【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2022年10月20日提出
【発行者名】	り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 西岡　明彦
【本店の所在の場所】	東京都江東区木場一丁目５番６５号
【事務連絡者氏名】	塚田　光子
【電話番号】	03-6704-3821
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	九州ＳＤＧｓ・グローバルバランス
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

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】

2022年10月21日から2023年4月20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	内外	不動産投信
		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	グローバル（含む日本）		
	年２回	日本		
	年４回			
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）	北米	ファミリーファンド	あり（部分ヘッジ）
		欧州		
	年12回（毎月）	アジア		
		オセアニア		
	日々			
不動産投信		中南米	ファンド・オブ・ファンズ	なし
	その他（　　）	アフリカ		
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））		中近東（中東）		
		エマージング		
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ないファンドをいう。
   (2)追加型投信：一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。
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・マネージメント・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、為替のヘッジを行な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。

- 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。
*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】 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）
	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の場合があります。
※ 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、Environment（環境）、Social（社会）、Governance（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

マーケットシナリオの作成

投資対象資産の過去の収益率データなどを分析し、ランダムに組み合わせる事によって、将来起こり得る可能性があると考えられる、数万通りのマーケットシナリオを作成

▼

基本的資産配分比率の算出(原則として年1回程度見直し)

数万通りのマーケットシナリオを用い、独自の定量モデルによって中長期的な運用に最適と考えられる基本的資産配分比率を算出

▼

ポートフォリオ構築

基本的資産配分比率に基づき、ポートフォリオを構築

※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。

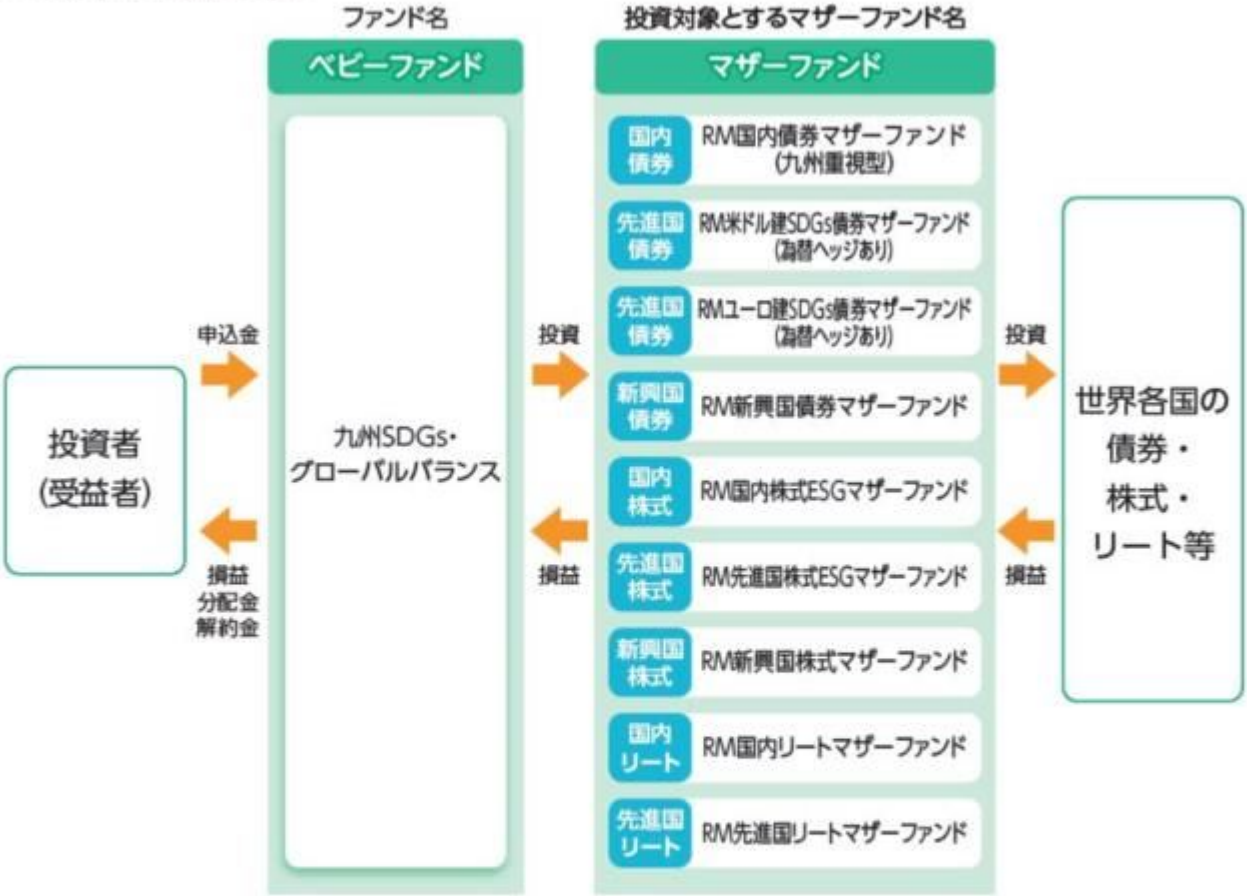
3 実質組入外貨建資産の一部について、対円での為替ヘッジを行います。

- 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に実質的に投資を行う、ファミリーファンド方式で運用をします。



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・セキュリティーズ・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。

－先進国債券の投資について－

- 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員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。

《 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。	●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。 ・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 ・レポーティング ●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。 ・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 など
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。	
サスティナブル・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、今後変更される場合があります。

－国内株式および先進国株式の投資について－

● 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。

・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上のリスクや機会は何か、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、り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、今後変更される場合があります。

〈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、り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。

〈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
S	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、り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。

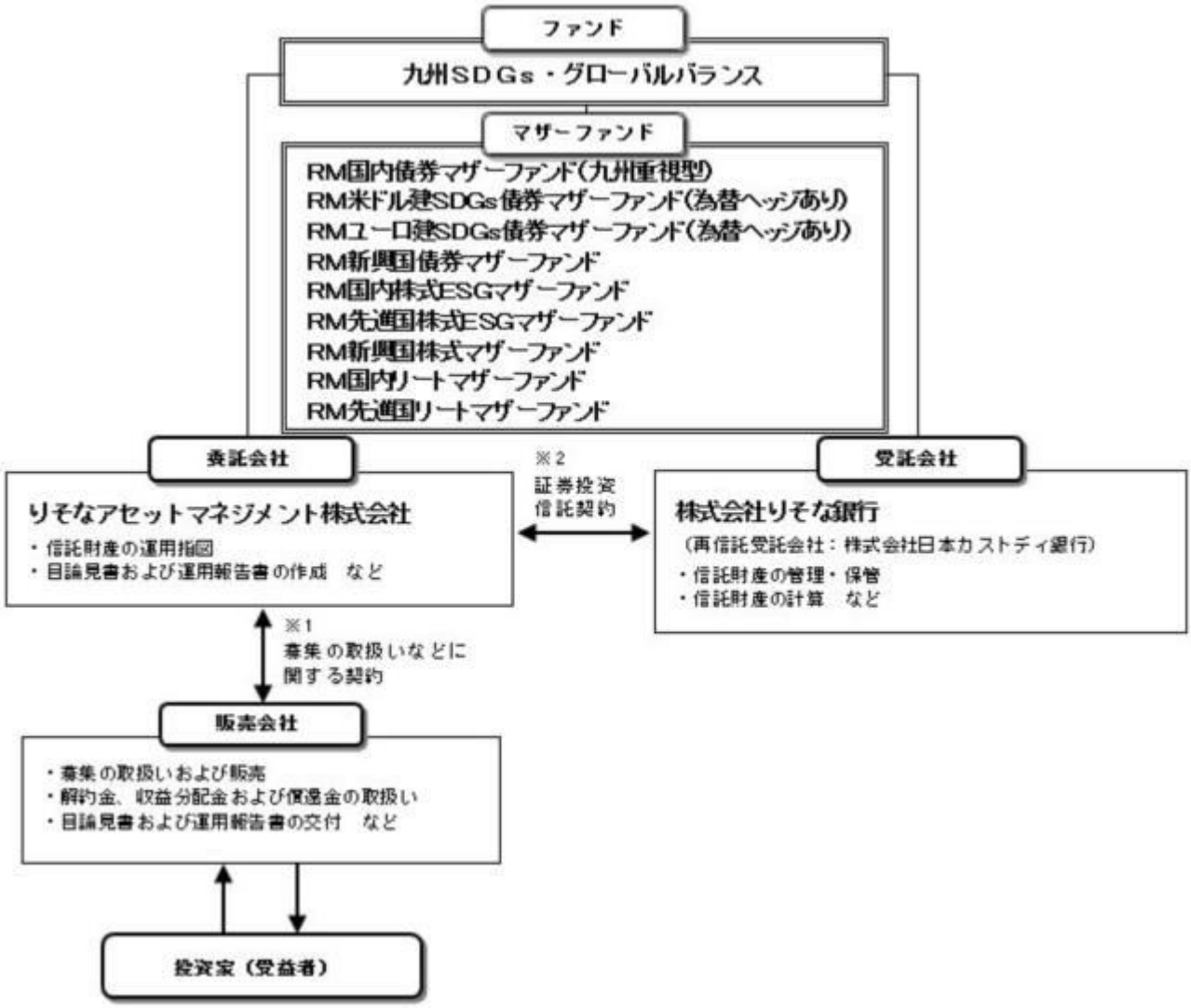
（２）【ファンドの沿革】

2021年11月18日

・ファンドの信託契約締結、運用開始

（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。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。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（2022年7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す。）
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	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	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ＳＤＧｓ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。

投資方針	①　主として、米ドル建のＳＤＧｓ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　米ドル建のＳＤＧｓ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年程度までの米ドル建のＳＤＧｓ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	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ユーロ建ＳＤＧｓ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。
投資方針	①　主として、ユーロ建のＳＤＧｓ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ＳＤＧｓ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ＳＤＧｓ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	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、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）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。 ・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）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ＥＴＦ（上場投資信託証券）
投資方針	①　主として、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）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ＥＴＦ（上場投資信託証券）に投資し、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）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、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）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ＥＴＦ（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態で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	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ます。）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	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。 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、通常の状態で高位に維持することを基本とします。 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。 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、ＭＳＣＩ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。 ・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（*） （*）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	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、ＭＳＣＩ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、ＭＳＣＩ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	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＞

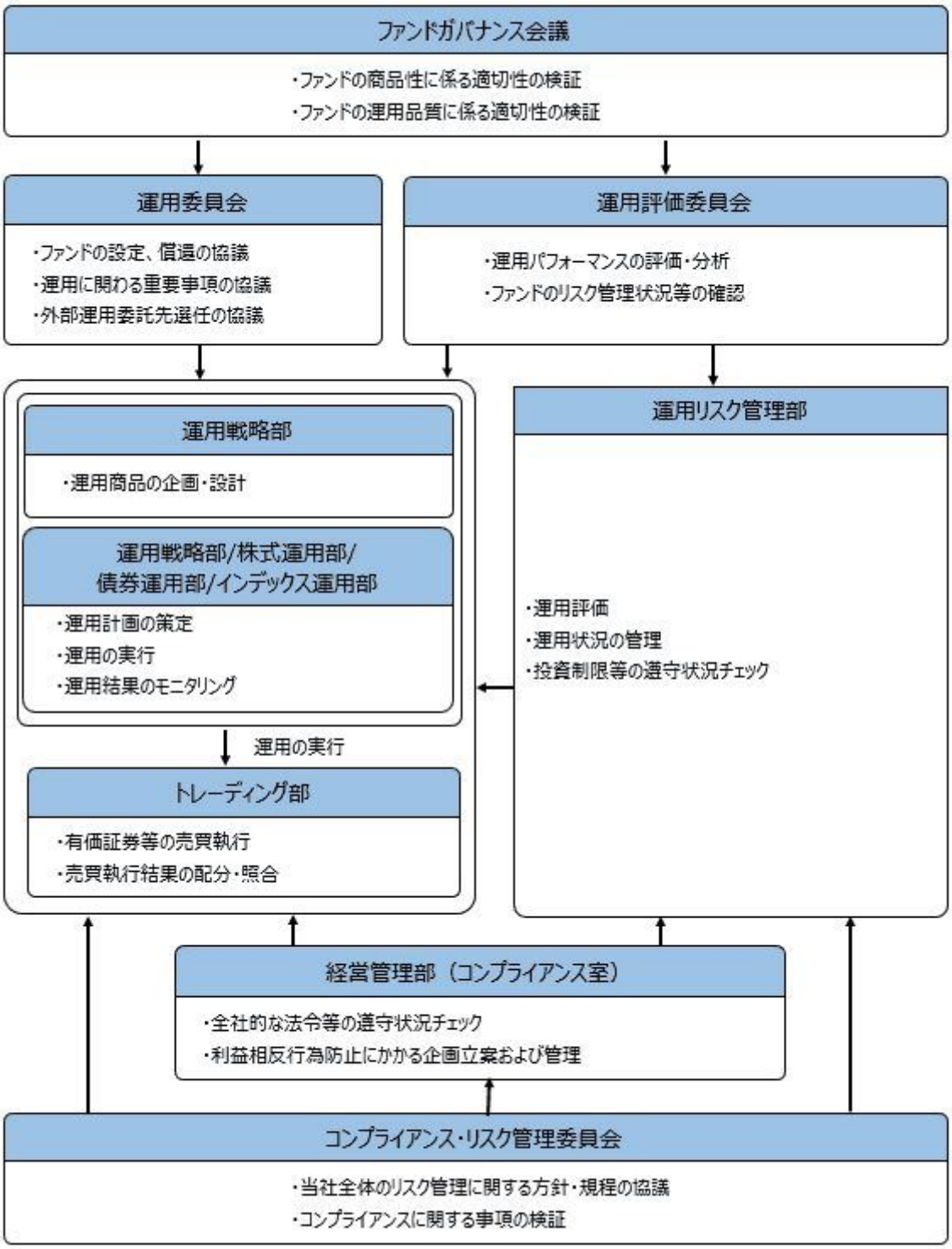
運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

主な投資対象	次の有価証券を主要投資対象とします。 ・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	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	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、2022年7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書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

へ）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。

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。

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。

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たときは、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生じた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

〇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2022年7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

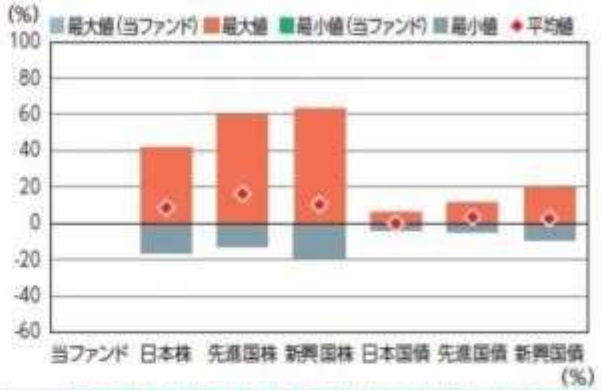
2017年8月末～2022年7月末

＊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、運用期間が1年未満であるため掲載しておりません。

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。

2017年8月末～2022年7月末



(%)

	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	－	42.1	59.8	62.7	5.4	11.4	19.3
最小値	－	△16.0	△12.4	△19.4	△3.5	△4.5	△9.4
平均値	－	8.7	16.5	10.5	0.1	3.6	2.7

＊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。
＊2017年8月から2022年7月の5年間の各月末における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。
なお、当ファンドの騰落率につきましては、運用期間が1年未満であるため掲載しておりません。
＊決算日に対応した数値とは異なります。

※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、野村證券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、野村證券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、少額投資非課税制度の適用対象です。

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ます。）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ます。）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）」および未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA」をご利用の場合、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一定期間非課税となります。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。

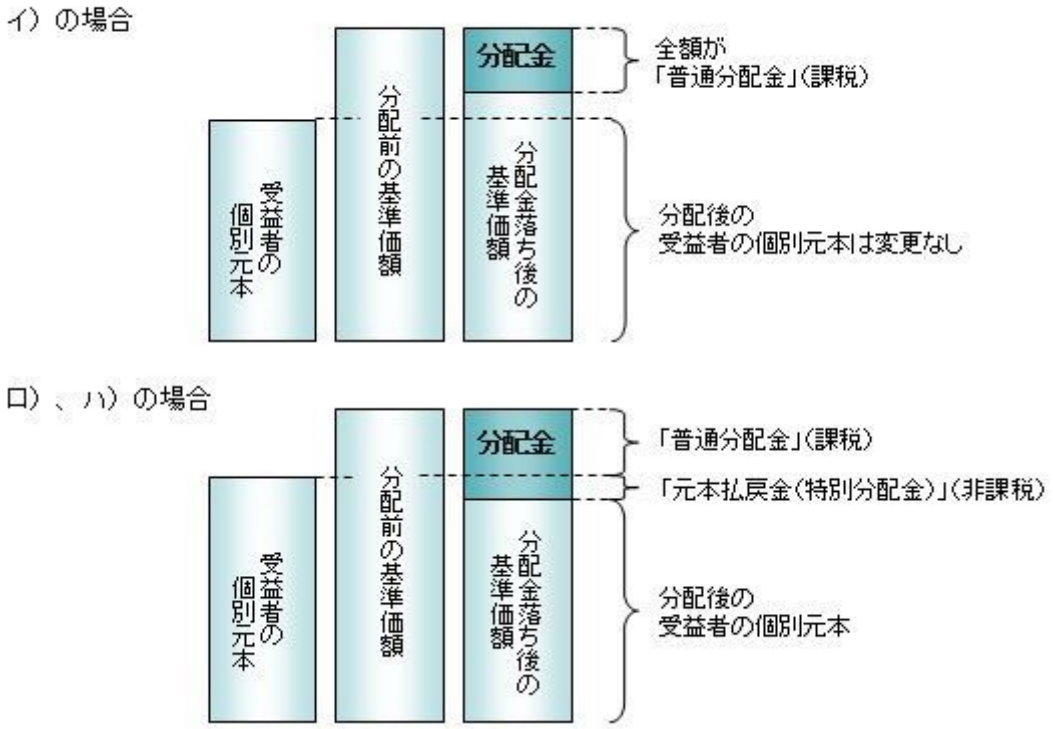
２）受益者が収益分配金を受け取る際

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＞



※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2022年7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。

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2022年 7月29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	2,708,470,967	99.55
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	―	12,195,104	0.45
合計（純資産総額）		2,720,666,071	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	632,022,197	1.5565	983,742,549	1.5660	989,746,760	36.38
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）	444,867,045	0.9247	411,368,556	0.9395	417,952,588	15.36
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）	376,132,625	0.9257	348,185,970	0.9451	355,482,943	13.07
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）	335,853,547	0.9887	332,058,401	0.9931	333,536,157	12.26
日本	親投資信託受益証券	RM国内株式ＥＳＧマザーファンド	155,679,960	1.2723	198,071,613	1.2675	197,324,349	7.25
日本	親投資信託受益証券	RM新興国株式マザーファンド	101,188,019	1.6093	162,841,878	1.5975	161,647,860	5.94
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	86,429,535	1.5132	130,785,172	1.5496	133,931,207	4.92
日本	親投資信託受益証券	RM国内リートマザーファンド	44,099,078	1.4669	64,688,937	1.5062	66,422,031	2.44
日本	親投資信託受益証券	RM新興国債券マザーファンド	47,813,108	1.0999	52,589,637	1.0965	52,427,072	1.93

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	99.55
合　　計	99.55

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
2021年11月末日	2,273	―	0.9846	―
12月末日	2,602	―	1.0017	―

2022年 1月末日	2,594	―	0.9655	―
2月末日	2,540	―	0.9542	―
3月末日	2,692	―	0.9990	―
4月末日	2,624	―	0.9765	―
5月末日	2,682	―	0.9713	―
6月末日	2,656	―	0.9573	―
7月末日	2,720	―	0.9803	―

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

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

(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

(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2022年 7月29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	908,739,620	68.51
地方債証券	日本	396,572,000	29.90
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	―	21,130,566	1.59
合計（純資産総額）		1,326,442,186	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３６０回利付国債（１０年）	210,000,000	99.11	208,143,600	100.00	210,000,000	0.100	2030/9/20	15.83
日本	国債証券	第３５３回利付国債（１０年）	200,000,000	99.96	199,936,000	100.54	201,084,000	0.100	2028/12/20	15.16
日本	国債証券	第１４３回利付国債（５年）	198,000,000	100.48	198,950,400	100.51	199,017,720	0.100	2025/3/20	15.00
日本	国債証券	第４２７回利付国債（２年）	198,000,000	100.15	198,304,920	100.15	198,306,900	0.005	2023/8/1	14.95
日本	国債証券	第１４８回利付国債（５年）	100,000,000	100.17	100,176,000	100.33	100,331,000	0.005	2026/6/20	7.56
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	99.68	99,686,000	99.84	99,845,000	0.001	2026/10/29	7.53
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	98.08	98,085,000	98.93	98,937,000	0.135	2031/10/29	7.46
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	98.08	98,085,000	98.93	98,937,000	0.135	2031/10/28	7.46
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	98.03	98,038,000	98.85	98,853,000	0.130	2031/11/28	7.45

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	68.51
地方債証券	29.90
合　　計	98.41

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2022年 7月29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	177,611,464	22.39
特殊債券	ドイツ	124,601,612	15.71
	国際機関	505,837,713	63.78
	小計	630,439,325	79.49
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	―	△14,921,696	△1.88
合計（純資産総額）		793,129,093	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	―	811,409,381	△102.30

(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	EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000	13,463.40	134,634,042	13,460.22	134,602,287	2.875	2025/6/13	16.97
国際機関	特殊債券	EUROPEAN BK RECON & DEV	1,000,000	13,085.31	130,853,115	13,084.04	130,840,408	1.625	2024/9/27	16.50
ドイツ	特殊債券	KFW	1,000,000	12,346.29	123,462,919	12,460.16	124,601,612	1.000	2026/10/1	15.71
国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000	12,215.29	122,152,908	12,399.56	123,995,611	1.375	2028/4/20	15.63
国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000	11,286.34	112,863,431	11,639.94	116,399,407	0.875	2030/5/17	14.68
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	310,000	11,922.40	36,959,464	12,130.14	37,603,460	0.500	2027/4/30	4.74
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	270,000	13,552.75	36,592,450	13,456.26	36,331,920	2.875	2023/9/30	4.58
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	290,000	11,943.98	34,637,567	12,378.59	35,897,933	1.625	2031/5/15	4.53
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	270,000	12,869.23	34,746,926	13,181.26	35,589,408	2.375	2029/5/15	4.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	240,000	13,405.81	32,173,944	13,411.97	32,188,743	0.125	2022/9/30	4.06

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	22.39
特殊債券	79.49
合　　計	101.88

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	6,036,100.00	779,827,320	811,409,381	△102.30

(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2022年 7月29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	202,861,674	27.69
特殊債券	ドイツ	128,322,025	17.52
	国際機関	392,897,614	53.64
	小計	521,219,639	71.16
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	―	8,404,138	1.15
合計（純資産総額）		732,485,451	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	―	723,306,593	△98.75

(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	EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000	13,742.01	137,420,190	13,691.25	136,912,502	0.500	2023/11/15	18.69
国際機関	特殊債券	EUROPEAN UNION	1,000,000	13,280.99	132,809,962	13,380.20	133,802,005	0.000	2025/11/4	18.27
ドイツ	特殊債券	KFW	1,000,000	12,650.11	126,501,129	12,832.20	128,322,025	0.000	2028/9/15	17.52
国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000	11,966.89	119,668,961	12,218.31	122,183,107	0.010	2030/11/15	16.68
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	250,000	13,898.00	34,745,009	13,799.08	34,497,719	2.250	2022/10/25	4.71
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	280,000	11,832.34	33,130,577	12,246.44	34,290,051	0.000	2031/11/25	4.68
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	240,000	14,141.26	33,939,032	14,151.76	33,964,236	1.750	2024/11/25	4.64
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	250,000	13,299.65	33,249,146	13,473.87	33,684,684	0.250	2026/11/25	4.60

フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	220,000	14,963.74	32,920,235	15,125.36	33,275,795	2.750	2027/10/25	4.54
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	260,000	12,419.86	32,291,660	12,749.68	33,149,189	0.000	2029/11/25	4.53

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	27.69
特殊債券	71.16
合　　計	98.85

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	5,270,700.00	720,571,560	723,306,593	△98.75

(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2022年 7月29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	2,038,049,599	22.36
	アイルランド	6,874,138,877	75.43
	小計	8,912,188,476	97.79
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	―	200,951,309	2.21
合計（純資産総額）		9,113,139,785	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	1,209,547	6,564.95	7,940,616,082	5,683.23	6,874,138,877	75.43
アメリカ	投資信託受益証券	VANECK J.P.MORGAN EM LOCAL	623,832	3,832.34	2,390,740,506	3,266.98	2,038,049,599	22.36

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	97.79
合　　計	97.79

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2022年 7月29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	2,207,335,690	88.92
投資証券	日本	37,693,700	1.52
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	―	237,385,499	9.56
合計（純資産総額）		2,482,414,889	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	234,437,500	9.44

(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	84,400	2,120.15	178,941,400	2,137.00	180,362,800	7.27
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	10,000	13,005.40	130,054,000	11,695.00	116,950,000	4.71
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	11,500	5,802.95	66,734,000	4,953.00	56,959,500	2.29
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	1,200	58,109.16	69,731,000	46,010.00	55,212,000	2.22
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	12,800	3,825.70	48,969,000	4,292.00	54,937,600	2.21
日本	株式	任天堂	その他製品	900	54,497.77	49,048,000	59,710.00	53,739,000	2.16
日本	株式	日立製作所	電気機器	7,700	6,511.50	50,138,599	6,704.00	51,620,800	2.08
日本	株式	第一三共	医薬品	14,000	3,037.21	42,521,000	3,523.00	49,322,000	1.99
日本	株式	ダイキン工業	機械	2,000	22,525.00	45,050,000	23,250.00	46,500,000	1.87
日本	株式	キーエンス	電気機器	800	61,795.62	49,436,498	52,430.00	41,944,000	1.69
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	500	70,334.00	35,167,000	80,200.00	40,100,000	1.62
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	9,500	3,583.87	34,046,800	3,866.00	36,727,000	1.48
日本	株式	村田製作所	電気機器	4,600	8,342.91	38,377,400	7,747.00	35,636,200	1.44
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	47,600	731.73	34,830,436	745.40	35,481,040	1.43
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	22,900	1,541.61	35,302,950	1,538.50	35,231,650	1.42
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	1,600	19,462.81	31,140,500	20,150.00	32,240,000	1.30
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	14,800	1,954.14	28,921,300	2,087.50	30,895,000	1.24
日本	株式	富士通	電気機器	1,600	18,661.25	29,858,000	18,515.00	29,624,000	1.19
日本	株式	信越化学工業	化学	1,500	18,765.96	28,148,944	16,960.00	25,440,000	1.02
日本	株式	テルモ	精密機器	5,100	4,291.77	21,888,055	4,531.00	23,108,100	0.93
日本	株式	オリックス	その他金融業	9,500	2,360.73	22,426,950	2,360.50	22,424,750	0.90
日本	株式	小松製作所	機械	7,400	2,953.86	21,858,600	3,009.00	22,266,600	0.90
日本	株式	花王	化学	3,800	5,729.68	21,772,800	5,785.00	21,983,000	0.89
日本	株式	富士フイルムホールディングス	化学	2,900	8,236.58	23,886,100	7,560.00	21,924,000	0.88
日本	株式	三井不動産	不動産業	7,300	2,628.50	19,188,100	2,966.50	21,655,450	0.87
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	5,200	3,960.45	20,594,380	4,107.00	21,356,400	0.86
日本	株式	ＨＯＹＡ	精密機器	1,500	13,389.66	20,084,500	13,270.00	19,905,000	0.80
日本	株式	中外製薬	医薬品	5,300	3,876.05	20,543,100	3,734.00	19,790,200	0.80
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	2,500	6,555.47	16,388,694	7,764.00	19,410,000	0.78
日本	株式	パナソニック　ホールディングス	電気機器	17,600	1,256.67	22,117,550	1,094.00	19,254,400	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	国内	水産・農林業	0.02
		鉱業	0.50
		建設業	1.94
		食料品	3.10
		繊維製品	0.44
		パルプ・紙	0.04
		化学	6.67

		医薬品	5.63
		石油・石炭製品	0.50
		ゴム製品	0.48
		ガラス・土石製品	0.53
		鉄鋼	0.55
		非鉄金属	0.52
		機械	4.95
		電気機器	19.09
		輸送用機器	8.20
		精密機器	2.26
		その他製品	2.87
		電気・ガス業	1.17
		陸運業	2.98
		海運業	0.54
		倉庫・運輸関連業	0.04
		情報・通信業	5.90
		卸売業	2.75
		小売業	2.92
		銀行業	3.32
		証券、商品先物取引業	0.62
		保険業	2.86
		その他金融業	0.99
		不動産業	2.19
		サービス業	4.34
投資証券	—	—	1.52
合　　計			90.44

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	4	日本円	77,662,200	77,500,000	3.12
	大阪取引所	ミニＴＯＰＩＸ先物	買建	81	日本円	154,587,560	156,937,500	6.32

(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2022年 7月29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	2,713,127,921	63.71
	カナダ	150,374,674	3.53
	ドイツ	66,420,155	1.56
	イタリア	13,727,527	0.32
	フランス	118,174,205	2.77
	オランダ	83,561,046	1.96
	スペイン	23,478,200	0.55
	ベルギー	4,868,990	0.11
	オーストリア	2,573,224	0.06
	ルクセンブルク	1,033,304	0.02
	フィンランド	19,916,688	0.47
	アイルランド	101,036,458	2.37
	ポルトガル	1,951,363	0.05
	イギリス	184,261,802	4.33
	スイス	114,016,683	2.68
	スウェーデン	37,383,703	0.88
	ノルウェー	17,050,301	0.40
	デンマーク	54,356,232	1.28
	ケイマン	2,264,004	0.05
	オーストラリア	85,934,097	2.02
	バミューダ	6,494,336	0.15
	ニュージーランド	5,420,227	0.13
	香港	29,752,072	0.70
	シンガポール	8,820,215	0.21
	イスラエル	2,442,812	0.06
	キュラソー	8,147,735	0.19
	ジャージー	15,030,296	0.35
	小計	3,871,618,270	90.91
投資証券	アメリカ	85,036,146	2.00
	カナダ	440,159	0.01
	フランス	2,973,141	0.07
	イギリス	4,304,271	0.10
	オーストラリア	10,406,436	0.24
	シンガポール	1,328,275	0.03
	小計	104,488,428	2.45
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	―	282,625,764	6.64
合計（純資産総額）		4,258,732,462	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	238,525,212	5.60
	買建	ドイツ	53,276,330	1.25

