

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2022年11月22日提出
【計算期間】	第2期(自 2021年8月21日至 2022年8月22日)
【ファンド名】	埼玉りそな・グローバルバランス・プラスE S G
【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
【連絡場所】	東京都江東区木場一丁目5番65号
【電話番号】	03-6704-3821
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

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。

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	北米	ファミリーファンド	あり (部分ヘッジ)
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)	欧州		
	年12回 (毎月)	アジア		
	日々	オセアニア		
不動産投信	その他 ()	中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	なし
その他資産 (投資信託証券(資 産複合(債券、株 式、不動産投信) 資産配分変更 型))		アフリカ		
		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

- 一般：次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。
大型株：目論見書又は投資信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいう。
中小型株：目論見書又は投資信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいう。

(2) 債券

- 一般：次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。
公債：目論見書又は投資信託約款において、日本国又は各国の政府の発行する国債（地方債、政府保証債、政府機関

債、国際機関債を含む。以下同じ。)に主として投資する旨の記載があるものをいう。

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

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

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

(3)不動産投信

これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産

組入れている資産を記載するものとする。

(5)資産複合

以下の小分類に該当する場合には当該小分類を併記することができる。

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

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

2. 決算頻度による属性区分

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。

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。

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。

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。

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。

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。

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)

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。

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。

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。

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。

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。

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。

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。

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。

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。

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

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。

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

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。

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

6. インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分

日経225

TOPIX

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

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。

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。

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。

その他型：目論見書又は投資信託約款において、上記 から 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。

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。

- 国内株式および先進国株式に投資を行う2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*2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、埼玉県が発行する公募地方債も主要投資対象とします*3。
 - ◆ RM国内債券マザーファンド(埼玉重視型)は、投資するわが国の国債および埼玉県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 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。

*3 埼玉県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 (埼玉重視型) 【主要投資対象】 わが国の国債および埼玉県が発行する公募地方債 【対象指数】 なし	RM先進国債券マザーファンド (為替ヘッジあり) 【主要投資対象】 先進国(日本を除く)の債券 【対象指数】 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)	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)
		RM先進国債券マザーファンド 【主要投資対象】 先進国(日本を除く)の債券 【対象指数】 FTSE世界国債インデックス (除く日本、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】 MSCIE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 ■ 埼玉に関連した運用を行うマザーファンド

※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

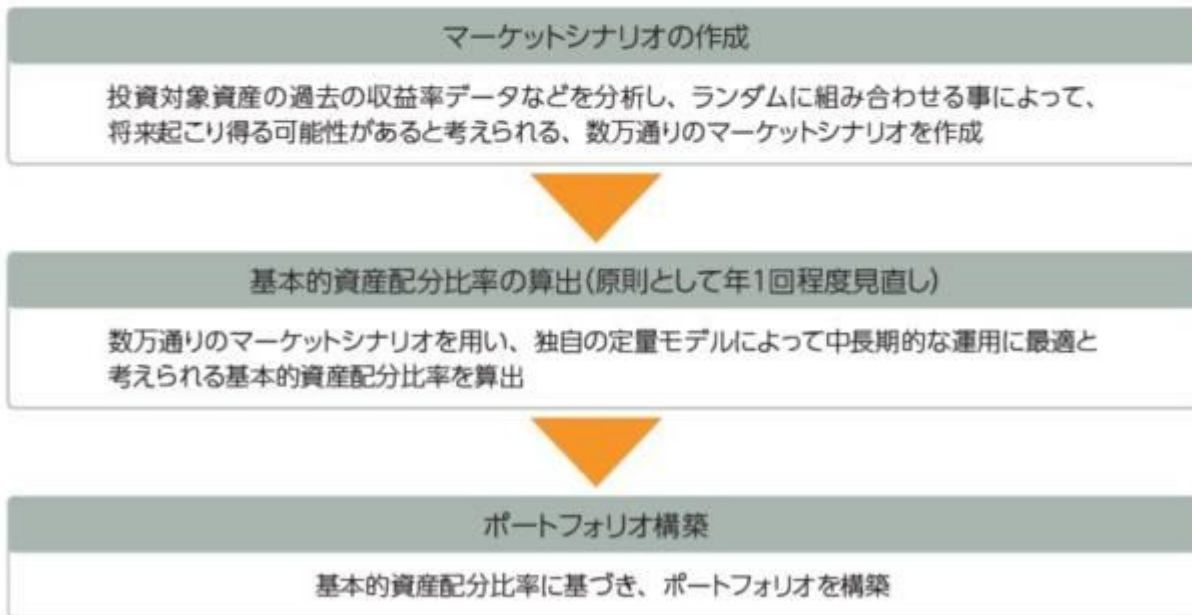
「ESG」とは、Environment(環境)、Social(社会)、Governance(ガバナンス)の頭文字を取ったものです。ESG評価の高い企業は、持続的な企業価値の向上が期待されています。ESG投資は、従来の財務情報に加え、非財務情報であるESGの評価を重視して銘柄選別を行う運用手法です。

2 中長期的な運用に理想的なポートフォリオ構築を目指します。

- 独自の定量モデルを用いて算出した基本的資産配分比率に基づき、ポートフォリオを構築します。基本的資産配分比率は、原則として年1回程度見直します。

当ファンドでは、過去に起きていなかった事象も今後起こり得ると考え、過去のデータをランダムに組み合わせ、将来起こり得る可能性のある数万通りのシナリオを作成します。このように作成されたマーケット・シナリオを用いてシミュレーションを行い、中長期的な運用に最適と考えられるポートフォリオを構築します。

運用プロセスのイメージ



※上記の運用プロセスおよびイメージ図は、今後変更になる場合があります。

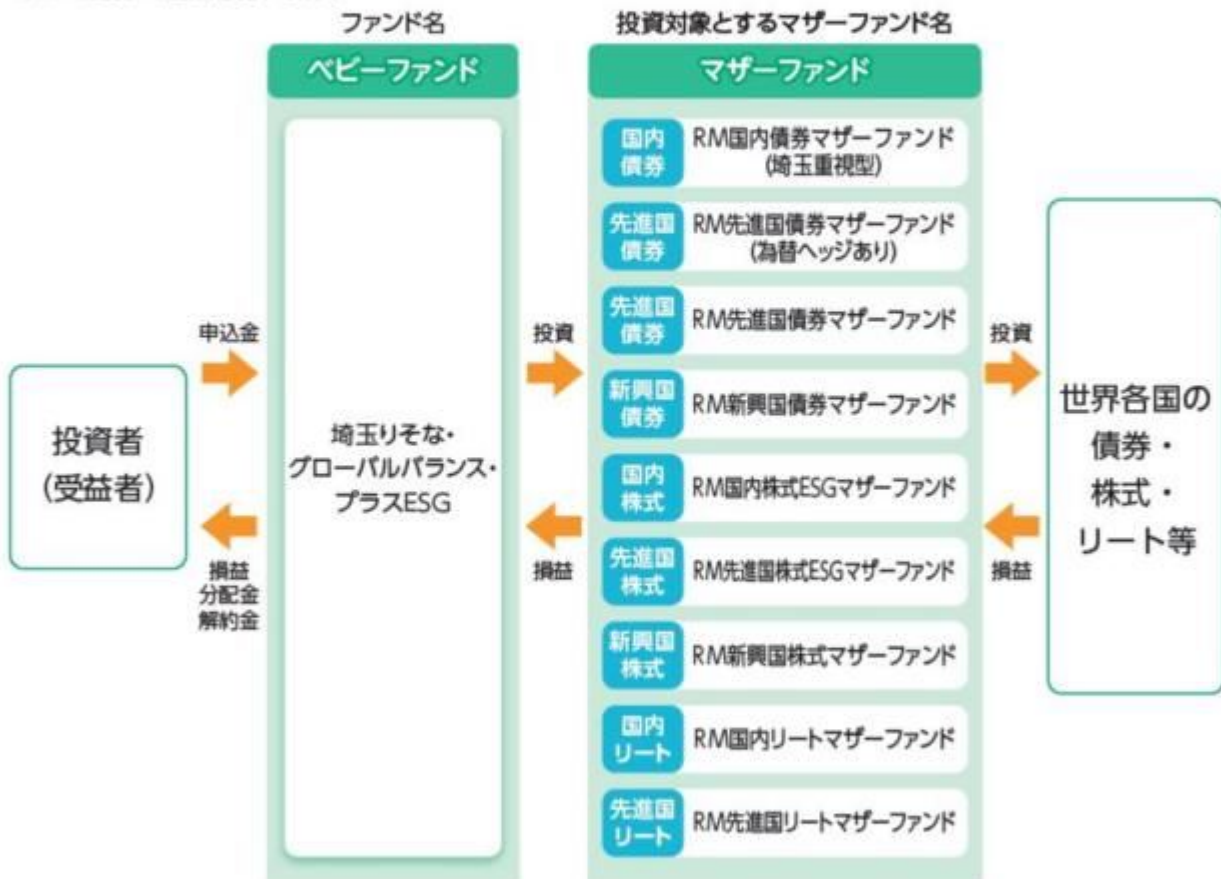
3 実質組入外貨建資産の一部について、対円での為替ヘッジを行います。

- 外貨建資産として組み入れるRM先進国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行います。



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8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留保金は、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先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)

「FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・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債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

●RM先進国債券マザーファンド

「FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)」は、FTSE世界国債インデックス(除く日本、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。FTSE世界国債インデックス(除く日本、米ドルベース)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債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

●RM新興国債券マザーファンド

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

●RM国内株式ESGマザーファンド

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

●RM先進国株式ESGマザーファンド

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

●RM新興国株式マザーファンド

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

●RM国内リートマザーファンド

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

●RM先進国リートマザーファンド

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

ESG/SDGsを重視した運用について

- 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。

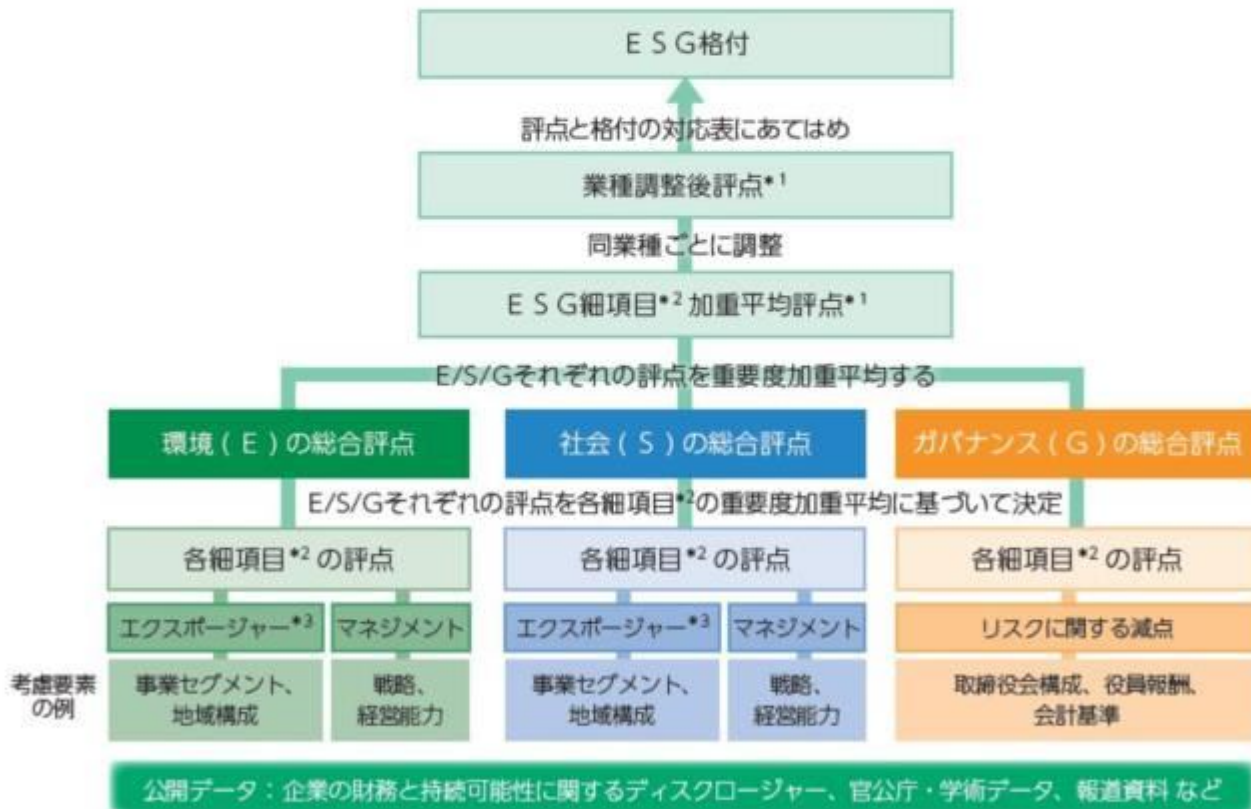
*2 MSCI-KOKUSAI指数は、MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数です。

※ 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
	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。

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。

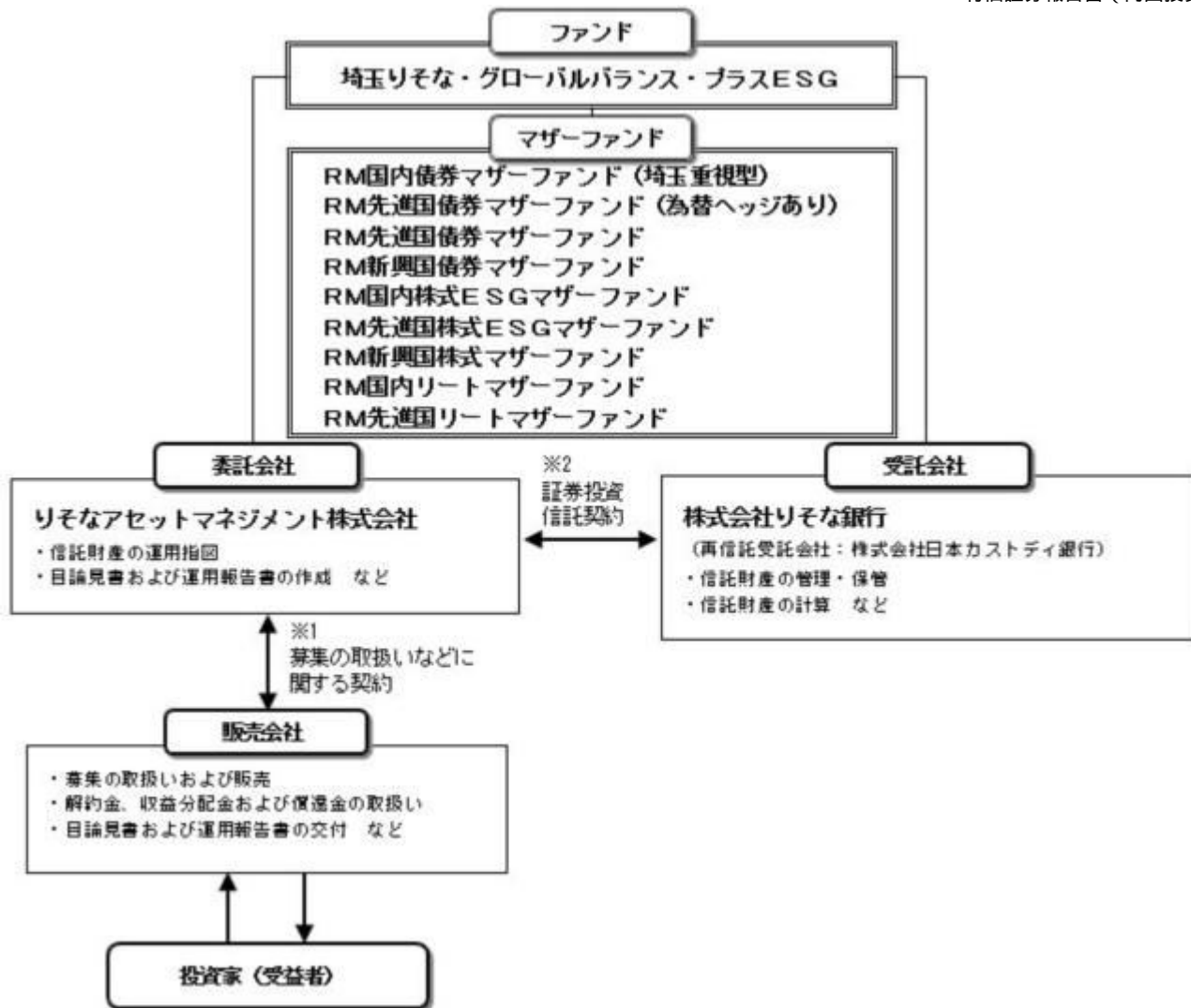
(2) 【ファンドの沿革】

2020年9月25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】

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。

委託会社の概況（2022年8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（埼玉重視型）、RM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)、RM先進国債券マザーファンド、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。

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。

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。

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。

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。

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】

投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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券
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。)の新株引受権証券を除きます。)
- 6) 特定目的会社にかかる特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
- 7) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
- 8) 協同組織金融機関にかかる優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
- 9) 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
- 10) コマーシャル・ペーパー
- 11) 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)
- 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。)

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。

金融商品の指図範囲

委託者は、信託金を、上記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

- 1) 預金
- 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
- 3) コール・ローン
- 4) 手形割引市場において売買される手形
- 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
- 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの

上記 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、 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。

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（埼玉重視型） >

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埼玉県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	<p>主として、わが国の国債および埼玉県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。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。</p> <p>債券の組入比率は、通常の状態でも高に維持することを基本とします。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。</p>
主な投資制限	<p>株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	<p>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。</p> <p>上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。</p>
その他	
決算日	毎年8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

< R M先進国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、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）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	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）に採用されている先進国の債券を主要投資対象とします。

投資方針	<p>主として、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）に採用されている先進国の債券に投資し、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）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、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）への連動性を高めるため、先進国債券の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）または海外の債券先物取引を活用することがあります。</p> <p>債券またはETF（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。</p> <p>外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行います。</p> <p>資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、）の行使等により取得したものに限り、</p> <p>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。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	<p>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。</p> <p>上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。</p>
その他	
決算日	毎年12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

< R M先進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、FTSE世界国債インデックス（除く日本、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。 ・ FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に採用されている先進国の債券
投資方針	主として、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に採用されている先進国の債券に投資し、FTSE世界国債インデックス（除く日本、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、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）への連動性を高めるため、先進国債券の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）または海外の債券先物取引を活用することがあります。 債券またはETF（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。 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。 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	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せん。）の行使等により取得したものに限りません。 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。 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。 外貨建資産への投資割合には、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。 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。 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

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	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。 債券またはＥＴＦ（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態を高位に維持することを基本とします。 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。 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	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せん。）の行使等により取得したものに限りません。 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。 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。 外貨建資産への投資割合には、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。 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。 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

< R M国内株式 E S G マザーファンド >

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
主な投資対象	国内の金融商品取引所上場株式（上場予定を含みます。）のうち、MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数（配当込み）に採用されている株式を主要投資対象とします。
投資方針	<p>主として、国内の金融商品取引所上場株式（上場予定を含みます。）のうち、MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数（配当込み）に採用されている株式に投資し、MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数（配当込み）への連動性を高めるため、国内株式の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）、国内株式を対象とした株価指数先物取引を活用することがあります。</p> <p>株式（ETF（上場投資信託証券）、株価指数先物取引を含みます。）の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。</p> <p>非株式割合（株式以外の資産への投資割合）は、原則として信託財産総額の50%以下を基本とします。</p> <p>資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。

その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
決算日	毎年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

< R M先進国株式 E S G 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	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。 株式(ETF(上場投資信託証券)、株価指数先物取引を含みます。)の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。 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。 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	<p>株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	<p>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。</p> <p>上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。</p>
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

< R M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、MSCIE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	<p>次の有価証券を主要投資対象とします。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・金融商品取引所に上場されているまたは店頭登録されている（上場予定および店頭登録予定を含みます。）新興国株式（*） （*）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	<p>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、MSCIE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、MSCIE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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	<p>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。</p> <p>上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。</p>
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	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。 不動産投資信託証券またはETF（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。 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	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。 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。 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。 外貨建資産への投資は、行いません。 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。 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。 一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
決算日	毎年1月25日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

< RM先進国リートマザーファンド >

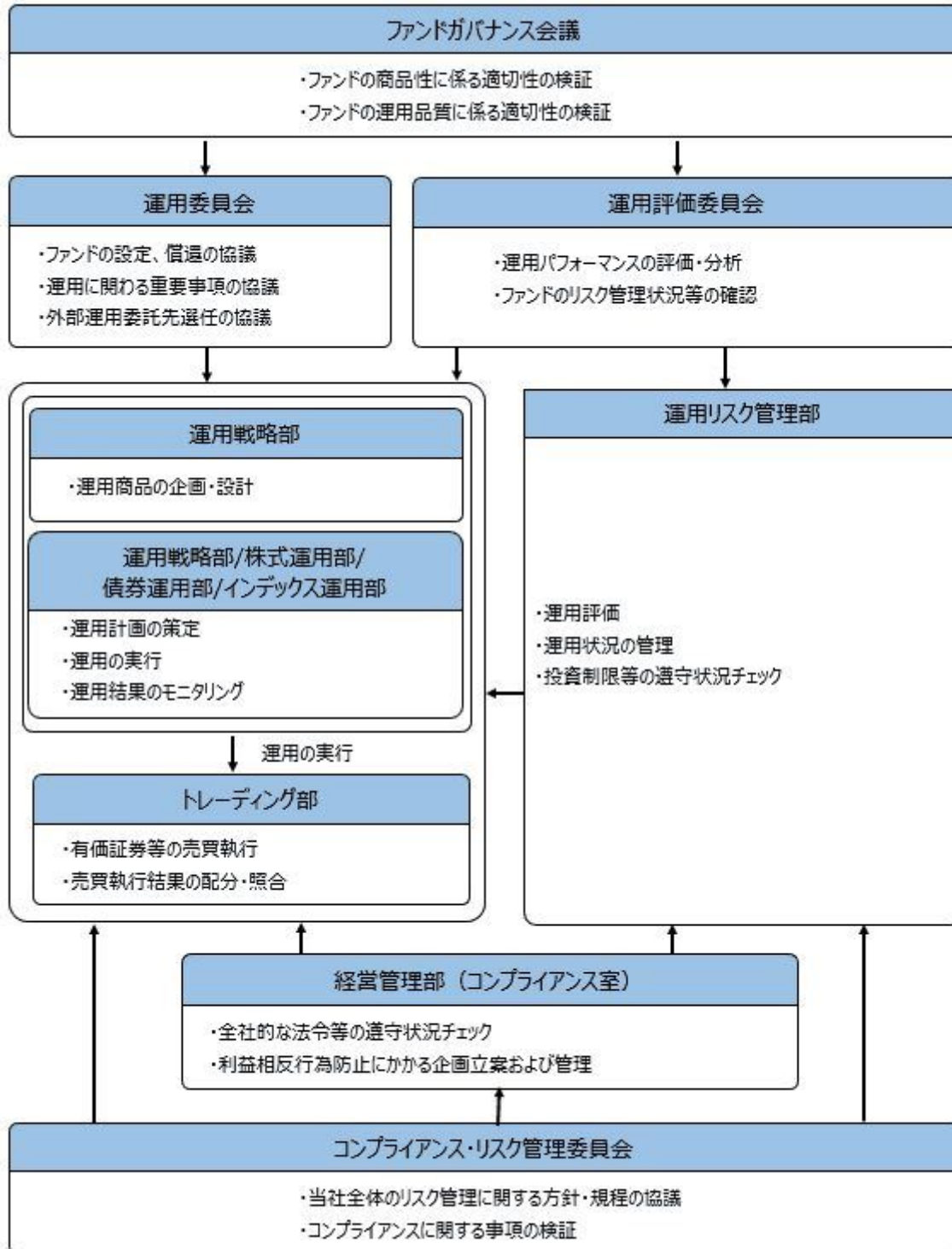
運用の基本方針

基本方針	この投資信託は、S & P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	次の有価証券を主要投資対象とします。 <ul style="list-style-type: none"> ・先進国（除く日本）の金融商品取引所に上場（上場予定を含みます。）されているまたは店頭登録されている（登録予定を含みます。）不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に規定する不動産投資信託証券をいいます。） ・先進国（除く日本）の金融商品取引所に上場（上場予定を含みます。）されているまたは店頭登録されている（登録予定を含みます。）不動産関連株式 ・先進国の不動産投資信託証券に関する指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）
投資方針	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。 不動産投資信託証券またはETF（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。 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。 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	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。 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。 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。 外貨建資産への投資割合には、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。 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。 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】

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。

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。

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8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】

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。

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】

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、)の行使により取得可能な株券

ヘ) 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権(ホ)に定めるものを除きます。))の行使により取得可能な株券

10) 先物取引等の運用指図

1. 委託者は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。))および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。))ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うこと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。))を行うこと指図をすることができます。
2. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として、信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
3. スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。
4. 委託者は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

12) 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図

1. 委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うこと指図をすることができます。
2. 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として、信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
3. 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。
4. 委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

13) 直物為替先渡取引の運用指図

1. 委託者は、直物為替先渡取引を行うこと指図をすることができます。
2. 直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として、信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

3. 直物為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。
4. 委託者は、直物為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

14) 有価証券の貸付けの指図および範囲

1. 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式、公社債および投資信託証券を次の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。
 - イ) 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 - ロ) 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
 - ハ) 投資信託証券の貸付けは、貸付時点において、貸付投資信託証券の時価合計額が、信託財産で保有する投資信託証券の時価合計額を超えないものとします。
2. 前記1. に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかにその超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
3. 委託者は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

15) 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

16) 外国為替予約取引の指図および範囲

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

17) 資金の借入れ

1. 委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
2. 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から、信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間、または解約代金の入金日までの間、もしくは償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。
3. 収益分配金の再投資にかかる借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
4. 借入金の利息は信託財産中から支弁します。

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せんが、運用により信託財産に生じた損益はすべて投資者のみなさまに帰属します。

したがって、投資者のみなさまの投資元本が保証されているものではなく、基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。また、投資信託は預貯金と異なります。

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

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。

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。

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。

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。

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場合があります。

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）

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。

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る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。

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性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。

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。

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。

当資料に記載している指数の知的財産権、その他の一切の権利は、その発行者および許諾者に帰属します。

(2) リスク管理体制

委託会社における投資リスクに対する管理体制

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。

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り締り役会等に報告します。

上記体制は2022年8月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

【参考情報】

ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



- * 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- * 年間騰落率は、2021年9月から2022年8月の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

* 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。

ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

グラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	14.1	42.1	59.8	62.7	5.4	11.4	19.3
最小値	△4.3	△16.0	△12.4	△19.4	△3.5	△4.5	△9.4
平均値	3.7	8.3	16.2	9.9	0.1	3.5	2.5

- * 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9月から2022年8月の5年間(当ファンドは2021年9月から2022年8月)の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- * 決算日に対応した数値とは異なります。
- * 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

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、信頼性、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く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、知財権、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権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、JP 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、JP 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】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

（３）【信託報酬等】

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0.88%（税抜0.80%）の率を乗じて得た額とします。

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
0.385%	0.385%	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

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】

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。

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。）

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。

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。

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。

個人受益者の場合

1) 収益分配金に対する課税

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

2) 解約金および償還金に対する課税

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

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

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

少額投資非課税制度「愛称：NISA(ニーサ)」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。

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。

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。

普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

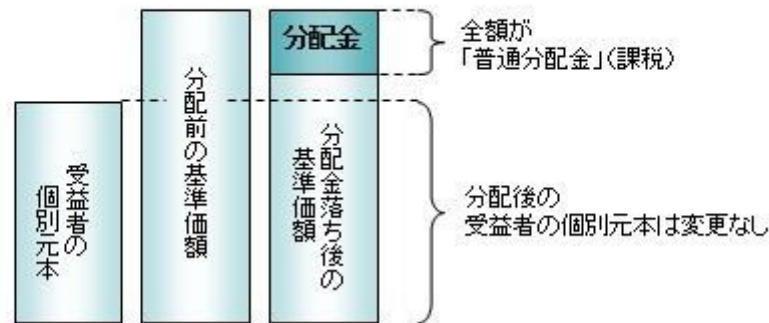
1) 収益分配金には課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」(元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。

2) 受益者が収益分配金を受け取る際

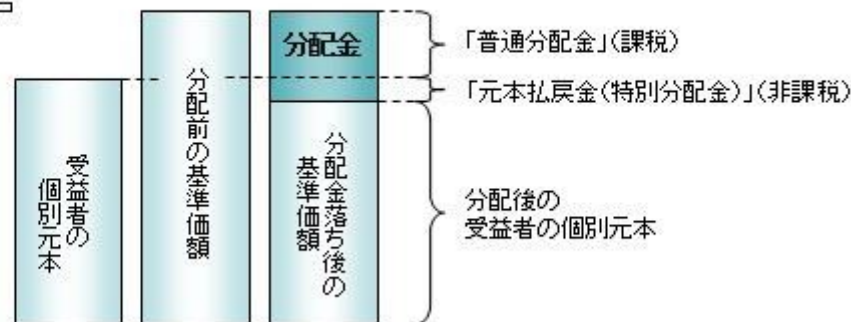
- イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。
- ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。
- ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

<分配金に関するイメージ図>

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



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

上記は2022年8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】

【埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG】

以下の運用状況は2022年8月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1)【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	6,828,809,491	99.79
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		14,709,718	0.21
合計(純資産総額)		6,843,519,209	100.00

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 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	R M先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	2,942,320,834	0.9254	2,722,823,699	0.9135	2,687,810,081	39.28
日本	親投資信託受益証券	R M先進国株式E S Gマザーファンド	882,412,567	1.6336	1,441,509,169	1.5573	1,374,181,090	20.08
日本	親投資信託受益証券	R M国内債券マザーファンド（埼玉重視型）	1,188,701,069	0.9922	1,179,429,200	0.9918	1,178,953,720	17.23
日本	親投資信託受益証券	R M国内株式E S Gマザーファンド	334,562,392	1.2950	433,258,297	1.2716	425,429,537	6.22
日本	親投資信託受益証券	R M先進国債券マザーファンド	329,440,058	1.1246	370,488,289	1.1218	369,565,857	5.40
日本	親投資信託受益証券	R M先進国リートマザーファンド	178,909,575	1.5851	283,589,567	1.5159	271,209,024	3.96
日本	親投資信託受益証券	R M新興国株式マザーファンド	145,236,475	1.6332	237,200,210	1.6350	237,461,636	3.47
日本	親投資信託受益証券	R M新興国債券マザーファンド	124,770,667	1.1182	139,518,559	1.1515	143,673,423	2.10
日本	親投資信託受益証券	R M国内リートマザーファンド	92,208,086	1.5116	139,381,742	1.5240	140,525,123	2.05

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	99.79
合 計	99.79

【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。

(3) 【運用実績】

【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 (2021年 8月20日)	6,158	6,158	1.1133	1.1133
第2計算期間末 (2022年 8月22日)	6,960	6,960	1.0949	1.0949
2021年 8月末日	6,255		1.1239	

