMATIC DATA PROCESSING	687	237.33	163,045.71
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	196	169.67	33,255.32
CERIDIAN HCM HOLDING INC	261	71.58	18,682.38
CINTAS CORP	154	504.06	77,625.24
CLARIVATE PLC	662	9.78	6,474.36

PAYCHEX INC	546	123.31	67,327.26
PAYLOCITY HOLDING CORP	74	224.96	16,647.04
ROBERT HALF INC	174	84.56	14,713.44
TRANSUNION	319	81.00	25,839.00
WASTE MANAGEMENT INC	688	166.70	114,689.60
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	196	98.32	19,270.72
CSX CORP	3,400	33.80	114,920.00
DELTA AIR LINES INC	259	48.55	12,574.45
EXPEDITORS INTL WASH INC	252	124.51	31,376.52
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	144	195.23	28,113.12
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	294	56.37	16,572.78
NORFOLK SOUTHERN CORP	386	237.41	91,640.26
OLD DOMINION FREIGHT LINE	162	395.20	64,022.40
UNION PACIFIC CORP	1,016	214.25	217,678.00
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	1,204	186.02	223,968.08
APTIV PLC	468	110.38	51,657.84
BORGWARNER INC	369	45.93	16,948.17
LEAR CORP	107	149.04	15,947.28
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	1,051	24.83	26,096.33
TESLA INC	4,762	291.26	1,386,980.12
DECKERS OUTDOOR CORP	44	543.72	23,923.68
HASBRO INC	208	64.61	13,438.88
LULULEMON ATHLETICA INC	192	390.51	74,977.92
NIKE INC -CL B	2,054	109.88	225,693.52
NVR INC	5	6,445.95	32,229.75
PULTEGROUP INC	375	81.96	30,735.00
VF CORP	592	20.46	12,112.32
WHIRLPOOL CORP	98	156.10	15,297.80
ARAMARK	420	43.01	18,064.20
BOOKING HOLDINGS INC	63	2,927.88	184,456.44
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	436	148.92	64,929.12
MCDONALD'S CORP	1,216	294.13	357,662.08
VAIL RESORTS INC	63	241.29	15,201.27
YUM! BRANDS INC	472	135.93	64,158.96
ALPHABET INC-CL A	9,953	122.03	1,214,564.59
ALPHABET INC-CL C	8,969	122.78	1,101,213.82

COMCAST CORP-CLASS A	7,012	42.71	299,482.52
ELECTRONIC ARTS INC	453	136.84	61,988.52
FOX CORP - CLASS A	509	33.72	17,163.48
FOX CORP- CLASS B	235	31.68	7,444.80
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	673	37.66	25,345.18
OMNICOM GROUP	337	87.78	29,581.86
SIRIUS XM HOLDINGS INC	1,044	5.49	5,731.56
SNAP INC - A	1,641	13.11	21,513.51
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	290	152.01	44,082.90
WALT DISNEY CO/THE	3,045	87.04	265,036.80
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	427	28.85	12,318.95
ADVANCE AUTO PARTS INC	96	72.44	6,954.24
AUTOZONE INC	31	2,505.89	77,682.59
BEST BUY CO INC	350	84.22	29,477.00
BURLINGTON STORES INC	113	176.37	19,929.81
CARMAX INC	255	85.14	21,710.70
EBAY INC	935	49.03	45,843.05
GENUINE PARTS CO	243	168.07	40,841.01
HOME DEPOT INC	1,689	319.48	539,601.72
LKQ CORP	439	58.29	25,589.31
LOWE'S COS INC	993	230.89	229,273.77
MERCADOLIBRE INC	75	1,225.75	91,931.25
POOL CORP	68	365.97	24,885.96
TJX COMPANIES INC	1,916	85.59	163,990.44
TRACTOR SUPPLY COMPANY	190	211.16	40,120.40
ULTA BEAUTY INC	82	471.21	38,639.22
KROGER CO	1,173	46.98	55,107.54
TARGET CORP	761	132.70	100,984.70
BUNGE LTD	264	103.93	27,437.52
CAMPBELL SOUP CO	348	45.89	15,969.72
COCA-COLA CO/THE	6,852	61.64	422,357.28
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	327	64.76	21,176.52
CONAGRA BRANDS INC	839	32.57	27,326.23
DARLING INGREDIENTS INC	292	66.74	19,488.08
GENERAL MILLS INC	969	75.21	72,878.49
HORMEL FOODS CORP	532	39.56	21,045.92

JM SMUCKER CO/THE	180	149.69	26,944.20
KELLOGG CO	463	67.18	31,104.34
KEURIG DR PEPPER INC	1,548	31.89	49,365.72
LAMB WESTON HOLDINGS INC	246	112.37	27,643.02
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	406	86.06	34,940.36
PEPSICO INC	2,296	186.26	427,652.96
CHURCH & DWIGHT CO INC	407	98.27	39,995.89
CLOROX COMPANY	212	154.74	32,804.88
COLGATE-PALMOLIVE CO	1,313	76.42	100,339.46
KIMBERLY-CLARK CORP	559	135.35	75,660.65
PROCTER & GAMBLE CO/THE	3,938	150.29	591,842.02
ALIGN TECHNOLOGY INC	118	342.58	40,424.44
AMERISOURCEBERGEN CORP	289	191.94	55,470.66
CIGNA GROUP/THE	492	292.66	143,988.72
COOPER COS INC/THE	82	394.84	32,376.88
DAVITA INC	97	104.76	10,161.72
DENTSPLY SIRONA INC	353	40.67	14,356.51
DEXCOM INC	638	133.63	85,255.94
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	1,024	91.62	93,818.88
ELEVANCE HEALTH INC	394	463.21	182,504.74
HCA HEALTHCARE INC	352	286.71	100,921.92
HOLOGIC INC	425	78.54	33,379.50
HUMANA INC	212	447.26	94,819.12
IDEXX LABORATORIES INC	136	547.75	74,494.00
INSULET CORP	120	287.82	34,538.40
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	153	217.11	33,217.83
MOLINA HEALTHCARE INC	96	312.45	29,995.20
QUEST DIAGNOSTICS INC	197	143.10	28,190.70
STERIS PLC	160	227.44	36,390.40
TELEFLEX INC	84	251.30	21,109.20
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	352	140.79	49,558.08
AGILENT TECHNOLOGIES INC	506	123.08	62,278.48
AMGEN INC	888	232.05	206,060.40
AVANTOR INC	1,116	21.83	24,362.28
BIO-TECHNE CORP	270	83.88	22,647.60
BIOGEN INC	247	276.89	68,391.83

BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	3,500	62.06	217,210.00
DANAHER CORP	1,153	243.88	281,193.64
ELI LILLY & CO	1,348	453.56	611,398.88
GILEAD SCIENCES INC	2,074	78.96	163,763.04
ILLUMINA INC	270	184.53	49,823.10
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	97	131.19	12,725.43
JOHNSON & JOHNSON	4,336	158.74	688,296.64
MERCK & CO. INC.	4,232	105.95	448,380.40
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	38	1,340.03	50,921.14
REPLIGEN CORP	94	158.59	14,907.46
WATERS CORP	102	280.08	28,568.16
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	127	385.62	48,973.74
ZOETIS INC	767	170.89	131,072.63
CITIZENS FINANCIAL GROUP	844	30.97	26,138.68
HUNTINGTON BANCSHARES INC	2,472	11.88	29,367.36
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	659	132.37	87,231.83
REGIONS FINANCIAL CORP	1,601	20.02	32,052.02
TRUIST FINANCIAL CORP	2,187	35.59	77,835.33
US BANCORP	2,588	38.91	100,699.08
WEBSTER FINANCIAL CORP	281	44.33	12,456.73
ALLY FINANCIAL INC	438	29.66	12,991.08
AMERICAN EXPRESS CO	1,054	177.12	186,684.48
AMERIPRISE FINANCIAL INC	174	352.47	61,329.78
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	1,322	45.60	60,283.20
BLACKROCK INC	250	747.30	186,825.00
CBOE GLOBAL MARKETS INC	184	140.19	25,794.96
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	437	121.85	53,248.45
EQUITABLE HOLDINGS INC	593	28.47	16,882.71
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	66	425.18	28,061.88
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	999	60.83	60,769.17
FISERV INC	1,056	127.63	134,777.28
FRANKLIN RESOURCES INC	483	30.00	14,490.00
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	931	115.66	107,679.46
INVESCO LTD	468	18.04	8,442.72
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	138	229.26	31,637.88
MARKETAXESS HOLDINGS INC	59	261.14	15,407.26

MASTERCARD INC-CLASS A	1,421	398.27	565,941.67
MOODY'S CORP	274	359.54	98,513.96
MORGAN STANLEY	2,090	93.16	194,704.40
NASDAQ INC	595	50.43	30,005.85
NORTHERN TRUST CORP	343	81.28	27,879.04
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	335	109.59	36,712.65
S&P GLOBAL INC	547	422.53	231,123.91
SCHWAB (CHARLES) CORP	2,502	66.04	165,232.08
STATE STREET CORP	566	69.38	39,269.08
SYNCHRONY FINANCIAL	732	36.11	26,432.52
T ROWE PRICE GROUP INC	386	121.27	46,810.22
VISA INC-CLASS A SHARES	2,713	241.42	654,972.46
AFLAC INC	956	71.32	68,181.92
ALLSTATE CORP	430	105.79	45,489.70
ARCH CAPITAL GROUP LTD	634	80.25	50,878.50
ASSURANT INC	86	128.01	11,008.86
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	507	72.43	36,722.01
MARSH & MCLENNAN COS	821	187.36	153,822.56
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	420	82.51	34,654.20
PROGRESSIVE CORP	970	118.22	114,673.40
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	631	94.30	59,503.30
TRAVELERS COS INC/THE	387	170.56	66,006.72
WILLIS TOWERS WATSON PLC	173	226.72	39,222.56
ACCENTURE PLC-CL A	1,053	318.80	335,696.40
ADOBE INC	765	527.17	403,285.05
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	261	93.98	24,528.78
ANSYS INC	150	348.81	52,321.50
AUTODESK INC	355	219.07	77,769.85
BLACK KNIGHT INC	282	70.08	19,762.56
CADENCE DESIGN SYS INC	453	242.49	109,847.97
DOCUSIGN INC	362	54.18	19,613.16
FAIR ISAAC CORP	42	844.85	35,483.70
GARTNER INC	133	367.68	48,901.44
GEN DIGITAL INC	910	19.32	17,581.20
HUBSPOT INC	79	568.62	44,920.98
INTL BUSINESS MACHINES CORP	1,510	135.48	204,574.80

INTUIT INC	467	500.56	233,761.52
MICROSOFT CORP	11,815	355.08	4,195,270.20
PTC INC	187	146.64	27,421.68
SALESFORCE INC	1,667	234.37	390,694.79
SERVICENOW INC	339	603.25	204,501.75
SPLUNK INC	256	108.67	27,819.52
SYNOPSYS INC	258	457.33	117,991.14
TWILIO INC - A	319	67.61	21,567.59
VMWARE INC-CLASS A	397	166.69	66,175.93
WORKDAY INC-CLASS A	345	231.68	79,929.60
ZSCALER INC	144	161.04	23,189.76
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	2,210	17.27	38,166.70
HP INC	1,494	32.93	49,197.42
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	290	172.58	50,048.20
NETAPP INC	357	79.31	28,313.67
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	309	59.86	18,496.74
TRIMBLE INC	424	53.67	22,756.08
WESTERN DIGITAL CORP	499	38.93	19,426.07
LIBERTY GLOBAL PLC-A	277	18.87	5,226.99
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	457	19.85	9,071.45
VERIZON COMMUNICATIONS INC	6,992	33.97	237,518.24
AMERICAN WATER WORKS CO INC	334	143.98	48,089.32
ATMOS ENERGY CORP	246	121.17	29,807.82
CMS ENERGY CORP	486	60.51	29,407.86
CONSOLIDATED EDISON INC	584	93.49	54,598.16
EDISON INTERNATIONAL	661	70.64	46,693.04
ESSENTIAL UTILITIES INC	399	41.50	16,558.50
EVERSOURCE ENERGY	603	72.15	43,506.45
EXELON CORP	1,641	41.51	68,117.91
SEMPRA ENERGY	520	146.53	76,195.60
UGI CORP	330	26.60	8,778.00
APPLIED MATERIALS INC	1,408	141.78	199,626.24
INTEL CORP	6,953	34.46	239,600.38
LAM RESEARCH CORP	225	640.11	144,024.75
MARVELL TECHNOLOGY INC	1,451	65.63	95,229.13
NVIDIA CORP	4,126	470.77	1,942,397.02

	NXP SEMICONDUCTORS NV	443	220.28	97,584.04
	TEXAS INSTRUMENTS INC	1,513	183.67	277,892.71
	CBRE GROUP INC - A	513	88.91	45,610.83
	米ドル 小計	251,683		33,525,516.50 (4,683,514,655)
カナダドル	CAMECO CORP	679	43.33	29,421.07
	ENBRIDGE INC	3,353	48.52	162,687.56
	KEYERA CORP	324	31.76	10,290.24
	PARKLAND CORP	182	35.39	6,440.98
	PEMBINA PIPELINE CORP	957	40.86	39,103.02
	AGNICO EAGLE MINES LTD	790	70.58	55,758.20
	IVANHOE MINES LTD-CL A	1,023	12.80	13,094.40
	KINROSS GOLD CORP	2,391	6.79	16,234.89
	LUNDIN MINING CORP	1,264	11.59	14,649.76
	NUTRIEN LTD	836	84.88	70,959.68
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	104	115.77	12,040.08
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	785	59.06	46,362.10
	CAE INC	528	29.10	15,364.80
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	137	109.04	14,938.48
	RB GLOBAL INC	282	81.86	23,084.52
	THOMSON REUTERS CORP	281	174.66	49,079.46
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	941	155.37	146,203.17
	MAGNA INTERNATIONAL INC	476	81.35	38,722.60
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	337	42.38	14,282.06
	CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	92	184.87	17,008.04
	DOLLARAMA INC	474	88.06	41,740.44
	ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	1,318	67.08	88,411.44
	METRO INC	388	72.91	28,289.08
	BANK OF MONTREAL	1,200	123.38	148,056.00
	BANK OF NOVA SCOTIA	1,967	67.02	131,828.34
	NATIONAL BANK OF CANADA	579	100.95	58,450.05
	TORONTO-DOMINION BANK	3,025	86.05	260,301.25
	BROOKFIELD CORP	2,335	47.11	110,001.85
	INTACT FINANCIAL CORP	302	196.43	59,321.86
	SUN LIFE FINANCIAL INC	975	68.46	66,748.50
	OPEN TEXT CORP	437	55.47	24,240.39

	SHOPIFY INC - CLASS A	1,986	89.91	178,561.26
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	618	59.31	36,653.58
	TELUS CORP	717	24.29	17,415.93
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	1,266	10.91	13,812.06
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	204	42.43	8,655.72
	FORTIS INC	838	56.70	47,514.60
	HYDRO ONE LTD	509	37.90	19,291.10
	FIRSTSERVICE CORP	67	209.72	14,051.24
	カナダドル 小計	34,967		2,149,069.80 (228,274,194)
ユーロ	GALP ENERGIA SGPS SA	947	11.27	10,672.69
	NESTE OYJ	739	36.70	27,121.30
	OMV AG	239	40.82	9,755.98
	REPSOL SA	2,213	12.95	28,669.41
	TENARIS SA	798	14.42	11,507.16
	TOTALENERGIES SE	3,937	52.32	205,983.84
	AKZO NOBEL	280	74.22	20,781.60
	COVESTRO AG	348	48.84	16,996.32
	CRH PLC	1,246	51.78	64,517.88
	DSM-FIRMENICH AG	304	103.30	31,403.20
	EVONIK INDUSTRIES AG	352	18.31	6,445.12
	HEIDELBERG MATERIALS AG	228	72.10	16,438.80
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	389	33.94	13,202.66
	STORA ENSO OYJ-R SHS	932	11.53	10,745.96
	SYMRISE AG	210	97.00	20,370.00
	UMICORE	377	27.76	10,465.52
	UPM-KYMMENE OYJ	938	28.96	27,164.48
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	375	30.30	11,362.50
	BOUYGUES SA	366	31.34	11,470.44
	BRENTAG SE	249	67.50	16,807.50
	CNH INDUSTRIAL NV	1,795	13.86	24,887.67
	EIFFAGE	135	94.50	12,757.50
	GEA GROUP AG	292	37.80	11,037.60
	KINGSPAN GROUP PLC	247	72.16	17,823.52
	KNORR-BREMSE AG	129	62.66	8,083.14
	METSO CORPORATION	1,125	11.29	12,701.25

PRYSMIAN SPA	411	36.69	15,079.59
SCHNEIDER ELECTRIC SE	902	157.86	142,389.72
WARTSILA OYJ ABP	698	10.49	7,325.51
TELEPERFORMANCE	104	156.85	16,312.40
WOLTERS KLUWER	420	112.90	47,418.00
ADP	49	130.40	6,389.60
DEUTSCHE GROUP AG	1,711	45.78	78,338.13
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	1,009	8.79	8,875.16
GETLINK	682	16.08	10,966.56
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	548	107.20	58,745.60
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	93	99.45	9,248.85
MICHELIN(CGDE)	1,183	28.09	33,230.47
VALEO SA	298	21.30	6,347.40
ADIDAS AG	267	172.30	46,004.10
HERMES INTERNATIONAL	53	1,882.20	99,756.60
KERING	123	530.40	65,239.20
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	461	850.40	392,034.40
MONCLER SPA	342	62.00	21,204.00
PUMA SE	201	58.80	11,818.80
AMADEUS IT GROUP SA	760	66.98	50,904.80
JUST EAT TAKEAWAY	406	16.15	6,557.71
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	1,368	21.70	29,685.60
PROSUS NV	1,325	67.87	89,927.75
ZALANDO SE	359	29.75	10,680.25
CARREFOUR SA	1,051	17.45	18,339.95
HELLOFRESH SE	235	24.00	5,640.00
JERONIMO MARTINS	453	26.38	11,950.14
KESKO OYJ-B SHS	438	17.43	7,636.53
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N.V.	1,633	30.82	50,337.22
DANONE	1,057	55.55	58,716.35
JDE PEET' S BV	101	26.98	2,724.98
KERRY GROUP PLC-A	284	90.52	25,707.68
BEIERSDORF AG	178	114.75	20,425.50
HENKEL AG & CO KGAA	164	63.54	10,420.56
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	286	71.04	20,317.44
L' OREAL	401	406.30	162,926.30

	MERCK KGAA	225	149.05	33,536.25
	BNP PARIBAS	1,840	57.96	106,646.40
	COMMERZBANK AG	1,725	11.09	19,138.87
	CREDIT AGRICOLE SA	2,015	11.11	22,398.74
	FINECOBANK SPA	1,099	13.74	15,105.75
	ING GROEP NV-CVA	6,116	13.08	79,997.28
	KBC GROEP NV	424	65.36	27,712.64
	MEDIOBANCA SPA	1,012	11.44	11,577.28
	SOCIETE GENERALE SA	1,215	23.90	29,038.50
	DEUTSCHE BOERSE AG	314	165.25	51,888.50
	NEXI SPA	1,129	7.68	8,675.23
	WORLDLINE SA	381	34.46	13,129.26
	ASSICURAZIONI GENERALI	1,662	18.76	31,187.43
	AXA SA	3,085	26.63	82,168.97
	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	236	332.50	78,470.00
	NN GROUP NV	453	33.29	15,080.37
	POSTE ITALIANE SPA	774	9.96	7,715.23
	DASSAULT SYSTEMES SE	1,125	41.36	46,535.62
	NOKIA OYJ	8,850	3.52	31,209.52
	ELISA OYJ	226	48.80	11,028.80
	KONINKLIJKE KPN NV	5,834	3.24	18,913.82
	ORANGE	3,109	10.57	32,874.56
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	1,281	2.43	3,115.39
	ENEL SPA	13,391	6.27	84,028.52
	IBERDROLA SA	9,999	11.17	111,688.83
	NATURGY ENERGY GROUP SA	198	26.86	5,318.28
	REDEIA CORP SA	644	15.23	9,811.34
	TERNA SPA	2,313	7.65	17,703.70
	VERBUND AG	119	74.25	8,835.75
	ASML HOLDING NV	673	651.90	438,728.70
	STMICROELECTRONICS NV	1,151	46.93	54,022.18
	LEG IMMOBILIEN SE	106	63.72	6,754.32
	VONOVIA SE	1,200	21.12	25,344.00
	ユーロ 小計	113,168		3,858,175.92 (604,691,911)
英ポンド	ANGLO AMERICAN PLC	2,126	23.03	48,961.78

ANTOFAGASTA PLC	654	14.86	9,721.71
CRODA INTERNATIONAL PLC	227	58.18	13,206.86
ENDEAVOUR MINING PLC	307	19.67	6,038.69
JOHNSON MATTHEY PLC	257	18.38	4,724.94
MONDI PLC	802	13.22	10,606.45
ASHTED GROUP PLC	722	54.72	39,507.84
DCC PLC	185	45.73	8,460.05
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	118	110.10	12,991.80
INTERTEK GROUP PLC	263	41.94	11,030.22
RELX PLC	3,208	25.72	82,509.76
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	1,858	4.54	8,435.32
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	180	43.00	7,740.00
BURBERRY GROUP PLC	628	21.94	13,778.32
TAYLOR WIMPEY PLC	5,889	1.16	6,848.90
AUTO TRADER GROUP PLC	1,644	6.60	10,860.26
INFORMA PLC	2,317	7.43	17,215.31
WPP PLC	1,731	8.60	14,886.60
KINGFISHER PLC	3,200	2.48	7,945.60
OCADO GROUP PLC	775	6.83	5,299.45
SAINSBURY (J) PLC	3,312	2.83	9,376.27
TESCO PLC	11,922	2.57	30,651.46
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	564	21.03	11,860.92
COCA-COLA HBC AG-DI	348	23.49	8,174.52
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	1,190	58.60	69,734.00
UNILEVER PLC	4,211	40.85	172,019.35
NMC HEALTH PLC	5	0.00	0.00
ASTRAZENECA PLC	2,583	105.02	271,266.66
HSBC HOLDINGS PLC	33,272	6.28	209,214.33
LLOYDS BANKING GROUP PLC	109,110	0.46	50,948.91
3I GROUP PLC	1,625	19.53	31,736.25
ABRDN PLC	3,791	2.31	8,761.00
SCHRODERS PLC	1,456	4.61	6,719.44
ST JAMES' S PLACE PLC	1,011	11.61	11,737.71
ADMIRAL GROUP PLC	365	21.78	7,949.70
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	10,341	2.36	24,487.48
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	1,289	5.52	7,115.28

	PRUDENTIAL PLC	4,530	10.64	48,199.20
	SAGE GROUP PLC/THE	1,812	9.43	17,101.65
	BT GROUP PLC	12,272	1.25	15,407.49
	VODAFONE GROUP PLC	38,026	0.73	27,930.09
	NATIONAL GRID PLC	6,089	10.40	63,325.60
	英ポンド 小計	276,215		1,444,487.17 (261,264,394)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	406	13.65	5,541.90
	GIVAUDAN-REG	15	2,973.00	44,595.00
	SIG GROUP AG	540	25.24	13,629.60
	SIKA AG-REG	241	256.30	61,768.30
	ABB LTD-REG	2,610	33.45	87,304.50
	GEBERIT AG-REG	56	474.10	26,549.60
	VAT GROUP AG	47	373.40	17,549.80
	SGS SA-REG	241	81.40	19,617.40
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	96	268.60	25,785.60
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	3	10,840.00	32,520.00
	SONOVA HOLDING AG-REG	91	239.30	21,776.30
	LONZA GROUP AG-REG	123	553.20	68,043.60
	NOVARTIS AG-REG	3,417	88.95	303,942.15
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	54	96.85	5,229.90
	JULIUS BAER GROUP LTD	354	57.42	20,326.68
	BALOISE HOLDING AG - REG	79	133.10	10,514.90
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	53	535.00	28,355.00
	SWISS RE AG	521	91.00	47,411.00
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	253	411.90	104,210.70
	TEMENOS GROUP AG-REG	107	73.34	7,847.38
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	293	54.70	16,027.10	
SWISSCOM AG-REG	43	553.60	23,804.80	
	スイスフラン 小計	9,643		992,351.21 (161,673,859)
スウェーデンク ローナ	BOLIDEN AB	435	327.55	142,484.25
	HOLMEN AB-B SHARES	114	406.80	46,375.20
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	984	143.00	140,712.00
	ALFA LAVAL AB	480	368.90	177,072.00
	ASSA ABLOY AB-B	1,639	254.50	417,125.50

	ATLAS COPCO AB-A SHS	4,475	145.80	652,455.00
	ATLAS COPCO AB-B SHS	2,536	126.55	320,930.80
	BEIJER REF AB	572	129.10	73,845.20
	EPIROC AB-A	1,182	199.05	235,277.10
	EPIROC AB-B	610	171.10	104,371.00
	HUSQVARNA AB-B SHS	588	98.04	57,647.52
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	2,675	95.08	254,339.00
	SANDVIK AB	1,870	205.40	384,098.00
	SKF AB-B SHARES	646	190.90	123,321.40
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	1,039	178.70	185,669.30
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	1,062	282.50	300,015.00
	NORDEA BANK ABP	5,409	117.88	637,612.92
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	2,340	91.56	214,250.40
	EQT AB	595	237.70	141,431.50
	KINNEVIK AB - B	456	140.50	64,068.00
	TELE2 AB-B SHS	1,080	80.38	86,810.40
	TELIA CO AB	4,305	24.29	104,568.45
	スウェーデンクローナ 小計	35,092		4,864,479.94 (66,302,861)
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	498	272.70	135,804.60
	EQUINOR ASA	1,569	301.80	473,524.20
	NORSK HYDRO ASA	2,253	62.60	141,037.80
	MOWI ASA	709	175.60	124,500.40
	ORKLA ASA	1,575	80.04	126,063.00
	SALMAR ASA	139	445.80	61,966.20
	DNB BANK ASA	1,638	203.00	332,514.00
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	244	157.40	38,405.60
	TELENOR ASA	1,123	103.45	116,174.35
	ノルウェークローネ 小計	9,748		1,549,990.15 (21,606,862)
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	170	505.80	85,986.00
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	367	338.20	124,119.40
	ROCKWOOL A/S-B SHS	17	1,803.50	30,659.50
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	1,657	187.82	311,217.74
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	5	13,760.00	68,800.00
	AP MOELLER-MAERSK A/S-B	8	14,040.00	112,320.00

	DSV A/S	314	1,477.00	463,778.00
	PANDORA A/S	147	656.60	96,520.20
	COLOPLAST-B	188	805.00	151,340.00
	GENMAB A/S	114	2,717.00	309,738.00
	NOVO NORDISK A/S-B	2,760	1,064.40	2,937,744.00
	ORSTED A/S	307	625.00	191,875.00
	デンマーククローネ 小計	6,054		4,884,097.84 (102,712,577)
オーストラリア ドル	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	3,134	36.05	112,980.70
	BLUESCOPE STEEL LTD	782	20.25	15,835.50
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	2,765	22.29	61,631.85
	IGO LTD	1,162	14.77	17,162.74
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	716	40.51	29,005.16
	MINERAL RESOURCES LTD	272	72.06	19,600.32
	NEWCREST MINING LTD	1,569	27.75	43,539.75
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	1,919	12.59	24,160.21
	ORICA LTD	891	15.15	13,498.65
	PILBARA MINERALS LTD	4,599	5.13	23,592.87
	BRAMBLES LTD	2,449	13.96	34,188.04
	COMPUTERSHARE LTD	874	24.35	21,281.90
	AURIZON HOLDINGS LTD	2,643	3.71	9,805.53
	TRANSURBAN GROUP	5,068	13.92	70,546.56
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	1,039	38.34	39,835.26
	IDP EDUCATION LTD	356	23.16	8,244.96
	REA GROUP LTD	103	149.57	15,405.71
	SEEK LTD	653	24.47	15,978.91
	COLES GROUP LTD	2,355	18.09	42,601.95
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	2,324	5.89	13,688.36
	COCHLEAR LTD	105	235.13	24,688.65
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	306	56.85	17,396.10
	SONIC HEALTHCARE LTD	726	35.31	25,635.06
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	4,959	25.46	126,256.14
	ASX LTD	312	61.76	19,269.12
	MACQUARIE GROUP LTD	610	183.90	112,179.00
	QBE INSURANCE GROUP LTD	2,584	15.24	39,380.16
	SUNCORP GROUP LTD	1,985	13.83	27,452.55

	XERO LTD	222	126.80	28,149.60
	TELSTRA GROUP LTD	6,669	4.21	28,076.49
	APA GROUP	1,923	9.84	18,922.32
	LENDLEASE GROUP	954	7.94	7,574.76
	オーストラリアドル 小計	57,028		1,107,564.88 (105,008,226)
ニュージーランドドル	EBOS GROUP LTD	262	37.90	9,929.80
	SPARK NEW ZEALAND LTD	2,779	5.07	14,089.53
	MERCURY NZ LTD	826	6.40	5,286.40
	MERIDIAN ENERGY LTD	2,181	5.38	11,733.78
	ニュージーランドドル 小計	6,048		41,039.51 (3,594,240)
香港ドル	MTR CORP	2,523	34.95	88,178.85
	WH GROUP LTD	17,000	4.03	68,510.00
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	5,742	22.65	130,056.30
	HANG SENG BANK LTD	1,261	109.20	137,701.20
	AIA GROUP LTD	19,400	78.50	1,522,900.00
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	7,289	9.25	67,423.25
	HONG KONG & CHINA GAS	20,079	6.43	129,107.97
	SINO LAND CO	6,000	9.39	56,340.00
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	672	62.20	41,798.40
	SWIRE PROPERTIES LTD	1,804	18.68	33,698.72
	香港ドル 小計	81,770		2,275,714.69 (40,712,535)
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	2,509	6.86	17,211.74
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	2,100	28.64	60,144.00
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	1,380	9.44	13,027.20
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	4,405	3.36	14,800.80
	CITY DEVELOPMENTS LTD	968	6.92	6,698.56
	シンガポールドル 小計	11,362		111,882.30 (11,804,701)
イスラエルシェケル	BANK LEUMI LE-ISRAEL	2,644	30.89	81,673.16
	イスラエルシェケル 小計	2,644		81,673.16 (3,180,557)
	合 計	895,422		6,294,341,572

(6, 294, 341, 572)