(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	―	17,508,976	0.41

(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	8,544	43,693.39	373,316,379	37,207.55	317,901,308	7.46
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	1,054	139,734.75	147,280,437	113,435.84	119,561,383	2.81
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	7,220	18,986.59	137,083,199	15,375.15	111,008,613	2.61
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	6,820	19,092.14	130,208,407	15,424.95	105,198,227	2.47
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	3,154	22,046.14	69,533,528	23,449.06	73,958,342	1.74
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	2,999	40,418.51	121,215,116	24,208.26	72,600,579	1.70
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	2,876	20,117.10	57,856,805	19,930.35	57,319,706	1.35
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	1,990	27,663.96	55,051,284	28,449.82	56,615,149	1.33
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	1,253	52,660.02	65,983,012	40,333.19	50,537,492	1.19
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	1,047	46,286.19	48,461,642	47,443.29	49,673,129	1.17
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	971	35,837.77	34,798,478	44,528.98	43,237,647	1.02
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	4,949	7,671.84	37,967,977	8,623.11	42,675,804	1.00
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	1,662	22,135.73	36,789,591	23,535.21	39,115,523	0.92

スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	844	50,407.19	42,543,674	45,741.94	38,606,204	0.91
アメリカ	株式	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	469	83,017.09	38,935,019	80,448.31	37,730,262	0.89
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	3,033	11,100.09	33,666,599	12,106.82	36,719,995	0.86
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	488	93,023.98	45,395,705	74,856.14	36,529,801	0.86
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	1,860	14,355.41	26,701,073	17,811.58	33,129,543	0.78
アメリカ	株式	MCDONALD'S CORP	消費者サービス	892	34,289.21	30,585,984	35,464.35	31,634,201	0.74
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	2,021	13,226.70	26,731,167	15,587.33	31,501,998	0.74
アイルランド	株式	ACCENTURE PLC-CL A	ソフトウェア・サービス	758	47,370.60	35,906,918	40,878.36	30,985,801	0.73
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	5,037	6,974.82	35,132,217	6,131.48	30,884,292	0.73
アメリカ	株式	WALT DISNEY CO/THE	メディア・娯楽	2,183	19,691.36	42,986,255	14,120.58	30,825,246	0.72
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	566	82,426.77	46,653,555	54,315.13	30,742,366	0.72
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4,985	7,416.77	36,972,626	6,140.90	30,612,427	0.72
アメリカ	株式	SALESFORCE INC	ソフトウェア・サービス	1,182	35,394.50	41,836,309	24,403.44	28,844,874	0.68
アメリカ	株式	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2,615	8,091.50	21,159,298	10,055.36	26,294,785	0.62
アメリカ	株式	TEXAS INSTRUMENTS INC	半導体・半導体製造装置	1,108	25,480.11	28,231,972	23,657.70	26,212,740	0.62
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	4,886	6,634.60	32,416,703	5,345.36	26,117,444	0.61
アイルランド	株式	LINDE PLC	素材	615	43,707.94	26,880,387	39,969.74	24,581,395	0.58

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	3.05
		素材	3.99
		資本財	5.25

		商業・専門サービス	1.03
		運輸	2.55
		自動車・自動車部品	3.28
		耐久消費財・アパレル	1.71
		消費者サービス	1.24
		メディア・娯楽	6.50
		小売	3.56
		食品・生活必需品小売り	0.75
		食品・飲料・タバコ	3.04
		家庭用品・パーソナル用品	3.24
		ヘルスケア機器・サービス	3.14
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	10.62
		銀行	4.68
		各種金融	4.65
		保険	3.74
		不動産	0.25
		ソフトウェア・サービス	15.43
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1.43
		電気通信サービス	1.40
		公益事業	1.79
		半導体・半導体製造装置	4.58
投資証券	—	—	2.45
合　　計			93.36

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	SP500MIC2209	買建	87	米ドル	1,650,375.25	222,157,015	1,771,972.5	238,525,212	5.60
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	STX E6002209	買建	18	ユーロ	367,887	50,492,493	388,170	53,276,330	1.25

(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	117,000.00	15,868,390	15,744,716	0.37
	カナダドル	買建	8,000.00	840,350	840,330	0.02

	スウェーデンクローナ	買建	70,000.00	931,259	923,930	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2022年 7月29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	60,202,643	0.32
	メキシコ	336,168,848	1.78
	ブラジル	838,944,687	4.44
	チリ	91,664,418	0.48
	コロンビア	25,805,577	0.14
	ペルー	2,834,554	0.01
	オランダ	0	0.00
	ルクセンブルク	16,425,691	0.09
	ギリシャ	42,495,332	0.22
	トルコ	43,904,588	0.23
	チェコ	26,551,541	0.14
	キプロス	0	0.00
	ハンガリー	26,067,002	0.14
	ポーランド	93,852,388	0.50
	ロシア	0	0.00
	ケイマン	3,070,825,329	16.24
	バミューダ	97,964,575	0.52
	香港	202,880,520	1.07
	シンガポール	4,030,679	0.02
	マレーシア	245,102,359	1.30
	タイ	305,016,406	1.61
	フィリピン	120,567,142	0.64
	インドネシア	308,707,548	1.63
	韓国	1,953,157,344	10.33
	台湾	2,335,487,793	12.35
	中国	2,050,359,956	10.84
	インド	2,244,393,869	11.87
	カタール	179,711,213	0.95
	エジプト	8,092,996	0.04
	南アフリカ	568,208,679	3.00
	ジャージー	0	0.00
	英ヴァージン諸島	0	0.00

	アラブ首長国連邦	216,198,015	1.14
	クウェート	139,221,610	0.74
	サウジアラビア	737,353,204	3.90
	小計	16,392,196,506	86.68
投資証券	メキシコ	11,231,934	0.06
	南アフリカ	7,042,783	0.04
	小計	18,274,717	0.10
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	―	2,501,257,192	13.23
合計（純資産総額）		18,911,728,415	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	2,532,014,067	13.39

(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	―	79,996,039	0.42
	売建	―	599,992	△0.00

(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	461,000	2,912.61	1,342,716,332	2,251.29	1,037,846,350	5.49
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	116,900	7,821.99	914,391,499	5,501.72	643,151,068	3.40
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	89,408	7,759.64	693,774,229	6,431.40	575,019,505	3.04
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	小売	284,140	2,021.45	574,375,566	1,700.42	483,158,049	2.55
ケイマン	株式	MEITUAN	小売	76,700	3,950.77	303,024,514	3,224.20	247,296,140	1.31
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	56,982	4,096.34	233,418,078	4,177.07	238,017,803	1.26
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	63,048	2,930.74	184,777,913	2,579.58	162,637,360	0.86
ケイマン	株式	JD.COM INC - CL A	小売	37,560	4,909.53	184,402,183	4,201.75	157,817,730	0.83
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	1,800,000	101.79	183,224,666	85.92	154,658,700	0.82
ブラジル	株式	VALE SA	素材	74,904	2,178.01	163,141,912	1,834.27	137,394,249	0.73
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	96,256	1,353.02	130,236,499	1,384.82	133,297,234	0.70

インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	32,231	4,297.36	138,508,266	3,973.83	128,080,676	0.68
サウジアラビア	株式	AL RAJHI BANK	銀行	36,709	3,321.38	121,924,681	3,216.64	118,079,638	0.62
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	233,800	465.15	108,753,846	487.55	113,990,499	0.60
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	10,232	12,301.90	125,873,099	10,327.65	105,672,617	0.56
サウジアラビア	株式	THE SAUDI NATIONAL BANK	銀行	41,103	2,572.43	105,734,994	2,516.59	103,439,399	0.55
ケイマン	株式	NETEASE INC	メディア・娯楽	38,900	2,597.48	101,042,034	2,589.65	100,737,385	0.53
ケイマン	株式	BAIDU INC-CLASS A	メディア・娯楽	41,980	2,509.70	105,357,302	2,376.98	99,786,040	0.53
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	118,500	1,109.37	131,460,817	820.62	97,244,359	0.51
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	17,341	6,374.19	110,534,868	5,542.85	96,118,562	0.51
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	15,431	7,042.64	108,674,995	5,922.29	91,387,011	0.48
ケイマン	株式	WUXI BIOLOGICS (CAYMAN) INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	67,500	1,476.90	99,691,030	1,319.69	89,079,244	0.47
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	28,800	4,768.50	137,333,035	3,064.63	88,261,494	0.47
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	小売	4,085	19,990.52	81,661,289	20,040.93	81,867,205	0.43
中国	株式	BYD CO LTD-H	自動車・自動車部品	15,500	4,348.48	67,401,573	4,959.78	76,876,590	0.41
中国	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	1,057,000	80.94	85,558,909	71.00	75,048,057	0.40
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	エネルギー	89,200	826.32	73,708,048	837.86	74,737,482	0.40
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	1,488,000	52.07	77,489,687	48.02	71,453,760	0.38
インドネシア	株式	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	銀行	1,039,900	70.95	73,789,557	66.88	69,553,711	0.37
インド	株式	HINDUSTAN UNILEVER LTD	家庭用品・パーソナル用品	15,444	3,887.80	60,043,246	4,454.16	68,790,201	0.36

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	4.36
		素材	7.25
		資本財	3.08
		商業・専門サービス	0.07
		運輸	1.83
		自動車・自動車部品	3.37
		耐久消費財・アパレル	1.36
		消費者サービス	0.98

		メディア・娯楽	6.04
		小売	6.59
		食品・生活必需品小売り	1.09
		食品・飲料・タバコ	3.51
		家庭用品・パーソナル用品	0.80
		ヘルスケア機器・サービス	0.84
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.69
		銀行	14.11
		各種金融	2.21
		保険	2.23
		不動産	1.60
		ソフトウェア・サービス	2.28
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.08
		電気通信サービス	2.76
		公益事業	2.60
		半導体・半導体製造装置	7.91
投資証券	—	—	0.10
合　　計			86.77

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	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 2209	買建	375	米ドル	18,723,405	2,520,357,544	18,810,000	2,532,014,067	13.39

(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	594,452.12	80,682,125	79,996,039	0.42
	チリペソ	売建	104,104.00	15,544	15,374	△0.00
	オフショア人民元	売建	12,986.46	262,037	258,890	△0.00
	サウジアラビアリアル	売建	9,073.21	329,811	325,728	△0.00

(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2022年 7月29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	30,897,428,300	98.72
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	―	402,104,206	1.28
合計（純資産総額）		31,299,532,506	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	359,790,000	1.15

(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	3,209	660,458.02	2,119,409,786	706,000	2,265,554,000	7.24
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	2,751	617,651.92	1,699,160,431	643,000	1,768,893,000	5.65
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	4,508	349,311.42	1,574,695,881	346,000	1,559,768,000	4.98
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	13,880	95,690.78	1,328,188,026	108,400	1,504,592,000	4.81
日本	投資証券	ＧＬＰ投資法人	8,471	179,189.08	1,517,910,696	175,100	1,483,272,100	4.74
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	8,896	154,823.98	1,377,314,126	166,700	1,482,963,200	4.74
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	4,147	324,377.27	1,345,192,550	320,500	1,329,113,500	4.25
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	5,481	167,699.02	919,158,328	191,100	1,047,419,100	3.35
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	2,750	347,294.26	955,059,215	367,000	1,009,250,000	3.22
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	6,193	134,020.62	829,989,699	145,000	897,985,000	2.87
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	1,881	373,769.53	703,060,485	406,500	764,626,500	2.44
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	4,111	187,620.94	771,309,702	185,100	760,946,100	2.43
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	8,360	77,515.43	648,028,994	83,400	697,224,000	2.23
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	950	623,731.6	592,545,020	696,000	661,200,000	2.11
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	8,871	58,534.22	519,257,126	69,000	612,099,000	1.96
日本	投資証券	アクティビア・プロパティーズ投資法人	1,452	385,641.89	559,952,029	417,500	606,210,000	1.94
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	1,855	313,719.65	581,949,950	320,000	593,600,000	1.90
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	3,368	175,811.02	592,131,515	175,600	591,420,800	1.89
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	808	666,045.23	538,164,545	715,000	577,720,000	1.85
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	1,087	556,125.53	604,508,453	523,000	568,501,000	1.82
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	1,021	488,261.22	498,514,710	543,000	554,403,000	1.77
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	12,108	36,509.52	442,057,268	41,850	506,719,800	1.62

日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	3,235	144,002.79	465,849,025	153,000	494,955,000	1.58
日本	投資証券	イオンリート投資法人	3,045	146,033.18	444,671,033	156,100	475,324,500	1.52
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	3,722	110,903.06	412,781,189	125,800	468,227,600	1.50
日本	投資証券	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	1,973	204,320.51	403,124,366	223,700	441,360,100	1.41
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,280	316,243.5	404,791,680	336,500	430,720,000	1.38
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	2,574	161,781.96	416,426,774	166,700	429,085,800	1.37
日本	投資証券	三菱地所物流リート投資法人	849	454,526.78	385,893,237	477,500	405,397,500	1.30
日本	投資証券	ＮＴＴ都市開発リート投資法人	2,644	145,862.96	385,661,666	152,500	403,210,000	1.29

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
投資証券	98.72
合　　計	98.72

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	179	日本円	353,499,090	359,790,000	1.15

(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2022年 7月29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	263,253,796	0.87
	オーストラリア	18,218,108	0.06
	小計	281,471,904	0.93
投資証券	アメリカ	23,004,478,908	76.19
	カナダ	545,110,631	1.81
	ドイツ	16,026,824	0.05
	イタリア	8,387,591	0.03
	フランス	465,968,932	1.54
	オランダ	52,478,908	0.17

	スペイン	113,138,978	0.37
	ベルギー	335,707,351	1.11
	アイルランド	13,044,547	0.04
	イギリス	1,513,373,439	5.01
	オーストラリア	1,885,425,723	6.24
	ニュージーランド	105,845,618	0.35
	香港	418,205,494	1.39
	シンガポール	1,090,466,685	3.61
	韓国	66,252,955	0.22
	イスラエル	35,496,919	0.12
	ガーンジー	76,365,213	0.25
	小計	29,745,774,716	98.52
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	—	164,873,762	0.55
合計（純資産総額）		30,192,120,382	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	—	37,678,404	0.12

(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	114,482	19,179.23	2,195,676,929	17,822.36	2,040,339,875	6.76
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	14,079	94,875.82	1,335,756,672	95,749.43	1,348,056,353	4.46
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	23,613	45,823.93	1,082,040,605	45,377.03	1,071,487,833	3.55
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	93,018	9,129.25	849,184,595	9,899.21	920,805,590	3.05
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	70,194	11,432.42	802,487,802	11,573.76	812,409,057	2.69
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	44,032	19,600.56	863,051,950	18,432.14	811,604,310	2.69
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	50,763	17,683.71	897,678,460	14,465.19	734,296,470	2.43
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	148,953	3,860.61	575,050,157	4,549.81	677,709,041	2.24
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	21,624	30,459.55	658,657,326	28,569.62	617,789,601	2.05
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	52,922	11,218.39	593,700,027	10,465.92	553,877,815	1.83
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	20,756	25,180.14	522,639,123	25,325.52	525,656,605	1.74
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	22,954	24,216.33	555,861,846	21,968.35	504,261,552	1.67
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	59,425	7,528.73	447,395,214	8,406.39	499,549,993	1.65
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	94,387	5,337.28	503,770,461	5,198.63	490,683,864	1.63
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	262,817	2,061.09	541,691,067	1,864.21	489,948,182	1.62
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	61,786	7,011.83	433,233,231	7,177.40	443,463,158	1.47

アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	17,851	25,944.73	463,139,400	24,766.89	442,113,823	1.46
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	18,807	23,757.31	446,803,897	21,992.58	413,614,486	1.37
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	10,103	42,149.08	425,832,188	38,336.92	387,317,984	1.28
香港	投資証券	LINK REIT	326,600	1,167.74	381,385,028	1,117.32	364,917,529	1.21
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	29,809	10,482.08	312,460,343	11,418.96	340,387,966	1.13
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	185,760	1,964.68	364,959,217	1,737.73	322,801,709	1.07
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	16,472	20,194.19	332,638,734	19,024.43	313,370,432	1.04
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	83,384	4,331.74	361,198,625	3,700.42	308,556,563	1.02
アメリカ	投資証券	UDR INC	46,282	7,106.06	328,882,757	6,496.27	300,660,766	1.00
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	44,943	6,212.25	279,197,219	6,461.27	290,389,307	0.96
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	95,476	3,063.72	292,512,075	2,942.57	280,945,253	0.93
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	22,024	14,672.49	323,146,920	12,125.66	267,055,730	0.88
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	110,363	2,300.48	253,888,415	2,410.86	266,070,305	0.88
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	26,750	10,048.63	268,801,026	9,823.83	262,787,661	0.87

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	不動産	0.93
投資証券	―	―	98.52
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	245,000.00	33,255,337	32,969,920	0.11
	カナダドル	買建	20,000.00	2,100,876	2,100,826	0.01
	ユーロ	買建	19,000.00	2,607,468	2,607,658	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。

≪参考情報≫

運用実績

2022年7月29日現在

基準価額・純資産の推移

基準価額	9,803円	純資産総額	27.2億円

※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して計算しております。

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

2022年7月20日	0円
－	－
－	－
－	－
－	－
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)	12.3
RM米ドル建SDGs債券マザーファンド(為替ヘッジあり)	15.4
RMユーロ建SDGs債券マザーファンド(為替ヘッジあり)	13.1
RM国内株式ESGマザーファンド	7.3
RM先進国株式ESGマザーファンド	36.4
RM新興国株式マザーファンド	5.9
RM新興国債券マザーファンド	1.9
RM国内リートマザーファンド	2.4
RM先進国リートマザーファンド	4.9
その他	0.4
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	50.8
米ドル	31.9
ユーロ	3.5
英ポンド	1.9
香港ドル	1.6
その他	10.3
合計	100.0

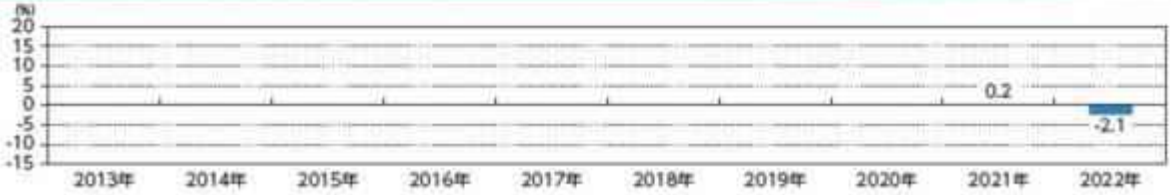
※比率はファンドの純資産総額に対する組入比率であり、四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。
※上記通貨別組入比率は、各マザーファンドが実質的に保有している株式・債券等の通貨を基準に算出しています。
※為替ヘッジをかけている外貨建資産については、日本円に含めています。

■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360回利付国債(10年)	2030/9/20	15.83
	日本	第353回利付国債(10年)	2028/12/20	15.16
	日本	第143回利付国債(5年)	2025/3/20	15.00
米ドル建SDGs債券(為替ヘッジあり)	国際機関	EUROPEAN INVESTMENT BANK	2025/6/13	16.97
	国際機関	EUROPEAN BK RECON & DEV	2024/9/27	16.50
	ドイツ	KFW	2026/10/1	15.71
ユーロ建SDGs債券(為替ヘッジあり)	国際機関	EUROPEAN INVESTMENT BANK	2023/11/15	18.69
	国際機関	EUROPEAN UNION	2025/11/4	18.27
	ドイツ	KFW	2028/9/15	17.52
国内株式ESG	日本	トヨタ自動車	－	7.27
	日本	ソニーグループ	－	4.71
	日本	リクルートホールディングス	－	2.29
先進国株式ESG	アメリカ	MICROSOFT CORP	－	7.46
	アメリカ	TESLA INC	－	2.81
	アメリカ	ALPHABET INC-CL A	－	2.61
新興国株式	台湾	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	－	5.49
	ケイマン	TENCENT HOLDINGS LTD	－	3.40
	韓国	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	－	3.04
新興国債券	アイルランド	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	－	75.43
	アメリカ	VANECK J.P.MORGAN EM LOCAL	－	22.36
国内リート	日本	日本ビルファンド投資法人	－	7.24
	日本	ジャパンリアルエステイト投資法人	－	5.65
	日本	日本プロロジスリート投資法人	－	4.98
先進国リート	アメリカ	PROLOGIS INC	－	6.76
	アメリカ	EQUINIX INC	－	4.46
	アメリカ	PUBLIC STORAGE	－	3.55

※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日が設定日のため、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。2022年は7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

最低単位を1円または1口単位として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づき、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

最低単位を1口単位として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。

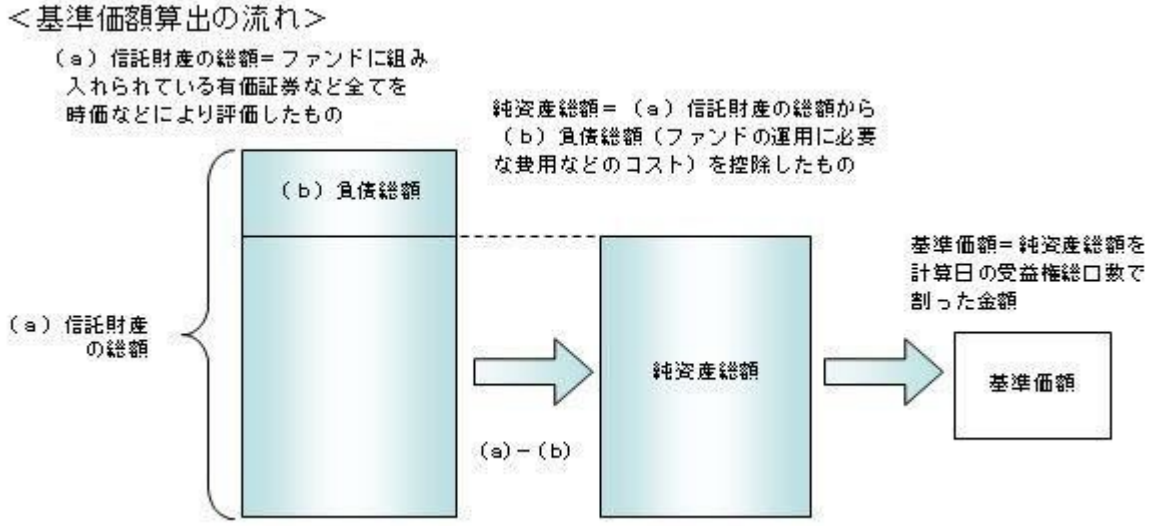
3【資産管理等の概要】

（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１万口当たりに換算した価額で表示することがあります。



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】

2031年7月22日までとします（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。）を行ないます。（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、書面決議を行ないます。（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ないます。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、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、書面決議について賛成するものとみなします。

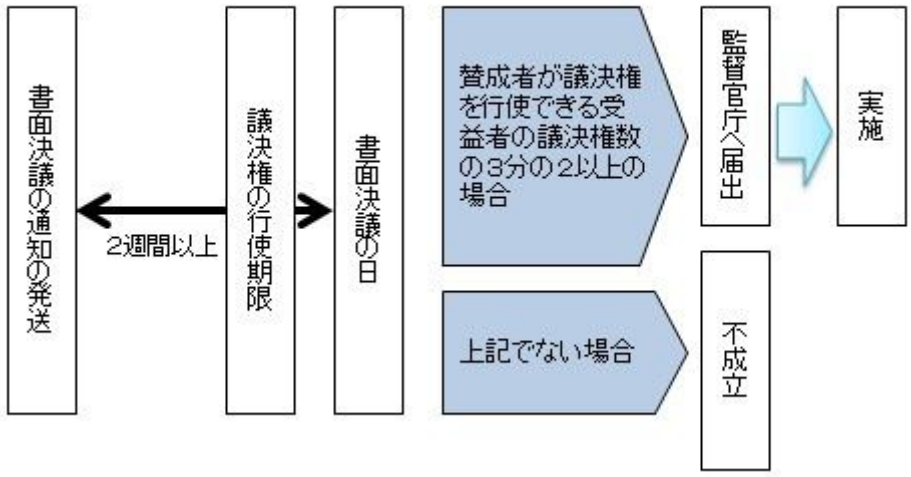
3）書面決議は、議決権を行使することができる受益者の議決権の３分の２以上にあたる多数をもって行ないます。

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、書面決議を行ないません。

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年間請求を行な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1期計算期間(2021年11月18日から2022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。

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
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	19,048,993
親投資信託受益証券	2,684,332,713
流動資産合計	2,703,381,706
資産合計	2,703,381,706
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	152,708
未払委託者報酬	4,937,563
未払利息	51
その他未払費用	39,675
流動負債合計	5,129,997
負債合計	5,129,997
純資産の部	
元本等	
元本	2,776,234,468
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△77,982,759
（分配準備積立金）	8,734,406
元本等合計	2,698,251,709
純資産合計	2,698,251,709
負債純資産合計	2,703,381,706

（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
営業収益	
有価証券売買等損益	△48,285,287
営業収益合計	△48,285,287
営業費用	
支払利息	17,856
受託者報酬	568,859
委託者報酬	18,393,004
その他費用	148,755
営業費用合計	19,128,474
営業利益又は営業損失（△）	△67,413,761
経常利益又は経常損失（△）	△67,413,761
当期純利益又は当期純損失（△）	△67,413,761
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
期首剰余金又は期首欠損金（△）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	298,788
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
剰余金減少額又は欠損金増加額	13,892,174
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
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△77,982,759

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１.有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
２.その他財務諸表作成のための基礎となる事項	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、設定日（2021年11月18日）から2022年 7月20日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

第1期 2022年 7月20日現在	
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
期中追加設定元本額	814,962,731円
期中一部解約元本額	103,252,540円
２． 計算期間の末日における受益権の総数	
	2,776,234,468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	
1口当たり純資産額	0.9719円
(10,000口当たり純資産額)	(9,719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	
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
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
C 収益調整金額	625,896円
D 分配準備積立金額	0円
E 当ファンドの分配対象収益額(E=A+B+C+D)	9,360,302円
F 当ファンドの期末残存口数	2,776,234,468口
G 10,000口当たり収益分配対象額(G=E/F×10,000)	33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

（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
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、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。 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

第1期 2022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 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。 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）

第1期 自 2021年11月18日 至 2022年 7月20日
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	第1期 自 2021年11月18日 至 2022年 7月20日
	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
合計	△43,727,140

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）	335,853,547	332,058,401	
	RM米ドル建ＳＤＧｓ債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	444,867,045	411,368,556	
	RMユーロ建ＳＤＧｓ債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	376,132,625	348,185,970	
	RM新興国債券マザーファンド	47,813,108	52,589,637	
	RM国内株式ＥＳＧマザーファンド	155,679,960	198,071,613	
	RM先進国株式ＥＳＧマザーファンド	632,022,197	983,742,549	

	RM新興国株式マザーファンド	101,188,019	162,841,878	
	RM国内リートマザーファンド	44,099,078	64,688,937	
	RM先進国リートマザーファンド	86,429,535	130,785,172	
合計		2,224,085,114	2,684,332,713	

(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）

	2022年 7月20日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	20,870,108
国債証券	905,510,920
地方債証券	393,894,000
未収利息	235,344
前払費用	493
流動資産合計	1,320,510,865
資産合計	1,320,510,865
負債の部	
流動負債	
未払利息	56

	2022年 7月20日現在
流動負債合計	56
負債合計	56
純資産の部	
元本等	
元本	1,335,668,450
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△15,157,641
元本等合計	1,320,510,809
純資産合計	1,320,510,809
負債純資産合計	1,320,510,865

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）

2022年 7月20日現在	
１． 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年11月18日
期首元本額	1,000,300,000円
期中追加設定元本額	449,021,897円
期中一部解約元本額	113,653,447円
期末元本額	1,335,668,450円
期末元本の内訳※	
九州ＳＤＧｓ・グローバルバランス	335,853,547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）	999,814,903円
２． 計算日における受益権の総数	
	1,335,668,450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	15,157,641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	0.9887円
(10,000口当たり純資産額)	(9,887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

2022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

2022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）

2022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

	2022年 7月20日現在

種類	損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△7,384,280
地方債証券	△6,106,000
合計	△13,490,280

(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４２７回利付国債（２年）	198,000,000	198,304,920	
	第１４３回利付国債（５年）	198,000,000	198,950,400	
	第１４８回利付国債（５年）	100,000,000	100,176,000	
	第３５３回利付国債（１０年）	200,000,000	199,936,000	
	第３６０回利付国債（１０年）	210,000,000	208,143,600	
	国債証券合計	906,000,000	905,510,920	
地方債証券	令和３年度第２回大分県公募公債	100,000,000	98,085,000	
	令和３年度第４回熊本県公募公債	100,000,000	98,085,000	
	令和３年度第１回宮崎県公募公債	100,000,000	98,038,000	
	令和３年度第１回鹿児島県公募公債	100,000,000	99,686,000	
	地方債証券合計	400,000,000	393,894,000	
合計			1,299,404,920	

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）

	2022年 7月20日現在
資産の部	
流動資産	
預金	4,644,101
コール・ローン	9,095,589
国債証券	179,341,574
特殊債券	637,094,408
未収利息	2,873,200
前払費用	2,605
流動資産合計	833,051,477
資産合計	833,051,477
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	52,354,804
未払金	45,948
未払解約金	20,000
未払利息	24
流動負債合計	52,420,776
負債合計	52,420,776
純資産の部	
元本等	
元本	844,224,449
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△63,593,748
元本等合計	780,630,701
純資産合計	780,630,701
負債純資産合計	833,051,477

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）

2022年 7月20日現在	
１． 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年11月18日
期首元本額	499,468,301円
期中追加設定元本額	512,977,278円
期中一部解約元本額	168,221,130円
期末元本額	844,224,449円
期末元本の内訳※	
九州ＳＤＧｓ・グローバルバランス	444,867,045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）	399,357,404円
２． 計算日における受益権の総数	
	844,224,449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	63,593,748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	0.9247円
(10,000口当たり純資産額)	(9,247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

2022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

2022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）

2022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	2022年 7月20日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△399,881
特殊債券	△3,373,904
合計	△3,773,785

(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)

（2022年 7月20日現在）　　（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	770,729,334	－	823,084,138	△52,354,804
	米ドル	770,729,334	－	823,084,138	△52,354,804
合計		770,729,334	－	823,084,138	△52,354,804

（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	240,000.00	239,030.71	
		US TREASURY N/B	270,000.00	268,934.73	
		US TREASURY N/B	310,000.00	273,423.62	
		US TREASURY N/B	270,000.00	257,639.04	
		US TREASURY N/B	290,000.00	258,949.57	
	米ドル 小計		1,380,000.00	1,297,977.67 (179,341,574)	
国債証券合計				179,341,574 (179,341,574)	
特殊債券	米ドル	EUROPEAN BK RECON & DEV	1,000,000.00	964,560.60	
		EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000.00	988,773.50	
		EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000.00	844,967.90	
		INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000.00	900,660.70	
		KFW	1,000,000.00	911,983.30	
	米ドル 小計		5,000,000.00	4,610,946.00 (637,094,408)	
特殊債券合計				637,094,408 (637,094,408)	
合計				816,435,982 (816,435,982)	

(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	5銘柄	22.0%	22.0%
	特殊債券	5銘柄	78.0%	78.0%