9月末日	6,598		1.1104
10月末日	6,679		1.1357
11月末日	6,757		1.1308
12月末日	7,001		1.1438
2022年 1月末日	6,802		1.1081
2月末日	6,842		1.0921
3月末日	6,969		1.1164
4月末日	6,859		1.0940
5月末日	6,830		1.0850
6月末日	6,803		1.0682
7月末日	6,989		1.0930
8月末日	6,843		1.0760

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2020年 9月25日～2021年 8月20日	0.0000
第2期	2021年 8月21日～2022年 8月22日	0.0000

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1期	2020年 9月25日～2021年 8月20日	11.33
第2期	2021年 8月21日～2022年 8月22日	1.65

(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	2020年 9月25日～2021年 8月20日	6,141,844,751	609,918,666
第2期	2021年 8月21日～2022年 8月22日	1,649,743,586	823,970,233

(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)

R M国内債券マザーファンド（埼玉重視型）

以下の運用状況は2022年 8月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	120,271,000	10.20
地方債証券	日本	1,045,468,500	88.68
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		13,218,707	1.12
合計（純資産総額）		1,178,958,207	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	地方債証券	令和2年度第7回 埼玉県公募公債	150,000,000	98.61	147,918,000	98.49	147,742,500	0.125	2030/10/16	12.53
日本	地方債証券	平成27年度第6 回埼玉県公募公債	100,000,000	101.47	101,473,000	101.47	101,476,000	0.505	2025/9/29	8.61
日本	地方債証券	平成29年度第9 回埼玉県公募公債	100,000,000	100.21	100,219,000	100.22	100,220,000	0.200	2028/3/27	8.50
日本	地方債証券	平成24年度第7 回埼玉県公募公債	100,000,000	100.21	100,214,000	100.19	100,195,000	0.815	2022/11/28	8.50
日本	地方債証券	令和4年度第2回 埼玉県公募公債 (5年)	100,000,000	99.87	99,875,000	99.90	99,907,000	0.075	2027/4/26	8.47
日本	地方債証券	令和3年度第2回 埼玉県公募公債 (5年)	100,000,000	99.85	99,851,000	99.89	99,894,000	0.010	2026/4/15	8.47
日本	地方債証券	令和3年度第6回 埼玉県公募公債	100,000,000	99.78	99,785,000	99.80	99,806,000	0.005	2026/7/28	8.47
日本	地方債証券	令和4年度第3回 埼玉県公募公債 (10年)	100,000,000	99.61	99,616,000	99.53	99,534,000	0.304	2032/5/24	8.44
日本	地方債証券	令和2年度第9回 埼玉県公募公債	100,000,000	98.65	98,655,000	98.51	98,516,000	0.140	2031/2/18	8.36
日本	地方債証券	令和3年度第8回 埼玉県公募公債	100,000,000	98.34	98,344,000	98.17	98,178,000	0.125	2031/10/27	8.33
日本	国債証券	第139回利付国 債(5年)	70,000,000	100.31	70,220,500	100.31	70,217,000	0.100	2024/3/20	5.96
日本	国債証券	第425回利付国 債(2年)	50,000,000	100.10	50,054,000	100.10	50,054,000	0.005	2023/6/1	4.25

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	10.20
地方債証券	88.68
合計	98.88

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

該当事項はありません。

RM先進国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 8月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	136,256,978,821	52.13
	カナダ	5,637,281,838	2.16
	メキシコ	2,071,154,086	0.79
	ドイツ	17,145,622,006	6.56
	イタリア	20,342,680,952	7.78
	フランス	22,806,185,399	8.72
	オランダ	4,148,842,410	1.59
	スペイン	13,305,152,754	5.09
	ベルギー	5,037,431,490	1.93
	オーストリア	3,177,349,978	1.22
	フィンランド	1,365,986,600	0.52
	アイルランド	1,706,246,350	0.65
	イギリス	12,357,806,620	4.73
	スウェーデン	648,896,077	0.25
	ノルウェー	529,108,781	0.20
	デンマーク	930,927,440	0.36
	ポーランド	1,107,007,694	0.42
	オーストラリア	4,141,055,967	1.58
	シンガポール	1,105,824,061	0.42
	マレーシア	1,362,808,787	0.52
中国	6,731,464,678	2.58	
イスラエル	1,112,365,066	0.43	
	小計	263,028,177,855	100.62
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		1,628,511,695	0.62
合計（純資産総額）		261,399,666,160	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		273,582,756,586	104.66

(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 (%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11,820,000	13,124.45	1,551,310,519	12,455.03	1,472,185,617	1.875	2032/2/15	0.56
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11,740,000	13,499.38	1,584,828,226	11,935.71	1,401,253,202	1.375	2031/11/15	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11,710,000	13,599.60	1,592,513,511	11,860.98	1,388,921,615	1.250	2031/8/15	0.53
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,050,000	13,918.62	1,398,821,444	13,580.32	1,364,822,534	2.875	2032/5/15	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11,660,000	13,207.28	1,539,968,860	11,647.35	1,358,081,678	0.875	2030/11/15	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,730,000	13,355.05	1,432,997,139	11,849.07	1,271,405,583	1.125	2031/2/15	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11,070,000	12,873.34	1,425,078,927	11,429.39	1,265,233,840	0.625	2030/8/15	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,400,000	13,459.29	1,265,173,553	12,310.45	1,157,182,498	1.625	2031/5/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,130,000	13,766.06	981,520,586	13,399.45	955,381,208	0.250	2023/9/30	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,740,000	14,416.13	971,647,411	13,645.30	919,693,660	2.500	2024/5/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,150,000	13,707.73	980,103,010	12,812.98	916,128,491	1.500	2027/1/31	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,840,000	14,307.62	1,121,717,670	11,542.03	904,895,163	2.375	2051/5/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,820,000	12,968.83	1,014,163,014	11,485.16	898,140,272	0.625	2030/5/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,100,000	13,640.97	968,509,217	12,540.59	890,382,510	0.875	2026/9/30	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,480,000	15,444.24	1,000,787,299	13,736.28	890,111,104	3.125	2028/11/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,200,000	13,731.95	988,700,421	12,361.35	890,017,509	1.250	2028/6/30	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,610,000	15,016.44	992,586,987	13,344.76	882,088,693	2.625	2029/2/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,600,000	13,702.16	904,343,023	13,289.79	877,126,591	0.125	2023/12/15	0.34
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	5,930,000	17,094.46	1,013,701,976	14,644.44	868,415,707	2.500	2030/5/25	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,970,000	13,094.45	912,683,530	12,399.80	864,266,289	1.250	2028/4/30	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,800,000	13,476.35	916,391,883	12,453.95	846,868,938	0.625	2026/7/31	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,300,000	14,295.13	900,593,483	13,287.35	837,103,662	2.000	2025/8/15	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,700,000	13,810.46	925,301,137	12,468.57	835,394,611	1.500	2028/11/30	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,440,000	13,340.63	859,136,852	12,912.08	831,538,218	2.875	2052/5/15	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,110,000	14,400.73	879,884,719	13,584.11	829,989,441	2.375	2024/8/15	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,570,000	13,132.96	862,835,544	12,608.28	828,364,586	0.750	2026/3/31	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,180,000	13,613.44	841,310,893	13,385.37	827,216,192	0.375	2023/10/31	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,090,000	15,135.03	921,723,837	13,549.45	825,161,977	2.875	2028/5/15	0.32
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	5,610,000	16,513.49	926,407,149	14,681.65	823,640,644	2.750	2027/10/25	0.32
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	4,750,000	19,907.60	945,611,398	17,172.20	815,679,834	5.500	2029/4/25	0.31

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	100.62

合 計	100.62
-----	--------

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	1,010,899,000.00	139,774,310,344	139,743,746,152	53.46
	カナダドル	売建	54,938,000.00	5,802,727,821	5,801,452,800	2.22
	メキシコペソ	売建	314,854,000.00	2,147,020,911	2,146,107,834	0.82
	ユーロ	売建	679,003,000.00	94,344,638,703	94,351,201,366	36.09
	英ポンド	売建	83,294,000.00	13,434,597,678	13,447,274,888	5.14
	スウェーデンクローナ	売建	51,966,000.00	673,801,549	673,832,728	0.26
	ノルウェークローネ	売建	39,114,000.00	551,476,108	551,710,792	0.21
	デンマーククローネ	売建	53,132,000.00	992,160,402	992,420,748	0.38
	ポーランドズロチ	売建	38,762,000.00	1,131,497,665	1,129,927,804	0.43
	オーストラリアドル	売建	45,520,000.00	4,314,139,938	4,321,345,607	1.65
	シンガポールドル	売建	11,473,000.00	1,134,639,544	1,134,887,361	0.43
	マレーシアリングット	売建	44,770,000.00	1,328,634,813	1,385,568,822	0.53
	中国元	売建	338,229,000.00	6,765,425,572	6,765,290,280	2.59
	イスラエルシェケル	売建	27,364,000.00	1,139,614,826	1,137,989,404	0.44

(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。

R M先進国債券マザーファンド

以下の運用状況は2022年 8月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	24,679,190,176	51.18
	カナダ	1,021,133,507	2.12
	メキシコ	376,777,574	0.78
	ドイツ	3,089,972,122	6.41
	イタリア	3,692,217,422	7.66
	フランス	4,139,810,765	8.59
	オランダ	754,237,510	1.56
	スペイン	2,418,787,142	5.02
	ベルギー	917,429,710	1.90

	オーストリア	578,339,020	1.20
	フィンランド	253,603,597	0.53
	アイルランド	305,955,492	0.63
	イギリス	2,246,122,898	4.66
	スウェーデン	119,691,936	0.25
	ノルウェー	101,214,253	0.21
	デンマーク	176,566,077	0.37
	ポーランド	197,597,870	0.41
	オーストラリア	740,637,500	1.54
	シンガポール	201,017,342	0.42
	マレーシア	250,690,574	0.52
	中国	1,228,949,744	2.55
	イスラエル	197,930,307	0.41
	小計	47,687,872,538	98.90
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		531,834,026	1.10
合計(純資産総額)		48,219,706,564	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 (%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,070,000	13,730.84	284,228,525	12,310.45	254,826,358	1.625	2031/5/15	0.53
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,110,000	13,290.06	280,420,414	11,860.98	250,266,831	1.250	2031/8/15	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,050,000	13,395.32	274,604,183	11,935.71	244,682,202	1.375	2031/11/15	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,100,000	12,928.87	271,506,288	11,647.35	244,594,470	0.875	2030/11/15	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,920,000	12,829.63	246,329,021	12,455.03	239,136,750	1.875	2032/2/15	0.50
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,700,000	13,760.27	233,924,678	13,375.62	227,385,680	0.750	2023/12/31	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,540,000	14,188.99	218,510,549	13,581.94	209,162,006	2.125	2024/3/31	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,580,000	13,693.50	216,357,342	13,066.41	206,449,407	0.750	2024/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,510,000	13,988.55	211,227,135	13,580.32	205,062,888	2.875	2032/5/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,720,000	13,190.96	226,884,664	11,849.07	203,804,064	1.125	2031/2/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,500,000	13,653.97	204,809,564	13,289.79	199,346,953	0.125	2023/12/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,720,000	12,457.44	214,268,053	11,429.39	196,585,564	0.625	2030/8/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,520,000	13,398.54	203,657,928	12,759.91	193,950,716	1.875	2029/2/28	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,550,000	13,524.54	209,630,483	12,379.22	191,877,988	1.250	2028/5/31	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,450,000	13,611.84	197,371,749	12,812.98	185,788,295	1.500	2027/1/31	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,480,000	12,693.38	187,862,132	12,414.42	183,733,484	1.250	2028/3/31	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,410,000	13,871.12	195,582,823	12,888.25	181,724,434	1.500	2026/8/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,440,000	13,204.89	190,150,499	12,380.30	178,276,432	1.375	2028/12/31	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,330,000	13,624.72	181,208,904	13,212.35	175,724,381	0.125	2024/2/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,330,000	13,591.15	180,762,359	13,095.66	174,172,288	0.250	2024/6/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,300,000	14,301.09	185,914,190	13,348.01	173,524,134	2.250	2025/11/15	0.36

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,380,000	13,341.89	184,118,181	12,560.63	173,336,761	0.750	2026/5/31	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,360,000	13,344.76	181,488,745	12,519.47	170,264,925	0.500	2026/2/28	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,260,000	13,705.95	172,695,058	13,419.06	169,080,256	0.125	2023/8/31	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,200,000	14,223.65	170,683,851	13,744.50	164,934,089	2.500	2023/8/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,320,000	13,294.94	175,493,224	12,488.07	164,842,547	0.375	2026/1/31	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,310,000	13,470.93	176,469,265	12,540.59	164,281,843	0.875	2026/9/30	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,430,000	12,720.38	181,901,508	11,485.16	164,237,926	0.625	2030/5/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,400,000	14,757.59	206,606,343	11,542.03	161,588,423	2.375	2051/5/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,170,000	14,910.84	174,456,914	13,544.58	158,471,627	2.875	2028/8/15	0.33

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.90
合計	98.90

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。

R M新興国債券マザーファンド

以下の運用状況は2022年 8月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	アメリカ	2,065,654,895	21.35
	アイルランド	7,578,114,353	78.32
	小計	9,643,769,248	99.67
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		31,999,747	0.33
合計(純資産総額)		9,675,768,995	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		40,224,041	0.42

(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 (%)
アイルランド	投資信託受益証券	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	1,262,747	6,724.55	8,491,416,675	6,001.29	7,578,114,353	78.32
アメリカ	投資信託受益証券	VANECK J.P.MORGAN EM LOCAL	616,232	3,946.79	2,432,142,054	3,352.07	2,065,654,895	21.35

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率 (%)
投資信託受益証券	99.67
合計	99.67

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	290,200.00	40,224,622	40,224,041	0.42

(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。

R M国内株式ESGマザーファンド

以下の運用状況は2022年 8月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	2,341,261,960	93.33
投資証券	日本	37,378,300	1.49
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		130,066,555	5.18
合計 (純資産総額)		2,508,706,815	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	125,568,000	5.01

(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	91,300	2,118.74	193,441,750	2,101.50	191,866,950	7.65
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	10,900	12,850.96	140,075,500	11,135.00	121,371,500	4.84
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	103,000	726.01	74,779,376	721.10	74,273,300	2.96
日本	株式	第一三共	医薬品	15,100	3,121.70	47,137,700	4,197.00	63,374,700	2.53
日本	株式	KDDI	情報・通信業	13,900	3,861.41	53,673,700	4,277.00	59,450,300	2.37
日本	株式	日立製作所	電気機器	8,300	6,546.53	54,336,199	6,996.00	58,066,800	2.31
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	1,300	57,036.15	74,147,000	44,160.00	57,408,000	2.29
日本	株式	任天堂	その他製品	1,000	54,747.00	54,747,000	56,990.00	56,990,000	2.27
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	12,400	5,707.15	70,768,700	4,483.00	55,589,200	2.22
日本	株式	ダイキン工業	機械	2,100	22,618.33	47,498,500	24,485.00	51,418,500	2.05
日本	株式	HOYA	精密機器	3,200	13,846.71	44,309,500	14,250.00	45,600,000	1.82
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	81,950.00	40,975,000	1.63
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	10,200	3,601.65	36,736,900	3,843.00	39,198,600	1.56
日本	株式	三井物産	卸売業	12,000	3,252.71	39,032,600	3,266.00	39,192,000	1.56
日本	株式	ファナック	電気機器	1,700	21,772.64	37,013,500	22,535.00	38,309,500	1.53
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	24,700	1,540.73	38,056,050	1,529.50	37,778,650	1.51
日本	株式	村田製作所	電気機器	4,900	8,294.61	40,643,600	7,554.00	37,014,600	1.48
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	1,700	19,544.41	33,225,500	20,850.00	35,445,000	1.41
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	15,800	1,956.06	30,905,800	1,984.50	31,355,100	1.25
日本	株式	富士通	電気機器	1,700	18,537.94	31,514,500	16,565.00	28,160,500	1.12
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	4,900	5,230.22	25,628,100	5,353.00	26,229,700	1.05
日本	株式	テルモ	精密機器	5,600	4,310.90	24,141,055	4,506.00	25,233,600	1.01
日本	株式	花王	化学	4,100	5,753.48	23,589,300	6,055.00	24,825,500	0.99
日本	株式	オリックス	その他金融業	10,300	2,355.70	24,263,750	2,296.00	23,648,800	0.94
日本	株式	小松製作所	機械	8,000	2,952.07	23,616,600	2,930.00	23,440,000	0.93
日本	株式	富士フイルムホールディングス	化学	3,100	8,163.96	25,308,300	7,111.00	22,044,100	0.88
日本	株式	三井不動産	不動産業	7,800	2,641.00	20,599,850	2,823.50	22,023,300	0.88
日本	株式	京セラ	電気機器	2,800	7,538.03	21,106,500	7,778.00	21,778,400	0.87
日本	株式	パナソニックホールディングス	電気機器	19,000	1,247.56	23,703,750	1,133.00	21,527,000	0.86
日本	株式	中外製薬	医薬品	5,800	3,853.03	22,347,600	3,609.00	20,932,200	0.83

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国内	鉱業	0.58
		建設業	1.72
		食料品	3.65
		繊維製品	0.50
		化学	6.20
		医薬品	5.86
		石油・石炭製品	0.55
		ゴム製品	1.05
		ガラス・土石製品	0.62
		鉄鋼	1.09
		非鉄金属	0.62
		機械	4.92
		電気機器	19.12
		輸送用機器	8.19
		精密機器	3.31
		その他製品	3.02
		電気・ガス業	1.18
		陸運業	2.75
		海運業	0.60
		倉庫・運輸関連業	0.06
		情報・通信業	5.83
		卸売業	4.09
		小売業	3.33
		銀行業	3.96
		証券、商品先物取引業	0.81
		保険業	2.08
その他金融業	1.00		
不動産業	2.47		
サービス業	4.15		
投資証券			1.49
合計			94.82

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	2	日本円	38,831,100	39,240,000	1.56
	大阪取引所	ミニTOPIX先物	買建	44	日本円	85,759,590	86,328,000	3.44

(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。

R M先進国株式 E S G マザーファンド

以下の運用状況は2022年 8月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	2,700,837,927	63.39
	カナダ	150,695,072	3.54
	ドイツ	64,688,664	1.52
	イタリア	13,843,301	0.32
	フランス	118,515,839	2.78
	オランダ	78,525,903	1.84
	スペイン	24,467,599	0.57
	ベルギー	4,709,488	0.11
	オーストリア	2,461,010	0.06
	ルクセンブルク	1,092,353	0.03
	フィンランド	20,528,175	0.48
	アイルランド	100,871,776	2.37
	ポルトガル	1,990,106	0.05
	イギリス	176,539,987	4.14
	スイス	111,214,418	2.61
	スウェーデン	36,065,551	0.85
	ノルウェー	17,912,345	0.42
	デンマーク	51,950,611	1.22
	ケイマン	2,219,922	0.05
	オーストラリア	87,058,226	2.04
	バミューダ	7,049,958	0.17
	ニュージーランド	5,390,220	0.13
	香港	29,466,835	0.69
	シンガポール	8,815,658	0.21
	イスラエル	2,788,192	0.07
キュラソー	9,088,943	0.21	
ジャージー	14,537,352	0.34	
小計		3,843,325,431	90.21
投資証券	アメリカ	81,880,615	1.92
	カナダ	421,533	0.01
	フランス	2,838,365	0.07
	イギリス	3,856,483	0.09
	オーストラリア	10,391,980	0.24

	シンガポール	1,312,426	0.03
	小計	100,701,402	2.36
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		316,326,659	7.42
合計(純資産総額)		4,260,353,492	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	268,101,742	6.29
	買建	ドイツ	61,224,640	1.44

(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。

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		19,714,159	0.46

(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	44,998.25	384,465,119	36,455.53	311,476,058	7.31
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	3,162	47,969.26	151,678,827	38,497.55	121,729,256	2.86
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	7,220	19,553.60	141,177,059	15,102.35	109,038,983	2.56
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	6,820	19,662.31	134,096,957	15,236.82	103,915,135	2.44
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	22,704.52	71,610,081	22,517.67	71,020,734	1.67
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	2,999	41,625.57	124,835,091	21,443.28	64,308,422	1.51
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	2,876	20,717.88	59,584,643	19,433.15	55,889,749	1.31
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	1,990	28,490.11	56,695,338	27,917.30	55,555,446	1.30
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	1,253	54,232.66	67,953,533	40,632.45	50,912,464	1.20
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	1,047	47,668.48	49,908,903	45,444.29	47,580,182	1.12
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	4,949	7,900.96	39,101,854	8,615.85	42,639,864	1.00

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	36,908.03	35,837,701	42,564.95	41,330,571	0.97
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	1,662	22,796.79	37,888,277	23,981.60	39,857,425	0.94
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	50,882.43	42,944,773	45,055.36	38,026,724	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	11,431.59	34,672,020	12,044.17	36,529,981	0.86
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	85,496.32	40,097,776	76,841.22	36,038,533	0.85
アメリカ	株式	WALT DISNEY CO/THE	メディア・娯楽	2,183	20,279.43	44,269,999	15,586.17	34,024,611	0.80
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	488	94,230.41	45,984,443	68,180.31	33,271,992	0.78
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	14,174.94	26,365,395	17,749.46	33,013,996	0.77
アメリカ	株式	MCDONALD'S CORP	消費者サービス	892	35,313.23	31,499,404	35,141.31	31,346,056	0.74
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	7,638.27	38,076,779	6,271.62	31,264,032	0.73
アイルランド	株式	ACCENTURE PLC-CL A	ソフトウェア・サービス	758	48,785.28	36,979,243	40,549.27	30,736,350	0.72
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	13,406.02	27,093,575	14,852.94	30,017,798	0.70
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	5,037	7,183.12	36,181,408	5,895.93	29,697,819	0.70
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	566	84,888.37	48,046,819	51,995.95	29,429,710	0.69
アメリカ	株式	SALESFORCE INC	ソフトウェア・サービス	1,182	36,451.53	43,085,711	22,135.05	26,163,632	0.61
アメリカ	株式	TEXAS INSTRUMENTS INC	半導体・半導体製造装置	1,108	26,241.05	29,075,093	23,115.16	25,611,604	0.60
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	8,333.15	21,791,200	9,315.93	24,361,173	0.57
アイルランド	株式	LINDE PLC	素材	615	45,013.24	27,683,144	39,461.02	24,268,533	0.57
アメリカ	株式	UNION PACIFIC CORP	運輸	764	34,015.83	25,988,101	31,225.02	23,855,916	0.56

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	3.30
		素材	4.00
		資本財	5.26
		商業・専門サービス	1.01
		運輸	2.60
		自動車・自動車部品	3.30
		耐久消費財・アパレル	1.66
		消費者サービス	1.22
		メディア・娯楽	6.47
		小売	3.61
		食品・生活必需品小売り	0.75
		食品・飲料・タバコ	3.09
		家庭用品・パーソナル用品	3.20
		ヘルスケア機器・サービス	3.09
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	10.18
		銀行	4.74
		各種金融	4.77
		保険	3.88
		不動産	0.25
		ソフトウェア・サービス	15.09
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1.45		
電気通信サービス	1.36		
公益事業	1.81		
半導体・半導体製造装置	4.14		
投資証券		2.36	
合計		92.58	

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	97	米ドル	1,871,136.5	259,395,650	1,933,937.5	268,101,742	6.29
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	STX E6002209	買建	21	ユーロ	433,360	60,250,044	440,370	61,224,640	1.44

(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。

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	113,000.00	15,662,930	15,662,704	0.37
	カナダドル	買建	12,000.00	1,270,980	1,270,935	0.03
	ユーロ	買建	20,000.00	2,780,520	2,780,520	0.07

(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。

R M新興国株式マザーファンド

以下の運用状況は2022年 8月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	63,907,975	0.32
	メキシコ	333,338,857	1.67
	ブラジル	904,739,946	4.55
	チリ	100,468,834	0.50
	コロンビア	26,071,489	0.13
	ペルー	2,861,761	0.01
	オランダ	0	0.00
	ルクセンブルク	16,218,144	0.08
	ギリシャ	42,894,372	0.22
	トルコ	57,649,361	0.29
	チェコ	24,858,856	0.12
	キプロス	0	0.00
	ハンガリー	27,201,204	0.14
	ポーランド	86,132,236	0.43
	ロシア	0	0.00
	ケイマン	3,078,930,726	15.47
	バミューダ	93,651,140	0.47
	香港	197,022,254	0.99
	シンガポール	3,921,844	0.02
	マレーシア	277,912,786	1.40
	タイ	327,127,876	1.64
	フィリピン	128,883,334	0.65
	インドネシア	331,427,191	1.67
	韓国	1,907,723,922	9.59
台湾	2,361,763,100	11.87	
中国	2,031,075,418	10.21	
インド	2,669,621,893	13.41	

	カタール	190,672,198	0.96
	エジプト	8,260,599	0.04
	南アフリカ	562,495,505	2.83
	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	223,793,491	1.12
	クウェート	143,261,606	0.72
	サウジアラビア	784,714,455	3.94
	小計	17,008,602,373	85.46
投資証券	メキシコ	11,157,809	0.06
	南アフリカ	6,631,087	0.03
	小計	17,788,896	0.09
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		2,874,999,679	14.45
合計(純資産総額)		19,901,390,948	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	2,782,518,920	13.98

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

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		440,070,322	2.21
	売建		499,886,091	2.51

(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	2,951.31	1,360,555,072	2,258.43	1,041,139,365	5.23
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	116,900	8,054.60	941,583,316	5,714.77	668,057,314	3.36
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	7,677.49	686,429,170	6,044.63	540,439,173	2.72
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	小売	284,140	2,081.56	591,456,122	1,681.23	477,705,260	2.40
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	62,242	4,248.13	264,412,619	4,616.41	287,334,747	1.44
ケイマン	株式	MEITUAN	小売	76,700	4,068.26	312,035,738	3,267.10	250,586,570	1.26

インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	68,865	2,980.63	205,261,257	2,612.66	179,921,003	0.90
ケイマン	株式	JD.COM INC - CL A	小売	37,560	5,055.53	189,885,863	4,362.01	163,837,471	0.82
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	105,289	1,403.64	147,788,744	1,552.77	163,490,127	0.82
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	1,800,000	104.81	188,673,329	85.65	154,171,800	0.77
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	各種金融	35,319	4,404.15	155,550,199	4,281.20	151,207,703	0.76
ブラジル	株式	VALE SA	素材	74,904	2,270.90	170,100,000	1,757.75	131,662,533	0.66
サウジアラビア	株式	AL RAJHI BANK	銀行	36,709	3,421.30	125,592,610	3,350.38	122,989,393	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	471.33	110,198,702	494.03	115,504,927	0.58
ケイマン	株式	BAIDU INC-CLASS A	メディア・娯楽	41,980	2,584.33	108,490,377	2,583.65	108,461,963	0.54
サウジアラビア	株式	THE SAUDI NATIONAL BANK	銀行	41,103	2,649.82	108,915,880	2,588.60	106,399,226	0.53
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	18,744	6,487.04	121,593,113	5,619.51	105,332,142	0.53
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	10,232	12,171.66	124,540,468	9,580.96	98,032,383	0.49
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	118,500	1,142.36	135,370,147	811.47	96,160,024	0.48
ケイマン	株式	NETEASE INC	メディア・娯楽	38,900	2,674.72	104,046,783	2,461.80	95,764,176	0.48
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	6,968.07	107,524,442	5,623.16	86,770,982	0.44
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	28,800	4,831.86	139,157,581	2,991.51	86,155,721	0.43
ケイマン	株式	MUXI 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	1,520.82	102,655,603	1,234.43	83,324,295	0.42
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	小売	4,085	20,039.58	81,861,685	19,714.29	80,532,882	0.40
インドネシア	株式	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	銀行	1,039,900	73.29	76,222,180	76.84	79,911,115	0.40
インド	株式	HINDUSTAN UNILEVER LTD	家庭用品・パーソナル用品	16,917	4,054.64	68,592,359	4,654.73	78,744,194	0.40
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	エネルギー	89,200	861.56	76,851,735	877.38	78,262,935	0.39
ケイマン	株式	PINDUODUO INC-ADR	小売	8,225	8,312.25	68,368,281	9,218.89	75,825,411	0.38
中国	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	1,057,000	83.35	88,103,227	70.64	74,666,480	0.38
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	1,488,000	53.62	79,794,045	48.38	72,001,939	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	4.65
		素材	7.23
		資本財	3.14
		商業・専門サービス	0.07

	運輸	1.80
	自動車・自動車部品	3.28
	耐久消費財・アパレル	1.37
	消費者サービス	0.97
	メディア・娯楽	5.83
	小売	6.41
	食品・生活必需品小売り	1.09
	食品・飲料・タバコ	3.42
	家庭用品・パーソナル用品	0.83
	ヘルスケア機器・サービス	0.85
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.51
	銀行	13.50
	各種金融	2.99
	保険	2.20
	不動産	1.54
	ソフトウェア・サービス	2.35
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.52
	電気通信サービス	2.69
	公益事業	2.76
	半導体・半導体製造装置	7.47
投資証券		0.09
合計		85.55

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	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	410	米ドル	20,455,170	2,835,700,222	20,071,550	2,782,518,920	13.98

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

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	買建	191,477.82	26,502,828	26,542,462	0.13
	メキシコペソ	買建	2,700,000.00	18,584,100	18,587,340	0.09
	ユーロ	買建	10,000.00	1,390,260	1,390,260	0.01
	トルコリラ	買建	550,000.00	4,189,900	4,190,450	0.02
	チェココルナ	買建	120,000.00	680,280	679,212	0.00

ポーランドズロチ	買建	220,000.00	6,478,120	6,469,958	0.03
香港ドル	買建	18,500,000.00	326,710,000	326,673,000	1.64
南アフリカランド	買建	6,800,000.00	55,542,400	55,537,640	0.28
米ドル	売建	3,600,000.00	498,996,000	498,988,800	2.51
ブラジルレアル	売建	33,165.74	913,536	897,291	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。

R M国内リートマザーファンド

以下の運用状況は2022年 8月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	日本	28,877,357,000	89.16
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		3,509,893,398	10.84
合計(純資産総額)		32,387,250,398	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	465,671,500	1.44

(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	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	2,980	664,035.69	1,978,826,356	694,000	2,068,120,000	6.39
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	2,555	620,479.77	1,585,325,812	645,000	1,647,975,000	5.09
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	4,186	350,181.21	1,465,858,545	350,500	1,467,193,000	4.53
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	12,891	97,512.14	1,257,028,996	110,600	1,425,744,600	4.40
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	8,262	156,683.66	1,294,520,398	170,200	1,406,192,400	4.34
日本	投資証券	G L P投資法人	7,868	179,005.61	1,408,416,139	169,900	1,336,773,200	4.13
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	3,851	324,042.69	1,247,888,399	322,000	1,240,022,000	3.83
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	5,091	170,814.89	869,618,604	191,500	974,926,500	3.01
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	2,555	349,170.55	892,130,755	368,000	940,240,000	2.90
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	5,752	135,508.57	779,445,294	148,200	852,446,400	2.63
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	1,747	377,806.46	660,027,885	412,500	720,637,500	2.23
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	3,818	187,252.88	714,931,495	183,800	701,748,400	2.17