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(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
投資証券	米ドル	AMERICAN TOWER CORP	774	146,371.14	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	755	15,500.15	
		BOSTON PROPERTIES INC	235	15,138.70	
		CROWN CASTLE INC	717	81,379.50	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	487	59,009.79	
		EQUINIX INC	155	125,973.15	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	940	20,134.80	
		IRON MOUNTAIN INC	480	29,870.40	
		PROLOGIS INC	1,536	188,590.08	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	187	43,808.49	
		WELLTOWER INC	815	65,542.30	
		WEYERHAEUSER CO	1,275	43,694.25	
		米ドル 小計	8,356	835,012.75 (116,651,281)	
	カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	115	6,052.45	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	292	5,840.00	
		カナダドル 小計	407	11,892.45 (1,263,216)	
	ユーロ	GECINA SA	65	6,532.50	
		KLEPIERRE	368	8,787.84	
		ユーロ 小計	433	15,320.34 (2,401,156)	
	英ポンド	SEGRO PLC	2,149	17,097.44	
		英ポンド 小計	2,149	17,097.44 (3,092,413)	
	オーストラリアドル	DEXUS/AU	2,103	17,139.45	
		GOODMAN GROUP	2,959	60,718.68	
		GPT GROUP	3,278	13,931.50	
		MIRVAC GROUP	6,751	15,864.85	
		SCENTRE GROUP	8,253	22,695.75	

		STOCKLAND	4,073	16,943.68
		VICINITY CENTRES	7,638	14,779.53
	オーストラリアドル 小計		35,055	162,073.44 (15,366,182)
	シンガポールドル	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	8,592	17,098.08
	シンガポールドル 小計		8,592	17,098.08 (1,804,018)
合計				140,578,266 (140,578,266)

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式 285 銘柄	97.6%	—	72.9%
	投資証券 12 銘柄	—	2.4%	1.8%
カナダドル	株式 39 銘柄	99.4%	—	3.5%
	投資証券 2 銘柄	—	0.6%	0.0%
ユーロ	株式 95 銘柄	99.6%	—	9.5%
	投資証券 2 銘柄	—	0.4%	0.0%
英ポンド	株式 42 銘柄	98.8%	—	4.2%
	投資証券 1 銘柄	—	1.2%	0.0%
スイスフラン	株式 22 銘柄	100.0%	—	2.5%
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 9 銘柄	100.0%	—	0.3%
デンマーククローネ	株式 12 銘柄	100.0%	—	1.6%
オーストラリアドル	株式 32 銘柄	87.2%	—	1.6%
	投資証券 7 銘柄	—	12.8%	0.2%
ニュージーランドドル	株式 4 銘柄	100.0%	—	0.1%
香港ドル	株式 10 銘柄	100.0%	—	0.6%
シンガポールドル	株式 5 銘柄	86.7%	—	0.2%
	投資証券 1 銘柄	—	13.3%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 1 銘柄	100.0%	—	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（その他の注記）の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

RM新興国株式マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2023年7月20日現在

資産の部	
流動資産	
預金	823,104,460
コール・ローン	32,476,441
株式	25,479,697,457
投資証券	28,361,520
派生商品評価勘定	12,852,494
未収入金	3,873,846
未収配当金	161,135,154
差入委託証拠金	487,651,454
流動資産合計	27,029,152,826
資産合計	27,029,152,826
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,403,244
未払解約金	14,172,700
未払利息	88
流動負債合計	15,576,032
負債合計	15,576,032
純資産の部	
元本等	
元本	15,608,210,450
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	11,405,366,344
元本等合計	27,013,576,794
純資産合計	27,013,576,794
負債純資産合計	27,029,152,826

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	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。</p> <p>為替予約取引 個別法に基づき、原則としてわが国における計算日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。</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の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 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。</p> <p>派生商品取引等損益 原則として、約定日基準で計上しております。 為替予約取引による為替差損益 原則として、約定日基準で計上しております。</p>
5. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準 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して整理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>

(貸借対照表に関する注記)

2023年7月20日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年7月21日
期首元本額	11,648,718,312円
期中追加設定元本額	7,603,707,517円
期中一部解約元本額	3,644,215,379円
期末元本額	15,608,210,450円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド(安定型)	593,839,711円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	2,305,137,861円
りそなラップ型ファンド(成長型)	2,152,574,198円
DCりそな グローバルバランス	15,894,621円
つみたてバランスファンド	1,030,406,494円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	459,372,542円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	331,507,170円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	225,980,305円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	116,436,536円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	79,131,353円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	43,607,375円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	89,738,797円

埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	156,780,672円
九州SDGs・グローバルバランス	83,565,205円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定型)	2,479,103円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定成長型)	48,805,029円
ラップ型ファンド・プラスESG(成長型)	102,765,629円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定型)	5,104,864円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定成長型)	13,561,458円
りそな つみたてラップ型ファンド(成長型)	16,429,974円
りそな つみたてリスクコントロールファンド	646,529円
ターゲットリターンバランスファンド(目標2%)	11,784円
ターゲットリターンバランスファンド(目標3%)	22,135円
ターゲットリターンバランスファンド(目標4%)	34,960円
ターゲットリターンバランスファンド(目標5%)	47,850円
ターゲットリターンバランスファンド(目標6%)	57,514円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2065	56,688円
FWりそな先進国+新興国株式アクティブファンド	124,473,775円
FWりそな新興国株式インデックスファンド	3,895,558,216円
Smart-i 新興国株式インデックス	2,543,597,002円
Smart-i 8資産バランス 安定型	115,443,902円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	375,120,422円
Smart-i 8資産バランス 成長型	483,935,665円
Smart-i Select 全世界株式インデックス	44,838,020円
Smart-i Select 全世界株式インデックス(除く日本)	28,953,346円
りそなVIグローバル・バランスファンド(安定型)(適格機関投資家専用)	7,055,860円
りそなVIグローバル・バランスファンド(安定成長型)(適格機関投資家専用)	10,006,362円
りそなVIグローバル・バランスファンド(成長型)(適格機関投資家専用)	60,362,538円
りそなFT マルチアセットファンド(適格機関投資家専用)	28,864,277円
りそなDAAマルチアセットファンド(適格機関投資家専用)	16,004,708円
2. 計算日における受益権の総数	15,608,210,450口
3. 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.7307円
(10,000口当たり純資産額)	(17,307円)

(注) ※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

2023年7月20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金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、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。 これらは、株価変動リスク、リートの価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理

委員会に報告します。

II 金融商品の時価等に関する事項

2023年7月20日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべ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	
株式、投資証券	(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。
デリバティブ取引	(その他の注記)の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	
	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。
	また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算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。

(関連当事者との取引に関する注記)

2023年7月20日現在	
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)

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2023年7月20日現在	
	損益に含まれた評価差額(円)	
株式	29,774,504	
投資証券	△2,707,438	
合計	27,067,066	

(注) 損益に含まれた評価差額は、親投資信託受益証券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。

2 デリバティブ取引に関する注記

(株式関連)

(2023年7月20日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	1,520,112,720	—	1,531,561,834	11,449,114
合計		1,520,112,720	—	1,531,561,834	11,449,114

(注) 時価の算定方法

先物取引

外国先物取引について

先物取引の評価においては、原則として計算日の取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

※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。

(通貨関連)

(2023年7月20日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	50,641,976	—	50,642,622	646
	米ドル	50,641,976	—	50,642,622	646
	売建	389,576	—	390,086	△510
	オフショア人民元	389,576	—	390,086	△510
合計		51,031,552	—	51,032,708	136

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

1) 計算日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については以下のように評価しております。

① 計算日において為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます）の対顧客先物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で評価しております。

② 計算日において当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、当該日に最も近い前後二つの対顧客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。
- ・ 計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

2) 計算日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については計算日の対顧客相場の仲値で評価しております。

※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	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	29,100	1.39	40,681.80	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	1,600	0.00	0.00	
	SURGUTNEFTEGAS-SP ADR	13,769	0.00	0.00	
	TATNEFT PAO-SPONSORED ADR	4,090	0.00	0.00	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	5,573	7.69	42,856.37	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	11,117	0.00	0.00	
	NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR	2,773	0.00	0.00	
	PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	2,330	0.00	0.00	
	PHOSAGRO PJSC(BLOCKED)-GDR	15	0.00	0.00	
	POLYUS PJSC-REG S-GDR	1,288	0.00	0.00	
	SEVERSTAL - GDR REG S	3,862	0.00	0.00	
	SOUTHERN COPPER CORP	2,307	76.76	177,085.32	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	11,187	26.43	295,672.41	
	NIO INC - ADR	36,208	10.64	385,253.12	
	H WORLD GROUP LTD	5,136	40.93	210,216.48	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	11,675	6.10	71,217.50	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	11,085	58.85	652,352.25	
	AUTOHOME INC-ADR	2,118	29.26	61,972.68	
	IQIYI INC-ADR	11,203	5.26	58,927.78	
	JOYY INC	1,098	33.22	36,475.56	
	KANZHUN LTD	4,502	15.98	71,941.96	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	19,111	7.02	134,159.22	
	VK CO LTD	2,211	0.00	0.00	
	WEIBO CORP-SPON ADR	1,731	13.79	23,870.49	
	MINISO GROUP HOLDING LTD-ADR	2,291	17.89	40,985.99	
	PDD HOLDINGS INC	13,382	75.23	1,006,727.86	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	9,598	16.52	158,558.96	
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	1	0.00	0.00		
X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	2,296	0.00	0.00		
LEGEND BIOTECH CORP-ADR	1,616	70.42	113,798.72		

	COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	105,788	1.18	124,829.84
	CREDICORP LTD	1,808	156.29	282,572.32
	TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	2,188	0.00	0.00
	LUFAX HOLDING LTD-ADR	16,257	1.59	25,848.63
	QIFU TECHNOLOGY INC	3,164	18.18	57,521.52
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	14,388	2.63	37,969.93
	DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	1,554	38.39	59,658.06
	KE HOLDINGS INC	17,711	14.89	263,716.79
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	31,080	0.63	19,611.48
	米ドル 小計	418,211		4,454,483.04 (622,291,280)
メキシコペソ	CEMEX SAB-CPO	385,000	12.48	4,804,800.00
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	83,000	84.21	6,989,430.00
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	5,350	238.19	1,274,316.50
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	27,700	37.92	1,050,384.00
	ALFA S. A. B. -A	87,800	10.15	891,170.00
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	14,500	129.15	1,872,675.00
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	10,200	313.62	3,198,924.00
	GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	5,295	477.60	2,528,892.00
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	5,980	170.82	1,021,503.60
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	59,200	16.65	985,680.00
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	139,200	68.44	9,526,848.00
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	13,400	174.36	2,336,424.00
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	14,350	139.82	2,006,417.00
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	51,800	180.96	9,373,728.00
	GRUMA S. A. B. -B	5,455	285.07	1,555,056.85
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	33,400	87.79	2,932,186.00
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	40,200	38.82	1,560,564.00
	BANCO DEL BAJIO SA	22,200	56.14	1,246,308.00
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	69,000	150.07	10,354,830.00
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	54,000	42.15	2,276,100.00
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	830,200	17.59	14,603,218.00
	メキシコペソ 小計	1,957,230		82,389,454.95 (688,817,038)
ブラジルリアル	COSAN SA	34,500	19.32	666,540.00
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	99,000	32.46	3,213,540.00

PETROBRAS – PETROLEO BRAS-PR	126,500	29.10	3,681,150.00
PRIO SA	19,700	44.14	869,558.00
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	20,900	18.88	394,592.00
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	17,000	12.70	215,900.00
GERDAU SA-PREF	31,695	27.43	869,393.85
KLABIN SA – UNIT	18,200	20.95	381,290.00
SUZANO SA	21,307	43.47	926,215.29
VALE SA	89,704	67.24	6,031,696.96
WEG SA	45,000	37.91	1,705,950.00
CCR SA	26,700	13.53	361,251.00
LOCALIZA RENT A CAR	23,710	69.46	1,646,896.60
RUMO SA	36,000	22.80	820,800.00
LOJAS RENNER S. A.	23,620	17.78	419,963.60
MAGAZINE LUIZA SA	86,300	2.94	253,722.00
VIBRA ENERGIA SA	28,100	16.86	473,766.00
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	19,100	10.70	204,370.00
RAIA DROGASIL SA	33,876	27.99	948,189.24
SENDAS DISTRIBUIDORA SA	34,700	12.14	421,258.00
AMBEV SA	126,400	14.63	1,849,232.00
JBS SA	21,300	18.21	387,873.00
NATURA &CO HOLDING SA	22,400	15.93	356,832.00
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	150,892	4.13	623,183.96
REDE D'OR SAO LUIZ SA	14,200	32.95	467,890.00
HYPERA SA	9,800	44.02	431,396.00
BANCO BRADESCO S. A.	42,615	14.59	621,752.85
BANCO BRADESCO SA-PREF	142,636	16.51	2,354,920.36
BANCO DO BRASIL S. A.	22,000	47.43	1,043,460.00
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	8,100	29.50	238,950.00
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	129,000	27.97	3,608,130.00
ITAUSA SA	129,170	9.66	1,247,782.20
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	153,300	14.60	2,238,180.00
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	32,400	32.89	1,065,636.00
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	18,600	30.18	561,348.00
TOTVS SA	12,700	29.01	368,427.00
TELEFONICA BRASIL S. A.	11,000	40.29	443,190.00
TIM SA	24,000	13.78	330,720.00

	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	7,100	42.49	301,679.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	30,800	37.81	1,164,548.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	34,434	12.40	426,981.60	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	8,100	54.17	438,777.00	
	CPFL ENERGIA SA	7,200	35.16	253,152.00	
	ENERGISA SA-UNITS	6,100	49.40	301,340.00	
	ENEVA SA	22,700	12.52	284,204.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	6,275	44.55	279,551.25	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	28,200	33.36	940,752.00	
	ブラジルリアル 小計	2,057,034		47,135,930.76 (1,373,107,371)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	9,594	6,368.00	61,094,592.00	
	EMPRESAS CMPC SA	33,869	1,628.90	55,169,214.10	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	3,822	64,550.00	246,710,100.00	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES	466,759	59.60	27,818,836.40	
	FALABELLA SA	21,259	2,279.80	48,466,268.20	
	CENCOSUD SA	35,890	1,816.80	65,204,952.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	3,292	6,898.00	22,708,216.00	
	BANCO DE CHILE	1,244,596	88.88	110,619,692.48	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	1,739	23,781.00	41,355,159.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	1,641,012	42.22	69,283,526.64	
	ENEL AMERICAS SA	517,290	109.79	56,793,269.10	
	ENEL CHILE SA	827,632	60.00	49,657,920.00	
	チリペソ 小計	4,806,754		854,881,745.92 (147,776,568)	
コロンビアペソ	BANCOLOMBIA SA	6,380	33,600.00	214,368,000.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	10,944	29,780.00	325,912,320.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	12,989	17,300.00	224,709,700.00	
	コロンビアペソ 小計	30,313		764,990,020.00 (26,845,794)	
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	1,474	22.82	33,636.68	
	MYTILINEOS S. A.	2,599	35.68	92,732.32	
	OPAP SA	4,870	16.28	79,283.60	
	JUMBO SA	2,974	27.90	82,974.60	
	ALPHA SERVICES AND HOLDINGS	65,690	1.62	106,647.71	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	74,565	1.63	121,540.95	

	NATIONAL BANK OF GREECE	14,028	6.22	87,254.16	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	4,849	14.60	70,795.40	
	PUBLIC POWER CORP	5,654	10.75	60,780.50	
	TERNA ENERGY SA	1,400	18.11	25,354.00	
	ユーロ 小計	178,103		760,999.92 (119,271,517)	
英ポンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	5,948	0.00	0.00	
	英ポンド 小計	5,948		0.00 (0)	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	27,711	89.45	2,478,748.95	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	34,746	37.68	1,309,229.28	
	HEKTAS TICARET T. A. S	35,672	31.36	1,118,673.92	
	KOZA ALTIN ISLETMELERI AS	25,931	27.30	707,916.30	
	SASA POLYESTER SANAYI	27,188	62.25	1,692,453.00	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	15,288	71.60	1,094,620.80	
	KOC HOLDING AS	18,208	114.50	2,084,816.00	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	37,427	49.94	1,869,104.38	
	PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS	1,253	731.70	916,820.10	
	TURK HAVA YOLLARI AO	14,261	223.60	3,188,759.60	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	1,780	835.00	1,486,300.00	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	3,208	253.70	813,869.60	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	11,198	199.90	2,238,480.20	
	AKBANK T. A. S.	83,796	25.02	2,096,575.92	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	30,648	52.35	1,604,422.80	
	TURKIYE IS BANKASI-C	90,125	14.27	1,286,083.75	
	YAPI VE KREDI BANKASI	92,810	13.22	1,226,948.20	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	31,132	47.12	1,466,939.84	
	トルコリラ 小計	582,382		28,680,762.64 (149,117,021)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	2,117	715.00	1,513,655.00	
	MONETA MONEY BANK AS	7,045	83.20	586,144.00	
	CEZ AS	4,323	897.00	3,877,731.00	
	チェココルナ 小計	13,485		5,977,530.00 (39,171,949)	
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	11,609	3,190.00	37,032,710.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	3,960	8,800.00	34,848,000.00	

	OTP BANK PLC	6,308	12,500.00	78,850,000.00	
	ハンガリーフォリント 小計	21,877		150,730,710.00 (62,476,221)	
ポーランドズロチ	ORLEN SA	14,813	70.44	1,043,427.72	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	3,988	116.60	465,000.80	
	LPP SA	26	14,420.00	374,920.00	
	CD PROJEKT SA	1,602	160.00	256,320.00	
	CYFROWY POLSAT SA	8,679	16.66	144,635.53	
	ALLEGRO. EU SA	11,388	32.50	370,110.00	
	PEPCO GROUP NV	5,086	35.48	180,451.28	
	DINO POLSKA SA	1,364	474.00	646,536.00	
	BANK PEKAO SA	5,176	114.95	594,981.20	
	MBANK SA	290	465.80	135,082.00	
	PKO BANK POLSKI SA	22,290	39.89	889,148.10	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	977	406.00	396,662.00	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	15,971	38.79	619,515.09	
	PGE SA	29,021	8.44	245,111.36	
	ポーランドズロチ 小計	120,671		6,361,901.08 (223,952,278)	
ロシアルーブル	GAZPROM PJSC	209,472	0.00	0.00	
	LUKOIL PJSC	7,345	0.00	0.00	
	ROSNEFT OIL CO PJSC	20,180	0.00	0.00	
	SURGUTNEFTEGAS-PREFERENCE	131,600	0.00	0.00	
	ALROSA PJSC	46,260	0.00	0.00	
	UNITED CO RUSAL INTERNATIONA	55,000	0.00	0.00	
	YANDEX NV-A	5,354	0.00	0.00	
	OZON HOLDINGS PLC - ADR	920	0.00	0.00	
	MAGNIT PJSC	1,334	0.00	0.00	
	SBERBANK OF RUSSIA PJSC	190,680	0.00	0.00	
	VTB BANK PJSC	65,736,000	0.00	0.00	
	MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ	22,980	0.00	0.00	
	MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JO	16,768	0.00	0.00	
	INTER RAO UES PJSC	725,000	0.00	0.00	
	ロシアルーブル 小計	67,168,893		0.00 (0)	
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO-H	58,000	5.79	335,820.00	

CHINA OILFIELD SERVICES-H	50,000	9.01	450,500.00	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	650,000	4.58	2,977,000.00	
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	89,500	23.15	2,071,925.00	
COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	38,000	8.50	323,000.00	
PETROCHINA CO LTD-H	560,000	5.87	3,287,200.00	
YANKUANG ENERGY GROUP CO-H	57,000	11.72	668,040.00	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	110,000	3.48	382,800.00	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	30,500	19.74	602,070.00	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	64,500	6.63	427,635.00	
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	100,000	4.44	444,000.00	
CHINA RESOURCES CEMENT	68,000	3.00	204,000.00	
CMOC GROUP LTD-H	87,000	4.73	411,510.00	
DONGYUE GROUP	44,000	7.60	334,400.00	
GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD-H	9,640	51.25	494,050.00	
JIANGXI COPPER CO LTD-H	31,000	12.48	386,880.00	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	42,000	4.85	203,700.00	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	20,500	16.14	330,870.00	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	31,500	11.72	369,180.00	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	152,000	12.64	1,921,280.00	
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	61,000	3.88	236,680.00	
BOC AVIATION LTD	6,100	65.45	399,245.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	68,000	3.62	246,160.00	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	43,000	9.06	389,580.00	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	26,000	4.71	122,460.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	113,000	4.94	558,220.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	58,000	9.39	544,620.00	
CITIC LTD	155,000	8.48	1,314,400.00	
CRRC CORP LTD - H	118,000	4.30	507,400.00	
FOSUN INTERNATIONAL LTD	72,500	5.32	385,700.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	17,000	18.38	312,460.00	
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	27,000	11.06	298,620.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	49,000	11.36	556,640.00	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	13,800	31.30	431,940.00	
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL LIMITED	92,000	3.05	280,600.00	
AIR CHINA LTD-H	42,000	5.95	249,900.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	46,000	4.99	229,540.00	

CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	40,000	10.42	416,800.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	46,000	4.63	212,980.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	83,700	8.13	680,481.00	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	46,000	4.62	212,520.00	
JD LOGISTICS INC	52,200	12.12	632,664.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	30,000	6.93	207,900.00	
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	3,500	121.00	423,500.00	
SHENZHEN INTL HOLDINGS	32,500	7.12	231,400.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	32,000	6.05	193,600.00	
BYD CO LTD-H	26,500	265.20	7,027,800.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	70,000	3.52	246,400.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	16,400	33.05	542,020.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	161,000	9.69	1,560,090.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	64,000	9.48	606,720.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	70,000	4.64	324,800.00	
LI AUTO INC-CLASS A	29,688	145.80	4,328,510.40	
MINTH GROUP LTD	22,000	22.90	503,800.00	
XPENG INC-CLASS A SHARES	27,664	57.20	1,582,380.80	
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	32,000	17.10	547,200.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	32,400	82.95	2,687,580.00	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	110,000	3.43	377,300.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	61,000	23.90	1,457,900.00	
LI NING CO LTD	62,500	40.50	2,531,250.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	21,900	78.25	1,713,675.00	
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	41,500	7.91	328,265.00	
EAST BUY HOLDING LTD	10,500	29.90	313,950.00	
H Aidilao INTERNATIONAL HOLDI	44,000	18.16	799,040.00	
JiUmaoJiu INTERNATIONAL HOLD	27,000	13.16	355,320.00	
MEITUAN	133,810	127.70	17,087,537.00	
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	41,510	35.00	1,452,850.00	
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LT	34,800	17.70	615,960.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	25,000	13.42	335,500.00	
TRIP.COM GROUP LTD	14,460	286.00	4,135,560.00	
BAIDU INC-CLASS A	59,530	142.10	8,459,213.00	
BILIBILI INC-CLASS Z	5,117	124.20	635,531.40	
CHINA LITERATURE LTD	9,800	32.65	319,970.00	

CHINA RUYI HOLDINGS LIMITED	136,000	2.59	352,240.00
KINGSOFT CORP LTD	24,200	34.15	826,430.00
KUAISHOU TECHNOLOGY	61,100	57.90	3,537,690.00
NETEASE INC	52,100	163.10	8,497,510.00
TENCENT HOLDINGS LTD	164,400	333.00	54,745,200.00
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	437,740	90.35	39,549,809.00
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	20,000	8.74	174,800.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-H	1,900	108.20	205,580.00
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	49,600	13.04	646,784.00
JD.COM INC - CL A	62,210	142.80	8,883,588.00
POP MART INTERNATIONAL GROUP	15,000	18.90	283,500.00
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	50,000	6.76	338,000.00
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	19,500	26.90	524,550.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	118,000	4.96	585,280.00
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	29,550	51.85	1,532,167.50
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	15,000	18.68	280,200.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	2,600	138.58	360,308.00
CHINA FEIHE LTD	95,000	4.40	418,000.00
CHINA MENGNIU DAIRY CO	84,000	27.75	2,331,000.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	42,000	48.95	2,055,900.00
DALI FOODS GROUP CO LTD	66,500	3.55	236,075.00
NONGFU SPRING CO LTD-H	46,800	43.20	2,021,760.00
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	48,000	7.88	378,240.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	50,000	11.80	590,000.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	16,000	67.60	1,081,600.00
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	31,000	6.30	195,300.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	123,000	5.27	648,210.00
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	14,000	16.64	232,960.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	17,500	30.65	536,375.00
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	9,000	18.24	164,160.00
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	9,000	45.00	405,000.00
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	24,200	14.30	346,060.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	64,000	10.30	659,200.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	21,500	14.18	304,870.00
SINOPHARM GROUP CO-H	33,600	23.90	803,040.00
3SBIO INC	52,500	7.19	377,475.00

AKESO INC	13,000	35.90	466,700.00
BEIGENE LTD	18,296	117.30	2,146,120.80
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	33,000	12.06	397,980.00
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	43,500	6.06	263,610.00
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	90,000	3.36	302,400.00
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	240,000	6.22	1,492,800.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	30,000	16.38	491,400.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	2,700	44.55	120,285.00
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	32,000	12.38	396,160.00
INNOVENT BIOLOGICS INC	29,500	30.75	907,125.00
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	9,600	16.66	159,936.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	14,000	20.40	285,600.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	279,250	3.41	952,242.50
WUXI APPTec CO LTD-H	10,168	69.55	707,184.40
WUXI BIOLOGICS (CAYMAN) INC.	101,500	40.05	4,065,075.00
ZAI LAB LTD	23,030	23.05	530,841.50
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	772,000	2.61	2,014,920.00
BANK OF CHINA LTD-H	2,100,000	2.74	5,754,000.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	232,000	4.46	1,034,720.00
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	245,000	3.62	886,900.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	2,546,000	4.29	10,922,340.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	69,000	2.20	151,800.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	103,000	33.25	3,424,750.00
CHINA MINSHENG BANKING-H	171,600	2.88	494,208.00
IND & COMM BK OF CHINA-H	1,497,000	3.59	5,374,230.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	214,000	4.44	950,160.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	250,000	0.78	195,000.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	82,000	3.99	327,180.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	38,800	14.08	546,304.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	53,000	14.14	749,420.00
FAR EAST HORIZON LTD	38,000	5.70	216,600.00
GF SECURITIES CO LTD-H	26,800	10.60	284,080.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	65,200	4.93	321,436.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	35,800	9.79	350,482.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	199,000	11.64	2,316,360.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	71,200	19.18	1,365,616.00

CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	33,400	7.50	250,500.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	20,700	19.10	395,370.00	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	224,000	2.82	631,680.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	184,000	8.45	1,554,800.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	168,000	50.25	8,442,000.00	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	19,800	22.00	435,600.00	
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	80,000	4.97	397,600.00	
GDS HOLDINGS LTD-CL A	25,524	11.38	290,463.12	
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	72,000	11.58	833,760.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	17,500	18.72	327,600.00	
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	19,500	27.75	541,125.00	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	19,000	20.70	393,300.00	
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	24,000	7.64	183,360.00	
LENOVO GROUP LTD	196,000	8.63	1,691,480.00	
SUNNY OPTICAL TECH	19,100	78.00	1,489,800.00	
XIAOMI CORP-CLASS B	403,400	11.16	4,501,944.00	
ZTE CORP-H	18,800	30.20	567,760.00	
CHINA TOWER CORP LTD-H	1,178,000	0.86	1,013,080.00	
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	14,500	28.15	408,175.00	
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	122,000	1.90	231,800.00	
CGN POWER CO LTD-H	285,000	1.92	547,200.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	78,000	8.42	656,760.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	88,000	7.79	685,520.00	
CHINA POWER INTERNATIONAL	126,000	3.07	386,820.00	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	24,200	25.50	617,100.00	
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	52,000	17.38	903,760.00	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	21,000	88.75	1,863,750.00	
GUANGDONG INVESTMENT LTD	78,000	6.37	496,860.00	
HUANENG POWER INTL INC-H	96,000	4.91	471,360.00	
KUNLUN ENERGY CO LTD	102,000	6.16	628,320.00	
FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	11,000	23.15	254,650.00	
GCL TECHNOLOGY HOLDINGS LTD	517,000	1.61	832,370.00	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	16,000	26.60	425,600.00	
SHANGHAI FUDAN MICROELECT-H	7,000	21.10	147,700.00	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	130,000	8.12	1,055,600.00	
C&D INTERNATIONAL INVESTMENT	16,000	18.76	300,160.00	

	CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	94,000	1.10	103,400.00	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	102,000	16.20	1,652,400.00	
	CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	40,000	8.19	327,600.00	
	CHINA RESOURCES LAND LTD	86,000	31.45	2,704,700.00	
	CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	18,800	36.40	684,320.00	
	CHINA VANKE CO LTD-H	56,400	9.71	547,644.00	
	COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	276,000	1.41	389,160.00	
	COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	57,000	8.92	508,440.00	
	GREENTOWN CHINA HOLDINGS	21,500	7.41	159,315.00	
	GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	36,000	3.77	135,720.00	
	LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	50,500	15.84	799,920.00	
	SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	20,000	4.42	88,400.00	
	YUEXIU PROPERTY CO LTD	50,800	8.52	432,816.00	
	香港ドル 小計	22,221,387		317,641,382.42 (5,682,604,331)	
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	95,700	2.23	213,411.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	5,900	22.20	130,980.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	66,900	6.31	422,139.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	102,800	4.85	498,580.00	
	GAMUDA BHD	49,000	4.45	218,050.00	
	SIME DARBY BERHAD	56,700	2.06	116,802.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	13,800	6.90	95,220.00	
	MISC BHD	36,800	7.15	263,120.00	
	GENTING BHD	57,900	4.20	243,180.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	91,400	2.54	232,156.00	
	MR DIY GROUP M BHD	92,550	1.48	136,974.00	
	IOI CORP BHD	69,200	3.88	268,496.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	12,000	22.80	273,600.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	1,800	131.40	236,520.00	
	PPB GROUP BERHAD	16,120	16.14	260,176.80	
	QL RESOURCES BHD	30,350	5.32	161,462.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	63,000	4.40	277,200.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	59,200	5.84	345,728.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	153,200	0.92	140,944.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	36,600	3.64	133,224.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	172,800	5.22	902,016.00	