（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）

	2022年 7月20日現在
資産の部	
流動資産	
預金	993,890
コール・ローン	9,427,317
国債証券	204,701,328
特殊債券	526,616,432
派生商品評価勘定	70,571
未収利息	2,000,468
前払費用	142,831
流動資産合計	743,952,837
資産合計	743,952,837
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	25,116,812
未払金	1,357,451
未払利息	25
流動負債合計	26,474,288
負債合計	26,474,288
純資産の部	
元本等	
元本	775,039,813
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△57,561,264
元本等合計	717,478,549
純資産合計	717,478,549
負債純資産合計	743,952,837

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）

2022年 7月20日現在	
1． 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年11月18日
期首元本額	498,959,941円
期中追加設定元本額	435,411,614円
期中一部解約元本額	159,331,742円
期末元本額	775,039,813円
期末元本の内訳※	
九州ＳＤＧｓ・グローバルバランス	376,132,625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）	398,907,188円
2． 計算日における受益権の総数	
	775,039,813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	57,561,264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	0.9257円
(10,000口当たり純資産額)	(9,257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

2022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

2022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）

2022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	2022年 7月20日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△1,921,866
特殊債券	△6,150,594
合計	△8,072,460

(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

(通貨関連)

（2022年 7月20日現在）　（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	698,345,679	－	723,391,920	△25,046,241
	ユーロ	698,345,679	－	723,391,920	△25,046,241
合計		698,345,679	－	723,391,920	△25,046,241

（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	250,000.00	251,602.75	
		GOV OF FRANCE	240,000.00	245,272.80	
		GOV OF FRANCE	250,000.00	240,072.50	
		GOV OF FRANCE	220,000.00	236,256.46	
		GOV OF FRANCE	260,000.00	233,060.22	
		GOV OF FRANCE	280,000.00	239,366.12	
	ユーロ 小計		1,500,000.00	1,445,630.85 (204,701,328)	
国債証券合計				204,701,328 (204,701,328)	
特殊債券	ユーロ	EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000.00	994,284.60	
		EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000.00	856,944.00	
		EUROPEAN UNION	1,000,000.00	960,204.00	
		KFW	1,000,000.00	907,610.00	
	ユーロ 小計		4,000,000.00	3,719,042.60 (526,616,432)	
特殊債券合計				526,616,432 (526,616,432)	
合計				731,317,760 (731,317,760)	

(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	6銘柄	28.0%	28.0%
	特殊債券	4銘柄	72.0%	72.0%

（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新興国債券マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2022年 7月20日現在
資産の部	
流動資産	
預金	89,146,992
コール・ローン	70,530,632
投資信託受益証券	8,836,043,186
未収配当金	185,874,285
流動資産合計	9,181,595,095
資産合計	9,181,595,095
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	32,973
未払金	142,512,520
未払利息	191
流動負債合計	142,545,684
負債合計	142,545,684
純資産の部	
元本等	
元本	8,217,837,630
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	821,211,781
元本等合計	9,039,049,411
純資産合計	9,039,049,411
負債純資産合計	9,181,595,095

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）

2022年 7月20日現在	
１． 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年11月18日
期首元本額	6,293,284,811円
期中追加設定元本額	3,537,632,840円
期中一部解約元本額	1,613,080,021円
期末元本額	8,217,837,630円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド（安定型）	961,142,692円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	931,424,134円
りそなラップ型ファンド（成長型）	551,730,190円
ＤＣりそな　グローバルバランス	20,840,859円
つみたてバランスファンド	1,067,168,229円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	289,676,763円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	178,911,842円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	120,826,086円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	50,790,725円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	33,275,748円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	17,749,384円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	32,633,283円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスＥＳＧ	124,770,667円
九州ＳＤＧｓ・グローバルバランス	47,813,108円

ＦＷりそな先進国＋新興国債券アクティブファンド	56,577,110円
ＦＷりそな新興国債券インデックスファンド	3,269,902,181円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	56,256,100円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	175,289,853円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	205,978,764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）	1,275,854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）	6,320,676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）	17,483,382円
２．　計算日における受益権の総数	
	8,217,837,630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	1.0999円
(10,000口当たり純資産額)	(10,999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

2022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

2022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。

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）

2022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	2022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	△1,668,437,621
合計	△1,668,437,621

(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)

（2022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	110,823,812	－	110,790,839	△32,973
	米ドル	110,823,812	－	110,790,839	△32,973
合計		110,823,812	－	110,790,839	△32,973

（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	1,192,047	49,171,938.75	
		VANECK J.P.MORGAN EM LOCAL	623,832	14,778,580.08	
	米ドル 小計		1,815,879	63,950,518.83 (8,836,043,186)	
合計				8,836,043,186 (8,836,043,186)	

(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

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国内株式ＥＳＧマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2022年 7月20日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	211,268,720
株式	2,216,785,910
投資証券	36,789,400
派生商品評価勘定	3,446,040
未収配当金	2,760,422
前払金	2,111,400
差入委託証拠金	9,222,000
流動資産合計	2,482,383,892
資産合計	2,482,383,892
負債の部	
流動負債	
未払解約金	413,000
未払利息	573
流動負債合計	413,573
負債合計	413,573
純資産の部	
元本等	
元本	1,950,746,165
剰余金	

	2022年 7月20日現在
剰余金又は欠損金（△）	531,224,154
元本等合計	2,481,970,319
純資産合計	2,481,970,319
負債純資産合計	2,482,383,892

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）

2022年 7月20日現在	
１． 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年11月18日
期首元本額	1,717,427,947円
期中追加設定元本額	1,148,947,668円
期中一部解約元本額	915,629,450円
期末元本額	1,950,746,165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	334,562,392円
国内株式ＥＳＧインデックス・オープン	40,095,486円
九州ＳＤＧｓ・グローバルバランス	155,679,960円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　国内株式ＥＳＧインデックス	571,338,032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）	849,070,295円
２． 計算日における受益権の総数	
	1,950,746,165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	1.2723円

(10,000口当たり純資産額)	(12,723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

2022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

2022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）

2022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	2022年 7月20日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
株式	△8,361,806
投資証券	△902,566
合計	△9,264,372

(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)

（2022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	222,521,960	―	225,968,000	3,446,040
合計		222,521,960	―	225,968,000	3,446,040

（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	
マルハニチロ	200	2,475.00	495,000	
ＩＮＰＥＸ	8,300	1,422.00	11,802,600	
コムシスホールディングス	400	2,609.00	1,043,600	
大成建設	800	4,205.00	3,364,000	
大林組	5,200	977.00	5,080,400	
清水建設	4,400	761.00	3,348,400	
鹿島建設	1,700	1,500.00	2,550,000	
戸田建設	800	713.00	570,400	
住友林業	1,100	2,076.00	2,283,600	
大和ハウス工業	4,800	3,253.00	15,614,400	
積水ハウス	4,900	2,404.00	11,779,600	
エクシオグループ	400	2,165.00	866,000	
三機工業	200	1,606.00	321,200	
高砂熱学工業	400	1,685.00	674,000	
大氣社	100	3,190.00	319,000	
千代田化工建設	600	411.00	246,600	
明治ホールディングス	500	6,740.00	3,370,000	
サッポロホールディングス	500	2,909.00	1,454,500	
アサヒグループホールディングス	3,600	4,584.00	16,502,400	
キリンホールディングス	6,500	2,216.50	14,407,250	
サントリー食品インターナショナル	1,100	5,190.00	5,709,000	
伊藤園	200	6,190.00	1,238,000	
不二製油グループ本社	300	2,218.00	665,400	
キッコーマン	1,200	8,030.00	9,636,000	
味の素	3,700	3,455.00	12,783,500	
キユーピー	700	2,265.00	1,585,500	
ハウス食品グループ本社	500	2,947.00	1,473,500	
カゴメ	300	3,380.00	1,014,000	

ニチレイ	900	2,338.00	2,104,200	
日清食品ホールディングス	500	9,550.00	4,775,000	
片倉工業	100	2,083.00	208,300	
東洋紡	600	1,025.00	615,000	
帝人	1,400	1,448.00	2,027,200	
東レ	11,000	745.30	8,198,300	
日本製紙	400	982.00	392,800	
レンゴー	800	758.00	606,400	
クラレ	2,500	1,103.00	2,757,500	
旭化成	10,000	1,076.00	10,760,000	
住友化学	11,900	524.00	6,235,600	
東ソー	1,000	1,768.00	1,768,000	
デンカ	300	3,430.00	1,029,000	
信越化学工業	1,500	16,860.00	25,290,000	
カネカ	400	3,565.00	1,426,000	
三井化学	1,500	2,838.00	4,257,000	
ＪＳＲ	700	3,620.00	2,534,000	
東京応化工業	300	6,980.00	2,094,000	
三菱ケミカルグループ	10,200	744.00	7,588,800	
ダイセル	2,100	852.00	1,789,200	
積水化学工業	3,000	1,913.00	5,739,000	
ＵＢＥ	400	2,091.00	836,400	
日本化薬	500	1,147.00	573,500	
花王	3,800	5,764.00	21,903,200	
日本ペイントホールディングス	3,300	1,035.00	3,415,500	
関西ペイント	1,400	1,914.00	2,679,600	
ＤＩＣ	600	2,453.00	1,471,800	
東洋インキＳＣホールディングス	100	1,943.00	194,300	
富士フイルムホールディングス	2,900	7,618.00	22,092,200	
資生堂	1,600	5,616.00	8,985,600	
ライオン	900	1,537.00	1,383,300	
小林製薬	200	8,930.00	1,786,000	
デクセリアルズ	200	3,785.00	757,000	
日東電工	1,100	8,850.00	9,735,000	
信越ポリマー	200	1,275.00	255,000	
ニフコ	600	3,325.00	1,995,000	

ユニ・チャーム	3,200	4,966.00	15,891,200	
協和キリン	1,100	3,205.00	3,525,500	
アステラス製薬	14,800	2,151.50	31,842,200	
住友ファーマ	700	1,092.00	764,400	
塩野義製薬	2,100	7,540.00	15,834,000	
中外製薬	5,300	3,732.00	19,779,600	
エーザイ	2,000	6,270.00	12,540,000	
小野薬品工業	1,500	3,911.00	5,866,500	
持田製薬	100	3,360.00	336,000	
参天製薬	2,900	1,102.00	3,195,800	
第一三共	14,000	3,586.00	50,204,000	
ＥＮＥＯＳホールディングス	24,400	508.00	12,395,200	
ブリヂストン	2,300	5,275.00	12,132,500	
住友理工	100	617.00	61,700	
太平洋セメント	500	2,023.00	1,011,500	
ＴＯＴＯ	1,100	4,505.00	4,955,500	
日本碍子	1,900	1,953.00	3,710,700	
日本特殊陶業	1,200	2,590.00	3,108,000	
ニチアス	200	2,393.00	478,600	
日本製鉄	3,200	2,036.00	6,515,200	
神戸製鋼所	1,300	635.00	825,500	
ＪＦＥホールディングス	2,000	1,522.00	3,044,000	
日立金属	1,700	2,052.00	3,488,400	
日本軽金属ホールディングス	400	1,563.00	625,200	
三菱マテリアル	900	1,982.00	1,783,800	
住友金属鉱山	2,000	4,113.00	8,226,000	
ＤＯＷＡホールディングス	400	4,710.00	1,884,000	
ＵＡＣＪ	100	2,190.00	219,000	
三浦工業	700	3,215.00	2,250,500	
タクマ	200	1,354.00	270,800	
ナブテスコ	900	3,270.00	2,943,000	
サトーホールディングス	100	1,955.00	195,500	
小松製作所	7,400	2,978.00	22,037,200	
日立建機	900	2,948.00	2,653,200	
クボタ	8,100	2,226.00	18,030,600	
荏原製作所	700	5,180.00	3,626,000	

ダイキン工業	2,000	23,095.00	46,190,000	
栗田工業	800	5,140.00	4,112,000	
ダイフク	800	8,620.00	6,896,000	
グローリー	400	2,195.00	878,000	
セガサミーホールディングス	1,400	2,228.00	3,119,200	
ホシザキ	400	3,995.00	1,598,000	
ＮＴＮ	1,600	256.00	409,600	
日立造船	1,300	824.00	1,071,200	
三菱重工業	1,300	5,037.00	6,548,100	
日清紡ホールディングス	1,100	1,068.00	1,174,800	
イビデン	900	4,035.00	3,631,500	
コニカミノルタ	3,600	468.00	1,684,800	
日立製作所	7,700	6,806.00	52,406,200	
三菱電機	7,700	1,478.50	11,384,450	
安川電機	1,900	4,500.00	8,550,000	
明電舎	100	2,156.00	215,600	
東芝テック	100	4,380.00	438,000	
オムロン	1,500	7,342.00	11,013,000	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	300	2,279.00	683,700	
日本電気	1,000	5,370.00	5,370,000	
富士通	1,600	18,610.00	29,776,000	
セイコーエプソン	1,100	2,026.00	2,228,600	
アルバック	200	4,895.00	979,000	
パナソニック　ホールディングス	17,600	1,148.00	20,204,800	
アンリツ	600	1,545.00	927,000	
ソニーグループ	10,000	11,940.00	119,400,000	
ＴＤＫ	3,100	4,130.00	12,803,000	
アルプスアルパイン	800	1,322.00	1,057,600	
ヒロセ電機	100	18,520.00	1,852,000	
日本航空電子工業	400	2,192.00	876,800	
横河電機	1,800	2,310.00	4,158,000	
アズビル	900	3,930.00	3,537,000	
日本光電工業	300	3,045.00	913,500	
キーエンス	800	54,350.00	43,480,000	
シスメックス	1,300	9,222.00	11,988,600	
スタンレー電気	1,000	2,419.00	2,419,000	

ウシオ電機	400	1,801.00	720,400	
ファナック	800	22,095.00	17,676,000	
ローム	300	9,860.00	2,958,000	
京セラ	1,300	7,340.00	9,542,000	
太陽誘電	500	4,760.00	2,380,000	
村田製作所	4,600	7,857.00	36,142,200	
リコー	2,300	1,085.00	2,495,500	
東京エレクトロン	1,200	45,100.00	54,120,000	
デンソー	1,700	7,718.00	13,120,600	
川崎重工業	600	2,607.00	1,564,200	
トヨタ自動車	84,400	2,194.00	185,173,600	
日野自動車	1,100	756.00	831,600	
マツダ	2,300	1,116.00	2,566,800	
ヤマハ発動機	2,400	2,598.00	6,235,200	
テルモ	5,100	4,434.00	22,613,400	
島津製作所	1,900	4,660.00	8,854,000	
ニコン	2,400	1,534.00	3,681,600	
ＨＯＹＡ	1,500	13,090.00	19,635,000	
シチズン時計	1,000	577.00	577,000	
前田工繊	100	3,065.00	306,500	
大建工業	100	1,954.00	195,400	
大日本印刷	1,800	2,887.00	5,196,600	
アシックス	1,300	2,608.00	3,390,400	
ヤマハ	1,100	5,670.00	6,237,000	
リンテック	300	2,339.00	701,700	
任天堂	900	62,240.00	56,016,000	
コクヨ	700	1,803.00	1,262,100	
美津濃	100	2,521.00	252,100	
中部電力	2,600	1,392.00	3,619,200	
中国電力	1,100	888.00	976,800	
東北電力	1,800	735.00	1,323,000	
四国電力	600	810.00	486,000	
九州電力	3,200	892.00	2,854,400	
電源開発	600	2,256.00	1,353,600	
イーレックス	100	2,305.00	230,500	
レノバ	300	2,392.00	717,600	

東京瓦斯	3,200	2,592.00	8,294,400	
大阪瓦斯	3,000	2,417.00	7,251,000	
東邦瓦斯	600	3,055.00	1,833,000	
東武鉄道	800	3,075.00	2,460,000	
相鉄ホールディングス	600	2,299.00	1,379,400	
東急	4,200	1,602.00	6,728,400	
小田急電鉄	2,300	1,824.00	4,195,200	
京王電鉄	800	4,880.00	3,904,000	
東日本旅客鉄道	1,200	6,825.00	8,190,000	
西日本旅客鉄道	1,700	4,796.00	8,153,200	
西武ホールディングス	1,800	1,288.00	2,318,400	
西日本鉄道	500	2,854.00	1,427,000	
近鉄グループホールディングス	700	4,220.00	2,954,000	
阪急阪神ホールディングス	1,800	3,715.00	6,687,000	
南海電気鉄道	800	2,548.00	2,038,400	
京阪ホールディングス	400	3,275.00	1,310,000	
名古屋鉄道	700	2,093.00	1,465,100	
山九	400	4,120.00	1,648,000	
センコーグループホールディングス	800	910.00	728,000	
福山通運	200	3,205.00	641,000	
日立物流	300	8,610.00	2,583,000	
九州旅客鉄道	1,100	2,758.00	3,033,800	
ＳＧホールディングス	2,300	2,555.00	5,876,500	
ＮＩＰＰＯＮ　ＥＸＰＲＥＳＳホールディングス	600	7,680.00	4,608,000	
日本郵船	1,300	9,890.00	12,857,000	
トランコム	100	7,350.00	735,000	
三井倉庫ホールディングス	100	3,060.00	306,000	
ＴＩＳ	900	3,665.00	3,298,500	
オープンドア	100	1,678.00	167,800	
野村総合研究所	2,700	3,960.00	10,692,000	
メルカリ	800	2,169.00	1,735,200	
Ｚホールディングス	21,200	441.70	9,364,040	
伊藤忠テクノソリューションズ	400	3,555.00	1,422,000	
ネットワンシステムズ	300	3,155.00	946,500	
ＢＩＰＲＯＧＹ	600	2,825.00	1,695,000	

ビジョン	100	1,117.00	111,700	
日本電信電話	4,800	3,896.00	18,700,800	
ＫＤＤＩ	12,800	4,391.00	56,204,800	
ソフトバンク	22,900	1,550.50	35,506,450	
エヌ・ティ・ティ・データ	2,500	1,939.00	4,847,500	
ＳＣＳＫ	1,200	2,328.00	2,793,600	
あらた	100	4,165.00	416,500	
アルフレッサ　ホールディングス	700	1,879.00	1,315,300	
ＴＯＫＡＩホールディングス	400	899.00	359,600	
シップヘルスケアホールディングス	300	2,538.00	761,400	
アズワン	200	6,280.00	1,256,000	
日本ライフライン	200	966.00	193,200	
伊藤忠商事	9,500	3,939.00	37,420,500	
丸紅	6,200	1,242.00	7,700,400	
三井物産	5,600	2,959.50	16,573,200	
キヤノンマーケティングジャパン	400	2,879.00	1,151,600	
サンゲツ	300	1,624.00	487,200	
モスフードサービス	100	3,365.00	336,500	
イエローハット	100	1,772.00	177,200	
スズケン	300	3,860.00	1,158,000	
ローソン	400	4,720.00	1,888,000	
ゲオホールディングス	100	1,373.00	137,300	
ハローズ	100	3,130.00	313,000	
大黒天物産	100	5,310.00	531,000	
ＤＣＭホールディングス	500	1,058.00	529,000	
マツキヨココカラ＆カンパニー	400	5,030.00	2,012,000	
ＺＯＺＯ	500	2,939.00	1,469,500	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	200	1,129.00	225,800	
ノジマ	100	3,025.00	302,500	
イオン北海道	100	1,075.00	107,500	
スギホールディングス	100	5,970.00	597,000	
マックスバリュ東海	100	2,666.00	266,600	
丸井グループ	1,400	2,365.00	3,311,000	
イオン	5,200	2,639.00	13,722,800	
平和堂	100	2,018.00	201,800	

ヤオコー	100	6,470.00	647,000	
ケーズホールディングス	1,300	1,398.00	1,817,400	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	100	3,485.00	348,500	
ヤマダホールディングス	5,800	495.00	2,871,000	
ファーストリテイリング	500	79,550.00	39,775,000	
サンドラッグ	300	3,115.00	934,500	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	47,600	727.40	34,624,240	
りそなホールディングス	17,200	510.90	8,787,480	
三井住友トラスト・ホールディングス	2,700	4,264.00	11,512,800	
三井住友フィナンシャルグループ	5,200	4,120.00	21,424,000	
千葉銀行	2,100	728.00	1,528,800	
静岡銀行	3,600	811.00	2,919,600	
山口フィナンシャルグループ	800	744.00	595,200	
大和証券グループ本社	5,400	627.20	3,386,880	
野村ホールディングス	23,200	517.10	11,996,720	
マネックスグループ	700	472.00	330,400	
ＳＯＭＰＯホールディングス	2,500	5,955.00	14,887,500	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	3,500	4,350.00	15,225,000	
第一生命ホールディングス	8,000	2,345.50	18,764,000	
東京海上ホールディングス	2,500	7,942.00	19,855,000	
Ｔ＆Ｄホールディングス	2,100	1,530.00	3,213,000	
芙蓉総合リース	100	8,050.00	805,000	
東京センチュリー	300	4,680.00	1,404,000	
オリックス	9,500	2,308.00	21,926,000	
ヒューリック	3,100	1,049.00	3,251,900	
野村不動産ホールディングス	900	3,200.00	2,880,000	
東急不動産ホールディングス	2,400	698.00	1,675,200	
三井不動産	7,300	2,872.00	20,965,600	
三菱地所	9,400	1,919.50	18,043,300	
平和不動産	100	3,990.00	399,000	
東京建物	700	1,896.00	1,327,200	
住友不動産	1,200	3,562.00	4,274,400	
綜合警備保障	600	3,975.00	2,385,000	
ディップ	100	3,595.00	359,500	
エスプール	300	1,050.00	315,000	

H．U．グループホールディングス	400	3,165.00	1,266,000	
オリエンタルランド	1,600	18,900.00	30,240,000	
ダスキン	300	3,015.00	904,500	
テクノプロ・ホールディングス	900	3,045.00	2,740,500	
リクルートホールディングス	11,500	4,610.00	53,015,000	
エラン	100	1,051.00	105,100	
インソース	100	2,285.00	228,500	
カーブスホールディングス	200	692.00	138,400	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	100	2,346.00	234,600	
乃村工藝社	600	897.00	538,200	
セコム	800	8,923.00	7,138,400	
メイテック	300	2,355.00	706,500	
ベネッセホールディングス	600	2,291.00	1,374,600	
合　計	778,800		2,216,785,910	

(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	6	925,800	
	産業ファンド投資法人	8	1,477,600	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	3	1,029,000	
	日本プロロジスリート投資法人	17	5,788,500	
	ヒューリックリート投資法人	10	1,604,000	
	積水ハウス・リート投資法人	17	1,354,900	
	野村不動産マスターファンド投資法人	17	2,799,900	
	日本ビルファンド投資法人	12	8,232,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	5	3,145,000	
	日本都市ファンド投資法人	28	2,920,400	
	オリックス不動産投資法人	10	1,850,000	
	日本プライムリアルティ投資法人	7	2,782,500	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	12	1,666,800	
	ジャパンエクセレント投資法人	10	1,213,000	
合計		162	36,789,400	

(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）

	2022年 7月20日現在
資産の部	
流動資産	
預金	188,608,948
コール・ローン	6,824,796
株式	3,852,808,398
投資証券	101,994,988
派生商品評価勘定	11,156,406
未収入金	22,648
未収配当金	3,551,914
差入委託証拠金	59,074,125
流動資産合計	4,224,042,223
資産合計	4,224,042,223
負債の部	
流動負債	
未払利息	18
流動負債合計	18
負債合計	18
純資産の部	
元本等	
元本	2,713,754,291
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	1,510,287,914
元本等合計	4,224,042,205
純資産合計	4,224,042,205
負債純資産合計	4,224,042,223

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）

2022年 7月20日現在	
1． 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年11月18日
期首元本額	1,633,060,563円
期中追加設定元本額	1,391,811,315円
期中一部解約元本額	311,117,587円
期末元本額	2,713,754,291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	889,825,685円
先進国株式ＥＳＧインデックス・オープン	116,274,244円
九州ＳＤＧｓ・グローバルバランス	632,022,197円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　先進国株式ＥＳＧインデックス	1,075,632,165円
2． 計算日における受益権の総数	
	2,713,754,291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	1.5565円

(10,000口当たり純資産額)	(15,565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

2022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

2022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）

2022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	2022年 7月20日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
株式	△649,034,396
投資証券	△13,146,366
合計	△662,180,762

(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)

（2022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	254,545,078	―	265,701,484	11,156,406
合計		254,545,078	―	265,701,484	11,156,406

（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	1,143	28.22	32,255.46	
	CHENIERE ENERGY INC	275	132.11	36,330.25	
	HALLIBURTON CO	1,077	29.46	31,728.42	
	KINDER MORGAN INC	2,447	17.31	42,357.57	
	MARATHON PETROLEUM CORP	678	87.85	59,562.30	
	ONEOK INC	535	58.36	31,222.60	
	PHILLIPS 66	576	85.41	49,196.16	
	SCHLUMBERGER LTD	1,695	34.22	58,002.90	
	TARGA RESOURCES CORP	261	62.64	16,349.04	
	VALERO ENERGY CORP	491	108.74	53,391.34	
	WILLIAMS COS INC	1,457	32.35	47,133.95	
	AMCOR PLC	1,822	12.63	23,011.86	
	BALL CORP	387	69.98	27,082.26	
	CELANESE CORP	130	115.64	15,033.20	
	ECOLAB INC	310	157.80	48,918.00	
	INTERNATIONAL PAPER CO	430	42.61	18,322.30	
	INTL FLAVORS & FRAGRANCES	306	117.70	36,016.20	
	LINDE PLC	615	285.75	175,736.25	
	MARTIN MARIETTA MATERIALS	75	323.12	24,234.00	
	MOSAIC CO/THE	443	48.07	21,295.01	
	NEWMONT CORP	958	54.65	52,354.70	
	NUCOR CORP	323	117.23	37,865.29	
	PPG INDUSTRIES INC	284	119.77	34,014.68	
	SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	297	247.48	73,501.56	
	STEEL DYNAMICS INC	231	66.62	15,389.22	
	WESTROCK CO	318	40.40	12,847.20	
	3M CO	685	132.13	90,509.05	
	ALLEGION PLC	102	100.49	10,249.98	

CARRIER GLOBAL CORP	1,028	37.17	38,210.76	
CATERPILLAR INC	643	179.49	115,412.07	
CUMMINS INC	171	205.05	35,063.55	
DEERE & CO	350	311.59	109,056.50	
DOVER CORP	173	124.91	21,609.43	
EATON CORP PLC	479	132.30	63,371.70	
FASTENAL CO	691	48.50	33,513.50	
FORTIVE CORP	409	56.60	23,149.40	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	153	65.41	10,007.73	
GENERAC HOLDINGS INC	77	230.58	17,754.66	
IDEX CORP	92	189.39	17,423.88	
ILLINOIS TOOL WORKS	376	187.46	70,484.96	
INGERSOLL-RAND INC	490	43.27	21,202.30	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	844	48.66	41,069.04	
KORNIT DIGITAL LTD	60	26.98	1,618.80	
LENNOX INTERNATIONAL INC	38	219.83	8,353.54	
MASCO CORP	276	54.32	14,992.32	
OTIS WORLDWIDE CORP	510	71.84	36,638.40	
OWENS CORNING	115	82.82	9,524.30	
PENTAIR PLC	189	47.97	9,066.33	
PLUG POWER INC	625	17.30	10,812.50	
QUANTA SERVICES INC	173	131.11	22,682.03	
ROCKWELL AUTOMATION INC	140	216.40	30,296.00	
SMITH (A.O.) CORP	158	57.51	9,086.58	
SNAP-ON INC	65	207.55	13,490.75	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	281	132.64	37,271.84	
UNITED RENTALS INC	87	270.51	23,534.37	
WW GRAINGER INC	55	465.93	25,626.15	
XYLEM INC	216	79.78	17,232.48	
COPART INC	256	121.41	31,080.96	
REPUBLIC SERVICES INC	265	128.89	34,155.85	
ROBERT HALF INTL INC	133	81.50	10,839.50	
ROLLINS INC	264	36.44	9,620.16	
AMERCO	12	495.01	5,940.12	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	148	100.93	14,937.64	

CSX CORP	2,634	29.72	78,282.48	
DELTA AIR LINES INC	193	32.60	6,291.80	
EXPEDITORS INTL WASH INC	204	100.13	20,426.52	
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	1,316	2.82	3,711.12	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	101	174.46	17,620.46	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	191	50.56	9,656.96	
NORFOLK SOUTHERN CORP	288	236.19	68,022.72	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	117	270.65	31,666.05	
UNION PACIFIC CORP	764	216.90	165,711.60	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	879	185.81	163,326.99	
APTIV PLC	326	97.11	31,657.86	
BORGWARNER INC	274	35.74	9,792.76	
LEAR CORP	73	138.67	10,122.91	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	217	31.71	6,881.07	
TESLA INC	1,054	736.59	776,365.86	
HASBRO INC	149	79.98	11,917.02	
LULULEMON ATHLETICA INC	142	296.34	42,080.28	
NEWELL RUBBERMAID INC	491	19.80	9,721.80	
NIKE INC -CL B	1,532	109.19	167,279.08	
VF CORP	398	47.77	19,012.46	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	336	121.41	40,793.76	
MCDONALD'S CORP	892	256.50	228,798.00	
VAIL RESORTS INC	46	227.32	10,456.72	
ALPHABET INC-CL A	7,220	113.81	821,708.20	
ALPHABET INC-CL C	6,820	114.62	781,708.40	
CABLE ONE INC	6	1,392.18	8,353.08	
ELECTRONIC ARTS INC	337	126.75	42,714.75	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	470	29.65	13,935.50	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	1,044	6.48	6,765.12	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	193	126.97	24,505.21	
WALT DISNEY CO/THE	2,183	99.61	217,448.63	
WARNER BROS DISCOVERY INC	2,667	14.25	38,004.75	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	312	38.57	12,033.84	
ADVANCE AUTO PARTS INC	74	190.65	14,108.10	
BEST BUY CO INC	260	75.97	19,752.20	

BURLINGTON STORES INC	80	147.49	11,799.20	
CARMAX INC	194	96.16	18,655.04	
EBAY INC	706	45.38	32,038.28	
GENUINE PARTS CO	171	141.79	24,246.09	
HOME DEPOT INC	1,253	299.83	375,686.99	
LKQ CORP	314	52.76	16,566.64	
LOWE'S COS INC	804	188.78	151,779.12	
MERCADOLIBRE INC	55	724.75	39,861.25	
POOL CORP	48	386.49	18,551.52	
TARGET CORP	575	153.36	88,182.00	
TJX COMPANIES INC	1,432	62.65	89,714.80	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	136	205.63	27,965.68	
ULTA BEAUTY INC	65	402.36	26,153.40	
KROGER CO	840	47.30	39,732.00	
BUNGE LTD	174	90.00	15,660.00	
CAMPBELL SOUP CO	263	48.42	12,734.46	
COCA-COLA CO/THE	4,949	62.53	309,460.97	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	241	51.39	12,384.99	
CONAGRA BRANDS INC	590	33.45	19,735.50	
GENERAL MILLS INC	730	74.37	54,290.10	
HORMEL FOODS CORP	368	47.72	17,560.96	
KELLOGG CO	314	71.95	22,592.30	
KEURIG DR PEPPER INC	949	36.48	34,619.52	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	305	81.96	24,997.80	
PEPSICO INC	1,662	170.06	282,639.72	
CLOROX COMPANY	148	149.72	22,158.56	
COLGATE-PALMOLIVE CO	959	77.53	74,351.27	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	279	255.40	71,256.60	
KIMBERLY-CLARK CORP	405	132.24	53,557.20	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	2,876	144.04	414,259.04	
ABIOMED INC	55	269.35	14,814.25	
ALIGN TECHNOLOGY INC	90	267.31	24,057.90	
AMERISOURCEBERGEN CORP	188	143.09	26,900.92	
BAXTER INTERNATIONAL INC	602	65.32	39,322.64	
CARDINAL HEALTH INC	332	55.68	18,485.76	