日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	7,764	78,265.39	607,652,487	84,400	655,281,600	2.02
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	882	631,209.05	556,726,382	683,000	602,406,000	1.86
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	1,349	390,144.22	526,304,552	432,500	583,442,500	1.80
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	1,723	315,003.03	542,750,220	330,500	569,451,500	1.76
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	8,239	59,922.68	493,702,960	68,800	566,843,200	1.75
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	1,009	554,908.47	559,902,646	545,000	549,905,000	1.70
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	751	671,846.19	504,556,488	720,000	540,720,000	1.67
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	3,128	175,745.8	549,732,862	172,100	538,328,800	1.66
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	948	494,266.93	468,565,049	533,000	505,284,000	1.56
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	11,245	37,344.41	419,937,890	42,900	482,410,500	1.49
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	3,004	145,201.23	436,184,494	156,400	469,825,600	1.45
日本	投資証券	イオンリート投資法人	2,828	147,180.75	416,227,161	157,200	444,561,600	1.37
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	3,457	112,348.52	388,388,833	124,300	429,705,100	1.33
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	1,832	206,206.5	377,770,308	226,100	414,215,200	1.28
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,189	318,593.67	378,807,873	341,500	406,043,500	1.25
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	2,390	162,367.3	388,057,847	166,000	396,740,000	1.22
日本	投資証券	三菱地所物流リート投資法人	788	458,270.14	361,116,870	478,500	377,058,000	1.16
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	534	681,666.56	364,009,943	704,000	375,936,000	1.16

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	89.16
合計	89.16

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	229	日本円	454,553,590	465,671,500	1.44

(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。

R M先進国リートマザーファンド

以下の運用状況は2022年 8月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	266,884,702	0.91
	オーストラリア	17,373,972	0.06
	小計	284,258,674	0.96
投資証券	アメリカ	24,720,598,272	83.91
	カナダ	591,742,695	2.01
	ドイツ	16,164,497	0.05
	イタリア	4,146,542	0.01
	フランス	447,558,224	1.52
	オランダ	50,071,593	0.17
	スペイン	107,566,151	0.37
	ベルギー	326,704,081	1.11
	アイルランド	11,511,336	0.04
	イギリス	1,388,051,733	4.71
	オーストラリア	1,899,090,610	6.45
	ニュージーランド	106,946,696	0.36
	香港	408,812,046	1.39
	シンガポール	1,083,956,520	3.68
	韓国	69,024,824	0.23
	イスラエル	40,216,186	0.14
	ガーンジー	73,636,346	0.25
小計	31,345,798,352	106.40	
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		2,168,356,823	7.36
合計（純資産総額）		29,461,700,203	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		2,994,227,698	10.16

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	126,934	19,399.38	2,462,442,071	17,418.85	2,211,045,512	7.50
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	15,606	97,008.67	1,513,917,428	90,926.03	1,418,991,635	4.82
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	26,134	47,063.66	1,229,961,939	46,094.47	1,204,633,010	4.09
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	103,115	9,488.46	978,402,588	9,561.31	985,914,594	3.35
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	48,830	19,714.22	962,645,533	17,163.78	838,107,392	2.84

アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	77,871	11,620.97	904,936,627	10,551.12	821,626,990	2.79
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	56,260	17,562.12	988,045,385	14,388.40	809,491,817	2.75
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	165,200	4,109.24	678,848,067	4,587.26	757,816,459	2.57
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	23,924	30,838.16	737,772,332	28,157.13	673,631,401	2.29
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	23,057	26,302.04	606,446,280	27,874.33	642,698,521	2.18
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	58,714	11,335.22	665,536,184	10,219.80	600,045,549	2.04
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	25,491	24,377.61	621,409,813	21,346.24	544,137,192	1.85
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	65,904	7,880.42	519,351,483	8,236.00	542,785,891	1.84
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	104,667	5,428.06	568,139,341	4,993.45	522,649,703	1.77
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	265,379	2,065.11	548,039,439	1,917.07	508,750,385	1.73
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	19,818	26,233.75	519,900,518	23,263.50	461,036,049	1.56
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	68,514	7,133.97	488,776,902	6,591.85	451,634,456	1.53
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	20,884	24,037.76	502,004,659	21,555.57	450,166,706	1.53
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	11,198	42,400.75	474,803,705	36,921.32	413,445,030	1.40
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	33,123	10,980.64	363,711,918	11,711.46	387,918,769	1.32
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	49,851	6,586.96	328,366,594	7,344.61	366,136,522	1.24
香港	投資証券	LINK REIT	329,100	1,198.15	394,314,444	1,084.32	356,851,028	1.21
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	92,568	4,319.59	399,856,633	3,644.58	337,371,731	1.15
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	18,229	20,399.72	371,866,606	18,075.96	329,506,779	1.12
アメリカ	投資証券	UDR INC	51,323	7,144.61	366,683,269	6,218.94	319,174,750	1.08
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	105,928	3,126.45	331,179,203	2,972.22	314,842,083	1.07
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	122,585	2,392.97	293,343,345	2,477.31	303,682,039	1.03
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	29,706	10,306.83	306,174,970	9,896.79	293,994,213	1.00
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	188,175	1,914.72	360,304,069	1,558.78	293,323,652	1.00
アメリカ	投資証券	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	40,406	6,249.29	252,508,825	6,769.30	273,520,453	0.93

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	0.96
投資証券			106.40
合計			107.36

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	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	16,960,000.00	2,350,186,208	2,350,045,440	7.98
	カナダドル	買建	500,000.00	52,942,650	52,937,000	0.18
	ユーロ	買建	700,000.00	97,317,570	97,312,600	0.33
	英ポンド	買建	900,000.00	145,567,221	145,567,200	0.49

オーストラリアドル	買建	2,000,000.00	190,246,000	190,212,000	0.65
ニュージーランドドル	買建	125,000.00	10,628,275	10,627,250	0.04
香港ドル	買建	2,500,000.00	44,143,250	44,135,000	0.15
シンガポールドル	買建	1,000,000.00	99,145,000	99,144,000	0.34
イスラエルシェケル	買建	102,000.00	4,249,382	4,247,208	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8月31日現在

基準価額・純資産の推移



分配の推移

(1万口当たり、税引前)

2021年8月20日	0円
2022年8月22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(純土重視型)	17.2
RM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)	39.3
RM先進国債券マザーファンド	5.4
RM新興国債券マザーファンド	2.1
RM国内株式ESGマザーファンド	6.2
RM先進国株式ESGマザーファンド	20.1
RM新興国株式マザーファンド	3.5
RM国内リートマザーファンド	2.1
RM先進国リートマザーファンド	4.0
その他	0.2
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	64.7
米ドル	21.7
ユーロ	3.8
英ポンド	1.3
香港ドル	0.9
その他	7.5
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。

※為替ヘッジを付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 (純土重視型)	日本	令和2年度第7回埼玉県公債	2030/10/16	12.5
	日本	平成27年度第6回埼玉県公債	2025/9/29	8.6
	日本	平成29年度第9回埼玉県公債	2028/3/27	8.5
先進国債券 (為替ヘッジあり)	アメリカ	US TREASURY N/B	2032/2/15	0.6
	アメリカ	US TREASURY N/B	2031/11/15	0.5
先進国債券	アメリカ	US TREASURY N/B	2031/8/15	0.5
	アメリカ	US TREASURY N/B	2031/5/15	0.5
新興国債券	アメリカ	US TREASURY N/B	2031/8/15	0.5
	アメリカ	US TREASURY N/B	2031/11/15	0.5
新興国債券	アイルランド	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	-	78.3
	アメリカ	VANECK J.P.MORGAN EM LOCAL	-	21.3
国内株式ESG	日本	トヨタ自動車	-	7.6
	日本	ソニーグループ	-	4.8
	日本	三菱UFJフィナンシャルグループ	-	3.0
先進国株式ESG	アメリカ	MICROSOFT CORP	-	7.3
	アメリカ	TESLA INC	-	2.9
新興国株式	アメリカ	ALPHABET INC-CL A	-	2.6
	台湾	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	-	5.2
国内リート	中国	TENCENT HOLDINGS LTD	-	3.4
	韓国	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	-	2.7
先進国リート	日本	日本ビルファンド投資法人	-	6.4
	日本	ジャパンリアルエステイト投資法人	-	5.1
先進国リート	日本	日本プロロジスリート投資法人	-	4.5
	アメリカ	PROLOGIS INC	-	7.5
先進国リート	アメリカ	EQUINIX INC	-	4.8
	アメリカ	PUBLIC STORAGE	-	4.1

※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)



※ファン内にベンチマークはありません。

※2020年9月25日が設定日のため、2019年以前の実績はありません。2020年は9月25日から12月末までの騰落率です。2022年は8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号口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。

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。

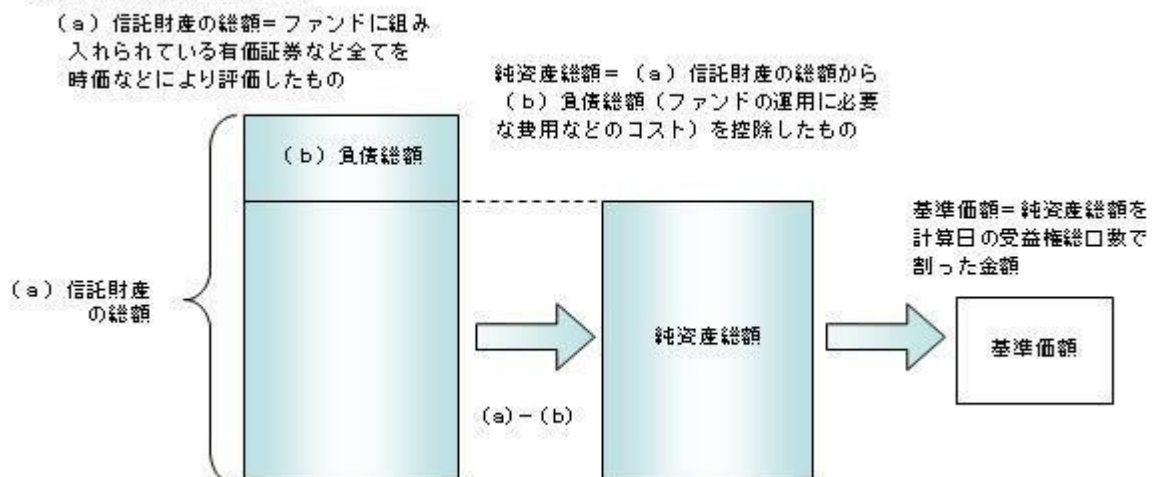
3【資産管理等の概要】

(1) 【資産の評価】

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1万口当たりには換算した価額で表示することがあります。

<基準価額算出の流れ>



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。

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】

2030年8月20日までとします(2020年9月25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8月21日から翌年8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】

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10億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。

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。

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。

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週間前までに知っている受益者に対し書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。

2) 受益者は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、書面決議について賛成するものとみなします。

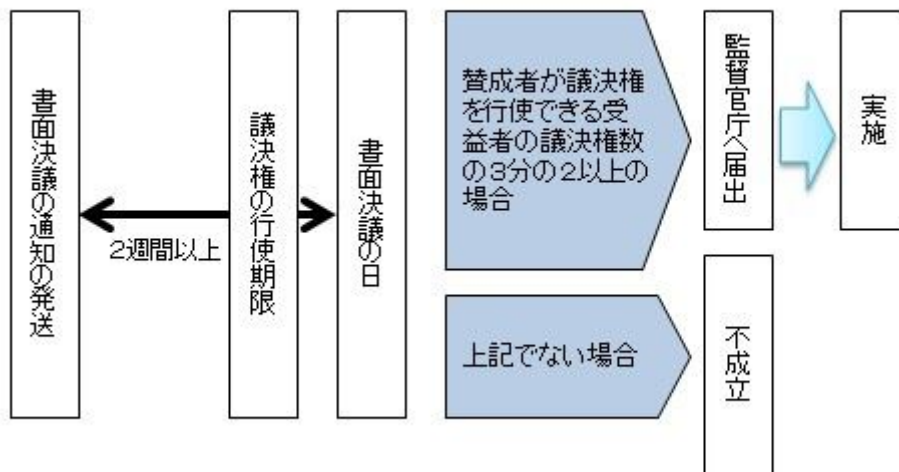
3) 書面決議は、議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。

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＞



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。

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/>

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。

他の受益者の氏名などの開示の請求の制限

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

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金・償還金受領権

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

(2) 解約請求権

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

(3) 帳簿閲覧権

受益者は、委託会社に対し、その営業時間内にファンドの信託財産に関する帳簿書類の閲覧を請求することができます。

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期計算期間(2021年 8月21日から2022年 8月22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】

【埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 2021年 8月20日現在	第2期 2022年 8月22日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	50,165,277	55,206,048
親投資信託受益証券	6,128,292,050	6,947,198,732
流動資産合計	6,178,457,327	7,002,404,780
資産合計	6,178,457,327	7,002,404,780
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	11,319,584
未払受託者報酬	727,850	1,124,913
未払委託者報酬	18,681,458	28,872,551
未払利息	136	149
その他未払費用	189,564	292,378
流動負債合計	19,599,008	41,609,575
負債合計	19,599,008	41,609,575
純資産の部		
元本等		
元本	5,531,926,085	6,357,699,438
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	626,932,234	603,095,767
（分配準備積立金）	397,415,671	397,068,373
元本等合計	6,158,858,319	6,960,795,205
純資産合計	6,158,858,319	6,960,795,205
負債純資産合計	6,178,457,327	7,002,404,780

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期		第2期	
	自	2020年 9月25日 至 2021年 8月20日	自	2021年 8月21日 至 2022年 8月22日
営業収益				
有価証券売買等損益		460,358,050		59,064,318
営業収益合計		460,358,050		59,064,318
営業費用				
支払利息		46,615		54,199
受託者報酬		1,283,939		2,243,414
委託者報酬		32,954,400		57,580,795
その他費用		334,057		584,915
営業費用合計		34,619,011		60,463,323
営業利益又は営業損失（ ）		425,739,039		119,527,641
経常利益又は経常損失（ ）		425,739,039		119,527,641
当期純利益又は当期純損失（ ）		425,739,039		119,527,641
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（ ）		28,323,368		2,342,253
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		-		626,932,234
剰余金増加額又は欠損金減少額		239,431,750		187,598,957
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		239,431,750		187,598,957
剰余金減少額又は欠損金増加額		9,915,187		94,250,036
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		9,915,187		94,250,036
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		626,932,234		603,095,767

(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原則として、毎年8月21日から翌年8月20日までとなっております。ただし、当計算期間末日が休業日のため、当計算期間は2021年 8月21日から2022年 8月22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 2021年 8月20日現在		第2期 2022年 8月22日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況		1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首元本額	2,185,671,585円	期首元本額	5,531,926,085円
期中追加設定元本額	3,956,173,166円	期中追加設定元本額	1,649,743,586円
期中一部解約元本額	609,918,666円	期中一部解約元本額	823,970,233円
2. 計算期間の末日における受益権の総数	5,531,926,085口	2. 計算期間の末日における受益権の総数	6,357,699,438口
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1.1133円	3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1.0949円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額)	(11,133円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額)	(10,949円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 2020年 9月25日 至 2021年 8月20日		第2期 自 2021年 8月21日 至 2022年 8月22日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
A 費用控除後の配当等収益額	55,987,149円	A 費用控除後の配当等収益額	50,207,956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	341,428,522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	229,516,563円	C 収益調整金額	206,027,394円
D 分配準備積立金額	0円	D 分配準備積立金額	346,860,417円
E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D)	626,932,234円	E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D)	603,095,767円
F 当ファンドの期末残存口数	5,531,926,085口	F 当ファンドの期末残存口数	6,357,699,438口
G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000)	1,133円	G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000)	948円
H 10,000口当たり分配金額	0円	H 10,000口当たり分配金額	0円
I 収益分配金金額(I=F×H/10,000)	0円	I 収益分配金金額(I=F×H/10,000)	0円

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

第1期 自 2020年 9月25日 至 2021年 8月20日	第2期 自 2021年 8月21日 至 2022年 8月22日
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>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。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>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。</p> <p>これらは、株価変動リスク、金利変動リスク、リートの価格変動リスク、投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。</p> <p>また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。</p>	<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>同左</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>同左</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p>

金融商品の時価等に関する事項

第1期 2021年 8月20日現在	第2期 2022年 8月22日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>親投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> <p>3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>親投資信託受益証券 同左</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左</p> <p>3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p>

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。	同左
--	----

（関連当事者との取引に関する注記）

第1期 自 2020年 9月25日 至 2021年 8月20日	第2期 自 2021年 8月21日 至 2022年 8月22日
該当事項はありません。	同左

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	第1期 自 2020年 9月25日 至 2021年 8月20日	第2期 自 2021年 8月21日 至 2022年 8月22日
	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	427,781,297	81,944,250
合計	427,781,297	81,944,250

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	R M国内債券マザーファンド（埼玉重視型）	1,188,701,069	1,179,429,200	
	R M先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	2,942,320,834	2,722,823,699	
	R M先進国債券マザーファンド	329,440,058	370,488,289	
	R M新興国債券マザーファンド	124,770,667	139,518,559	
	R M国内株式E S Gマザーファンド	334,562,392	433,258,297	
	R M先進国株式E S Gマザーファンド	882,412,567	1,441,509,169	
	R M新興国株式マザーファンド	145,236,475	237,200,210	
	R M国内リートマザーファンド	92,208,086	139,381,742	
	R M先進国リートマザーファンド	178,909,575	283,589,567	
合計		6,218,561,723	6,947,198,732	

(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「R M国内債券マザーファンド（埼玉重視型）」、「R M先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）」、「R M先進国債券マザーファンド」、「R M新興国債券マザーファンド」、「R M国内株式E S Gマザーファンド」、「R M先進国株式E S Gマザーファンド」、「R M新興国株式マザーファンド」、「R M国内リートマザーファンド」および「R M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。

R M国内債券マザーファンド（埼玉重視型）

貸借対照表

（単位：円）

2022年 8月22日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	12,443,961
国債証券	120,274,500
地方債証券	1,045,950,000
未収利息	715,011
流動資産合計	1,179,383,472
資産合計	1,179,383,472
負債の部	
流動負債	
未払利息	33
流動負債合計	33
負債合計	33
純資産の部	
元本等	
元本	1,188,701,069
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	9,317,630
元本等合計	1,179,383,439
純資産合計	1,179,383,439
負債純資産合計	1,179,383,472

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 8月22日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 8月21日
期首元本額	1,052,175,599円
期中追加設定元本額	168,349,286円
期中一部解約元本額	31,823,816円
期末元本額	1,188,701,069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E S G	1,188,701,069円
2. 計算日における受益権の総数	
	1,188,701,069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	9,317,630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	0.9922円
(10,000口当たり純資産額)	(9,922円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2022年 8月22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。

金融商品の時価等に関する事項

2022年 8月22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る場合、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 8月22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 8月22日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
国債証券		275,500
地方債証券		9,850,500
合計		10,126,000

(注) 損益に含まれた評価差額は、親投資信託受益証券の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

2 デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第4 2 5 回利付国債（2年）	50,000,000	50,054,000	
	第1 3 9 回利付国債（5年）	70,000,000	70,220,500	

	国債証券合計	120,000,000	120,274,500	
地方債証券	平成24年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	100,214,000	
	平成27年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	101,473,000	
	平成29年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	100,219,000	
	令和2年度第7回埼玉県公募公債	150,000,000	147,918,000	
	令和2年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	98,655,000	
	令和3年度第2回埼玉県公募公債（5年）	100,000,000	99,851,000	
	令和3年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	99,785,000	
	令和3年度第8回埼玉県公募公債	100,000,000	98,344,000	
	令和4年度第2回埼玉県公募公債（5年）	100,000,000	99,875,000	
	令和4年度第3回埼玉県公募公債（10年）	100,000,000	99,616,000	
	地方債証券合計	1,050,000,000	1,045,950,000	
	合計		1,166,224,500	

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。

R M先進国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 8月22日現在

資産の部	
流動資産	
預金	714,598,905
コール・ローン	284,461,106
国債証券	260,869,811,789
派生商品評価勘定	852,637,625
未収入金	293,278
未収利息	1,307,908,688
前払費用	106,072,722
流動資産合計	264,135,784,113

2022年 8月22日現在

資産合計	264,135,784,113
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,789,310,035
未払金	683,073,717
未払利息	771
流動負債合計	2,472,384,523
負債合計	2,472,384,523
純資産の部	
元本等	
元本	282,758,404,561
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	21,095,004,971
元本等合計	261,663,399,590
純資産合計	261,663,399,590
負債純資産合計	264,135,784,113

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>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。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則としてわが国における計算日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>為替予約取引による為替差損益</p> <p>原則として、約定日基準で計上しております。</p>
5. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産等については、投資信託財産の計算に関する規則第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分して整理する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2022年 8月22日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 8月21日
期首元本額	258,458,092,431円
期中追加設定元本額	138,083,776,796円
期中一部解約元本額	113,783,464,666円
期末元本額	282,758,404,561円
期末元本の内訳	

りそなラップ型ファンド(安定型)	23,941,240,023円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	16,636,153,438円
りそなラップ型ファンド(成長型)	1,520,214,503円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	4,500,805,748円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	1,199,105,338円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	372,055,517円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	504,965,942円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	153,611,278円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	34,968,033円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	34,416,213円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	2,942,320,834円
FWりそな円建債券アクティブファンド	1,337,838,087円
FWりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジあり)	202,434,173,301円
Smart-i 先進国債券インデックス(為替ヘッジあり)	1,308,733,484円
Smart-i 8資産バランス 安定型	1,507,783,125円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	1,211,558,167円
Smart-i 8資産バランス 成長型	497,727,505円
りそなFT 先進国債券インデックス・為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	8,128,781,925円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	2,365,575,160円
りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	3,753,229,708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)	31,900,185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)	98,982,000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)	18,476,945円
りそなDAAマルチアセットファンド(適格機関投資家専用)	6,830,229,457円
りそなDAAファンド202205(適格機関投資家専用)	1,393,558,645円
2. 計算日における受益権の総数	282,758,404,561口
3. 元本の欠損	
純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	21,095,004,971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	0.9254円
(10,000口当たり純資産額)	(9,254円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2022年 8月22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。

金融商品の時価等に関する事項

2022年 8月22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

（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 8月22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 8月22日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
国債証券		31,375,640,864
合計		31,375,640,864

(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 8月22日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	267,419,863,240	-	268,356,535,650	936,672,410
	米ドル	135,453,038,976	-	136,979,168,040	1,526,129,064
	カナダドル	5,756,073,822	-	5,718,470,779	37,603,043
	メキシコペソ	2,072,575,607	-	2,129,546,743	56,971,136
	ユーロ	92,835,731,941	-	92,333,004,032	502,727,909
	英ポンド	13,577,262,387	-	13,348,527,529	228,734,858
	スウェーデンクローナ	688,491,334	-	672,723,208	15,768,126
	ノルウェークローネ	542,739,441	-	544,808,372	2,068,931
	デンマーククローネ	986,540,432	-	982,686,966	3,853,466
	ポーランドズロチ	1,110,483,117	-	1,119,386,417	8,903,300
	オーストラリアドル	4,223,270,257	-	4,216,519,851	6,750,406
	シンガポールドル	1,122,915,460	-	1,128,065,515	5,150,055
	マレーシアリンギット	1,328,634,813	-	1,368,095,091	39,460,278
	中国元	6,673,581,507	-	6,704,561,946	30,980,439
	イスラエルシケル	1,048,524,146	-	1,110,971,161	62,447,015
	合計	267,419,863,240	-	268,356,535,650	936,672,410

(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。

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。

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いません。

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	2,100,000.00	2,062,196.64	
		US TREASURY N/B	90,000.00	89,610.37	
		US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,476,651.15	
		US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,455,597.45	
		US TREASURY N/B	2,320,000.00	2,277,044.73	
		US TREASURY N/B	2,130,000.00	2,120,371.33	
		US TREASURY N/B	3,640,000.00	3,522,310.79	
		US TREASURY N/B	3,330,000.00	3,264,440.62	
		US TREASURY N/B	7,130,000.00	6,902,173.68	
		US TREASURY N/B	4,050,000.00	3,908,803.63	
		US TREASURY N/B	3,800,000.00	3,728,601.42	
		US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,792,546.74	
		US TREASURY N/B	6,180,000.00	5,975,166.37	

US TREASURY N/B	5,480,000.00	5,446,391.70	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,821,289.00	
US TREASURY N/B	2,420,000.00	2,386,393.94	
US TREASURY N/B	3,180,000.00	3,164,721.05	
US TREASURY N/B	4,250,000.00	4,105,151.07	
US TREASURY N/B	6,600,000.00	6,336,515.46	
US TREASURY N/B	1,920,000.00	1,894,387.39	
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,677,851.36	
US TREASURY N/B	5,890,000.00	5,694,203.44	
US TREASURY N/B	5,470,000.00	5,236,242.83	
US TREASURY N/B	3,410,000.00	3,361,780.21	
US TREASURY N/B	3,980,000.00	3,936,934.80	
US TREASURY N/B	4,280,000.00	4,136,887.50	
US TREASURY N/B	4,880,000.00	4,844,162.25	
US TREASURY N/B	5,950,000.00	5,683,179.39	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,769,976.54	
US TREASURY N/B	3,360,000.00	3,316,031.04	
US TREASURY N/B	5,590,000.00	5,445,009.37	
US TREASURY N/B	6,130,000.00	5,849,120.94	
US TREASURY N/B	5,350,000.00	5,256,375.00	
US TREASURY N/B	2,800,000.00	2,755,265.52	
US TREASURY N/B	4,280,000.00	4,082,551.18	
US TREASURY N/B	2,320,000.00	2,272,784.28	
US TREASURY N/B	2,940,000.00	2,891,650.52	
US TREASURY N/B	3,870,000.00	3,820,944.65	
US TREASURY N/B	6,740,000.00	6,654,433.00	
US TREASURY N/B	6,060,000.00	5,754,869.30	
US TREASURY N/B	3,140,000.00	3,072,416.21	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,934,277.00	
US TREASURY N/B	5,980,000.00	5,665,349.14	
US TREASURY N/B	2,380,000.00	2,326,078.00	
US TREASURY N/B	3,440,000.00	3,347,415.49	
US TREASURY N/B	4,990,000.00	4,728,804.43	
US TREASURY N/B	1,480,000.00	1,448,896.76	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,888,124.80	

US TREASURY N/B	6,110,000.00	6,007,132.04	
US TREASURY N/B	4,960,000.00	4,687,974.75	
US TREASURY N/B	2,640,000.00	2,568,946.77	
US TREASURY N/B	2,480,000.00	2,383,609.34	
US TREASURY N/B	5,300,000.00	4,997,941.34	
US TREASURY N/B	2,520,000.00	2,462,315.43	
US TREASURY N/B	3,760,000.00	3,627,665.29	
US TREASURY N/B	3,740,000.00	3,537,075.45	
US TREASURY N/B	2,420,000.00	2,368,291.37	
US TREASURY N/B	3,990,000.00	3,842,712.74	
US TREASURY N/B	5,460,000.00	5,341,201.86	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	5,673,984.00	
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,267,195.28	
US TREASURY N/B	4,880,000.00	4,691,090.32	
US TREASURY N/B	5,970,000.00	5,667,301.89	
US TREASURY N/B	2,400,000.00	2,343,937.44	
US TREASURY N/B	3,800,000.00	3,669,449.10	
US TREASURY N/B	4,100,000.00	3,895,480.11	
US TREASURY N/B	2,620,000.00	2,571,284.24	
US TREASURY N/B	3,290,000.00	3,142,528.05	
US TREASURY N/B	4,250,000.00	4,120,009.50	
US TREASURY N/B	3,340,000.00	3,196,745.06	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,269,542.94	
US TREASURY N/B	2,630,000.00	2,492,746.87	
US TREASURY N/B	5,140,000.00	4,944,438.93	
US TREASURY N/B	2,530,000.00	2,488,195.54	
US TREASURY N/B	4,340,000.00	4,038,742.80	
US TREASURY N/B	4,550,000.00	4,470,375.00	
US TREASURY N/B	2,540,000.00	2,510,928.68	
US TREASURY N/B	3,490,000.00	3,228,658.67	
US TREASURY N/B	5,950,000.00	5,767,315.96	
US TREASURY N/B	4,920,000.00	4,847,352.75	
US TREASURY N/B	2,470,000.00	2,441,633.53	
US TREASURY N/B	2,520,000.00	2,317,317.15	
US TREASURY N/B	2,120,000.00	2,088,614.03	

US TREASURY N/B	4,190,000.00	3,843,833.93	
US TREASURY N/B	5,590,000.00	5,543,270.95	
US TREASURY N/B	2,250,000.00	2,223,369.00	
US TREASURY N/B	3,020,000.00	2,763,417.78	
US TREASURY N/B	6,300,000.00	6,067,687.50	
US TREASURY N/B	1,890,000.00	1,860,320.95	
US TREASURY N/B	4,920,000.00	4,490,749.18	
US TREASURY N/B	2,430,000.00	2,410,635.81	
US TREASURY N/B	6,020,000.00	5,484,078.53	
US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,181,609.32	
US TREASURY N/B	5,200,000.00	4,725,398.07	
US TREASURY N/B	5,570,000.00	5,394,849.12	
US TREASURY N/B	1,720,000.00	1,698,835.91	
US TREASURY N/B	4,340,000.00	3,950,416.86	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,666,000.00	
US TREASURY N/B	5,700,000.00	5,177,648.01	
US TREASURY N/B	2,820,000.00	2,762,718.75	
US TREASURY N/B	6,190,000.00	5,610,412.34	
US TREASURY N/B	2,960,000.00	2,801,478.08	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,657,433.53	
US TREASURY N/B	6,450,000.00	5,861,185.30	
US TREASURY N/B	2,670,000.00	2,580,930.40	
US TREASURY N/B	6,570,000.00	6,013,859.35	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,426,562.50	
US TREASURY N/B	5,820,000.00	5,318,934.08	
US TREASURY N/B	5,420,000.00	5,114,701.15	
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,595,427.65	
US TREASURY N/B	4,850,000.00	4,422,782.90	
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,571,538.86	
US TREASURY N/B	4,670,000.00	4,272,867.40	
US TREASURY N/B	2,600,000.00	2,472,741.96	
US TREASURY N/B	6,800,000.00	6,150,546.28	
US TREASURY N/B	5,830,000.00	5,458,337.50	
US TREASURY N/B	3,280,000.00	3,054,948.37	
US TREASURY N/B	4,670,000.00	4,238,025.00	