	HONG LEONG BANK BERHAD	16,200	18.92	306,504.00	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	5,300	17.60	93,280.00	
	MALAYAN BANKING BHD	142,900	8.82	1,260,378.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	389,100	3.96	1,540,836.00	
	RHB BANK BHD	39,200	5.50	215,600.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	72,600	2.51	182,226.00	
	CELCOMDIGI BHD	90,500	4.26	385,530.00	
	MAXIS BHD	64,700	4.07	263,329.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	36,600	4.84	177,144.00	
	PETRONAS GAS BHD	22,900	16.94	387,926.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	71,400	9.10	649,740.00	
	INARI AMERTRON BHD	74,800	3.10	231,880.00	
	マレーシアリングイト 小計	2,309,920		11,264,351.80 (345,158,888)	
タイパーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	201,000	9.45	1,899,450.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	37,900	157.50	5,969,250.00	
	PTT PCL-NVDR	270,400	34.50	9,328,800.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	31,600	47.25	1,493,100.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	53,800	33.75	1,815,750.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	54,100	39.00	2,109,900.00	
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	32,200	39.50	1,271,900.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	19,700	324.00	6,382,800.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	115,700	71.75	8,301,475.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	234,600	8.80	2,064,480.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	207,000	7.70	1,593,900.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	190,600	4.50	857,700.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	75,900	32.25	2,447,775.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	45,225	40.75	1,842,918.75	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	145,900	14.00	2,042,600.00	
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	85,300	21.50	1,833,950.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	36,100	34.75	1,254,475.00	
	CP ALL PCL-NVDR	157,200	62.75	9,864,300.00	
	CP AXTRA PCL-NVDR	59,000	35.00	2,065,000.00	
	CARABAO GROUP PCL-NVDR	4,900	70.50	345,450.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	94,100	19.70	1,853,770.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	31,400	29.50	926,300.00	

	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	280,500	28.75	8,064,375.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	16,900	222.00	3,751,800.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	13,200	134.50	1,775,400.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	84,100	20.10	1,690,410.00	
	SCB X PCL-NVDR	21,200	111.00	2,353,200.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	23,600	46.50	1,097,400.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	16,300	37.75	615,325.00	
	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	16,200	49.00	793,800.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	84,500	105.50	8,914,750.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	30,000	221.00	6,630,000.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	28,600	76.75	2,195,050.00	
	TRUE CORP PCL/NEW-NVDR	327,315	7.05	2,307,570.75	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	25,200	36.50	919,800.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	6,300	138.50	872,550.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	48,000	56.75	2,724,000.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	21,300	55.25	1,176,825.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	81,400	49.00	3,988,600.00	
	RATCH GROUP PCL-NVDR	21,900	36.75	804,825.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	57,400	65.75	3,774,050.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	207,600	8.50	1,764,600.00	
	タイパーツ 小計	3,595,140		123,779,374.50 (509,971,022)	
フィリピンペン	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	51,250	53.30	2,731,625.00	
	AYALA CORPORATION	7,910	620.00	4,904,200.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	72,731	44.70	3,251,075.70	
	SM INVESTMENTS CORP	6,870	921.00	6,327,270.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	24,500	207.60	5,086,200.00	
	JOLLIBEE FOODS CORP	11,290	255.00	2,878,950.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	24,530	131.00	3,213,430.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	54,578	113.40	6,189,145.20	
	BDO UNIBANK INC	65,396	141.70	9,266,613.20	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	45,472	56.00	2,546,432.00	
	PLDT INC	1,865	1,306.00	2,435,690.00	
	ACEN CORP	14,250	5.37	76,522.50	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	7,490	349.80	2,620,002.00	
	AYALA LAND INC	181,100	26.05	4,717,655.00	

	SM PRIME HOLDINGS INC	252,700	33.00	8,339,100.00	
	フィリピンペソ 小計	821,932		64,583,910.60 (165,457,520)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY TBK PT	355,100	2,330.00	827,383,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	45,500	24,250.00	1,103,375,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK	175,600	1,990.00	349,444,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	909,184	775.00	704,617,600.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	89,700	8,725.00	782,632,500.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	292,209	3,160.00	923,380,440.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	101,289	6,775.00	686,232,975.00	
	VALE INDONESIA TBK	49,100	6,425.00	315,467,500.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	507,600	6,575.00	3,337,470,000.00	
	GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT	22,100,000	115.00	2,541,500,000.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	409,300	2,750.00	1,125,575,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	181,300	5,325.00	965,422,500.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	75,400	11,750.00	885,950,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	117,600	7,350.00	864,360,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	202,200	4,270.00	863,394,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	526,300	2,000.00	1,052,600,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	1,473,900	9,150.00	13,486,185,000.00	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	999,900	5,350.00	5,349,465,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	207,300	8,900.00	1,844,970,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	1,816,545	5,625.00	10,218,065,625.00	
SARANA MENARA NUSANTARA PT	412,300	1,050.00	432,915,000.00		
TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	1,327,300	3,850.00	5,110,105,000.00		
	インドネシアルピア 小計	32,374,627		53,770,510,140.00 (505,442,795)	
韓国ウォン	HD HYUNDAI	1,185	59,400.00	70,389,000.00	
	S-OIL CORP	1,083	69,800.00	75,593,400.00	
	SK INNOVATION CO LTD	1,402	169,500.00	237,639,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORP	2,898	44,450.00	128,816,100.00	
	HYUNDAI STEEL CO	2,249	33,450.00	75,229,050.00	
	KOREA ZINC CO LTD	231	462,500.00	106,837,500.00	
	KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	458	125,500.00	57,479,000.00	
	LG CHEM LTD	1,320	687,000.00	906,840,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	197	388,000.00	76,436,000.00	

LOTTE CHEMICAL CORP	484	146,200.00	70,760,800.00	
POSCO FUTURE M CO LTD	803	480,000.00	385,440,000.00	
POSCO HOLDINGS INC	1,912	499,500.00	955,044,000.00	
SK IE TECHNOLOGY CO LTD	775	91,300.00	70,757,500.00	
SKC CO LTD	602	96,300.00	57,972,600.00	
CJ CORP	425	61,900.00	26,307,500.00	
DOOSAN BOBCAT INC	1,487	59,400.00	88,327,800.00	
DOOSAN ENERBILITY	11,421	17,670.00	201,809,070.00	
ECOPRO BM CO LTD	1,314	361,000.00	474,354,000.00	
GS HOLDINGS	1,411	38,050.00	53,688,550.00	
HANWHA AEROSPACE CO LTD	957	127,900.00	122,400,300.00	
HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	607	144,800.00	87,893,600.00	
HD KOREA SHIPBUILDING & OFFS	1,038	126,500.00	131,307,000.00	
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	2,000	37,450.00	74,900,000.00	
HYUNDAI MIPO DOCKYARD	517	91,500.00	47,305,500.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	1,854	52,300.00	96,964,200.00	
LG CORP	2,401	86,400.00	207,446,400.00	
LG ENERGY SOLUTION	938	560,000.00	525,280,000.00	
POSCO INTERNATIONAL CORP	1,476	46,950.00	69,298,200.00	
SAMSUNG C&T CORP	2,130	103,300.00	220,029,000.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	3,781	32,450.00	122,693,450.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	15,535	8,560.00	132,979,600.00	
SK	1,030	147,000.00	151,410,000.00	
SK SQUARE CO LTD	2,400	46,450.00	111,480,000.00	
HMM CO LTD	6,429	19,020.00	122,279,580.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	524	188,000.00	98,512,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	4,956	25,450.00	126,130,200.00	
PAN OCEAN CO LTD	5,356	4,960.00	26,565,760.00	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	1,948	37,000.00	72,076,000.00	
HANON SYSTEMS	3,541	9,200.00	32,577,200.00	
HYUNDAI MOBIS CO LTD	1,635	244,000.00	398,940,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	3,690	202,000.00	745,380,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	870	106,700.00	92,829,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	533	106,400.00	56,711,200.00	
KIA CORP	7,008	86,000.00	602,688,000.00	
COWAY CO LTD	1,442	44,100.00	63,592,200.00	

F&F CO LTD / NEW	518	105,300.00	54,545,400.00	
LG ELECTRONICS INC	2,914	123,500.00	359,879,000.00	
KANGWON LAND INC	3,072	16,410.00	50,411,520.00	
HYBE CO LTD	525	263,500.00	138,337,500.00	
KAKAO CORP	8,310	50,400.00	418,824,000.00	
KAKAO GAMES CORP	1,051	32,850.00	34,525,350.00	
KRAFTON INC	724	183,300.00	132,709,200.00	
NAVER CORP	3,490	204,500.00	713,705,000.00	
NCSOFT CORP	383	287,500.00	110,112,500.00	
NETMARBLE CORPORATION	392	48,700.00	19,090,400.00	
PEARL ABYSS CORP	960	56,600.00	54,336,000.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	885	72,800.00	64,428,000.00	
BGF RETAIL CO LTD/NEW	138	164,100.00	22,645,800.00	
E-MART INC	557	78,400.00	43,668,800.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	221	278,000.00	61,438,000.00	
KT&G CORP	2,766	82,000.00	226,812,000.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	591	117,100.00	69,206,100.00	
AMOREPACIFIC CORP	788	105,800.00	83,370,400.00	
LG H&H	260	454,000.00	118,040,000.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	2,829	63,900.00	180,773,100.00	
HLB INC	2,982	31,000.00	92,442,000.00	
CELLTRION INC	2,900	149,900.00	434,710,000.00	
CELLTRION PHARM INC	355	82,200.00	29,181,000.00	
HANMI PHARM CO LTD	214	275,000.00	58,850,000.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	477	741,000.00	353,457,000.00	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	783	81,600.00	63,892,800.00	
SK BIOSCIENCE CO LTD	710	76,000.00	53,960,000.00	
YUHAN CORP	1,526	60,000.00	91,560,000.00	
HANA FINANCIAL GROUP	7,972	38,750.00	308,915,000.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	6,372	10,180.00	64,866,960.00	
KAKAOBANK CORP	4,052	25,500.00	103,326,000.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	10,410	48,150.00	501,241,500.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	11,243	33,550.00	377,202,650.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	15,149	11,660.00	176,637,340.00	
KAKAOPAY CORP	730	49,950.00	36,463,500.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	1,162	50,600.00	58,797,200.00	

	MERITZ FINANCIAL GROUP INC	2,513	45,200.00	113,587,600.00	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	5,653	6,990.00	39,514,470.00	
	NH INVESTMENT & SECURITIES C	2,964	9,680.00	28,691,520.00	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	1,943	36,200.00	70,336,600.00	
	DB INSURANCE CO LTD	1,260	72,100.00	90,846,000.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	856	237,500.00	203,300,000.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	2,205	69,100.00	152,365,500.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	1,032	129,600.00	133,747,200.00	
	COSMOAM&T CO LTD	620	202,500.00	125,550,000.00	
	L&F CO LTD	644	279,000.00	179,676,000.00	
	LG DISPLAY CO LTD	5,817	14,930.00	86,847,810.00	
	LG INNOTEK CO LTD	384	288,000.00	110,592,000.00	
	LOTTE ENERGY MATERIALS CORP	440	53,800.00	23,672,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	1,437	153,200.00	220,148,400.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	126,333	71,700.00	9,058,076,100.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	21,845	59,800.00	1,306,331,000.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	1,461	695,000.00	1,015,395,000.00	
	KT CORP	1,598	29,400.00	46,981,200.00	
	LG UPLUS CORP	6,485	10,330.00	66,990,050.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	7,197	20,200.00	145,379,400.00	
	SK HYNIX INC	14,474	117,500.00	1,700,695,000.00	
	韓国ウォン 小計	411,825		29,340,473,130.00 (3,242,122,280)	
新台幣ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	31,000	79.30	2,458,300.00	
	ASIA CEMENT CORP	54,000	44.80	2,419,200.00	
	CHINA STEEL CORP	315,000	29.30	9,229,500.00	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	88,000	64.30	5,658,400.00	
	FORMOSA PLASTICS CORP	102,000	82.80	8,445,600.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	127,000	70.30	8,928,100.00	
	TAIWAN CEMENT	152,917	36.60	5,596,762.20	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	3,600	961.00	3,459,600.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	92,000	29.75	2,737,000.00	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	1,500	1,810.00	2,715,000.00	
	WALSIN LIHWA CORP	74,000	40.40	2,989,600.00	
	CHINA AIRLINES LTD	75,000	24.50	1,837,500.00	
	EVA AIRWAYS CORP	66,000	36.10	2,382,600.00	

EVERGREEN MARINE CORP LTD	27,420	98.10	2,689,902.00	
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	55,000	30.25	1,663,750.00	
WAN HAI LINES LTD	18,650	50.90	949,285.00	
YANG MING MARINE TRANSPORT	41,000	46.80	1,918,800.00	
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	53,000	38.40	2,035,200.00	
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	5,420	507.00	2,747,940.00	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	10,080	202.50	2,041,200.00	
GIANT MANUFACTURING	9,000	228.50	2,056,500.00	
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	5,000	319.00	1,595,000.00	
POU CHEN	61,000	30.60	1,866,600.00	
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	8,000	767.00	6,136,000.00	
MOMO.COM INC	2,000	637.00	1,274,000.00	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	16,000	284.00	4,544,000.00	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	130,000	76.40	9,932,000.00	
PHARMAESSENTIA CORP	7,000	376.00	2,632,000.00	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	151,265	18.70	2,828,655.50	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	470,000	26.05	12,243,500.00	
E. SUN FINANCIAL HOLDING CO	359,578	26.45	9,510,838.10	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	285,168	28.15	8,027,479.20	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	222,430	22.10	4,915,703.00	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	297,125	38.85	11,543,306.25	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	276,814	18.00	4,982,652.00	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	276,445	19.25	5,321,566.25	
TAIWAN BUSINESS BANK	172,000	14.25	2,451,000.00	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	244,741	28.35	6,938,407.35	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	106,000	44.30	4,695,800.00	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	38,245	212.00	8,107,940.00	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	251,437	24.10	6,059,631.70	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	252,000	44.50	11,214,000.00	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	414,000	12.30	5,092,200.00	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	198,825	64.80	12,883,860.00	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	366,835	9.10	3,338,198.50	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	14,000	385.50	5,397,000.00	
ACER INC	78,000	36.30	2,831,400.00	
ADVANTECH CO LTD	12,427	400.00	4,970,800.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	18,000	298.00	5,364,000.00	

AUO CORP	176,200	18.85	3,321,370.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	16,000	177.50	2,840,000.00	
COMPAL ELECTRONICS	100,000	31.10	3,110,000.00	
DELTA ELECTRONICS INC	52,000	357.00	18,564,000.00	
E INK HOLDINGS INC	24,000	219.00	5,256,000.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	330,800	108.50	35,891,800.00	
INNOLUX CORP	254,475	15.75	4,007,981.25	
INVENTEC CORP	73,000	63.60	4,642,800.00	
LARGAN PRECISION CO LTD	2,500	2,270.00	5,675,000.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	56,000	136.50	7,644,000.00	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	17,000	187.00	3,179,000.00	
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	6,000	266.50	1,599,000.00	
PEGATRON CORP	56,000	76.80	4,300,800.00	
QUANTA COMPUTER INC	72,000	198.00	14,256,000.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	34,000	59.30	2,016,200.00	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	35,000	203.00	7,105,000.00	
WISTRON CORP	73,000	128.00	9,344,000.00	
WIWYNN CORP	2,000	1,800.00	3,600,000.00	
WPG HOLDINGS LTD	35,960	57.80	2,078,488.00	
YAGEO CORPORATION	8,524	486.00	4,142,664.00	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	18,000	105.00	1,890,000.00	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	101,000	115.00	11,615,000.00	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	44,000	70.90	3,119,600.00	
TAIWAN MOBILE CO LTD	47,000	94.20	4,427,400.00	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	82,000	112.50	9,225,000.00	
EMEMORY TECHNOLOGY INC	1,800	2,050.00	3,690,000.00	
GLOBAL UNICHIP CORP	2,300	1,850.00	4,255,000.00	
GLOBALWAFERS CO LTD	6,000	517.00	3,102,000.00	
MEDIATEK INC	39,800	696.00	27,700,800.00	
NANYA TECHNOLOGY CORP	30,000	70.40	2,112,000.00	
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	16,000	404.50	6,472,000.00	
PARADE TECHNOLOGIES LTD	2,000	919.00	1,838,000.00	
POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU	70,000	30.10	2,107,000.00	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	13,000	415.00	5,395,000.00	
SILERGY CORP	8,640	340.50	2,941,920.00	
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	652,000	581.00	378,812,000.00	

	UNITED MICROELECTRONICS CORP	298,000	47.50	14,155,000.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	21,000	80.00	1,680,000.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	9,000	171.50	1,543,500.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	77,000	27.95	2,152,150.00	
	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	49,608	35.10	1,741,240.80	
	新台湾ドル 小計	9,148,529		874,205,991.10 (3,926,408,788)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	19,660	384.55	7,560,253.00	
	COAL INDIA LTD	42,402	228.60	9,693,097.20	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	14,851	297.90	4,424,112.90	
	INDIAN OIL CORP LTD	70,217	98.25	6,898,820.25	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	81,360	166.75	13,566,780.00	
	PETRONET LNG LTD	18,996	224.85	4,271,250.60	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	80,649	2,841.85	229,192,360.65	
	ACC LTD	1,469	1,800.05	2,644,273.45	
	AMBUJA CEMENTS LTD	13,736	419.30	5,759,504.80	
	ASIAN PAINTS LTD	10,272	3,514.65	36,102,484.80	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	6,576	683.55	4,495,024.80	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	7,281	1,784.20	12,990,760.20	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	31,670	439.20	13,909,464.00	
	JINDAL STEEL & POWER LTD	10,594	640.05	6,780,689.70	
	JSW STEEL LTD	15,763	791.90	12,482,719.70	
	PI INDUSTRIES LTD	2,083	3,645.95	7,594,513.85	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	4,189	2,685.95	11,251,444.55	
	SHREE CEMENT LTD	251	24,028.30	6,031,103.30	
	SRF LTD	4,133	2,241.25	9,263,086.25	
	TATA STEEL LTD	197,316	116.70	23,026,777.20	
	ULTRATECH CEMENT LTD	3,033	8,329.20	25,262,463.60	
	UPL LTD	13,811	639.15	8,827,300.65	
	VEDANTA LTD	18,821	283.65	5,338,576.65	
	ABB INDIA LTD	1,585	4,493.50	7,122,197.50	
	ADANI ENTERPRISES LTD	4,197	2,423.75	10,172,478.75	
	BHARAT ELECTRONICS LTD	102,464	126.90	13,002,681.60	
	CG POWER AND INDUSTRIAL SOLU	15,444	417.40	6,446,325.60	
	HAVELLS INDIA LTD	7,120	1,364.00	9,711,680.00	
	HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	2,237	3,860.90	8,636,833.30	

LARSEN & TOUBRO LTD	18,402	2,494.15	45,897,348.30
SIEMENS LTD	2,310	3,710.35	8,570,908.50
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	6,472	625.50	4,048,236.00
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	14,130	731.40	10,334,682.00
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	7,859	685.90	5,390,488.10
INTERGLOBE AVIATION LTD	3,501	2,700.50	9,454,450.50
BAJAJ AUTO LTD	1,903	4,823.65	9,179,405.95
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	2,334	2,430.20	5,672,086.80
BHARAT FORGE LTD	6,216	855.55	5,318,098.80
EICHER MOTORS LTD	3,761	3,330.15	12,524,694.15
HERO MOTOCORP LTD	2,952	3,096.65	9,141,310.80
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	24,535	1,544.45	37,893,080.75
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	3,577	9,607.55	34,366,206.35
MRF LTD	54	102,718.15	5,546,780.10
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN	53,088	96.20	5,107,065.60
SONA BLW PRECISION FORGINGS	10,800	553.95	5,982,660.00
TATA MOTORS LTD	44,047	620.60	27,335,568.20
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LT	2,841	3,194.20	9,074,722.20
TVS MOTOR CO LTD	6,191	1,334.10	8,259,413.10
PAGE INDUSTRIES LTD	149	36,460.45	5,432,607.05
TITAN CO LTD	9,515	2,995.65	28,503,609.75
INDIAN HOTELS CO LTD	22,920	400.25	9,173,730.00
JUBILANT FOODWORKS LTD	10,195	476.00	4,852,820.00
ZOMATO LTD	116,147	77.65	9,018,814.55
INFO EDGE INDIA LTD	1,911	4,679.50	8,942,524.50
TRENT LTD	4,453	1,716.45	7,643,351.85
AVENUE SUPERMARTS LTD	4,103	3,705.85	15,205,102.55
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	3,003	5,065.90	15,212,897.70
ITC LTD	79,816	478.85	38,219,891.60
MARICO LTD	12,369	531.85	6,578,452.65
NESTLE INDIA LTD	851	22,940.95	19,522,748.45
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	15,548	860.45	13,378,276.60
UNITED SPIRITS LTD	7,422	970.95	7,206,390.90
VARUN BEVERAGES LTD	11,762	819.85	9,643,075.70
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	3,413	1,828.85	6,241,865.05
DABUR INDIA LTD	17,113	574.55	9,832,274.15

GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	11,134	1,043.90	11,622,782.60
HINDUSTAN UNILEVER LTD	21,860	2,671.60	58,401,176.00
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	2,793	5,175.60	14,455,450.80
MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	20,500	611.55	12,536,775.00
AUROBINDO PHARMA LTD	7,383	751.10	5,545,371.30
CIPLA LTD	13,421	1,035.80	13,901,471.80
DIVI'S LABORATORIES LTD	3,145	3,638.05	11,441,667.25
DR. REDDY'S LABORATORIES	2,966	5,221.35	15,486,524.10
LUPIN LTD	4,421	932.75	4,123,687.75
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	25,785	1,081.85	27,895,502.25
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	2,579	1,924.55	4,963,414.45
AU SMALL FINANCE BANK LTD	5,313	769.35	4,087,556.55
AXIS BANK LTD	60,500	964.30	58,340,150.00
BANDHAN BANK LTD	19,777	214.55	4,243,155.35
BANK OF BARODA	27,026	200.00	5,405,200.00
HDFC BANK LIMITED	73,394	1,685.10	123,676,229.40
ICICI BANK LTD	136,870	973.45	133,236,101.50
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	28,784	1,906.60	54,879,574.40
STATE BANK OF INDIA	47,984	601.45	28,859,976.80
YES BANK LTD	275,079	17.45	4,800,128.55
BAJAJ FINANCE LTD	7,278	7,584.70	55,201,446.60
BAJAJ FINSERV LTD	9,746	1,644.10	16,023,398.60
BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMEN	806	7,456.65	6,010,059.90
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	11,638	1,170.30	13,619,951.40
MUTHOOT FINANCE LTD	2,371	1,292.75	3,065,110.25
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	7,713	865.75	6,677,529.75
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	6,408	1,785.75	11,443,086.00
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	24,553	659.05	16,181,654.65
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	5,683	1,366.45	7,765,535.35
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	8,896	559.45	4,976,867.20
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	11,421	1,310.45	14,966,649.45
HCL TECHNOLOGIES LTD	25,519	1,169.05	29,832,986.95
INFOSYS LTD	87,548	1,474.95	129,128,922.60
LTIMINDTREE LTD	2,255	4,990.50	11,253,577.50
MPHASIS LTD	1,924	2,169.80	4,174,695.20
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	24,319	3,470.05	84,388,145.95

	TATA ELXSI LTD	853	7, 558. 90	6, 447, 741. 70
	TECH MAHINDRA LTD	14, 666	1, 244. 70	18, 254, 770. 20
	WIPRO LTD	37, 402	417. 95	15, 632, 165. 90
	BHARTI AIRTEL LTD	59, 315	870. 75	51, 648, 536. 25
	ADANI GREEN ENERGY LTD	7, 170	979. 65	7, 024, 090. 50
	ADANI POWER LTD	20, 741	245. 70	5, 096, 063. 70
	GAIL INDIA LTD	58, 140	109. 50	6, 366, 330. 00
	INDRAPRASTHA GAS LTD	7, 746	497. 05	3, 850, 149. 30
	NTPC LTD	113, 658	192. 55	21, 884, 847. 90
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	90, 939	243. 25	22, 120, 911. 75
	TATA POWER CO LTD	39, 023	219. 50	8, 565, 548. 50
	DLF LTD	15, 745	501. 00	7, 888, 245. 00
	GODREJ PROPERTIES LTD	3, 754	1, 607. 50	6, 034, 555. 00
	インドルピー 小計	2, 835, 787		2, 189, 590, 167. 00 (3, 744, 199, 185)
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	16, 008	16. 55	264, 932. 40
	QATAR GAS TRANSPORT (NAKILAT)	68, 061	4. 19	285, 175. 59
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	107, 154	1. 91	204, 664. 14
	INDUSTRIES QATAR	41, 380	12. 15	502, 767. 00
	COMMERCIAL BANK PQSC	89, 506	5. 85	523, 610. 10
	DUKHAN BANK	47, 311	4. 12	195, 347. 11
	MASRAF AL RAYAN	156, 266	2. 47	386, 602. 08
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	26, 217	10. 00	262, 170. 00
	QATAR ISLAMIC BANK	41, 163	18. 65	767, 689. 95
	QATAR NATIONAL BANK	122, 744	15. 97	1, 960, 221. 68
	OOREDOO QPSC	18, 307	11. 41	208, 882. 87
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	11, 535	18. 10	208, 783. 50
	BARWA REAL ESTATE CO	60, 279	2. 60	157, 147. 35
	カタールリアル 小計	805, 931		5, 927, 993. 77 (227, 575, 680)
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	5, 798	163. 10	945, 653. 80
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	2, 290	201. 14	460, 610. 60
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	1, 807	900. 00	1, 626, 300. 00
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	11, 272	414. 63	4, 673, 709. 36
	GOLD FIELDS LTD	23, 923	285. 23	6, 823, 557. 29
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	15, 256	83. 01	1, 266, 400. 56

	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	23,265	136.28	3,170,554.20
	KUMBA IRON ORE LTD	1,694	445.94	755,422.36
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	9,656	142.56	1,376,559.36
	SASOL LTD	14,307	236.71	3,386,609.97
	SIBANYE STILLWATER LTD	72,813	33.01	2,403,557.13
	BIDVEST GROUP LTD	8,221	266.68	2,192,376.28
	MULTICHOICE GROUP LTD	9,584	83.13	796,717.92
	MR PRICE GROUP LTD	6,240	143.81	897,374.40
	NASPERS LTD-N SHS	5,199	3,374.28	17,542,881.72
	PEPKOR HOLDINGS LTD	52,043	16.25	845,698.75
	THE FOSCHINI GROUP LTD	10,240	94.35	966,144.00
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	22,905	76.61	1,754,752.05
	BID CORP LTD	8,546	421.06	3,598,378.76
	CLICKS GROUP LTD	6,931	257.99	1,788,128.69
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	12,899	237.53	3,063,899.47
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	9,547	186.62	1,781,661.14
	ABSA GROUP LTD	22,911	180.45	4,134,289.95
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	2,173	1,637.74	3,558,809.02
	NEDBANK GROUP LTD	12,732	225.51	2,871,193.32
	STANDARD BANK GROUP LTD	35,808	185.35	6,637,012.80
	FIRSTRAND LTD	134,868	70.60	9,521,680.80
	REINET INVESTMENTS SCA	3,701	443.42	1,641,097.42
	REMGRO LTD	14,915	157.27	2,345,682.05
	DISCOVERY LTD	13,990	152.15	2,128,578.50
	OLD MUTUAL LTD	121,527	12.62	1,533,670.74
	OUTSURANCE GROUP LTD	22,382	37.95	849,396.90
	SANLAM LTD	49,120	63.78	3,132,873.60
	MTN GROUP LTD	45,604	134.59	6,137,842.36
	VODACOM GROUP LTD	15,613	114.03	1,780,350.39
	NEPI ROCKCASTLE N. V.	10,844	111.00	1,203,684.00
	南アフリカランド 小計	840,624		109,593,109.66 (857,018,117)
アラブディルハム	MULTIPLY GROUP	88,559	3.26	288,702.34
	AMERICANA RESTAURANTS INTERN	70,134	3.88	272,119.92
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	88,102	3.97	349,764.94
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	73,466	8.30	609,767.80

	ABU DHABI ISLAMIC BANK	35,275	11.04	389,436.00	
	DUBAI ISLAMIC BANK	80,564	5.64	454,380.96	
	EMIRATES NBD PJSC	47,764	16.35	780,941.40	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	117,934	13.72	1,618,054.48	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	92,661	22.30	2,066,340.30	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	106,834	5.29	565,151.86	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	179,649	6.66	1,196,462.34	
	アラブディルハム 小計	980,942		8,591,122.34 (326,376,737)	
クウェートディ ナール	AGILITY	35,573	0.65	23,335.88	
	BOUBYAN BANK K. S. C	38,661	0.65	25,168.31	
	GULF BANK	32,739	0.27	9,035.96	
	KUWAIT FINANCE HOUSE	216,159	0.78	169,252.49	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	200,495	0.98	196,886.09	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	52,466	0.53	27,911.91	
	MABANEE CO KPSC	20,333	0.87	17,750.70	
	クウェートディナール 小計	596,426		469,341.34 (214,273,095)	
オフショア人民 元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	18,900	6.50	122,850.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	47,900	6.53	312,787.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	11,500	27.96	321,540.00	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-A	8,100	14.50	117,450.00	
	GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	9,700	6.83	66,251.00	
	INNER MONGOLIA DIAN TOU EN-A	2,700	13.69	36,963.00	
	JIZHONG ENERGY RESOURCES-A	4,900	6.52	31,948.00	
	OFFSHORE OIL ENGINEERING-A	10,500	6.58	69,090.00	
	PETROCHINA CO LTD-A	33,500	8.14	272,690.00	
	PINGDINGSHAN TIANAN COAL -A	3,200	7.74	24,768.00	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	15,700	16.28	255,596.00	
	SHAN XI HUA YANG GROUP NEW-A	5,100	8.05	41,055.00	
	SHANXI COKING COAL ENERGY-A	12,420	8.85	109,917.00	
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	6,500	16.88	109,720.00	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO-A	6,736	18.30	123,268.80	
	YANTAI JEREH OILFIELD-A	900	26.81	24,129.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	23,100	5.80	133,980.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	6,200	23.57	146,134.00	