CIGNA CORP	385	274.60	105,721.00	
DAVITA INC	69	87.67	6,049.23	
DENTSPLY SIRONA INC	263	35.88	9,436.44	
DEXCOM INC	464	80.64	37,416.96	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	747	101.24	75,626.28	
ELEVANCE HEALTH INC	289	497.43	143,757.27	
HCA HEALTHCARE INC	291	178.18	51,850.38	
HOLOGIC INC	300	70.49	21,147.00	
HUMANA INC	152	495.31	75,287.12	
IDEXX LABORATORIES INC	101	377.10	38,087.10	
INSULET CORP	83	231.21	19,190.43	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	112	245.94	27,545.28	
NOVOCURE LTD	113	73.67	8,324.71	
QUEST DIAGNOSTICS INC	143	136.66	19,542.38	
RESMED INC	175	224.76	39,333.00	
STERIS PLC	120	212.97	25,556.40	
TELADOC HEALTH INC	192	41.15	7,900.80	
TELEFLEX INC	53	254.55	13,491.15	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	360	119.06	42,861.60	
AMGEN INC	668	247.32	165,209.76	
BIO-TECHNE CORP	47	350.24	16,461.28	
BIOGEN INC	176	220.26	38,765.76	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	221	86.09	19,025.89	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	2,615	73.14	191,261.10	
CATALENT INC	204	102.72	20,954.88	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	514	20.62	10,598.68	
ELI LILLY & CO	971	326.20	316,740.20	
GILEAD SCIENCES INC	1,504	62.12	93,428.48	
ILLUMINA INC	188	194.64	36,592.32	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	70	158.93	11,125.10	
JOHNSON & JOHNSON	3,154	171.69	541,510.26	
MERCK & CO. INC.	3,033	92.36	280,127.88	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	27	1,156.87	31,235.49	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	469	536.87	251,792.03	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	305	289.60	88,328.00	

WATERS CORP	73	330.76	24,145.48	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	89	300.19	26,716.91	
ZOETIS INC	566	177.42	100,419.72	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	595	37.89	22,544.55	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	212	157.55	33,400.60	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	1,727	13.04	22,520.08	
KEYCORP	1,114	18.05	20,107.70	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	502	160.19	80,415.38	
REGIONS FINANCIAL CORP	1,125	20.04	22,545.00	
SVB FINANCIAL GROUP	71	426.70	30,295.70	
TRUIST FINANCIAL CORP	1,594	48.31	77,006.14	
US BANCORP	1,692	47.46	80,302.32	
WEBSTER FINANCIAL CORP	219	45.34	9,929.46	
ALLY FINANCIAL INC	391	33.32	13,028.12	
AMERICAN EXPRESS CO	775	147.78	114,529.50	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	133	238.08	31,664.64	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	918	43.58	40,006.44	
BLACKROCK INC	182	628.34	114,357.88	
CARLYLE GROUP INC/THE	236	33.86	7,990.96	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	128	121.86	15,598.08	
CME GROUP INC	431	203.82	87,846.42	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	342	108.82	37,216.44	
EQUITABLE HOLDINGS INC	469	26.35	12,358.15	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	46	399.67	18,384.82	
FRANKLIN RESOURCES INC	340	25.37	8,625.80	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	675	96.81	65,346.75	
INVESCO LTD	395	16.86	6,659.70	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	96	187.01	17,952.96	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	43	274.74	11,813.82	
MOODY'S CORP	200	289.14	57,828.00	
MORGAN STANLEY	1,603	81.65	130,884.95	
NASDAQ INC	138	159.32	21,986.16	
NORTHERN TRUST CORP	237	101.22	23,989.14	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	225	93.72	21,087.00	
S&P GLOBAL INC	425	357.14	151,784.50	

SCHWAB (CHARLES) CORP	1,739	63.20	109,904.80	
STATE STREET CORP	440	67.33	29,625.20	
SYNCHRONY FINANCIAL	627	32.89	20,622.03	
T ROWE PRICE GROUP INC	274	119.05	32,619.70	
AFLAC INC	740	54.97	40,677.80	
ALLSTATE CORP	334	122.63	40,958.42	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	977	51.74	50,549.98	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	454	43.88	19,921.52	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	250	166.52	41,630.00	
ASSURANT INC	66	168.29	11,107.14	
CHUBB LTD	511	185.72	94,902.92	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	398	63.48	25,265.04	
LINCOLN NATIONAL CORP	194	49.06	9,517.64	
LOEWS CORP	244	57.73	14,086.12	
MARSH & MCLENNAN COS	603	153.28	92,427.84	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	313	63.87	19,991.31	
PROGRESSIVE CORP	701	111.96	78,483.96	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	451	95.17	42,921.67	
TRAVELERS COS INC/THE	290	158.35	45,921.50	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	141	198.47	27,984.27	
CBRE GROUP INC - A	403	79.51	32,042.53	
ACCENTURE PLC-CL A	758	280.04	212,270.32	
ADOBE INC	566	387.83	219,511.78	
ANSYS INC	105	247.86	26,025.30	
AUTODESK INC	264	184.76	48,776.64	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	504	218.95	110,350.80	
CADENCE DESIGN SYS INC	333	161.58	53,806.14	
CITRIX SYSTEMS INC	151	102.57	15,488.07	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	95	72.22	6,860.90	
HUBSPOT INC	54	283.63	15,316.02	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	1,079	130.88	141,219.52	
INTUIT INC	323	403.86	130,446.78	
MASTERCARD INC-CLASS A	1,047	340.38	356,377.86	
MICROSOFT CORP	8,544	259.53	2,217,424.32	
NORTONLIFELOCK INC	698	24.69	17,233.62	

	ROPER TECHNOLOGIES INC	127	404.13	51,324.51	
	SALESFORCE INC	1,182	173.81	205,443.42	
	SERVICENOW INC	240	435.94	104,625.60	
	SPLUNK INC	190	99.40	18,886.00	
	VISA INC-CLASS A SHARES	1,990	213.66	425,183.40	
	VMWARE INC-CLASS A	251	114.14	28,649.14	
	WESTERN UNION CO	474	16.90	8,010.60	
	ZENDESK INC	147	74.97	11,020.59	
	CISCO SYSTEMS INC	4,985	44.03	219,489.55	
	COGNEX CORP	211	46.98	9,912.78	
	HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	1,565	13.78	21,565.70	
	HP INC	1,248	32.83	40,971.84	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	220	147.55	32,461.00	
	MOTOROLA SOLUTIONS INC	202	218.28	44,092.56	
	TRIMBLE INC	302	60.88	18,385.76	
	ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	64	311.91	19,962.24	
	LUMEN TECHNOLOGIES INC	1,110	11.04	12,254.40	
	VERIZON COMMUNICATIONS INC	5,037	50.45	254,116.65	
	AMERICAN WATER WORKS CO INC	218	146.77	31,995.86	
	ATMOS ENERGY CORP	163	113.47	18,495.61	
	CONSOLIDATED EDISON INC	425	92.22	39,193.50	
	EDISON INTERNATIONAL	458	61.64	28,231.12	
	ESSENTIAL UTILITIES INC	272	47.43	12,900.96	
	EVERSOURCE ENERGY	414	83.25	34,465.50	
	SEMPRA ENERGY	379	151.59	57,452.61	
	UGI CORP	240	41.16	9,878.40	
	APPLIED MATERIALS INC	1,060	98.23	104,123.80	
	INTEL CORP	4,886	40.22	196,514.92	
	LAM RESEARCH CORP	167	446.94	74,638.98	
	NVIDIA CORP	2,999	169.92	509,590.08	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	315	170.43	53,685.45	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	1,108	164.64	182,421.12	
米ドル 小計		179,653		20,400,231.40 (2,818,699,972)	
カナダドル	CAMECO CORP	480	30.49	14,635.20	

	ENBRIDGE INC	2,431	55.55	135,042.05	
	KEYERA CORP	264	32.00	8,448.00	
	PARKLAND CORP	182	34.76	6,326.32	
	PEMBINA PIPELINE CORP	660	47.02	31,033.20	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	550	55.30	30,415.00	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	746	7.08	5,281.68	
	KINROSS GOLD CORP	1,459	4.23	6,171.57	
	LUNDIN MINING CORP	820	7.70	6,314.00	
	NUTRIEN LTD	663	100.95	66,929.85	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	543	43.76	23,761.68	
	CAE INC	386	33.71	13,012.06	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	100	103.03	10,303.00	
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS	124	88.52	10,976.48	
	THOMSON REUTERS CORP	204	137.61	28,072.44	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	715	148.60	106,249.00	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	345	78.00	26,910.00	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	214	36.64	7,840.96	
	CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	63	166.63	10,497.69	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	1,019	52.27	53,263.13	
	METRO INC	293	69.76	20,439.68	
	BANK OF MONTREAL	778	123.97	96,448.66	
	BANK OF NOVA SCOTIA	1,459	74.88	109,249.92	
	NATIONAL BANK OF CANADA	407	87.88	35,767.16	
	TORONTO-DOMINION BANK	2,187	81.98	179,290.26	
	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	1,695	60.29	102,191.55	
	INTACT FINANCIAL CORP	211	182.37	38,480.07	
	POWER CORP OF CANADA	671	33.94	22,773.74	
	FIRSTSERVICE CORP	49	167.01	8,183.49	
	OPEN TEXT CORP	327	51.07	16,699.89	
	SHOPIFY INC - CLASS A	1,370	44.23	60,595.10	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	427	60.73	25,931.71	
	TELUS CORP	549	28.80	15,811.20	
	FORTIS INC	569	59.90	34,083.10	
	HYDRO ONE LTD	375	34.61	12,978.75	
	NORTHLAND POWER INC	280	40.33	11,292.40	

カナダドル 小計		23,615		1,391,699.99 (149,454,661)	
ユーロ	GALP ENERGIA SGPS SA	614	9.99	6,133.86	
	NESTE OYJ	510	45.77	23,342.70	
	OMV AG	170	42.21	7,175.70	
	REPSOL SA	1,733	12.11	20,986.63	
	TENARIS SA	571	12.72	7,265.97	
	TOTALENERGIES SE	2,975	49.10	146,072.50	
	AIR LIQUIDE SA	628	129.06	81,049.68	
	AKZO NOBEL	219	66.22	14,502.18	
	CRH PLC	917	35.28	32,351.76	
	EVONIK INDUSTRIES AG	257	21.14	5,432.98	
	HEIDELBERGCEMENT AG	169	49.79	8,414.51	
	KONINKLIJKE DSM NV	210	146.70	30,807.00	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	293	33.77	9,894.61	
	SOLVAY SA	82	82.86	6,794.52	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	672	16.03	10,772.16	
	SYMRISE AG	161	106.85	17,202.85	
	UMICORE	256	33.91	8,680.96	
	UPM-KYMMENE OYJ	646	30.21	19,515.66	
	VOESTALPINE AG	119	20.74	2,468.06	
	ALSTOM	385	24.14	9,293.90	
	BOUYGUES SA	262	28.83	7,553.46	
	BRENNTAG SE	187	62.76	11,736.12	
	CNH INDUSTRIAL NV	1,234	11.59	14,302.06	
	EIFFAGE	102	89.42	9,120.84	
	GEA GROUP AG	188	33.37	6,273.56	
	IMCD NV	69	140.30	9,680.70	
	KINGSPAN GROUP PLC	184	55.64	10,237.76	
	MTU AERO ENGINES AG	65	189.00	12,285.00	
	PRYSMIAN SPA	310	27.50	8,525.00	
	SCHNEIDER ELECTRIC SE	649	121.14	78,619.86	
	WARTSILA OYJ ABP	535	8.10	4,337.78	
	BUREAU VERITAS SA	335	25.46	8,529.10	
	RANDSTAD NV	137	50.42	6,907.54	

TELEPERFORMANCE	71	322.60	22,904.60	
WOLTERS KLUWER	314	99.42	31,217.88	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	400	78.07	31,228.00	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	65	72.85	4,735.25	
MICHELIN(CGDE)	820	27.89	22,869.80	
VALEO SA	238	19.71	4,692.17	
ADIDAS AG	205	176.10	36,100.50	
ESSILORLUXOTTICA	346	153.45	53,093.70	
KERING	90	528.30	47,547.00	
PUMA SE	129	67.30	8,681.70	
SEB SA	29	93.30	2,705.70	
ACCOR SA	201	28.45	5,718.45	
PUBLICIS GROUPE	273	46.41	12,669.93	
VIVENDI	892	9.85	8,791.55	
D'IETEREN GROUP	31	151.60	4,699.60	
DELIVERY HERO SE	187	38.74	7,244.38	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	1,307	25.01	32,688.07	
PROSUS NV	1,006	67.20	67,603.20	
ZALANDO SE	271	27.91	7,563.61	
CARREFOUR SA	710	16.99	12,062.90	
HELLOFRESH SE	192	32.69	6,276.48	
JERONIMO MARTINS	352	21.42	7,539.84	
KESKO OYJ-B SHS	341	23.78	8,108.98	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N.V.	1,260	26.17	32,974.20	
DANONE	793	54.62	43,313.66	
JDE PEET'S BV	101	28.02	2,830.02	
KERRY GROUP PLC-A	194	97.12	18,841.28	
BEIERSDORF AG	114	99.18	11,306.52	
HENKEL AG & CO KGAA	118	60.50	7,139.00	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	217	61.02	13,241.34	
L'OREAL	290	347.20	100,688.00	
AMPLIFON SPA	134	29.80	3,993.20	
BIOMERIEUX	50	104.40	5,220.00	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	49	130.55	6,396.95	
MERCK KGAA	156	171.10	26,691.60	

	ORION OYJ-CLASS B	119	45.94	5,466.86	
	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	7,984	4.26	34,015.83	
	BNP PARIBAS	1,334	43.90	58,562.60	
	COMMERZBANK AG	1,299	6.63	8,622.76	
	ING GROEP NV-CVA	4,687	9.19	43,073.53	
	INTESA SANPAOLO	19,844	1.77	35,175.47	
	KBC GROEP NV	302	50.00	15,100.00	
	SOCIETE GENERALE SA	958	20.97	20,089.26	
	DEUTSCHE BOERSE AG	229	160.60	36,777.40	
	ALLIANZ SE-REG	490	176.36	86,416.40	
	AXA SA	2,326	21.40	49,776.40	
	NN GROUP NV	343	44.29	15,191.47	
	SAMPO OYJ-A SHS	601	40.71	24,466.71	
	LEG IMMOBILIEN SE	90	81.52	7,336.80	
	NEXI SPA	632	8.31	5,256.97	
	SAP SE	1,254	89.55	112,295.70	
	WORLDLINE SA	287	37.22	10,682.14	
	ELISA OYJ	175	52.76	9,233.00	
	KONINKLIJKE KPN NV	3,984	3.39	13,505.76	
	ORANGE	2,405	10.54	25,363.13	
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	1,281	2.81	3,607.29	
	ENEL SPA	9,774	4.97	48,610.98	
	IBERDROLA SA	6,948	9.84	68,368.32	
	NATURGY ENERGY GROUP SA	198	28.65	5,672.70	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	467	18.17	8,485.39	
	VERBUND AG	88	105.30	9,266.40	
	ASML HOLDING NV	488	484.80	236,582.40	
ユーロ 小計		96,377		2,372,647.70 (335,966,914)	
英ポンド	ANTOFAGASTA PLC	451	10.46	4,719.71	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	169	68.88	11,640.72	
	JOHNSON MATTHEY PLC	202	20.96	4,233.92	
	MONDI PLC	594	14.94	8,874.36	
	ASHTEAD GROUP PLC	536	39.39	21,113.04	
	BUNZL PLC	410	29.29	12,008.90	

DCC PLC	114	53.26	6,071.64	
FERGUSON PLC	264	95.40	25,185.60	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	84	108.15	9,084.60	
INTERTEK GROUP PLC	195	43.92	8,564.40	
RELX PLC	2,321	23.11	53,638.31	
RENTOKIL INITIAL PLC	2,235	5.13	11,483.43	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	1,114	4.85	5,402.90	
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	138	40.55	5,595.90	
BURBERRY GROUP PLC	490	17.16	8,408.40	
PERSIMMON PLC	391	18.11	7,082.96	
TAYLOR WIMPEY PLC	4,279	1.20	5,162.61	
COMPASS GROUP PLC	2,149	18.52	39,810.22	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	225	47.69	10,730.25	
WHITBREAD PLC	234	26.81	6,273.54	
INFORMA PLC	1,802	5.68	10,246.17	
PEARSON PLC	832	7.75	6,454.65	
WPP PLC	1,370	8.35	11,442.24	
KINGFISHER PLC	2,512	2.59	6,508.59	
NEXT PLC	152	65.66	9,980.32	
OCADO GROUP PLC	521	7.54	3,932.50	
SAINSBURY (J) PLC	2,039	2.16	4,416.47	
TESCO PLC	9,222	2.62	24,189.30	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	453	16.67	7,551.51	
COCA-COLA HBC AG-DI	225	19.45	4,377.37	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	860	64.24	55,246.40	
UNILEVER PLC	3,076	39.43	121,286.68	
HALEON PLC	6,103	3.01	18,370.03	
NMC HEALTH PLC	5	0.00	0.00	
ASTRAZENECA PLC	1,860	112.32	208,915.20	
GSK PLC	4,882	17.83	87,065.58	
HSBC HOLDINGS PLC	24,313	5.23	127,254.24	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	85,361	0.44	37,618.59	
ABRDN PLC	2,675	1.58	4,245.22	
SCHRODERS PLC	144	27.58	3,971.52	
ST JAMES'S PLACE PLC	662	11.62	7,695.75	

	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	7,182	2.54	18,278.19	
	PRUDENTIAL PLC	3,300	10.22	33,742.50	
	BT GROUP PLC	8,401	1.81	15,243.61	
	VODAFONE GROUP PLC	32,411	1.31	42,458.41	
	NATIONAL GRID PLC	4,383	11.07	48,519.81	
英ポンド 小計		221,341		1,184,096.26 (196,571,820)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	242	17.58	4,254.36	
	GIVAUDAN-REG	11	3,329.00	36,619.00	
	SIKA AG-REG	176	229.70	40,427.20	
	ABB LTD-REG	1,986	27.12	53,860.32	
	GEBERIT AG-REG	44	484.70	21,326.80	
	ADECCO SA-REG	202	33.93	6,853.86	
	SGS SA-REG	8	2,192.00	17,536.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	67	237.50	15,912.50	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	631	106.05	66,917.55	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	2	9,630.00	19,260.00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	66	329.70	21,760.20	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	137	122.05	16,720.85	
	LONZA GROUP AG-REG	90	574.40	51,696.00	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	844	330.35	278,815.40	
	VIFOR PHARMA AG-NEW	57	168.00	9,576.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	38	483.00	18,354.00	
	SWISS RE AG	367	72.96	26,776.32	
	TEMENOS GROUP AG-REG	80	79.08	6,326.40	
スイスフラン 小計		5,048		712,992.76 (101,801,106)	
スウェーデンクローナ	BOLIDEN AB	331	317.80	105,191.80	
	HOLMEN AB-B SHARES	114	432.30	49,282.20	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	735	153.40	112,749.00	
	ALFA LAVAL AB	358	269.20	96,373.60	
	ASSA ABLOY AB-B	1,205	228.40	275,222.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	3,229	107.36	346,665.44	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	1,880	95.66	179,840.80	
	EPIROC AB-A	794	170.45	135,337.30	

	EPIROC AB-B	471	151.25	71,238.75	
	HUSQVARNA AB-B SHS	424	78.80	33,411.20	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	1,826	87.40	159,592.40	
	SANDVIK AB	1,283	172.15	220,868.45	
	SKF AB-B SHARES	443	171.10	75,797.30	
	ELECTROLUX AB-B	275	146.36	40,249.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	881	133.88	117,948.28	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	735	272.40	200,214.00	
	NORDEA BANK ABP	3,974	97.70	388,259.80	
	EQT AB	358	225.90	80,872.20	
	ERICSSON LM-B SHS	3,512	73.67	258,729.04	
	TELE2 AB-B SHS	691	115.65	79,914.15	
	TELIA CO AB	3,051	39.50	120,514.50	
スウェーデンクローナ 小計		26,570		3,148,271.21 (42,659,074)	
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	379	333.70	126,472.30	
	EQUINOR ASA	1,174	339.80	398,925.20	
	NORSK HYDRO ASA	1,518	55.66	84,491.88	
	MOWI ASA	520	221.40	115,128.00	
	ORKLA ASA	905	82.64	74,789.20	
	SALMAR ASA	78	679.00	52,962.00	
	DNB BANK ASA	1,120	187.85	210,392.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	244	200.40	48,897.60	
	TELENOR ASA	792	125.45	99,356.40	
ノルウェークローネ 小計		6,730		1,211,414.58 (16,923,461)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	129	451.20	58,204.80	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	234	441.50	103,311.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	1,216	166.04	201,904.64	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	4	18,230.00	72,920.00	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-B	6	18,430.00	110,580.00	
	PANDORA A/S	117	504.80	59,061.60	
	COLOPLAST-B	143	829.60	118,632.80	
	DEMANT A/S	127	269.20	34,188.40	
	GN STORE NORD A/S	159	241.70	38,430.30	

	GENMAB A/S	79	2,595.00	205,005.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	2,021	838.60	1,694,810.60	
	ORSTED A/S	228	815.00	185,820.00	
デンマーククローネ 小計		4,463		2,882,869.14 (54,832,171)	
オーストラリアドル	SANTOS LTD	3,867	7.24	27,997.08	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	2,265	32.43	73,453.95	
	BLUESCOPE STEEL LTD	603	15.64	9,430.92	
	EVOLUTION MINING LTD	2,008	2.28	4,578.24	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	2,041	17.01	34,717.41	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	505	32.75	16,538.75	
	MINERAL RESOURCES LTD	208	45.14	9,389.12	
	NEWCREST MINING LTD	1,076	18.53	19,938.28	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	1,429	6.76	9,660.04	
	ORICA LTD	514	16.16	8,306.24	
	BRAMBLES LTD	1,728	11.32	19,560.96	
	AURIZON HOLDINGS LTD	2,255	3.89	8,771.95	
	TRANSURBAN GROUP	3,696	14.35	53,037.60	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	730	35.59	25,980.70	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	75	71.03	5,327.25	
	IDP EDUCATION LTD	259	25.47	6,596.73	
	REA GROUP LTD	54	118.33	6,389.82	
	SEEK LTD	405	21.48	8,699.40	
	COLES GROUP LTD	1,618	18.72	30,288.96	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	1,658	7.90	13,098.20	
	COCHLEAR LTD	79	201.66	15,931.14	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	221	70.31	15,538.51	
	SONIC HEALTHCARE LTD	521	32.95	17,166.95	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	3,368	21.64	72,883.52	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	2,048	94.95	194,457.60	
	ASX LTD	235	84.74	19,913.90	
	MACQUARIE GROUP LTD	438	167.63	73,421.94	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	1,786	11.59	20,699.74	
	SUNCORP GROUP LTD	1,525	11.19	17,064.75	
	LENDLEASE GROUP	769	9.30	7,151.70	

	COMPUTERSHARE LTD	658	25.38	16,700.04	
	XERO LTD	151	82.73	12,492.23	
	TELSTRA CORP LTD	4,977	3.93	19,559.61	
	APA GROUP	1,437	11.96	17,186.52	
オーストラリアドル 小計		45,207		911,929.75 (87,007,217)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	1,292	7.32	9,457.44	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	782	20.42	15,968.44	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	2,037	5.02	10,225.74	
	MERCURY NZ LTD	826	5.95	4,914.70	
	MERIDIAN ENERGY LTD	1,514	4.86	7,358.04	
ニュージーランドドル 小計		6,451		47,924.36 (4,132,038)	
香港ドル	MTR CORP	2,023	41.35	83,651.05	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	2,400	15.12	36,288.00	
	WH GROUP LTD	10,500	5.85	61,425.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	4,242	27.55	116,867.10	
	HANG SENG BANK LTD	861	127.60	109,863.60	
	AIA GROUP LTD	14,600	83.55	1,219,830.00	
	SINO LAND CO	4,000	11.78	47,120.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	672	45.20	30,374.40	
	SWIRE PROPERTIES LTD	1,004	18.58	18,654.32	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	4,289	10.94	46,921.66	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD (CKI)	1,000	48.45	48,450.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	13,079	8.27	108,163.33	
香港ドル 小計		58,670		1,927,608.46 (33,925,908)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	1,809	6.43	11,631.87	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	1,587	5.35	8,490.45	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	1,400	26.46	37,044.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	1,080	9.80	10,584.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	3,105	3.79	11,767.95	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	368	7.62	2,804.16	
	UOL GROUP LTD	593	7.26	4,305.18	
		9,942		86,627.61	

シンガポールドル 小計				(8,608,185)	
イスラエルシュケル	BANK LEUMI LE-ISRAEL	1,739	31.85	55,387.15	
イスラエルシュケル 小計		1,739		55,387.15 (2,225,871)	
合　計		685,806		3,852,808,398 (3,852,808,398)	

(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	AMERICAN TOWER CORP	547	140,666.52	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	1,890	12,001.50	
		BOSTON PROPERTIES INC	180	16,191.00	
		CROWN CASTLE INTL CORP	519	90,062.07	
		EQUINIX INC	109	69,474.42	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	651	17,218.95	
		PROLOGIS INC	889	111,222.79	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	131	42,282.87	
		VENTAS INC	481	24,766.69	
		WELLTOWER INC	538	44,185.94	
		WEYERHAEUSER CO	898	31,573.68	
	米ドル 小計		6,833	599,646.43 (82,853,147)	
	カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	88	3,923.92	
	カナダドル 小計		88	3,923.92 (421,389)	
	ユーロ	COVIVIO	62	3,561.90	
		GECINA SA	51	4,740.45	
		KLEPIERRE	268	5,673.56	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	132	6,656.76	
	ユーロ 小計		513	20,632.67 (2,921,586)	

	英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	1,024	4,819.96	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	819	5,734.63	
		SEGRO PLC	1,457	14,999.81	
	英ポンド 小計		3,300	25,554.40 (4,242,285)	
	オーストラリアドル	DEXUS/AU	1,321	12,377.77	
		GOODMAN GROUP	2,029	37,719.11	
		GPT GROUP	2,220	9,812.40	
		MIRVAC GROUP	4,565	9,495.20	
		SCENTRE GROUP	6,335	17,484.60	
		STOCKLAND	2,945	11,191.00	
		VICINITY CENTRES	4,659	9,131.64	
	オーストラリアドル 小計		24,074	107,211.72 (10,229,070)	
	シンガポールドル	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	6,392	13,359.28	
	シンガポールドル 小計		6,392	13,359.28 (1,327,511)	
合計				101,994,988 (101,994,988)	

(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	270銘柄	97.1%	—	71.2%
	投資証券	11銘柄	—	2.9%	2.1%
カナダドル	株式	36銘柄	99.7%	—	3.8%
	投資証券	1銘柄	—	0.3%	0.0%
ユーロ	株式	95銘柄	99.1%	—	8.4%
	投資証券	4銘柄	—	0.9%	0.1%
英ポンド	株式	46銘柄	97.9%	—	5.0%
	投資証券	3銘柄	—	2.1%	0.1%
スイスフラン	株式	18銘柄	100.0%	—	2.6%

スウェーデンクローナ	株式	21銘柄	100.0%	—	1.1%
ノルウェークローネ	株式	9銘柄	100.0%	—	0.4%
デンマーククローネ	株式	12銘柄	100.0%	—	1.4%
オーストラリアドル	株式	34銘柄	89.5%	—	2.2%
	投資証券	7銘柄	—	10.5%	0.3%
ニュージーランドドル	株式	5銘柄	100.0%	—	0.1%
香港ドル	株式	12銘柄	100.0%	—	0.9%
シンガポールドル	株式	7銘柄	86.6%	—	0.2%
	投資証券	1銘柄	—	13.4%	0.0%
イスラエルシュケル	株式	1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。

ＲＭ新興国株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2022年 7月20日現在
資産の部	
流動資産	
預金	1,123,191,358
コール・ローン	74,840,025
株式	16,515,724,971
投資証券	17,864,001
派生商品評価勘定	5,028,930
未収入金	2,362,971
未収配当金	120,585,322
差入委託証拠金	916,283,387
流動資産合計	18,775,880,965
資産合計	18,775,880,965
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	29,781,862
未払利息	202

	2022年 7月20日現在
流動負債合計	29,782,064
負債合計	29,782,064
純資産の部	
元本等	
元本	11,648,718,312
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	7,097,380,589
元本等合計	18,746,098,901
純資産合計	18,746,098,901
負債純資産合計	18,775,880,965

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）

2022年 7月20日現在	
１．　投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年11月18日
期首元本額	10,666,188,927円
期中追加設定元本額	4,287,435,258円
期中一部解約元本額	3,304,905,873円
期末元本額	11,648,718,312円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド（安定型）	667,152,665円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	1,634,071,055円
りそなラップ型ファンド（成長型）	1,844,150,728円
ＤＣりそな　グローバルバランス	14,466,031円
つみたてバランスファンド	727,701,681円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	391,954,726円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	251,209,081円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	169,146,750円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	68,923,603円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	45,297,353円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	24,197,946円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	45,010,818円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスＥＳＧ	145,236,475円
九州ＳＤＧｓ・グローバルバランス	101,188,019円
ＦＷりそな先進国＋新興国株式アクティブファンド	41,640,152円
ＦＷりそな新興国株式インデックスファンド	2,882,528,548円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　新興国株式インデックス	1,891,121,422円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	79,043,751円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	242,389,771円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	287,962,863円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　Ｓｅｌｅｃｔ　全世界株式インデックス	8,998,818円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　Ｓｅｌｅｃｔ　全世界株式インデックス（除く日本）	9,727,058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）	885,568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）	12,308,519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）	62,404,911円
２．　計算日における受益権の総数	
	11,648,718,312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	1.6093円
(10,000口当たり純資産額)	(16,093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

2022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

2022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）

2022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	2022年 7月20日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
株式	△2,941,818,838
投資証券	△776,778
合計	△2,942,595,616

(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)