US TREASURY N/B	2,360,000.00	2,219,275.56	
US TREASURY N/B	7,100,000.00	6,467,378.64	
US TREASURY N/B	2,520,000.00	2,366,043.62	
US TREASURY N/B	6,110,000.00	5,616,187.35	
US TREASURY N/B	5,740,000.00	5,468,246.58	
US TREASURY N/B	2,550,000.00	2,393,314.23	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	5,540,038.80	
US TREASURY N/B	2,720,000.00	2,565,087.29	
US TREASURY N/B	5,800,000.00	5,347,780.96	
US TREASURY N/B	7,150,000.00	6,659,554.33	
US TREASURY N/B	5,530,000.00	5,317,008.17	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	915,117.10	
US TREASURY N/B	5,060,000.00	4,791,483.50	
US TREASURY N/B	2,800,000.00	2,499,546.84	
US TREASURY N/B	5,200,000.00	5,057,913.64	
US TREASURY N/B	2,650,000.00	2,345,974.51	
US TREASURY N/B	2,900,000.00	2,851,005.66	
US TREASURY N/B	4,620,000.00	4,462,631.25	
US TREASURY N/B	3,600,000.00	3,181,429.44	
US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,858,956.96	
US TREASURY N/B	4,280,000.00	3,775,010.07	
US TREASURY N/B	4,200,000.00	4,223,460.78	
US TREASURY N/B	4,670,000.00	4,089,077.21	
US TREASURY N/B	3,850,000.00	3,694,646.34	
US TREASURY N/B	4,290,000.00	3,769,921.15	
US TREASURY N/B	4,270,000.00	3,717,985.50	
US TREASURY N/B	5,010,000.00	4,383,162.82	
US TREASURY N/B	5,240,000.00	5,017,709.24	
US TREASURY N/B	5,250,000.00	4,614,257.55	
US TREASURY N/B	4,780,000.00	4,192,209.13	
US TREASURY N/B	5,590,000.00	4,928,588.96	
US TREASURY N/B	5,850,000.00	5,735,056.27	
US TREASURY N/B	5,800,000.00	5,216,827.98	
US TREASURY N/B	6,090,000.00	5,501,220.62	
US TREASURY N/B	5,530,000.00	4,988,664.41	

US TREASURY N/B	6,090,000.00	6,005,786.26
US TREASURY N/B	6,500,000.00	5,856,093.75
US TREASURY N/B	7,200,000.00	6,478,312.32
US TREASURY N/B	5,450,000.00	4,824,526.93
US TREASURY N/B	3,890,000.00	3,835,600.68
US TREASURY N/B	6,130,000.00	5,460,967.50
US TREASURY N/B	6,600,000.00	5,914,991.94
US TREASURY N/B	6,080,000.00	5,482,449.69
US TREASURY N/B	6,480,000.00	6,481,012.17
US TREASURY N/B	6,700,000.00	6,081,296.54
US TREASURY N/B	4,120,000.00	3,714,437.50
US TREASURY N/B	6,360,000.00	5,862,006.91
US TREASURY N/B	6,610,000.00	6,425,642.47
US TREASURY N/B	6,100,000.00	5,668,472.58
US TREASURY N/B	2,860,000.00	2,734,595.57
US TREASURY N/B	4,800,000.00	4,731,093.60
US TREASURY N/B	5,320,000.00	5,088,496.47
US TREASURY N/B	3,800,000.00	3,718,062.50
US TREASURY N/B	5,530,000.00	5,587,028.12
US TREASURY N/B	4,900,000.00	4,478,331.97
US TREASURY N/B	2,830,000.00	2,608,021.87
US TREASURY N/B	6,300,000.00	5,678,612.73
US TREASURY N/B	780,000.00	952,300.75
US TREASURY N/B	7,820,000.00	6,555,664.74
US TREASURY N/B	11,070,000.00	9,227,017.69
US TREASURY N/B	11,660,000.00	9,905,077.88
US TREASURY N/B	1,210,000.00	1,422,175.31
US TREASURY N/B	10,730,000.00	9,278,515.34
US TREASURY N/B	9,400,000.00	8,442,741.60
US TREASURY N/B	11,710,000.00	10,129,606.69
US TREASURY N/B	11,740,000.00	10,217,468.75
US TREASURY N/B	11,820,000.00	10,735,883.78
US TREASURY N/B	8,550,000.00	8,461,828.12
US TREASURY N/B	540,000.00	633,951.52
US TREASURY N/B	730,000.00	901,863.60

US TREASURY N/B	690,000.00	802,906.63
US TREASURY N/B	1,620,000.00	1,909,733.11
US TREASURY N/B	960,000.00	1,003,274.97
US TREASURY N/B	1,290,000.00	1,474,706.71
US TREASURY N/B	1,340,000.00	1,577,692.95
US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,851,500.00
US TREASURY N/B	780,000.00	928,900.75
US TREASURY N/B	950,000.00	1,095,765.62
US TREASURY N/B	4,640,000.00	3,205,950.00
US TREASURY N/B	1,410,000.00	1,518,944.49
US TREASURY N/B	4,740,000.00	3,246,159.13
US TREASURY N/B	1,220,000.00	1,378,933.54
US TREASURY N/B	6,040,000.00	4,307,275.00
US TREASURY N/B	1,800,000.00	2,167,382.70
US TREASURY N/B	6,510,000.00	5,066,610.61
US TREASURY N/B	1,130,000.00	1,294,247.19
US TREASURY N/B	3,450,000.00	2,860,400.17
US TREASURY N/B	1,080,000.00	1,131,848.42
US TREASURY N/B	7,810,000.00	5,899,905.17
US TREASURY N/B	1,040,000.00	993,971.78
US TREASURY N/B	5,720,000.00	4,517,235.58
US TREASURY N/B	1,340,000.00	1,277,763.16
US TREASURY N/B	5,510,000.00	4,637,870.03
US TREASURY N/B	1,070,000.00	997,733.16
US TREASURY N/B	4,540,000.00	4,404,509.14
US TREASURY N/B	1,640,000.00	1,462,354.54
US TREASURY N/B	1,860,000.00	1,654,019.50
US TREASURY N/B	2,240,000.00	2,111,200.00
US TREASURY N/B	2,720,000.00	2,458,412.43
US TREASURY N/B	2,430,000.00	2,473,758.95
US TREASURY N/B	2,260,000.00	2,342,542.88
US TREASURY N/B	1,740,000.00	1,768,275.00
US TREASURY N/B	2,710,000.00	2,646,590.06
US TREASURY N/B	2,930,000.00	2,742,869.10
US TREASURY N/B	2,800,000.00	2,561,562.36

US TREASURY N/B	3,380,000.00	2,826,788.97	
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,005,468.75	
US TREASURY N/B	2,590,000.00	2,316,937.07	
US TREASURY N/B	1,220,000.00	1,116,585.84	
US TREASURY N/B	1,270,000.00	1,059,259.37	
US TREASURY N/B	3,090,000.00	2,575,804.53	
US TREASURY N/B	2,950,000.00	2,335,570.16	
US TREASURY N/B	1,260,000.00	1,128,142.89	
US TREASURY N/B	2,940,000.00	2,694,463.84	
US TREASURY N/B	2,290,000.00	2,101,432.69	
US TREASURY N/B	3,430,000.00	3,008,753.12	
US TREASURY N/B	4,050,000.00	3,557,038.86	
US TREASURY N/B	3,300,000.00	3,051,081.99	
US TREASURY N/B	4,500,000.00	4,276,054.35	
US TREASURY N/B	4,190,000.00	3,896,372.34	
US TREASURY N/B	4,880,000.00	4,880,190.32	
US TREASURY N/B	2,980,000.00	2,797,009.22	
US TREASURY N/B	4,090,000.00	3,754,252.30	
US TREASURY N/B	4,100,000.00	3,314,433.44	
US TREASURY N/B	4,340,000.00	3,608,641.86	
US TREASURY N/B	5,440,000.00	4,152,249.72	
US TREASURY N/B	5,760,000.00	3,597,524.92	
US TREASURY N/B	7,220,000.00	4,664,655.72	
US TREASURY N/B	6,070,000.00	4,193,634.92	
US TREASURY N/B	7,260,000.00	5,352,831.39	
US TREASURY N/B	7,840,000.00	6,520,674.58	
US TREASURY N/B	7,600,000.00	5,767,389.96	
US TREASURY N/B	6,640,000.00	4,885,846.78	
US TREASURY N/B	6,050,000.00	4,885,375.00	
US TREASURY N/B	6,440,000.00	5,994,230.92	
	米ドル 小計	1,060,000,000.00	976,862,474.97 (133,996,225,691)
カナダドル	GOV OF CANADA	1,070,000.00	1,037,139.23
	GOV OF CANADA	1,400,000.00	1,377,651.80
	GOV OF CANADA	1,510,000.00	1,456,908.40

GOV OF CANADA	1,710,000.00	1,645,187.58
GOV OF CANADA	840,000.00	825,294.96
GOV OF CANADA	2,310,000.00	2,196,548.97
GOV OF CANADA	1,310,000.00	1,268,514.92
GOV OF CANADA	1,180,000.00	1,161,876.38
GOV OF CANADA	1,070,000.00	1,056,559.73
GOV OF CANADA	810,000.00	780,474.69
GOV OF CANADA	1,460,000.00	1,383,072.60
GOV OF CANADA	840,000.00	797,893.32
GOV OF CANADA	950,000.00	906,948.85
GOV OF CANADA	1,250,000.00	1,216,883.75
GOV OF CANADA	2,770,000.00	2,550,452.57
GOV OF CANADA	1,800,000.00	1,623,654.00
GOV OF CANADA	850,000.00	800,760.35
GOV OF CANADA	1,840,000.00	1,692,696.96
GOV OF CANADA	1,650,000.00	1,523,542.35
GOV OF CANADA	920,000.00	837,030.72
GOV OF CANADA	1,170,000.00	1,153,152.00
GOV OF CANADA	690,000.00	653,632.17
GOV OF CANADA	880,000.00	1,028,834.40
GOV OF CANADA	410,000.00	392,307.27
GOV OF CANADA	3,450,000.00	3,045,208.05
GOV OF CANADA	2,960,000.00	2,428,774.72
GOV OF CANADA	3,280,000.00	2,912,964.72
GOV OF CANADA	3,250,000.00	2,869,636.25
GOV OF CANADA	1,470,000.00	1,352,464.68
GOV OF CANADA	1,020,000.00	1,274,972.46
GOV OF CANADA	690,000.00	852,676.47
GOV OF CANADA	790,000.00	902,209.23
GOV OF CANADA	1,060,000.00	1,151,614.74
GOV OF CANADA	980,000.00	942,149.46
GOV OF CANADA	3,950,000.00	3,208,853.60
GOV OF CANADA	2,550,000.00	1,925,854.35
GOV OF CANADA	710,000.00	673,569.90
カナダドル 小計	56,850,000.00	52,907,966.60 (5,580,732,316)

メキシコペソ	UNITED MEXICAN STATE	20,620,000.00	20,189,584.30
	UNITED MEXICAN STATE	30,930,000.00	30,214,279.80
	UNITED MEXICAN STATE	25,540,000.00	25,954,618.91
	UNITED MEXICAN STATE	7,820,000.00	7,097,825.34
	UNITED MEXICAN STATE	39,980,000.00	36,237,448.21
	UNITED MEXICAN STATE	10,730,000.00	9,439,932.10
	UNITED MEXICAN STATE	33,070,000.00	31,500,309.30
	UNITED MEXICAN STATE	28,540,000.00	28,210,928.09
	UNITED MEXICAN STATE	36,376,000.00	34,174,160.72
	UNITED MEXICAN STATE	7,200,000.00	6,662,376.00
	UNITED MEXICAN STATE	8,200,000.00	9,024,288.60
	UNITED MEXICAN STATE	23,070,000.00	22,176,323.56
	UNITED MEXICAN STATE	21,320,000.00	18,917,022.80
	UNITED MEXICAN STATE	23,460,000.00	21,361,563.99
	UNITED MEXICAN STATE	3,400,000.00	3,081,631.14
	メキシコペソ 小計	320,256,000.00	304,242,292.86 (2,067,265,531)
ユーロ	GOV OF AUSTRIA	1,040,000.00	1,052,438.40
	GOV OF AUSTRIA	1,230,000.00	1,210,085.15
	GOV OF AUSTRIA	1,100,000.00	1,116,274.83
	GOV OF AUSTRIA	580,000.00	564,055.22
	GOV OF AUSTRIA	870,000.00	873,664.44
	GOV OF AUSTRIA	1,030,000.00	1,169,356.52
	GOV OF AUSTRIA	1,670,000.00	1,646,013.79
	GOV OF AUSTRIA	1,110,000.00	1,074,206.94
	GOV OF AUSTRIA	1,220,000.00	1,513,773.56
	GOV OF AUSTRIA	1,130,000.00	1,091,296.37
	GOV OF AUSTRIA	300,000.00	273,867.90
	GOV OF AUSTRIA	1,190,000.00	1,118,974.85
	GOV OF AUSTRIA	1,190,000.00	1,058,828.68
	GOV OF AUSTRIA	1,370,000.00	1,190,378.88
	GOV OF AUSTRIA	540,000.00	498,327.27
	GOV OF AUSTRIA	690,000.00	726,984.00
	GOV OF AUSTRIA	510,000.00	401,427.12
	GOV OF AUSTRIA	1,620,000.00	2,054,069.28

GOV OF AUSTRIA	590,000.00	403,945.27
GOV OF AUSTRIA	780,000.00	935,218.44
GOV OF AUSTRIA	560,000.00	503,781.60
GOV OF AUSTRIA	430,000.00	411,073.55
GOV OF AUSTRIA	570,000.00	410,226.15
GOV OF AUSTRIA	410,000.00	582,856.00
GOV OF AUSTRIA	340,000.00	194,256.62
GOV OF AUSTRIA	440,000.00	222,633.40
GOV OF AUSTRIA	610,000.00	569,354.48
GOV OF AUSTRIA	260,000.00	200,685.85
GOV OF BELGIUM	960,000.00	953,669.76
GOV OF BELGIUM	1,190,000.00	1,228,371.55
GOV OF BELGIUM	1,450,000.00	1,438,028.20
GOV OF BELGIUM	1,960,000.00	1,948,814.28
GOV OF BELGIUM	1,200,000.00	1,343,739.60
GOV OF BELGIUM	1,510,000.00	1,502,160.08
GOV OF BELGIUM	1,660,000.00	1,625,047.04
GOV OF BELGIUM	1,030,000.00	963,367.24
GOV OF BELGIUM	1,770,000.00	2,175,098.13
GOV OF BELGIUM	1,690,000.00	1,639,342.25
GOV OF BELGIUM	1,790,000.00	1,725,923.37
GOV OF BELGIUM	1,290,000.00	1,154,211.50
GOV OF BELGIUM	1,830,000.00	1,735,734.87
GOV OF BELGIUM	1,450,000.00	1,242,188.90
GOV OF BELGIUM	870,000.00	1,047,436.50
GOV OF BELGIUM	1,030,000.00	892,701.00
GOV OF BELGIUM	1,010,000.00	956,968.94
GOV OF BELGIUM	930,000.00	1,026,053.19
GOV OF BELGIUM	2,270,000.00	3,011,543.17
GOV OF BELGIUM	170,000.00	154,410.83
GOV OF BELGIUM	680,000.00	653,981.84
GOV OF BELGIUM	870,000.00	630,335.01
GOV OF BELGIUM	1,730,000.00	2,220,752.56
GOV OF BELGIUM	1,060,000.00	1,315,327.50
GOV OF BELGIUM	1,040,000.00	890,318.00

GOV OF BELGIUM	1,030,000.00	886,448.90	
GOV OF BELGIUM	920,000.00	715,071.84	
GOV OF BELGIUM	700,000.00	674,591.40	
GOV OF BELGIUM	690,000.00	647,275.89	
GOV OF BELGIUM	590,000.00	305,177.61	
GOV OF FINLAND	540,000.00	536,419.80	
GOV OF FINLAND	450,000.00	459,951.75	
GOV OF FINLAND	460,000.00	452,062.37	
GOV OF FINLAND	520,000.00	565,314.88	
GOV OF FINLAND	460,000.00	457,959.90	
GOV OF FINLAND	610,000.00	597,318.10	
GOV OF FINLAND	500,000.00	476,613.50	
GOV OF FINLAND	750,000.00	721,094.25	
GOV OF FINLAND	470,000.00	506,852.70	
GOV OF FINLAND	510,000.00	483,113.82	
GOV OF FINLAND	460,000.00	430,060.44	
GOV OF FINLAND	580,000.00	512,401.58	
GOV OF FINLAND	490,000.00	457,341.50	
GOV OF FINLAND	690,000.00	602,741.22	
GOV OF FINLAND	230,000.00	224,917.34	
GOV OF FINLAND	390,000.00	360,151.35	
GOV OF FINLAND	580,000.00	454,240.92	
GOV OF FINLAND	470,000.00	342,099.37	
GOV OF FINLAND	550,000.00	596,430.45	
GOV OF FINLAND	330,000.00	242,237.82	
GOV OF FINLAND	380,000.00	335,559.76	
GOV OF FINLAND	400,000.00	236,188.40	
GOV OF FRANCE	4,330,000.00	4,508,006.30	
GOV OF FRANCE	1,510,000.00	1,493,984.94	
GOV OF FRANCE	3,720,000.00	3,677,621.76	
GOV OF FRANCE	3,940,000.00	4,037,798.68	
GOV OF FRANCE	4,090,000.00	4,161,824.49	
GOV OF FRANCE	1,530,000.00	1,490,373.00	
GOV OF FRANCE	4,750,000.00	4,623,735.50	
GOV OF FRANCE	4,300,000.00	4,236,080.50	

GOV OF FRANCE	3,250,000.00	3,747,607.50	
GOV OF FRANCE	2,710,000.00	2,702,393.03	
GOV OF FRANCE	4,390,000.00	4,221,972.75	
GOV OF FRANCE	5,110,000.00	5,543,787.90	
GOV OF FRANCE	3,950,000.00	3,856,223.05	
GOV OF FRANCE	3,980,000.00	3,823,872.56	
GOV OF FRANCE	4,100,000.00	3,878,493.40	
GOV OF FRANCE	3,550,000.00	3,508,642.50	
GOV OF FRANCE	5,610,000.00	6,021,089.58	
GOV OF FRANCE	1,750,000.00	1,691,478.25	
GOV OF FRANCE	5,400,000.00	5,221,530.00	
GOV OF FRANCE	5,050,000.00	4,859,312.00	
GOV OF FRANCE	4,750,000.00	5,979,547.00	
GOV OF FRANCE	4,470,000.00	4,207,289.16	
GOV OF FRANCE	4,080,000.00	3,673,003.68	
GOV OF FRANCE	5,930,000.00	6,383,407.80	
GOV OF FRANCE	5,390,000.00	4,737,648.30	
GOV OF FRANCE	5,220,000.00	5,195,205.00	
GOV OF FRANCE	4,930,000.00	4,237,571.64	
GOV OF FRANCE	3,450,000.00	2,921,736.00	
GOV OF FRANCE	4,140,000.00	5,685,544.80	
GOV OF FRANCE	690,000.00	702,609.06	
GOV OF FRANCE	3,510,000.00	3,258,824.40	
GOV OF FRANCE	2,910,000.00	3,826,184.40	
GOV OF FRANCE	3,840,000.00	3,496,224.00	
GOV OF FRANCE	280,000.00	248,125.92	
GOV OF FRANCE	2,980,000.00	3,755,321.50	
GOV OF FRANCE	2,820,000.00	2,694,958.38	
GOV OF FRANCE	2,380,000.00	1,800,949.56	
GOV OF FRANCE	3,770,000.00	5,095,237.94	
GOV OF FRANCE	1,450,000.00	1,019,260.10	
GOV OF FRANCE	3,150,000.00	3,709,881.00	
GOV OF FRANCE	2,980,000.00	2,828,264.36	
GOV OF FRANCE	3,190,000.00	2,694,688.70	
GOV OF FRANCE	3,330,000.00	2,245,185.90	

GOV OF FRANCE	2,490,000.00	1,639,630.14	
GOV OF FRANCE	1,820,000.00	2,500,931.16	
GOV OF FRANCE	1,670,000.00	2,351,827.60	
GOV OF FRANCE	1,390,000.00	1,183,869.95	
GOV OF FRANCE	1,050,000.00	515,196.15	
GOV OF GERMANY	1,200,000.00	1,216,323.60	
GOV OF GERMANY	1,660,000.00	1,650,089.80	
GOV OF GERMANY	1,680,000.00	1,669,375.68	
GOV OF GERMANY	2,260,000.00	2,244,634.26	
GOV OF GERMANY	2,530,000.00	2,574,942.92	
GOV OF GERMANY	1,880,000.00	1,862,921.13	
GOV OF GERMANY	2,550,000.00	2,526,007.55	
GOV OF GERMANY	2,490,000.00	2,527,830.57	
GOV OF GERMANY	1,290,000.00	1,278,169.41	
GOV OF GERMANY	2,110,000.00	2,121,077.50	
GOV OF GERMANY	2,760,000.00	2,714,526.24	
GOV OF GERMANY	1,850,000.00	1,837,497.70	
GOV OF GERMANY	2,450,000.00	2,399,298.95	
GOV OF GERMANY	3,190,000.00	3,206,533.77	
GOV OF GERMANY	2,100,000.00	2,046,298.80	
GOV OF GERMANY	350,000.00	341,779.90	
GOV OF GERMANY	2,720,000.00	2,689,095.36	
GOV OF GERMANY	2,160,000.00	2,094,932.16	
GOV OF GERMANY	2,840,000.00	2,744,107.40	
GOV OF GERMANY	2,130,000.00	2,050,001.46	
GOV OF GERMANY	3,220,000.00	3,130,274.70	
GOV OF GERMANY	2,060,000.00	1,972,717.80	
GOV OF GERMANY	1,680,000.00	2,116,633.68	
GOV OF GERMANY	2,840,000.00	2,779,445.52	
GOV OF GERMANY	750,000.00	759,849.75	
GOV OF GERMANY	1,960,000.00	1,862,931.00	
GOV OF GERMANY	1,730,000.00	2,145,777.82	
GOV OF GERMANY	2,330,000.00	2,268,907.40	
GOV OF GERMANY	1,630,000.00	1,975,066.11	
GOV OF GERMANY	2,330,000.00	2,226,815.95	

GOV OF GERMANY	2,520,000.00	2,367,459.36	
GOV OF GERMANY	2,860,000.00	2,723,886.88	
GOV OF GERMANY	2,840,000.00	2,645,286.76	
GOV OF GERMANY	1,150,000.00	1,574,636.35	
GOV OF GERMANY	2,200,000.00	2,035,924.00	
GOV OF GERMANY	3,270,000.00	3,003,831.81	
GOV OF GERMANY	700,000.00	643,384.00	
GOV OF GERMANY	2,370,000.00	3,207,894.54	
GOV OF GERMANY	2,440,000.00	2,225,836.32	
GOV OF GERMANY	3,010,000.00	2,724,080.10	
GOV OF GERMANY	750,000.00	679,725.00	
GOV OF GERMANY	2,980,000.00	2,669,573.40	
GOV OF GERMANY	450,000.00	469,955.25	
GOV OF GERMANY	2,370,000.00	3,290,043.48	
GOV OF GERMANY	1,880,000.00	1,588,750.40	
GOV OF GERMANY	2,530,000.00	2,103,578.62	
GOV OF GERMANY	2,970,000.00	3,987,866.52	
GOV OF GERMANY	420,000.00	396,393.06	
GOV OF GERMANY	1,830,000.00	2,610,216.84	
GOV OF GERMANY	2,210,000.00	3,372,055.57	
GOV OF GERMANY	2,070,000.00	2,745,565.20	
GOV OF GERMANY	2,570,000.00	3,110,357.92	
GOV OF GERMANY	3,030,000.00	3,723,482.16	
GOV OF GERMANY	3,320,000.00	3,221,684.84	
GOV OF GERMANY	4,160,000.00	2,824,156.54	
GOV OF GERMANY	1,700,000.00	1,119,927.70	
GOV OF IRELAND	750,000.00	780,116.02	
GOV OF IRELAND	1,070,000.00	1,187,349.68	
GOV OF IRELAND	1,150,000.00	1,144,931.95	
GOV OF IRELAND	770,000.00	732,445.86	
GOV OF IRELAND	700,000.00	680,660.40	
GOV OF IRELAND	1,030,000.00	1,005,042.79	
GOV OF IRELAND	900,000.00	959,136.30	
GOV OF IRELAND	890,000.00	794,624.04	
GOV OF IRELAND	500,000.00	490,511.00	

GOV OF IRELAND	930,000.00	794,356.71	
GOV OF IRELAND	280,000.00	241,985.52	
GOV OF IRELAND	500,000.00	472,015.00	
GOV OF IRELAND	540,000.00	444,854.70	
GOV OF IRELAND	730,000.00	701,197.85	
GOV OF IRELAND	370,000.00	278,092.74	
GOV OF IRELAND	980,000.00	940,931.32	
GOV OF IRELAND	680,000.00	567,985.64	
GOV OF ITALY	2,510,000.00	2,594,295.84	
GOV OF ITALY	1,390,000.00	1,378,501.50	
GOV OF ITALY	2,190,000.00	2,220,311.79	
GOV OF ITALY	1,260,000.00	1,252,443.78	
GOV OF ITALY	1,730,000.00	1,700,678.23	
GOV OF ITALY	1,740,000.00	1,705,137.88	
GOV OF ITALY	1,940,000.00	1,900,400.72	
GOV OF ITALY	1,980,000.00	2,069,932.78	
GOV OF ITALY	1,530,000.00	1,491,090.57	
GOV OF ITALY	1,900,000.00	1,906,674.70	
GOV OF ITALY	2,020,000.00	2,021,755.38	
GOV OF ITALY	1,540,000.00	1,488,130.18	
GOV OF ITALY	2,190,000.00	2,275,731.93	
GOV OF ITALY	1,680,000.00	1,664,310.14	
GOV OF ITALY	2,270,000.00	2,300,967.34	
GOV OF ITALY	650,000.00	621,627.69	
GOV OF ITALY	2,040,000.00	1,963,654.22	
GOV OF ITALY	2,350,000.00	2,526,670.65	
GOV OF ITALY	1,500,000.00	1,474,081.65	
GOV OF ITALY	1,460,000.00	1,438,222.64	
GOV OF ITALY	2,020,000.00	2,004,070.28	
GOV OF ITALY	460,000.00	446,593.76	
GOV OF ITALY	2,040,000.00	2,056,860.60	
GOV OF ITALY	2,310,000.00	2,296,920.78	
GOV OF ITALY	1,660,000.00	1,562,448.44	
GOV OF ITALY	2,660,000.00	2,866,538.36	
GOV OF ITALY	1,740,000.00	1,598,205.66	

GOV OF ITALY	1,680,000.00	1,636,256.16	
GOV OF ITALY	2,170,000.00	2,147,931.10	
GOV OF ITALY	1,800,000.00	1,637,881.20	
GOV OF ITALY	1,920,000.00	1,829,264.64	
GOV OF ITALY	2,280,000.00	2,126,207.16	
GOV OF ITALY	1,380,000.00	1,291,214.94	
GOV OF ITALY	2,580,000.00	2,537,049.19	
GOV OF ITALY	2,000,000.00	1,948,088.00	
GOV OF ITALY	2,330,000.00	2,146,327.96	
GOV OF ITALY	2,580,000.00	3,075,783.12	
GOV OF ITALY	900,000.00	893,875.50	
GOV OF ITALY	2,500,000.00	2,413,310.00	
GOV OF ITALY	990,000.00	861,967.26	
GOV OF ITALY	1,560,000.00	1,364,820.60	
GOV OF ITALY	2,660,000.00	2,941,183.28	
GOV OF ITALY	1,830,000.00	1,827,964.12	
GOV OF ITALY	1,620,000.00	1,383,045.84	
GOV OF ITALY	1,110,000.00	1,094,717.52	
GOV OF ITALY	2,510,000.00	2,516,372.89	
GOV OF ITALY	3,280,000.00	3,777,543.20	
GOV OF ITALY	2,640,000.00	2,731,119.60	
GOV OF ITALY	1,550,000.00	1,369,924.10	
GOV OF ITALY	1,710,000.00	1,447,173.00	
GOV OF ITALY	1,920,000.00	1,707,758.20	
GOV OF ITALY	1,560,000.00	1,287,767.52	
GOV OF ITALY	3,850,000.00	4,672,271.45	
GOV OF ITALY	2,110,000.00	1,673,926.30	
GOV OF ITALY	2,070,000.00	1,682,199.99	
GOV OF ITALY	2,620,000.00	2,272,577.52	
GOV OF ITALY	1,570,000.00	1,258,047.28	
GOV OF ITALY	590,000.00	541,561.59	
GOV OF ITALY	2,530,000.00	3,048,445.07	
GOV OF ITALY	1,550,000.00	1,411,054.90	
GOV OF ITALY	2,740,000.00	3,147,122.90	
GOV OF ITALY	890,000.00	876,049.95	

GOV OF ITALY	1,340,000.00	1,050,716.78	
GOV OF ITALY	1,810,000.00	1,564,535.04	
GOV OF ITALY	3,360,000.00	3,551,704.80	
GOV OF ITALY	770,000.00	548,574.18	
GOV OF ITALY	550,000.00	526,029.35	
GOV OF ITALY	1,090,000.00	1,008,707.80	
GOV OF ITALY	2,270,000.00	2,679,267.38	
GOV OF ITALY	1,470,000.00	1,370,010.60	
GOV OF ITALY	2,430,000.00	2,866,707.45	
GOV OF ITALY	1,600,000.00	1,210,150.40	
GOV OF ITALY	1,720,000.00	2,008,032.92	
GOV OF ITALY	1,440,000.00	976,219.20	
GOV OF ITALY	1,640,000.00	1,547,110.40	
GOV OF ITALY	1,830,000.00	1,562,928.70	
GOV OF ITALY	1,870,000.00	1,810,279.68	
GOV OF ITALY	1,310,000.00	1,344,639.02	
GOV OF ITALY	1,650,000.00	1,307,370.90	
GOV OF ITALY	1,900,000.00	1,271,244.76	
GOV OF ITALY	960,000.00	696,865.15	
GOV OF ITALY	930,000.00	762,088.50	
GOV OF ITALY	560,000.00	389,133.52	
GOV OF NETHERLANDS	1,450,000.00	1,436,760.05	
GOV OF NETHERLANDS	1,670,000.00	1,707,739.16	
GOV OF NETHERLANDS	2,000,000.00	1,959,752.00	
GOV OF NETHERLANDS	860,000.00	829,626.68	
GOV OF NETHERLANDS	2,000,000.00	1,956,954.00	
GOV OF NETHERLANDS	1,330,000.00	1,265,558.84	
GOV OF NETHERLANDS	1,270,000.00	1,245,774.75	
GOV OF NETHERLANDS	1,490,000.00	1,822,734.88	
GOV OF NETHERLANDS	1,640,000.00	1,594,434.24	
GOV OF NETHERLANDS	1,090,000.00	1,002,285.52	
GOV OF NETHERLANDS	1,090,000.00	1,014,362.72	
GOV OF NETHERLANDS	1,330,000.00	1,197,861.84	
GOV OF NETHERLANDS	1,290,000.00	1,140,010.41	
GOV OF NETHERLANDS	760,000.00	689,056.28	