ANHUI HONGLU STEEL CONSTRU-A	650	30.00	19,500.00
ASIA-POTASH INTERNATIONAL-A	1,500	26.04	39,060.00
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	33,700	5.74	193,438.00
BBMG CORPORATION-A	900	2.20	1,980.00
CANMAX TECHNOLOGIES CO LTD-A	1,040	33.53	34,871.20
CHENGXIN LITHIUM GROUP CO-A	1,400	28.12	39,368.00
CHINA JUSHI CO LTD -A	7,414	13.77	102,090.78
CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	5,700	23.99	136,743.00
CHINA RARE EARTH RESOURCES-A	1,900	30.49	57,931.00
CMOC GROUP LTD-A	28,400	5.85	166,140.00
CNGR ADVANCED MATERIAL CO -A	600	58.83	35,298.00
CNNC HUA YUAN TITANIUM -A	4,785	5.79	27,705.15
DO-FLUORIDE NEW MATERIALS -A	2,100	19.09	40,089.00
GANFENG LITHIUM GROUP CO L-A	2,740	59.77	163,769.80
GEM CO LTD-A	10,800	6.97	75,276.00
GUANGDONG HEC TECHNOLOGY H-A	6,300	6.93	43,659.00
GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	4,180	35.09	146,676.20
HANGZHOU OXYGEN PLANT GROU-A	2,000	32.89	65,780.00
HENAN SHENHUO COAL & POWER-A	3,500	14.30	50,050.00
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	9,320	14.90	138,868.00
HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	1,950	7.04	13,728.00
HESTEEL CO LTD-A	1,500	2.25	3,375.00
HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A	1,400	71.23	99,722.00
HUAFON CHEMICAL CO LTD -A	4,600	7.42	34,132.00
HUAIIBEI MINING HOLDINGS CO-A	3,700	12.36	45,732.00
HUAXIN CEMENT CO LTD-A	1,100	12.45	13,695.00
HUBEI FEILIHUA QUARTZ GLAS-A	1,000	43.90	43,900.00
HUBEI XINGFA CHEMICALS GRP-A	1,900	24.85	47,215.00
HUNAN CHANGYUAN LICO CO LT-A	3,324	10.91	36,264.84
HUNAN VALIN STEEL CO LTD -A	14,600	5.28	77,088.00
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	73,300	1.81	132,673.00
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	15,700	4.25	66,725.00
INNER MONGOLIA YUAN XING-A	5,900	7.29	43,011.00
JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	7,600	11.90	90,440.00
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	390	69.65	27,163.50
JIANGSU YOKE TECHNOLOGY-A	500	76.19	38,095.00

JIANGXI COPPER CO LTD-A	2,000	19.67	39,340.00
JINDUICHENG MOLYBDENUM CO -A	6,700	11.35	76,045.00
LB GROUP CO LTD-A	4,500	17.09	76,905.00
LUXI CHEMICAL GROUP CO LT-A	1,900	11.27	21,413.00
LUXIANG COMPANY, LTD.	400	61.58	24,632.00
NINGBO SHANSHAN CO LTD-A	2,300	14.97	34,431.00
NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	11,900	13.54	161,126.00
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	18,100	3.96	71,676.00
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY-A	8,400	19.37	162,708.00
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	15,750	12.21	192,307.50
SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A	8,090	15.75	127,417.50
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	6,368	25.90	164,931.20
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	3,520	32.81	115,491.20
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	10,000	3.10	31,000.00
SHANDONG SUN PAPER INDUSTR-A	2,200	11.15	24,530.00
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	4,408	38.33	168,958.64
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	3,700	7.73	28,601.00
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	4,800	3.98	19,104.00
SHENGHE RESOURCES HOLDINGS-A	1,700	12.38	21,046.00
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	1,080	49.52	53,481.60
SHENZHEN DYNANONIC CO LTD-A	320	116.28	37,209.60
SHENZHEN SENIOR TECHNOLOGY-A	1,798	16.42	29,523.16
SHENZHEN YUTO PACKAGING TE-A	1,700	25.66	43,622.00
SICHUAN HEBANG BIOTECHNOL- A	14,200	2.52	35,784.00
SICHUAN YAHUA INDUSTRIAL-A	1,900	17.49	33,231.00
SINOMA SCIENCE&TECHNOLOGY -A	2,200	20.22	44,484.00
SINOMINE RESOURCE GROUP CO-A	980	47.31	46,363.80
SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A	600	3.13	1,878.00
SKSHU PAINT CO LTD-A	784	69.05	54,135.20
SUNRESIN NEW MATERIALS CO -A	1,200	59.50	71,400.00
TANGSHAN JIDONG CEMENT INV-A	3,700	7.47	27,639.00
TIANQI LITHIUM CORP-A	2,300	67.84	156,032.00
TIANSHAN ALUMINUM GROUP CO-A	7,500	6.40	48,000.00
TIBET SUMMIT RESOURCES CO-A	1,500	17.78	26,670.00
TONGKUN GROUP CO LTD-A	1,500	14.68	22,020.00
TONGLING NONFERROUS METALS-A	10,400	3.10	32,240.00

WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	5,500	91.15	501,325.00
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	640	29.56	18,918.40
WESTERN MINING CO -A	3,300	11.66	38,478.00
WESTERN SUPERCONDUCTING TE-A	560	52.03	29,136.80
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD-A	1,200	18.50	22,200.00
XINJIANG ZHONGTAI CHEMICAL-A	4,100	6.79	27,839.00
YINTAI GOLD CO LTD-A	2,380	13.60	32,368.00
YONGXING SPECIAL MATERIALS-A	910	55.03	50,077.30
YUNNAN ALUMINIUM CO LTD-A	7,300	13.18	96,214.00
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	1,400	91.89	128,646.00
YUNNAN TIN CO LTD-A	3,500	16.40	57,400.00
YUNNAN YUNTIANHUA CO-A	1,500	18.27	27,405.00
ZANGGE MINING CO LTD-A	3,300	23.39	77,187.00
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	2,708	47.82	129,496.56
ZHEJIANG JUHUA CO-A	5,700	14.97	85,329.00
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	6,700	9.39	62,913.00
ZHONGJIN GOLD CORP-A	10,000	11.24	112,400.00
ZIBO QIXIANG TENGDA CHEMIC-A	4,500	6.50	29,250.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	36,000	12.59	453,240.00
AECC AERO-ENGINE CONTROL-A	1,000	23.25	23,250.00
AECC AVIATION POWER CO-A	4,600	41.48	190,808.00
AVICOPTER PLC-A	500	41.71	20,855.00
BEIJING EASPRING MATERIAL-A	700	48.23	33,761.00
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	3,700	25.32	93,684.00
BEIJING UNITED INFORMATION-A	841	34.29	28,837.89
CHINA BAOAN GROUP-A	4,500	11.47	51,615.00
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	6,900	31.85	219,765.00
CHINA ENERGY ENGINEERING COR	52,300	2.37	123,951.00
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	9,700	8.33	80,801.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	31,200	7.69	239,928.00
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	73,200	5.65	413,580.00
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	6,960	219.50	1,527,720.00
COSCO SHIPPING DEVELOPMENT CO	18,400	2.52	46,368.00
CRRC CORP LTD-A	36,500	6.58	240,170.00
DAJIN HEAVY INDUSTRY CO LT-A	1,200	30.73	36,876.00
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	4,400	19.31	84,964.00

EVE ENERGY CO LTD-A	3,020	56.05	169,271.00
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	417	5.97	2,489.49
FAW JIEFANG GROUP CO LTD-A	3,200	9.18	29,376.00
GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A	600	101.39	60,834.00
GOLDWIND SCIENCE & TECHNOL-A	3,400	10.91	37,094.00
GOODWE TECHNOLOGIES CO LTD-A	280	171.17	47,927.60
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	3,900	26.49	103,311.00
GUANGDONG KINLONG HARDWARE-A	400	54.81	21,924.00
GUANGZHOU GREAT POWER ENER-A	1,000	49.48	49,480.00
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	1,680	33.78	56,750.40
HOYMILES POWER ELECTRONICS-A	298	347.25	103,480.50
HOYUAN GREEN ENERGY CO LTD	978	49.95	48,851.10
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	2,436	68.68	167,304.48
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	5,300	15.56	82,468.00
JIANGXI SPECIAL ELECTRIC -A	2,500	11.95	29,875.00
KEDA INDUSTRIAL GROUP CO LTD	2,800	11.19	31,332.00
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A	2,200	14.89	32,758.00
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	39,700	4.04	160,388.00
MING YANG SMART ENERGY GRO-A	4,300	17.00	73,100.00
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	11,682	24.60	287,377.20
NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO -A	540	132.90	71,766.00
NINGBO ORIENT WIRES & CABL-A	1,000	45.22	45,220.00
NINGBO RONBAY NEW ENERGY T-A	450	50.19	22,585.50
NORTH INDUSTRIES GROUP RED-A	2,400	17.25	41,400.00
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	26,400	5.73	151,272.00
PYLON TECHNOLOGIES CO LTD-A	200	188.32	37,664.00
RIYUE HEAVY INDUSTRY CO LT-A	2,000	18.45	36,900.00
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	12,600	17.37	218,862.00
SHANGHAI CONSTRUCTION GROU-A	5,600	2.75	15,400.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	24,000	4.74	113,760.00
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	2,400	67.01	160,824.00
SHENZHEN KSTAR SCIENCE AND-A	1,200	37.73	45,276.00
SICHUAN NEW ENERGY POWER CO	2,400	14.63	35,112.00
SICHUAN ROAD&BRIDGE GROUP-A	13,860	9.91	137,352.60
SIEYUAN ELECTRIC CO LTD-A	1,500	51.64	77,460.00
SINOMA INTERNATIONAL ENGIN-A	5,500	12.80	70,400.00

SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	2,200	110.70	243,540.00
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	1,300	15.90	20,670.00
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	409	191.73	78,417.57
TBEA CO LTD-A	10,920	16.41	179,197.20
TITAN WIND ENERGY SUZHOU-A	2,800	13.98	39,144.00
WEICHAI POWER CO LTD-A	9,500	12.75	121,125.00
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	20,700	6.99	144,693.00
XIAMEN C & D INC-A	4,400	9.12	40,128.00
ZHEFU HOLDING GROUP CO LTD-A	5,300	4.30	22,790.00
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	4,100	27.32	112,012.00
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	420	59.64	25,048.80
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	3,800	28.07	106,666.00
ZHEJIANG WEIXING NEW BUILD-A	1,300	20.02	26,026.00
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-A	800	43.08	34,464.00
ZHUZHOU KIBING GROUP CO LT-A	4,000	8.55	34,200.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	15,500	7.07	109,585.00
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	1,800	42.57	76,626.00
ZHEJIANG WEIMING ENVIRONME-A	2,340	17.51	40,973.40
AIR CHINA LTD-A	11,400	8.70	99,180.00
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	56,400	5.57	314,148.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	24,800	4.71	116,808.00
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	17,600	6.52	114,752.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	20,770	9.96	206,869.20
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	24,100	7.21	173,761.00
HAINAN AIRLINES HOLDING CO-A	81,700	1.60	130,720.00
JUNEYAO AIRLINES CO LTD-A	3,500	16.91	59,185.00
LIAONING PORT CO LTD-A	21,900	1.56	34,164.00
S F HOLDING CO LTD-A	8,600	47.10	405,060.00
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	2,100	44.99	94,479.00
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	8,900	5.30	47,170.00
SPRING AIRLINES CO LTD-A	1,900	60.52	114,988.00
YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	7,400	15.74	116,476.00
YUNDA HOLDING CO LTD-A	4,870	9.78	47,628.60
BETHEL AUTOMOTIVE SAFETY S-A	900	86.22	77,598.00
BYD CO LTD -A	2,800	264.83	741,524.00
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	200	131.61	26,322.00

CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	10,226	13.76	140,709.76
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	3,400	36.28	123,352.00
GREAT WALL MOTOR CO LTD-A	3,300	25.33	83,589.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A	6,900	10.92	75,348.00
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	7,100	18.25	129,575.00
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	1,000	157.89	157,890.00
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	1,200	19.84	23,808.00
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	1,900	75.90	144,210.00
SAIC MOTOR CORP LTD-A	12,410	14.28	177,214.80
SAILUN GROUP CO LTD-A	3,100	11.58	35,898.00
SERES GROUP CO L-A	3,100	42.91	133,021.00
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	1,300	23.40	30,420.00
SHENZHEN KEDALI INDUSTRY C-A	400	120.65	48,260.00
BEIJING ROBOROCK TECHNOLOG-A	200	363.75	72,750.00
ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A	600	75.05	45,030.00
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	4,600	37.51	172,546.00
HAIER SMART HOME CO LTD-A	9,400	23.06	216,764.00
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	1,000	25.13	25,130.00
JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	1,040	40.31	41,922.40
OPPEIN HOME GROUP INC-A	1,040	94.00	97,760.00
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	31,790	4.40	139,876.00
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	300	51.78	15,534.00
BTG HOTELS GROUP CO LTD-A	1,600	20.04	32,064.00
OFFCN EDUCATION TECHNOLOGY-A	10,200	4.63	47,226.00
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	1,700	44.48	75,616.00
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	8,300	4.46	37,018.00
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	5,080	12.70	64,516.00
37 INTERACTIVE ENTERTAINME-A	3,900	28.60	111,540.00
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	1,300	8.24	10,712.00
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	23,800	7.31	173,978.00
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY XI	100	422.00	42,200.00
GIANT NETWORK GROUP CO LTD-A	4,100	15.14	62,074.00
KUNLUN TECH CO LTD-A	2,500	38.53	96,325.00
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	3,110	34.17	106,268.70
PERFECT WORLD CO LTD-A	4,450	15.21	67,684.50
WANDA FILM HOLDING CO LTD-A	4,500	14.47	65,115.00

ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	17,100	6.32	108,072.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	3,400	114.23	388,382.00
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	5,000	7.00	35,000.00
WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A	6,000	4.88	29,280.00
DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	1,036	26.77	27,733.72
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	2,164	36.00	77,904.00
ANGEL YEAST CO LTD-A	700	35.19	24,633.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	600	244.32	146,592.00
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	500	53.02	26,510.00
ANHUI YINGJIA DISTILLERY C-A	600	64.21	38,526.00
ANJOY FOODS GROUP CO LTD	400	146.70	58,680.00
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	6,600	7.03	46,398.00
BEIJING YANJING BREWERY CO-A	3,900	11.25	43,875.00
CHONGQING BREWERY CO-A	800	86.38	69,104.00
CHONGQING FULING ZHACAI-A	910	17.94	16,325.40
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	8,170	44.20	361,114.00
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	900	20.59	18,531.00
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	2,800	48.72	136,416.00
HEBEI YANGYUAN ZHIHUI BEVERA	2,600	25.19	65,494.00
HEILONGJIANG AGRICULTURE-A	2,500	14.13	35,325.00
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	7,400	24.33	180,042.00
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	11,500	27.24	313,260.00
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	2,000	55.39	110,780.00
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	2,700	131.61	355,347.00
JIUGUI LIQUOR CO LTD-A	400	91.15	36,460.00
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	300	34.28	10,284.00
JUEWEI FOOD CO LTD-A	300	36.79	11,037.00
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	2,000	1,723.00	3,446,000.00
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	2,500	221.15	552,875.00
MEIHUA HOLDINGS GROUP CO -A	5,400	8.97	48,438.00
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	9,416	42.45	399,709.20
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	7,600	11.89	90,364.00
SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT-A	1,372	35.01	48,033.72
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	2,120	212.95	451,454.00
SHEDE SPIRITS CO LTD-A	700	129.92	90,944.00
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	400	63.00	25,200.00

TOLY BREAD CO LTD-A	1,176	9.64	11,336.64
TSINGTAO BREWERY CO LTD-A	1,500	94.42	141,630.00
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	10,060	18.77	188,826.20
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	6,400	168.32	1,077,248.00
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	2,200	40.13	88,286.00
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	1,100	16.15	17,765.00
BY-HEALTH CO LTD-A	1,300	20.58	26,754.00
YUNNAN BOTANEE BIO-TECHNOL-A	400	89.58	35,832.00
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	13,168	19.14	252,035.52
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD-A	1,000	53.57	53,570.00
CHINA MEHECO CO LTD -A	2,240	12.88	28,851.20
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	3,300	31.20	102,960.00
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	700	69.91	48,937.00
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	2,940	43.74	128,595.60
IRAY TECHNOLOGY CO LTD-A	280	266.25	74,550.00
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	1,180	21.62	25,511.60
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A	500	35.31	17,655.00
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	5,960	9.93	59,182.80
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	1,900	21.11	40,109.00
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	8,380	6.91	57,905.80
OVCTEK CHINA INC-A	920	31.13	28,639.60
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	4,400	20.84	91,696.00
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	1,900	297.52	565,288.00
SHENZHEN NEW INDUSTRIES BI-A	1,000	59.00	59,000.00
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	300	103.16	30,948.00
APELOA PHARMACEUTICAL CO-A	900	16.66	14,994.00
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	680	118.07	80,287.60
BEIJING TIANTAN BIOLOGICAL-A	3,300	24.81	81,873.00
BEIJING TONGRENTANG CO-A	2,300	52.01	119,623.00
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	1,015	64.02	64,980.30
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	300	49.84	14,952.00
BGI GENOMICS CO LTD-A	300	57.57	17,271.00
BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY COR-A	800	89.64	71,712.00
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	700	143.84	100,688.00
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	1,500	54.68	82,020.00
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	4,050	45.88	185,814.00

DAAN GENE CO LTD-A	960	9.77	9,379.20
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	1,200	52.12	62,544.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	300	62.81	18,843.00
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	4,680	21.67	101,415.60
HUBEI JUMPCAN PHARMACEUT-A	1,300	27.31	35,503.00
HUMANWELL HEALTHCARE GROUP-A	3,800	24.38	92,644.00
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	300	440.01	132,003.00
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	11,016	46.69	514,337.04
JOINCARE PHARMACEUTICAL GR-A	1,600	12.29	19,664.00
JOINN LABORATORIES CHINA C-A	784	37.75	29,596.00
LIVZON PHARMACEUTICAL GROU-A	500	36.88	18,440.00
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	1,098	13.20	14,493.60
PHARMARON BEIJING CO LTD-A	2,450	37.83	92,683.50
PORTON PHARMA SOLUTIONS L-A	800	27.17	21,736.00
SHANDONG BUCHANG PHARMACEU-A	260	19.98	5,194.80
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	3,600	30.56	110,016.00
SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCE-A	835	38.52	32,164.20
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	10,500	7.57	79,485.00
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	960	25.60	24,576.00
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	1,700	31.79	54,043.00
SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A	2,600	24.25	63,050.00
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	2,400	27.70	66,480.00
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	3,000	26.25	78,750.00
WUXI APPTec CO LTD-A	3,728	67.87	253,019.36
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	2,960	53.99	159,810.40
ZHANGZHOU PIENTZEHUANG PHA-A	900	282.90	254,610.00
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	1,210	18.15	21,961.50
ZHEJIANG JIUZHOU PHARMACEU-A	1,300	24.82	32,266.00
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	5,463	16.19	88,445.97
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A	400	34.09	13,636.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	125,400	3.40	426,360.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	32,600	4.63	150,938.00
BANK OF CHANGSHA CO LTD-A	7,500	7.95	59,625.00
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	5,400	12.87	69,498.00
BANK OF CHINA LTD-A	52,600	3.72	195,672.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	62,200	5.52	343,344.00

BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	13,000	11.32	147,160.00
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	23,800	7.03	167,314.00
BANK OF NANJING CO LTD -A	15,500	8.12	125,860.00
BANK OF NINGBO CO LTD -A	9,900	24.30	240,570.00
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	24,610	5.95	146,429.50
BANK OF SUZHOU CO LTD-A	5,100	6.72	34,272.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	9,200	5.89	54,188.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	78,400	2.94	230,496.00
CHINA MERCHANTS BANK-A	34,000	31.58	1,073,720.00
CHINA MINSHENG BANKING-A	46,000	3.92	180,320.00
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	21,970	2.58	56,682.60
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-A	8,500	3.69	31,365.00
HUAXIA BANK CO LTD-A	24,300	5.52	134,136.00
IND & COMM BK OF CHINA-A	94,400	4.56	430,464.00
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	35,300	15.72	554,916.00
PING AN BANK CO LTD-A	34,400	11.31	389,064.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	42,400	4.78	202,672.00
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	44,600	7.41	330,486.00
SHANGHAI RURAL COMMERCIAL -A	13,500	5.58	75,330.00
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A	13,900	3.82	53,098.00
BOC INTERNATIONAL CHINA CO-A	3,000	10.61	31,830.00
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	8,800	7.51	66,088.00
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	6,800	6.10	41,480.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-A	8,000	11.92	95,360.00
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	3,000	8.27	24,810.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL-A	3,500	36.63	128,205.00
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	11,900	14.01	166,719.00
CITIC SECURITIES CO-A	21,500	20.41	438,815.00
CSC FINANCIAL CO LTD-A	7,500	24.67	185,025.00
DONGXING SECURITIES CO LT-A	6,200	8.24	51,088.00
EAST MONEY INFORMATION CO-A	27,812	14.37	399,658.44
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	6,600	16.66	109,956.00
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	500	5.76	2,880.00
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	17,000	6.75	114,750.00
GF SECURITIES CO LTD-A	9,500	14.90	141,550.00
GUANGZHOU YUEXIU CAPITAL H-A	4,374	6.50	28,431.00

GUOLIAN SECURITIES CO LTD-A	2,200	9.25	20,350.00
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	11,300	9.08	102,604.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	12,000	14.61	175,320.00
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	9,500	6.73	63,935.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	18,700	9.64	180,268.00
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	1,000	165.10	165,100.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	13,100	14.68	192,308.00
HUAXI SECURITIES CO LTD-A	300	8.43	2,529.00
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	16,300	6.35	103,505.00
NANJING SECURITIES CO LTD	7,600	8.28	62,928.00
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	10,800	9.91	107,028.00
SDIC CAPITAL CO LTD-A	11,000	7.44	81,840.00
SHANXI SECURITIES CO LTD-A	400	5.77	2,308.00
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	45,600	4.68	213,408.00
SINOLINK SECURITIES CO LTD-A	7,700	8.91	68,607.00
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	9,700	7.59	73,623.00
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	3,800	3.74	14,212.00
WESTERN SECURITIES CO LTD-A	10,000	6.58	65,800.00
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	6,000	10.07	60,420.00
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD-A	10,500	7.02	73,710.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	4,500	32.59	146,655.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	11,100	27.55	305,805.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	3,800	39.97	151,886.00
PICC HOLDING CO-A	15,500	6.03	93,465.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	16,500	47.77	788,205.00
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	11,700	12.00	140,400.00
BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	800	451.00	360,800.00
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	4,674	13.15	61,463.10
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	1,170	49.29	57,669.30
DHC SOFTWARE CO LTD -A	400	6.85	2,740.00
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	3,073	37.74	115,975.02
IFLYTEK CO LTD - A	3,600	67.76	243,936.00
NAVINFO CO LTD-A	4,800	11.29	54,192.00
QI AN XIN TECHNOLOGY GROUP-A	1,252	48.98	61,322.96
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	900	111.09	99,981.00
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	2,995	52.71	157,866.45

THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	900	98.12	88,308.00
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	5,908	18.83	111,247.64
AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A	2,300	24.61	56,603.00
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	57,300	4.30	246,390.00
CETC CYBERSPACE SECURITY T-A	1,300	27.06	35,178.00
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	4,500	31.74	142,830.00
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	6,700	12.59	84,353.00
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-A	11,000	6.04	66,440.00
CHINA ZHENHUA GROUP SCIENC-A	1,200	93.05	111,660.00
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	17,600	25.09	441,584.00
GOERTEK INC -A	6,100	18.03	109,983.00
GRG BANKING EQUIPMENT CO -A	2,200	11.55	25,410.00
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	6,900	6.89	47,541.00
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICAT-A	300	10.18	3,054.00
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	1,500	62.50	93,750.00
HENGDIAN GROUP DMEGC -A	2,700	17.50	47,250.00
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO-A	3,700	15.36	56,832.00
HUAGONG TECH CO LTD-A	2,700	44.16	119,232.00
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	2,400	45.11	108,264.00
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	9,600	12.29	117,984.00
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	10,433	33.56	350,131.48
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	576	121.97	70,254.72
NINESTAR CORP-A	1,800	32.88	59,184.00
RAYTRON TECHNOLOGY CO LTD-A	700	47.60	33,320.00
SHANGHAI FRIENDESS ELECTRO-A	280	211.11	59,110.80
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	2,300	15.94	36,662.00
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	780	79.70	62,166.00
SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY-A	3,500	21.16	74,060.00
SHENZHEN SUNLORD ELECTRONI-A	800	25.36	20,288.00
SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	1,794	133.36	239,247.84
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	3,300	23.60	77,880.00
TIANJIN712 COMMUNICATION &-A	700	28.62	20,034.00
TIANMA MICROELECTRONICS-A	2,400	9.19	22,056.00
UNISPLENDOR CORP LTD-A	4,876	28.69	139,892.44
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	2,700	47.01	126,927.00
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	3,464	8.11	28,093.04

WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHA-A	1,760	24.42	42,979.20
XIAMEN FARATRONIC CO LTD-A	400	133.20	53,280.00
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	2,240	39.86	89,286.40
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	6,300	22.02	138,726.00
ZHEJIANG SUPCON TECHNOLOGY-A	870	55.22	48,041.40
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	1,700	149.00	253,300.00
ZTE CORP-A	6,400	42.19	270,016.00
CHINA UNITED NETWORK-A	46,500	5.23	243,195.00
CECEP SOLAR ENERGY CO LT-A	6,500	6.59	42,835.00
CECEP WIND POWER CORP-A	7,900	3.63	28,677.00
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	32,500	7.18	233,350.00
CHINA THREE GORGES RENEWAB-A	42,200	5.32	224,504.00
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	35,300	22.50	794,250.00
DATANG INTL POWER GEN CO-A	20,000	3.15	63,000.00
ENN NATURAL GAS CO LTD-A	4,800	18.99	91,152.00
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	31,000	3.67	113,770.00
HUADIAN POWER INTL CORP-A	12,500	6.06	75,750.00
HUANENG POWER INTL INC-A	18,200	9.26	168,532.00
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	13,800	12.58	173,604.00
SHANGHAI ELECTRIC POWER CO-A	7,100	10.27	72,917.00
SHENZHEN ENERGY GROUP CO L-A	11,600	6.81	78,996.00
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A	5,200	14.63	76,076.00
ZHEJIANG ZHENENG ELECTRIC-A	21,300	4.91	104,583.00
3PEAK INC-A	200	226.12	45,224.00
ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	943	137.00	129,191.00
AMLOGIC SHANGHAI INC-A	600	94.73	56,838.00
CAMBRICON TECHNOLOGIES-A	800	182.37	145,896.00
CHINA RESOURCES MICROELECT-A	2,200	53.84	118,448.00
FLAT GLASS GROUP CO LTD-A	2,300	34.52	79,396.00
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR I-A	1,356	114.60	155,397.60
HANGZHOU CHANG CHUAN TECHN-A	1,300	43.79	56,927.00
HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	2,352	33.90	79,732.80
HANGZHOU LION ELECTRONICS -A	1,000	37.03	37,030.00
HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	2,000	30.69	61,380.00
INGENIC SEMICONDUCTOR CO -A	1,200	92.29	110,748.00
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	4,312	32.76	141,261.12

JCET GROUP CO LTD-A	3,800	35.16	133,608.00
JIANGSU PACIFIC QUARTZ CO -A	700	104.68	73,276.00
JINKO SOLAR CO LTD-A	13,400	12.20	163,480.00
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	12,936	29.24	378,248.64
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A	1,514	59.19	89,613.66
NATIONAL SILICON INDUSTRY -A	5,600	20.30	113,680.00
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	900	276.63	248,967.00
RISEN ENERGY CO LTD-A	2,400	23.88	57,312.00
SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	9,900	16.89	167,211.00
SG MICRO CORP-A	1,007	85.30	85,897.10
SHANGHAI AIKO SOLAR ENERGY-A	3,220	27.72	89,258.40
SHANGHAI FUDAN MICROELE-DO-A	800	58.43	46,744.00
SHENZHEN SC NEW ENERGY TEC-A	300	101.36	30,408.00
STARPOWER SEMICONDUCTOR LT-A	200	222.64	44,528.00
TCL ZHONGHUAN RENEWABLE EN-A	5,375	29.60	159,100.00
TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	1,900	9.97	18,943.00
TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	3,200	24.24	77,568.00
TONGWEI CO LTD-A	6,600	33.80	223,080.00
TRINA SOLAR CO LTD-A	3,200	36.19	115,808.00
UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	1,819	90.81	165,183.39
VERISILICON MICROELECTRONI-A	1,000	68.59	68,590.00
WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	2,185	103.87	226,955.95
WUXI AUTOWELL TECHNOLOGY C-A	400	184.10	73,640.00
XINJIANG DAQO NEW ENERGY C-A	3,600	40.52	145,872.00
YANGZHOU YANGJIE ELECTRONI-A	700	43.08	30,156.00
ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	1,800	64.11	115,398.00
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	12,100	12.46	150,766.00
CHINA VANKE CO LTD -A	16,400	13.90	227,960.00
GEMDALE CORP-A	7,200	6.88	49,536.00
HAINAN AIRPORT INFRASTRUCT-A	21,800	4.09	89,162.00
HANGZHOU BINJIANG REAL EST-A	5,600	8.57	47,992.00
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	17,400	12.75	221,850.00
SHANGHAI LINGANG HOLDINGS-A	1,680	12.22	20,529.60
YOUNGOR GROUP CO-A	3,100	6.56	20,336.00
ZHEJIANG CHINA COMMODITIES-A	13,000	8.57	111,410.00
オフショア人民元 小計	4,121,413		62,277,842.08

				(1, 204, 802, 221)
サウジアラビア リアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	7, 849	10. 66	83, 670. 34
	SAUDI ARABIAN OIL CO	70, 868	32. 30	2, 289, 036. 40
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	3, 568	46. 20	164, 841. 60
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	8, 294	14. 60	121, 092. 40
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	6, 122	129. 40	792, 186. 80
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	10, 211	36. 10	368, 617. 10
	SAUDI ARABIAN MINING CO	34, 492	43. 80	1, 510, 749. 60
	SAUDI ARAMCO BASE OIL CO	1, 374	146. 00	200, 604. 00
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	23, 960	85. 50	2, 048, 580. 00
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	9, 618	24. 58	236, 410. 44
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	18, 931	12. 50	236, 637. 50
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	7, 669	45. 90	352, 007. 10
	SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	1, 076	180. 60	194, 325. 60
	JARIR MARKETING CO	14, 720	16. 18	238, 169. 60
	NAHDI MEDICAL CO	871	179. 20	156, 083. 20
	ALMARAI CO	6, 924	65. 70	454, 906. 80
	SAVOLA	6, 673	41. 10	274, 260. 30
	DALLAH HEALTHCARE CO	835	172. 80	144, 288. 00
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	2, 355	302. 80	713, 094. 00
	MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	1, 322	262. 80	347, 421. 60
	AL RAJHI BANK	51, 979	70. 80	3, 680, 113. 20
	ALINMA BANK	24, 489	36. 45	892, 624. 05
	ARAB NATIONAL BANK	16, 584	27. 70	459, 376. 80
	BANK AL-JAZIRA	11, 133	18. 30	203, 733. 90
	BANK ALBILAD	13, 423	43. 35	581, 887. 05
	BANQUE SAUDI FRANSI	16, 111	44. 15	711, 300. 65
	RIYAD BANK	38, 641	34. 60	1, 336, 978. 60
	SAUDI AWWAL BANK	26, 419	41. 50	1, 096, 388. 50
	SAUDI INVESTMENT BANK/THE	13, 432	17. 66	237, 209. 12
	THE SAUDI NATIONAL BANK	78, 054	40. 60	3, 168, 992. 40
	SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING	1, 363	197. 20	268, 783. 60
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	1, 990	183. 00	364, 170. 00	
ARABIAN INTERNET & COMMUNICA	542	365. 00	197, 830. 00	
ELM CO	642	656. 40	421, 408. 80	
ETIHAD ETISALAT CO	10, 475	47. 55	498, 086. 25	