（2022年 7月20日現在）　（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	2,258,264,987	－	2,233,551,901	△24,713,086
合計		2,258,264,987	－	2,233,551,901	△24,713,086

（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はありません。

(通貨関連)

（2022年 7月20日現在）　（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	97,094,406	－	97,055,815	△38,591

	米ドル	97,094,406	－	97,055,815	△38,591
	売建	353,987	－	355,242	△1,255
	ブラジルレアル	278,893	－	279,966	△1,073
	オフショア人民元	75,094	－	75,276	△182
合計		97,448,393	－	97,411,057	△39,846

（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	20,800	1.60	33,363.20	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	1,600	0.00	0.00	
	ROSNEFT OIL CO PJSC-REGS GDR	20,180	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	3,767	6.13	23,091.71	
	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	2,346	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	1,502	49.08	73,718.16	
ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	7,676	26.65	204,565.40	
LI AUTO INC - ADR	10,277	37.31	383,434.87	
NIO INC - ADR	24,653	20.20	497,990.60	
XPENG INC - ADR	7,965	27.14	216,170.10	
H WORLD GROUP LTD	3,654	40.00	146,160.00	
TAL EDUCATION GROUP- ADR	8,474	4.78	40,505.72	
TRIP.COM GROUP LTD	10,155	26.74	271,544.70	
YUM CHINA HOLDINGS INC	7,972	47.16	375,959.52	
AUTOHOME INC-ADR	1,487	36.31	53,992.97	
IQIYI INC-ADR	6,995	4.29	30,008.55	
JOYY INC	1,098	27.29	29,964.42	
KANZHUN LTD	1,693	24.59	41,630.87	
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	12,024	4.60	55,310.40	
VK CO LTD	2,211	0.00	0.00	
WEIBO CORP-SPON ADR	1,164	20.47	23,827.08	
YANDEX NV-A	5,354	0.00	0.00	
OZON HOLDINGS PLC - ADR	920	0.00	0.00	
PINDUODUO INC-ADR	8,225	54.95	451,963.75	
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	8,297	10.01	83,052.97	
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	6,671	0.00	0.00	
X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	2,296	0.00	0.00	
RLX TECHNOLOGY INC-ADR	10,147	1.86	18,873.42	
BEIGENE LTD-ADR	887	178.36	158,205.32	
HUTCHMED CHINA-ADR	1,668	12.71	21,200.28	
LEGEND BIOTECH CORP-ADR	929	51.88	48,196.52	
ZAI LAB LTD-ADR	1,716	43.21	74,148.36	
COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	33,401	1.70	56,781.70	
CREDICORP LTD	1,372	126.71	173,846.12	
TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	2,188	0.00	0.00	
360 DIGITECH INC	1,806	15.01	27,108.06	
LUFAX HOLDING LTD-ADR	16,053	5.04	80,907.12	
KE HOLDINGS INC	6,358	15.71	99,884.18	
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	10,080	0.88	8,920.80	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	9,490	3.33	31,620.68	

	DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	1,144	67.46	77,174.24	
米ドル 小計		323,594		3,913,121.79 (540,676,037)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-CPO	286,900	8.16	2,341,104.00	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	58,300	76.49	4,459,367.00	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	2,650	184.08	487,812.00	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	19,800	43.77	866,646.00	
	ALFA S.A.B.-A	56,600	14.95	846,170.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	7,400	77.59	574,166.00	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	6,900	291.37	2,010,453.00	
	GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	3,830	391.44	1,499,215.20	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	4,405	144.24	635,377.20	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	44,300	32.93	1,458,799.00	
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	98,800	70.93	7,007,884.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	7,700	136.63	1,052,051.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	9,510	114.95	1,093,174.50	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	36,700	123.95	4,548,965.00	
	GRUMA S.A.B.-B	4,125	260.84	1,075,965.00	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	26,700	72.07	1,924,269.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	30,200	28.44	858,888.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	48,600	114.28	5,554,008.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	36,900	35.20	1,298,880.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	528,000	19.55	10,322,400.00	
メキシコペソ 小計		1,318,320		49,915,593.90 (336,336,263)	
ブラジルレアル	COSAN SA	23,200	17.47	405,304.00	
	PETRO RIO SA	13,500	22.36	301,860.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	69,700	31.67	2,207,399.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	89,200	29.18	2,602,856.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	14,100	12.01	169,341.00	
	BRASKEM SA-PREF A	2,900	34.54	100,166.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	12,400	14.34	177,816.00	
	GERDAU SA-PREF	21,400	23.99	513,386.00	
	KLABIN SA - UNIT	13,600	18.80	255,680.00	
	SUZANO SA	14,007	45.95	643,621.65	

VALE SA	74,904	68.88	5,159,387.52	
WEG SA	31,600	26.96	851,936.00	
CCR SA	23,400	12.04	281,736.00	
LOCALIZA RENT A CAR	13,810	54.39	751,125.90	
RUMO SA	24,400	15.90	387,960.00	
AMERICANAS SA	12,000	16.19	194,280.00	
LOJAS RENNER S.A.	17,820	24.74	440,866.80	
MAGAZINE LUIZA SA	48,800	2.79	136,152.00	
VIBRA ENERGIA SA	21,700	16.13	350,021.00	
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	8,000	17.07	136,560.00	
RAIA DROGASIL SA	20,200	20.19	407,838.00	
AMBEV SA	88,900	14.48	1,287,272.00	
BRF SA	12,600	14.96	188,496.00	
JBS SA	15,700	29.63	465,191.00	
NATURA &CO HOLDING SA	14,800	15.94	235,912.00	
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	88,792	5.75	510,554.00	
REDE D'OR SAO LUIZ SA	7,200	27.01	194,472.00	
HYPERA SA	8,000	40.50	324,000.00	
BANCO BRADESCO S.A.	29,515	14.33	422,949.95	
BANCO BRADESCO SA-PREF	99,936	17.26	1,724,895.36	
BANCO DO BRASIL S.A.	15,800	34.66	547,628.00	
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	8,100	28.44	230,364.00	
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	90,800	23.62	2,144,696.00	
ITAUSA SA	86,955	8.59	746,943.45	
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	115,000	10.21	1,174,150.00	
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	20,900	22.71	474,639.00	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	13,700	27.01	370,037.00	
TOTVS SA	9,200	24.67	226,964.00	
TELEFONICA BRASIL S.A.	9,700	47.51	460,847.00	
TIM SA	17,100	13.06	223,326.00	
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	4,800	45.37	217,776.00	
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	19,700	44.22	871,134.00	
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	26,934	10.39	279,844.26	
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	6,600	42.61	281,226.00	
CPFL ENERGIA SA	4,500	31.75	142,875.00	

	ENERGISA SA-UNITS	3,900	39.77	155,103.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	4,075	41.71	169,968.25	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	18,000	22.67	408,060.00	
ブラジルレアル 小計		1,411,848		30,954,616.14 (789,949,422)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	7,351	7,211.00	53,008,061.00	
	EMPRESAS CMPC SA	23,076	1,738.50	40,117,626.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	2,663	82,989.00	220,999,707.00	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES	284,456	88.80	25,259,692.80	
	FALABELLA SA	14,299	1,965.00	28,097,535.00	
	CENCOSUD SA	25,901	1,215.00	31,469,715.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	3,292	5,219.90	17,183,910.80	
	BANCO DE CHILE	856,360	87.60	75,017,136.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	990	27,489.00	27,214,110.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	1,203,387	36.98	44,501,251.26	
	ENEL AMERICAS SA	383,577	88.70	34,023,279.90	
	ENEL CHILE SA	369,172	22.80	8,417,121.60	
チリペソ 小計		3,174,524		605,309,146.36 (90,244,935)	
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	89,323	2,200.00	196,510,600.00	
	BANCOLOMBIA SA	4,637	35,000.00	162,295,000.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	8,897	31,000.00	275,807,000.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	8,188	22,190.00	181,691,720.00	
コロンビアペソ 小計		111,045		816,304,320.00 (26,124,187)	
ユーロ	MYTILINEOS S.A.	1,925	13.20	25,410.00	
	OPAP SA	3,467	13.75	47,671.25	
	JUMBO SA	2,215	14.90	33,003.50	
	ALPHA SERVICES AND HOLDINGS	33,439	0.74	24,912.05	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	51,021	0.78	40,296.38	
	NATIONAL BANK OF GREECE	10,331	2.85	29,495.00	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	4,371	16.32	71,334.72	
	PUBLIC POWER CORP	3,599	5.10	18,354.90	
ユーロ 小計		110,368		290,477.80 (41,131,656)	

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	2,516	244.60	615,413.60	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	22,394	27.70	620,313.80	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	15,288	22.30	340,922.40	
	KOC HOLDING AS	14,295	34.82	497,751.90	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	28,207	21.18	597,424.26	
	TURK HAVA YOLLARI AO	11,099	51.10	567,158.90	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	1,092	261.40	285,448.80	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	8,276	85.40	706,770.40	
	AKBANK T.A.S.	62,081	8.50	527,688.50	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	20,913	19.21	401,738.73	
	TURKIYE IS BANKASI-C	55,641	4.90	272,640.90	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	19,091	17.92	342,110.72	
トルコリラ 小計		260,893		5,775,382.91 (45,517,525)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	1,528	625.50	955,764.00	
	MONETA MONEY BANK AS	7,045	85.10	599,529.50	
	CEZ AS	2,959	1,125.00	3,328,875.00	
チェココルナ 小計		11,532		4,884,168.50 (28,213,399)	
ハンガリーフォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	7,310	3,042.00	22,237,020.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	2,477	8,095.00	20,051,315.00	
	OTP BANK PLC	4,422	7,990.00	35,331,780.00	
ハンガリーフォリント 小計		14,209		77,620,115.00 (27,614,054)	
ポーランドズロチ	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	5,618	72.80	408,990.40	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	33,451	5.62	187,994.62	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	2,722	104.50	284,449.00	
	LPP SA	18	9,950.00	179,100.00	
	CD PROJEKT SA	1,104	93.99	103,764.96	
	CYFROWY POLSAT SA	4,876	20.10	98,007.60	
	ALLEGRO.EU SA	5,653	25.86	146,186.58	
	DINO POLSKA SA	930	327.50	304,575.00	

	BANK PEKAO SA	3,378	77.00	260,106.00	
	MBANK SA	290	207.00	60,030.00	
	PKO BANK POLSKI SA	16,652	26.50	441,278.00	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	668	232.80	155,510.40	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	11,937	29.93	357,274.41	
	ORANGE POLSKA SA	11,699	6.21	72,697.58	
	PGE SA	17,929	10.53	188,882.01	
ポーランドズロチ 小計		116,925		3,248,846.56 (96,742,853)	
ロシアルーブル	GAZPROM PJSC	209,472	0.00	0.00	
	LUKOIL PJSC	7,345	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	
	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		67,141,105		0.00 (0)	
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO-H	35,000	6.44	225,400.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	30,000	7.31	219,300.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	478,000	3.59	1,716,020.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	63,500	22.85	1,450,975.00	
	CHINA SUNTIEN GREEN ENERGY-H	38,000	4.03	153,140.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	396,000	3.63	1,437,480.00	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO-H	28,000	24.65	690,200.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	66,000	2.91	192,060.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	22,000	34.20	752,400.00	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	38,000	8.15	309,700.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	76,000	8.24	626,240.00	
	CHINA RESOURCES CEMENT	50,000	5.10	255,000.00	
	CMOC GROUP LTD-H	66,000	3.82	252,120.00	
	DONGYUE GROUP	28,000	9.12	255,360.00	

GANFENG LITHIUM CO LTD-H	6,440	76.85	494,914.00	
JIANGXI COPPER CO LTD-H	18,000	9.69	174,420.00	
MMG LTD	68,000	2.58	175,440.00	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	33,000	6.27	206,910.00	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	14,500	12.82	185,890.00	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	24,000	6.49	155,760.00	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	108,000	8.59	927,720.00	
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	44,000	4.23	186,120.00	
BOC AVIATION LTD	3,500	68.10	238,350.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	42,000	3.35	140,700.00	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	32,000	16.14	516,480.00	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	18,000	9.89	178,020.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	80,000	5.18	414,400.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	40,000	8.74	349,600.00	
CITIC LTD	110,000	8.35	918,500.00	
CRRC CORP LTD - H	81,000	2.94	238,140.00	
FOSUN INTERNATIONAL LTD	48,500	6.89	334,165.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	13,000	18.82	244,660.00	
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	19,000	8.12	154,280.00	
SINOTRUK HONG KONG LTD	11,500	9.60	110,400.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	36,000	11.90	428,400.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	12,800	14.16	181,248.00	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	10,300	36.60	376,980.00	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	31,400	3.98	124,972.00	
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL LIMITED	74,000	4.21	311,540.00	
AIR CHINA LTD-H	30,000	6.47	194,100.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	30,000	4.74	142,200.00	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	24,000	13.08	313,920.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	26,000	4.53	117,780.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	58,700	12.06	707,922.00	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	32,000	5.63	180,160.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	20,000	7.22	144,400.00	
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	2,500	249.20	623,000.00	
SHENZHEN INTL HOLDINGS	19,500	7.36	143,520.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	32,000	6.65	212,800.00	

BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	34,000	7.30	248,200.00	
BYD CO LTD-H	15,500	290.00	4,495,000.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	56,000	5.73	320,880.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	11,600	39.90	462,840.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	113,000	16.50	1,864,500.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	55,000	13.46	740,300.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	56,000	7.76	434,560.00	
MINTH GROUP LTD	14,000	21.05	294,700.00	
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	24,000	17.68	424,320.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	22,800	91.60	2,088,480.00	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	54,000	4.86	262,440.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	43,000	25.50	1,096,500.00	
LI NING CO LTD	44,000	66.75	2,937,000.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	15,500	84.50	1,309,750.00	
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	26,000	13.84	359,840.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	21,000	15.68	329,280.00	
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	14,000	17.36	243,040.00	
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	29,310	17.32	507,649.20	
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LT	23,600	15.44	364,384.00	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	200,000	0.69	138,000.00	
BAIDU INC-CLASS A	41,980	137.20	5,759,656.00	
BILIBILI INC-CLASS Z	3,497	189.40	662,331.80	
CHINA LITERATURE LTD	6,800	33.75	229,500.00	
KINGSOFT CORP LTD	17,800	27.40	487,720.00	
KUAISHOU TECHNOLOGY	32,800	79.35	2,602,680.00	
NETEASE INC	38,900	138.60	5,391,540.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	116,900	333.20	38,951,080.00	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	284,140	100.90	28,669,726.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	90,000	5.17	465,300.00	
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	10,000	19.88	198,800.00	
CHINA RUYI HOLDINGS LIMITED	92,000	2.40	220,800.00	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	21,050	62.40	1,313,520.00	
JD.COM INC - CL A	37,560	241.00	9,051,960.00	
MEITUAN	76,700	189.10	14,503,970.00	
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	10,300	22.30	229,690.00	

POP MART INTERNATIONAL GROUP	10,800	22.25	240,300.00	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	38,000	6.75	256,500.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	11,000	51.10	562,100.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	2,200	124.08	272,976.00	
CHINA FEIHE LTD	64,000	8.67	554,880.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	60,000	37.40	2,244,000.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	30,000	51.90	1,557,000.00	
DALI FOODS GROUP CO LTD	45,000	4.06	182,700.00	
NONGFU SPRING CO LTD-H	33,200	45.95	1,525,540.00	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	32,000	20.25	648,000.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	38,000	13.22	502,360.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	12,000	73.90	886,800.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	21,000	6.90	144,900.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	91,000	6.62	602,420.00	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	9,000	24.05	216,450.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	12,500	36.75	459,375.00	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	6,000	20.35	122,100.00	
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	6,400	49.15	314,560.00	
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	32,000	6.58	210,560.00	
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	12,000	20.35	244,200.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	48,800	9.64	470,432.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	16,400	12.42	203,688.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	26,400	18.36	484,704.00	
3SBIO INC	31,000	5.71	177,010.00	
CANSINO BIOLOGICS INC-H	1,600	71.90	115,040.00	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	28,000	12.44	348,320.00	
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	56,000	3.58	200,480.00	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	168,000	8.14	1,367,520.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	22,000	30.50	671,000.00	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	1,900	88.55	168,245.00	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	24,000	16.08	385,920.00	
INNOVENT BIOLOGICS INC	20,000	35.40	708,000.00	
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	3,900	67.00	261,300.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	10,000	30.60	306,000.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	196,250	4.82	945,925.00	

WUXI APPTEC CO LTD-H	6,168	102.20	630,369.60	
WUXI BIOLOGICS (CAYMAN) INC.	67,500	77.55	5,234,625.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	548,000	2.56	1,402,880.00	
BANK OF CHINA LTD-H	1,488,000	2.75	4,092,000.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	161,000	4.60	740,600.00	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	167,000	3.30	551,100.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	1,800,000	5.01	9,018,000.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	47,000	2.41	113,270.00	
CHINA MERCHANTS BANK-H	73,000	42.55	3,106,150.00	
CHINA MINSHENG BANKING-H	110,600	2.59	286,454.00	
IND & COMM BK OF CHINA-H	1,057,000	4.10	4,333,700.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	148,000	5.18	766,640.00	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	181,000	1.19	215,390.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	56,000	3.95	221,200.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	27,200	14.98	407,456.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	40,000	16.18	647,200.00	
FAR EAST HORIZON LTD	29,000	6.28	182,120.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	21,600	10.38	224,208.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	53,600	5.26	281,936.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	25,800	10.54	271,932.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	140,000	11.76	1,646,400.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	50,000	17.26	863,000.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	26,200	8.41	220,342.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	17,300	18.92	327,316.00	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	163,000	2.36	384,680.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	130,000	8.28	1,076,400.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	118,500	48.45	5,741,325.00	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	14,100	22.40	315,840.00	
A-LIVING SMART CITY SERVICES	13,750	9.80	134,750.00	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	94,000	1.89	177,660.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	72,500	22.80	1,653,000.00	
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	20,000	8.40	168,000.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD	60,000	34.50	2,070,000.00	
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	13,400	35.10	470,340.00	
CHINA VANKE CO LTD-H	32,100	15.82	507,822.00	

CIFI EVER SUNSHINE SERVICES	12,000	6.34	76,080.00	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	85,280	2.36	201,260.80	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	155,000	3.40	527,000.00	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	39,000	22.85	891,150.00	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	15,000	15.92	238,800.00	
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	24,000	7.54	180,960.00	
HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	12,947	10.44	135,166.68	
LOGAN GROUP CO LTD	23,000	2.18	50,140.00	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	34,500	29.15	1,005,675.00	
SEAZEN GROUP LIMITED	36,000	2.71	97,560.00	
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	20,000	4.42	88,400.00	
WHARF HOLDINGS LTD	24,000	29.15	699,600.00	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	30,800	9.87	303,996.00	
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	48,000	7.83	375,840.00	
GDS HOLDINGS LTD-CL A	17,324	27.75	480,741.00	
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	46,000	17.00	782,000.00	
MING YUAN CLOUD GROUP HOLDIN	12,000	8.01	96,120.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	20,000	13.90	278,000.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	14,000	15.52	217,280.00	
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	11,000	20.90	229,900.00	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	13,000	25.65	333,450.00	
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	16,500	7.87	129,855.00	
LENOVO GROUP LTD	136,000	7.15	972,400.00	
SUNNY OPTICAL TECH	13,400	107.00	1,433,800.00	
XIAOMI CORP-CLASS B	286,800	12.92	3,705,456.00	
ZTE CORP-H	15,400	17.32	266,728.00	
CHINA TOWER CORP LTD-H	834,000	1.04	867,360.00	
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	8,500	25.60	217,600.00	
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	76,000	2.40	182,400.00	
CGN POWER CO LTD-H	202,000	1.96	395,920.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	53,600	12.06	646,416.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	63,000	13.28	836,640.00	
CHINA POWER INTERNATIONAL	99,000	4.75	470,250.00	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	18,000	34.85	627,300.00	
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	36,000	15.82	569,520.00	

	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	14,900	125.30	1,866,970.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD	56,000	8.00	448,000.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	76,000	3.79	288,040.00	
	KUNLUN ENERGY CO LTD	76,000	5.99	455,240.00	
	FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	7,000	27.50	192,500.00	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	10,000	25.00	250,000.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	92,000	12.04	1,107,680.00	
香港ドル 小計		15,596,496		237,007,748.08 (4,171,336,366)	
マレーシアリンギット	DIALOG GROUP BHD	69,800	2.01	140,298.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	5,900	22.80	134,520.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	44,400	8.30	368,520.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	68,600	4.20	288,120.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	12,300	7.43	91,389.00	
	SIME DARBY BERHAD	56,700	2.29	129,843.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	13,800	6.17	85,146.00	
	MISC BHD	26,800	6.93	185,724.00	
	GENTING BHD	41,300	4.57	188,741.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	55,700	2.82	157,074.00	
	MR DIY GROUP M BHD	47,550	2.09	99,379.50	
	IOI CORP BHD	49,600	3.92	194,432.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	8,300	21.16	175,628.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	1,300	133.80	173,940.00	
	PPB GROUP BERHAD	11,120	16.20	180,144.00	
	QL RESOURCES BHD	17,150	5.26	90,209.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	41,900	4.18	175,142.00	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	33,500	2.75	92,125.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	31,800	6.42	204,156.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	80,000	1.02	81,600.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	36,600	3.85	140,910.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	125,100	5.10	638,010.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	12,300	20.08	246,984.00	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	5,300	18.50	98,050.00	
	MALAYAN BANKING BHD	89,300	8.56	764,408.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	273,300	4.40	1,202,520.00	

	RHB BANK BHD	26,900	5.66	152,254.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	47,800	2.66	127,148.00	
	DIGI.COM BHD	52,900	3.39	179,331.00	
	MAXIS BHD	45,700	3.34	152,638.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	18,400	5.50	101,200.00	
	PETRONAS GAS BHD	14,000	16.52	231,280.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	48,900	7.89	385,821.00	
	INARI AMERTRON BHD	42,600	2.61	111,186.00	
マレーシアリンギット 小計		1,556,620		7,767,870.50 (241,270,834)	
タイバーツ	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	26,200	160.00	4,192,000.00	
	PTT PCL-NVDR	187,800	34.25	6,432,150.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	22,300	50.75	1,131,725.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	33,200	44.50	1,477,400.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	42,100	44.25	1,862,925.00	
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	19,800	53.00	1,049,400.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	14,700	371.00	5,453,700.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	80,600	69.50	5,601,700.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	154,900	8.60	1,332,140.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	157,400	8.65	1,361,510.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	190,600	4.92	937,752.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	59,300	33.25	1,971,725.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	33,225	35.00	1,162,875.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	111,200	12.80	1,423,360.00	
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	54,500	25.50	1,389,750.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	16,500	31.25	515,625.00	
	CP ALL PCL-NVDR	110,500	61.00	6,740,500.00	
	CARABAO GROUP PCL-NVDR	4,900	108.50	531,650.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	73,500	25.00	1,837,500.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	31,400	32.75	1,028,350.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	48,600	15.90	772,740.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	195,900	26.50	5,191,350.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	9,900	180.50	1,786,950.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	48,300	14.80	714,840.00	
	SCB X PCL-NVDR	15,400	91.25	1,405,250.00	

	BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR	37,300	16.30	607,990.00	
	JMT NETWORK SERVICES-NVDR	13,400	69.00	924,600.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	14,700	53.75	790,125.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	16,300	44.25	721,275.00	
	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	16,200	48.25	781,650.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	38,500	61.50	2,367,750.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	156,200	8.20	1,280,840.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	5,300	340.00	1,802,000.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	22,500	202.00	4,545,000.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	21,200	70.75	1,499,900.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	167,500	4.70	787,250.00	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	9,500	37.00	351,500.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	4,000	185.50	742,000.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	32,000	78.75	2,520,000.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	13,300	65.50	871,150.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	54,100	46.75	2,529,175.00	
	RATCH GROUP PCL-NVDR	21,900	38.50	843,150.00	
タイバーツ 小計		2,386,625		81,270,222.00 (306,388,736)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	29,260	51.00	1,492,260.00	
	AYALA CORPORATION	4,750	610.00	2,897,500.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	1,560	473.00	737,880.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	51,491	52.05	2,680,106.55	
	SM INVESTMENTS CORP	4,000	796.00	3,184,000.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	19,120	186.00	3,556,320.00	
	JOLLIBEE FOODS CORP	6,950	210.20	1,460,890.00	
	MONDE NISSIN CORP	123,700	13.90	1,719,430.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	17,410	115.40	2,009,114.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	34,680	89.40	3,100,392.00	
	BDO UNIBANK INC	35,410	117.50	4,160,675.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	36,812	45.70	1,682,308.40	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	283,000	3.69	1,044,270.00	
	AYALA LAND INC	152,200	24.40	3,713,680.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	220,800	37.85	8,357,280.00	
	CONVERGE INFORMATION AND COM	44,000	20.25	891,000.00	

	GLOBE TELECOM INC	450	2,242.00	1,008,900.00	
	PLDT INC	1,640	1,654.00	2,712,560.00	
	AC ENERGY CORP	168,850	8.25	1,393,012.50	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	4,650	369.60	1,718,640.00	
フィリピンペソ 小計		1,240,733		49,520,218.45 (121,577,088)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY TBK PT	278,800	2,950.00	822,460,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	33,800	29,100.00	983,580,000.00	
	ADARO MINERALS INDONESIA TBK	161,700	1,680.00	271,656,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK	175,600	1,655.00	290,618,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	559,600	910.00	509,236,000.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	53,900	7,650.00	412,335,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	220,109	3,770.00	829,810,930.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	55,300	6,550.00	362,215,000.00	
	VALE INDONESIA TBK	49,100	5,150.00	252,865,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	381,900	6,075.00	2,320,042,500.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	333,700	1,860.00	620,682,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESI PT	139,000	5,800.00	806,200,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	6,600	29,475.00	194,535,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	47,000	9,450.00	444,150,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	81,200	7,150.00	580,580,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	140,700	4,970.00	699,279,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	346,500	1,700.00	589,050,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	1,039,900	7,175.00	7,461,282,500.00	
	BANK JAGO TBK PT	70,000	9,700.00	679,000,000.00	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	351,000	7,425.00	2,606,175,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	136,500	7,300.00	996,450,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	1,279,245	4,110.00	5,257,696,950.00	
	SARANA MENARA NUSANTARA PT	347,300	1,150.00	399,395,000.00	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	933,900	4,160.00	3,885,024,000.00	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	140,900	2,990.00	421,291,000.00	
インドネシアルピア 小計		7,363,254		32,695,608,880.00 (304,069,162)	
韓国ウォン	HD HYUNDAI	813	52,600.00	42,763,800.00	
	S-OIL CORP	847	93,200.00	78,940,400.00	

SK INNOVATION CO LTD	1,042	177,000.00	184,434,000.00	
HANWHA SOLUTIONS CORP	2,345	32,750.00	76,798,750.00	
HYUNDAI STEEL CO	1,620	32,600.00	52,812,000.00	
KOREA ZINC CO LTD	158	456,500.00	72,127,000.00	
KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	307	121,000.00	37,147,000.00	
LG CHEM LTD	929	521,000.00	484,009,000.00	
LG CHEM LTD-PREFERENCE	133	250,000.00	33,250,000.00	
LOTTE CHEMICAL CORP	320	168,000.00	53,760,000.00	
POSCO CHEMICAL CO LTD	576	113,500.00	65,376,000.00	
POSCO HOLDINGS INC	1,472	230,000.00	338,560,000.00	
SK CHEMICALS CO LTD/NEW	263	104,000.00	27,352,000.00	
SK IE TECHNOLOGY CO LTD	491	83,900.00	41,194,900.00	
SKC CO LTD	401	126,000.00	50,526,000.00	
CJ CORP	193	77,900.00	15,034,700.00	
DOOSAN BOBCAT INC	883	29,550.00	26,092,650.00	
DOOSAN ENERBILITY	7,695	17,550.00	135,047,250.00	
ECOPRO BM CO LTD	940	110,600.00	103,964,000.00	
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	1,254	28,900.00	36,240,600.00	
GS HOLDINGS	848	39,850.00	33,792,800.00	
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	1,469	38,950.00	57,217,550.00	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO	355	123,000.00	43,665,000.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	1,409	51,600.00	72,704,400.00	
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	719	81,900.00	58,886,100.00	
LG CORP	1,793	77,000.00	138,061,000.00	
LG ENERGY SOLUTION	374	383,000.00	143,242,000.00	
SAMSUNG C&T CORP	1,591	115,500.00	183,760,500.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	2,961	19,350.00	57,295,350.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	12,107	5,380.00	65,135,660.00	
SK	724	216,000.00	156,384,000.00	
S-1 CORPORATION	228	63,500.00	14,478,000.00	
CJ LOGISTICS	135	113,000.00	15,255,000.00	
HMM CO LTD	4,920	23,650.00	116,358,000.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	365	184,500.00	67,342,500.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	3,186	25,200.00	80,287,200.00	
PAN OCEAN CO LTD	5,356	5,410.00	28,975,960.00	

HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	1,393	32,700.00	45,551,100.00	
HANON SYSTEMS	3,541	10,200.00	36,118,200.00	
HYUNDAI MOBIS CO LTD	1,161	219,500.00	254,839,500.00	
HYUNDAI MOTOR CO	2,609	188,500.00	491,796,500.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	610	91,700.00	55,937,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	336	90,700.00	30,475,200.00	
KIA CORP	4,953	82,100.00	406,641,300.00	
COWAY CO LTD	1,045	63,400.00	66,253,000.00	
F&F CO LTD / NEW	325	139,500.00	45,337,500.00	
HLB INC	1,659	40,550.00	67,272,450.00	
LG ELECTRONICS INC	2,001	92,900.00	185,892,900.00	
KANGWON LAND INC	1,879	24,100.00	45,283,900.00	
CHEIL WORLDWIDE INC	1,050	22,550.00	23,677,500.00	
CJ ENM CO LTD	195	99,500.00	19,402,500.00	
HYBE CO LTD	292	152,500.00	44,530,000.00	
KAKAO CORP	5,900	72,800.00	429,520,000.00	
KAKAO GAMES CORP	600	50,900.00	30,540,000.00	
KRAFTON INC	470	235,000.00	110,450,000.00	
NAVER CORP	2,475	243,500.00	602,662,500.00	
NCSOFT CORP	284	367,500.00	104,370,000.00	
NETMARBLE CORPORATION	392	70,400.00	27,596,800.00	
PEARL ABYSS CORP	460	52,600.00	24,196,000.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	602	68,600.00	41,297,200.00	
LOTTE SHOPPING CO	222	89,500.00	19,869,000.00	
BGF RETAIL CO LTD/NEW	138	188,000.00	25,944,000.00	
E-MART INC	374	102,000.00	38,148,000.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	160	405,000.00	64,800,000.00	
KT&G CORP	1,988	81,300.00	161,624,400.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	412	105,000.00	43,260,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	611	133,500.00	81,568,500.00	
AMOREPACIFIC GROUP	429	37,200.00	15,958,800.00	
LG H&H	176	710,000.00	124,960,000.00	
LG H&H-PRF	31	337,000.00	10,447,000.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	1,458	70,000.00	102,060,000.00	
SD BIOSENSOR INC	691	46,900.00	32,407,900.00	