GOV OF NETHERLANDS	1,560,000.00	1,699,568.52	
GOV OF NETHERLANDS	1,940,000.00	2,501,767.74	
GOV OF NETHERLANDS	870,000.00	667,436.93	
GOV OF NETHERLANDS	1,170,000.00	956,813.13	
GOV OF NETHERLANDS	2,010,000.00	2,669,975.46	
GOV OF NETHERLANDS	1,980,000.00	2,390,192.64	
GOV OF NETHERLANDS	1,350,000.00	817,210.35	
GOV OF SPAIN	2,000,000.00	2,082,540.00	
GOV OF SPAIN	1,790,000.00	1,887,875.41	
GOV OF SPAIN	2,070,000.00	2,165,501.52	
GOV OF SPAIN	1,780,000.00	1,747,909.44	
GOV OF SPAIN	1,490,000.00	1,465,674.70	
GOV OF SPAIN	2,790,000.00	2,889,608.58	
GOV OF SPAIN	2,320,000.00	2,252,107.52	
GOV OF SPAIN	2,440,000.00	2,464,000.57	
GOV OF SPAIN	350,000.00	337,428.73	
GOV OF SPAIN	2,610,000.00	2,869,427.99	
GOV OF SPAIN	1,700,000.00	1,746,639.50	
GOV OF SPAIN	2,280,000.00	2,170,731.00	
GOV OF SPAIN	2,390,000.00	2,434,152.86	
GOV OF SPAIN	2,490,000.00	2,918,342.25	
GOV OF SPAIN	2,590,000.00	2,573,255.65	
GOV OF SPAIN	1,350,000.00	1,256,037.97	
GOV OF SPAIN	1,770,000.00	1,762,084.56	
GOV OF SPAIN	2,040,000.00	1,956,980.16	
GOV OF SPAIN	2,760,000.00	2,731,020.00	
GOV OF SPAIN	1,420,000.00	1,293,238.02	
GOV OF SPAIN	2,490,000.00	2,445,630.69	
GOV OF SPAIN	2,160,000.00	2,115,160.56	
GOV OF SPAIN	2,040,000.00	2,437,481.76	
GOV OF SPAIN	2,640,000.00	3,315,383.28	
GOV OF SPAIN	1,810,000.00	1,764,556.33	
GOV OF SPAIN	360,000.00	333,444.24	
GOV OF SPAIN	2,250,000.00	2,052,120.37	
GOV OF SPAIN	2,530,000.00	2,264,957.20	

	GOV OF SPAIN	2,520,000.00	2,507,193.36	
	GOV OF SPAIN	2,300,000.00	2,161,613.60	
	GOV OF SPAIN	2,280,000.00	1,915,269.54	
	GOV OF SPAIN	2,170,000.00	1,864,833.98	
	GOV OF SPAIN	2,250,000.00	1,942,931.25	
	GOV OF SPAIN	2,650,000.00	3,485,515.85	
	GOV OF SPAIN	760,000.00	771,326.28	
	GOV OF SPAIN	1,810,000.00	1,807,357.40	
	GOV OF SPAIN	1,980,000.00	1,833,693.84	
	GOV OF SPAIN	2,610,000.00	3,121,794.90	
	GOV OF SPAIN	1,240,000.00	960,332.26	
	GOV OF SPAIN	2,070,000.00	2,719,893.06	
	GOV OF SPAIN	1,340,000.00	1,040,719.04	
	GOV OF SPAIN	2,190,000.00	2,831,133.23	
	GOV OF SPAIN	320,000.00	234,661.76	
	GOV OF SPAIN	1,740,000.00	2,422,038.24	
	GOV OF SPAIN	1,850,000.00	1,876,473.50	
	GOV OF SPAIN	1,820,000.00	1,768,195.52	
	GOV OF SPAIN	1,990,000.00	1,270,288.64	
	GOV OF SPAIN	780,000.00	609,069.24	
	GOV OF SPAIN	1,540,000.00	1,643,860.68	
	GOV OF SPAIN	570,000.00	332,856.74	
	ユーロ 小計	646,230,000.00	646,909,418.03 (88,982,390,450)	
英bond	UK TREASURY	920,000.00	916,699.04	
	UK TREASURY	3,350,000.00	3,232,582.50	
	UK TREASURY	1,790,000.00	1,745,931.62	
	UK TREASURY	1,330,000.00	1,337,514.50	
	UK TREASURY	1,850,000.00	1,751,006.50	
	UK TREASURY	1,040,000.00	1,105,413.92	
	UK TREASURY	1,600,000.00	1,529,520.00	
	UK TREASURY	1,810,000.00	1,794,135.35	
	UK TREASURY	540,000.00	501,482.66	
	UK TREASURY	1,120,000.00	1,085,728.00	
	UK TREASURY	2,060,000.00	1,899,031.60	

UK TREASURY	1,240,000.00	1,181,429.84
UK TREASURY	1,480,000.00	1,618,883.20
UK TREASURY	1,270,000.00	1,132,433.09
UK TREASURY	1,080,000.00	1,042,785.36
UK TREASURY	1,210,000.00	1,471,592.32
UK TREASURY	1,260,000.00	1,123,276.77
UK TREASURY	1,230,000.00	1,116,532.50
UK TREASURY	1,530,000.00	1,309,737.81
UK TREASURY	1,430,000.00	1,692,499.38
UK TREASURY	2,780,000.00	2,302,206.96
UK TREASURY	1,690,000.00	1,482,941.20
UK TREASURY	1,630,000.00	1,889,743.76
UK TREASURY	630,000.00	530,506.11
UK TREASURY	1,350,000.00	1,612,866.60
UK TREASURY	1,740,000.00	1,345,785.60
UK TREASURY	1,900,000.00	2,238,112.60
UK TREASURY	1,830,000.00	1,604,704.30
UK TREASURY	1,710,000.00	2,162,414.70
UK TREASURY	620,000.00	484,677.56
UK TREASURY	1,430,000.00	1,715,914.20
UK TREASURY	1,520,000.00	1,836,889.60
UK TREASURY	2,400,000.00	1,853,039.51
UK TREASURY	1,960,000.00	2,472,100.17
UK TREASURY	2,060,000.00	2,205,922.36
UK TREASURY	1,570,000.00	1,747,748.80
UK TREASURY	990,000.00	667,115.46
UK TREASURY	1,660,000.00	2,080,497.92
UK TREASURY	1,830,000.00	1,415,450.10
UK TREASURY	1,000,000.00	815,290.00
UK TREASURY	1,410,000.00	1,810,256.70
UK TREASURY	970,000.00	575,582.48
UK TREASURY	1,550,000.00	1,097,620.10
UK TREASURY	1,140,000.00	1,382,124.60
UK TREASURY	570,000.00	428,924.94
UK TREASURY	1,290,000.00	999,525.54

	UK TREASURY	1,770,000.00	2,389,747.80
	UK TREASURY	1,730,000.00	1,390,401.00
	UK TREASURY	1,150,000.00	1,531,892.00
	UK TREASURY	1,460,000.00	726,204.00
	UK TREASURY	1,450,000.00	1,436,602.00
	UK TREASURY	1,450,000.00	1,817,937.50
	UK TREASURY	1,340,000.00	1,003,070.40
	UK TREASURY	980,000.00	597,070.88
	英ボンド 小計	79,700,000.00	78,239,103.41 (12,680,993,880)
スウェーデンクローナ	GOV OF SWEDEN	9,580,000.00	9,540,461.42
	GOV OF SWEDEN	7,630,000.00	7,737,151.90
	GOV OF SWEDEN	7,460,000.00	7,214,664.47
	GOV OF SWEDEN	6,580,000.00	6,246,062.36
	GOV OF SWEDEN	6,740,000.00	6,331,307.96
	GOV OF SWEDEN	4,670,000.00	4,117,209.76
	GOV OF SWEDEN	4,350,000.00	4,615,893.75
	GOV OF SWEDEN	4,080,000.00	5,237,967.24
	スウェーデンクローナ 小計	51,090,000.00	51,040,718.86 (660,977,309)
ノルウェークローネ	GOV OF NORWAY	6,250,000.00	6,220,193.75
	GOV OF NORWAY	5,940,000.00	5,712,646.50
	GOV OF NORWAY	4,630,000.00	4,364,145.40
	GOV OF NORWAY	3,690,000.00	3,474,033.15
	GOV OF NORWAY	3,930,000.00	3,703,411.92
	GOV OF NORWAY	3,830,000.00	3,517,954.58
	GOV OF NORWAY	5,550,000.00	4,902,287.25
	GOV OF NORWAY	3,510,000.00	3,027,353.94
	GOV OF NORWAY	3,340,000.00	3,079,814.00
	ノルウェークローネ 小計	40,670,000.00	38,001,840.49 (530,125,674)
デンマーククローネ	GOV OF DENMARK	4,420,000.00	4,458,666.16
	GOV OF DENMARK	4,310,000.00	4,212,378.50
	GOV OF DENMARK	5,230,000.00	5,331,723.50
	GOV OF DENMARK	6,580,000.00	6,307,927.52
	GOV OF DENMARK	7,470,000.00	6,994,758.60

	GOV OF DENMARK	5,860,000.00	5,085,155.04	
	GOV OF DENMARK	10,730,000.00	15,103,502.92	
	GOV OF DENMARK	5,220,000.00	3,473,649.00	
	デンマーククローネ 小計	49,820,000.00	50,967,761.24	(942,903,582)
ポーランドズロチ	GOV OF POLAND	2,440,000.00	2,370,899.20	
	GOV OF POLAND	2,510,000.00	2,350,866.00	
	GOV OF POLAND	1,980,000.00	1,750,020.62	
	GOV OF POLAND	3,030,000.00	2,765,632.50	
	GOV OF POLAND	2,730,000.00	2,359,129.50	
	GOV OF POLAND	4,450,000.00	4,069,747.50	
	GOV OF POLAND	5,820,000.00	5,073,876.00	
	GOV OF POLAND	2,380,000.00	1,866,753.00	
	GOV OF POLAND	1,410,000.00	1,265,207.10	
	GOV OF POLAND	2,910,000.00	2,451,820.50	
	GOV OF POLAND	3,590,000.00	3,031,252.40	
	GOV OF POLAND	1,120,000.00	1,107,456.00	
	GOV OF POLAND	4,550,000.00	3,705,065.00	
	GOV OF POLAND	4,000,000.00	2,815,200.00	
	GOV OF POLAND	1,420,000.00	988,320.00	
	ポーランドズロチ 小計	44,340,000.00	37,971,245.32	(1,100,038,368)
オーストラリアドル	GOV OF AUSTRALIA	1,390,000.00	1,387,166.48	
	GOV OF AUSTRALIA	2,470,000.00	2,323,937.28	
	GOV OF AUSTRALIA	2,020,000.00	2,028,051.11	
	GOV OF AUSTRALIA	1,560,000.00	1,421,880.40	
	GOV OF AUSTRALIA	2,020,000.00	2,095,853.22	
	GOV OF AUSTRALIA	2,400,000.00	2,155,890.70	
	GOV OF AUSTRALIA	1,800,000.00	1,921,437.18	
	GOV OF AUSTRALIA	1,790,000.00	1,749,994.74	
	GOV OF AUSTRALIA	1,230,000.00	1,167,055.48	
	GOV OF AUSTRALIA	1,140,000.00	1,107,509.08	
	GOV OF AUSTRALIA	1,770,000.00	1,767,360.39	
	GOV OF AUSTRALIA	1,800,000.00	1,735,954.02	
	GOV OF AUSTRALIA	2,110,000.00	1,991,427.70	

	GOV OF AUSTRALIA	1,800,000.00	1,493,032.86
	GOV OF AUSTRALIA	2,530,000.00	2,168,346.87
	GOV OF AUSTRALIA	2,940,000.00	2,384,872.14
	GOV OF AUSTRALIA	2,600,000.00	2,138,646.63
	GOV OF AUSTRALIA	2,300,000.00	1,970,676.33
	GOV OF AUSTRALIA	1,970,000.00	2,157,701.79
	GOV OF AUSTRALIA	1,290,000.00	1,235,197.82
	GOV OF AUSTRALIA	1,000,000.00	918,282.60
	GOV OF AUSTRALIA	1,250,000.00	1,266,921.50
	GOV OF AUSTRALIA	1,110,000.00	1,046,587.58
	GOV OF AUSTRALIA	1,420,000.00	1,227,151.93
	GOV OF AUSTRALIA	1,330,000.00	1,163,155.88
	GOV OF AUSTRALIA	1,920,000.00	1,241,947.58
	オーストラリアドル 小計	46,960,000.00	43,266,039.29 (4,083,016,127)
シンガポールドル	GOV OF SINGAPORE	900,000.00	891,376.92
	GOV OF SINGAPORE	910,000.00	916,870.50
	GOV OF SINGAPORE	760,000.00	756,043.44
	GOV OF SINGAPORE	440,000.00	412,016.00
	GOV OF SINGAPORE	810,000.00	796,878.00
	GOV OF SINGAPORE	370,000.00	350,057.00
	GOV OF SINGAPORE	870,000.00	901,911.60
	GOV OF SINGAPORE	460,000.00	459,448.00
	GOV OF SINGAPORE	790,000.00	798,690.00
	GOV OF SINGAPORE	970,000.00	981,252.00
	GOV OF SINGAPORE	440,000.00	402,538.08
	GOV OF SINGAPORE	720,000.00	762,120.00
	GOV OF SINGAPORE	740,000.00	693,690.80
	GOV OF SINGAPORE	380,000.00	356,250.00
	GOV OF SINGAPORE	500,000.00	488,840.00
	GOV OF SINGAPORE	650,000.00	628,550.00
	GOV OF SINGAPORE	720,000.00	576,720.00
	GOV OF SINGAPORE	160,000.00	127,772.80
	シンガポールドル 小計	11,590,000.00	11,301,025.14 (1,112,359,904)
マレーシアリングgit	GOV OF MALAYSIA	640,000.00	645,978.24

	GOV OF MALAYSIA	1,920,000.00	1,927,707.07	
	GOV OF MALAYSIA	950,000.00	965,692.76	
	GOV OF MALAYSIA	1,260,000.00	1,279,397.70	
	GOV OF MALAYSIA	1,330,000.00	1,345,421.21	
	GOV OF MALAYSIA	3,030,000.00	3,078,278.50	
	GOV OF MALAYSIA	730,000.00	751,164.45	
	GOV OF MALAYSIA	1,190,000.00	1,203,366.55	
	GOV OF MALAYSIA	2,460,000.00	2,480,130.18	
	GOV OF MALAYSIA	130,000.00	131,046.91	
	GOV OF MALAYSIA	1,790,000.00	1,773,720.66	
	GOV OF MALAYSIA	870,000.00	876,693.17	
	GOV OF MALAYSIA	2,520,000.00	2,510,209.29	
	GOV OF MALAYSIA	520,000.00	538,332.86	
	GOV OF MALAYSIA	2,460,000.00	2,456,725.98	
	GOV OF MALAYSIA	1,130,000.00	1,172,562.35	
	GOV OF MALAYSIA	1,850,000.00	1,665,254.19	
	GOV OF MALAYSIA	1,450,000.00	1,473,435.77	
	GOV OF MALAYSIA	930,000.00	900,664.26	
	GOV OF MALAYSIA	1,410,000.00	1,376,674.22	
	GOV OF MALAYSIA	1,100,000.00	1,148,274.49	
	GOV OF MALAYSIA	2,100,000.00	2,029,405.35	
	GOV OF MALAYSIA	1,860,000.00	1,866,091.50	
	GOV OF MALAYSIA	1,610,000.00	1,706,282.99	
	GOV OF MALAYSIA	890,000.00	944,524.15	
	GOV OF MALAYSIA	2,150,000.00	1,981,927.40	
	GOV OF MALAYSIA	520,000.00	540,759.02	
	GOV OF MALAYSIA	860,000.00	914,516.08	
	GOV OF MALAYSIA	1,180,000.00	1,216,617.40	
	GOV OF MALAYSIA	1,280,000.00	1,347,442.17	
	GOV OF MALAYSIA	2,650,000.00	2,442,287.70	
	マレーシアリングット 小計	44,770,000.00	44,690,584.57	(1,367,281,620)
中国元	GOV OF CHINA	15,150,000.00	15,270,139.50	
	GOV OF CHINA	9,940,000.00	10,057,287.03	
	GOV OF CHINA	14,910,000.00	14,980,971.60	

	GOV OF CHINA	17,330,000.00	17,565,254.75
	GOV OF CHINA	12,400,000.00	12,495,117.92
	GOV OF CHINA	14,370,000.00	14,399,530.35
	GOV OF CHINA	9,490,000.00	9,434,149.45
	GOV OF CHINA	6,500,000.00	6,507,442.50
	GOV OF CHINA	17,280,000.00	17,684,265.60
	GOV OF CHINA	15,990,000.00	16,391,648.01
	GOV OF CHINA	14,400,000.00	14,589,000.00
	GOV OF CHINA	14,180,000.00	14,181,993.70
	GOV OF CHINA	12,100,000.00	12,160,739.58
	GOV OF CHINA	8,200,000.00	8,377,225.78
	GOV OF CHINA	11,890,000.00	12,397,771.95
	GOV OF CHINA	10,120,000.00	10,402,196.20
	GOV OF CHINA	14,250,000.00	14,539,702.50
	GOV OF CHINA	13,700,000.00	13,898,897.97
	GOV OF CHINA	5,600,000.00	5,655,916.00
	GOV OF CHINA	13,050,000.00	13,067,241.65
	GOV OF CHINA	10,600,000.00	11,093,476.64
	GOV OF CHINA	13,590,000.00	13,948,436.25
	GOV OF CHINA	6,250,000.00	6,354,062.50
	GOV OF CHINA	5,700,000.00	5,740,348.59
	GOV OF CHINA	3,110,000.00	3,615,443.73
	GOV OF CHINA	4,600,000.00	5,162,286.52
	GOV OF CHINA	11,170,000.00	12,490,510.69
	GOV OF CHINA	7,470,000.00	8,236,258.40
	GOV OF CHINA	9,640,000.00	10,377,363.60
	中国元 小計	322,980,000.00	331,074,678.96 (6,660,924,573)
イスラエルシュケル	GOV OF ISRAEL	1,360,000.00	1,337,288.00
	GOV OF ISRAEL	990,000.00	993,762.00
	GOV OF ISRAEL	2,370,000.00	2,460,889.50
	GOV OF ISRAEL	1,460,000.00	1,406,783.00
	GOV OF ISRAEL	2,440,000.00	2,332,518.00
	GOV OF ISRAEL	1,840,000.00	1,841,472.00
	GOV OF ISRAEL	1,280,000.00	1,209,472.00
	GOV OF ISRAEL	1,970,000.00	2,372,274.00

	GOV OF ISRAEL	1,230,000.00	1,220,713.50	
	GOV OF ISRAEL	1,770,000.00	1,797,612.00	
	GOV OF ISRAEL	2,740,000.00	2,480,933.00	
	GOV OF ISRAEL	1,870,000.00	1,567,434.00	
	GOV OF ISRAEL	2,130,000.00	2,957,292.00	
	GOV OF ISRAEL	2,110,000.00	2,335,664.50	
	イスラエルシェケル 小計	25,560,000.00	26,314,107.50	(1,104,576,764)
	合計		260,869,811,789	(260,869,811,789)

(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 253銘柄	100.0%	51.3%
カナダドル	国債証券 37銘柄	100.0%	2.1%
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 355銘柄	100.0%	34.1%
英ポンド	国債証券 54銘柄	100.0%	4.9%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券 9銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.4%
ポーランドズロチ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.4%
オーストラリアドル	国債証券 26銘柄	100.0%	1.6%
シンガポールドル	国債証券 18銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券 31銘柄	100.0%	0.5%
中国元	国債証券 29銘柄	100.0%	2.6%
イスラエルシェケル	国債証券 14銘柄	100.0%	0.4%

(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。

R M先進国債券マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2022年 8月22日現在

資産の部	
流動資産	
預金	93,357,683
コール・ローン	99,913,036
国債証券	47,468,921,748
派生商品評価勘定	100,298
未収利息	228,357,592
前払費用	16,846,774
流動資産合計	47,907,497,131
資産合計	47,907,497,131
負債の部	
流動負債	
未払解約金	144,900
未払利息	270
流動負債合計	145,170
負債合計	145,170
純資産の部	
元本等	
元本	42,597,788,427
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	5,309,563,534
元本等合計	47,907,351,961
純資産合計	47,907,351,961
負債純資産合計	47,907,497,131

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 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

法	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 8月22日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 8月21日
期首元本額	37,395,564,705円
期中追加設定元本額	14,696,211,893円
期中一部解約元本額	9,493,988,171円
期末元本額	42,597,788,427円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	3,649,638,333円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	979,000,938円
りそなラップ型ファンド(成長型)	573,406,414円
DCりそな グローバルバランス	82,621,012円
つみたてバランスファンド	1,104,488,195円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	821,543,890円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	218,532,793円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	66,430,465円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	93,951,689円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	28,523,190円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	6,559,669円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	5,979,785円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	329,440,058円
FWりそな先進国債券アクティブファンド	9,242,931円
FWりそな先進国+新興国債券アクティブファンド	22,652,074円
FWりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジなし)	31,588,114,059円
Smart-i 先進国債券インデックス(為替ヘッジなし)	1,255,754,861円
Smart-i 8資産バランス 安定型	279,235,051円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	219,501,325円
Smart-i 8資産バランス 成長型	90,679,060円
りそなFT 先進国債券インデックス(適格機関投資家専用)	915,526,825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)	4,835,525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)	6,556,117円

りそなV I グローバル・バランスファンド(成長型)(適格機関投資家専用)	19,105,070円
りそなF T パッシブバランス(適格機関投資家専用)	226,469,098円
2. 計算日における受益権の総数	42,597,788,427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	1.1246円
(10,000口当たり純資産額)	(11,246円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2022年 8月22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。

金融商品の時価等に関する事項

2022年 8月22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	<p>国債証券 (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。</p> <p>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。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
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 8月22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 8月22日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
国債証券		4,999,470,111
合計		4,999,470,111

(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 8月22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	23,244,160	-	23,344,458	100,298
	米ドル	13,627,000	-	13,716,000	89,000
	ユーロ	9,617,160	-	9,628,458	11,298
	合計	23,244,160	-	23,344,458	100,298

（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。

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。

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いません。

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	640,000.00	628,478.97	
		US TREASURY N/B	320,000.00	318,614.65	
		US TREASURY N/B	570,000.00	553,838.50	
		US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,191,994.68	
		US TREASURY N/B	830,000.00	805,430.58	
		US TREASURY N/B	530,000.00	520,186.94	
		US TREASURY N/B	130,000.00	129,412.33	
		US TREASURY N/B	1,260,000.00	1,221,178.64	
		US TREASURY N/B	630,000.00	609,630.71	
		US TREASURY N/B	890,000.00	872,478.12	
		US TREASURY N/B	480,000.00	478,368.72	
		US TREASURY N/B	500,000.00	484,023.40	
		US TREASURY N/B	940,000.00	907,228.49	

US TREASURY N/B	540,000.00	529,853.88
US TREASURY N/B	150,000.00	149,378.89
US TREASURY N/B	1,110,000.00	1,073,209.49
US TREASURY N/B	710,000.00	705,645.64
US TREASURY N/B	1,140,000.00	1,099,253.89
US TREASURY N/B	440,000.00	433,889.80
US TREASURY N/B	340,000.00	338,366.40
US TREASURY N/B	720,000.00	695,460.88
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,440,117.15
US TREASURY N/B	140,000.00	138,132.41
US TREASURY N/B	450,000.00	446,308.56
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,643,488.26
US TREASURY N/B	810,000.00	775,385.13
US TREASURY N/B	420,000.00	414,060.90
US TREASURY N/B	440,000.00	435,239.02
US TREASURY N/B	1,000,000.00	966,562.50
US TREASURY N/B	690,000.00	684,932.77
US TREASURY N/B	1,330,000.00	1,270,357.74
US TREASURY N/B	490,000.00	481,826.94
US TREASURY N/B	340,000.00	335,550.76
US TREASURY N/B	380,000.00	370,143.75
US TREASURY N/B	410,000.00	391,213.63
US TREASURY N/B	1,540,000.00	1,513,050.00
US TREASURY N/B	300,000.00	295,207.02
US TREASURY N/B	240,000.00	228,928.10
US TREASURY N/B	320,000.00	313,487.48
US TREASURY N/B	700,000.00	688,488.22
US TREASURY N/B	720,000.00	710,873.42
US TREASURY N/B	850,000.00	839,208.91
US TREASURY N/B	690,000.00	655,257.39
US TREASURY N/B	650,000.00	636,009.72
US TREASURY N/B	850,000.00	838,827.09
US TREASURY N/B	1,330,000.00	1,260,019.12
US TREASURY N/B	390,000.00	381,164.04
US TREASURY N/B	600,000.00	583,851.54

US TREASURY N/B	800,000.00	796,093.68
US TREASURY N/B	1,050,000.00	995,039.01
US TREASURY N/B	220,000.00	215,376.54
US TREASURY N/B	730,000.00	709,582.77
US TREASURY N/B	950,000.00	934,005.80
US TREASURY N/B	630,000.00	595,448.40
US TREASURY N/B	650,000.00	632,505.83
US TREASURY N/B	600,000.00	576,679.68
US TREASURY N/B	1,190,000.00	1,122,179.28
US TREASURY N/B	220,000.00	214,964.04
US TREASURY N/B	710,000.00	685,011.26
US TREASURY N/B	1,070,000.00	1,011,944.04
US TREASURY N/B	310,000.00	303,376.16
US TREASURY N/B	1,030,000.00	991,978.47
US TREASURY N/B	750,000.00	733,681.57
US TREASURY N/B	1,580,000.00	1,494,149.12
US TREASURY N/B	400,000.00	389,906.24
US TREASURY N/B	700,000.00	672,902.30
US TREASURY N/B	1,130,000.00	1,072,705.38
US TREASURY N/B	400,000.00	390,656.24
US TREASURY N/B	860,000.00	830,454.27
US TREASURY N/B	700,000.00	665,081.97
US TREASURY N/B	430,000.00	422,004.66
US TREASURY N/B	550,000.00	525,346.63
US TREASURY N/B	730,000.00	707,672.22
US TREASURY N/B	400,000.00	382,843.72
US TREASURY N/B	340,000.00	335,497.65
US TREASURY N/B	960,000.00	909,900.00
US TREASURY N/B	490,000.00	471,357.01
US TREASURY N/B	250,000.00	245,869.12
US TREASURY N/B	1,160,000.00	1,079,479.64
US TREASURY N/B	600,000.00	589,500.00
US TREASURY N/B	250,000.00	247,138.65
US TREASURY N/B	1,060,000.00	980,624.12
US TREASURY N/B	570,000.00	552,499.17

US TREASURY N/B	880,000.00	867,006.18	
US TREASURY N/B	240,000.00	237,243.74	
US TREASURY N/B	850,000.00	781,634.75	
US TREASURY N/B	900,000.00	889,488.27	
US TREASURY N/B	290,000.00	285,706.63	
US TREASURY N/B	650,000.00	596,298.82	
US TREASURY N/B	780,000.00	773,479.66	
US TREASURY N/B	470,000.00	464,437.08	
US TREASURY N/B	630,000.00	576,474.57	
US TREASURY N/B	810,000.00	780,131.25	
US TREASURY N/B	310,000.00	305,132.00	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	912,753.90	
US TREASURY N/B	230,000.00	228,167.17	
US TREASURY N/B	1,180,000.00	1,074,952.27	
US TREASURY N/B	570,000.00	565,235.14	
US TREASURY N/B	770,000.00	699,722.40	
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,259,120.98	
US TREASURY N/B	480,000.00	474,093.74	
US TREASURY N/B	980,000.00	892,029.61	
US TREASURY N/B	300,000.00	294,000.00	
US TREASURY N/B	1,130,000.00	1,026,446.00	
US TREASURY N/B	330,000.00	323,296.87	
US TREASURY N/B	1,320,000.00	1,196,404.57	
US TREASURY N/B	1,060,000.00	1,003,232.01	
US TREASURY N/B	350,000.00	341,236.31	
US TREASURY N/B	1,360,000.00	1,235,846.82	
US TREASURY N/B	430,000.00	415,655.45	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	915,351.50	
US TREASURY N/B	450,000.00	436,781.25	
US TREASURY N/B	870,000.00	795,098.39	
US TREASURY N/B	340,000.00	320,848.40	
US TREASURY N/B	470,000.00	451,796.66	
US TREASURY N/B	1,380,000.00	1,258,441.32	
US TREASURY N/B	450,000.00	428,589.81	
US TREASURY N/B	280,000.00	256,189.05	

US TREASURY N/B	520,000.00	494,548.39
US TREASURY N/B	1,050,000.00	949,716.70
US TREASURY N/B	1,410,000.00	1,320,112.50
US TREASURY N/B	320,000.00	298,043.74
US TREASURY N/B	1,030,000.00	934,725.00
US TREASURY N/B	400,000.00	376,148.40
US TREASURY N/B	1,310,000.00	1,193,276.90
US TREASURY N/B	350,000.00	328,617.17
US TREASURY N/B	1,170,000.00	1,075,440.13
US TREASURY N/B	850,000.00	809,757.77
US TREASURY N/B	300,000.00	281,566.38
US TREASURY N/B	1,210,000.00	1,117,241.15
US TREASURY N/B	440,000.00	414,940.59
US TREASURY N/B	900,000.00	829,828.08
US TREASURY N/B	1,450,000.00	1,350,538.99
US TREASURY N/B	140,000.00	134,607.80
US TREASURY N/B	1,220,000.00	1,116,442.86
US TREASURY N/B	470,000.00	445,058.74
US TREASURY N/B	300,000.00	267,808.59
US TREASURY N/B	1,040,000.00	1,011,582.72
US TREASURY N/B	1,130,000.00	1,000,358.94
US TREASURY N/B	350,000.00	344,086.89
US TREASURY N/B	580,000.00	560,243.75
US TREASURY N/B	1,120,000.00	989,778.04
US TREASURY N/B	660,000.00	645,742.94
US TREASURY N/B	1,180,000.00	1,040,773.80
US TREASURY N/B	250,000.00	218,901.35
US TREASURY N/B	800,000.00	767,718.72
US TREASURY N/B	410,000.00	360,295.49
US TREASURY N/B	810,000.00	705,285.30
US TREASURY N/B	1,230,000.00	1,076,105.84
US TREASURY N/B	690,000.00	660,728.88
US TREASURY N/B	1,180,000.00	1,037,109.31
US TREASURY N/B	1,040,000.00	912,112.44
US TREASURY N/B	1,150,000.00	1,013,931.54