	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	13,459	13.86	186,541.74	
	SAUDI TELECOM CO	52,586	45.30	2,382,145.80	
	ACWA POWER CO	2,007	191.20	383,738.40	
	SAUDI ELECTRICITY CO	21,376	22.66	484,380.16	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	14,772	16.04	236,942.88	
	EMAAR ECONOMIC CITY	8,295	8.98	74,489.10	
	サウジアラビアリアル 小計	655,504		28,794,103.38 (1,075,459,761)	
	合 計	159,080,888		25,479,697,457 (25,479,697,457)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

(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
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	76,400	1,905,416.00	
		OPERADORA DE SITES MEX- A-1	33,000	546,810.00	
		メキシコペソ 小計	109,400	2,452,226.00 (20,501,835)	
	南アフリカランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	81,251	1,005,074.87	
		南アフリカランド 小計	81,251	1,005,074.87 (7,859,685)	
	合 計			28,361,520 (28,361,520)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式 39 銘柄	100.0%	—	2.4%
メキシコペソ	株式 21 銘柄	97.1%	—	2.7%
	投資証券 2 銘柄	—	2.9%	0.1%
ブラジルリアル	株式 47 銘柄	100.0%	—	5.4%
チリペソ	株式 12 銘柄	100.0%	—	0.6%
コロンビアペソ	株式 3 銘柄	100.0%	—	0.1%
ユーロ	株式 10 銘柄	100.0%	—	0.5%
英ポンド	株式 1 銘柄	—	—	—

トルコリラ	株式	18 銘柄	100.0%	—	0.6%
チェココルナ	株式	3 銘柄	100.0%	—	0.2%
ハンガリーフォリント	株式	3 銘柄	100.0%	—	0.2%
ポーランドズロチ	株式	14 銘柄	100.0%	—	0.9%
ロシアルーブル	株式	14 銘柄	—	—	—
香港ドル	株式	194 銘柄	100.0%	—	22.2%
マレーシアリングット	株式	33 銘柄	100.0%	—	1.4%
タイバーツ	株式	42 銘柄	100.0%	—	2.0%
フィリピンペソ	株式	15 銘柄	100.0%	—	0.6%
インドネシアルピア	株式	22 銘柄	100.0%	—	2.0%
韓国ウォン	株式	102 銘柄	100.0%	—	12.7%
新台湾ドル	株式	90 銘柄	100.0%	—	15.4%
インドルピー	株式	114 銘柄	100.0%	—	14.7%
カタールリアル	株式	13 銘柄	100.0%	—	0.9%
南アフリカランド	株式	36 銘柄	99.1%	—	3.4%
	投資証券	1 銘柄	—	0.9%	0.0%
アラブディルハム	株式	11 銘柄	100.0%	—	1.3%
クウェートディナール	株式	7 銘柄	100.0%	—	0.8%
オフショア人民元	株式	521 銘柄	100.0%	—	4.7%
サウジアラビアリアル	株式	41 銘柄	100.0%	—	4.2%

(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(その他の注記)の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

RM国内リートマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2023年7月20日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	246,194,688
投資証券	44,994,987,700
派生商品評価勘定	4,945,670
未収配当金	262,035,677
差入委託証拠金	25,087,500
流動資産合計	45,533,251,235
資産合計	45,533,251,235
負債の部	
流動負債	
前受金	4,524,200
未払解約金	42,990,800
未払利息	667
流動負債合計	47,515,667
負債合計	47,515,667
純資産の部	
元本等	
元本	31,278,827,263
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	14,206,908,305
元本等合計	45,485,735,568
純資産合計	45,485,735,568
負債純資産合計	45,533,251,235

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	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の取引所の発表する清算値段で評価しております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 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。 派生商品取引等損益 原則として、約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

2023年7月20日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年7月21日
期首元本額	18,033,890,177円
期中追加設定元本額	28,033,752,454円
期中一部解約元本額	14,788,815,368円
期末元本額	31,278,827,263円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド(安定型)	1,025,657,749円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	1,356,881,495円
りそなラップ型ファンド(成長型)	1,638,562,987円
DCりそな グローバルバランス	28,693,532円
つみたてバランスファンド	2,479,261,030円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	264,718,090円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	193,718,894円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	132,472,943円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	68,139,964円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	46,388,700円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	25,560,249円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	53,503,127円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	141,866,936円
九州SDGs・グローバルバランス	62,415,293円
りそな国内リートインデックス(ラップ専用)	1,332,776,499円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定型)	4,135,127円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定成長型)	42,809,280円
ラップ型ファンド・プラスESG(成長型)	46,007,425円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定型)	8,721,958円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定成長型)	14,455,951円
りそな つみたてラップ型ファンド(成長型)	16,760,508円
りそな つみたてリスクコントロールファンド	2,116,442円
ターゲットリターンバランスファンド(目標2%)	14,228円
ターゲットリターンバランスファンド(目標3%)	14,435円
ターゲットリターンバランスファンド(目標4%)	22,690円
ターゲットリターンバランスファンド(目標5%)	31,197円

ターゲットリターンバランスファンド (目標6%)	45,421円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2065	33,508円
FWりそな国内リートインデックスオープン	7,396,252,073円
FWりそな国内リートインデックスファンド	6,375,177,493円
Smart-i Jリートインデックス	3,174,521,535円
Smart-i 8資産バランス 安定型	64,448,907円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	219,992,220円
Smart-i 8資産バランス 成長型	287,348,487円
J-REITインデックスファンド (適格機関投資家専用)	4,144,144,077円
りそなDAAファンド (適格機関投資家専用)	134,466,226円
りそなVIグローバル・バランスファンド (安定型) (適格機関投資家専用)	12,051,598円
りそなVIグローバル・バランスファンド (安定成長型) (適格機関投資家専用)	12,028,214円
りそなVIグローバル・バランスファンド (成長型) (適格機関投資家専用)	16,808,510円
りそなFT マルチアセットファンド (適格機関投資家専用)	16,961,960円
りそなDAAマルチアセットファンド (適格機関投資家専用)	4,584,406円
りそなマルチアセットファンド (適格機関投資家専用)	14,177,252円
りそなDAAファンドII (適格機関投資家専用)	12,093円
J-REITインデックスファンド202102 (適格機関投資家専用)	136,541,799円
りそなDAAファンド202205 (適格機関投資家専用)	283,524,755円
2. 計算日における受益権の総数	31,278,827,263口
3. 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.4542円
(10,000口当たり純資産額)	(14,542円)

(注) ※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

2023年7月20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金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、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。 これらは、リートの価格変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

II 金融商品の時価等に関する事項

2023年7月20日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべ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	投資証券 (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。

デリバティブ取引

(その他の注記)の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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。

また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算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。

(関連当事者との取引に関する注記)

2023年7月20日現在

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)

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2023年7月20日現在	
	損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券		1,074,533,595
合計		1,074,533,595

(注) 損益に含まれた評価差額は、親投資信託受益証券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。

2 デリバティブ取引に関する注記

(投資証券関連)

(2023年7月20日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	不動産投信指数先物取引				
	買建	410,503,330	—	415,449,000	4,945,670
合計		410,503,330	—	415,449,000	4,945,670

(注) 時価の算定方法

先物取引

国内先物取引について

先物取引の評価においては、原則として計算日の取引所の発表する清算値段で評価しております。

※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

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	860	103,458,000	
	サンケイリアルエステート投資法人	1,355	127,641,000	
	S O S i L A 物流リート投資法人	2,104	271,416,000	
	東海道リート投資法人	704	88,140,800	
	日本アコモデーションファンド投資法人	1,461	968,643,000	
	森ヒルズリート投資法人	4,974	733,167,600	
	産業ファンド投資法人	6,455	978,578,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	4,230	1,478,385,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	3,102	692,986,800	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	2,219	926,432,500	
	G L P 投資法人	14,262	1,996,680,000	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	2,023	712,096,000	
	日本プロロジスリート投資法人	7,355	2,157,957,000	
	星野リゾート・リート投資法人	740	479,520,000	
	O n e リート投資法人	738	190,182,600	
	イオンリート投資法人	4,856	739,083,200	
	ヒューリックリート投資法人	3,958	649,507,800	
	日本リート投資法人	1,374	471,282,000	
	積水ハウス・リート投資法人	12,712	1,097,045,600	
	トーセイ・リート投資法人	938	127,099,000	
	ケネディクス商業リート投資法人	1,839	516,023,400	
	ヘルスケア&メディカル投資法人	1,043	164,376,800	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	1,100	132,550,000	
	野村不動産マスターファンド投資法人	13,680	2,233,944,000	
いちごホテルリート投資法人	701	72,553,500		
ラサールロジポート投資法人	5,407	829,433,800		
スターアジア不動産投資法人	5,282	307,940,600		

マリモ地方創生リート投資法人	646	83,269,400	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	1,671	848,868,000	
大江戸温泉リート投資法人	683	44,121,800	
投資法人みらい	5,139	238,963,500	
三菱地所物流リート投資法人	1,453	587,738,500	
CREロジスティクスファンド投資法人	1,812	326,522,400	
ザイマックス・リート投資法人	686	79,301,600	
タカラレーベン不動産投資法人	1,994	193,218,600	
アドバンス・ロジスティクス投資法人	1,844	245,252,000	
日本ビルファンド投資法人	4,935	3,025,155,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	4,338	2,481,336,000	
日本都市ファンド投資法人	21,344	2,055,427,200	
オリックス不動産投資法人	8,429	1,514,691,300	
日本プライムリアルティ投資法人	2,893	1,027,015,000	
NTT都市開発リート投資法人	4,066	552,976,000	
東急リアル・エステート投資法人	2,836	540,258,000	
グローバル・ワン不動産投資法人	3,113	363,287,100	
ユナイテッド・アーバン投資法人	9,463	1,440,268,600	
森トラストリート投資法人	7,873	561,344,900	
インヴィンシブル投資法人	18,619	1,031,492,600	
フロンティア不動産投資法人	1,570	745,750,000	
平和不動産リート投資法人	2,980	430,312,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	2,852	869,860,000	
福岡リート投資法人	2,188	362,551,600	
ケネディクス・オフィス投資法人	2,461	831,818,000	
いちごオフィスリート投資法人	3,466	308,820,600	
大和証券オフィス投資法人	876	561,516,000	
阪急阪神リート投資法人	1,911	277,095,000	
スターツプロシード投資法人	733	163,752,200	
大和ハウスリート投資法人	6,377	1,780,458,400	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	13,642	980,859,800	
大和証券リビング投資法人	5,862	677,061,000	
ジャパンエクセレント投資法人	3,881	518,501,600	
合計	258,108	44,994,987,700	

(注) 券面総額欄の数値は口数を表しております。

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

注記表（その他の注記）の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

RM先進国リートマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2023年7月20日現在

資産の部	
流動資産	
預金	387,774,462
コール・ローン	55,338,439
株式	577,936,943
投資証券	58,740,032,146
派生商品評価勘定	220,684
未収入金	104,307
未収配当金	106,126,046
流動資産合計	59,867,533,027
資産合計	59,867,533,027
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	477
未払解約金	7,138,300
未払利息	150
流動負債合計	7,138,927
負債合計	7,138,927
純資産の部	
元本等	
元本	39,434,592,049
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	20,425,802,051
元本等合計	59,860,394,100
純資産合計	59,860,394,100
負債純資産合計	59,867,533,027

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	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則としてわが国における計算日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	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の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
4. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 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。 配当株式 原則として、配当落ち日において、その数量に相当する券面総額又は発行価額を計上しております。
5. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	為替予約取引による為替差損益 原則として、約定日基準で計上しております。 外貨建取引等の処理基準 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して整理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。

(貸借対照表に関する注記)

2023年7月20日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年7月21日
期首元本額	21,136,405,855円
期中追加設定元本額	34,712,952,354円
期中一部解約元本額	16,414,766,160円
期末元本額	39,434,592,049円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド(安定型)	1,095,912,905円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	1,710,967,750円
りそなラップ型ファンド(成長型)	2,501,228,021円
DCりそな グローバルバランス	28,193,527円
つみたてバランスファンド	1,182,527,079円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	542,559,769円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	385,879,347円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	264,423,561円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	132,746,082円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	90,222,214円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	50,155,959円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	102,954,944円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	270,795,035円
九州SDGs・グローバルバランス	120,203,068円

ラップ型ファンド・プラスE S G (安定型)	4,507,339円
ラップ型ファンド・プラスE S G (安定成長型)	58,384,313円
ラップ型ファンド・プラスE S G (成長型)	58,176,263円
りそな つみたてラップ型ファンド (安定型)	9,438,188円
りそな つみたてラップ型ファンド (安定成長型)	20,178,143円
りそな つみたてラップ型ファンド (成長型)	26,912,629円
りそな つみたてリスクコントロールファンド	746,784円
ターゲットリターンバランスファンド (目標2%)	27,409円
ターゲットリターンバランスファンド (目標3%)	28,514円
ターゲットリターンバランスファンド (目標4%)	44,643円
ターゲットリターンバランスファンド (目標5%)	59,948円
ターゲットリターンバランスファンド (目標6%)	90,869円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2065	64,666円
FWりそな先進国リートインデックスオープン	14,127,528,562円
FWりそな先進国リートインデックスファンド	12,202,495,406円
S m a r t e r i 先進国リートインデックス	2,742,263,743円
S m a r t e r i 8資産バランス 安定型	137,246,955円
S m a r t e r i 8資産バランス 安定成長型	443,871,291円
S m a r t e r i 8資産バランス 成長型	572,472,688円
りそなDAAファンド (適格機関投資家専用)	121,316,490円
りそなV I グローバル・バランスファンド (安定型) (適格機関投資家専用)	13,046,089円
りそなV I グローバル・バランスファンド (安定成長型) (適格機関投資家専用)	8,250,061円
りそなV I グローバル・バランスファンド (成長型) (適格機関投資家専用)	85,527,533円
りそなF T マルチアセットファンド (適格機関投資家専用)	34,759,359円
りそなDAAマルチアセットファンド (適格機関投資家専用)	18,816,657円
りそなマルチアセットファンド (適格機関投資家専用)	13,745,742円
りそなDAAファンドⅡ (適格機関投資家専用)	23,823円
りそなDAAファンド202205 (適格機関投資家専用)	255,798,681円
2. 計算日における受益権の総数	39,434,592,049口
3. 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.5180円
(10,000口当たり純資産額)	(15,180円)

(注) ※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

2023年7月20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金融商品に係るリスク	
	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、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。
	これらは、株価変動リスク、リートの価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。
	デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	
	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。
	また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

II 金融商品の時価等に関する事項

2023年7月20日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべ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	
株式、投資証券	(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。
デリバティブ取引	(その他の注記)の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	
	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。
	また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算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。

(関連当事者との取引に関する注記)

2023年7月20日現在	
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)

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2023年7月20日現在	
	損益に含まれた評価差額(円)	
株式		35,208,156
投資証券		764,241,831
合計		799,449,987

(注) 損益に含まれた評価差額は、親投資信託受益証券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。

2 デリバティブ取引に関する注記

(通貨関連)

(2023年7月20日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	45,939,179	—	46,159,863	220,684
	米ドル	33,345,624	—	33,507,312	161,688
	カナダドル	4,219,172	—	4,246,400	27,228
	ユーロ	3,120,778	—	3,133,276	12,498
	シンガポールドル	5,253,605	—	5,272,875	19,270

売建	16,225,610	—	16,226,087	△477
米ドル	14,659,050	—	14,659,449	△399
ユーロ	1,566,560	—	1,566,638	△78
合計	62,164,789	—	62,385,950	220,207

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

1) 計算日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については以下のように評価しております。

① 計算日において為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます）の対顧客先物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で評価しております。

② 計算日において当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、当該日に最も近い前後二つの対顧客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。
- ・ 計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

2) 計算日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については計算日の対顧客相場の仲値で評価しております。

※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	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	AMERICOLD REALTY TRUST INC	86,828	32.97	2,862,719.16	
	BROADSTONE NET LEASE INC-A	59,516	16.31	970,705.96	
	STAR HOLDINGS	3,563	15.10	53,801.30	
米ドル 小計		149,907		3,887,226.42 (543,045,530)	
オーストラリアドル	CENTURIA CAPITAL GROUP	222,365	1.65	368,014.07	
オーストラリアドル 小計		222,365		368,014.07 (34,891,413)	
合 計		372,272		577,936,943 (577,936,943)	

(注1) 通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額 (単位:円) であります。

(注2) 合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

(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
投資証券	米ドル	ACADIA REALTY TRUST	31,077	485,111.97	
		AGREE REALTY CORP	29,682	1,963,167.48	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	22,884	443,034.24	
		ALEXANDER'S INC	738	137,747.70	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	50,525	6,033,695.50	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	3,468	57,395.40	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	16,990	377,687.70	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	100,780	3,657,306.20	
		APARTMENT INCOME REIT CO	47,496	1,711,755.84	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	48,768	427,207.68	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	67,649	1,047,206.52	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	21,671	270,454.08	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	12,741	47,396.52	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	45,534	8,853,175.62	
		BLUEROCK HOMES TRUST INC	607	9,875.89	

	BOSTON PROPERTIES INC	45,852	2,953,785.84
	BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	21,236	82,395.68
	BRANDYWINE REALTY TRUST	55,191	271,539.72
	BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	95,732	2,202,793.32
	BRT APARTMENTS CORP	3,225	65,596.50
	CAMDEN PROPERTY TRUST	34,244	3,814,439.16
	CARETRUST REIT INC	31,518	651,477.06
	CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	8,439	190,383.84
	CENTERSPACE	4,898	309,308.70
	CHATHAM LODGING TRUST	17,055	164,580.75
	CITY OFFICE REIT INC	14,501	83,090.73
	CLIPPER REALTY INC	2,188	13,521.84
	COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	8,122	290,848.82
	CORPORATE OFFICE PROPERTIES	35,648	931,125.76
	COUSINS PROPERTIES INC	48,167	1,181,054.84
	CTO REALTY GROWTH INC	6,920	122,553.20
	CUBESMART	72,107	3,304,663.81
	DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	66,372	546,241.56
	DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	92,300	46,150.00
	DIGITAL REALTY TRUST INC	93,472	11,326,002.24
	DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	82,808	226,893.92
	DOUGLAS EMMETT INC	53,708	758,356.96
	EAGLE HOSPITALITY TRUST	82,000	—
	EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	29,974	439,418.84
	EASTGROUP PROPERTIES INC	14,278	2,605,449.44
	ELME COMMUNITIES	28,983	476,480.52
	EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	42,453	346,841.01
	EPR PROPERTIES	23,947	1,084,080.69
	EQUINIX INC	29,993	24,376,210.89
	EQUITY COMMONWEALTH	34,709	712,228.68
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	56,143	3,760,458.14
	EQUITY RESIDENTIAL	109,356	7,442,769.36
	ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	47,347	1,200,246.45
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	20,584	5,002,941.20
	EXTRA SPACE STORAGE INC	43,320	6,452,947.20

	FARMLAND PARTNERS INC	15,087	196,281.87
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	23,585	2,416,754.95
	FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	42,158	2,219,197.12
	FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	27,857	740,439.06
	FRANKLIN STREET PROPERTIES C	33,544	56,018.48
	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	84,277	4,121,145.30
	GETTY REALTY CORP	14,649	484,735.41
	GLADSTONE COMMERCIAL CORP	13,837	190,120.38
	GLADSTONE LAND CORP	11,212	191,052.48
	GLOBAL MEDICAL REIT INC	21,276	211,908.96
	GLOBAL NET LEASE INC	33,604	376,028.76
	HEALTHCARE REALTY TRUST INC	122,343	2,374,677.63
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	175,602	3,761,394.84
	HERSHA HOSPITALITY TRUST	8,823	56,202.51
	HIGHWOODS PROPERTIES INC	33,399	877,057.74
	HOST HOTELS & RESORTS INC	228,459	4,036,870.53
	HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	39,736	229,276.72
	INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	71,361	1,253,099.16
	INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	17,584	72,270.24
	INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	8,924	722,397.80
	INVENTRUST PROPERTIES CORP	21,401	517,048.16
	INVITATION HOMES INC	186,423	6,580,731.90
	IRON MOUNTAIN INC	93,554	5,821,865.42
	JBG SMITH PROPERTIES	30,544	505,503.20
	KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	274,900	85,219.00
	KILROY REALTY CORP	33,433	1,157,784.79
	KIMCO REALTY CORP	199,050	4,152,183.00
	KITE REALTY GROUP TRUST	69,825	1,635,999.75
	LIFE STORAGE INC	27,305	3,634,295.50
	LTC PROPERTIES INC	13,323	464,306.55
	LXP INDUSTRIAL TRUST	92,811	964,306.29
	MACERICH CO/THE	68,338	875,409.78
	MANULIFE US REAL ESTATE INV	635,700	73,741.20
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	190,397	1,985,840.71
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	37,413	5,721,195.96
	NATIONAL STORAGE AFFILIATES	26,147	922,466.16

	NATL HEALTH INVESTORS INC	13,760	754,873.60
	NECESSITY RETAIL REIT INC/TH	42,346	315,477.70
	NETSTREIT CORP	18,899	334,323.31
	NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES	11,428	144,107.08
	NEXPOINT RESIDENTIAL	7,337	346,159.66
	NNN REIT INC	58,523	2,548,676.65
	OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	17,029	146,619.69
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	74,619	2,438,548.92
	ONE LIBERTY PROPERTIES INC	5,669	118,028.58
	ORION OFFICE REIT INC	19,499	133,568.15
	PARAMOUNT GROUP INC	52,275	263,466.00
	PARK HOTELS & RESORTS INC	68,442	921,913.74
	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	40,092	570,910.08
	PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	37,327	1,300,845.95
	PHYSICIANS REALTY TRUST	75,745	1,121,783.45
	PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	39,816	317,731.68
	PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	12,349	283,656.53
	POSTAL REALTY TRUST INC- A	6,456	98,324.88
	PRIME US REIT	183,100	34,789.00
	PROLOGIS INC	296,121	36,357,736.38
	PUBLIC STORAGE	50,741	14,865,083.36
	REALTY INCOME CORP	215,940	13,329,976.20
	REGENCY CENTERS CORP	49,435	3,200,916.25
	RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	41,175	589,626.00
	REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	64,555	3,485,324.45
	RLJ LODGING TRUST	50,339	507,920.51
	RPT REALTY	27,355	303,366.95
	RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	19,028	1,782,733.32
	SABRA HEALTH CARE REIT INC	73,389	943,048.65
	SAFEHOLD INC	12,956	319,235.84
	SAUL CENTERS INC	4,442	169,817.66
	SERVICE PROPERTIES TRUST	52,270	478,270.50
	SIMON PROPERTY GROUP INC	104,887	12,944,104.67
	SITE CENTERS CORP	57,839	834,616.77
	SL GREEN REALTY CORP	20,343	731,127.42
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	44,994	1,866,351.12

	STAG INDUSTRIAL INC	57,181	2,141,428.45
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	33,606	219,447.18
	SUN COMMUNITIES INC	39,899	5,381,178.13
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	65,630	662,206.70
	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	33,411	794,513.58
	TERRENO REALTY CORP	23,614	1,395,115.12
	UDR INC	99,241	4,243,545.16
	UMH PROPERTIES INC	18,720	302,889.60
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	4,387	212,418.54
	URBAN EDGE PROPERTIES	37,301	625,910.78
	URSTADT BIDDLE - CLASS A	9,974	223,417.60
	VENTAS INC	128,357	6,188,090.97
	VERIS RESIDENTIAL INC	26,189	439,189.53
	VICI PROPERTIES INC	322,067	10,354,454.05
	VORNADO REALTY TRUST	51,097	1,049,021.41
	WELLTOWER INC	159,408	12,819,591.36
	WHITESTONE REIT	15,983	161,588.13
	WP CAREY INC	68,655	4,852,535.40
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	35,531	452,309.63
	米ドル 小計	8,186,052	326,065,834.34 (45,551,397,057)
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	20,562	463,878.72
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	20,272	145,755.68
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	5,322	62,586.72
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	7,377	493,668.84
	BSR REAL ESTATE INVESTMENT T	6,564	116,839.20
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	14,969	50,295.84
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	25,958	1,366,169.54
	CHOICE PROPERTIES REIT	50,425	681,241.75
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	15,851	219,853.37
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	16,684	259,102.52
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	39,654	566,259.12
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	5,350	75,970.00
	EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	15,851	45,492.37
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	32,437	476,499.53
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	9,850	765,837.50

	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	42,850	451,639.00
	INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	2,543	9,256.52
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	22,620	290,667.00
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	18,755	334,401.65
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	5,378	82,552.30
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	6,979	116,968.04
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	12,242	103,812.16
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	37,128	263,237.52
	PRIMARIS REIT	14,963	200,504.20
	PRO REAL ESTATE INVESTMENT T	8,626	46,925.44
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	47,761	955,220.00
	SLATE GROCERY REIT	10,423	142,273.95
	SLATE OFFICE REIT	6,335	12,289.90
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	22,146	553,650.00
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	16,181	44,335.94
	カナダドル 小計	562,056	9,397,184.32 (998,168,918)
ユーロ	AEDIFICA	14,913	953,686.35
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	2,209	11,243.81
	ALTAREA	1,602	165,967.20
	CARE PROPERTY INVEST	11,306	146,978.00
	CARMILA	18,272	287,966.72
	COFINIMMO	9,647	706,642.75
	COVIVIO	14,674	677,645.32
	CROMWELL REIT EUR	114,140	180,341.20
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	13,695	301,837.80
	GECINA SA	17,501	1,758,850.50
	HAMBORNER REIT AG	22,165	144,737.45
	ICADE	10,070	390,917.40
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	14,471	37,335.18
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	93,814	540,368.64
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	9,152	128,311.04
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	132,455	129,673.44
	KLEPIERRE	62,063	1,482,064.44
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	19,976	119,656.24

	MERCIALYS	26,360	215,097.60
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	105,872	887,736.72
	MONTEA NV	4,410	326,340.00
	NSI NV	5,397	105,673.26
	RETAIL ESTATES	3,532	204,856.00
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	34,458	1,822,828.20
	VASTNED RETAIL NV	6,207	125,071.05
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	50,026	1,395,725.40
	WERELDHAVE NV	13,508	206,807.48
	XIOR STUDENT HOUSING NV	8,062	227,751.50
	ユーロ 小計	839,957	13,682,110.69 (2,144,397,208)
英ポンド	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	141,815	74,452.87
	AEW UK REIT PLC	42,887	42,286.58
	ASSURA PLC	936,180	456,668.60
	BALANCED COMM PROPERTY TRUST	252,276	184,161.48
	BIG YELLOW GROUP PLC	55,646	610,993.08
	BRITISH LAND CO PLC	302,823	1,072,901.88
	CLS HOLDINGS PLC	64,468	92,576.04
	CUSTODIAN PROPERTY INCOME REIT PLC	153,661	136,758.29
	DERWENT LONDON PLC	36,322	816,518.56
	EDISTON PROPERTY INVESTMENT	57,084	35,506.24
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	188,158	168,777.72
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	83,526	363,672.20
	HAMMERSON PLC	1,312,197	336,709.75
	HELICAL PLC	33,175	88,245.50
	HOME REIT PLC	147,401	56,086.08
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	142,814	133,673.90
	INTU PROPERTIES PLC	117,549	—
	LAND SECURITIES GROUP PLC	242,000	1,600,588.00
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	310,639	570,643.84
	LXI REIT PLC	541,292	522,617.42
	NEWRIVER REIT PLC	107,134	93,206.58
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	190,871	141,244.54
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	421,955	418,790.33

	PRS REIT PLC/THE	171,235	143,666.16
	REGIONAL REIT LTD	151,551	72,441.37
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	69,285	628,761.37
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	197,166	88,527.53
	SEGRO PLC	393,422	3,130,065.43
	SHAFTESBURY CAPITAL PLC	618,851	767,375.24
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	398,928	312,759.55
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	106,966	64,179.60
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	594,580	848,465.66
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	267,793	145,679.39
	UNITE GROUP PLC	127,291	1,229,631.06
	URBAN LOGISTICS REIT PLC	147,659	182,211.20
	WAREHOUSE REIT PLC	145,941	130,179.37
	WORKSPACE GROUP PLC	43,511	231,260.96
	英ポンド 小計	9,316,052	15,992,283.37 (2,892,524,293)
オーストラリアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	126,889	343,869.19
	ARENA REIT	111,944	411,953.92
	BWP TRUST	155,714	573,027.52
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	176,579	550,926.48
	CENTURIA OFFICE REIT	150,261	214,873.23
	CHARTER HALL GROUP	149,818	1,707,925.20
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	204,710	845,452.30
	CHARTER HALL RETAIL REIT	169,064	637,371.28
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	102,691	304,992.27
	CROMWELL PROPERTY GROUP	432,684	244,466.46
	DEXUS INDUSTRIA REIT	71,835	197,546.25
	DEXUS/AU	345,560	2,816,314.00
	GDI PROPERTY GROUP	181,458	118,854.99
	GOODMAN GROUP	549,007	11,265,623.64
	GPT GROUP	608,304	2,585,292.00
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	88,398	251,050.32
	HEALTHCO REIT	136,880	186,156.80
	HMC CAPITAL LTD	77,093	396,258.02
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	507,628	604,077.32
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	67,652	208,368.16

	INGENIA COMMUNITIES GROUP	119,014	468,915.16
	MIRVAC GROUP	1,267,475	2,978,566.25
	NATIONAL STORAGE REIT	397,707	898,817.82
	RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE	96,236	67,365.20
	REGION RE LTD	362,765	870,636.00
	RURAL FUNDS GROUP	133,000	266,000.00
	SCENTRE GROUP	1,666,601	4,583,152.75
	STOCKLAND	766,711	3,189,517.76
	VICINITY CENTRES	1,229,748	2,379,562.38
	WAYPOINT REIT	219,293	563,583.01
	オーストラリアドル 小計	10,672,719	40,730,515.68 (3,861,660,191)
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	256,643	297,705.88
	GOODMAN PROPERTY TRUST	342,168	752,769.60
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	498,622	456,239.13
	PRECINCT PROPERTIES GROUP	432,348	557,728.92
	STRIDE STAPLED GROUP	186,933	265,444.86
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	159,328	374,420.80
	ニュージーランドドル 小計	1,876,042	2,704,309.19 (236,843,398)
香港ドル	CHAMPION REIT	601,000	1,658,760.00
	FORTUNE REIT	470,000	2,660,200.00
	LINK REIT	817,400	35,270,810.00
	PROSPERITY REIT	431,000	728,390.00
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	345,000	997,050.00
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	795,000	1,311,750.00
	香港ドル 小計	3,459,400	42,626,960.00 (762,596,314)
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LT	184,100	228,284.00
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	1,081,400	2,995,478.00
	CAPITALAND ASCOTT TRUST	695,096	757,654.64
	CAPITALAND CHINA TRUST	376,400	391,456.00
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	1,620,532	3,224,858.68
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	266,200	314,116.00
	DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	209,200	127,612.00
	EC WORLD REIT	50,000	15,000.00