ALTEOGEN INC	544	66,600.00	36,230,400.00	
CELLTRION INC	1,856	183,500.00	340,576,000.00	
CELLTRION PHARM INC	339	78,300.00	26,543,700.00	
GREEN CROSS CORP	90	181,500.00	16,335,000.00	
HANMI PHARM CO LTD	137	310,500.00	42,538,500.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	332	819,000.00	271,908,000.00	
SEEGENE INC	734	45,600.00	33,470,400.00	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	529	77,600.00	41,050,400.00	
SK BIOSCIENCE CO LTD	417	132,500.00	55,252,500.00	
YUHAN CORP	1,019	58,100.00	59,203,900.00	
HANA FINANCIAL GROUP	5,640	35,650.00	201,066,000.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	4,455	9,200.00	40,986,000.00	
KAKAOBANK CORP	2,253	30,600.00	68,941,800.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	7,410	46,300.00	343,083,000.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	8,726	34,600.00	301,919,600.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	9,741	11,600.00	112,995,600.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	832	59,200.00	49,254,400.00	
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	467	24,900.00	11,628,300.00	
MERITZ SECURITIES CO LTD	6,080	4,475.00	27,208,000.00	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	5,653	6,310.00	35,670,430.00	
NH INVESTMENT & SECURITIES C	2,964	9,290.00	27,535,560.00	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	1,222	32,550.00	39,776,100.00	
DB INSURANCE CO LTD	911	61,400.00	55,935,400.00	
MERITZ FIRE & MARINE INSURAN	581	33,300.00	19,347,300.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	598	200,000.00	119,600,000.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	1,532	58,000.00	88,856,000.00	
SAMSUNG SDS CO LTD	647	132,000.00	85,404,000.00	
ILJIN MATERIALS CO LTD	440	70,200.00	30,888,000.00	
L&F CO LTD	420	213,600.00	89,712,000.00	
LG DISPLAY CO LTD	4,329	15,350.00	66,450,150.00	
LG INNOTEK CO LTD	276	328,500.00	90,666,000.00	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	1,061	139,000.00	147,479,000.00	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	89,408	60,900.00	5,444,947,200.00	
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	15,431	56,300.00	868,765,300.00	
SAMSUNG SDI CO LTD	1,033	545,000.00	562,985,000.00	

	LG UPLUS CORP	4,303	12,100.00	52,066,300.00	
	SK TELECOM	476	54,000.00	25,704,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	4,725	21,900.00	103,477,500.00	
	SK HYNIX INC	10,232	100,000.00	1,023,200,000.00	
	SK SQUARE CO LTD	1,808	40,400.00	73,043,200.00	
韓国ウォン 小計		301,795		18,330,659,660.00 (1,943,049,923)	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	19,000	84.70	1,609,300.00	
	ASIA CEMENT CORP	41,000	44.10	1,808,100.00	
	CHINA STEEL CORP	222,000	30.25	6,715,500.00	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	66,000	66.50	4,389,000.00	
	FORMOSA PLASTICS CORP	78,000	88.60	6,910,800.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	91,000	63.70	5,796,700.00	
	TAIWAN CEMENT	104,477	41.65	4,351,467.05	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	2,600	900.00	2,340,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	55,000	32.50	1,787,500.00	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	1,000	1,505.00	1,505,000.00	
	WALSIN LIHWA CORP	47,000	33.70	1,583,900.00	
	CHINA AIRLINES LTD	55,000	23.60	1,298,000.00	
	EVA AIRWAYS CORP	50,000	34.15	1,707,500.00	
	EVERGREEN MARINE CORP LTD	47,550	91.60	4,355,580.00	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	38,000	29.35	1,115,300.00	
	WAN HAI LINES LTD	11,000	131.00	1,441,000.00	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	33,000	87.80	2,897,400.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	30,000	36.65	1,099,500.00	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	4,020	442.00	1,776,840.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	8,080	175.00	1,414,000.00	
	GIANT MANUFACTURING	6,000	229.00	1,374,000.00	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	3,000	282.50	847,500.00	
	POU CHEN	45,000	27.95	1,257,750.00	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	6,000	599.00	3,594,000.00	
	MOMO.COM INC	1,200	800.00	960,000.00	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	10,000	283.00	2,830,000.00	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	92,000	67.50	6,210,000.00	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	93,332	17.35	1,619,310.20	

CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	328,000	22.20	7,281,600.00	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	225,900	27.85	6,291,315.00	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	195,263	25.05	4,891,338.15	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	159,991	21.75	3,479,804.25	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	205,000	34.15	7,000,750.00	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	181,995	16.00	2,911,920.00	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	196,708	15.20	2,989,961.60	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	179,361	25.65	4,600,609.65	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	67,000	48.05	3,219,350.00	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	26,245	187.50	4,920,937.50	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	183,920	19.20	3,531,264.00	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	149,000	44.95	6,697,550.00	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	282,000	12.80	3,609,600.00	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	133,500	58.60	7,823,100.00	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	215,835	8.52	1,838,914.20	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	23,072	72.90	1,681,948.80	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	9,000	260.00	2,340,000.00	
ACER INC	56,000	21.75	1,218,000.00	
ADVANTECH CO LTD	8,299	335.00	2,780,165.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	13,000	312.00	4,056,000.00	
AUO CORP	159,000	14.55	2,313,450.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	13,000	167.00	2,171,000.00	
COMPAL ELECTRONICS	78,000	21.95	1,712,100.00	
DELTA ELECTRONICS INC	37,000	246.00	9,102,000.00	
E INK HOLDINGS INC	16,000	174.50	2,792,000.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	233,800	104.00	24,315,200.00	
INNOLUX CORP	195,000	11.00	2,145,000.00	
INVENTEC CORP	52,000	22.40	1,164,800.00	
LARGAN PRECISION CO LTD	1,900	1,980.00	3,762,000.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	39,000	58.80	2,293,200.00	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	13,000	118.00	1,534,000.00	
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	4,000	253.00	1,012,000.00	
PEGATRON CORP	37,000	58.80	2,175,600.00	
QUANTA COMPUTER INC	48,000	81.10	3,892,800.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	26,000	52.80	1,372,800.00	

	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	24,000	164.00	3,936,000.00	
	WIWYNN CORP	1,500	696.00	1,044,000.00	
	WPG HOLDINGS LTD	26,960	48.60	1,310,256.00	
	YAGEO CORPORATION	8,198	326.00	2,672,548.00	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	13,000	104.00	1,352,000.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	72,000	121.50	8,748,000.00	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	30,000	74.90	2,247,000.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	30,000	99.10	2,973,000.00	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	62,000	82.60	5,121,200.00	
	ASMEDIA TECHNOLOGY INC	500	1,040.00	520,000.00	
	EMEMORY TECHNOLOGY INC	1,000	1,090.00	1,090,000.00	
	GLOBALWAFERS CO LTD	4,000	430.50	1,722,000.00	
	MEDIATEK INC	28,800	662.00	19,065,600.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	21,000	53.00	1,113,000.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS COR	11,000	250.50	2,755,500.00	
	PARADE TECHNOLOGIES LTD	1,400	1,130.00	1,582,000.00	
	POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU	51,000	38.75	1,976,250.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	9,000	339.00	3,051,000.00	
	SILERGY CORP	5,640	552.00	3,113,280.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	461,000	491.00	226,351,000.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	223,000	39.90	8,897,700.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	15,000	72.90	1,093,500.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	6,000	179.00	1,074,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	50,000	21.95	1,097,500.00	
新台湾ドル 小計		6,208,046		523,423,359.40 (2,419,367,451)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	16,143	316.55	5,110,066.65	
	COAL INDIA LTD	25,983	198.25	5,151,129.75	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	9,986	240.85	2,405,128.10	
	INDIAN OIL CORP LTD	52,920	72.00	3,810,240.00	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	43,103	127.90	5,512,873.70	
	PETRONET LNG LTD	12,992	225.95	2,935,542.40	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	56,982	2,437.10	138,870,832.20	
	ACC LTD	1,469	2,168.80	3,185,967.20	
	AMBUJA CEMENTS LTD	11,174	370.95	4,144,995.30	

ASIAN PAINTS LTD	7,189	3,019.10	21,704,309.90	
BERGER PAINTS INDIA LTD	4,076	579.00	2,360,004.00	
GRASIM INDUSTRIES LTD	4,892	1,442.20	7,055,242.40	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	25,302	367.95	9,309,870.90	
JINDAL STEEL & POWER LTD	8,017	352.65	2,827,195.05	
JSW STEEL LTD	14,544	584.85	8,506,058.40	
PI INDUSTRIES LTD	1,583	2,950.85	4,671,195.55	
PIDILITE INDUSTRIES LTD	2,744	2,291.45	6,287,738.80	
SHREE CEMENT LTD	197	20,068.20	3,953,435.40	
SRF LTD	2,838	2,331.95	6,618,074.10	
TATA STEEL LTD	13,741	919.45	12,634,162.45	
ULTRATECH CEMENT LTD	1,896	6,085.85	11,538,771.60	
UPL LTD	9,171	684.35	6,276,173.85	
VEDANTA LTD	13,970	238.75	3,335,337.50	
ADANI ENTERPRISES LTD	5,192	2,451.30	12,727,149.60	
BHARAT ELECTRONICS LTD	22,968	255.15	5,860,285.20	
HAVELLS INDIA LTD	4,513	1,258.70	5,680,513.10	
LARSEN & TOUBRO LTD	12,944	1,729.80	22,390,531.20	
SIEMENS LTD	1,348	2,684.75	3,619,043.00	
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	4,422	607.75	2,687,470.50	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	9,517	749.00	7,128,233.00	
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	5,358	673.65	3,609,416.70	
INTERGLOBE AVIATION LTD	1,928	1,776.65	3,425,381.20	
BAJAJ AUTO LTD	1,154	4,002.00	4,618,308.00	
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	1,609	2,292.00	3,687,828.00	
BHARAT FORGE LTD	4,571	668.60	3,056,170.60	
EICHER MOTORS LTD	2,527	3,077.70	7,777,347.90	
HERO MOTOCORP LTD	2,256	2,801.20	6,319,507.20	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	16,376	1,186.25	19,426,030.00	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	2,272	8,715.85	19,802,411.20	
MRF LTD	38	79,941.80	3,037,788.40	
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN	23,659	125.30	2,964,472.70	
TATA MOTORS LTD	31,271	449.05	14,042,242.55	
PAGE INDUSTRIES LTD	118	43,750.85	5,162,600.30	
TITAN CO LTD	6,665	2,241.20	14,937,598.00	

JUBILANT FOODWORKS LTD	7,490	558.80	4,185,412.00	
INFO EDGE INDIA LTD	1,429	4,129.40	5,900,912.60	
TRENT LTD	3,269	1,202.25	3,930,155.25	
ZOMATO LTD	27,665	53.95	1,492,526.75	
AVENUE SUPERMARTS LTD	3,091	3,931.30	12,151,648.30	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	1,847	3,787.45	6,995,420.15	
ITC LTD	55,909	294.60	16,470,791.40	
MARICO LTD	9,787	507.45	4,966,413.15	
NESTLE INDIA LTD	623	18,377.70	11,449,307.10	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	11,092	787.25	8,732,177.00	
UNITED SPIRITS LTD	5,758	821.50	4,730,197.00	
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	2,394	1,563.50	3,743,019.00	
DABUR INDIA LTD	10,503	549.45	5,770,873.35	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	7,814	865.90	6,766,142.60	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	15,444	2,567.95	39,659,419.80	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	1,882	4,020.20	7,566,016.40	
AUROBINDO PHARMA LTD	4,528	556.95	2,521,869.60	
BIOCON LTD	8,322	329.05	2,738,354.10	
CIPLA LTD	9,018	960.65	8,663,141.70	
DIVI'S LABORATORIES LTD	2,293	3,753.25	8,606,202.25	
DR. REDDY'S LABORATORIES	2,154	4,447.90	9,580,776.60	
LUPIN LTD	4,421	643.80	2,846,239.80	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	18,064	875.30	15,811,419.20	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	1,744	1,498.05	2,612,599.20	
AU SMALL FINANCE BANK LTD	3,156	566.20	1,786,927.20	
AXIS BANK LTD	42,527	700.60	29,794,416.20	
BANDHAN BANK LTD	12,468	287.75	3,587,667.00	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	32,231	2,217.70	71,478,688.70	
ICICI BANK LTD	96,256	780.65	75,142,246.40	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	10,417	1,834.95	19,114,674.15	
STATE BANK OF INDIA	33,485	497.95	16,673,855.75	
YES BANK LTD	214,143	13.50	2,890,930.50	
BAJAJ FINANCE LTD	5,094	6,065.95	30,899,949.30	
BAJAJ FINSERV LTD	722	12,444.80	8,985,145.60	
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	8,009	683.90	5,477,355.10	

	MUTHOOT FINANCE LTD	2,371	1,036.95	2,458,608.45	
	PIRAMAL ENTERPRISES LTD	2,065	1,704.75	3,520,308.75	
	SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	4,350	858.30	3,733,605.00	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	3,848	1,391.55	5,354,684.40	
	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	16,905	535.90	9,059,389.50	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	4,188	1,270.50	5,320,854.00	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	6,031	520.90	3,141,547.90	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	8,533	1,169.95	9,983,183.35	
	DLF LTD	11,721	359.85	4,217,801.85	
	GODREJ PROPERTIES LTD	2,400	1,385.85	3,326,040.00	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	20,425	889.70	18,172,122.50	
	INFOSYS LTD	63,048	1,484.15	93,572,689.20	
	LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	1,030	4,310.95	4,440,278.50	
	MINDTREE LTD	1,148	3,040.10	3,490,034.80	
	MPHASIS LTD	1,375	2,146.80	2,951,850.00	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	17,341	3,074.25	53,310,569.25	
	TATA ELXSI LTD	666	8,079.40	5,380,880.40	
	TECH MAHINDRA LTD	11,055	1,007.70	11,140,123.50	
	WIPRO LTD	25,802	405.65	10,466,581.30	
	BHARTI AIRTEL LTD	41,224	672.90	27,739,629.60	
	INDUS TOWERS LTD	13,541	221.45	2,998,654.45	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	5,889	2,109.00	12,419,901.00	
	ADANI POWER LTD	15,041	293.35	4,412,277.35	
	ADANI TOTAL GAS LTD	5,050	2,832.35	14,303,367.50	
	ADANI TRANSMISSION LTD	5,050	3,029.75	15,300,237.50	
	GAIL INDIA LTD	29,821	140.25	4,182,395.25	
	INDRAPRASTHA GAS LTD	6,370	372.05	2,369,958.50	
	NTPC LTD	73,091	150.75	11,018,468.25	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	59,082	210.00	12,407,220.00	
	TATA POWER CO LTD	24,154	228.00	5,507,112.00	
インドルピー 小計		1,659,282		1,279,587,937.80 (2,226,483,011)	
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	9,835	17.20	169,162.00	
	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	48,704	4.05	197,251.20	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	75,832	2.54	193,295.76	

	INDUSTRIES QATAR	27,513	15.20	418,197.60	
	COMMERCIAL BANK PQSC	37,796	6.75	255,123.00	
	MASRAF AL RAYAN	104,222	3.93	409,592.46	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	15,043	11.25	169,233.75	
	QATAR ISLAMIC BANK	30,915	23.58	728,975.70	
	QATAR NATIONAL BANK	86,382	18.80	1,623,981.60	
	BARWA REAL ESTATE CO	40,684	3.40	138,366.28	
	OOREDOO QPSC	12,412	7.95	98,675.40	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	8,098	17.97	145,521.06	
カタールリアル 小計		497,436		4,547,375.81 (170,935,856)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	4,207	202.55	852,127.85	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	2,290	211.65	484,678.50	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	983	1,223.36	1,202,562.88	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	7,937	238.55	1,893,371.35	
	GOLD FIELDS LTD	16,859	153.29	2,584,316.11	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	10,759	51.48	553,873.32	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	15,908	156.84	2,495,010.72	
	KUMBA IRON ORE LTD	1,067	476.19	508,094.73	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	5,936	152.29	903,993.44	
	SASOL LTD	10,618	346.97	3,684,127.46	
	SIBANYE STILLWATER LTD	53,218	39.14	2,082,952.52	
	BIDVEST GROUP LTD	5,290	217.48	1,150,469.20	
	MULTICHOICE GROUP LTD	7,242	119.01	861,870.42	
	MR PRICE GROUP LTD	4,651	176.35	820,203.85	
	NASPERS LTD-N SHS	4,085	2,644.47	10,802,659.95	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	33,135	20.15	667,670.25	
	THE FOSCHINI GROUP LTD	6,447	123.10	793,625.70	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	18,906	55.22	1,043,989.32	
	BID CORP LTD	6,193	326.32	2,020,899.76	
	CLICKS GROUP LTD	4,730	290.36	1,373,402.80	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	9,655	206.34	1,992,212.70	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	3,680	139.59	513,691.20	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	7,294	150.26	1,095,996.44	
	ABSA GROUP LTD	15,141	162.90	2,466,468.90	

	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	1,635	2,023.68	3,308,716.80	
	NEDBANK GROUP LTD	8,594	209.20	1,797,864.80	
	STANDARD BANK GROUP LTD	25,185	154.70	3,896,119.50	
	FIRSTRAND LTD	94,795	63.80	6,047,921.00	
	REINET INVESTMENTS SCA	2,729	301.61	823,093.69	
	REMGRO LTD	10,067	132.75	1,336,394.25	
	DISCOVERY LTD	8,947	128.50	1,149,689.50	
	OLD MUTUAL LTD	90,974	11.51	1,047,110.74	
	SANLAM LTD	32,128	54.61	1,754,510.08	
	NEPI ROCKCASTLE S.A.	7,950	92.25	733,387.50	
	MTN GROUP LTD	32,363	138.97	4,497,486.11	
	VODACOM GROUP LTD	11,161	138.00	1,540,218.00	
南アフリカランド 小計		582,759		70,780,781.34 (571,200,905)	
アラブディルハム	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	59,313	4.24	251,487.12	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	50,749	8.65	438,978.85	
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	27,087	8.50	230,239.50	
	DUBAI ISLAMIC BANK	54,804	5.51	301,970.04	
	EMIRATES NBD PJSC	35,845	12.45	446,270.25	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	82,819	18.80	1,556,997.20	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	72,043	4.53	326,354.79	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	74,686	5.34	398,823.24	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	65,245	26.04	1,698,979.80	
アラブディルハム 小計		522,591		5,650,100.79 (212,895,797)	
クウェートディナール	AGILITY	27,829	0.80	22,430.17	
	BOUBYAN BANK K.S.C	22,185	0.80	17,881.11	
	GULF BANK	31,180	0.33	10,382.94	
	KUWAIT FINANCE HOUSE	95,612	0.84	80,314.08	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	134,303	1.06	142,495.48	
	MABANEE CO KPSC	12,240	0.78	9,559.44	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	41,562	0.59	24,895.63	
クウェートディナール 小計		364,911		307,958.85 (138,692,347)	
オフショア人民	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	32,500	4.10	133,250.00	

元	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	8,900	30.09	267,801.00	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-A	3,400	10.38	35,292.00	
	GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	9,700	9.51	92,247.00	
	INNER MONGOLIA DIAN TOU EN-A	2,700	13.83	37,341.00	
	JIZHONG ENERGY RESOURCES-A	4,900	7.05	34,545.00	
	OFFSHORE OIL ENGINEERING-A	500	4.15	2,075.00	
	PETROCHINA CO LTD-A	21,700	5.20	112,840.00	
	PINGDINGSHAN TIANAN COAL -A	3,200	12.30	39,360.00	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	11,700	19.86	232,362.00	
	SHAN XI HUA YANG GROUP NEW-A	3,400	18.87	64,158.00	
	SHANXI COKING COAL ENERGY-A	8,520	12.09	103,006.80	
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	2,900	14.38	41,702.00	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO-A	2,891	38.04	109,973.64	
	YANTAI JEREH OILFIELD-A	900	35.41	31,869.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	12,700	4.65	59,055.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	3,900	34.74	135,486.00	
	ANHUI HONGLU STEEL CONSTRU-A	650	32.66	21,229.00	
	ASIA-POTASH INTERNATIONAL-A	1,500	36.81	55,215.00	
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	24,500	5.76	141,120.00	
	BBMG CORPORATION-A	900	2.61	2,349.00	
	BEIJING EASPRING MATERIAL-A	700	112.31	78,617.00	
	CHENGTUN MINING GROUP CO -A	4,400	7.62	33,528.00	
	CHENGXIN LITHIUM GROUP CO-A	1,400	59.17	82,838.00	
	CHIFENG JILONG GOLD MINING-A	2,400	15.74	37,776.00	
	CHINA JUSHI CO LTD -A	3,314	15.32	50,770.48	
	CHINA MINMETALS RARE EARTH-A	1,900	29.68	56,392.00	
	CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	3,500	32.49	113,715.00	
	CMOC GROUP LTD-A	17,200	5.24	90,128.00	
	CNGR ADVANCED MATERIAL CO -A	600	151.30	90,780.00	
	CNNC HUA YUAN TITANIUM -A	4,785	9.89	47,323.65	
	DO-FLUORIDE NEW MATERIALS -A	1,500	50.96	76,440.00	
	GEM CO LTD-A	3,500	9.11	31,885.00	
	GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	2,380	58.12	138,325.60	
	HANGZHOU OXYGEN PLANT GROU-A	2,000	39.24	78,480.00	
	HENAN SHENHUO COAL & POWER-A	3,500	14.17	49,595.00	

HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	5,720	20.78	118,861.60	
HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	1,950	9.66	18,837.00	
HESTEEL CO LTD-A	1,500	2.92	4,380.00	
HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A	700	104.00	72,800.00	
HUAFON CHEMICAL CO LTD -A	4,600	7.79	35,834.00	
HUAIBEI MINING HOLDINGS CO-A	3,700	13.52	50,024.00	
HUAXIN CEMENT CO LTD-A	1,100	18.37	20,207.00	
HUBEI XINGFA CHEMICALS GRP-A	1,900	40.39	76,741.00	
HUNAN VALIN STEEL CO LTD -A	3,500	4.66	16,310.00	
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	44,300	2.18	96,574.00	
INNER MONGOLIA EERDUOSI RE-A	2,100	17.87	37,527.00	
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	3,500	4.56	15,960.00	
INNER MONGOLIA YUAN XING-A	5,900	9.16	54,044.00	
JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	3,200	17.09	54,688.00	
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	300	118.04	35,412.00	
JIANGSU YOKE TECHNOLOGY-A	500	48.49	24,245.00	
JIANGXI COPPER CO LTD-A	2,000	17.35	34,700.00	
JIANGXI GANFENG LITHIUM CO-A	1,540	98.20	151,228.00	
KINGFA SCI.& TECH CO LTD-A	3,200	9.05	28,960.00	
LB GROUP CO LTD-A	1,700	21.49	36,533.00	
LUXI CHEMICAL GROUP CO LT-A	1,900	14.85	28,215.00	
LUXIANG COMPANY,LTD.	400	140.19	56,076.00	
MAANSHAN IRON & STEEL-A	10,000	3.66	36,600.00	
NINGBO SHANSHAN CO LTD-A	2,300	31.76	73,048.00	
NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	6,100	14.12	86,132.00	
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	7,200	6.50	46,800.00	
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	10,050	14.68	147,534.00	
SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A	2,350	24.29	57,081.50	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	3,468	17.70	61,383.60	
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	1,820	28.30	51,506.00	
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	10,000	3.48	34,800.00	
SHANDONG SUN PAPER INDUSTR-A	2,200	12.03	26,466.00	
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	1,440	78.80	113,472.00	
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	3,700	11.50	42,550.00	
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	4,800	5.03	24,144.00	

SHENGHE RESOURCES HOLDINGS-A	1,700	21.55	36,635.00	
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	1,080	49.55	53,514.00	
SHENZHEN DYNANONIC CO LTD-A	200	370.50	74,100.00	
SHENZHEN SENIOR TECHNOLOGY-A	1,798	30.40	54,659.20	
SICHUAN HEBANG BIOTECHNOL- A	14,200	4.19	59,498.00	
SICHUAN YAHUA INDUSTRIAL-A	1,900	30.95	58,805.00	
SINOMA SCIENCE&TECHNOLOGY -A	2,200	30.43	66,946.00	
SINOMINE RESOURCE GROUP CO-A	700	89.28	62,496.00	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A	600	3.12	1,872.00	
SKSHU PAINT CO LTD-A	560	105.10	58,856.00	
SUZHOU TA&A ULTRA CLEAN TE-A	800	83.33	66,664.00	
TANGSHAN JIDONG CEMENT INV-A	3,700	9.82	36,334.00	
TIANSHAN ALUMINUM GROUP CO-A	7,500	7.01	52,575.00	
TIBET SUMMIT RESOURCES CO-A	1,500	29.60	44,400.00	
TONGKUN GROUP CO LTD-A	1,500	14.87	22,305.00	
TONGLING NONFERROUS METALS-A	10,400	3.08	32,032.00	
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD-A	1,300	5.90	7,670.00	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	3,800	90.91	345,458.00	
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	400	70.70	28,280.00	
WESTERN MINING CO -A	3,300	11.53	38,049.00	
WESTERN SUPERCONDUCTING TE-A	1,000	96.83	96,830.00	
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD-A	1,200	24.61	29,532.00	
XINJIANG ZHONGTAI CHEMICAL-A	4,100	7.49	30,709.00	
YINTAI GOLD CO LTD-A	2,380	9.52	22,657.60	
YONGXING SPECIAL MATERIALS-A	700	149.12	104,384.00	
YUNNAN ALUMINIUM CO LTD-A	3,100	9.63	29,853.00	
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	1,000	225.23	225,230.00	
YUNNAN TIN CO LTD-A	3,500	15.14	52,990.00	
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	1,508	89.97	135,674.76	
ZHEJIANG JUHUA CO-A	2,300	16.68	38,364.00	
ZHEJIANG YONGTAI TECH-A	1,500	32.90	49,350.00	
ZIBO QIXIANG TENGDA CHEMIC-A	4,500	7.71	34,695.00	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	22,600	8.74	197,524.00	
AECC AERO-ENGINE CONTROL-A	1,000	27.62	27,620.00	
AECC AVIATION POWER CO-A	2,500	50.48	126,200.00	

AVIC ELECTROMECHANICAL SY-A	3,000	11.92	35,760.00	
AVICOPTER PLC-A	500	44.61	22,305.00	
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	1,400	29.65	41,510.00	
BEIJING UNITED INFORMATION-A	580	89.50	51,910.00	
CHINA BAOAN GROUP-A	4,500	12.51	56,295.00	
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	4,400	20.95	92,180.00	
CHINA ENERGY ENGINEERING COR	30,000	2.35	70,500.00	
CHINA MEHECO CO LTD -A	2,240	14.94	33,465.60	
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	9,700	9.99	96,903.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	21,400	6.46	138,244.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	45,100	5.36	241,736.00	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	2,700	524.61	1,416,447.00	
COSCO SHIPPING DEVELOPMENT CO	18,400	3.01	55,384.00	
CRRC CORP LTD-A	26,200	5.16	135,192.00	
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	4,400	17.51	77,044.00	
EVE ENERGY CO LTD-A	2,020	102.90	207,858.00	
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	417	7.26	3,027.42	
GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A	600	233.00	139,800.00	
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	1,800	43.21	77,778.00	
GUANGDONG KINLONG HARDWARE-A	400	87.50	35,000.00	
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	1,680	41.41	69,568.80	
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	1,436	55.13	79,166.68	
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	5,300	26.24	139,072.00	
JIANGXI SPECIAL ELECTRIC -A	2,500	26.46	66,150.00	
KEDA INDUSTRIAL GROUP CO LTD	2,800	20.89	58,492.00	
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A	2,200	17.52	38,544.00	
LUOYANG XINQIANGLIAN SLEWI-A	340	93.45	31,773.00	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	21,800	3.45	75,210.00	
MING YANG SMART ENERGY GRO-A	1,800	33.17	59,706.00	
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	7,135	29.11	207,699.85	
NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO -A	300	311.00	93,300.00	
NINGBO ORIENT WIRES & CABL-A	1,000	84.11	84,110.00	
NINGBO RONBAY NEW ENERGY T-A	450	151.88	68,346.00	
NORTH INDUSTRIES GROUP RED-A	2,400	29.66	71,184.00	
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	16,500	7.58	125,070.00	

RIYUE HEAVY INDUSTRY CO LT-A	2,000	27.70	55,400.00	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	9,100	18.39	167,349.00	
SHANGHAI CONSTRUCTION GROU-A	5,600	2.93	16,408.00	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	10,400	4.45	46,280.00	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	2,700	62.38	168,426.00	
SICHUAN NEW ENERGY POWER CO	2,400	24.50	58,800.00	
SICHUAN ROAD&BRIDGE CO LT-A	4,500	10.74	48,330.00	
SIEYUAN ELECTRIC CO LTD-A	1,500	44.90	67,350.00	
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	1,500	120.58	180,870.00	
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	1,300	30.86	40,118.00	
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	256	458.50	117,376.00	
TBEA CO LTD-A	5,500	26.77	147,235.00	
TITAN WIND ENERGY SUZHOU-A	2,800	18.59	52,052.00	
WEICHAI POWER CO LTD-A	9,500	12.32	117,040.00	
WUXI SHANGJI AUTOMATION CO-A	700	157.94	110,558.00	
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	7,700	5.48	42,196.00	
XIAMEN C & D INC-A	4,400	12.01	52,844.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	3,400	15.03	51,102.00	
ZHEFU HOLDING GROUP CO LTD-A	5,300	4.81	25,493.00	
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	2,000	39.24	78,480.00	
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	420	44.23	18,576.60	
ZHEJIANG HANGKE TECHNOLOGY-A	800	66.58	53,264.00	
ZHEJIANG WEIXING NEW BUILD-A	1,300	20.45	26,585.00	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-A	800	62.05	49,640.00	
ZHUZHOU KIBING GROUP CO LT-A	4,000	10.75	43,000.00	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	6,400	5.81	37,184.00	
BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A	2,600	5.08	13,208.00	
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	800	48.40	38,720.00	
ZHEJIANG WEIMING ENVIRONME-A	2,340	32.20	75,348.00	
AIR CHINA LTD-A	6,400	10.05	64,320.00	
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	44,000	4.71	207,240.00	
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	10,800	4.99	53,892.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	9,100	6.70	60,970.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	12,870	14.53	187,001.10	
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	16,200	6.06	98,172.00	