US TREASURY N/B	850,000.00	833,298.77	
US TREASURY N/B	1,110,000.00	998,392.94	
US TREASURY N/B	1,480,000.00	1,336,914.04	
US TREASURY N/B	920,000.00	829,940.55	
US TREASURY N/B	840,000.00	828,384.31	
US TREASURY N/B	1,550,000.00	1,396,453.12	
US TREASURY N/B	1,220,000.00	1,097,714.03	
US TREASURY N/B	830,000.00	734,744.46	
US TREASURY N/B	1,170,000.00	1,153,638.25	
US TREASURY N/B	1,280,000.00	1,140,299.90	
US TREASURY N/B	920,000.00	824,514.02	
US TREASURY N/B	500,000.00	450,859.35	
US TREASURY N/B	890,000.00	890,139.01	
US TREASURY N/B	1,110,000.00	1,007,498.38	
US TREASURY N/B	1,440,000.00	1,298,250.00	
US TREASURY N/B	890,000.00	820,312.28	
US TREASURY N/B	1,140,000.00	1,108,204.60	
US TREASURY N/B	1,520,000.00	1,412,471.85	
US TREASURY N/B	500,000.00	478,076.15	
US TREASURY N/B	510,000.00	502,678.69	
US TREASURY N/B	930,000.00	889,530.39	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	978,437.50	
US TREASURY N/B	480,000.00	484,950.00	
US TREASURY N/B	850,000.00	776,853.50	
US TREASURY N/B	680,000.00	626,662.50	
US TREASURY N/B	960,000.00	865,312.41	
US TREASURY N/B	120,000.00	146,507.80	
US TREASURY N/B	1,430,000.00	1,198,798.02	
US TREASURY N/B	1,390,000.00	1,158,586.68	
US TREASURY N/B	2,100,000.00	1,783,933.41	
US TREASURY N/B	160,000.00	188,056.24	
US TREASURY N/B	1,720,000.00	1,487,329.58	
US TREASURY N/B	2,070,000.00	1,859,199.48	
US TREASURY N/B	2,110,000.00	1,825,232.29	
US TREASURY N/B	2,050,000.00	1,784,140.62	

US TREASURY N/B	1,920,000.00	1,743,899.90	
US TREASURY N/B	1,510,000.00	1,494,428.12	
US TREASURY N/B	80,000.00	93,918.74	
US TREASURY N/B	90,000.00	111,188.66	
US TREASURY N/B	280,000.00	325,817.18	
US TREASURY N/B	100,000.00	117,884.76	
US TREASURY N/B	70,000.00	73,155.46	
US TREASURY N/B	140,000.00	160,045.69	
US TREASURY N/B	190,000.00	223,702.73	
US TREASURY N/B	40,000.00	46,287.50	
US TREASURY N/B	190,000.00	226,270.69	
US TREASURY N/B	210,000.00	242,221.87	
US TREASURY N/B	950,000.00	656,390.62	
US TREASURY N/B	150,000.00	161,589.84	
US TREASURY N/B	1,110,000.00	760,176.50	
US TREASURY N/B	210,000.00	237,357.41	
US TREASURY N/B	1,200,000.00	855,750.00	
US TREASURY N/B	230,000.00	276,943.34	
US TREASURY N/B	1,110,000.00	863,892.13	
US TREASURY N/B	250,000.00	286,337.87	
US TREASURY N/B	710,000.00	588,662.06	
US TREASURY N/B	230,000.00	241,041.79	
US TREASURY N/B	1,110,000.00	838,526.85	
US TREASURY N/B	130,000.00	124,246.47	
US TREASURY N/B	1,290,000.00	1,018,747.18	
US TREASURY N/B	180,000.00	171,639.82	
US TREASURY N/B	1,070,000.00	900,639.00	
US TREASURY N/B	200,000.00	186,492.18	
US TREASURY N/B	720,000.00	698,512.45	
US TREASURY N/B	200,000.00	178,335.92	
US TREASURY N/B	870,000.00	773,654.28	
US TREASURY N/B	320,000.00	301,600.00	
US TREASURY N/B	590,000.00	533,258.57	
US TREASURY N/B	360,000.00	366,482.80	
US TREASURY N/B	320,000.00	331,687.48	

US TREASURY N/B	410,000.00	416,662.50	
US TREASURY N/B	390,000.00	380,874.58	
US TREASURY N/B	430,000.00	402,537.10	
US TREASURY N/B	380,000.00	347,640.60	
US TREASURY N/B	530,000.00	443,253.89	
US TREASURY N/B	320,000.00	292,500.00	
US TREASURY N/B	410,000.00	366,773.82	
US TREASURY N/B	290,000.00	265,417.94	
US TREASURY N/B	530,000.00	442,053.12	
US TREASURY N/B	460,000.00	383,453.10	
US TREASURY N/B	620,000.00	490,865.59	
US TREASURY N/B	350,000.00	313,373.02	
US TREASURY N/B	570,000.00	522,396.05	
US TREASURY N/B	350,000.00	321,179.67	
US TREASURY N/B	620,000.00	543,856.25	
US TREASURY N/B	520,000.00	456,706.22	
US TREASURY N/B	640,000.00	591,724.99	
US TREASURY N/B	760,000.00	722,178.06	
US TREASURY N/B	630,000.00	585,850.73	
US TREASURY N/B	830,000.00	830,032.37	
US TREASURY N/B	810,000.00	760,260.89	
US TREASURY N/B	970,000.00	890,372.79	
US TREASURY N/B	800,000.00	646,718.72	
US TREASURY N/B	710,000.00	590,353.85	
US TREASURY N/B	860,000.00	656,421.83	
US TREASURY N/B	1,060,000.00	662,044.51	
US TREASURY N/B	1,150,000.00	742,985.33	
US TREASURY N/B	1,330,000.00	918,868.93	
US TREASURY N/B	1,140,000.00	840,527.24	
US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,164,406.18	
US TREASURY N/B	1,380,000.00	1,047,236.59	
US TREASURY N/B	1,050,000.00	772,611.31	
US TREASURY N/B	1,170,000.00	944,775.00	
US TREASURY N/B	1,050,000.00	977,320.26	
米ドル 小計	193,090,000.00	177,553,902.22	

カナダドル	GOV OF CANADA	230,000.00	222,936.47
	GOV OF CANADA	380,000.00	373,934.06
	GOV OF CANADA	370,000.00	356,990.80
	GOV OF CANADA	130,000.00	125,072.74
	GOV OF CANADA	210,000.00	206,323.74
	GOV OF CANADA	530,000.00	503,970.11
	GOV OF CANADA	100,000.00	96,833.20
	GOV OF CANADA	170,000.00	167,388.97
	GOV OF CANADA	230,000.00	227,110.97
	GOV OF CANADA	180,000.00	173,438.82
	GOV OF CANADA	160,000.00	151,569.60
	GOV OF CANADA	200,000.00	189,974.60
	GOV OF CANADA	190,000.00	181,389.77
	GOV OF CANADA	150,000.00	146,026.05
	GOV OF CANADA	590,000.00	543,237.19
	GOV OF CANADA	350,000.00	315,710.50
	GOV OF CANADA	130,000.00	122,469.23
	GOV OF CANADA	360,000.00	331,179.84
	GOV OF CANADA	140,000.00	129,270.26
	GOV OF CANADA	160,000.00	145,570.56
	GOV OF CANADA	190,000.00	187,264.00
	GOV OF CANADA	150,000.00	142,093.95
	GOV OF CANADA	120,000.00	140,295.60
	GOV OF CANADA	130,000.00	124,390.11
	GOV OF CANADA	150,000.00	143,191.65
	GOV OF CANADA	590,000.00	520,774.71
	GOV OF CANADA	410,000.00	336,418.12
	GOV OF CANADA	670,000.00	595,026.33
	GOV OF CANADA	570,000.00	503,290.05
	GOV OF CANADA	370,000.00	340,416.28
	GOV OF CANADA	160,000.00	199,995.68
	GOV OF CANADA	120,000.00	148,291.56
	GOV OF CANADA	140,000.00	159,885.18
GOV OF CANADA	200,000.00	217,285.80	
	200,000.00	192,275.40	

	GOV OF CANADA		
	GOV OF CANADA	730,000.00	593,028.64
	GOV OF CANADA	390,000.00	294,542.43
	GOV OF CANADA	110,000.00	104,355.90
	カナダドル 小計	10,360,000.00	9,653,218.87 (1,018,221,526)
メキシコペソ	UNITED MEXICAN STATE	4,070,000.00	3,985,044.04
	UNITED MEXICAN STATE	6,100,000.00	5,958,846.00
	UNITED MEXICAN STATE	4,770,000.00	4,847,436.65
	UNITED MEXICAN STATE	410,000.00	372,136.61
	UNITED MEXICAN STATE	7,470,000.00	6,770,728.81
	UNITED MEXICAN STATE	1,860,000.00	1,636,372.20
	UNITED MEXICAN STATE	5,980,000.00	5,696,155.11
	UNITED MEXICAN STATE	5,130,000.00	5,070,850.07
	UNITED MEXICAN STATE	6,140,000.00	5,768,345.80
	UNITED MEXICAN STATE	1,810,000.00	1,674,847.30
	UNITED MEXICAN STATE	1,470,000.00	1,617,768.81
	UNITED MEXICAN STATE	3,980,000.00	3,825,824.35
	UNITED MEXICAN STATE	4,230,000.00	3,753,236.70
	UNITED MEXICAN STATE	4,350,000.00	3,960,903.81
	UNITED MEXICAN STATE	450,000.00	407,862.94
	メキシコペソ 小計	58,220,000.00	55,346,359.20 (376,067,441)
ユーロ	GOV OF AUSTRIA	200,000.00	202,392.00
	GOV OF AUSTRIA	190,000.00	186,923.71
	GOV OF AUSTRIA	240,000.00	243,550.86
	GOV OF AUSTRIA	110,000.00	106,975.99
	GOV OF AUSTRIA	260,000.00	261,095.12
	GOV OF AUSTRIA	120,000.00	136,235.71
	GOV OF AUSTRIA	310,000.00	305,547.47
	GOV OF AUSTRIA	220,000.00	212,905.88
	GOV OF AUSTRIA	130,000.00	161,303.74
	GOV OF AUSTRIA	250,000.00	241,437.25
	GOV OF AUSTRIA	60,000.00	54,773.58
	GOV OF AUSTRIA	230,000.00	216,272.45
	GOV OF AUSTRIA	190,000.00	169,056.68

GOV OF AUSTRIA	250,000.00	217,222.41	
GOV OF AUSTRIA	100,000.00	92,282.83	
GOV OF AUSTRIA	160,000.00	168,576.00	
GOV OF AUSTRIA	120,000.00	94,453.44	
GOV OF AUSTRIA	260,000.00	329,665.44	
GOV OF AUSTRIA	130,000.00	89,004.89	
GOV OF AUSTRIA	160,000.00	191,839.68	
GOV OF AUSTRIA	90,000.00	80,964.90	
GOV OF AUSTRIA	80,000.00	76,478.80	
GOV OF AUSTRIA	110,000.00	79,166.45	
GOV OF AUSTRIA	60,000.00	85,296.00	
GOV OF AUSTRIA	60,000.00	34,280.58	
GOV OF AUSTRIA	90,000.00	45,538.65	
GOV OF AUSTRIA	104,000.00	97,070.27	
GOV OF AUSTRIA	50,000.00	38,593.42	
GOV OF BELGIUM	150,000.00	149,010.90	
GOV OF BELGIUM	320,000.00	330,318.40	
GOV OF BELGIUM	170,000.00	168,596.40	
GOV OF BELGIUM	420,000.00	417,603.06	
GOV OF BELGIUM	190,000.00	212,758.77	
GOV OF BELGIUM	290,000.00	288,494.32	
GOV OF BELGIUM	310,000.00	303,472.64	
GOV OF BELGIUM	170,000.00	159,002.36	
GOV OF BELGIUM	350,000.00	430,104.15	
GOV OF BELGIUM	240,000.00	232,806.00	
GOV OF BELGIUM	360,000.00	347,113.08	
GOV OF BELGIUM	250,000.00	223,684.40	
GOV OF BELGIUM	340,000.00	322,486.26	
GOV OF BELGIUM	370,000.00	316,972.34	
GOV OF BELGIUM	110,000.00	132,434.50	
GOV OF BELGIUM	120,000.00	104,004.00	
GOV OF BELGIUM	150,000.00	142,124.10	
GOV OF BELGIUM	160,000.00	176,525.28	
GOV OF BELGIUM	370,000.00	490,868.27	
GOV OF BELGIUM	140,000.00	127,161.86	

GOV OF BELGIUM	180,000.00	173,112.84
GOV OF BELGIUM	150,000.00	108,678.45
GOV OF BELGIUM	310,000.00	397,938.32
GOV OF BELGIUM	170,000.00	210,948.75
GOV OF BELGIUM	210,000.00	179,775.75
GOV OF BELGIUM	200,000.00	172,126.00
GOV OF BELGIUM	150,000.00	116,587.80
GOV OF BELGIUM	90,000.00	86,733.18
GOV OF BELGIUM	150,000.00	140,712.15
GOV OF BELGIUM	100,000.00	51,725.02
GOV OF FINLAND	130,000.00	129,138.10
GOV OF FINLAND	30,000.00	30,663.45
GOV OF FINLAND	130,000.00	127,756.75
GOV OF FINLAND	80,000.00	86,971.52
GOV OF FINLAND	100,000.00	99,556.50
GOV OF FINLAND	130,000.00	127,297.30
GOV OF FINLAND	80,000.00	76,258.16
GOV OF FINLAND	120,000.00	115,375.08
GOV OF FINLAND	70,000.00	75,488.70
GOV OF FINLAND	140,000.00	132,619.48
GOV OF FINLAND	120,000.00	112,189.68
GOV OF FINLAND	120,000.00	106,014.12
GOV OF FINLAND	60,000.00	56,001.00
GOV OF FINLAND	100,000.00	87,353.80
GOV OF FINLAND	20,000.00	19,558.03
GOV OF FINLAND	80,000.00	73,877.20
GOV OF FINLAND	80,000.00	62,653.92
GOV OF FINLAND	70,000.00	50,950.97
GOV OF FINLAND	110,000.00	119,286.09
GOV OF FINLAND	100,000.00	73,405.40
GOV OF FINLAND	70,000.00	61,813.64
GOV OF FINLAND	70,000.00	41,332.97
GOV OF FRANCE	840,000.00	874,532.40
GOV OF FRANCE	460,000.00	455,121.24
GOV OF FRANCE	840,000.00	830,430.72

GOV OF FRANCE	710,000.00	727,623.62	
GOV OF FRANCE	740,000.00	752,995.14	
GOV OF FRANCE	380,000.00	370,158.00	
GOV OF FRANCE	890,000.00	866,342.02	
GOV OF FRANCE	670,000.00	660,040.45	
GOV OF FRANCE	340,000.00	392,057.40	
GOV OF FRANCE	930,000.00	927,389.49	
GOV OF FRANCE	1,040,000.00	1,000,194.00	
GOV OF FRANCE	550,000.00	596,689.50	
GOV OF FRANCE	900,000.00	878,633.10	
GOV OF FRANCE	810,000.00	778,225.32	
GOV OF FRANCE	700,000.00	662,181.80	
GOV OF FRANCE	560,000.00	553,476.00	
GOV OF FRANCE	940,000.00	1,008,881.32	
GOV OF FRANCE	180,000.00	173,980.62	
GOV OF FRANCE	1,020,000.00	986,289.00	
GOV OF FRANCE	1,110,000.00	1,068,086.40	
GOV OF FRANCE	620,000.00	780,488.24	
GOV OF FRANCE	940,000.00	884,754.32	
GOV OF FRANCE	920,000.00	828,226.32	
GOV OF FRANCE	750,000.00	807,345.00	
GOV OF FRANCE	940,000.00	826,231.80	
GOV OF FRANCE	1,060,000.00	1,054,965.00	
GOV OF FRANCE	780,000.00	670,447.44	
GOV OF FRANCE	530,000.00	448,846.40	
GOV OF FRANCE	720,000.00	988,790.40	
GOV OF FRANCE	100,000.00	101,827.40	
GOV OF FRANCE	720,000.00	668,476.80	
GOV OF FRANCE	580,000.00	762,607.20	
GOV OF FRANCE	630,000.00	573,599.25	
GOV OF FRANCE	130,000.00	115,201.32	
GOV OF FRANCE	480,000.00	604,884.00	
GOV OF FRANCE	560,000.00	535,169.04	
GOV OF FRANCE	360,000.00	272,412.54	
GOV OF FRANCE	730,000.00	986,611.06	

GOV OF FRANCE	280,000.00	196,822.64	
GOV OF FRANCE	520,000.00	612,424.80	
GOV OF FRANCE	530,000.00	503,013.46	
GOV OF FRANCE	590,000.00	498,390.70	
GOV OF FRANCE	600,000.00	404,538.00	
GOV OF FRANCE	390,000.00	256,809.54	
GOV OF FRANCE	370,000.00	508,431.06	
GOV OF FRANCE	290,000.00	408,401.20	
GOV OF FRANCE	260,000.00	221,443.30	
GOV OF FRANCE	170,000.00	83,412.71	
GOV OF GERMANY	480,000.00	486,529.44	
GOV OF GERMANY	370,000.00	367,791.10	
GOV OF GERMANY	410,000.00	407,407.16	
GOV OF GERMANY	370,000.00	367,484.37	
GOV OF GERMANY	440,000.00	447,816.16	
GOV OF GERMANY	260,000.00	257,638.03	
GOV OF GERMANY	370,000.00	366,518.73	
GOV OF GERMANY	410,000.00	416,229.13	
GOV OF GERMANY	290,000.00	287,340.41	
GOV OF GERMANY	480,000.00	482,520.00	
GOV OF GERMANY	440,000.00	432,750.56	
GOV OF GERMANY	320,000.00	317,837.44	
GOV OF GERMANY	370,000.00	362,343.08	
GOV OF GERMANY	490,000.00	492,539.67	
GOV OF GERMANY	510,000.00	496,958.28	
GOV OF GERMANY	630,000.00	622,841.94	
GOV OF GERMANY	470,000.00	455,841.72	
GOV OF GERMANY	530,000.00	512,104.55	
GOV OF GERMANY	380,000.00	365,727.96	
GOV OF GERMANY	660,000.00	641,609.10	
GOV OF GERMANY	280,000.00	268,136.40	
GOV OF GERMANY	140,000.00	176,386.14	
GOV OF GERMANY	550,000.00	538,272.90	
GOV OF GERMANY	120,000.00	121,575.96	
GOV OF GERMANY	550,000.00	522,761.25	

GOV OF GERMANY	170,000.00	210,856.78	
GOV OF GERMANY	510,000.00	496,627.80	
GOV OF GERMANY	190,000.00	230,222.43	
GOV OF GERMANY	550,000.00	525,643.25	
GOV OF GERMANY	380,000.00	356,997.84	
GOV OF GERMANY	530,000.00	504,776.24	
GOV OF GERMANY	570,000.00	530,920.23	
GOV OF GERMANY	210,000.00	287,542.29	
GOV OF GERMANY	450,000.00	416,439.00	
GOV OF GERMANY	440,000.00	404,185.32	
GOV OF GERMANY	170,000.00	156,250.40	
GOV OF GERMANY	370,000.00	500,810.54	
GOV OF GERMANY	460,000.00	419,624.88	
GOV OF GERMANY	800,000.00	724,008.00	
GOV OF GERMANY	420,000.00	376,248.60	
GOV OF GERMANY	390,000.00	541,399.56	
GOV OF GERMANY	390,000.00	329,581.20	
GOV OF GERMANY	420,000.00	349,210.68	
GOV OF GERMANY	540,000.00	725,066.64	
GOV OF GERMANY	110,000.00	103,817.23	
GOV OF GERMANY	340,000.00	484,958.32	
GOV OF GERMANY	370,000.00	564,552.29	
GOV OF GERMANY	380,000.00	504,016.80	
GOV OF GERMANY	460,000.00	556,717.76	
GOV OF GERMANY	600,000.00	737,323.20	
GOV OF GERMANY	520,000.00	504,601.24	
GOV OF GERMANY	640,000.00	434,485.54	
GOV OF GERMANY	130,000.00	88,553.79	
GOV OF GERMANY	290,000.00	191,046.49	
GOV OF IRELAND	130,000.00	135,220.11	
GOV OF IRELAND	200,000.00	221,934.52	
GOV OF IRELAND	170,000.00	169,250.81	
GOV OF IRELAND	160,000.00	152,196.54	
GOV OF IRELAND	150,000.00	145,855.80	
GOV OF IRELAND	200,000.00	195,153.94	

GOV OF IRELAND	160,000.00	170,513.12	
GOV OF IRELAND	150,000.00	133,925.40	
GOV OF IRELAND	120,000.00	117,722.64	
GOV OF IRELAND	160,000.00	136,663.52	
GOV OF IRELAND	50,000.00	43,211.70	
GOV OF IRELAND	110,000.00	103,843.30	
GOV OF IRELAND	90,000.00	74,142.45	
GOV OF IRELAND	130,000.00	124,870.85	
GOV OF IRELAND	80,000.00	60,128.16	
GOV OF IRELAND	190,000.00	182,425.46	
GOV OF IRELAND	110,000.00	91,880.03	
GOV OF ITALY	340,000.00	351,418.56	
GOV OF ITALY	290,000.00	287,601.03	
GOV OF ITALY	340,000.00	344,705.94	
GOV OF ITALY	490,000.00	487,061.47	
GOV OF ITALY	210,000.00	206,440.71	
GOV OF ITALY	460,000.00	450,783.57	
GOV OF ITALY	450,000.00	440,814.60	
GOV OF ITALY	200,000.00	209,084.12	
GOV OF ITALY	400,000.00	389,827.60	
GOV OF ITALY	330,000.00	331,159.29	
GOV OF ITALY	260,000.00	260,225.94	
GOV OF ITALY	250,000.00	241,579.57	
GOV OF ITALY	270,000.00	280,569.69	
GOV OF ITALY	330,000.00	326,918.06	
GOV OF ITALY	550,000.00	557,503.10	
GOV OF ITALY	170,000.00	162,579.55	
GOV OF ITALY	440,000.00	423,533.26	
GOV OF ITALY	370,000.00	397,816.23	
GOV OF ITALY	350,000.00	343,952.38	
GOV OF ITALY	220,000.00	216,718.48	
GOV OF ITALY	340,000.00	337,318.76	
GOV OF ITALY	120,000.00	116,502.72	
GOV OF ITALY	310,000.00	312,562.15	
GOV OF ITALY	400,000.00	397,735.20	

GOV OF ITALY	380,000.00	357,668.92	
GOV OF ITALY	530,000.00	571,152.38	
GOV OF ITALY	150,000.00	137,776.35	
GOV OF ITALY	440,000.00	428,543.28	
GOV OF ITALY	370,000.00	366,237.10	
GOV OF ITALY	430,000.00	391,271.62	
GOV OF ITALY	400,000.00	381,096.80	
GOV OF ITALY	360,000.00	335,716.92	
GOV OF ITALY	280,000.00	261,985.64	
GOV OF ITALY	400,000.00	393,340.96	
GOV OF ITALY	410,000.00	399,358.04	
GOV OF ITALY	270,000.00	248,716.11	
GOV OF ITALY	450,000.00	536,473.80	
GOV OF ITALY	500,000.00	482,662.00	
GOV OF ITALY	400,000.00	348,269.60	
GOV OF ITALY	420,000.00	367,451.70	
GOV OF ITALY	350,000.00	386,997.80	
GOV OF ITALY	440,000.00	439,510.50	
GOV OF ITALY	360,000.00	307,343.52	
GOV OF ITALY	100,000.00	98,623.20	
GOV OF ITALY	490,000.00	491,244.11	
GOV OF ITALY	480,000.00	552,811.20	
GOV OF ITALY	510,000.00	527,602.65	
GOV OF ITALY	360,000.00	318,175.92	
GOV OF ITALY	350,000.00	296,205.00	
GOV OF ITALY	430,000.00	382,466.68	
GOV OF ITALY	520,000.00	429,255.84	
GOV OF ITALY	400,000.00	485,430.80	
GOV OF ITALY	390,000.00	309,398.70	
GOV OF ITALY	370,000.00	300,683.09	
GOV OF ITALY	440,000.00	381,654.24	
GOV OF ITALY	340,000.00	272,443.36	
GOV OF ITALY	190,000.00	174,401.19	
GOV OF ITALY	340,000.00	409,672.46	
GOV OF ITALY	350,000.00	318,625.30	

GOV OF ITALY	430,000.00	493,891.55	
GOV OF ITALY	260,000.00	255,924.70	
GOV OF ITALY	280,000.00	219,552.76	
GOV OF ITALY	320,000.00	276,602.88	
GOV OF ITALY	510,000.00	539,098.05	
GOV OF ITALY	310,000.00	220,854.54	
GOV OF ITALY	60,000.00	57,385.02	
GOV OF ITALY	320,000.00	296,134.40	
GOV OF ITALY	400,000.00	472,117.60	
GOV OF ITALY	280,000.00	260,954.40	
GOV OF ITALY	380,000.00	448,291.70	
GOV OF ITALY	290,000.00	219,339.76	
GOV OF ITALY	340,000.00	396,936.74	
GOV OF ITALY	250,000.00	169,482.50	
GOV OF ITALY	280,000.00	264,140.80	
GOV OF ITALY	310,000.00	264,758.41	
GOV OF ITALY	340,000.00	329,141.76	
GOV OF ITALY	230,000.00	236,081.66	
GOV OF ITALY	280,000.00	221,856.88	
GOV OF ITALY	310,000.00	207,413.62	
GOV OF ITALY	120,000.00	87,108.14	
GOV OF ITALY	140,000.00	114,723.00	
GOV OF ITALY	90,000.00	62,539.31	
GOV OF NETHERLANDS	280,000.00	277,443.32	
GOV OF NETHERLANDS	290,000.00	296,553.50	
GOV OF NETHERLANDS	420,000.00	411,547.92	
GOV OF NETHERLANDS	80,000.00	77,174.57	
GOV OF NETHERLANDS	360,000.00	352,251.72	
GOV OF NETHERLANDS	280,000.00	266,433.44	
GOV OF NETHERLANDS	300,000.00	294,277.50	
GOV OF NETHERLANDS	210,000.00	256,895.52	
GOV OF NETHERLANDS	330,000.00	320,831.28	
GOV OF NETHERLANDS	160,000.00	147,124.48	
GOV OF NETHERLANDS	210,000.00	195,427.68	
GOV OF NETHERLANDS	260,000.00	234,168.48	

GOV OF NETHERLANDS	270,000.00	238,606.83
GOV OF NETHERLANDS	120,000.00	108,798.36
GOV OF NETHERLANDS	250,000.00	272,366.75
GOV OF NETHERLANDS	330,000.00	425,558.43
GOV OF NETHERLANDS	180,000.00	138,090.38
GOV OF NETHERLANDS	260,000.00	212,625.14
GOV OF NETHERLANDS	330,000.00	438,354.18
GOV OF NETHERLANDS	370,000.00	446,652.16
GOV OF NETHERLANDS	240,000.00	145,281.84
GOV OF SPAIN	320,000.00	333,206.40
GOV OF SPAIN	290,000.00	305,856.91
GOV OF SPAIN	400,000.00	418,454.40
GOV OF SPAIN	370,000.00	363,329.47
GOV OF SPAIN	390,000.00	383,632.97
GOV OF SPAIN	390,000.00	403,923.78
GOV OF SPAIN	370,000.00	359,172.32
GOV OF SPAIN	470,000.00	474,623.06
GOV OF SPAIN	170,000.00	163,893.95
GOV OF SPAIN	340,000.00	373,795.21
GOV OF SPAIN	480,000.00	493,168.80
GOV OF SPAIN	410,000.00	390,350.75
GOV OF SPAIN	420,000.00	427,759.08
GOV OF SPAIN	360,000.00	421,929.00
GOV OF SPAIN	500,000.00	496,767.50
GOV OF SPAIN	290,000.00	269,815.56
GOV OF SPAIN	460,000.00	457,942.88
GOV OF SPAIN	380,000.00	364,535.52
GOV OF SPAIN	440,000.00	435,380.00
GOV OF SPAIN	200,000.00	182,146.20
GOV OF SPAIN	450,000.00	441,981.45
GOV OF SPAIN	430,000.00	421,073.63
GOV OF SPAIN	360,000.00	430,143.84
GOV OF SPAIN	410,000.00	514,889.07
GOV OF SPAIN	460,000.00	448,450.78
GOV OF SPAIN	110,000.00	101,885.74

	GOV OF SPAIN	430,000.00	392,183.00	
	GOV OF SPAIN	420,000.00	376,000.80	
	GOV OF SPAIN	410,000.00	407,916.38	
	GOV OF SPAIN	400,000.00	375,932.80	
	GOV OF SPAIN	440,000.00	369,613.42	
	GOV OF SPAIN	410,000.00	352,341.90	
	GOV OF SPAIN	410,000.00	354,045.25	
	GOV OF SPAIN	390,000.00	512,962.71	
	GOV OF SPAIN	180,000.00	182,682.54	
	GOV OF SPAIN	440,000.00	439,357.60	
	GOV OF SPAIN	420,000.00	388,965.36	
	GOV OF SPAIN	360,000.00	430,592.40	
	GOV OF SPAIN	230,000.00	178,126.14	
	GOV OF SPAIN	350,000.00	459,885.30	
	GOV OF SPAIN	290,000.00	225,230.24	
	GOV OF SPAIN	400,000.00	517,101.96	
	GOV OF SPAIN	60,000.00	43,999.08	
	GOV OF SPAIN	270,000.00	375,833.52	
	GOV OF SPAIN	360,000.00	365,151.60	
	GOV OF SPAIN	300,000.00	291,460.80	
	GOV OF SPAIN	370,000.00	236,184.32	
	GOV OF SPAIN	140,000.00	109,320.12	
	GOV OF SPAIN	270,000.00	288,209.34	
	GOV OF SPAIN	100,000.00	58,395.90	
	ユーロ 小計	118,544,000.00	117,741,701.23 (16,195,371,004)	
英bond	UK TREASURY	290,000.00	288,959.48	
	UK TREASURY	570,000.00	550,021.50	
	UK TREASURY	250,000.00	243,845.20	
	UK TREASURY	210,000.00	211,186.50	
	UK TREASURY	410,000.00	388,060.90	
	UK TREASURY	250,000.00	265,724.50	
	UK TREASURY	240,000.00	229,428.00	
	UK TREASURY	250,000.00	247,808.75	
	UK TREASURY	240,000.00	222,881.18	