	ESR-LOGOS REIT	2,101,050	714,357.00	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	321,400	205,696.00	
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	461,400	119,964.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	338,500	744,700.00	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL	918,579	1,175,781.12	
	KEPPEL DC REIT	419,500	935,485.00	
	KEPPEL REIT	649,200	594,018.00	
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	611,800	416,024.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	635,700	1,436,682.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,069,600	1,807,624.00	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	729,700	1,218,599.00	
	MOUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	779,700	241,707.00	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	126,100	462,787.00	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT	188,100	136,372.50	
	SPH REIT	333,900	315,535.50	
	STARHILL GLOBAL REIT	435,300	226,356.00	
	SUNTEC REIT	709,600	922,480.00	
	シンガポールドル 小計	15,312,057	19,728,627.44 (2,081,567,481)	
韓国ウォン	D&D PLATFORM REIT CO LTD	15,215	48,383,700.00	
	E KOCREF CR-REIT CO LTD	3,951	20,387,160.00	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	43,823	173,319,965.00	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	7,910	35,199,500.00	
	JR REIT XXVII	47,106	195,489,900.00	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	14,612	81,534,960.00	
	LOTTE REIT CO LTD	44,180	160,594,300.00	
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	34,232	142,747,440.00	
	NH ALL-ONE REIT CO LTD	11,869	39,642,460.00	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	26,417	161,407,870.00	
	SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LTD	4,632	15,054,000.00	
	SK REITS CO LTD	27,542	136,057,480.00	
	韓国ウォン 小計	281,489	1,209,818,735.00 (133,684,970)	
イスラエルシェケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	237,765	413,948.86	
	REIT 1 LTD	62,662	1,053,348.22	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LTD	64,116	514,915.59	

	イスラエルシェケル 小計	364,543	1,982,212.67 (77,192,316)
	合計		58,740,032,146 (58,740,032,146)

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式 3 銘柄	1.2%	—	0.9%
	投資証券 141 銘柄	—	98.8%	76.8%
カナダドル	投資証券 30 銘柄	—	100.0%	1.7%
ユーロ	投資証券 28 銘柄	—	100.0%	3.6%
英ポンド	投資証券 37 銘柄	—	100.0%	4.9%
オーストラリアドル	株式 1 銘柄	0.9%	—	0.1%
	投資証券 30 銘柄	—	99.1%	6.5%
ニュージーランドドル	投資証券 6 銘柄	—	100.0%	0.4%
香港ドル	投資証券 6 銘柄	—	100.0%	1.3%
シンガポールドル	投資証券 25 銘柄	—	100.0%	3.5%
韓国ウォン	投資証券 12 銘柄	—	100.0%	0.2%
イスラエルシェケル	投資証券 3 銘柄	—	100.0%	0.1%

(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(その他の注記)の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

【中間財務諸表】

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和 52 年大蔵省令第 38 号)ならびに同規則第 38 条の 3 および第 57 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、中間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 期中間計算期間(2023 年 7 月 21 日から 2024 年 1 月 20 日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

独立監査人の中間監査報告書

2024年4月5日

りそな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 松崎 雅則
業務執行社員

中間監査意見

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」に掲げられている九州SDGs・グローバルバランスの2023年7月21日から2024年1月20日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、九州SDGs・グローバルバランスの2024年1月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年7月21日から2024年1月20日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間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、りそな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、中間監査の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。

中間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中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を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中間財務諸表を作成し有用な情報を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。

中間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中間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中間財務諸表の作成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。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間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、中間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中間監査の基準に従って、中間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中間財務諸表の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する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の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。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- 中間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中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示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中間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、中間監査報告書において中間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中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間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、中間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、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- 中間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中間財務諸表の作成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中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を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、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間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中間監査上の重要な発見事項、及び中間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

りそな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) 上記は中間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。

【九州SDGs・グローバルバランス】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 2023年7月20日現在	第3期中間計算期間末 2024年1月20日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	20,280,397	18,563,925
親投資信託受益証券	2,341,698,863	2,020,926,582
未収入金	25,689,000	12,618,000
流動資産合計	2,387,668,260	2,052,108,507
資産合計	2,387,668,260	2,052,108,507
負債の部		
流動負債		
未払解約金	26,635,393	13,141,447
未払受託者報酬	418,258	360,298
未払委託者報酬	13,523,502	11,649,631
未払利息	55	50
その他未払費用	84,947	73,172
流動負債合計	40,662,155	25,224,598
負債合計	40,662,155	25,224,598
純資産の部		
元本等		
元本	2,254,411,654	1,851,599,494
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金(△)	92,594,451	175,284,415
(分配準備積立金)	104,309,026	83,784,859
元本等合計	2,347,006,105	2,026,883,909
純資産合計	2,347,006,105	2,026,883,909
負債純資産合計	2,387,668,260	2,052,108,507

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第2期中間計算期間 自 2022年7月21日 至 2023年1月20日	第3期中間計算期間 自 2023年7月21日 至 2024年1月20日
営業収益		
有価証券売買等損益	△90,187,771	116,956,719
営業収益合計	△90,187,771	116,956,719
営業費用		
支払利息	7,459	5,518
受託者報酬	436,637	360,298
委託者報酬	14,117,887	11,649,631
その他費用	88,817	73,742
営業費用合計	14,650,800	12,089,189
営業利益又は営業損失(△)	△104,838,571	104,867,530
経常利益又は経常損失(△)	△104,838,571	104,867,530
中間純利益又は中間純損失(△)	△104,838,571	104,867,530
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額(△)	△366,572	6,194,427
期首剰余金又は期首欠損金(△)	△77,982,759	92,594,451
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,346,794	2,424,694
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,346,794	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	2,424,694
剰余金減少額又は欠損金増加額	696,221	18,407,833
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	18,407,833
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	696,221	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金(△)	△180,804,185	175,284,415

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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。
-----------------	---------------------------------------

(中間貸借対照表に関する注記)

第2期 2023年7月20日現在	第3期中間計算期間末 2024年1月20日現在
1. 投資信託財産に係る元本の状況	1. 投資信託財産に係る元本の状況
期首元本額 2,776,234,468円	期首元本額 2,254,411,654円
期中追加設定元本額 30,165,358円	期中追加設定元本額 45,730,638円
期中一部解約元本額 551,988,172円	期中一部解約元本額 448,542,798円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 2,254,411,654口	2. 中間計算期間の末日における受益権の総数 1,851,599,494口
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1.0411円	3. 中間計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1.0947円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,411円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,947円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

第2期 2023年7月20日現在	第3期中間計算期間末 2024年1月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべ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。	1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額 中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間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 親投資信託受益証券 (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。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 同左 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 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。	3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 同左

(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)

デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは「RM国内債券マザーファンド（九州重視型）」、「RM米ドル建SDGs債券マザーファンド（為替ヘッジあり）」、「RMユーロ建SDGs債券マザーファンド（為替ヘッジあり）」、「RM新興国債券マザーファンド」、「RM国内株式ESGマザーファンド」、「RM先進国株式ESGマザーファンド」、「RM新興国株式マザーファンド」、「RM国内リートマザーファンド」および「RM先進国リートマザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同親投資信託の受益証券です。なお、以下に記載した状況は監査意見の対象外となっております。

RM国内債券マザーファンド（九州重視型）

貸借対照表

(単位：円)

2024年1月20日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	7,759,343
国債証券	396,557,200
地方債証券	784,751,000
未収利息	387,814
流動資産合計	1,189,455,357
資産合計	1,189,455,357
負債の部	
流動負債	
未払利息	21
流動負債合計	21
負債合計	21
純資産の部	
元本等	
元本	1,210,925,913
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△21,470,577
元本等合計	1,189,455,336
純資産合計	1,189,455,336
負債純資産合計	1,189,455,357

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額、又は価格情報会社の提供する価額で評価しております。
-----------------	---

(貸借対照表に関する注記)

2024年1月20日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年7月21日
期首元本額	1,245,851,646円
期中追加設定元本額	997,659円
期中一部解約元本額	35,923,392円
期末元本額	1,210,925,913円
期末元本の内訳※	
九州SDGs・グローバルバランス	213,123,625円
りそな国内債券ファンド(九州重視型)(適格機関投資家専用)	997,802,288円
2. 計算日における受益権の総数	1,210,925,913口
3. 元本の欠損	
純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	21,470,577円
4. 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	0.9823円
(10,000口当たり純資産額)	(9,823円)

(注) ※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2024年1月20日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべ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	
国債証券、地方債証券	(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。
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	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。

(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)

デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

RM米ドル建SDGs債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

貸借対照表

（単位：円）

2024年1月20日現在

資産の部	
流動資産	
預金	38,189,821
コール・ローン	24,917,693
国債証券	195,368,307
特殊債券	2,032,315,143
派生商品評価勘定	12,644,665
未収入金	11,180,014
未収利息	12,006,470
前払費用	55,642
流動資産合計	2,326,677,755
資産合計	2,326,677,755
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,481,053
未払金	33,792,530
未払利息	67
流動負債合計	37,273,650
負債合計	37,273,650
純資産の部	
元本等	
元本	2,641,781,176
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△352,377,071
元本等合計	2,289,404,105
純資産合計	2,289,404,105
負債純資産合計	2,326,677,755

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	国債証券、特殊債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額、又は価格情報会社の提供する価額で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則としてわが国における計算日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	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の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
4. 収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 原則として、約定日基準で計上しております。
5. その他財務諸表作成のための重要な事項	外貨建取引等の処理基準 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して整理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。

(貸借対照表に関する注記)

2024年 1月 20日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 7月 21日
期首元本額	2,562,031,575円
期中追加設定元本額	430,897,539円
期中一部解約元本額	351,147,938円
期末元本額	2,641,781,176円
期末元本の内訳※	
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	1,557,013,973円
九州SDGs・グローバルバランス	337,251,906円
ラップ型ファンド・プラスESG (安定型)	109,344,490円
ラップ型ファンド・プラスESG (安定成長型)	492,439,009円
ラップ型ファンド・プラスESG (成長型)	45,504,078円
りそな米ドル建SDGs債券ファンド (為替ヘッジあり) (適格機関投資家専用)	100,227,720円
2. 計算日における受益権の総数	2,641,781,176口
3. 元本の欠損	
純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	352,377,071円
4. 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	0.8666円
(10,000口当たり純資産額)	(8,666円)

(注) ※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2024年 1月 20日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべ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	
国債証券、特殊債券	

(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。

デリバティブ取引

(その他の注記)のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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。

また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算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。

(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)

デリバティブ取引に関する注記

(通貨関連)

(2024年1月20日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	2,260,528,445	—	2,251,364,833	9,163,612
	米ドル	2,260,528,445	—	2,251,364,833	9,163,612
	合計	2,260,528,445	—	2,251,364,833	9,163,612

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

1) 計算日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については以下のように評価しております。

① 計算日において為替予約の受渡日(以下「当該日」といいます)の対顧客先物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で評価しております。

② 計算日において当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、当該日に最も近い前後二つの対顧客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。
- ・ 計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

2) 計算日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については計算日の対顧客相場の仲値で評価しております。

※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。

RMユーロ建SDGs債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

貸借対照表

（単位：円）

2024年1月20日現在

資産の部	
流動資産	
預金	26,694,813
コール・ローン	17,610,701
国債証券	213,873,998
特殊債券	1,312,909,626
派生商品評価勘定	8,985,702
未収入金	6,603,956
未収利息	4,664,709
前払費用	1,128,813
流動資産合計	1,592,472,318
資産合計	1,592,472,318
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,509,361
未払金	23,922,728
未払利息	47
流動負債合計	25,432,136
負債合計	25,432,136
純資産の部	
元本等	
元本	1,777,615,908
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△210,575,726
元本等合計	1,567,040,182
純資産合計	1,567,040,182
負債純資産合計	1,592,472,318

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	国債証券、特殊債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額、又は価格情報会社の提供する価額で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則としてわが国における計算日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	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の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
4. 収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 原則として、約定日基準で計上しております。
5. その他財務諸表作成のための重要な事項	外貨建取引等の処理基準 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して整理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。

(貸借対照表に関する注記)

2024年1月20日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年7月21日
期首元本額	1,849,111,108円
期中追加設定元本額	255,653,803円
期中一部解約元本額	327,149,003円
期末元本額	1,777,615,908円
期末元本の内訳※	
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	1,026,497,758円
九州SDGs・グローバルバランス	222,640,560円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定型)	72,439,439円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定成長型)	326,062,313円
ラップ型ファンド・プラスESG(成長型)	29,717,237円
りそなユーロ建SDGs債券ファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	100,258,601円
2. 計算日における受益権の総数	1,777,615,908口
3. 元本の欠損	
純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	210,575,726円
4. 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	0.8815円
(10,000口当たり純資産額)	(8,815円)

(注) ※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2024年1月20日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべ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	
国債証券、特殊債券	

(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。

デリバティブ取引

(その他の注記)のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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。

また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算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。

(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)

デリバティブ取引に関する注記

(通貨関連)

(2024年1月20日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	1,535,106,900	—	1,527,630,559	7,476,341
	ユーロ	1,535,106,900	—	1,527,630,559	7,476,341
	合計	1,535,106,900	—	1,527,630,559	7,476,341

(注)時価の算定方法

為替予約取引

1) 計算日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については以下のように評価しております。

① 計算日において為替予約の受渡日(以下「当該日」といいます)の対顧客先物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で評価しております。

② 計算日において当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、当該日に最も近い前後二つの対顧客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。
- ・ 計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

2) 計算日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については計算日の対顧客相場の仲値で評価しております。

※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。

RM新興国債券マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2024年1月20日現在

資産の部	
流動資産	
預金	5,012,903
コール・ローン	17,829,873
投資信託受益証券	11,995,208,335
派生商品評価勘定	6,243
未収入金	34,552,400
未収配当金	255,061,368
流動資産合計	12,307,671,122
資産合計	12,307,671,122
負債の部	
流動負債	
未払解約金	20,615,000
未払利息	48
流動負債合計	20,615,048
負債合計	20,615,048
純資産の部	
元本等	
元本	9,006,113,938
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	3,280,942,136
元本等合計	12,287,056,074
純資産合計	12,287,056,074
負債純資産合計	12,307,671,122

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	投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則としてわが国における計算日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	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の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
4. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 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。 為替予約取引による為替差損益 原則として、約定日基準で計上しております。
5. その他財務諸表作成のための重要な事項	外貨建取引等の処理基準 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して整理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。

(貸借対照表に関する注記)

2024 年 1 月 20 日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023 年 7 月 21 日
期首元本額	8,016,360,322 円
期中追加設定元本額	1,405,391,159 円
期中一部解約元本額	415,637,543 円
期末元本額	9,006,113,938 円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド(安定型)	743,545,548 円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	972,628,504 円
りそなラップ型ファンド(成長型)	636,416,217 円
DCりそな グローバルバランス	22,122,992 円
つみたてバランスファンド	1,548,580,273 円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	326,700,550 円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	249,813,371 円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	172,458,002 円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	91,964,096 円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	61,303,908 円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	35,112,180 円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	82,181,763 円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	92,707,530 円
九州SDGs・グローバルバランス	29,457,343 円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定型)	5,378,143 円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定成長型)	44,987,259 円
ラップ型ファンド・プラスESG(成長型)	52,644,909 円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定型)	23,394,401 円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定成長型)	24,889,769 円
りそな つみたてラップ型ファンド(成長型)	15,125,102 円
ターゲットリターンバランスファンド(目標2%)	414,162 円

ターゲットリターンバランスファンド（目標3%）	195,649円
ターゲットリターンバランスファンド（目標4%）	807,112円
ターゲットリターンバランスファンド（目標5%）	293,277円
ターゲットリターンバランスファンド（目標6%）	636,201円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2065	325,101円
FWりそな先進国+新興国債券アクティブファンド	19,528,289円
FWりそな新興国債券インデックスファンド	2,965,408,078円
Smart-i 8資産バランス 安定型	82,969,642円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	277,655,630円
Smart-i 8資産バランス 成長型	385,216,595円
りそなVIグローバル・バランスファンド（安定型）（適格機関投資家専用）	2,429,562円
りそなVIグローバル・バランスファンド（安定成長型）（適格機関投資家専用）	4,398,133円
りそなVIグローバル・バランスファンド（成長型）（適格機関投資家専用）	20,100,120円
りそなFT マルチアセットファンド（適格機関投資家専用）	14,294,203円
りそなDAAマルチアセットファンド（適格機関投資家専用）	30,324円
2. 計算日における受益権の総数	9,006,113,938口
3. 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.3643円
(10,000口当たり純資産額)	(13,643円)

(注) ※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2024年1月20日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべ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	投資信託受益証券 (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。 デリバティブ取引 (その他の注記)のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	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。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算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。

(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)

デリバティブ取引に関する注記

(通貨関連)

(2024年1月20日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		

市場取引以外の 取引	為替予約取引 買建	70,577,025	—	70,583,268	6,243
	米ドル	70,577,025	—	70,583,268	6,243
合計		70,577,025	—	70,583,268	6,243

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

1) 計算日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については以下のように評価しております。

① 計算日において為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます）の対顧客先物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で評価しております。

② 計算日において当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、当該日に最も近い前後二つの対顧客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。
- ・ 計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

2) 計算日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については計算日の対顧客相場の仲値で評価しております。

※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。

RM国内株式ESGマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2024年1月20日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	476,683,182
株式	3,675,048,710
投資証券	29,669,600
派生商品評価勘定	6,277,730
未収配当金	4,451,019
差入委託証拠金	5,930,409
流動資産合計	4,198,060,650
資産合計	4,198,060,650
負債の部	
流動負債	
前受金	5,905,250
未払解約金	352,598,300
未払利息	1,292
流動負債合計	358,504,842
負債合計	358,504,842
純資産の部	
元本等	
元本	2,270,337,233
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	1,569,218,575
元本等合計	3,839,555,808
純資産合計	3,839,555,808
負債純資産合計	4,198,060,650

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	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の取引所の発表する清算値段で評価しております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 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。 派生商品取引等損益 原則として、約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

2024年1月20日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年7月21日
期首元本額	2,359,889,618円
期中追加設定元本額	1,111,415,972円
期中一部解約元本額	1,200,968,357円
期末元本額	2,270,337,233円
期末元本の内訳※	
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	349,899,247円
国内株式ESGインデックス・オープン	72,033,310円
九州SDGs・グローバルバランス	141,318,962円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定型)	7,692,350円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定成長型)	143,062,424円
ラップ型ファンド・プラスESG(成長型)	183,668,373円
Smart-i 国内株式ESGインデックス	1,042,293,598円
国内株式ESGインデックスファンド(適格機関投資家専用)	330,368,969円
2. 計算日における受益権の総数	2,270,337,233口
3. 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.6912円
(10,000口当たり純資産額)	(16,912円)

(注) ※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2024年1月20日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべ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	株式、投資証券

(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。

デリバティブ取引

(その他の注記)のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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。

また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算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。

(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)

デリバティブ取引に関する注記

(株式関連)

(2024年1月20日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	111,692,270	—	117,970,000	6,277,730
	合計	111,692,270	—	117,970,000	6,277,730

(注) 時価の算定方法

先物取引

国内先物取引について

先物取引の評価においては、原則として計算日の取引所の発表する清算値段で評価しております。

※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。

RM先進国株式ESGマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2024年1月20日現在

資産の部	
流動資産	
預金	300,635,462
コール・ローン	33,414,938
株式	8,334,054,607
投資証券	185,567,964
派生商品評価勘定	6,325,733
未収入金	394,291,700
未収配当金	5,873,385
差入委託証拠金	153,607,255
流動資産合計	9,413,771,044
資産合計	9,413,771,044
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,941,226
未払金	551,741
未払解約金	40,886,000
未払利息	90
流動負債合計	43,379,057
負債合計	43,379,057
純資産の部	
元本等	
元本	4,531,179,973
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	4,839,212,014
元本等合計	9,370,391,987
純資産合計	9,370,391,987
負債純資産合計	9,413,771,044

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	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。 為替予約取引 個別法に基づき、原則としてわが国における計算日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	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の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
4. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 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。 派生商品取引等損益 原則として、約定日基準で計上しております。 為替予約取引による為替差損益 原則として、約定日基準で計上しております。
5. その他財務諸表作成のための重要な事項	外貨建取引等の処理基準 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して整理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。

(貸借対照表に関する注記)

2024年1月20日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年7月21日
期首元本額	3,598,118,896円
期中追加設定元本額	1,629,715,866円
期中一部解約元本額	696,654,789円
期末元本額	4,531,179,973円
期末元本の内訳※	
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	733,547,800円
先進国株式ESGインデックス・オープン	33,353,956円
九州SDGs・グローバルバランス	332,185,736円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定型)	33,286,565円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定成長型)	520,744,077円
ラップ型ファンド・プラスESG(成長型)	1,100,486,040円
S m a r t e r i 先進国株式ESGインデックス	1,777,575,799円
2. 計算日における受益権の総数	4,531,179,973口
3. 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	2.0680円
(10,000口当たり純資産額)	(20,680円)

(注) ※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2024年1月20日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべ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	株式、投資証券 (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。 デリバティブ取引 (その他の注記)のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	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。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算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。

(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)

デリバティブ取引に関する注記

(株式関連)

(2024年1月20日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	877,255,242	—	879,534,042	2,278,800
合計		877,255,242	—	879,534,042	2,278,800

(注) 時価の算定方法

先物取引

外国先物取引について

先物取引の評価においては、原則として計算日の取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

※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。

(通貨関連)

(2024年1月20日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の 取引	為替予約取引				
	買建	418,451,387	—	420,557,094	2,105,707
	米ドル	314,789,600	—	316,378,994	1,589,394
	カナダドル	14,199,185	—	14,278,303	79,118
	ユーロ	36,869,442	—	37,073,749	204,307

英ポンド	14,895,368	—	15,061,176	165,808
スイスフラン	11,968,661	—	11,944,745	△23,916
スウェーデンク ローナ	4,237,170	—	4,237,590	420
ノルウェークロ ーネ	2,111,610	—	2,112,660	1,050
デンマーククロ ーネ	7,095,723	—	7,132,293	36,570
オーストラリア ドル	7,771,320	—	7,802,672	31,352
香港ドル	2,824,770	—	2,841,375	16,605
シンガポールド ル	1,097,594	—	1,102,534	4,940
イスラエルシュ ケル	590,944	—	591,003	59
合計	418,451,387	—	420,557,094	2,105,707

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

1) 計算日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については以下のように評価しております。

① 計算日において為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます）の対顧客先物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で評価しております。

② 計算日において当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、当該日に最も近い前後二つの対顧客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。
- ・ 計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

2) 計算日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については計算日の対顧客相場の仲値で評価しております。

※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。

RM新興国株式マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2024年1月20日現在

資産の部	
流動資産	
預金	2,074,572,607
コール・ローン	47,289,112
株式	27,952,752,140
投資証券	41,259,982
派生商品評価勘定	1,104,022
未収入金	147,812,972
未収配当金	22,822,359
差入委託証拠金	685,919,356
流動資産合計	30,973,532,550
資産合計	30,973,532,550
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	77,729,334
未払解約金	107,700
未払利息	128
流動負債合計	77,837,162
負債合計	77,837,162
純資産の部	
元本等	
元本	17,727,234,591
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	13,168,460,797
元本等合計	30,895,695,388
純資産合計	30,895,695,388
負債純資産合計	30,973,532,550

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	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。</p> <p>為替予約取引 個別法に基づき、原則としてわが国における計算日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。</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の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 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。</p> <p>派生商品取引等損益 原則として、約定日基準で計上しております。 為替予約取引による為替差損益 原則として、約定日基準で計上しております。</p>
5. その他財務諸表作成のための重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 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して整理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>

(貸借対照表に関する注記)

2024年1月20日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年7月21日
期首元本額	15,608,210,450円
期中追加設定元本額	2,677,776,820円
期中一部解約元本額	558,752,679円
期末元本額	17,727,234,591円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド(安定型)	570,322,632円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	2,497,947,366円
りそなラップ型ファンド(成長型)	2,431,321,683円
DCりそな グローバルバランス	16,969,289円
つみたてバランスファンド	1,175,267,833円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	506,268,455円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	384,759,863円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	266,413,201円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	140,042,989円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	94,131,325円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	54,085,559円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	127,512,970円

埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	141,112,436円
九州SDGs・グローバルバランス	71,299,628円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定型)	4,144,082円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定成長型)	101,287,311円
ラップ型ファンド・プラスESG(成長型)	198,155,122円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定型)	17,950,345円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定成長型)	49,081,576円
りそな つみたてラップ型ファンド(成長型)	51,922,004円
りそな つみたてリスクコントロールファンド	2,351,495円
ターゲットリターンバランスファンド(目標2%)	319,136円
ターゲットリターンバランスファンド(目標3%)	276,507円
ターゲットリターンバランスファンド(目標4%)	1,761,987円
ターゲットリターンバランスファンド(目標5%)	853,750円
ターゲットリターンバランスファンド(目標6%)	2,163,030円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2065	502,915円
FWりそな先進国+新興国株式アクティブファンド	92,783,002円
FWりそな新興国株式インデックスファンド	4,395,405,745円
Smart-i 新興国株式インデックス	2,912,726,152円
Smart-i 8資産バランス 安定型	127,390,658円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	429,363,495円
Smart-i 8資産バランス 成長型	592,912,575円
Smart-i Select 全世界株式インデックス	95,827,850円
Smart-i Select 全世界株式インデックス(除く日本)	40,036,961円
Smart-i DC 全世界株式インデックス	61,873円
Smart-i DC 全世界株式インデックス(除く日本)	65,301円
りそなVIグローバル・バランスファンド(安定型)(適格機関投資家専用)	1,863,872円
りそなVIグローバル・バランスファンド(安定成長型)(適格機関投資家専用)	9,537,100円
りそなVIグローバル・バランスファンド(成長型)(適格機関投資家専用)	95,712,278円
りそなFT マルチアセットファンド(適格機関投資家専用)	25,226,638円
りそなDAAマルチアセットファンド(適格機関投資家専用)	96,602円
2. 計算日における受益権の総数	17,727,234,591口
3. 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.7428円
(10,000口当たり純資産額)	(17,428円)

(注) ※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2024年1月20日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべ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	
株式、投資証券	(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。
デリバティブ取引	(その他の注記)のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	

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。

また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算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。

(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)

デリバティブ取引に関する注記

(株式関連)

(2024年1月20日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	3,110,542,183	—	3,032,992,133	△77,550,050
合計		3,110,542,183	—	3,032,992,133	△77,550,050

(注) 時価の算定方法

先物取引

外国先物取引について

先物取引の評価においては、原則として計算日の取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

※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。

(通貨関連)

(2024年1月20日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	325,636,255	—	326,560,993	924,738
	米ドル	325,636,255	—	326,560,993	924,738
合計		325,636,255	—	326,560,993	924,738

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

1) 計算日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については以下のように評価しております。

① 計算日において為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます）の対顧客先物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で評価しております。

② 計算日において当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、当該日に最も近い前後二つの対顧客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。
- ・ 計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

2) 計算日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については計算日の対顧客相場の仲値で評価してまいります。

※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。

RM国内リートマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2024年1月20日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,746,524,530
投資証券	51,088,810,900
派生商品評価勘定	3,355,170
未収入金	1,012,413,100
未収配当金	426,514,260
前払金	2,881,500
差入委託証拠金	37,381,462
流動資産合計	54,317,880,922
資産合計	54,317,880,922
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	831,600
未払金	2,561,265,458
未払解約金	28,614,600
未払利息	4,737
流動負債合計	2,590,716,395
負債合計	2,590,716,395
純資産の部	
元本等	
元本	36,071,564,419
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	15,655,600,108
元本等合計	51,727,164,527
純資産合計	51,727,164,527
負債純資産合計	54,317,880,922

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	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の取引所の発表する清算値段で評価しております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 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。 派生商品取引等損益 原則として、約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

2024年1月20日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年7月21日
期首元本額	31,278,827,263円
期中追加設定元本額	9,689,239,797円
期中一部解約元本額	4,896,502,641円
期末元本額	36,071,564,419円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド(安定型)	1,055,678,041円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	1,562,716,983円
りそなラップ型ファンド(成長型)	1,935,415,810円
DCりそな グローバルバランス	31,381,842円
つみたてバランスファンド	2,924,531,143円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	310,531,575円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	237,449,229円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	163,914,102円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	85,111,182円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	57,722,902円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	33,068,650円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	77,735,407円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	131,485,087円
九州SDGs・グローバルバランス	54,989,214円
りそな国内リートインデックス(ラップ専用)	2,596,467,763円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定型)	7,668,797円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定成長型)	94,801,107円
ラップ型ファンド・プラスESG(成長型)	94,864,219円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定型)	33,223,664円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定成長型)	55,353,183円
りそな つみたてラップ型ファンド(成長型)	55,158,578円
りそな つみたてリスクコントロールファンド	7,883,565円
ターゲットリターンバランスファンド(目標2%)	391,798円
ターゲットリターンバランスファンド(目標3%)	185,066円
ターゲットリターンバランスファンド(目標4%)	1,163,393円
ターゲットリターンバランスファンド(目標5%)	565,810円