LIAONING PORT CO LTD-A	21,900	1.71	37,449.00	
S F HOLDING CO LTD-A	5,600	54.50	305,200.00	
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	1,000	51.23	51,230.00	
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	8,900	5.60	49,840.00	
SINOTRANS LIMITED-A	2,000	3.77	7,540.00	
YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	4,000	19.34	77,360.00	
YUNDA HOLDING CO LTD-A	4,870	17.40	84,738.00	
BYD CO LTD -A	2,100	331.10	695,310.00	
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	200	174.37	34,874.00	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	7,826	17.94	140,398.44	
FAW JIEFANG GROUP CO LTD-A	3,200	8.85	28,320.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	1,900	42.43	80,617.00	
GREAT WALL MOTOR CO LTD-A	3,300	35.62	117,546.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A	6,900	15.71	108,399.00	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	3,000	21.46	64,380.00	
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	500	179.20	89,600.00	
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	1,200	19.02	22,824.00	
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	1,100	87.21	95,931.00	
SAIC MOTOR CORP LTD-A	8,610	16.66	143,442.60	
SAILUN GROUP CO LTD-A	3,100	11.77	36,487.00	
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	1,300	29.20	37,960.00	
SHENZHEN KEDALI INDUSTRY C-A	400	164.47	65,788.00	
BEIJING ROBOROCK TECHNOLOG-A	280	346.00	96,880.00	
ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A	600	99.90	59,940.00	
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	3,100	34.08	105,648.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-A	6,900	25.14	173,466.00	
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	1,000	28.70	28,700.00	
JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	1,040	47.90	49,816.00	
OPPEIN HOME GROUP INC-A	540	121.00	65,340.00	
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	14,100	4.38	61,758.00	
XIAMEN INTRETECH INC-A	510	20.16	10,281.60	
ZHEJIANG SEMIR GARMENT CO-A	400	5.51	2,204.00	
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	300	52.92	15,876.00	
BTG HOTELS GROUP CO LTD-A	1,600	21.43	34,288.00	
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	600	61.53	36,918.00	

SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	8,300	5.61	46,563.00	
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	1,080	13.00	14,040.00	
37 INTERACTIVE ENTERTAINME-A	3,900	20.30	79,170.00	
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	1,300	8.34	10,842.00	
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	15,900	6.33	100,647.00	
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY XI	100	363.90	36,390.00	
GIANT NETWORK GROUP CO LTD-A	200	8.49	1,698.00	
KUNLUN TECH CO LTD-A	800	14.91	11,928.00	
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	3,110	30.30	94,233.00	
PERFECT WORLD CO LTD-A	1,350	14.35	19,372.50	
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	7,100	4.69	33,299.00	
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	2,100	209.00	438,900.00	
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	5,000	8.34	41,700.00	
WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A	6,000	4.85	29,100.00	
DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	864	30.29	26,170.56	
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	546	50.65	27,654.90	
ANGEL YEAST CO LTD-A	700	45.63	31,941.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	600	240.47	144,282.00	
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	500	53.00	26,500.00	
ANHUI YINGJIA DISTILLERY C-A	600	55.47	33,282.00	
ANJOY FOODS GROUP CO LTD	400	156.20	62,480.00	
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	6,600	7.30	48,180.00	
BEIJING SHUNXIN AGRICULT-A	600	24.50	14,700.00	
CHACHA FOOD CO LTD-A	400	49.91	19,964.00	
CHONGQING BREWERY CO-A	400	130.25	52,100.00	
CHONGQING FULING ZHACAI-A	700	30.28	21,196.00	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	4,609	84.60	389,921.40	
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	900	18.45	16,605.00	
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	1,800	58.55	105,390.00	
HEILONGJIANG AGRICULTURE-A	2,500	14.11	35,275.00	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	4,800	27.00	129,600.00	
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	6,900	36.16	249,504.00	
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	1,000	43.96	43,960.00	
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	1,600	170.66	273,056.00	
JIANGXI ZHENGBANG TECH -A	2,000	6.42	12,840.00	

JIUGUI LIQUOR CO LTD-A	400	162.35	64,940.00	
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	300	34.61	10,383.00	
JUEWEI FOOD CO LTD-A	300	50.23	15,069.00	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	1,400	1,943.10	2,720,340.00	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	1,600	234.80	375,680.00	
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	5,716	61.71	352,734.36	
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	7,600	16.91	128,516.00	
SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT-A	1,372	27.88	38,251.36	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	1,320	285.00	376,200.00	
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	400	81.25	32,500.00	
TOLY BREAD CO LTD-A	980	14.65	14,357.00	
TONGWEI CO LTD-A	4,900	57.86	283,514.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-A	900	95.11	85,599.00	
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	7,060	24.11	170,216.60	
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	4,500	188.90	850,050.00	
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	2,200	48.27	106,194.00	
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	1,100	15.03	16,533.00	
BY-HEALTH CO LTD-A	1,300	19.27	25,051.00	
PROYA COSMETICS CO LTD-A	140	158.80	22,232.00	
YUNNAN BOTANEE BIO-TECHNOL-A	400	208.01	83,204.00	
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	7,229	34.13	246,725.77	
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	700	77.25	54,075.00	
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	1,740	46.00	80,040.00	
INTCO MEDICAL TECHNOLOGY C-A	540	23.63	12,760.20	
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	1,180	46.94	55,389.20	
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A	500	24.74	12,370.00	
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	200	11.65	2,330.00	
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	1,900	17.77	33,763.00	
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	480	5.15	2,472.00	
OVCTEK CHINA INC-A	920	51.81	47,665.20	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	4,400	17.92	78,848.00	
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	1,400	301.45	422,030.00	
SHENZHEN NEW INDUSTRIES BI-A	1,000	43.23	43,230.00	
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	300	154.80	46,440.00	
WINNING HEALTH TECHNOLOGY-A	1,040	7.97	8,288.80	

APELOA PHARMACEUTICAL CO-A	900	19.80	17,820.00	
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	200	265.34	53,068.00	
BEIJING TIANTAN BIOLOGICAL-A	1,296	20.86	27,034.56	
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	725	144.20	104,545.00	
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	300	52.32	15,696.00	
BGI GENOMICS CO LTD-A	300	66.87	20,061.00	
BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY COR-A	400	136.24	54,496.00	
CANSINO BIOLOGICS INC-A	200	168.20	33,640.00	
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	400	209.73	83,892.00	
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	1,500	38.00	57,000.00	
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	2,000	102.85	205,700.00	
DAAN GENE CO LTD-A	960	18.33	17,596.80	
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	100	37.88	3,788.00	
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	1,400	29.29	41,006.00	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	300	110.42	33,126.00	
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	1,780	21.64	38,519.20	
HUMANWELL HEALTHCARE GROUP-A	1,400	18.10	25,340.00	
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	300	582.18	174,654.00	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	6,916	37.64	260,318.24	
JOINCARE PHARMACEUTICAL GR-A	1,600	11.29	18,064.00	
JOINN LABORATORIES CHINA C-A	560	122.81	68,773.60	
LIVZON PHARMACEUTICAL GROU-A	500	32.72	16,360.00	
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	1,098	19.18	21,059.64	
PHARMARON BEIJING CO LTD-A	1,050	82.95	87,097.50	
SHANDONG BUCHANG PHARMACEU-A	260	19.20	4,992.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	1,900	48.88	92,872.00	
SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCE-A	835	64.21	53,615.35	
SHANGHAI MEDICILON INC-A	280	347.10	97,188.00	
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	10,500	5.77	60,585.00	
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	960	39.90	38,304.00	
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	100	25.47	2,547.00	
SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A	1,400	25.23	35,322.00	
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	200	19.40	3,880.00	
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	1,500	44.38	66,570.00	
WUXI APPTEC CO LTD-A	3,128	101.56	317,679.68	

YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	1,960	56.39	110,524.40	
ZHANGZHOU PIENTZEHUANG PHA-A	700	309.52	216,664.00	
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	1,210	20.95	25,349.50	
ZHEJIANG JIUZHOU PHARMACEU-A	1,300	50.92	66,196.00	
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	2,563	21.59	55,335.17	
ZHEJIANG ORIENT GENE BIOTE-A	280	115.65	32,382.00	
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A	400	51.72	20,688.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	101,400	2.84	287,976.00	
BANK OF BEIJING CO LTD -A	18,700	4.21	78,727.00	
BANK OF CHANGSHA CO LTD-A	7,500	7.70	57,750.00	
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	5,400	15.97	86,238.00	
BANK OF CHINA LTD-A	33,600	3.04	102,144.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	37,500	4.57	171,375.00	
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	5,800	14.36	83,288.00	
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	14,900	7.18	106,982.00	
BANK OF NANJING CO LTD -A	8,900	10.25	91,225.00	
BANK OF NINGBO CO LTD -A	7,900	32.72	258,488.00	
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	13,610	6.00	81,660.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	9,200	5.59	51,428.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	56,300	2.93	164,959.00	
CHINA MERCHANTS BANK-A	23,600	35.71	842,756.00	
CHINA MINSHENG BANKING-A	29,800	3.64	108,472.00	
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	16,900	3.26	55,094.00	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-A	8,500	3.62	30,770.00	
HUAXIA BANK CO LTD-A	12,300	5.14	63,222.00	
IND & COMM BK OF CHINA-A	77,400	4.39	339,786.00	
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	22,400	17.75	397,600.00	
PING AN BANK CO LTD-A	23,000	13.42	308,660.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	29,400	4.78	140,532.00	
QINGDAO RURAL COMMERCIAL B-A	5,300	3.13	16,589.00	
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	36,600	7.81	285,846.00	
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A	13,900	3.27	45,453.00	
BOC INTERNATIONAL CHINA CO-A	3,000	12.59	37,770.00	
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	1,500	7.43	11,145.00	
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	6,800	5.51	37,468.00	

CHINA GALAXY SECURITIES CO-A	2,800	8.84	24,752.00	
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	3,000	9.09	27,270.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPTAL-A	1,200	44.29	53,148.00	
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	8,200	13.90	113,980.00	
CITIC SECURITIES CO-A	13,500	19.96	269,460.00	
CSC FINANCIAL CO LTD-A	5,000	26.57	132,850.00	
DONGXING SECURITIES CO LT-A	6,200	8.54	52,948.00	
EAST MONEY INFORMATION CO-A	15,844	23.30	369,165.20	
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	3,200	15.21	48,672.00	
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	500	6.27	3,135.00	
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	7,200	6.59	47,448.00	
GF SECURITIES CO LTD-A	5,900	16.87	99,533.00	
GUANGZHOU YUEXIU FINANCIAL-A	4,374	6.47	28,299.78	
GUOLIAN SECURITIES CO LTD-A	2,200	11.28	24,816.00	
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	4,600	9.27	42,642.00	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	8,300	14.36	119,188.00	
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	500	6.43	3,215.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	8,900	9.51	84,639.00	
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	500	88.81	44,405.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	8,100	13.40	108,540.00	
HUAXI SECURITIES CO LTD-A	300	7.59	2,277.00	
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	6,700	6.63	44,421.00	
NANJING SECURITIES CO LTD-A	1,600	8.06	12,896.00	
NORTHEAST SECURITIES CO LT-A	3,000	6.91	20,730.00	
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	10,800	8.98	96,984.00	
SEALAND SECURITIES CO LTD -A	2,500	3.50	8,750.00	
SHANXI SECURITIES CO LTD-A	400	5.60	2,240.00	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	27,200	4.13	112,336.00	
SINOLINK SECURITIES CO LTD-A	4,300	8.74	37,582.00	
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	9,700	6.72	65,184.00	
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	3,800	3.82	14,516.00	
WESTERN SECURITIES CO LTD-A	500	6.42	3,210.00	
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	6,000	10.69	64,140.00	
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD-A	10,500	7.34	77,070.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	2,500	28.48	71,200.00	

CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	8,900	20.98	186,722.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	1,900	30.00	57,000.00	
PICC HOLDING CO-A	3,500	4.89	17,115.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	12,700	43.40	551,180.00	
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	8,000	12.74	101,920.00	
CHINA VANKE CO LTD -A	12,800	17.80	227,840.00	
FUTURE LAND HOLDINGS CO -A	2,400	20.85	50,040.00	
GEMDALE CORP-A	7,200	11.41	82,152.00	
JINKE PROPERTIES GROUP CO -A	700	2.59	1,813.00	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	12,800	16.50	211,200.00	
SHANGHAI LINGANG HOLDINGS-A	1,680	12.27	20,613.60	
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A	900	11.49	10,341.00	
YOUNGOR GROUP CO-A	3,100	6.58	20,398.00	
ZHEJIANG CHINA COMMODITIES-A	13,000	5.36	69,680.00	
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	8,400	7.50	63,000.00	
BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	600	177.00	106,200.00	
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	196	14.47	2,836.12	
BEIJING SINNET TECHNOLOGY-A	700	9.68	6,776.00	
DHC SOFTWARE CO LTD -A	400	6.07	2,428.00	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	2,364	40.76	96,356.64	
IFLYTEK CO LTD - A	2,500	41.57	103,925.00	
NAVINFO CO LTD-A	900	14.05	12,645.00	
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	400	94.20	37,680.00	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	2,496	42.81	106,853.76	
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	300	140.69	42,207.00	
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	3,708	20.83	77,237.64	
AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A	2,300	30.35	69,805.00	
BEIJING YUANLIU HONGYUAN E-A	200	113.74	22,748.00	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	41,400	3.89	161,046.00	
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	1,800	26.48	47,664.00	
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	2,600	9.94	25,844.00	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-A	11,000	4.34	47,740.00	
CHINA ZHENHUA GROUP SCIENC-A	500	122.51	61,255.00	
FIBERHOME TELECOM TECH CO-A	1,100	14.49	15,939.00	
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	13,500	9.80	132,300.00	

GOERTEK INC -A	3,300	31.97	105,501.00	
GRG BANKING EQUIPMENT CO -A	2,200	9.16	20,152.00	
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	6,900	5.01	34,569.00	
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICAT-A	300	8.88	2,664.00	
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	500	70.68	35,340.00	
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO-A	3,700	17.65	65,305.00	
HUAGONG TECH CO LTD-A	1,000	22.51	22,510.00	
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	600	24.85	14,910.00	
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	4,600	11.02	50,692.00	
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	7,633	32.42	247,461.86	
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	576	103.88	59,834.88	
NINESTAR CORP-A	1,800	52.54	94,572.00	
OFILM GROUP CO LTD-A	400	6.03	2,412.00	
RAYTRON TECHNOLOGY CO LTD-A	700	34.39	24,073.00	
SHANGHAI FRIENDESS ELECTRO-A	280	237.04	66,371.20	
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	2,300	16.04	36,892.00	
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	780	89.90	70,122.00	
SHENZHEN SUNLORD ELECTRONI-A	800	23.96	19,168.00	
SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	1,000	74.35	74,350.00	
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	700	22.88	16,016.00	
TIANJIN712 COMMUNICATION &-A	700	28.25	19,775.00	
TIANMA MICROELECTRONICS-A	2,400	9.68	23,232.00	
UNISPLENDOUR CORP LTD-A	1,876	20.20	37,895.20	
WESTONE INFORMATION INDUST-A	1,300	44.75	58,175.00	
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	1,200	71.35	85,620.00	
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	2,665	12.09	32,219.85	
WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHA-A	1,760	13.49	23,742.40	
XIAMEN FARATRONIC CO LTD-A	400	222.00	88,800.00	
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	900	74.20	66,780.00	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	2,400	15.07	36,168.00	
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	500	33.29	16,645.00	
ZHUZHOU HONGDA ELECTRONICS-A	700	52.94	37,058.00	
ZTE CORP-A	3,800	25.03	95,114.00	
CHINA UNITED NETWORK-A	46,500	3.43	159,495.00	
CECEP SOLAR ENERGY CO LT-A	6,500	8.83	57,395.00	

CECEP WIND POWER CORP-A	7,900	5.62	44,398.00	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	23,000	6.45	148,350.00	
CHINA THREE GORGES RENEWAB-A	30,600	6.49	198,594.00	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	26,400	25.05	661,320.00	
ENN NATURAL GAS CO LTD-A	1,900	17.56	33,364.00	
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	31,000	4.10	127,100.00	
HUADIAN POWER INTL CORP-A	12,500	4.97	62,125.00	
HUANENG POWER INTL INC-A	11,300	7.38	83,394.00	
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	6,600	11.12	73,392.00	
SHENZHEN ENERGY GROUP CO L-A	600	6.65	3,990.00	
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A	5,200	13.69	71,188.00	
ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	943	112.04	105,653.72	
AMLOGIC SHANGHAI INC-A	600	81.99	49,194.00	
CHINA RESOURCES MICROELECT-A	1,200	53.05	63,660.00	
FLAT GLASS GROUP CO LTD-A	2,300	38.14	87,722.00	
GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A	4,300	3.75	16,125.00	
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR B-A	756	121.97	92,209.32	
HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	1,680	67.42	113,265.60	
HANGZHOU LION ELECTRONICS -A	1,000	59.89	59,890.00	
HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	2,000	46.33	92,660.00	
INGENIC SEMICONDUCTOR CO -A	400	89.41	35,764.00	
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	3,080	70.80	218,064.00	
JCET GROUP CO LTD-A	1,900	25.17	47,823.00	
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	8,736	60.15	525,470.40	
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A	1,514	54.38	82,331.32	
NATIONAL SILICON INDUSTRY -A	3,600	20.74	74,664.00	
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	500	264.42	132,210.00	
SG MICRO CORP-A	375	164.66	61,747.50	
SHENZHEN SC NEW ENERGY TEC-A	300	121.80	36,540.00	
STARPOWER SEMICONDUCTOR LT-A	200	368.00	73,600.00	
TCL ZHONGHUAN RENEWABLE EN-A	4,300	53.22	228,846.00	
TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	1,900	8.82	16,758.00	
TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	800	16.40	13,120.00	
TRINA SOLAR CO LTD-A	2,200	69.96	153,912.00	
UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	800	200.86	160,688.00	

	WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	1,100	144.78	159,258.00	
	YANGZHOU YANGJIE ELECTRONI-A	700	62.15	43,505.00	
	ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	1,800	67.00	120,600.00	
オフショア人民元 小計		2,616,227		45,383,111.60 (930,426,400)	
サウジアラビアリアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	7,849	17.80	139,712.20	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	45,339	38.75	1,756,886.25	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	2,256	45.75	103,212.00	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	4,640	15.02	69,692.80	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	4,023	131.00	527,013.00	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	6,674	44.80	298,995.20	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	15,540	55.50	862,470.00	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	16,862	99.60	1,679,455.20	
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	6,906	25.10	173,340.60	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	13,830	14.26	197,215.80	
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	4,534	47.00	213,098.00	
	SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	714	190.60	136,088.40	
	JARIR MARKETING CO	1,096	143.60	157,385.60	
	ALMARAI CO	4,232	50.40	213,292.80	
	SAVOLA	4,558	32.00	145,856.00	
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	1,665	197.60	329,004.00	
	MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	955	240.00	229,200.00	
	AL RAJHI BANK	36,709	84.90	3,116,594.10	
	ALINMA BANK	18,025	36.30	654,307.50	
	ARAB NATIONAL BANK	11,172	30.30	338,511.60	
	BANK AL-JAZIRA	7,789	24.78	193,011.42	
	BANK ALBILAD	9,016	45.70	412,031.20	
	BANQUE SAUDI FRANSI	10,854	51.40	557,895.60	
	RIYAD BANK	25,334	36.75	931,024.50	
	SAUDI BRITISH BANK	17,365	41.65	723,252.25	
	SAUDI INVESTMENT BANK/THE	9,393	19.90	186,920.70	
	THE SAUDI NATIONAL BANK	41,103	68.90	2,831,996.70	
	SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING	708	200.00	141,600.00	
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	1,168	154.00	179,872.00	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	10,941	11.46	125,383.86	

	EMAAR ECONOMIC CITY	8,295	9.62	79,797.90	
	ELM CO	483	284.80	137,558.40	
	ETIHAD ETISALAT CO	7,054	36.05	254,296.70	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	9,085	11.70	106,294.50	
	SAUDI TELECOM CO	11,271	100.60	1,133,862.60	
	ACWA POWER CO	1,553	160.00	248,480.00	
	SAUDI ELECTRICITY CO	15,559	23.70	368,748.30	
サウジアラビアリアル 小計		394,550		19,953,357.68 (735,480,764)	
合　計		115,291,636		16,515,724,971 (16,515,724,971)	

(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	58,900	1,196,259.00	
		OPERADORA DE SITES MEX- A-1	19,700	458,616.00	
	メキシコペソ 小計		78,600	1,654,875.00 (11,150,713)	
	南アフリカランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	63,261	831,882.15	
	南アフリカランド 小計		63,261	831,882.15 (6,713,288)	
合計				17,864,001 (17,864,001)	

(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　47銘柄	100.0%	―	3.3%

メキシコペソ	株式	20銘柄	96.8%	—	2.0%
	投資証券	2銘柄	—	3.2%	0.1%
ブラジルレアル	株式	48銘柄	100.0%	—	4.8%
チリペソ	株式	12銘柄	100.0%	—	0.5%
コロンビアペソ	株式	4銘柄	100.0%	—	0.2%
ユーロ	株式	8銘柄	100.0%	—	0.2%
英ポンド	株式	1銘柄	—	—	—
トルコリラ	株式	12銘柄	100.0%	—	0.3%
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	15銘柄	100.0%	—	0.6%
ロシアルーブル	株式	10銘柄	—	—	—
香港ドル	株式	196銘柄	100.0%	—	25.2%
マレーシアリンギット	株式	34銘柄	100.0%	—	1.5%
タイバーツ	株式	42銘柄	100.0%	—	1.9%
フィリピンペソ	株式	20銘柄	100.0%	—	0.7%
インドネシアルピア	株式	25銘柄	100.0%	—	1.8%
韓国ウォン	株式	112銘柄	100.0%	—	11.8%
新台湾ドル	株式	87銘柄	100.0%	—	14.6%
インドルピー	株式	109銘柄	100.0%	—	13.5%
カタールリアル	株式	12銘柄	100.0%	—	1.0%
南アフリカランド	株式	36銘柄	98.8%	—	3.5%
	投資証券	1銘柄	—	1.2%	0.0%
アラブディルハム	株式	9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	494銘柄	100.0%	—	5.6%
サウジアラビアリアル	株式	37銘柄	100.0%	—	4.4%

（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）

	2022年 7月20日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	244,697,451
投資証券	26,198,292,650
派生商品評価勘定	636,500
未収配当金	168,374,614
前払金	2,997,400
差入委託証拠金	20,495,500
流動資産合計	26,635,494,115
資産合計	26,635,494,115
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,832,590
未払金	178,430,687
未払解約金	110,000
未払利息	663
流動負債合計	182,373,940
負債合計	182,373,940
純資産の部	
元本等	
元本	18,033,890,177
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	8,419,229,998
元本等合計	26,453,120,175
純資産合計	26,453,120,175
負債純資産合計	26,635,494,115

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）

2022年 7月20日現在	
１． 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年11月18日
期首元本額	20,469,651,367円
期中追加設定元本額	9,549,154,719円
期中一部解約元本額	11,984,915,909円
期末元本額	18,033,890,177円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド（安定型）	350,535,363円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	438,730,992円
りそなラップ型ファンド（成長型）	578,396,765円
ＤＣりそな　グローバルバランス	7,586,183円
つみたてバランスファンド	1,606,104,452円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	216,351,716円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	133,618,304円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	90,417,509円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	37,941,241円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	24,856,909円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	13,257,442円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	24,375,467円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスＥＳＧ	92,208,086円
九州ＳＤＧｓ・グローバルバランス	44,099,078円
りそな国内リートインデックス（ラップ専用）	71,749,337円
ＦＷりそな国内リートインデックスオープン	5,146,952,426円
ＦＷりそな国内リートインデックスファンド	4,351,252,703円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　Ｊリートインデックス	2,737,862,601円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	43,428,014円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	131,562,866円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	154,908,815円
Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド（適格機関投資家専用）	1,573,098,351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）	465,456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）	3,385,851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）	18,777,887円
Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド２０２１０２（適格機関投資家専用）	141,966,363円
２． 計算日における受益権の総数	
	18,033,890,177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	1.4669円
(10,000口当たり純資産額)	(14,669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

2022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

2022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）

2022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	2022年 7月20日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	877,063,307
合計	877,063,307

(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)

（2022年 7月20日現在）　　（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	不動産投信指数先物取引 買建	353,499,090	－	350,303,000	△3,196,090
合計		353,499,090	－	350,303,000	△3,196,090

（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	480	58,704,000	
	サンケイリアルエステート投資法人	755	73,461,500	
	ＳＯＳｉＬＡ物流リート投資法人	1,109	167,126,300	
	東海道リート投資法人	183	22,655,400	
	日本アコモデーションファンド投資法人	823	560,463,000	
	森ヒルズリート投資法人	2,803	432,502,900	
	産業ファンド投資法人	3,384	625,024,800	
	アドバンス・レジデンス投資法人	2,659	973,194,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	1,705	379,362,500	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	1,254	512,886,000	
	ＧＬＰ投資法人	7,719	1,296,020,100	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,109	380,387,000	
	日本プロロジスリート投資法人	3,899	1,327,609,500	
	星野リゾート・リート投資法人	417	264,378,000	
	Ｏｎｅリート投資法人	414	111,283,200	
	イオンリート投資法人	2,803	432,502,900	
	ヒューリックリート投資法人	2,223	356,569,200	
	日本リート投資法人	735	267,172,500	
	積水ハウス・リート投資法人	7,235	576,629,500	
	トーセイ・リート投資法人	498	67,080,600	
	ケネディクス商業リート投資法人	952	265,608,000	
	ヘルスケア＆メディカル投資法人	584	99,396,800	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	540	71,010,000	
	野村不動産マスターファンド投資法人	7,707	1,269,342,900	
	いちごホテルリート投資法人	395	35,629,000	
	ラサールロジポート投資法人	2,918	507,148,400	
	スターアジア不動産投資法人	2,463	145,563,300	
	マリモ地方創生リート投資法人	279	37,246,500	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	939	492,975,000	

	大江戸温泉リート投資法人	384	25,958,400	
	投資法人みらい	2,887	142,184,750	
	森トラスト・ホテルリート投資法人	559	70,266,300	
	三菱地所物流リート投資法人	692	326,278,000	
	ＣＲＥロジスティクスファンド投資法人	923	183,307,800	
	ザイマックス・リート投資法人	385	48,933,500	
	タカラレーベン不動産投資法人	940	107,254,000	
	アドバンス・ロジスティクス投資法人	929	142,694,400	
	日本ビルファンド投資法人	2,779	1,906,394,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	2,383	1,498,907,000	
	日本都市ファンド投資法人	12,025	1,254,207,500	
	オリックス不動産投資法人	4,749	878,565,000	
	日本プライムリアルティ投資法人	1,629	647,527,500	
	ＮＴＴ都市開発リート投資法人	2,285	327,440,500	
	東急リアル・エステート投資法人	1,598	310,331,600	
	グローバル・ワン不動産投資法人	1,633	172,444,800	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	5,365	745,198,500	
	森トラスト総合リート投資法人	1,703	245,232,000	
	インヴィンシブル投資法人	10,490	391,801,500	
	フロンティア不動産投資法人	836	446,424,000	
	平和不動産リート投資法人	1,625	232,537,500	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	1,607	515,847,000	
	福岡リート投資法人	1,233	205,787,700	
	ケネディクス・オフィス投資法人	737	521,059,000	
	いちごオフィスリート投資法人	1,953	164,052,000	
	大和証券オフィス投資法人	498	354,078,000	
	阪急阪神リート投資法人	1,201	178,468,600	
	スターツプロシード投資法人	371	93,529,100	
	大和ハウスリート投資法人	3,579	1,132,753,500	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	7,302	462,216,600	
	大和証券リビング投資法人	3,220	392,518,000	
	ジャパンエクセレント投資法人	2,186	265,161,800	
合計		139,670	26,198,292,650	

(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）

	2022年 7月20日現在
資産の部	
流動資産	
預金	283,372,304
コール・ローン	47,257,301
株式	275,869,191
投資証券	28,924,218,551
派生商品評価勘定	65,644
未収入金	2,390,011,847
未収配当金	63,567,619
流動資産合計	31,984,362,457
資産合計	31,984,362,457
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	75,605
未払金	1,693,400
未払利息	128
流動負債合計	1,769,133
負債合計	1,769,133
純資産の部	
元本等	
元本	21,136,405,855
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	10,846,187,469
元本等合計	31,982,593,324
純資産合計	31,982,593,324
負債純資産合計	31,984,362,457

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。 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）

2022年 7月20日現在	
１． 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年11月18日
期首元本額	18,224,922,649円
期中追加設定元本額	11,207,173,208円
期中一部解約元本額	8,295,690,002円
期末元本額	21,136,405,855円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド（安定型）	1,835,745,669円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	1,978,187,733円
りそなラップ型ファンド（成長型）	1,847,889,610円
ＤＣりそな　グローバルバランス	39,862,011円
つみたてバランスファンド	790,435,821円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	426,210,048円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	270,919,001円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	182,420,353円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	74,340,245円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	48,858,788円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	26,100,168円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	48,546,059円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスＥＳＧ	178,909,575円
九州ＳＤＧｓ・グローバルバランス	86,429,535円
ＦＷりそな先進国リートインデックスオープン	5,768,543,300円
ＦＷりそな先進国リートインデックスファンド	4,495,116,055円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　先進国リートインデックス	2,302,459,869円

Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	86,322,842円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	261,399,143円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	310,563,874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）	2,436,930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）	8,118,001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）	66,591,225円
２．　計算日における受益権の総数	
	21,136,405,855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	1.5132円
(10,000口当たり純資産額)	(15,132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

2022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

2022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）

2022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	2022年 7月20日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
株式	10,645,574
投資証券	△2,711,320,063
合計	△2,700,674,489

(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)

（2022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	為替予約取引				

の取引	買建	44,774,244	―	44,816,894	42,650
	米ドル	35,939,800	―	35,921,756	△18,044
	カナダドル	2,235,324	―	2,255,030	19,706
	英ポンド	6,599,120	―	6,640,108	40,988
	売建	2,822,019,561	―	2,822,072,172	△52,611
	米ドル	2,204,874,000	―	2,204,893,152	△19,152
	カナダドル	48,317,850	―	48,318,660	△810
	ユーロ	113,271,200	―	113,280,000	△8,800
	英ポンド	149,400,900	―	149,395,950	4,950
	オーストラリアドル	171,705,600	―	171,718,380	△12,780
	ニュージーランドドル	8,619,100	―	8,620,670	△1,570
	香港ドル	35,196,000	―	35,197,600	△1,600
	シンガポールドル	87,429,760	―	87,432,840	△3,080
	イスラエルシュケル	3,205,151	―	3,214,920	△9,769
合計		2,866,793,805	―	2,866,889,066	△9,961

（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	41,002	31.69	1,299,353.38	
	BROADSTONE NET LEASE INC-A	25,760	21.63	557,188.80	
米ドル 小計		66,762		1,856,542.18 (256,518,433)	
オーストラリアドル	CENTURIA CAPITAL GROUP	103,478	1.96	202,816.88	
オーストラリアドル 小計		103,478		202,816.88 (19,350,758)	
合　計		170,240		275,869,191 (275,869,191)	