UK TREASURY	250,000.00	242,350.00
UK TREASURY	340,000.00	313,432.40
UK TREASURY	280,000.00	266,774.48
UK TREASURY	280,000.00	306,275.20
UK TREASURY	230,000.00	205,086.30
UK TREASURY	240,000.00	231,730.08
UK TREASURY	140,000.00	170,266.88
UK TREASURY	220,000.00	196,127.69
UK TREASURY	260,000.00	236,015.00
UK TREASURY	230,000.00	196,888.69
UK TREASURY	280,000.00	331,398.48
UK TREASURY	470,000.00	389,222.04
UK TREASURY	260,000.00	228,144.80
UK TREASURY	350,000.00	405,773.20
UK TREASURY	180,000.00	151,573.17
UK TREASURY	220,000.00	262,837.52
UK TREASURY	390,000.00	301,641.60
UK TREASURY	270,000.00	318,047.58
UK TREASURY	330,000.00	289,372.90
UK TREASURY	280,000.00	354,079.60
UK TREASURY	240,000.00	187,617.12
UK TREASURY	210,000.00	251,987.40
UK TREASURY	240,000.00	290,035.20
UK TREASURY	440,000.00	339,723.91
UK TREASURY	340,000.00	428,833.70
UK TREASURY	280,000.00	299,834.10
UK TREASURY	360,000.00	400,757.68
UK TREASURY	210,000.00	141,509.34
UK TREASURY	300,000.00	375,993.60
UK TREASURY	340,000.00	262,979.80
UK TREASURY	210,000.00	171,210.90
UK TREASURY	210,000.00	269,612.70
UK TREASURY	180,000.00	106,809.12
UK TREASURY	260,000.00	184,116.92
UK TREASURY	240,000.00	290,973.60

	UK TREASURY	80,000.00	60,199.98
	UK TREASURY	240,000.00	185,958.24
	UK TREASURY	300,000.00	405,042.00
	UK TREASURY	320,000.00	257,184.00
	UK TREASURY	220,000.00	293,057.60
	UK TREASURY	260,000.00	129,324.00
	UK TREASURY	250,000.00	247,690.00
	UK TREASURY	280,000.00	351,050.00
	UK TREASURY	240,000.00	179,654.40
	UK TREASURY	170,000.00	103,573.52
	英ポンド 小計	14,630,000.00	14,259,682.45 (2,311,209,331)
スウェーデンクローナ	GOV OF SWEDEN	1,940,000.00	1,931,993.22
	GOV OF SWEDEN	1,250,000.00	1,267,554.37
	GOV OF SWEDEN	1,470,000.00	1,421,656.40
	GOV OF SWEDEN	1,060,000.00	1,006,204.57
	GOV OF SWEDEN	1,200,000.00	1,127,235.83
	GOV OF SWEDEN	930,000.00	819,915.43
	GOV OF SWEDEN	790,000.00	838,288.75
	GOV OF SWEDEN	780,000.00	1,001,376.09
	スウェーデンクローナ 小計	9,420,000.00	9,414,224.66 (121,914,209)
ノルウェークローネ	GOV OF NORWAY	1,210,000.00	1,204,229.51
	GOV OF NORWAY	1,040,000.00	1,000,194.00
	GOV OF NORWAY	930,000.00	876,599.40
	GOV OF NORWAY	750,000.00	706,104.30
	GOV OF NORWAY	720,000.00	678,487.68
	GOV OF NORWAY	890,000.00	817,488.14
	GOV OF NORWAY	1,060,000.00	936,292.70
	GOV OF NORWAY	640,000.00	551,996.16
	GOV OF NORWAY	540,000.00	497,934.00
	ノルウェークローネ 小計	7,780,000.00	7,269,325.89 (101,407,096)
デンマーククローネ	GOV OF DENMARK	960,000.00	968,398.08
	GOV OF DENMARK	850,000.00	830,747.50
	GOV OF DENMARK	860,000.00	876,727.00

	GOV OF DENMARK	1,160,000.00	1,112,035.85	
	GOV OF DENMARK	1,240,000.00	1,161,111.20	
	GOV OF DENMARK	1,170,000.00	1,015,295.44	
	GOV OF DENMARK	2,200,000.00	3,096,710.75	
	GOV OF DENMARK	910,000.00	605,559.50	
	デンマーククローネ 小計	9,350,000.00	9,666,585.32 (178,831,828)	
ポーランドズロチ	GOV OF POLAND	460,000.00	446,972.80	
	GOV OF POLAND	520,000.00	487,032.00	
	GOV OF POLAND	60,000.00	53,030.92	
	GOV OF POLAND	740,000.00	675,435.00	
	GOV OF POLAND	570,000.00	492,565.50	
	GOV OF POLAND	760,000.00	695,058.00	
	GOV OF POLAND	840,000.00	732,312.00	
	GOV OF POLAND	570,000.00	447,079.50	
	GOV OF POLAND	230,000.00	206,381.30	
	GOV OF POLAND	610,000.00	513,955.50	
	GOV OF POLAND	590,000.00	498,172.40	
	GOV OF POLAND	190,000.00	187,872.00	
	GOV OF POLAND	820,000.00	667,726.00	
	GOV OF POLAND	620,000.00	436,356.00	
	GOV OF POLAND	340,000.00	236,640.00	
	ポーランドズロチ 小計	7,920,000.00	6,776,588.92 (196,319,813)	
オーストラリアドル	GOV OF AUSTRALIA	280,000.00	279,429.22	
	GOV OF AUSTRALIA	520,000.00	489,249.94	
	GOV OF AUSTRALIA	330,000.00	331,315.28	
	GOV OF AUSTRALIA	310,000.00	282,553.15	
	GOV OF AUSTRALIA	380,000.00	394,269.41	
	GOV OF AUSTRALIA	420,000.00	377,280.87	
	GOV OF AUSTRALIA	330,000.00	352,263.48	
	GOV OF AUSTRALIA	330,000.00	322,624.73	
	GOV OF AUSTRALIA	230,000.00	218,229.88	
	GOV OF AUSTRALIA	200,000.00	194,299.84	
	GOV OF AUSTRALIA	290,000.00	289,567.52	

	GOV OF AUSTRALIA	330,000.00	318,258.23
	GOV OF AUSTRALIA	410,000.00	386,959.88
	GOV OF AUSTRALIA	310,000.00	257,133.43
	GOV OF AUSTRALIA	450,000.00	385,674.34
	GOV OF AUSTRALIA	590,000.00	478,596.79
	GOV OF AUSTRALIA	500,000.00	411,278.20
	GOV OF AUSTRALIA	350,000.00	299,885.52
	GOV OF AUSTRALIA	340,000.00	372,395.23
	GOV OF AUSTRALIA	240,000.00	229,804.24
	GOV OF AUSTRALIA	190,000.00	174,473.69
	GOV OF AUSTRALIA	220,000.00	222,978.18
	GOV OF AUSTRALIA	190,000.00	179,145.62
	GOV OF AUSTRALIA	240,000.00	207,405.96
	GOV OF AUSTRALIA	240,000.00	209,892.79
	GOV OF AUSTRALIA	330,000.00	213,459.73
	オーストラリアドル 小計	8,550,000.00	7,878,425.15 (743,486,981)
シンガポールドル	GOV OF SINGAPORE	170,000.00	168,371.19
	GOV OF SINGAPORE	140,000.00	141,057.00
	GOV OF SINGAPORE	130,000.00	129,323.22
	GOV OF SINGAPORE	120,000.00	112,368.00
	GOV OF SINGAPORE	120,000.00	118,056.00
	GOV OF SINGAPORE	110,000.00	104,071.00
	GOV OF SINGAPORE	120,000.00	124,401.60
	GOV OF SINGAPORE	110,000.00	109,868.00
	GOV OF SINGAPORE	120,000.00	121,320.00
	GOV OF SINGAPORE	180,000.00	182,088.00
	GOV OF SINGAPORE	120,000.00	109,783.11
	GOV OF SINGAPORE	110,000.00	116,435.00
	GOV OF SINGAPORE	160,000.00	149,987.20
	GOV OF SINGAPORE	10,000.00	9,375.00
	GOV OF SINGAPORE	110,000.00	107,544.80
	GOV OF SINGAPORE	110,000.00	106,370.00
	GOV OF SINGAPORE	120,000.00	96,120.00
	GOV OF SINGAPORE	60,000.00	47,914.80

	シンガポールドル 小計	2,120,000.00	2,054,453.92 (202,219,899)
マレーシアリングット	GOV OF MALAYSIA	240,000.00	242,241.84
	GOV OF MALAYSIA	260,000.00	261,043.66
	GOV OF MALAYSIA	270,000.00	274,460.04
	GOV OF MALAYSIA	240,000.00	243,694.80
	GOV OF MALAYSIA	100,000.00	101,159.49
	GOV OF MALAYSIA	520,000.00	528,285.42
	GOV OF MALAYSIA	210,000.00	216,088.40
	GOV OF MALAYSIA	280,000.00	283,145.07
	GOV OF MALAYSIA	290,000.00	292,373.07
	GOV OF MALAYSIA	270,000.00	267,544.45
	GOV OF MALAYSIA	620,000.00	624,769.84
	GOV OF MALAYSIA	80,000.00	79,689.18
	GOV OF MALAYSIA	160,000.00	165,640.88
	GOV OF MALAYSIA	470,000.00	469,374.47
	GOV OF MALAYSIA	250,000.00	259,416.45
	GOV OF MALAYSIA	430,000.00	387,059.08
	GOV OF MALAYSIA	210,000.00	213,394.14
	GOV OF MALAYSIA	190,000.00	185,509.29
	GOV OF MALAYSIA	280,000.00	292,288.05
	GOV OF MALAYSIA	420,000.00	405,881.07
	GOV OF MALAYSIA	220,000.00	220,720.50
	GOV OF MALAYSIA	330,000.00	349,735.02
	GOV OF MALAYSIA	150,000.00	159,189.46
	GOV OF MALAYSIA	500,000.00	460,913.35
	GOV OF MALAYSIA	180,000.00	187,185.80
	GOV OF MALAYSIA	140,000.00	148,874.71
	GOV OF MALAYSIA	180,000.00	185,585.70
	GOV OF MALAYSIA	250,000.00	263,172.30
GOV OF MALAYSIA	460,000.00	423,944.28	
	マレーシアリングット 小計	8,200,000.00	8,192,379.81 (250,640,944)
中国元	GOV OF CHINA	2,560,000.00	2,580,300.80
	GOV OF CHINA	1,240,000.00	1,254,631.38

	GOV OF CHINA	4,260,000.00	4,280,277.60
	GOV OF CHINA	3,270,000.00	3,314,390.25
	GOV OF CHINA	1,560,000.00	1,563,478.80
	GOV OF CHINA	1,320,000.00	1,330,125.45
	GOV OF CHINA	1,200,000.00	1,202,466.00
	GOV OF CHINA	1,580,000.00	1,570,701.38
	GOV OF CHINA	1,140,000.00	1,141,305.30
	GOV OF CHINA	3,540,000.00	3,622,818.30
	GOV OF CHINA	2,680,000.00	2,747,318.11
	GOV OF CHINA	1,900,000.00	1,924,937.50
	GOV OF CHINA	2,990,000.00	2,990,420.39
	GOV OF CHINA	2,440,000.00	2,452,248.31
	GOV OF CHINA	1,410,000.00	1,440,474.18
	GOV OF CHINA	2,080,000.00	2,168,828.06
	GOV OF CHINA	1,500,000.00	1,541,827.50
	GOV OF CHINA	2,860,000.00	2,918,143.80
	GOV OF CHINA	2,250,000.00	2,282,665.72
	GOV OF CHINA	1,520,000.00	1,535,177.20
	GOV OF CHINA	2,840,000.00	2,843,752.20
	GOV OF CHINA	2,140,000.00	2,239,626.41
	GOV OF CHINA	1,790,000.00	1,837,211.25
	GOV OF CHINA	1,200,000.00	1,219,980.00
	GOV OF CHINA	1,100,000.00	1,107,786.57
	GOV OF CHINA	740,000.00	860,266.35
	GOV OF CHINA	860,000.00	965,123.13
	GOV OF CHINA	1,950,000.00	2,180,527.83
	GOV OF CHINA	1,240,000.00	1,367,196.84
	GOV OF CHINA	1,780,000.00	1,916,152.20
	中国元 小計	58,940,000.00	60,400,158.81 (1,215,196,835)
イスラエルシュケル	GOV OF ISRAEL	240,000.00	235,992.00
	GOV OF ISRAEL	310,000.00	311,178.00
	GOV OF ISRAEL	390,000.00	404,956.50
	GOV OF ISRAEL	250,000.00	240,887.50
	GOV OF ISRAEL	430,000.00	411,058.50
	GOV OF ISRAEL	280,000.00	280,224.00

	GOV OF ISRAEL	190,000.00	179,531.00	
	GOV OF ISRAEL	260,000.00	313,092.00	
	GOV OF ISRAEL	380,000.00	377,131.00	
	GOV OF ISRAEL	390,000.00	396,084.00	
	GOV OF ISRAEL	490,000.00	443,670.50	
	GOV OF ISRAEL	350,000.00	293,370.00	
	GOV OF ISRAEL	340,000.00	472,056.00	
	GOV OF ISRAEL	430,000.00	475,988.50	
	イスラエルシュケル 小計	4,730,000.00	4,835,219.50	(202,966,074)
	合計		47,468,921,748	(47,468,921,748)

(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 257銘柄	100.0%	51.3%
カナダドル	国債証券 38銘柄	100.0%	2.1%
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 352銘柄	100.0%	34.1%
英ポンド	国債証券 54銘柄	100.0%	4.9%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券 9銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.4%
ポーランドズロチ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.4%
オーストラリアドル	国債証券 26銘柄	100.0%	1.6%
シンガポールドル	国債証券 18銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券 29銘柄	100.0%	0.5%
中国元	国債証券 30銘柄	100.0%	2.6%
イスラエルシュケル	国債証券 14銘柄	100.0%	0.4%

(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。

R M新興国債券マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）	
2022年 8月22日現在	
資産の部	
流動資産	
預金	4,847,643
コール・ローン	6,443,568
投資信託受益証券	9,363,734,984
流動資産合計	9,375,026,195
資産合計	9,375,026,195
負債の部	
流動負債	
未払利息	17
流動負債合計	17
負債合計	17
純資産の部	
元本等	
元本	8,384,271,906
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	990,754,272
元本等合計	9,375,026,178
純資産合計	9,375,026,178
負債純資産合計	9,375,026,195

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	為替予約取引

法	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 8月22日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 8月21日
期首元本額	5,877,873,742円
期中追加設定元本額	4,647,040,484円
期中一部解約元本額	2,140,642,320円
期末元本額	8,384,271,906円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	969,135,873円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	974,814,164円
りそなラップ型ファンド(成長型)	571,092,891円
DCりそな グローバルバランス	21,901,059円
つみたてバランスファンド	1,121,503,200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	181,420,578円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	124,977,432円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	53,471,507円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	35,345,108円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	19,006,933円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	35,717,743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	24,698,587円
FWりそな新興国債券インデックスファンド	3,281,317,752円
Smart-i 8資産バランス 安定型	59,895,013円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	183,847,741円
Smart-i 8資産バランス 成長型	220,695,228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)	1,289,986円

りそなV I グローバル・バランスファンド(安定成長型)(適格機関投資家専用)	6,528,557円
りそなV I グローバル・バランスファンド(成長型)(適格機関投資家専用)	19,153,293円
りそなD A A マルチアセットファンド(適格機関投資家専用)	16,198,723円
2. 計算日における受益権の総数	8,384,271,906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	1.1182円
(10,000口当たり純資産額)	(11,182円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2022年 8月22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。

金融商品の時価等に関する事項

2022年 8月22日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。
2. 時価の算定方法	投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額 が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

2022年 8月22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 8月22日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
投資信託受益証券		1,444,780,856
合計		1,444,780,856

(注) 損益に含まれた評価差額は、親投資信託受益証券の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

2 デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	米ドル	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	1,262,747	53,344,747.01	
		VANECK J.P.MORGAN EM LOCAL	616,232	14,918,976.72	
		米ドル 小計	1,878,979	68,263,723.73 (9,363,734,984)	
合計				9,363,734,984 (9,363,734,984)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

外貨建有価証券の内訳

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

(注)時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

RM国内株式ESGマザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2022年 8月22日現在

資産の部
流動資産

2022年 8月22日現在

コール・ローン	231,021,949
株式	2,254,788,120
投資証券	37,948,400
派生商品評価勘定	7,618,200
未収配当金	3,057,522
差入委託証拠金	8,910,000
流動資産合計	2,543,344,191
資産合計	2,543,344,191
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	43,080
前受金	8,395,350
未払解約金	26,560,000
未払利息	626
流動負債合計	34,999,056
負債合計	34,999,056
純資産の部	
元本等	
元本	1,936,936,330
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	571,408,805
元本等合計	2,508,345,135
純資産合計	2,508,345,135
負債純資産合計	2,543,344,191

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 8月22日現在

1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 8月21日
期首元本額	1,729,267,860円
期中追加設定元本額	1,278,213,709円
期中一部解約元本額	1,070,545,239円
期末元本額	1,936,936,330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	46,954,383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	551,366,205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）	848,373,390円
2. 計算日における受益権の総数	1,936,936,330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	1.2950円
(10,000口当たり純資産額)	(12,950円)

（注） は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

2022年 8月22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。

金融商品の時価等に関する事項

2022年 8月22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 8月22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 8月22日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式	29,640,404	
投資証券	256,434	
合計	29,896,838	

(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 8月22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	207,128,880	-	214,704,000	7,575,120
	合計	207,128,880	-	214,704,000	7,575,120

(注) 時価の算定方法

先物取引

国内先物取引について

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

(単位：円)

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
マルハニチロ	200	2,532.00	506,400	
I N P E X	8,300	1,538.00	12,765,400	
コムシスホールディングス	400	2,643.00	1,057,200	
大成建設	800	4,100.00	3,280,000	
大林組	5,200	964.00	5,012,800	
清水建設	4,400	766.00	3,370,400	
鹿島建設	1,700	1,480.00	2,516,000	
戸田建設	800	703.00	562,400	
住友林業	1,100	2,436.00	2,679,600	
大和ハウス工業	4,800	3,215.00	15,432,000	
積水ハウス	4,900	2,384.00	11,681,600	
エクシオグループ	400	2,157.00	862,800	
三機工業	200	1,633.00	326,600	
高砂熱学工業	400	1,680.00	672,000	
大気社	100	3,315.00	331,500	
千代田化工建設	600	396.00	237,600	
明治ホールディングス	500	6,790.00	3,395,000	
サッポロホールディングス	500	3,085.00	1,542,500	

アサヒグループホールディングス	3,600	4,803.00	17,290,800	
キリンホールディングス	6,500	2,262.00	14,703,000	
サントリー食品インターナショナル	1,100	5,160.00	5,676,000	
伊藤園	200	6,240.00	1,248,000	
不二製油グループ本社	300	2,409.00	722,700	
キッコーマン	1,200	8,950.00	10,740,000	
味の素	3,700	3,774.00	13,963,800	
キューピー	700	2,306.00	1,614,200	
ハウス食品グループ本社	500	2,978.00	1,489,000	
カゴメ	300	3,165.00	949,500	
ニチレイ	900	2,526.00	2,273,400	
日清食品ホールディングス	500	10,070.00	5,035,000	
片倉工業	100	2,036.00	203,600	
東洋紡	600	1,052.00	631,200	
帝人	1,400	1,471.00	2,059,400	
東レ	11,000	778.40	8,562,400	
日本製紙	400	919.00	367,600	
レンゴー	800	822.00	657,600	
クラレ	2,500	1,076.00	2,690,000	
旭化成	10,000	1,035.00	10,350,000	
住友化学	11,900	561.00	6,675,900	
東ソー	1,000	1,798.00	1,798,000	
デンカ	300	3,305.00	991,500	
信越化学工業	1,500	17,125.00	25,687,500	
カネカ	400	3,665.00	1,466,000	
三井化学	1,500	2,996.00	4,494,000	
J S R	700	3,250.00	2,275,000	
東京応化工業	300	7,090.00	2,127,000	
三菱ケミカルグループ	10,200	740.60	7,554,120	
ダイセル	2,100	868.00	1,822,800	
積水化学工業	3,000	1,948.00	5,844,000	
U B E	400	2,074.00	829,600	
日本化薬	500	1,245.00	622,500	
花王	3,800	6,199.00	23,556,200	
日本ペイントホールディングス	3,300	1,083.00	3,573,900	
関西ペイント	1,400	2,184.00	3,057,600	

D I C	600	2,493.00	1,495,800	
東洋インキSCホールディングス	100	1,928.00	192,800	
富士フイルムホールディングス	2,900	7,476.00	21,680,400	
資生堂	1,600	5,432.00	8,691,200	
ライオン	900	1,606.00	1,445,400	
小林製薬	200	8,260.00	1,652,000	
デクセリアルズ	200	4,050.00	810,000	
日東電工	1,100	8,960.00	9,856,000	
信越ポリマー	200	1,379.00	275,800	
ニフコ	600	3,295.00	1,977,000	
ユニ・チャーム	3,200	4,939.00	15,804,800	
協和キリン	1,100	3,105.00	3,415,500	
アステラス製薬	14,800	2,041.50	30,214,200	
住友ファーマ	700	1,068.00	747,600	
塩野義製薬	2,100	6,988.00	14,674,800	
中外製薬	5,300	3,820.00	20,246,000	
エーザイ	2,000	5,824.00	11,648,000	
小野薬品工業	1,500	3,447.00	5,170,500	
持田製薬	100	3,445.00	344,500	
参天製薬	2,900	1,025.00	2,972,500	
第一三共	14,000	4,074.00	57,036,000	
E N E O Sホールディングス	24,400	524.90	12,807,560	
ブリヂストン	2,300	5,460.00	12,558,000	
住友理工	100	586.00	58,600	
太平洋セメント	500	2,071.00	1,035,500	
T O T O	1,100	4,865.00	5,351,500	
日本碍子	1,900	1,966.00	3,735,400	
日本特殊陶業	1,200	2,899.00	3,478,800	
ニチアス	200	2,400.00	480,000	
日本製鉄	3,200	2,143.00	6,857,600	
神戸製鋼所	1,300	611.00	794,300	
J F Eホールディングス	2,000	1,485.00	2,970,000	
日立金属	1,700	1,996.00	3,393,200	
日本軽金属ホールディングス	400	1,615.00	646,000	
三菱マテリアル	900	2,095.00	1,885,500	
住友金属鉱山	2,000	4,417.00	8,834,000	

DOWAホールディングス	400	5,190.00	2,076,000	
UACJ	100	2,644.00	264,400	
三浦工業	700	3,115.00	2,180,500	
タクマ	200	1,414.00	282,800	
ナブテスコ	900	3,495.00	3,145,500	
サトーホールディングス	100	1,957.00	195,700	
小松製作所	7,400	2,893.00	21,408,200	
日立建機	900	2,995.00	2,695,500	
クボタ	8,100	2,252.50	18,245,250	
荏原製作所	700	5,500.00	3,850,000	
ダイキン工業	2,000	25,135.00	50,270,000	
栗田工業	800	5,650.00	4,520,000	
ダイフク	800	8,550.00	6,840,000	
グローリー	400	2,202.00	880,800	
セガサミーホールディングス	1,400	2,136.00	2,990,400	
ホシザキ	400	4,200.00	1,680,000	
NTN	1,600	273.00	436,800	
日立造船	1,300	856.00	1,112,800	
三菱重工業	1,300	4,957.00	6,444,100	
日清紡ホールディングス	1,100	1,073.00	1,180,300	
イビデン	900	4,580.00	4,122,000	
コニカミノルタ	3,600	483.00	1,738,800	
日立製作所	7,700	6,999.00	53,892,300	
三菱電機	7,700	1,435.50	11,053,350	
安川電機	1,900	4,765.00	9,053,500	
明電舎	100	1,996.00	199,600	
東芝テック	100	4,435.00	443,500	
オムロン	1,500	7,633.00	11,449,500	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	300	2,529.00	758,700	
日本電気	1,000	4,975.00	4,975,000	
富士通	1,600	17,000.00	27,200,000	
セイコーエプソン	1,100	2,204.00	2,424,400	
アルバック	200	5,450.00	1,090,000	
パナソニック ホールディングス	17,600	1,149.00	20,222,400	
アンリツ	600	1,665.00	999,000	
ソニーグループ	10,000	11,930.00	119,300,000	

T D K	3,100	4,965.00	15,391,500	
アルプスアルパイン	800	1,281.00	1,024,800	
ヒロセ電機	100	20,040.00	2,004,000	
日本航空電子工業	400	2,358.00	943,200	
横河電機	1,800	2,413.00	4,343,400	
アズビル	900	4,035.00	3,631,500	
日本光電工業	300	3,110.00	933,000	
キーエンス	800	56,270.00	45,016,000	
シスメックス	1,300	8,871.00	11,532,300	
スタンレー電気	1,000	2,597.00	2,597,000	
ウシオ電機	400	1,795.00	718,000	
ファナック	800	23,600.00	18,880,000	
ローム	300	10,610.00	3,183,000	
京セラ	1,300	7,775.00	10,107,500	
太陽誘電	500	4,480.00	2,240,000	
村田製作所	4,600	7,858.00	36,146,800	
リコー	2,300	1,100.00	2,530,000	
東京エレクトロン	1,200	45,680.00	54,816,000	
デンソー	1,700	7,935.00	13,489,500	
川崎重工業	600	2,616.00	1,569,600	
トヨタ自動車	84,400	2,150.00	181,460,000	
日野自動車	1,100	629.00	691,900	
マツダ	2,300	1,250.00	2,875,000	
ヤマハ発動機	2,400	2,876.00	6,902,400	
テルモ	5,100	4,603.00	23,475,300	
島津製作所	1,900	4,400.00	8,360,000	
ニコン	2,400	1,616.00	3,878,400	
H O Y A	1,500	14,855.00	22,282,500	
シチズン時計	1,000	608.00	608,000	
前田工織	100	3,020.00	302,000	
大建工業	100	1,964.00	196,400	
大日本印刷	1,800	2,991.00	5,383,800	
アシックス	1,300	2,647.00	3,441,100	
ヤマハ	1,100	5,660.00	6,226,000	
リンテック	300	2,344.00	703,200	
任天堂	900	60,050.00	54,045,000	

コクヨ	700	1,807.00	1,264,900	
美津濃	100	2,667.00	266,700	
中部電力	2,600	1,411.00	3,668,600	
中国電力	1,100	854.00	939,400	
東北電力	1,800	659.00	1,186,200	
四国電力	600	824.00	494,400	
九州電力	3,200	846.00	2,707,200	
電源開発	600	2,074.00	1,244,400	
イーレックス	100	2,768.00	276,800	
レノバ	300	2,803.00	840,900	
東京瓦斯	3,200	2,740.00	8,768,000	
大阪瓦斯	3,000	2,474.00	7,422,000	
東邦瓦斯	600	3,330.00	1,998,000	
東武鉄道	800	3,295.00	2,636,000	
相鉄ホールディングス	600	2,443.00	1,465,800	
東急	4,200	1,644.00	6,904,800	
小田急電鉄	2,300	1,938.00	4,457,400	
京王電鉄	800	5,380.00	4,304,000	
東日本旅客鉄道	1,200	6,982.00	8,378,400	
西日本旅客鉄道	1,700	5,195.00	8,831,500	
西武ホールディングス	1,800	1,385.00	2,493,000	
西日本鉄道	500	2,879.00	1,439,500	
近鉄グループホールディングス	700	4,770.00	3,339,000	
阪急阪神ホールディングス	1,800	4,130.00	7,434,000	
南海電気鉄道	800	2,769.00	2,215,200	
京阪ホールディングス	400	3,445.00	1,378,000	
名古屋鉄道	700	2,133.00	1,493,100	
山九	400	4,300.00	1,720,000	
センコーグループホールディングス	800	965.00	772,000	
福山通運	200	3,310.00	662,000	
日立物流	300	8,770.00	2,631,000	
九州旅客鉄道	1,100	2,837.00	3,120,700	
S Gホールディングス	2,300	2,378.00	5,469,400	
NIPPON EXPRESSホールディングス	600	7,820.00	4,692,000	
日本郵船	1,300	10,710.00	13,923,000	

トランコム	100	7,620.00	762,000
三井倉庫ホールディングス	100	3,425.00	342,500
T I S	900	4,025.00	3,622,500
オープンドア	100	1,864.00	186,400
野村総合研究所	2,700	3,955.00	10,678,500
メルカリ	800	2,379.00	1,903,200
Zホールディングス	21,200	429.20	9,099,040
伊藤忠テクノソリューションズ	400	3,545.00	1,418,000
ネットワンシステムズ	300	3,130.00	939,000
B I P R O G Y	600	3,130.00	1,878,000
ビジョン	100	1,239.00	123,900
日本電信電話	4,800	3,790.00	18,192,000
K D D I	12,800	4,240.00	54,272,000
ソフトバンク	22,900	1,535.50	35,162,950
エヌ・ティ・ティ・データ	2,500	2,057.00	5,142,500
S C S K	1,200	2,322.00	2,786,400
あらた	100	4,220.00	422,000
アルフレッサ ホールディングス	700	1,687.00	1,180,900
T O K A Iホールディングス	400	894.00	357,600
シップヘルスケアホールディングス	300	2,587.00	776,100
アズワン	200	6,420.00	1,284,000
日本ライフライン	200	1,032.00	206,400
伊藤忠商事	9,500	3,897.00	37,021,500
丸紅	6,200	1,403.50	8,701,700
三井物産	5,600	3,170.00	17,752,000
キヤノンマーケティングジャパン	400	3,235.00	1,294,000
サンゲツ	300	1,657.00	497,100
モスフードサービス	100	3,200.00	320,000
イエローハット	100	1,824.00	182,400
スズケン	300	3,455.00	1,036,500
ローソン	400	4,800.00	1,920,000
ゲオホールディングス	100	1,601.00	160,100
ハローズ	100	3,115.00	311,500
大黒天物産	100	5,710.00	571,000
D C Mホールディングス	500	1,052.00	526,000
マツキヨココカラ &カンパニー	400	5,430.00	2,172,000

Z O Z O	500	3,160.00	1,580,000	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	200	1,103.00	220,600	
ノジマ	100	2,830.00	283,000	
イオン北海道	100	1,137.00	113,700	
スギホールディングス	100	6,190.00	619,000	
マックスバリュ東海	100	2,769.00	276,900	
丸井グループ	1,400	2,463.00	3,448,200	
イオン	5,200	2,829.50	14,713,400	
平和堂	100	2,021.00	202,100	
ヤオコー	100	6,640.00	664,000	
ケーズホールディングス	1,300	1,309.00	1,701,700	
Genky DrugStores	100	3,640.00	364,000	
ヤマダホールディングス	5,800	479.00	2,778,200	
ファーストリテイリング	500	85,210.00	42,605,000	
サンドラッグ	300	3,485.00	1,045,500	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	47,600	732.40	34,862,240	
りそなホールディングス	17,200	514.20	8,844,240	
三井住友トラスト・ホールディングス	2,700	4,311.00	11,639,700	
三井住友フィナンシャルグループ	5,200	4,191.00	21,793,200	
千葉銀行	2,100	753.00	1,581,300	
静岡銀行	3,600	818.00	2,944,800	
山口フィナンシャルグループ	800	774.00	619,200	
大和証券グループ本社	5,400	609.00	3,288,600	
野村ホールディングス	23,200	507.10	11,764,720	
マネックスグループ	700	493.00	345,100	
S O M P Oホールディングス	2,500	5,945.00	14,862,500	
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	3,500	4,168.00	14,588,000	
第一生命ホールディングス	8,000	2,431.00	19,448,000	
東京海上ホールディングス	2,500	7,716.00	19,290,000	
T & Dホールディングス	2,100	1,490.00	3,129,000	
芙蓉総合リース	100	8,180.00	818,000	
東京センチュリー	300	5,080.00	1,524,000	
オリックス	9,500	2,273.50	21,598,250	
ヒューリック	3,100	1,066.00	3,304,600	
野村不動産ホールディングス	900	3,395.00	3,055,500	