ターゲットリターンバランスファンド（目標6%）	1,876,463円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2065	307,596円
りそなJリートインデックス（年1回決算型）	671,068円
りそなJリートインデックス（年4回決算型）	4,636,781円
FWりそな国内リートインデックスオープン	8,325,623,086円
FWりそな国内リートインデックスファンド	7,587,266,094円
S m a r t - i Jリートインデックス	3,300,615,985円
S m a r t - i 8資産バランス 安定型	78,601,072円
S m a r t - i 8資産バランス 安定成長型	263,823,648円
S m a r t - i 8資産バランス 成長型	360,184,430円
J-R E I Tインデックスファンド（適格機関投資家専用）	2,996,124,932円
りそなDAAファンド（適格機関投資家専用）	191,985,169円
りそなV Iグローバル・バランスファンド（安定型）（適格機関投資家専用）	3,449,524円
りそなV Iグローバル・バランスファンド（安定成長型）（適格機関投資家専用）	12,246,752円
りそなV Iグローバル・バランスファンド（成長型）（適格機関投資家専用）	28,531,226円
りそなDAAマルチアセットファンド（適格機関投資家専用）	28,185円
りそなマルチアセットファンド（適格機関投資家専用）	12,060,625円
りそなDAAファンドII（適格機関投資家専用）	17,773,450円
J-R E I Tインデックスファンド202102（適格機関投資家専用）	133,840,674円
りそなDAAファンド202205（適格機関投資家専用）	402,111,914円
りそなF T グローバルリートファンド202307（適格機関投資家専用）	489,477,796円
りそなマルチアセットファンド202310（適格機関投資家専用）	250,869,839円
2. 計算日における受益権の総数	36,071,564,419口
3. 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.4340円
(10,000口当たり純資産額)	(14,340円)

(注) ※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2024年1月20日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべ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	
投資証券	(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。
デリバティブ取引	(その他の注記)のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	
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。	
また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算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。	

(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)
 デリバティブ取引に関する注記
 (投資証券関連)

(2024年 1月 20日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	不動産投信指数先物取引				
	買建	649,242,930	—	651,766,500	2,523,570
	合計	649,242,930	—	651,766,500	2,523,570

(注) 時価の算定方法

先物取引

国内先物取引について

先物取引の評価においては、原則として計算日の取引所の発表する清算値段で評価しております。

※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。

RM先進国リートマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2024年1月20日現在

資産の部	
流動資産	
預金	82,681,796
コール・ローン	1,104,766,144
株式	573,352,374
投資証券	64,189,365,434
派生商品評価勘定	1,741
未収入金	112,692,940
未収配当金	124,133,777
流動資産合計	66,186,994,206
資産合計	66,186,994,206
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	9,198
未払解約金	1,069,247,000
未払利息	2,996
流動負債合計	1,069,259,194
負債合計	1,069,259,194
純資産の部	
元本等	
元本	40,446,137,612
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	24,671,597,400
元本等合計	65,117,735,012
純資産合計	65,117,735,012
負債純資産合計	66,186,994,206

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	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則としてわが国における計算日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	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の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
4. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 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。 配当株式 原則として、配当落ち日において、その数量に相当する券面総額又は発行価額を計上しております。 為替予約取引による為替差損益 原則として、約定日基準で計上しております。
5. その他財務諸表作成のための重要な事項	外貨建取引等の処理基準 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して整理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。

(貸借対照表に関する注記)

2024年1月20日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年7月21日
期首元本額	39,434,592,049円
期中追加設定元本額	6,629,185,963円
期中一部解約元本額	5,617,640,400円
期末元本額	40,446,137,612円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド(安定型)	930,645,233円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	1,665,464,358円
りそなラップ型ファンド(成長型)	2,617,414,486円
DCりそな グローバルバランス	27,703,525円
つみたてバランスファンド	1,302,925,339円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	568,043,508円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	421,802,207円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	290,093,497円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	152,703,516円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	102,234,339円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	58,937,021円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	136,423,690円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	234,531,808円
九州SDGs・グローバルバランス	95,523,097円

ラップ型ファンド・プラスE S G (安定型)	6,690,185 円
ラップ型ファンド・プラスE S G (安定成長型)	109,350,648 円
ラップ型ファンド・プラスE S G (成長型)	99,869,184 円
りそな つみたてラップ型ファンド (安定型)	29,281,474 円
りそな つみたてラップ型ファンド (安定成長型)	66,445,565 円
りそな つみたてラップ型ファンド (成長型)	78,429,860 円
りそな つみたてリスクコントロールファンド	2,540,991 円
ターゲットリターンバランスファンド (目標2%)	688,480 円
ターゲットリターンバランスファンド (目標3%)	325,248 円
ターゲットリターンバランスファンド (目標4%)	2,053,602 円
ターゲットリターンバランスファンド (目標5%)	989,958 円
ターゲットリターンバランスファンド (目標6%)	3,278,924 円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2065	537,959 円
FWりそな先進国リートインデックスオープン	13,784,711,201 円
FWりそな先進国リートインデックスファンド	12,587,812,334 円
S m a r t e r i 先進国リートインデックス	2,955,362,580 円
S m a r t e r i 8資産バランス 安定型	139,502,908 円
S m a r t e r i 8資産バランス 安定成長型	484,431,682 円
S m a r t e r i 8資産バランス 成長型	653,027,949 円
りそなDAAファンド (適格機関投資家専用)	154,312,137 円
りそなV I グローバル・バランスファンド (安定型) (適格機関投資家専用)	3,041,901 円
りそなV I グローバル・バランスファンド (安定成長型) (適格機関投資家専用)	7,094,406 円
りそなV I グローバル・バランスファンド (成長型) (適格機関投資家専用)	125,631,135 円
りそなDAAマルチアセットファンド (適格機関投資家専用)	103,041 円
りそなマルチアセットファンド (適格機関投資家専用)	10,484,631 円
りそなDAAファンドII (適格機関投資家専用)	31,521,867 円
りそなDAAファンド202205 (適格機関投資家専用)	323,205,959 円
りそなF T グローバルリートファンド202307 (適格機関投資家専用)	180,966,179 円
2. 計算日における受益権の総数	40,446,137,612 口
3. 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.6100 円
(10,000口当たり純資産額)	(16,100 円)

(注) ※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2024年1月20日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべ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	
株式、投資証券	
(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。	
デリバティブ取引	
(その他の注記)のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。	
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	
これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	
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。	

また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算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。

(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)

デリバティブ取引に関する注記

(通貨関連)

(2024年1月20日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	71,384,538	—	71,377,081	△7,457
	米ドル	71,384,538	—	71,377,081	△7,457
合計		71,384,538	—	71,377,081	△7,457

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

1) 計算日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については以下のように評価しております。

① 計算日において為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます）の対顧客先物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で評価しております。

② 計算日において当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、当該日に最も近い前後二つの対顧客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。
- ・ 計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

2) 計算日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については計算日の対顧客相場の仲値で評価しております。

※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。

2 【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2024年1月31日現在です。

【九州SDGs・グローバルバランス】

【純資産額計算書】

I 資産総額	2,032,731,288円
II 負債総額	2,964,810円
III 純資産総額 (I - II)	2,029,766,478円
IV 発行済口数	1,832,159,451口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	1.1079円

(参考)

RM国内債券マザーファンド (九州重視型)

純資産額計算書

I 資産総額	1,186,542,005円
II 負債総額	21円
III 純資産総額 (I - II)	1,186,541,984円
IV 発行済口数	1,210,925,913口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	0.9799円

RM米ドル建SDGs債券マザーファンド (為替ヘッジあり)

純資産額計算書

I 資産総額	2,495,611,403円
II 負債総額	155,988,584円
III 純資産総額 (I - II)	2,339,622,819円
IV 発行済口数	2,695,422,329口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	0.8680円

RMユーロ建SDGs債券マザーファンド (為替ヘッジあり)

純資産額計算書

I 資産総額	1,760,421,862円
II 負債総額	160,215,427円
III 純資産総額 (I - II)	1,600,206,435円
IV 発行済口数	1,811,988,414口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	0.8831円

RM新興国債券マザーファンド

純資産額計算書

I 資産総額	12,570,012,599円
II 負債総額	253,472,928円
III 純資産総額 (I - II)	12,316,539,671円
IV 発行済口数	9,052,252,647口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	1.3606円

RM国内株式ESGマザーファンド

純資産額計算書

I 資産総額	4,482,005,640円
II 負債総額	122,110,878円
III 純資産総額 (I - II)	4,359,894,762円
IV 発行済口数	2,542,308,931口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	1.7149円

RM先進国株式ESGマザーファンド

純資産額計算書

I 資産総額	9,564,875,809円
II 負債総額	4,223,674円
III 純資産総額 (I - II)	9,560,652,135円
IV 発行済口数	4,495,141,161口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	2.1269円

RM新興国株式マザーファンド

純資産額計算書

I 資産総額	31,881,718,611円
II 負債総額	23,243,671円
III 純資産総額 (I - II)	31,858,474,940円
IV 発行済口数	18,005,329,546口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	1.7694円

RM国内リートマザーファンド

純資産額計算書

I 資産総額	50,820,281,934円
II 負債総額	135,198,485円
III 純資産総額 (I - II)	50,685,083,449円
IV 発行済口数	35,527,592,010口
V 1口当たり純資産額 (III / IV)	1.4266円

RM先進国リートマザーファンド

純資産額計算書

I 資産総額	66,715,632,707円
II 負債総額	3,265,846円
III 純資産総額 (I - II)	66,712,366,861円
IV 発行済口数	41,250,547,622口
V 1口当たり純資産額 (III / IV)	1.6172円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換

受益者は、委託会社がやむを得ない事情などにより受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求を行わないものとします。

(2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3) 譲渡制限の内容

① 譲渡制限はありません。

② 受益権の譲渡

- ・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また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。
- ・前述の申請のある場合には、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およ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または記録するものとします。ただし、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。）に社債、株式等の振替に関する法律の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。
- ・前述の振替について、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また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などにおいて、委託会社が必要と認めたときまた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。

③ 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または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

(4) 受益証券の再発行

受益者は、委託会社がやむを得ない事情などにより受益証券を発行する場合を除き、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

(5) 受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議のうえ、社債、株式等の振替に関する法律に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

(6) 質権口記載また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または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、解約請求の受付、解約金および償還金の支払いなどについては、約款の規定によるほか、民法その他の法令などにしたがって取り扱われます。

第三部【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1月末現在	資本金の額	1,000,000,000円
	発行可能株式総数	3,960,000株
	発行済株式総数	3,960,000株

- 過去5年間における主な資本金の増減
該当事項はありません。

(2) 委託会社の機構（2024年1月末現在）

① 会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は取締役会の決議をもって決定します。

取締役会は、その決議によって代表取締役を選定します。取締役会は、業務執行を分担して行う責任者を執行役員として選任することができます。また、取締役会は、取締役および執行役員の職務執行を監督します。

取締役会は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役社長がこれを招集し、議長となります。取締役社長に事故または欠員があるときは、取締役会においてあらかじめ定めた順序に従い、他の取締役が取締役会を招集し、議長となります。

取締役会の決議は、議決に加わることができる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。

取締役は株主総会において選任されます。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の終結の時までです。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の終結の時までです。

経営会議は、経営に関する全般的な重要事項および重要な業務執行案件を協議します。

監査等委員会は、代表取締役その他の業務執行取締役の職務の執行を監査する独立の機関であるとともに、監査等委員である取締役以外の業務執行取締役の選任・解任・辞任および報酬等について監査等委員会としての意見を決定します。

② 投資運用の意思決定機構

委託会社では、以下P.D.C.Aサイクルにて投資運用の意思決定を行っています。

○PLAN：計画

- ・運用戦略部は、運用基本方針や主な投資制限などを策定し、運用委員会にて協議します。

○DO：実行

- ・運用部門のファンドマネージャーは、決定された運用基本方針等に基づいて運用計画を策定し、ファンドマネージャーが所属する部の部長が承認します。
- ・ファンドマネージャーは、決定された運用計画に沿って運用指図を行いポートフォリオを構築し、ファンドの運用状況を管理します。
- ・運用部門の各部長は、ファンドの運用が運用計画に沿って行われていることを確認します。
- ・売買発注の執行は、運用計画の策定等から組織的に分離されたトレーディング部が、発注先証券会社等の選定ルール等に基づく最良執行を行うよう努めます。

○CHECK：検証→ACTION：改善

- ・法令等や主な投資制限の遵守状況等については、運用部門から独立した運用リスク管理部がモニタリングを行います。その結果は、運用評価委員会に報告するとともにすみやかに運用部門にフィードバックされ、ファンドの運用に反映されます。
- ・運用実績等については運用評価委員会が統括し、運用部門に対する管理・指導を行います。

2【事業の内容及び営業の概況】

当社は、「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として、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・代理業および第二種金融商品取引業を行っています。

2024年1月末現在、委託会社が運用する証券投資信託は以下のとおりです（ただし、親投資信託を除きます。）。

ファンドの種類	本数	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	163	1,687,319
単位型株式投資信託	6	28,098
単位型公社債投資信託	12	21,754
合計	181	1,737,172

3 【委託会社等の経理状況】

- (1) 委託会社であるりそなアセットマネジメント株式会社（以下、「当社」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）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。
また、中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和 52 年大蔵省令第 38 号）並びに同規則第 38 条及び第 57 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。
- (2) 財務諸表及び中間財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。
- (3) 当社は、金融商品取引法第 193 条の 2 第 1 項の規定に基づき、第 8 期事業年度（自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツにより監査を受け、第 9 期事業年度に係る中間会計期間（自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 年 9 月 30 日）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツにより中間監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

2023年5月22日

りそな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
業務執行社員 公認会計士 松崎 雅則

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 石坂 武嗣

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」に掲げられているりそなアセットマネジメント株式会社の2022年4月1日から2023年3月31日までの第8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、りそなアセットマネジメント株式会社の2023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。

監査人は、監査等委員会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去又は軽減するためにセーフガードを講じている場合はその内容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) 上記は、当社が、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。

独立監査人の中間監査報告書

2023年11月24日

りそな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
業務執行社員 公認会計士 松崎 雅則

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 石坂 武嗣

中間監査意見

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」に掲げられているりそな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9期事業年度の中間会計期間（2023年4月1日から2023年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間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中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、りそなアセットマネジメント株式会社の2023年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2023年4月1日から2023年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間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、中間監査の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。

中間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中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を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中間財務諸表を作成し有用な情報を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。

中間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中間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中間財務諸表の作成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。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間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、中間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中間監査の基準に従って、中間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中間財務諸表の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する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の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。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- 中間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中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示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中間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。

継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間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中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間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、中間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。

- ・ 中間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中間財務諸表の作成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中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を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、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間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中間監査上の重要な発見事項、及び中間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。

監査人は、監査等委員会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去するための対応策を講じている場合又は阻害要因を許容可能な水準にまで軽減するためのセーフガードを適用している場合はその内容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)上記は、当社が、中間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。

(1)【貸借対照表】

(単位：千円)

	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
資産の部		
流動資産		
預金	7,480,501	9,745,910
前払費用	270,287	323,722
未収入金	247	314
未収委託者報酬	972,599	948,037
未収運用受託報酬	3,009,122	2,750,484
未収投資助言報酬	507,363	479,787
流動資産計	12,240,121	14,248,255
固定資産		
有形固定資産		
建物	※1 8,415	11,556
器具備品	※1 15,450	17,947
有形固定資産計	23,866	29,503
無形固定資産		
ソフトウェア	3,919	11,002
ソフトウェア仮勘定	3,100	—
無形固定資産計	7,019	11,002
投資その他の資産		
投資有価証券	37,596	60,103
繰延税金資産	118,572	117,863
投資その他の資産計	156,168	177,967
固定資産計	187,054	218,474
資産合計	12,427,176	14,466,729

(単位：千円)

	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
負債の部		
流動負債		
未払金		
未払手数料	274,374	252,008
その他未払金	※2 1,568,028	263,623
未払費用	105,943	111,825
未払法人税等	250,779	607,485
未払消費税等	276,917	99,188
預り金	2,465	2,245
賞与引当金	253,537	265,505
流動負債計	2,732,047	1,601,882
負債合計	2,732,047	1,601,882
純資産の部		
株主資本		
資本金	1,000,000	1,000,000
資本剰余金		
資本準備金	490,000	490,000
資本剰余金計	490,000	490,000
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	8,203,810	11,375,212
利益剰余金計	8,203,810	11,375,212
株主資本計	9,693,810	12,865,212
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	1,318	△364
評価・換算差額等計	1,318	△364
純資産合計	9,695,129	12,864,847
負債・純資産合計	12,427,176	14,466,729

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)		(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬	4,788,765		4,696,038	
運用受託報酬	5,438,177		5,142,361	
投資助言報酬	982,472		952,145	
営業収益計	11,209,415		10,790,545	
営業費用				
支払手数料	1,460,131		1,210,415	
広告宣伝費	49,322		68,988	
調査費				
調査費	1,502,951		1,772,867	
委託調査費	137,291		148,470	
委託計算費	269,116		300,448	
事務委託費	23,751		26,903	
営業雑経費				
印刷費	95,519		114,901	
協会費	12,887		13,978	
販売促進費	2,277		836	
その他	64,110		70,972	
営業費用計	3,617,359		3,728,783	
一般管理費				
給料				
役員報酬	127,995		124,995	
給料・手当	1,260,284		1,361,136	
賞与	169,303		192,845	
賞与引当金繰入額	253,537		265,505	
旅費交通費	6,944		20,681	
租税公課	92,204		85,343	
不動産賃借料	99,813		113,302	
固定資産減価償却費	15,365		13,938	
諸経費	270,995		267,977	
一般管理費計	2,296,443		2,445,724	
営業利益	5,295,612		4,616,037	
営業外収益				
受取利息	—		5,137	
受取配当金	506		64	
投資有価証券売却益	866		564	
雑収入	3,244		2,431	
営業外収益計	4,617		8,198	
営業外費用				
投資有価証券売却損	—		290	
為替差損	170		64,517	
雑損失	1,455		22	
営業外費用計	1,625		64,829	
経常利益	5,298,604		4,559,406	
特別損失				
固定資産除去損	—		2,368	
特別損失計	—		2,368	

税引前当期純利益		5,298,604	4,557,038
法人税、住民税及び事業税	※1	1,632,846	1,384,185
法人税等調整額		10,297	1,450
法人税等計		1,643,143	1,385,636
当期純利益		3,655,460	3,171,401

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

(単位：千円)

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本 合計
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他 利益剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	1,000,000	490,000	490,000	4,548,350	4,548,350	6,038,350
当期変動額						
当期純利益	—	—	—	3,655,460	3,655,460	3,655,460
株主資本以外の項目 の当期変動額(純額)	—	—	—	—	—	—
当期変動額合計	—	—	—	3,655,460	3,655,460	3,655,460
当期末残高	1,000,000	490,000	490,000	8,203,810	8,203,810	9,693,810

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	1,804	1,804	6,040,155
当期変動額			
当期純利益	—	—	3,655,460
株主資本以外の項目 の当期変動額(純額)	△486	△486	△486
当期変動額合計	△486	△486	3,654,974
当期末残高	1,318	1,318	9,695,129

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本 合計
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他 利益剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	1,000,000	490,000	490,000	8,203,810	8,203,810	9,693,810
当期変動額						
当期純利益	—	—	—	3,171,401	3,171,401	3,171,401
株主資本以外の項目 の当期変動額（純額）	—	—	—	—	—	—
当期変動額合計	—	—	—	3,171,401	3,171,401	3,171,401
当期末残高	1,000,000	490,000	490,000	11,375,212	11,375,212	12,865,212

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	1,318	1,318	9,695,129
当期変動額			
当期純利益	—	—	3,171,401
株主資本以外の項目 の当期変動額（純額）	△1,682	△1,682	△1,682
当期変動額合計	△1,682	△1,682	3,169,718
当期末残高	△364	△364	12,864,847

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

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（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）を採用しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

2016年4月1日以降に取得した建物附属設備につきましては、定額法を採用しております。

その他の有形固定資産につきましては、定率法を採用しております。

なお、主な耐用年数は次のとおりであります。

建物 5～15年

器具備品 3～20年

(2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）を採用しております。

3. 引当金の計上基準

賞与引当金

従業員への業績インセンティブ給与の支払いに備えるため、従業員に対する業績インセンティブ給与の支給見込額のうち、当事業年度に帰属する額を計上しております。

4. 収益および費用の計上基準

当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行義務の内容及び当該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投資運用業（投資信託委託業）

投資信託約款に基づき、信託財産の運用指図等を行っております。

当該業務より発生する委託者報酬は、信託期間にわたり収益として認識しております。

②投資運用業（投資一任業）

投資一任契約に基づき、顧客資産を一任して運用指図等を行っております。

当該業務より発生する運用受託報酬は、契約期間にわたり収益として認識しております。

③投資助言・代理業

投資助言契約に基づき、運用に関する投資判断の助言等を行っております。

当該業務より発生する投資助言報酬は、契約期間にわたり収益として認識しております。

5. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 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

当社は、当事業年度から、連結納税制度からグループ通算制度へ移行しております。これに伴い、法人税及び地方法人税並びに税効果会計の会計処理及び開示については、「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。以下「実務対応報告第42号」という。）に従っております。また、実務対応報告第42号第32項(1)に基づき、実務対応報告第42号の適用に伴う会計方針の変更による影響はないものとみなしております。

(会計方針の変更)

(時価の算定に関する会計基準等の適用)

「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。以下「時価算定会計基準適用指針」という。)を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準適用指針が定める新たな会計方針を将来にわたって適用することといたしました。これによる当財務諸表に与える影響はありません。また、「金融商品関係」注記において、金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項等の注記を行うことといたしました。

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

	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
建物	2,073千円	2,865千円
器具備品	32,416千円	40,455千円

※2 関係会社に対する資産及び負債

	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
流動負債		
その他未払金	1,311,908千円	—

(注) 当該金額は、連結納税親会社と受払いする金額であります。

(損益計算書関係)

※1 関係会社に対する主な取引

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
法人税、住民税及び事業税	1,311,417千円	—

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当期首	増加	減少	当期末
普通株式(株)	3,960,000	—	—	3,960,000

2. 配当に関する事項

該当事項はありません。

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当期首	増加	減少	当期末
普通株式(株)	3,960,000	—	—	3,960,000

2. 配当に関する事項

該当事項はありません。

(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

資金運用については、短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

当社の営業債権である未収委託者報酬は、投資信託約款に基づき、信託財産から委託者に支払われる信託報酬の未払金額であります。当該信託財産は、受託者である信託銀行により適切に分別管理され、信託法により受託者の倒産の影響を受けません。そのため、当該金銭債権に関する信用リスクはありません。

未収運用受託報酬は、顧客の信用リスクに晒されており、運用受託先毎に期日管理および残高管理を行うとともに、四半期毎に回収可能性を把握する体制としております。

未収投資助言報酬は、顧客の信用リスクに晒されており、投資助言先毎に期日管理および残高管理を行うとともに、四半期毎に回収可能性を把握する体制としております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、未収投資助言報酬、未払手数料、その他未払金は短期間で決済されるため時価が帳簿価額に近似することから、注記を省略しております。

前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

(単位：千円)

	貸借対照表 計上額	時価	差額
投資有価証券	37,596	37,596	—
資産計	37,596	37,596	—

(注) 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

	1年以内 (千円)	1年超 5年以内 (千円)	5年超 10年以内 (千円)	10年超 (千円)
投資有価証券 その他有価証券のうち満期 があるもの その他	—	19,725	2,959	—
合計	—	19,725	2,959	—

当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

(単位：千円)

	貸借対照表 計上額	時価	差額
投資有価証券	60,103	60,103	—
資産計	60,103	60,103	—

(注) 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

	1年以内 (千円)	1年超 5年以内 (千円)	5年超 10年以内 (千円)	10年超 (千円)
投資有価証券 その他有価証券のうち満期 があるもの その他	—	34,625	1,996	—
合計	—	34,625	1,996	—

3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

金融商品の時価を、時価の算定に用いた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。

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：千円）

区分	時価			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
投資有価証券 投資信託	—	37,596	—	37,596
資産計	—	37,596	—	37,596

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：千円）

区分	時価			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
投資有価証券 投資信託	—	60,103	—	60,103
資産計	—	60,103	—	60,103

(有価証券関係)

1. その他有価証券

前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

(単位: 千円)

	種類	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	(1)株式	—	—	—
	(2)債券	—	—	—
	(3)その他	17,169	14,100	3,069
	小計	17,169	14,100	3,069
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	(1)株式	—	—	—
	(2)債券	—	—	—
	(3)その他	20,427	21,596	△1,169
	小計	20,427	21,596	△1,169
合計		37,596	35,696	1,900

当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

(単位: 千円)

	種類	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	(1)株式	—	—	—
	(2)債券	—	—	—
	(3)その他	29,229	26,990	2,239
	小計	29,229	26,990	2,239
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	(1)株式	—	—	—
	(2)債券	—	—	—
	(3)その他	30,874	33,639	△2,764
	小計	30,874	33,639	△2,764
合計		60,103	60,629	△525

2. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：千円）

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
投資信託	7,866	866	—
合計	7,866	866	—

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：千円）

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
投資信託	9,274	564	290
合計	9,274	564	290

（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 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
繰延税金資産		
賞与引当金	77,607千円	81,271千円
未払事業所税	1,363千円	1,628千円
未払事業税	36,333千円	31,451千円
未確定債務	757千円	961千円
減価償却超過額	3,090千円	2,390千円
その他有価証券評価差額金	357千円	846千円
繰延税金資産小計	119,511千円	118,549千円
評価性引当額	—	—
繰延税金資産合計	119,511千円	118,549千円
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	939千円	685千円
繰延税金負債合計	939千円	685千円
繰延税金資産の純額	118,572千円	117,863千円

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要な項目別の内訳

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

法定実効税率	30.61%
（調整）	
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.02%
住民税均等割	0.07%
その他	0.31%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	<u>31.01%</u>

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

法定実効税率	30.61%
（調整）	
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.04%
住民税均等割	0.08%
その他	<u>△0.32%</u>
税効果会計適用後の法人税等の負担率	<u>30.41%</u>

(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

収益認識に関する注記における開示目的に照らし、定量面・定性面の両面において収益の分解情報を記載する重要性が乏しいため、記載を省略しております。

2. 収益を理解するための基礎となる情報

(重要な会計方針)の「4. 収益および費用の計上基準」に記載のとおりであります。

3. 当事業年度及び翌事業年度以降の収益の金額を理解するための情報

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)

前事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1. セグメント情報

当社は、「資産運用業」の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

単一の商品・サービスの区分の外部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) 地域ごとの情報

① 営業収益

本邦の外部顧客へ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。

なお、営業収益の地域区分は、契約相手方の所在地(ファンドの場合は組成地)を基礎として分類しております。

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

(単位:千円)

顧客の名称又は氏名	営業収益額
株式会社りそな銀行	5,964,710

3. 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。

4. 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。

5. 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。

当事業年度（自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日）

1. セグメント情報

当社は、「資産運用業」の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

単一の商品・サービスの区分の外部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) 地域ごとの情報

①営業収益

本邦の外部顧客へ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。

なお、営業収益の地域区分は、契約相手方の所在地（ファンドの場合は組成地）を基礎として分類しております。

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

(単位：千円)

顧客の名称又は氏名	営業収益額
株式会社りそな銀行	5,545,681

3. 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。

4. 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。

5. 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)

前事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(1) 親会社及び主要株主(会社等に限る)等

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は 出資金 (百万円)	事業の 内容	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 (千円)	科目	期末残高 (千円)
親会社	株式会社 りそなホール ディングス	東京都 江東区	50,552	持株会社 としての 経営管理	(直接) 100%	連結納税	連結納税 に係る 個別帰属額 (注1)	1,311,417	その他 未払金	1,311,908

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 連結納税制度に基づく連結法人税の支払予定額であります。

(2) 兄弟会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は 出資金 (百万円)	事業の 内容	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 (千円)	科目	期末残高 (千円) (注4)
親会社 の 子会社	株式会社 りそな銀行	大阪市 中央区	279,928	銀行業務 及び 信託業務	—	投資信託の 販売委託 投資助言 投資一任	運用受託 報酬 (注1)	5,202,291	未収運用 受託報酬	2,880,437
							投資助言 報酬 (注2)	762,418	未収投資 助言報酬	
							支払手数料 (注3)	922,420	未払 手数料	

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 投資一任の収益については、一般取引条件を勘案した個別契約に基づき決定しております。

(注2) 投資助言の収益については、一般取引条件を勘案した個別契約に基づき決定しております。

(注3) 投資信託の販売委託については、一般取引条件を基に、協議のうえ決定しております。

(注4) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には消費税等が含まれております。

2. 親会社に関する注記

親会社情報

株式会社りそなホールディングス(東京証券取引所に上場)

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

1. 関連当事者との取引

(1) 兄弟会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は 出資金 (百万円)	事業の 内容	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 (千円)	科目	期末残高 (千円) (注4)
親会社 の 子会社	株式会社 りそな銀行	大阪市 中央区	279,928	銀行業務 及び 信託業務	—	投資信託の 販売委託 投資助言 投資一任	運用受託 報酬 (注1)	4,790,900	未収運用 受託報酬	2,557,553
							投資助言 報酬 (注2)	754,781	未収投資 助言報酬	410,936
							支払手数料 (注3)	801,950	未払 手数料	161,752

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 投資一任の収益については、一般取引条件を勘案した個別契約に基づき決定しております。

(注2) 投資助言の収益については、一般取引条件を勘案した個別契約に基づき決定しております。

(注3) 投資信託の販売委託については、一般取引条件を基に、協議のうえ決定しております。

(注4) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には消費税等が含まれております。

2. 親会社に関する注記

親会社情報

株式会社りそなホールディングス（東京証券取引所に上場）

(1株当たり情報)

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
1株当たり純資産額	2,448円26銭	3,248円70銭
1株当たり当期純利益金額又は 1株当たり当期純損失(△)	923円09銭	800円86銭

なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

(注) 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 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
当期純利益又は当期純損失(△)(千円)	3,655,460	3,171,401
普通株主に帰属しない金額(千円)	—	—
普通株式に係る当期純利益又は 当期純損失(△)(千円)	3,655,460	3,171,401
普通株式の期中平均株式数(株)	3,960,000	3,960,000

(重要な後発事象)

前事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

該当事項はありません。

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

第9期中間会計期間
(2023年9月30日現在)

資産の部		
流動資産		
預金		11,392,118
前払費用		291,608
未収入金		251
未収委託者報酬		1,022,391
未収運用受託報酬		3,062,606
未収投資助言報酬		512,845
流動資産計		16,281,821
固定資産		
有形固定資産		
建物	※1	10,888
器具備品	※1	33,344
有形固定資産計		44,233
無形固定資産		
ソフトウェア		9,869
無形固定資産計		9,869
投資その他の資産		
投資有価証券		89,922
繰延税金資産		118,642
投資その他の資産計		208,565
固定資産計		262,668
資産合計		16,544,489

(単位：千円)

第9期中間会計期間
(2023年9月30日現在)

負債の部		
流動負債		
未払金		
未払手数料		280,368
その他未払金		289,518
未払費用		119,676
未払法人税等		826,250
未払事業所税		2,948
未払消費税等	※2	154,937
賞与引当金		237,686
預り金		3,663
流動負債計		1,915,050
負債合計		1,915,050
純資産の部		
株主資本		
資本金		1,000,000
資本剰余金		
資本準備金		490,000
資本剰余金計		490,000
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		13,139,895
利益剰余金計		13,139,895
株主資本計		14,629,895
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		△457
評価・換算差額等計		△457
純資産合計		14,629,438
負債・純資産合計		16,544,489