(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	14,411	240,951.92	
		AGREE REALTY CORP	11,437	872,185.62	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	11,045	198,699.55	
		ALEXANDER'S INC	350	82,222.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	22,607	3,313,281.92	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	1,626	29,186.70	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	8,005	241,030.55	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	21,231	1,383,836.58	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	44,982	1,620,701.46	
		APARTMENT INCOME REIT CO	23,911	1,023,629.91	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	23,203	168,917.84	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	32,370	518,567.40	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	10,281	137,662.59	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	5,488	47,635.84	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	21,286	4,160,561.56	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	4,262	111,749.64	
		BOSTON PROPERTIES INC	21,701	1,952,004.95	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	10,664	55,239.52	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	25,992	247,183.92	

BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	45,576	981,251.28	
BRT APARTMENTS CORP	1,983	45,985.77	
CAMDEN PROPERTY TRUST	16,215	2,170,053.45	
CARETRUST REIT INC	14,753	289,011.27	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	3,901	107,472.55	
CEDAR REALTY TRUST INC	1,951	56,461.94	
CENTERSPACE	2,336	189,589.76	
CHATHAM LODGING TRUST	7,387	87,388.21	
CITY OFFICE REIT INC	6,571	88,051.40	
CLIPPER REALTY INC	2,188	18,926.20	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	3,577	130,310.11	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	17,080	458,598.00	
COUSINS PROPERTIES INC	22,637	678,430.89	
CREATIVE MEDIA & COMMUNITY T	2,000	14,000.00	
CTO REALTY GROWTH INC	2,741	58,465.53	
CUBESMART	34,172	1,449,576.24	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	32,033	284,773.37	
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	53,000	38,690.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	43,341	5,358,247.83	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	38,904	72,361.44	
DOUGLAS EMMETT INC	26,721	607,635.54	
DUKE REALTY CORP	58,536	3,447,185.04	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	82,000	—	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	13,774	269,970.40	
EASTGROUP PROPERTIES INC	6,347	1,010,251.99	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	20,747	159,336.96	
EPR PROPERTIES	11,407	594,190.63	
EQUINIX INC	13,858	8,832,812.04	
EQUITY COMMONWEALTH	17,121	476,306.22	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	26,334	1,860,233.76	
EQUITY RESIDENTIAL	52,095	3,780,534.15	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	19,952	453,908.00	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	9,946	2,651,504.14	
EXTRA SPACE STORAGE INC	20,444	3,518,821.28	

FARMLAND PARTNERS INC	5,189	72,749.78	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	10,877	1,097,924.38	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	20,101	970,275.27	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	12,236	342,240.92	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	15,600	59,280.00	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	35,804	1,818,485.16	
GETTY REALTY CORP	6,169	167,673.42	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	5,865	112,959.90	
GLADSTONE LAND CORP	4,740	115,798.20	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	9,342	106,405.38	
GLOBAL NET LEASE INC	15,738	233,237.16	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	25,262	616,645.42	
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	32,683	954,670.43	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	82,132	2,172,391.40	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	5,354	55,360.36	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	15,982	553,296.84	
HOST HOTELS & RESORTS INC	108,787	1,862,433.44	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	21,954	323,162.88	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	33,617	715,033.59	
INDUS REALTY TRUST INC	1,064	63,988.96	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	9,923	97,642.32	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	4,260	379,310.40	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	10,238	279,702.16	
INVITATION HOMES INC	92,912	3,314,171.04	
IRON MOUNTAIN INC	44,238	2,053,527.96	
JBG SMITH PROPERTIES	16,514	410,372.90	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	127,900	90,169.50	
KILROY REALTY CORP	15,975	854,822.25	
KIMCO REALTY CORP	94,063	1,976,263.63	
KITE REALTY GROUP TRUST	33,316	617,678.64	
LIFE STORAGE INC	12,845	1,484,111.30	
LTC PROPERTIES INC	5,998	238,360.52	
LXP INDUSTRIAL TRUST	43,607	453,076.73	
MACERICH CO/THE	32,619	327,820.95	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	288,000	161,280.00	

MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	91,340	1,476,054.40	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	17,572	3,004,636.28	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	26,769	1,221,201.78	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	12,812	652,130.80	
NATL HEALTH INVESTORS INC	6,974	426,948.28	
NECESSITY RETAIL REIT INC/TH	20,179	155,378.30	
NETSTREIT CORP	7,268	149,430.08	
NEXPOINT RESIDENTIAL	3,516	215,987.88	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	7,327	151,888.71	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	35,799	1,104,041.16	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,621	69,404.08	
ORION OFFICE REIT INC	8,573	92,416.94	
PARAMOUNT GROUP INC	24,886	185,400.70	
PARK HOTELS & RESORTS INC	35,488	530,190.72	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	19,965	374,144.10	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	611	2,706.73	
PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	17,324	595,772.36	
PHYSICIANS REALTY TRUST	34,278	576,213.18	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	18,706	251,595.70	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	6,118	108,043.88	
POSTAL REALTY TRUST INC- A	2,739	42,810.57	
PRIME US REIT	92,400	62,832.00	
PROLOGIS INC	112,706	14,100,647.66	
PUBLIC STORAGE	23,250	7,353,510.00	
REALTY INCOME CORP	91,584	6,418,206.72	
REGENCY CENTERS CORP	23,608	1,474,083.52	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	18,874	309,722.34	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	25,127	1,540,285.10	
RLJ LODGING TRUST	25,350	305,721.00	
RPT REALTY	12,901	135,073.47	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	8,388	705,514.68	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	35,136	517,201.92	
SAFEHOLD INC	2,358	96,159.24	
SAUL CENTERS INC	1,990	96,594.60	
SERVICE PROPERTIES TRUST	25,040	163,761.60	

		SIMON PROPERTY GROUP INC	49,984	5,111,863.68	
		SITE CENTERS CORP	27,629	383,490.52	
		SL GREEN REALTY CORP	9,743	475,653.26	
		SPIRIT REALTY CAPITAL INC	20,434	856,388.94	
		STAG INDUSTRIAL INC	27,291	849,023.01	
		STORE CAPITAL CORP	38,431	1,047,629.06	
		SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	16,221	126,037.17	
		SUN COMMUNITIES INC	18,514	2,917,250.98	
		SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	32,705	354,849.25	
		TANGER FACTORY OUTLET CENTER	15,855	246,862.35	
		TERRENO REALTY CORP	11,503	668,209.27	
		UDR INC	45,561	2,069,836.23	
		UMH PROPERTIES INC	7,665	150,310.65	
		UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1,945	102,190.30	
		URBAN EDGE PROPERTIES	16,767	257,876.46	
		URSTADT BIDDLE - CLASS A	4,921	85,723.82	
		VENTAS INC	60,846	3,132,960.54	
		VERIS RESIDENTIAL INC	12,126	163,943.52	
		VICI PROPERTIES INC	146,616	4,825,132.56	
		VORNADO REALTY TRUST	24,198	715,776.84	
		WASHINGTON REIT	13,293	280,881.09	
		WELLTOWER INC	69,111	5,676,086.43	
		WHITESTONE REIT	7,537	82,153.30	
		WP CAREY INC	29,363	2,451,516.87	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	17,371	275,330.35	
	米ドル 小計		3,972,591	159,770,594.98 (22,075,503,108)	
	カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	9,501	316,288.29	
		ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	8,853	101,189.79	
		AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	2,822	36,178.04	
		BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	3,439	151,247.22	
		BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	5,776	20,793.60	
		CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	12,955	577,663.45	
		CHOICE PROPERTIES REIT	24,378	339,829.32	
		CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	7,731	124,314.48	

		CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	7,892	126,745.52	
		DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	18,958	231,098.02	
		DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	3,470	67,213.90	
		EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	7,098	26,120.64	
		FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	16,324	247,308.60	
		GRANITE REAL ESTATE INVESTME	4,913	376,434.06	
		H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	20,504	263,886.48	
		INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	2,543	18,309.60	
		INTERRENT REAL ESTATE INVEST	10,442	126,661.46	
		KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	8,593	146,252.86	
		MINTO APARTMENT REAL ESTATE	2,991	43,967.70	
		MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	3,128	51,142.80	
		NEXUS INDUSTRIAL REIT	4,813	46,830.49	
		NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	17,642	222,994.88	
		PLAZA RETAIL REIT	7,567	30,116.66	
		PRIMARIS REIT	7,526	96,558.58	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	23,030	462,442.40	
		SLATE GROCERY REIT	4,386	62,500.50	
		SLATE OFFICE REIT	6,335	29,141.00	
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	10,753	305,170.14	
		SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	14,137	240,470.37	
		TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	7,115	46,318.65	
		カナダドル 小計	285,615	4,935,189.50 (529,990,000)	
	ユーロ	AEDIFICA	5,969	570,337.95	
		ALSTRIA OFFICE REIT-AG	2,209	25,072.15	
		ALTAREA	646	92,765.60	
		BEFIMMO	725	34,365.00	
		CARE PROPERTY INVEST	4,074	95,127.90	
		CARMILA	6,861	105,796.62	
		COFINIMMO	4,490	478,634.00	
		COIMA RES SPA	3,009	29,969.64	
		COVIVIO	7,198	413,525.10	
		CROMWELL REIT EUR	50,540	100,069.20	
		EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	6,032	134,996.16	

		GECINA SA	8,275	769,161.25	
		HAMBORNER REIT AG	10,719	89,074.89	
		ICADE	4,871	225,429.88	
		IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	8,670	31,298.70	
		INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	40,692	252,290.40	
		INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	3,569	96,006.10	
		IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	65,287	90,748.93	
		KLEPIERRE	29,680	628,325.60	
		LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	8,741	41,825.68	
		MERCIALYS	7,777	68,204.29	
		MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	50,596	500,141.46	
		MONTEA NV	1,555	143,371.00	
		NSI NV	2,654	84,928.00	
		RETAIL ESTATES	1,723	116,647.10	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	17,738	894,527.34	
		VASTNED RETAIL NV	2,964	70,691.40	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	21,517	654,977.48	
		WERELDHAVE NV	6,050	92,928.00	
		XIOR STUDENT HOUSING NV	3,164	136,210.20	
	ユーロ 小計		387,995	7,067,447.02 (1,000,750,498)	
	英ポンド	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	66,618	52,361.74	
		AEW UK REIT PLC	25,892	28,325.84	
		ASSURA PLC	449,648	304,411.69	
		BALANCED COMM PROPERTY TRUST	121,439	138,197.58	
		BIG YELLOW GROUP PLC	26,337	361,343.64	
		BRITISH LAND CO PLC	142,740	671,877.18	
		CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	129,400	188,794.60	
		CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	94,484	76,626.52	
		CUSTODIAN REIT PLC	66,884	71,030.80	
		DERWENT LONDON PLC	17,066	467,608.40	
		EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	91,561	81,855.53	
		GREAT PORTLAND ESTATES PLC	38,521	227,273.90	
		HAMMERSON PLC	529,209	110,128.39	
		HOME REIT PLC	120,141	138,642.71	
		IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	58,502	68,330.33	

		INTU PROPERTIES PLC	117,549	—	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	114,343	800,629.68	
		LONDONMETRIC PROPERTY PLC	149,101	358,737.00	
		LXI REIT PLC	287,241	421,095.30	
		NEWRIVER REIT PLC	48,868	45,300.63	
		PICTON PROPERTY INCOME LTD	83,081	73,859.00	
		PRIMARY HEALTH PROPERTIES	202,695	282,354.13	
		PRS REIT PLC/THE	83,390	90,394.76	
		REGIONAL REIT LTD	65,361	47,778.89	
		SAFESTORE HOLDINGS PLC	32,102	350,232.82	
		SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	85,821	45,227.66	
		SEGRO PLC	183,084	1,884,849.78	
		SHAFTESBURY PLC	43,778	225,675.59	
		SUPERMARKET INCOME REIT PLC	188,255	235,318.75	
		TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	58,694	53,998.48	
		TRITAX BIG BOX REIT PLC	284,598	534,190.44	
		UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	130,172	99,060.89	
		UNITE GROUP PLC	60,744	708,275.04	
		WORKSPACE GROUP PLC	21,161	116,808.72	
	英ポンド 小計		4,218,480	9,360,596.41 (1,553,952,610)	
	オーストラリアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	66,994	186,243.32	
		ARENA REIT	56,446	258,522.68	
		BWP TRUST	81,019	336,228.85	
		CENTURIA INDUSTRIAL REIT	88,007	258,740.58	
		CENTURIA OFFICE REIT	72,290	129,760.55	
		CHARTER HALL GROUP	79,083	903,127.86	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	103,266	458,501.04	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	87,921	348,167.16	
		CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	54,648	198,918.72	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	231,178	183,786.51	
		DEXUS INDUSTRIA REIT	36,946	102,340.42	
		DEXUS/AU	179,295	1,679,994.15	
		GDI PROPERTY GROUP	81,966	79,507.02	
		GOODMAN GROUP	282,854	5,258,255.86	

		GPT GROUP	319,640	1,412,808.80	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	47,854	174,188.56	
		HEALTHCO REIT	42,260	69,517.70	
		HOME CONSORTIUM LTD	30,870	159,906.60	
		HOMECO DAILY NEEDS REIT	246,851	336,951.61	
		HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	31,845	104,770.05	
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	59,788	266,056.60	
		MIRVAC GROUP	658,061	1,368,766.88	
		NATIONAL STORAGE REIT	183,418	412,690.50	
		RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE	50,842	41,182.02	
		RURAL FUNDS GROUP	62,950	164,929.00	
		SCENTRE GROUP	864,542	2,386,135.92	
		SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	186,908	538,295.04	
		STOCKLAND	398,265	1,513,407.00	
		VICINITY CENTRES	645,418	1,265,019.28	
		WAYPOINT REIT	116,047	291,277.97	
		オーストラリアドル 小計	5,447,472	20,887,998.25 (1,992,923,913)	
	ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	137,835	177,807.15	
		GOODMAN PROPERTY TRUST	176,216	369,172.52	
		KIWI PROPERTY GROUP LTD	255,587	255,587.00	
		PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	220,332	310,668.12	
		VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	77,550	212,874.75	
		ニュージーランドドル 小計	867,520	1,326,109.54 (114,337,164)	
	香港ドル	CHAMPION REIT	312,000	1,073,280.00	
		FORTUNE REIT	244,000	1,590,880.00	
		LINK REIT	351,400	22,612,590.00	
		PROSPERITY REIT	204,000	493,680.00	
		SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	165,000	618,750.00	
		YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	374,000	1,118,260.00	
		香港ドル 小計	1,650,400	27,507,440.00 (484,130,944)	
	シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LT	77,900	106,723.00	
		ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	559,300	1,605,191.00	
		ASCOTT TRUST	326,396	368,827.48	

		CAPITALAND CHINA TRUST	185,400	211,356.00	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	850,232	1,776,984.88	
		CDL HOSPITALITY TRUSTS	137,100	171,375.00	
		DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	52,700	35,572.50	
		EC WORLD REIT	50,000	25,000.00	
		ESR-LOGOS REIT	847,550	343,257.75	
		FAR EAST HOSPITALITY TRUST	172,000	110,080.00	
		FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	199,000	53,730.00	
		FRASERS CENTREPOINT TRUST	179,900	404,775.00	
		FRASERS LOGISTICS & COMMERCI	486,579	652,015.86	
		IREIT GLOBAL	87,300	52,380.00	
		KEPPEL DC REIT	222,800	436,688.00	
		KEPPEL REIT	331,800	351,708.00	
		LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	313,200	253,692.00	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	362,500	652,500.00	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	325,900	847,340.00	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	533,800	907,460.00	
		OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	391,700	152,763.00	
		PARKWAYLIFE REAL ESTATE	65,100	302,064.00	
		SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	91,000	69,160.00	
		SPH REIT	155,500	143,837.50	
		STARHILL GLOBAL REIT	230,200	133,516.00	
		SUNTEC REIT	361,300	570,854.00	
	シンガポールドル 小計		7,596,157	10,738,850.97 (1,067,119,620)	
	韓国ウォン	D&D PLATFORM REIT CO LTD	8,140	34,147,300.00	
		ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	25,359	131,106,030.00	
		IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	4,000	19,200,000.00	
		JR REIT XXVII	23,911	105,088,845.00	
		KORAMCO ENERGY PLUS REIT	4,199	22,968,530.00	
		LOTTE REIT CO LTD	21,452	108,547,120.00	
		MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	13,249	58,958,050.00	
		NH ALL-ONE REIT CO LTD	4,876	21,430,020.00	
		SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	9,512	73,718,000.00	
		SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LT	4,632	23,113,680.00	

		SK REITS CO LTD	12,904	71,359,120.00	
	韓国ウォン 小計		132,234	669,636,695.00 (70,981,489)	
	イスラエルシュケル	REIT 1 LTD	28,167	545,313.12	
		SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	33,041	313,889.50	
	イスラエルシュケル 小計		61,208	859,202.62 (34,529,205)	
合計				28,924,218,551 (28,924,218,551)	

(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	2銘柄	1.1%	—	0.9%
	投資証券	148銘柄	—	98.9%	75.6%
カナダドル	投資証券	30銘柄	—	100.0%	1.8%
ユーロ	投資証券	30銘柄	—	100.0%	3.4%
英ポンド	投資証券	34銘柄	—	100.0%	5.3%
オーストラリアドル	株式	1銘柄	1.0%	—	0.1%
	投資証券	30銘柄	—	99.0%	6.8%
ニュージーランドドル	投資証券	5銘柄	—	100.0%	0.4%
香港ドル	投資証券	6銘柄	—	100.0%	1.7%
シンガポールドル	投資証券	26銘柄	—	100.0%	3.7%
韓国ウォン	投資証券	11銘柄	—	100.0%	0.2%
イスラエルシュケル	投資証券	2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。

２【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2022年 7月29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	2,721,885,111円
Ⅱ　負債総額	1,219,040円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	2,720,666,071円
Ⅳ　発行済口数	2,775,223,876口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.9803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	1,326,442,242円
Ⅱ　負債総額	56円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	1,326,442,186円
Ⅳ　発行済口数	1,335,668,450口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.9931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	824,757,126円
Ⅱ　負債総額	31,628,033円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	793,129,093円
Ⅳ　発行済口数	844,224,449口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.9395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	736,946,456円
Ⅱ　負債総額	4,461,005円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	732,485,451円
Ⅳ　発行済口数	775,018,540口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.9451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	9,160,854,326円
Ⅱ　負債総額	47,714,541円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	9,113,139,785円
Ⅳ　発行済口数	8,311,331,424口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0965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	2,482,806,130円
Ⅱ　負債総額	391,241円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	2,482,414,889円
Ⅳ　発行済口数	1,958,569,608口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2675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	4,260,064,224円
Ⅱ　負債総額	1,331,762円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	4,258,732,462円
Ⅳ　発行済口数	2,719,545,677口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.5660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	18,921,766,030円
Ⅱ　負債総額	10,037,615円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	18,911,728,415円
Ⅳ　発行済口数	11,838,451,676口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.5975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	31,500,718,751円
Ⅱ　負債総額	201,186,245円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	31,299,532,506円
Ⅳ　発行済口数	20,780,703,909口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.5062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	30,194,319,836円
Ⅱ　負債総額	2,199,454円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	30,192,120,382円
Ⅳ　発行済口数	19,484,159,910口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.5496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な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な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

2022年7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（2022年7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。
2022年7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	117	1,320,128
単位型株式投資信託	3	10,255
単位型公社債投資信託	2	3,146
合計	122	1,333,531

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。
（2）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７期事業年度（自 2021年４月１日 至 2022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ております。

（1）【貸借対照表】

（単位：千円）

		前事業年度 （2021年３月31日）	当事業年度 （2022年３月31日）
資産の部			
流動資産			
預金		4,261,664	7,480,501
前払費用		245,658	270,287
未収入金		8,551	247
未収委託者報酬		768,778	972,599
未収運用受託報酬		2,597,734	3,009,122
未収投資助言報酬		437,046	507,363
流動資産計		8,319,433	12,240,121
固定資産			
有形固定資産			
建物	※1	5,302	8,415
器具備品	※1	18,218	15,450
有形固定資産計		23,520	23,866
無形固定資産			
ソフトウェア		8,588	3,919
ソフトウェア仮勘定		―	3,100
無形固定資産計		8,588	7,019
投資その他の資産			
投資有価証券		19,301	37,596
繰延税金資産		128,654	118,572
投資その他の資産計		147,956	156,168

固定資産計	180,065	187,054
資産合計	8,499,498	12,427,176

（単位：千円）

		前事業年度 （2021年３月31日）	当事業年度 （2022年３月31日）
負債の部			
流動負債			
未払金			
未払手数料		256,287	274,374
その他未払金	※２	1,255,082	1,568,028
未払費用		99,584	105,943
未払法人税等		269,609	250,779
未払消費税等		352,528	276,917
預り金		1,387	2,465
賞与引当金		224,862	253,537
流動負債計		2,459,343	2,732,047
負債合計		2,459,343	2,732,047
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		4,548,350	8,203,810
利益剰余金計		4,548,350	8,203,810
株主資本計		6,038,350	9,693,810
評価・換算差額等			
その他有価証券評価差額金		1,804	1,318
評価・換算差額等計		1,804	1,318
純資産合計		6,040,155	9,695,129
負債・純資産合計		8,499,498	12,427,176

（２）【損益計算書】

（単位：千円）

	前事業年度 （自　2020年４月１日 至　2021年３月31日）	当事業年度 （自　2021年４月１日 至　2022年３月31日）
営業収益		
委託者報酬	3,539,887	4,788,765
運用受託報酬	4,624,333	5,438,177
投資助言報酬	839,669	982,472
その他営業収益	261	―
営業収益計	9,004,153	11,209,415
営業費用		
支払手数料	1,166,440	1,460,131
広告宣伝費	37,315	49,322
調査費		

調査費		1,297,321	1,502,951
委託調査費		98,375	137,291
委託計算費		207,635	269,116
事務委託費		23,815	23,751
営業雑経費			
印刷費		75,269	95,519
協会費		9,101	12,887
販売促進費		3,264	2,277
その他		55,514	64,110
営業費用計		2,974,056	3,617,359
一般管理費			
給料			
役員報酬		110,648	127,995
給料・手当		1,104,231	1,260,284
賞与		143,217	169,303
賞与引当金繰入額		224,862	253,537
旅費交通費		4,372	6,944
租税公課		73,538	92,204
不動産賃借料		97,751	99,813
固定資産減価償却費		21,729	15,365
諸経費		256,552	270,995
一般管理費計		2,036,904	2,296,443
営業利益		3,993,191	5,295,612
営業外収益			
受取配当金		189	506
投資有価証券売却益		―	866
雑収入		1,694	3,244
営業外収益計		1,883	4,617
営業外費用			
投資有価証券売却損		277	―
為替差損		―	170
雑損失		273	1,455
営業外費用計		550	1,625
経常利益		3,994,525	5,298,604
税引前当期純利益		3,994,525	5,298,604
法人税、住民税及び事業税	※1	1,281,563	1,632,846
法人税等調整額		△57,337	10,297
法人税等計		1,224,226	1,643,143
当期純利益		2,770,298	3,655,460

（３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自　2020年４月１日　　至　2021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	1,778,051	1,778,051	3,268,051
当期変動額						
当期純利益	―	―	―	2,770,298	2,770,298	2,770,298

株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	―	―	―	―	―	―
当期変動額合計	―	―	―	2,770,298	2,770,298	2,770,298
当期末残高	1,000,000	490,000	490,000	4,548,350	4,548,350	6,038,350

	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	△433	△433	3,267,617
当期変動額			
当期純利益	―	―	2,770,298
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	2,238	2,238	2,238
当期変動額合計	2,238	2,238	2,772,537
当期末残高	1,804	1,804	6,040,155

当事業年度（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

（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

時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法（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　　８～15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）連結納税制度の適用
当社は、株式会社りそなホールディングスを連結納税親会社とする連結納税主体の連結納税子会社として、連結納税制度を適用しております。

（２）連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用
当社は、翌事業年度から、連結納税制度からグループ通算制度へ移行することとなります。ただし、「所得税法等の一部を改正する法律」(2020年法律第8号)において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」(実務対応報告第39号 2020年3月31日)第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日)第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。
なお、翌事業年度の期首より、グループ通算制度を適用する場合における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の取扱いを定めた「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第42号 2021年８月12日）を適用する予定であります。

（会計方針の変更）
（収益認識に関する会計基準等の適用）
「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2020年3月31日。以下「収益認識会計基準」という。）等を当事業年度の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することといたしました。
この結果、当財務諸表に与える影響はありません。

（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」（企業会計基準第30号 2019年７月４日。以下「時価算定会計基準」という。）等を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 2019年７月４日）第44－２項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等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といたしました。

（未適用の会計基準等）

「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）

（１）概要

「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）の2021年６月17日の改正は、2019年７月４日の公表時において、「投資信託の時価の算定」に関する検討には、関係者との協議等に一定の期間が必要と考えられるため、また、「貸借対照表に持分相当額を純額で計上する組合等への出資」の時価の注記についても、一定の検討を要するため、時価算定会計基準公表後、概ね1年をかけて検討を行うこととされていたものが、改正され、公表されたものです。

（２）適用日

2023年３月期の期首から適用します。

（３）当該会計基準等の適用による影響

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」の適用による財務諸表に与える影響額については、現時点で評価中であります。

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 （2021年３月31日）	当事業年度 （2022年３月31日）
建物	1,346千円	2,073千円
器具備品	22,447千円	32,416千円

※２　関係会社に対する資産及び負債

	前事業年度 （2021年３月31日）	当事業年度 （2022年３月31日）
流動負債		
その他未払金	1,030,722千円	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　2020年４月１日 至　2021年３月31日）	当事業年度 （自　2021年４月１日 至　2022年３月31日）
法人税、住民税及び事業税	1,029,080千円	1,311,417千円

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自　2020年４月１日　至　2021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　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。

（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
当社は、国の預金保護の対象となる決済性預金に預け入れ管理しております。
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　2020年４月１日　至　2021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	19,301	19,301	－
資産計	19,301	19,301	－

（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（円）	１年超５年以内（円）	５年超10年以内（円）	10年超（円）
預金	4,261,664	－	－	－
未収入金	8,551	－	－	－
未収委託者報酬	768,778	－	－	－
未収運用受託報酬	2,597,734	－	－	－
未収投資助言報酬	437,046	－	－	－
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	－	12,169	－	－
合計	8,073,775	12,169	－	－

当事業年度（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）
預金	7,480,501	－	－	－
未収入金	247	－	－	－
未収委託者報酬	972,599	－	－	－
未収運用受託報酬	3,009,122	－	－	－
未収投資助言報酬	507,363	－	－	－
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	11,969,834	19,725	2,959	－

３．金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

「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 2019年7月4 日）第26項の経過措置を適用した投資信託については注記を省略しております。当該投資信託の貸借対照表計上額は37,596千円であります。

（有価証券関係）

１．その他有価証券

前事業年度（自　2020年４月１日　至　2021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	15,870	13,100	2,770
	小計	15,870	13,100	2,770
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	3,430	3,600	△169
	小計	3,430	3,600	△169
合計		19,301	16,700	2,601

当事業年度（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

２．事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（自　2020年４月１日　至　2021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	1,723	―	277
合計	1,723	―	277

当事業年度（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	―

（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 （2021年３月31日）	当事業年度 （2022年３月31日）
繰延税金資産		
賞与引当金	68,830千円	77,607千円
未払事業所税	1,246千円	1,363千円
未払事業税	54,775千円	36,333千円
未確定債務	757千円	757千円
減価償却超過額	3,840千円	3,090千円
その他有価証券評価差額金	51千円	357千円
繰延税金資産小計	129,502千円	119,511千円
評価性引当額	―	―
繰延税金資産合計	129,502千円	119,511千円
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	848千円	939千円
繰延税金負債合計	848千円	939千円
繰延税金資産の純額	128,654千円	118,572千円

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　2020年４月１日　至　2021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	0.01%
住民税均等割	0.06%
その他	△0.03%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	30.65%

当事業年度（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	31.01%

（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　2020年４月１日　至　2021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	5,083,778

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　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。

（関連当事者情報）

前事業年度（自　2020年４月１日　至　2021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	50,472	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）	1,029,080	その他未払金	1,030,722

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）
	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）	4,459,201	未収運用受託報酬	2,531,968

親会社の子会社					－		投資助言報酬（注２）	624,314	未収投資助言報酬	358,053
							支払手数料（注３）	746,352	未払手数料	164,487

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　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） 投資助言報酬（注2）	5,202,291 762,418	未収運用受託報酬 未収投資助言報酬	2,880,437 432,666
							支払手数料（注3）	922,420	未払手数料	175,773

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　2020年４月１日 至　2021年３月31日）	当事業年度 （自　2021年４月１日 至　2022年３月31日）
１株当たり純資産額	1,525円29銭	2,448円26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（△）	699円57銭	923円09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　2020年４月１日 至　2021年３月31日）	当事業年度 （自　2021年４月１日 至　2022年３月31日）
当期純利益又は当期純損失（△）（千円）	2,770,298	3,655,460
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）	2,770,298	3,655,460
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　2020年４月１日　至　2021年３月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自　2021年４月１日　至　2022年３月31日）

該当事項はありません。

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。

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

（１）受託会社

名　　称	資本金の額 （2022年3月末現在）	事業の内容
株式会社りそな銀行	279,928百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

＜再信託受託会社の概要＞

名称　　：株式会社日本カストディ銀行
資本金の額　：51,000百万円（2022年3月末現在）
事業の内容　：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
再信託の目的：原信託契約にかかる信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託者から再信託受託者（株式会社日本カストディ銀行）へ委託するため、原信託財産のすべてを再信託受託者へ移管することを目的とします。

（２）販売会社

名　　称	資本金の額 （2022年3月末現在）	事業の内容
九州ＦＧ証券株式会社	3,000百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社大分銀行	19,598百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社鹿児島銀行	18,130百万円	
株式会社肥後銀行	18,128百万円	
株式会社宮崎銀行	14,697百万円	

２【関係業務の概要】

（１）受託会社
ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行ないます。
（２）販売会社
日本におけるファンドの募集、解約、収益分配金および償還金の取扱いなどを行ないます。

３【資本関係】

（１）受託会社
該当事項はありません。
（２）販売会社
該当事項はありません。

第３【その他】

（１）目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」という名称を用いることがあります。
（２）目論見書の表紙等に委託会社または受託会社のロゴ・マーク、ファンドの総称、図案等を記載するこ

とがあります。

（３）目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。

（４）目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。

① ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

② 本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

③ 委託会社等の情報、受託会社に関する情報を記載することがあります。

④ 交付目論見書にはファンドの約款の主な内容が含まれておりますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されております。

⑤ ファンドに関する請求目論見書は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできます。

⑥ ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。

（５）有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。

（６）目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。

独立監査人の監査報告書

2022年5月20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	山　田　　信　之	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	畑　中　　建　二	印

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2021年4月1日から2022年3月31日までの第7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2022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)1.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。
2.ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

2022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
業務執行社員　　公認会計士　山　田　　信　之　　印

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2021年11月18日から2022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2022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。

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)1.上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2.ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。