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

第9期中間会計期間
(自 2023年4月1日
至 2023年9月30日)

営業収益		
委託者報酬		2,518,468
運用受託報酬		2,815,890
投資助言報酬		496,965
営業収益計		5,831,324
営業費用		
支払手数料		674,254
広告宣伝費		43,924
調査費		
調査費		951,111
委託調査費		58,686
委託計算費		156,106
事務委託費		15,858
営業雑経費		
印刷費		49,541
協会費		11,299
販売促進費		3,106
その他		41,911
営業費用計		2,005,801
一般管理費		
給料		
役員報酬		65,850
給料・手当		721,614
賞与		38,705
賞与引当金繰入額		237,686
旅費交通費		17,917
租税公課		48,115
不動産賃借料		61,403
固定資産減価償却費	※1	7,832
諸経費		142,791
一般管理費計		1,341,918
営業利益		2,483,604
営業外収益		
受取利息		5,080
受取配当金		58
投資有価証券売却益		2,000
為替差益		55,163
雑収入		1,103
営業外収益計		63,405
営業外費用		
投資有価証券売却損		15
雑損失		0
営業外費用計		15
経常利益		2,546,994
税引前中間純利益		2,546,994
法人税、住民税及び事業税		783,049
法人税等調整額		△738
法人税等計		782,311
中間純利益		1,764,683

(3) 中間株主資本等変動計算書

第9期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

(単位：千円)

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本 合計
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他 利益剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	1,000,000	490,000	490,000	11,375,212	11,375,212	12,865,212
当中間期変動額	-	-	-	-	-	-
当中間純利益	-	-	-	1,764,683	1,764,683	1,764,683
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)	-	-	-	-	-	-
当中間期変動額合計	-	-	-	1,764,683	1,764,683	1,764,683
当中間期末残高	1,000,000	490,000	490,000	13,139,895	13,139,895	14,629,895

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	△364	△364	12,864,847
当中間期変動額	-	-	-
当中間純利益	-	-	1,764,683
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)	△92	△92	△92
当中間期変動額合計	△92	△92	1,764,590
当中間期末残高	△457	△457	14,629,438

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

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（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）を採用しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

2016年4月1日以降に取得した建物附属設備につきましては、定額法を採用しております。

その他の有形固定資産につきましては、定率法を採用しております。

なお、主な耐用年数は次のとおりであります。

建物 5～15年

器具備品 3～20年

(2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）を採用しております。

3. 引当金の計上基準

賞与引当金

従業員への業績インセンティブ給与の支払いに備えるため、従業員に対する業績インセンティブ給与の支給見込額のうち、当中間会計期間に帰属する額を計上しております。

4. 収益および費用の計上基準

当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行義務の内容及び当該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投資運用業（投資信託委託業）

投資信託約款に基づき、信託財産の運用指図等を行っております。

当該業務より発生する委託者報酬は、信託期間にわたり収益として認識しております。

②投資運用業（投資一任業）

投資一任契約に基づき、顧客資産を一任して運用指図等を行っております。

当該業務より発生する運用受託報酬は、契約期間にわたり収益として認識しております。

③投資助言・代理業

投資助言契約に基づき、運用に関する投資判断の助言等を行っております。

当該業務より発生する投資助言報酬は、契約期間にわたり収益として認識しております。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

※1 有形固定資産の減価償却累計額

第9期中間会計期間 (2023年9月30日)	
建物	3,533千円
器具備品	45,605千円

※2 消費税等の取扱い

仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。

(中間損益計算書関係)

※1 減価償却実施額は、次のとおりであります。

第9期中間会計期間 (2023年9月30日)	
有形固定資産	5,817千円
無形固定資産	2,015千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第9期中間会計期間(自2023年4月1日至2023年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当中間会計期間末
普通株式(株)	3,960,000	-	-	3,960,000

2. 配当に関する事項

該当事項はありません。

(金融商品関係)

1. 金融商品の時価等に関する事項

中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、未収投資助言報酬、未払手数料、その他未払金は短期間で決済されるため時価が帳簿価額に近似することから、注記を省略しております。

第9期中間会計期間(2023年9月30日現在)

(単位:千円)

	中間貸借対照表 計上額	時価	差額
投資有価証券	89,922	89,922	-
資産計	89,922	89,922	-

2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

金融商品の時価を、時価の算定に用いた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。

(単位：千円)

区分	時価			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
投資有価証券 投資信託	—	89,922	—	89,922
資産計	—	89,922	—	89,922

(有価証券関係)

1. その他有価証券

第9期中間会計期間（2023年9月30日現在）

(単位：千円)

	種類	中間貸借対照表 計上額	取得原価	差額
中間貸借対照表計上額が取得 原価を超えるもの	(1) 株式	—	—	—
	(2) 債券	—	—	—
	(3) その他	26,571	23,986	2,585
	小計	26,571	23,986	2,585
中間貸借対照表計上額が取得 原価を超えないもの	(1) 株式	—	—	—
	(2) 債券	—	—	—
	(3) その他	63,350	66,595	△3,244
	小計	63,350	66,595	△3,244
資産計		89,922	90,581	△658

(収益認識関係)

収益認識に関する注記における開示目的に照らし、定量面・定性面の両面において収益の分解情報を記載する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)

第9期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

1. セグメント情報

当社は、「資産運用業」の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

単一の商品・サービスの区分の外部顧客からの営業収益が中間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

本邦の外部顧客への営業収益が中間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。

なお、営業収益の地域区分は、契約相手方の所在地（ファンドの場合は組成地）を基礎として分類しております。

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中間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

(単位：千円)

顧客の名称又は氏名	営業収益額
株式会社りそな銀行	3,013,395

3. 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。

4. 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。

5. 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。

(1株当たり情報)

	第9期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)
1株当たり純資産額	3,694円30銭
1株当たり中間純利益金額	445円63銭

(注) 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は以下のとおりであります。

	第9期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)
中間純利益 (千円)	1,764,683
普通株主に帰属しない金額 (千円)	—
普通株式に係る中間純利益 (千円)	1,764,683
普通株式の期中平均株式数 (株)	3,960,000

(重要な後発事象)

第9期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

該当事項はありません。

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) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (2) 運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれが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（4）、（5）において同じ。）または子法人等（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または金融デリバティブ取引を行なうこと。
- (4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行な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なうことを内容とした運用を行なうこと。
- (5) 上記（3）、（4）に掲げるもののほか、委託会社の親法人等また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、また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、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項
該当事項はありません。
- (2) 訴訟事件その他の重要事項
委託会社に重要な影響を与えた事実、または与えると予想される訴訟事件などは発生していません。

追加型証券投資信託

九州SDGs・グローバルバランス

約 款

りそなアセットマネジメント株式会社

運用の基本方針

約款第 18 条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、安定した収益の確保と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

RM国内債券マザーファンド(九州重視型)、RM米ドル建SDGs債券マザーファンド(為替ヘッジあり)、RMユーロ建SDGs債券マザーファンド(為替ヘッジあり)、RM新興国債券マザーファンド、RM国内株式ESGマザーファンド、RM先進国株式ESGマザーファンド、RM新興国株式マザーファンド、RM国内リートマザーファンド、RM先進国リートマザーファンド(以下、各々を「マザーファンド」といいます。)の各受益証券を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

- ① 主として、各マザーファンド受益証券への投資を通じ、実質的に国内、先進国および新興国の債券・株式ならびに国内および先進国の不動産投資信託証券(リート)等への分散投資を行います。また、株価指数先物取引、債券先物取引、不動産投信指数先物取引、ETF(上場投資信託証券)等を利用することがあります。
- ② 各マザーファンド受益証券への投資比率は、信託財産の中長期的な成長を目的に独自の定量モデルにて算出した基本的資産配分比率に基づき決定します。また、基本的資産配分比率は原則として年1回程度見直します。
- ③ 実質組入外貨建資産については、一部為替ヘッジを行います。
- ④ 各マザーファンド受益証券への投資比率の合計は、原則として高位を保ちますが、市場環境等を勘案して、投資比率を引き下げる場合があります。
- ⑤ 資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

- ① 株式への実質投資割合には、制限を設けません。
- ② 新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。
- ③ 投資信託証券(マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ④ 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

- ⑤ デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。
- ⑥ 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- ⑦ 一般社団法人投資信託協会規則に規定す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およびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

3. 収益分配方針

原則として毎決算時に以下の収益分配方針に基づいて分配を行います。

- ① 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。
- ② 原則として、基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配金額を決定します。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。
- ③ 留保益は、運用の基本方針に基づいて運用します。

追加型証券投資信託
九州SDGs・グローバルバランス
約 款

(信託の種類、委託者および受託者、信託事務の委託)

第 1 条 この信託は、証券投資信託であり、りそなアセットマネジメント株式会社を委託者とし、株式会社りそな銀行を受託者とします。

- ② この信託は、信託法（平成 18 年法律第 108 号）（以下「信託法」といいます。）の適用を受けません。
- ③ 受託者は、信託法第 28 条第 1 号に基づく信託事務の委託として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第 1 条第 1 項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関（受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第 2 条第 1 項にて準用する信託業法第 29 条第 2 項第 1 号に規定する利害関係人をいいます。以下本条、第 17 条第 1 項、同条第 2 項および第 30 条において同じ。）を含みます。）と信託契約を締結し、これを委託することができます。
- ④ 前項における利害関係人に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行うものとします。

(信託の目的および金額)

第 2 条 委託者は、金 1,000 億円を上限として受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けます。

(信託金の限度額)

第 3 条 委託者は、受託者と合意のうえ、1 兆円を限度として信託金を追加することができます。

- ② 委託者は、受託者と合意のうえ、前項の限度額を変更することができます。

(信託期間)

第 4 条 この信託の期間は、信託契約締結日から第 48 条第 1 項、第 49 条第 1 項、第 50 条第 1 項および第 52 条第 2 項の規定による信託終了日までとします。

(受益権の取得申込の勧誘の種類)

第 5 条 この信託にかかる受益権の取得申込の勧誘は、金融商品取引法第 2 条第 3 項第 1 号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第 2 条第 8 項で定める公募により行われます。

(当初の受益者)

第 6 条 この信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、次条の規定により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

(受益権の分割および再分割)

第 7 条 委託者は、第 2 条の規定による受益権については 1,000 億口を上限として、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第 8 条第 1 項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

- ② 委託者は、受託者と協議のうえ、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）に定めるところに従い、一定日現在の受益権を均等に再分割できます。

（追加信託の価額および口数、基準価額の計算方法）

第 8 条 追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に、当該追加信託にかかる受益権の口数を乗じた額とします。

- ② この約款において基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価または一部償却原価法により評価して得た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口数で除した金額をいいます。
- ③ 外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）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ます。
- ④ 第 28 条に規定する予約為替の評価は、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るものとします。

（信託日時異なる受益権の内容）

第 9 条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

（受益権の帰属と受益証券の不発行）

第 10 条 この信託のすべての受益権は、社振法の規定の適用を受け、受益権の帰属は、委託者があらかじめこの信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第 2 条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第 2 条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。

- ② 委託者は、この信託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また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。なお、受益者は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。
- ③ 委託者は、第 7 条の規定により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また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ます。振

替機関等は、委託者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または記録を行います。

(受益権の設定にかかる受託者の通知)

第 11 条 受託者は、信託契約締結日に生じた受益権については信託契約締結時に、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行います。

(受益権の申込単位および価額)

第 12 条 委託者の指定する第一種金融商品取引業者（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をいいます。）および登録金融機関（金融商品取引法第 2 条第 11 項に規定する登録金融機関をいいます。）（以下総称して「指定販売会社」といいます。）は、第 7 条第 1 項の規定により分割される受益権の取得申込者に対し、指定販売会社が定める単位をもって取得の申込に応じることができます。ただし、指定販売会社と別に定める自動けいぞく投資約款に従い契約（以下「別に定める契約」といいます。）を結んだ取得申込者に限り、1 口の整数倍をもって取得の申込に応じることができるものとします。

- ② 前項の取得申込者は指定販売会社に、取得申込と同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたこの信託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かかる口数の増加の記載または記録が行われます。なお、指定販売会社は、当該取得申込の代金（第 4 項の受益権の価額に当該取得申込の口数を乗じて得た額をいいます。）の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。
- ③ 第 1 項の規定にかかわらず、指定販売会社は、別に定める日のいずれかに該当する日においては、受益権の取得申込の受付を行いません。
- ④ 第 1 項の受益権の価額は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に指定販売会社がそれぞれ独自に定める手数料ならびに当該手数料にかかる消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、この信託契約締結日前の取得申込にかかる受益権の価額は、1 口につき 1 円に、指定販売会社がそれぞれ独自に定める手数料および当該手数料にかかる消費税等に相当する金額を加算した価額とします。
- ⑤ 前項の規定にかかわらず、受益者が別に定め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価額は、原則として、第 38 条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。
- ⑥ 前各項の規定にかかわらず、委託者は、金融商品取引所（金融商品取引法第 2 条第 16 項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第 2 条第 8 項第 3 号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。）等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更および規制の導入、自然災害、クーデター、重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖

または流動性の極端な減少ならびに資金の受渡しに関する障害等)が発生し、委託者が追加設定を制限する措置をとった場合には、受益権の取得申込の受付を中止することができるほか、すでに受け付けた取得申込を取消することができるものとします。

(受益権の譲渡にかかる記載または記録)

第13条 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または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。

② 前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少およ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または記録するものとします。ただし、前項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または記録が行われるよう通知するものとします。

③ 委託者は、第1項に規定する振替について、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかか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、委託者が必要と認めるときまた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)

第14条 受益権の譲渡は、前条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

(投資の対象とする資産の種類)

第15条 この信託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。

1. 次に掲げる特定資産(投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。)

イ. 有価証券

ロ. デリバティブ取引にかかる権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第21条、第22条、第23条および第24条に定めるものに限りません。)

ハ. 約束手形(イ.に掲げるものに該当するものを除きます。)

ニ. 金銭債権(イ.、ロ. およびハ. に掲げるものに該当するものを除きます。)

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

(有価証券および金融商品の指図範囲等)

第16条 委託者は、信託金を、主として、りそなアセットマネジメント株式会社を委託者とし、株式会社りそな銀行を受託者として締結された親投資信託である「RM国内債券マザーファンド(九

州重視型)」、「RM米ドル建SDGs債券マザーファンド(為替ヘッジあり)」、「RMユーロ建SDGs債券マザーファンド(為替ヘッジあり)」、「RM新興国債券マザーファンド」、「RM国内株式ESGマザーファンド」、「RM先進国株式ESGマザーファンド」、「RM新興国株式マザーファンド」、「RM国内リートマザーファンド」および「RM先進国リートマザーファンド」(以下総称して「マザーファンド」といいます。)の受益証券、ならびに次の有価証券(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することができます。

1. 株券または新株引受権証券
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と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. 特定目的会社にかかる特定社債券(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かかる優先出資証券(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. 特定目的会社にかかる優先出資証券また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。)および新株予約権証券
12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
13. 投資信託また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、新投資口予約権証券、投資法人債券または外国投資証券(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または証書(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、有価証券にかかるものに限りません。)

17. 預託証券（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券
19. 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）
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. 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって第19号の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

なお、第1号の証券または証書ならびに第12号および第17号の証券または証書のうち第1号の証券また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号までの証券ならびに第14号の証券のうち投資法人債券ならびに第12号および第17号の証券または証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第13号の証券および第14号の証券（新投資口予約権証券および投資法人債券を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

- ② 委託者は、信託金を、前項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
- ③ 第1項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときには、委託者は、信託金を、前項に掲げる金融商品により運用することを指図することができます。
- ④ 委託者は、信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、取得時において信託財産の純資産総額の20%を超えることとなる投資の指図をしません。
- ⑤ 委託者は、信託財産に属する投資信託証券（マザーファンドの受益証券および金融商品取引所に上場等され、かつ当該取引所において常時売却可能（市場急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。）な投資信託証券（以下「上場投資信託証券」といいます。）を除きます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券（上場投資信託証券を

除きます。)の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の5%を超えることとなる投資の指図をしません。

- ⑥ 前2項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(利害関係人等との取引等)

第17条 受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、信託財産と、受託者（第三者との間において信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託者が当該第三者の代理人となつて行うものを含みます。）および受託者の利害関係人、第30条第1項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、第15条、第16条第1項および同条第2項に掲げる資産への投資等ならびに第20条から第24条まで、第26条、第28条、第33条から第35条までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことができます。

- ② 受託者は、受託者がこの信託の受託者としての権限に基づいて信託事務の処理として行うことができる取引その他の行為について、受託者または受託者の利害関係人の計算で行うことができます。なお、受託者の利害関係人が当該利害関係人の計算で行う場合も同様とします。

- ③ 委託者は、金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、信託財産と委託者、その取締役、執行役および委託者の利害関係人等（金融商品取引法第31条の4第3項および同条第4項に規定する親法人等または子法人等をいいます。）または委託者が運用の指図を行う他の信託財産との間で、第15条、第16条第1項および同条第2項に掲げる資産への投資等ならびに第20条から第24条まで、第26条、第28条、第33条から第35条までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことの指図をすることができ、受託者は、委託者の指図により、当該投資等ならびに当該取引、当該行為を行うことができます。

- ④ 前3項の場合、委託者および受託者は、受益者に対して信託法第31条第3項および同法第32条第3項の通知は行いません。

(運用の基本方針)

第18条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針に従って、その指図を行います。

(投資する株式等の範囲)

第19条 委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所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、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

- ② 前項の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとします。

(信用取引の指図範囲)

第 20 条 委託者は、信託財産に属する資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、当該売付けの決済については、株券の引渡しまた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。

- ② 前項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の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. 信託財産に属する株券およ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. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（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 号および第 8 号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限り。）の行使により取得可能な株券
 6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券およ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

(先物取引等の運用指図)

第 21 条 委託者は、わが国の金融商品取引所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。）およ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。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。

- ② 委託者は、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。

- ③ 委託者は、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

(スワップ取引の運用指図)

第 22 条 委託者は、異なった通貨、異なった受取金利また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。）を行うことの指図をすることができます。

- ② スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として、第 4 条に定める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。
- ③ スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。
- ④ 委託者は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

(金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図)

第 23 条 委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

- ② 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として、第 4 条に定める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。
- ③ 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。
- ④ 委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

(直物為替先渡取引の運用指図)

第 24 条 委託者は、直物為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

- ② 直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として、第 4 条に定める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。
- ③ 直物為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。
- ④ 委託者は、直物為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

(デリバティブ取引等にかかる投資制限)

第 25 条 委託者は、デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に従い、合理的な方法により算出した額が、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。

(有価証券の貸付けの指図および範囲)

第 26 条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式、公社債および投資信託証券を次の各号の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。

1. 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、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。
 2. 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、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。
 3. 投資信託証券の貸付けは、貸付時点において、貸付投資信託証券の時価合計額が、信託財産で保有する投資信託証券の時価合計額を超えないものとします。
- ② 前項各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は、すみ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。
- ③ 委託者は、有価証券の貸付けにあ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。

(特別の場合の外貨建有価証券への投資制限)

第 27 条 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。

(外国為替予約取引の指図および範囲)

第 28 条 委託者は、信託財産に属する外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

(信用リスク集中回避のための投資制限)

第 29 条 一般社団法人投資信託協会規則に規定す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およびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に 10%、合計で 20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

(信託業務の委託等)

第 30 条 受託者は、委託者と協議のうえ、信託業務の一部について、信託業法第 22 条第 1 項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合するもの（受託者の利害関係人を含みます。）を委託先として選定します。

1. 委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと
2. 委託先の委託業務にかかる実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること

3. 委託される信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行う体制が整備されていること
 4. 内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること
- ② 受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。
 - ③ 前2項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務を、受託者および委託者が適当と認める者（受託者の利害関係人を含みます。）に委託することができるものとします。
 1. 信託財産の保存にかかる業務
 2. 信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務
 3. 委託者のみの指図により信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為にかかる業務
 4. 受託者が行う業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

（混蔵寄託）

第31条 金融機関または第一種金融商品取引業者（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およ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。以下本条において同じ。）から、売買代金およ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またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または第一種金融商品取引業者が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または第一種金融商品取引業者の名義で混蔵寄託できるものとします。

（信託財産の登記等および記載等の留保等）

- 第32条 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。
- ② 前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、すみやかに登記または登録をするものとします。
 - ③ 信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載また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、受託者が認める場合は、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。
 - ④ 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。

（一部解約の請求および有価証券売却等の指図）

第33条 委託者は、信託財産に属するマザーファンドの受益証券にかかる信託契約の一部解約の請求および信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

(再投資の指図)

第 34 条 委託者は、前条の規定による一部解約代金および売却代金、有価証券にかかる償還金等、株式の清算分配金、有価証券等にかかる利子等、株式の配当金ならびにその他の収入金を再投資することの指図ができます。

(資金の借入れ)

第 35 条 委託者は、信託財産の効率的な運用なら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入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。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。

- ② 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から、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、または解約代金の入金日までの間、もしくは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、解約代金および償還金の合計額を限度とします。
- ③ 収益分配金の再投資にかかる借入期間は、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。
- ④ 借入金の利息は信託財産中から支弁します。

(損益の帰属)

第 36 条 委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

(受託者による資金の立替え)

第 37 条 信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

- ② 信託財産に属する有価証券にかかる償還金等、株式の清算分配金、有価証券等にかかる利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。
- ③ 前 2 項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

(信託の計算期間)

第 38 条 この信託の計算期間は、毎年 7 月 21 日から翌年 7 月 20 日までとします。ただし、第 1 計算期間は、2021 年 11 月 18 日から 2022 年 7 月 20 日までとします。最終計算期間の終了日は、第 4 条に定める信託期間の終了日とします。

- ② 前項の規定にかかわらず、前項の規定により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日の場合には、各計算期間終了日は該当日の翌営業日とし、その翌日から

次の計算期間が開始されるものとします。

(信託財産に関する報告等)

第 39 条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

- ② 受託者は、信託終了のときに最終計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。
- ③ 受託者は、前 2 項の報告を行うことにより、受益者に対する信託法第 37 条第 3 項に定める報告は行わないこととします。
- ④ 受益者は、受託者に対し、信託法第 37 条第 2 項に定める書類または電磁的記録の作成に欠くことのできない情報その他の信託に関する重要な情報および当該受益者以外の者の利益を害するおそれのない情報を除き、信託法第 38 条第 1 項に定める閲覧または謄写の請求をすることはできないものとします。

(信託事務の諸費用および監査費用)

第 40 条 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立替えた立替金の利息(以下「諸経費」といいます。)は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

- ② 信託財産にかかる監査費用および当該監査費用にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、毎計算期間の最初の 6 ヶ月終了日(当該終了日が休業日の場合は翌営業日)、および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁します。
- ③ 信託財産に属する有価証券等に関連して発生した訴訟係争物たる権利その他の権利に基づいて益金が生じた場合、当該支払いに際して特別に必要となる費用(データ処理費用、郵送料等)は、受益者の負担とし、当該益金から支弁します。
- ④ その他諸費用(法律・税務顧問への報酬、法定書類の作成・印刷・交付費用、公告費用等)および当該諸費用にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁することができます。

(信託報酬等の額および支弁の方法)

第 41 条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第 38 条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年 1.0%の率を乗じて得た額とし、委託者と受託者との間の配分は別に定めます。

- ② 前項の信託報酬は、毎計算期間の最初の 6 ヶ月終了日(当該終了日が休業日の場合は翌営業日)、および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁します。
- ③ 第 1 項の信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

(収益の分配方式)

第 42 条 信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1. 配当金、利子、貸付有価証券にかかる品貸料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、監査費用、当該監査費用にかかる消費税等に相当する金額、その他諸費用、当該諸費用にかかる消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除した後、その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
2. 売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、監査費用、当該監査費用にかかる消費税等に相当する金額、その他諸費用、当該諸費用にかかる消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

② 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰越します。

（収益分配金、償還金および一部解約金の支払い）

第 43 条 収益分配金は、毎計算期間終了日後 1 ヶ月以内の委託者の指定する日から、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末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指定販売会社の名義で記載また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なります。）に支払います。

② 前項の規定にかかわらず、別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に収益分配金が指定販売会社に支払われます。この場合、指定販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の取得の申込に応じるものとします。当該取得申込により増加した受益権は、第 10 条第 3 項の規定に従い、振替口座簿に記載または記録されます。

③ 償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）は、信託終了日後 1 ヶ月以内の委託者の指定する日から、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（信託終了日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該信託終了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指定販売会社の名義で記載また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なります。）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引き換えに、当該償還にかか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または記録が行われます。

- ④ 一部解約金は、一部解約請求受付日から起算して、原則として、5 営業日目から受益者に支払います。
- ⑤ 前各項（第 2 項を除きます。）に規定する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、指定販売会社の営業所等において行うものとします。
- ⑥ 収益分配金、償還金および一部解約金にかかる収益調整金（所得税法施行令第 27 条の規定によるものとし、受益者ごとの信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。）は、原則として、受益者ごとの信託時の受益権の価額等（原則として、受益者ごとの信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。）に応じて計算されるものとします。

（収益分配金、償還金および一部解約金の払い込みと支払いに関する受託者の免責）

第 44 条 受託者は、収益分配金については原則として毎計算期間終了日の翌営業日までに、償還金については、前条第 3 項に規定する支払開始日までに、一部解約金については前条第 4 項に規定する支払開始日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

- ② 受託者は、前項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

（収益分配金および償還金の時効）

第 45 条 受益者が、収益分配金については第 43 条第 1 項に規定する支払開始日から 5 年間その支払いを請求しないときならびに信託終了による償還金については第 43 条第 3 項に規定する支払開始日から 10 年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

（信託契約の一部解約）

第 46 条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、指定販売会社が定める単位（別に定める契約にかかる受益権については、1 口の整数倍とします。）をもって、委託者に一部解約請求をすることができます。

- ② 委託者は、前項の一部解約請求を受け付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。ただし、委託者は、別に定める日のいずれかに該当する日においては、一部解約請求の受付を行いません。なお、前項の一部解約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かかるこの信託契約の一部解約を委託者が行うのと引き換えに、当該一部解約にかか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または記録が行われます。
- ③ 前項の一部解約の価額は、一部解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。
- ④ 受益者が第 1 項の一部解約請求をするときは、指定販売会社に対し、振替受益権をもって行う

ものとしします。

- ⑤ 委託者は、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、決済機能の停止その他やむを得ない事情（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更および規制の導入、自然災害、クーデター、重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖または流動性の極端な減少ならびに資金の受渡しに関する障害等）が発生した場合には、第1項による一部解約請求の受付を中止することおよびすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受け取りを中止することができます。
- ⑥ 前項により一部解約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請求を撤回することができます。ただし、受益者がその一部解約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請求を受け付けたものとして、第3項の規定に準じて算出した価額とします。

（質権口記載または記録の受益権の取扱い）

第47条 振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約請求の受付、一部解約金および償還金の支払い等については、この約款によるほか、民法その他の法令等に従って取り扱われます。

（信託契約の解約）

第48条 委託者は、信託期間中において、信託財産の純資産総額が20億円を下回ることとなったとき、この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ときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

- ② 委託者は、前項の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由等の事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託契約にかか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。
- ③ 前項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の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かかる受益者としての受託者を除きます。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、この信託契約にかかる知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- ④ 第2項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以上にあたる多数をもって行います。
- ⑤ 第2項から前項までの規定は、委託者が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約にかかるすべての受益者が書面また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、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、第2項から前項までの手続を行うことが困難な場合も同じとします。

(信託契約に関する監督官庁の命令)

第49条 委託者は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、信託契約を解約し信託を終了させます。

- ② 委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、第53条の規定に従います。

(委託者の登録取消等に伴う取扱い)

第50条 委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

- ② 前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第53条の書面決議で否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

(委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い)

第51条 委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

- ② 委託者は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

(受託者の辞任および解任に伴う取扱い)

第52条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に違反して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、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を申立てることができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第53条の規定に従い、新受託者を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託者を解任することはできないものとします。

- ② 委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

(信託約款の変更等)

第53条 委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は本条に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

- ② 委託者は、前項の事項（前項の変更事項にあつては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、前項の併合事項にあつては、その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。以下「重大な信託約款の変更等」といいます。）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、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由等の事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託約款にかか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。
- ③ 前項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の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かかる受益者としての受託者を除きます。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、この信託約款にかかる知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- ④ 第2項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以上にあたる多数をもって行います。
- ⑤ 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- ⑥ 第2項から前項までの規定は、委託者が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款にかかるすべての受益者が書面また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。
- ⑦ 前各項の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあつても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託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。

（反対受益者の受益権買取請求の不適用）

第54条 この信託は、受益者が第46条の規定による一部解約請求を行ったときは、委託者が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、第48条に規定する信託契約の解約または前条に規定する重大な信託約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

（他の受益者の氏名等の開示の請求の制限）

第55条 この信託の受益者は、委託者または受託者に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行うことはできません。

1. 他の受益者の氏名または名称および住所
2. 他の受益者が有する受益権の内容

（運用報告書に記載すべき事項の提供）

第56条 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書の交付に代

えて、運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により提供します。

- ② 前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付します。

(公告)

第 57 条 委託者が行う公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。

<https://www.resona-am.co.jp/>

- ② 前項の電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

(信託約款に関する疑義の取扱い)

第 58 条 この信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

(付 則)

第 1 条 この約款において「自動けいぞく投資約款」とは、この信託について受益権取得申込者と指定販売会社が締結する「自動けいぞく投資約款」と別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとします。この場合、「自動けいぞく投資約款」は当該別の名称に読み替えるものとします。

第 2 条 第 23 条に規定する「金利先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」といいます。）における決済日から一定の期間を経過した日（以下「満期日」といいます。）までの期間にかかる国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」といいます。）の数値を取り決め、その取決めにかかる数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

第 3 条 第 23 条に規定する「為替先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間にかかる為替スワップ取引（同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下本条において同じ。）のスワップ幅（当該直物外国為替取引にかかる外国為替相場と当該先物外国為替取引にかかる外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下本条において同じ。）を取り決め、その取決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらか

め元本として定めた金額を乗じた額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金にかかる決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

第 4 条 第 24 条に規定する「直物為替先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金の授受を約する取引その他これに類似する取引をいいます。

上記条項により信託契約を締結します。

2021 年 11 月 18 日

委託者	りそなアセットマネジメント株式会社
受託者	株式会社りそな銀行

(付 表)

I 別に定める日

約款第 12 条第 3 項および第 46 条第 2 項の「別に定める日」とは、次のものをいいます。

ニューヨークの銀行の休業日

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日



RESONA

リソナアセットマネジメント