東急不動産ホールディングス	2,400	750.00	1,800,000	
三井不動産	7,300	2,865.00	20,914,500	
三菱地所	9,400	1,899.00	17,850,600	
平和不動産	100	3,840.00	384,000	
東京建物	700	2,125.00	1,487,500	
住友不動産	1,200	3,473.00	4,167,600	
総合警備保障	600	3,730.00	2,238,000	
ディップ	100	3,660.00	366,000	
エスプール	300	1,079.00	323,700	
H.U.グループホールディングス	400	3,155.00	1,262,000	
オリエンタルランド	1,600	20,680.00	33,088,000	
ダスキン	300	2,932.00	879,600	
テクノプロ・ホールディングス	900	3,330.00	2,997,000	
リクルートホールディングス	11,500	4,837.00	55,625,500	
エラン	100	1,097.00	109,700	
インソース	100	2,772.00	277,200	
カーブスホールディングス	200	789.00	157,800	
LITALICO	100	2,886.00	288,600	
乃村工藝社	600	960.00	576,000	
セコム	800	9,205.00	7,364,000	
メイテック	300	2,522.00	756,600	
ベネッセホールディングス	600	2,164.00	1,298,400	
合 計	778,800		2,254,788,120	

(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	921,000	
	産業ファンド投資法人	8	1,464,000	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	3	1,011,000	
	日本プロロジスリート投資法人	17	5,967,000	
	ヒューリックリート投資法人	10	1,667,000	
	積水ハウス・リート投資法人	17	1,426,300	
	野村不動産マスターファンド投資法人	17	2,901,900	

日本ビルファンド投資法人	12	8,376,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	5	3,215,000	
日本都市ファンド投資法人	28	3,138,800	
オリックス不動産投資法人	10	1,958,000	
日本プライムリアルティ投資法人	7	2,842,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	12	1,760,400	
ジャパンエクセレント投資法人	10	1,300,000	
合計	162	37,948,400	

(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。

R M先進国株式ESGマザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2022年 8月22日現在

資産の部	
流動資産	
預金	220,615,278
コール・ローン	11,414,378
株式	4,033,392,928
投資証券	105,577,919
派生商品評価勘定	28,155,014
未収入金	189
未収配当金	5,811,807
差入委託証拠金	60,842,678
流動資産合計	4,465,810,191
資産合計	4,465,810,191
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	146,386
未払解約金	4,869,000
未払利息	30

2022年 8月22日現在

流動負債合計	5,015,416
負債合計	5,015,416
純資産の部	
元本等	
元本	2,730,736,332
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,730,058,443
元本等合計	4,460,794,775
純資産合計	4,460,794,775
負債純資産合計	4,465,810,191

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 8月22日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 8月21日
期首元本額	1,471,121,149円
期中追加設定元本額	1,695,320,480円
期中一部解約元本額	435,705,297円
期末元本額	2,730,736,332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	882,412,567円
先進国株式ESGインデックス・オープン	115,530,828円
九州SDGs・グローバルバランス	629,059,436円
Smart-i 先進国株式ESGインデックス	1,103,733,501円
2. 計算日における受益権の総数	2,730,736,332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	1.6336円
(10,000口当たり純資産額)	(16,336円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2022年 8月22日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	<p>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。</p>
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、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。</p> <p>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。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。</p> <p>また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。</p>

金融商品の時価等に関する事項

2022年 8月22日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ</p> <p>ん。</p>
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 8月22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 8月22日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式	416,384,288	
投資証券	8,518,290	
合計	424,902,578	

(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 8月22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	293,289,721	-	321,175,607	27,885,886	
合計		293,289,721	-	321,175,607	27,885,886	

(注) 時価の算定方法

先物取引

外国先物取引について

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

(通貨関連)

(2022年 8月22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	8,765,958	-	8,915,400	149,442	
	米ドル	8,765,958	-	8,915,400	149,442	
	売建	4,088,100	-	4,114,800	26,700	
	米ドル	4,088,100	-	4,114,800	26,700	
合計		12,854,058	-	13,030,200	122,742	

(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。

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。

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	BAKER HUGHES COMPANY	1,143	25.16	28,757.88	
	CHENIERE ENERGY INC	275	165.85	45,608.75	
	HALLIBURTON CO	1,077	29.39	31,653.03	
	KINDER MORGAN INC	2,447	18.72	45,807.84	
	MARATHON PETROLEUM CORP	678	100.45	68,105.10	
	ONEOK INC	535	63.95	34,213.25	
	PHILLIPS 66	576	88.44	50,941.44	
	SCHLUMBERGER LTD	1,695	37.12	62,918.40	
	TARGA RESOURCES CORP	261	68.89	17,980.29	
	VALERO ENERGY CORP	491	118.55	58,208.05	
	WILLIAMS COS INC	1,457	34.93	50,893.01	
	AMCOR PLC	1,822	12.48	22,738.56	
	BALL CORP	387	61.91	23,959.17	
	CELANESE CORP	130	114.67	14,907.10	
	ECOLAB INC	310	171.78	53,251.80	
	INTERNATIONAL PAPER CO	430	43.59	18,743.70	
	INTL FLAVORS & FRAGRANCES	306	119.32	36,511.92	
	LINDE PLC	615	303.75	186,806.25	
	MARTIN MARIETTA MATERIALS	75	365.15	27,386.25	
	MOSAIC CO/THE	443	53.52	23,709.36	
	NEWMONT CORP	958	43.53	41,701.74	
	NUCOR CORP	323	138.17	44,628.91	
	PPG INDUSTRIES INC	284	131.94	37,470.96	
	SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	297	244.58	72,640.26	
	STEEL DYNAMICS INC	231	81.80	18,895.80	
	WESTROCK CO	318	41.59	13,225.62	
3M CO	685	145.20	99,462.00		
ALLEGION PLC	102	106.45	10,857.90		
CARRIER GLOBAL CORP	1,028	42.48	43,669.44		
CATERPILLAR INC	643	195.60	125,770.80		

CUMMINS INC	171	228.58	39,087.18
DEERE & CO	350	369.66	129,381.00
DOVER CORP	173	137.87	23,851.51
EATON CORP PLC	479	150.84	72,252.36
FASTENAL CO	691	55.21	38,150.11
FORTIVE CORP	409	67.56	27,632.04
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	153	67.61	10,344.33
GENERAC HOLDINGS INC	77	256.01	19,712.77
IDEX CORP	92	215.54	19,829.68
ILLINOIS TOOL WORKS	376	213.70	80,351.20
INGERSOLL-RAND INC	490	51.82	25,391.80
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	844	57.26	48,327.44
KORNIT DIGITAL LTD	60	31.77	1,906.20
LENNOX INTERNATIONAL INC	38	258.68	9,829.84
MASCO CORP	276	55.38	15,284.88
OTIS WORLDWIDE CORP	510	79.41	40,499.10
OWENS CORNING	115	89.88	10,336.20
PENTAIR PLC	189	49.38	9,332.82
PLUG POWER INC	625	26.82	16,762.50
QUANTA SERVICES INC	173	142.02	24,569.46
ROCKWELL AUTOMATION INC	140	251.61	35,225.40
SMITH (A.O.) CORP	158	62.63	9,895.54
SNAP-ON INC	65	230.13	14,958.45
TRANE TECHNOLOGIES PLC	281	163.71	46,002.51
UNITED RENTALS INC	87	316.69	27,552.03
MW GRAINGER INC	55	583.91	32,115.05
XYLEM INC	216	99.53	21,498.48
COPART INC	256	128.24	32,829.44
REPUBLIC SERVICES INC	265	146.44	38,806.60
ROBERT HALF INTL INC	133	81.39	10,824.87
ROLLINS INC	264	36.54	9,646.56
AMERCO	12	578.53	6,942.36
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	148	117.12	17,333.76
CSX CORP	2,634	33.83	89,108.22
DELTA AIR LINES INC	193	33.25	6,417.25

EXPEDITORS INTL WASH INC	204	107.19	21,866.76
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	1,316	3.44	4,527.04
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	101	189.75	19,164.75
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	191	55.47	10,594.77
NORFOLK SOUTHERN CORP	288	255.75	73,656.00
OLD DOMINION FREIGHT LINE	117	297.04	34,753.68
UNION PACIFIC CORP	764	238.52	182,229.28
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	879	208.43	183,209.97
APTIV PLC	326	103.77	33,829.02
BORGWARNER INC	274	38.93	10,666.82
LEAR CORP	73	145.17	10,597.41
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	217	34.45	7,475.65
TESLA INC	1,054	890.00	938,060.00
HASBRO INC	149	84.00	12,516.00
LULULEMON ATHLETICA INC	142	322.47	45,790.74
NEWELL RUBBERMAID INC	491	20.84	10,232.44
NIKE INC -CL B	1,532	113.16	173,361.12
VF CORP	398	45.55	18,128.90
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	336	135.48	45,521.28
MCDONALD'S CORP	892	266.54	237,753.68
VAIL RESORTS INC	46	238.25	10,959.50
ALPHABET INC-CL A	7,220	117.21	846,256.20
ALPHABET INC-CL C	6,820	118.12	805,578.40
CABLE ONE INC	6	1,332.13	7,992.78
ELECTRONIC ARTS INC	337	130.48	43,971.76
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	470	30.17	14,179.90
SIRIUS XM HOLDINGS INC	1,044	6.40	6,681.60
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	193	127.74	24,653.82
WALT DISNEY CO/THE	2,183	120.14	262,265.62
WARNER BROS DISCOVERY INC	2,667	13.73	36,617.91
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	312	49.35	15,397.20
ADVANCE AUTO PARTS INC	74	207.02	15,319.48
BEST BUY CO INC	260	79.53	20,677.80
BURLINGTON STORES INC	80	163.31	13,064.80
CARMAX INC	194	96.27	18,676.38

EBAY INC	706	47.07	33,231.42
GENUINE PARTS CO	171	159.85	27,334.35
HOME DEPOT INC	1,253	321.32	402,613.96
LKQ CORP	314	56.07	17,605.98
LOWE'S COS INC	804	211.36	169,933.44
MERCADOLIBRE INC	55	909.76	50,036.80
POOL CORP	48	380.39	18,258.72
TARGET CORP	575	167.04	96,048.00
TJX COMPANIES INC	1,432	66.40	95,084.80
TRACTOR SUPPLY COMPANY	136	203.29	27,647.44
ULTA BEAUTY INC	65	403.25	26,211.25
KROGER CO	840	49.50	41,580.00
BUNGE LTD	174	100.02	17,403.48
CAMPBELL SOUP CO	263	51.31	13,494.53
COCA-COLA CO/THE	4,949	65.17	322,526.33
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	241	53.75	12,953.75
CONAGRA BRANDS INC	590	35.40	20,886.00
GENERAL MILLS INC	730	77.97	56,918.10
HORMEL FOODS CORP	368	51.07	18,793.76
KELLOGG CO	314	76.67	24,074.38
KEURIG DR PEPPER INC	949	39.96	37,922.04
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	305	91.78	27,992.90
PEPSICO INC	1,662	180.17	299,442.54
CLOROX COMPANY	148	148.87	22,032.76
COLGATE-PALMOLIVE CO	959	83.27	79,855.93
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	279	273.28	76,245.12
KIMBERLY-CLARK CORP	405	136.95	55,464.75
PROCTER & GAMBLE CO/THE	2,876	149.73	430,623.48
ABIOMED INC	55	270.68	14,887.40
ALIGN TECHNOLOGY INC	90	269.82	24,283.80
AMERISOURCEBERGEN CORP	188	152.03	28,581.64
BAXTER INTERNATIONAL INC	602	61.25	36,872.50
CARDINAL HEALTH INC	332	69.23	22,984.36
CIGNA CORP	385	292.98	112,797.30
DAVITA INC	69	93.21	6,431.49

DENTSPLY SIRONA INC	263	35.78	9,410.14
DEXCOM INC	464	85.11	39,491.04
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	747	98.55	73,616.85
ELEVANCE HEALTH INC	289	503.54	145,523.06
HCA HEALTHCARE INC	291	215.03	62,573.73
HOLOGIC INC	300	71.46	21,438.00
HUMANA INC	152	499.86	75,978.72
IDEXX LABORATORIES INC	101	373.74	37,747.74
INSULET CORP	83	267.42	22,195.86
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	112	249.31	27,922.72
NOVOCURE LTD	113	79.24	8,954.12
QUEST DIAGNOSTICS INC	143	135.48	19,373.64
RESMED INC	175	233.49	40,860.75
STERIS PLC	120	209.89	25,186.80
TELADOC HEALTH INC	192	32.90	6,316.80
TELEFLEX INC	53	242.18	12,835.54
AGILENT TECHNOLOGIES INC	360	137.62	49,543.20
AMGEN INC	668	250.86	167,574.48
BIO-TECHNE CORP	47	354.83	16,677.01
BIOGEN INC	176	214.09	37,679.84
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	221	92.84	20,517.64
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	2,615	75.33	196,987.95
CATALENT INC	204	105.24	21,468.96
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	514	17.47	8,979.58
ELI LILLY & CO	971	322.77	313,409.67
GILEAD SCIENCES INC	1,504	65.34	98,271.36
ILLUMINA INC	188	202.75	38,117.00
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	70	156.65	10,965.50
JOHNSON & JOHNSON	3,154	169.31	534,003.74
MERCK & CO. INC.	3,033	92.08	279,278.64
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	27	1,333.80	36,012.60
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	469	588.55	276,029.95
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	305	299.04	91,207.20
WATERS CORP	73	327.98	23,942.54
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	89	319.52	28,437.28

ZOETIS INC	566	169.52	95,948.32
CITIZENS FINANCIAL GROUP	595	38.98	23,193.10
FIRST REPUBLIC BANK/CA	212	163.54	34,670.48
HUNTINGTON BANCSHARES INC	1,727	14.08	24,316.16
KEYCORP	1,114	19.30	21,500.20
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	502	170.79	85,736.58
REGIONS FINANCIAL CORP	1,125	22.60	25,425.00
SVB FINANCIAL GROUP	71	435.39	30,912.69
TRUIST FINANCIAL CORP	1,594	50.63	80,704.22
US BANCORP	1,692	48.61	82,248.12
WEBSTER FINANCIAL CORP	219	49.10	10,752.90
ALLY FINANCIAL INC	391	35.16	13,747.56
AMERICAN EXPRESS CO	775	162.24	125,736.00
AMERIPRISE FINANCIAL INC	133	284.74	37,870.42
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	918	43.89	40,291.02
BLACKROCK INC	182	713.85	129,920.70
CARLYLE GROUP INC/THE	236	33.56	7,920.16
CBOE GLOBAL MARKETS INC	128	123.78	15,843.84
CME GROUP INC	431	202.07	87,092.17
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	342	106.91	36,563.22
EQUITABLE HOLDINGS INC	469	31.28	14,670.32
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	46	446.37	20,533.02
FRANKLIN RESOURCES INC	340	27.71	9,421.40
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	675	109.09	73,635.75
INVESCO LTD	395	18.10	7,149.50
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	96	224.39	21,541.44
MARKETAXESS HOLDINGS INC	43	262.31	11,279.33
MOODY'S CORP	200	310.89	62,178.00
MORGAN STANLEY	1,603	90.01	144,286.03
NASDAQ INC	138	187.11	25,821.18
NORTHERN TRUST CORP	237	100.56	23,832.72
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	225	108.89	24,500.25
S&P GLOBAL INC	425	379.92	161,466.00
SCHWAB (CHARLES) CORP	1,739	73.86	128,442.54
STATE STREET CORP	440	72.26	31,794.40

SYNCHRONY FINANCIAL	627	34.31	21,512.37
T ROWE PRICE GROUP INC	274	126.42	34,639.08
AFLAC INC	740	63.68	47,123.20
ALLSTATE CORP	334	130.20	43,486.80
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	977	56.10	54,809.70
ARCH CAPITAL GROUP LTD	454	47.28	21,465.12
ARTHUR J GALLAGHER & CO	250	190.70	47,675.00
ASSURANT INC	66	171.85	11,342.10
CHUBB LTD	511	200.58	102,496.38
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	398	68.81	27,386.38
LINCOLN NATIONAL CORP	194	49.47	9,597.18
LOEWS CORP	244	58.24	14,210.56
MARSH & MCLENNAN COS	603	171.78	103,583.34
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	313	78.15	24,460.95
PROGRESSIVE CORP	701	127.48	89,363.48
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	451	103.40	46,633.40
TRAVELERS COS INC/THE	290	172.64	50,065.60
WILLIS TOWERS WATSON PLC	141	216.26	30,492.66
CBRE GROUP INC - A	403	84.92	34,222.76
ACCENTURE PLC-CL A	758	315.29	238,989.82
ADOBE INC	566	425.05	240,581.13
ANSYS INC	105	271.62	28,520.10
AUTODESK INC	264	222.59	58,763.76
AUTOMATIC DATA PROCESSING	504	259.82	130,949.28
CADENCE DESIGN SYS INC	333	188.04	62,617.32
CITRIX SYSTEMS INC	151	102.77	15,518.27
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	95	77.03	7,317.85
HUBSPOT INC	54	351.58	18,985.32
INTL BUSINESS MACHINES CORP	1,079	138.37	149,301.23
INTUIT INC	323	463.95	149,855.85
MASTERCARD INC-CLASS A	1,047	354.28	370,931.16
MICROSOFT CORP	8,544	286.15	2,444,865.60
NORTONLIFELOCK INC	698	23.54	16,430.92
ROPER TECHNOLOGIES INC	127	433.32	55,031.64
SALESFORCE INC	1,182	183.77	217,216.14

	SERVICENOW INC	240	476.26	114,302.40	
	SPLUNK INC	190	109.22	20,751.80	
	VISA INC-CLASS A SHARES	1,990	212.82	423,511.80	
	VMWARE INC-CLASS A	251	121.58	30,516.58	
	WESTERN UNION CO	474	16.43	7,787.82	
	ZENDESK INC	147	76.55	11,252.85	
	CISCO SYSTEMS INC	4,985	48.70	242,769.50	
	COGNEX CORP	211	46.04	9,714.44	
	HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	1,565	14.86	23,255.90	
	HP INC	1,248	34.23	42,719.04	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	220	176.23	38,770.60	
	MOTOROLA SOLUTIONS INC	202	253.25	51,156.50	
	TRIMBLE INC	302	70.01	21,143.02	
	ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	64	328.41	21,018.24	
	LUMEN TECHNOLOGIES INC	1,110	11.06	12,276.60	
	VERIZON COMMUNICATIONS INC	5,037	44.42	223,743.54	
	AMERICAN WATER WORKS CO INC	218	157.81	34,402.58	
	ATMOS ENERGY CORP	163	118.01	19,235.63	
	CONSOLIDATED EDISON INC	425	100.55	42,733.75	
	EDISON INTERNATIONAL	458	71.54	32,765.32	
	ESSENTIAL UTILITIES INC	272	51.75	14,076.00	
	EVERSOURCE ENERGY	414	93.63	38,762.82	
	SEMPRA ENERGY	379	170.06	64,452.74	
	UGI CORP	240	41.40	9,936.00	
	APPLIED MATERIALS INC	1,060	104.63	110,907.80	
	INTEL CORP	4,886	35.38	172,866.68	
	LAM RESEARCH CORP	167	476.79	79,623.93	
	NVIDIA CORP	2,999	178.49	535,291.51	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	315	180.33	56,803.95	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	1,108	176.45	195,506.60	
	米ドル 小計	179,653		21,830,668.26 (2,994,512,765)	
カナダドル	CAMECO CORP	480	29.27	14,049.60	
	ENBRIDGE INC	2,431	56.25	136,743.75	
	KEYERA CORP	264	31.97	8,440.08	

PARKLAND CORP	182	34.13	6,211.66	
PEMBINA PIPELINE CORP	660	48.61	32,082.60	
AGNICO EAGLE MINES LTD	550	56.82	31,251.00	
IVANHOE MINES LTD-CL A	746	8.78	6,549.88	
KINROSS GOLD CORP	1,459	4.58	6,682.22	
LUNDIN MINING CORP	820	6.87	5,633.40	
NUTRIEN LTD	663	117.41	77,842.83	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	543	41.50	22,534.50	
CAE INC	386	26.15	10,093.90	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	100	106.43	10,643.00	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	124	91.61	11,359.64	
THOMSON REUTERS CORP	204	150.30	30,661.20	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	715	164.73	117,781.95	
MAGNA INTERNATIONAL INC	345	80.78	27,869.10	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	214	41.89	8,964.46	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	63	168.94	10,643.22	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	1,019	59.06	60,182.14	
METRO INC	293	72.37	21,204.41	
BANK OF MONTREAL	778	133.89	104,166.42	
BANK OF NOVA SCOTIA	1,459	81.24	118,529.16	
NATIONAL BANK OF CANADA	407	94.25	38,359.75	
TORONTO-DOMINION BANK	2,187	87.45	191,253.15	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	1,695	67.11	113,751.45	
INTACT FINANCIAL CORP	211	195.54	41,258.94	
POWER CORP OF CANADA	671	35.55	23,854.05	
FIRSTSERVICE CORP	49	174.35	8,543.15	
OPEN TEXT CORP	327	49.63	16,229.01	
SHOPIFY INC - CLASS A	1,370	44.43	60,869.10	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	427	58.97	25,180.19	
TELUS CORP	549	30.74	16,876.26	
FORTIS INC	569	60.32	34,322.08	
HYDRO ONE LTD	375	36.05	13,518.75	
NORTHLAND POWER INC	280	45.18	12,650.40	
カナダドル 小計	23,615		1,476,786.40 (155,771,429)	

ユーロ	GALP ENERGIA SGPS SA	614	10.80	6,631.20	
	NESTE OYJ	510	49.78	25,387.80	
	OMV AG	170	40.22	6,837.40	
	REPSOL SA	1,733	13.07	22,658.97	
	TENARIS SA	571	12.96	7,403.01	
	TOTALENERGIES SE	2,975	52.69	156,752.75	
	AIR LIQUIDE SA	628	136.50	85,722.00	
	AKZO NOBEL	219	66.78	14,624.82	
	CRH PLC	917	38.40	35,212.80	
	EVONIK INDUSTRIES AG	257	20.04	5,150.28	
	HEIDELBERGCEMENT AG	169	48.89	8,262.41	
	KONINKLIJKE DSM NV	210	142.80	29,988.00	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	293	35.95	10,533.35	
	SOLVAY SA	82	83.48	6,845.36	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	672	15.53	10,439.52	
	SYMRISE AG	161	114.05	18,362.05	
	UMICORE	256	33.19	8,496.64	
	UPM-KYMMENE OYJ	646	34.45	22,254.70	
	VOESTALPINE AG	119	20.54	2,444.26	
	ALSTOM	385	21.90	8,431.50	
	BOUYGUES SA	262	30.48	7,985.76	
	BRENTAG SE	187	69.84	13,060.08	
	CNH INDUSTRIAL NV	1,234	12.44	15,357.13	
	EIFFAGE	102	90.98	9,279.96	
	GEA GROUP AG	188	37.31	7,014.28	
	IMCD NV	69	151.40	10,446.60	
	KINGSPAN GROUP PLC	184	61.00	11,224.00	
	MTU AERO ENGINES AG	65	191.50	12,447.50	
	PRYSMIAN SPA	310	32.05	9,935.50	
	SCHNEIDER ELECTRIC SE	649	134.50	87,290.50	
	WARTSILA OYJ ABP	535	8.64	4,625.61	
	BUREAU VERITAS SA	335	26.95	9,028.25	
	RANDSTAD NV	137	47.79	6,547.23	
	TELEPERFORMANCE	71	310.10	22,017.10	
	WOLTERS KLUWER	314	106.75	33,519.50	

BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	400	75.90	30,360.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	65	71.50	4,647.50
MICHELIN(CGDE)	820	25.79	21,151.90
VALEO SA	238	19.97	4,754.05
ADIDAS AG	205	166.42	34,116.10
ESSILORLUXOTTICA	346	161.70	55,948.20
KERING	90	558.10	50,229.00
PUMA SE	129	65.60	8,462.40
SEB SA	29	78.15	2,266.35
ACCOR SA	201	25.36	5,097.36
PUBLICIS GROUPE	273	50.88	13,890.24
VIVENDI	892	8.98	8,011.94
D' IETEREN GROUP	31	161.80	5,015.80
DELIVERY HERO SE	187	52.16	9,753.92
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	1,307	24.78	32,387.46
PROSUS NV	1,006	62.86	63,237.16
ZALANDO SE	271	26.65	7,222.15
CARREFOUR SA	710	17.40	12,357.55
HELLOFRESH SE	192	27.89	5,354.88
JERONIMO MARTINS	352	23.00	8,096.00
KESKO OYJ-B SHS	341	22.34	7,617.94
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N.V.	1,260	28.30	35,658.00
DANONE	793	53.65	42,544.45
JDE PEET'S BV	101	31.76	3,207.76
KERRY GROUP PLC-A	194	106.75	20,709.50
BEIERSDORF AG	114	103.70	11,821.80
HENKEL AG & CO KGAA	118	65.30	7,705.40
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	217	66.44	14,417.48
L'OREAL	290	362.15	105,023.50
AMPLIFON SPA	134	28.71	3,847.14
BIOMERIEUX	50	100.10	5,005.00
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	49	133.60	6,546.40
MERCK KGAA	156	183.10	28,563.60
ORION OYJ-CLASS B	119	47.29	5,627.51
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	7,984	4.69	37,484.88

	BNP PARIBAS	1,334	47.66	63,578.44	
	COMMERZBANK AG	1,299	6.70	8,711.09	
	ING GROEP NV-CVA	4,687	9.11	42,698.57	
	INTESA SANPAOLO	19,844	1.77	35,187.38	
	KBC GROEP NV	302	49.17	14,849.34	
	SOCIETE GENERALE SA	958	22.52	21,578.95	
	DEUTSCHE BOERSE AG	229	169.75	38,872.75	
	ALLIANZ SE-REG	490	176.00	86,240.00	
	AXA SA	2,326	24.26	56,428.76	
	NN GROUP NV	343	42.01	14,409.43	
	SAMPO OYJ-A SHS	601	44.95	27,014.95	
	LEG IMMOBILIEN SE	90	82.00	7,380.00	
	NEXI SPA	632	8.86	5,600.78	
	SAP SE	1,254	90.96	114,063.84	
	WORLDLINE SA	287	42.77	12,274.99	
	ELISA OYJ	175	55.46	9,705.50	
	KONINKLIJKE KPN NV	3,984	3.24	12,920.11	
	ORANGE	2,405	10.37	24,959.09	
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	1,281	2.65	3,394.65	
	ENEL SPA	9,774	5.00	48,899.32	
	IBERDROLA SA	6,948	10.94	76,011.12	
	NATURGY ENERGY GROUP SA	198	29.08	5,757.84	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	467	19.62	9,164.87	
	VERBUND AG	88	109.10	9,600.80	
	ASML HOLDING NV	488	545.10	266,008.80	
	ユーロ 小計	96,377		2,485,669.51 (341,903,841)	
英ポンド	ANTOFAGASTA PLC	451	11.30	5,098.55	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	169	72.12	12,188.28	
	JOHNSON MATTHEY PLC	202	21.63	4,369.26	
	MONDI PLC	594	15.70	9,325.80	
	ASHTREAD GROUP PLC	536	45.38	24,323.68	
	BUNZL PLC	410	31.45	12,894.50	
	DCC PLC	114	51.80	5,905.20	
	FERGUSON PLC	264	104.45	27,574.80	

SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	84	111.85	9,395.40
INTERTEK GROUP PLC	195	42.76	8,338.20
RELX PLC	2,321	24.37	56,562.77
RENTOKIL INITIAL PLC	2,235	5.40	12,077.94
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	1,114	4.62	5,152.25
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	138	39.08	5,393.04
BURBERRY GROUP PLC	490	18.15	8,893.50
PERSIMMON PLC	391	16.70	6,529.70
TAYLOR WIMPEY PLC	4,279	1.19	5,094.14
COMPASS GROUP PLC	2,149	19.50	41,916.24
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	225	50.26	11,308.50
WHITBREAD PLC	234	25.86	6,051.24
INFORMA PLC	1,802	5.82	10,491.24
PEARSON PLC	832	8.79	7,314.94
WPP PLC	1,370	8.15	11,170.98
KINGFISHER PLC	2,512	2.39	6,026.28
NEXT PLC	152	61.64	9,369.28
OCADO GROUP PLC	521	8.77	4,569.17
SAINSBURY (J) PLC	2,039	2.19	4,475.60
TESCO PLC	9,222	2.70	24,982.39
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	453	16.12	7,302.36
COCA-COLA HBC AG-DI	225	20.96	4,716.00
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	860	66.74	57,396.40
UNILEVER PLC	3,076	40.04	123,163.04
NMC HEALTH PLC	5	0.00	0.00
ASTRAZENECA PLC	1,860	112.50	209,250.00
GSK PLC	4,882	14.25	69,578.26
HSBC HOLDINGS PLC	24,313	5.36	130,512.18
LLOYDS BANKING GROUP PLC	85,361	0.44	38,258.80
ABRDN PLC	2,675	1.58	4,239.87
SCHRODERS PLC	144	28.72	4,135.68
ST JAMES'S PLACE PLC	662	12.21	8,083.02
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	7,182	2.70	19,391.40
PRUDENTIAL PLC	3,300	9.58	31,640.40
BT GROUP PLC	8,401	1.57	13,210.57

	VODAFONE GROUP PLC	32,411	1.21	39,457.15	
	NATIONAL GRID PLC	4,383	11.68	51,215.35	
	英ポンド 小計	215,238		1,168,343.35	(189,365,090)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	242	18.26	4,418.92	
	GIVAUDAN-REG	11	3,298.00	36,278.00	
	SIKA AG-REG	176	235.10	41,377.60	
	ABB LTD-REG	1,986	28.54	56,680.44	
	GEBERIT AG-REG	44	478.80	21,067.20	
	ADECCO SA-REG	202	32.12	6,488.24	
	SGS SA-REG	8	2,251.00	18,008.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	67	244.50	16,381.50	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	631	112.10	70,735.10	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	2	10,780.00	21,560.00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	66	282.00	18,612.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	137	113.85	15,597.45	
	LONZA GROUP AG-REG	90	564.00	50,760.00	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	844	323.35	272,907.40	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	38	516.00	19,608.00	
	SWISS RE AG	367	74.74	27,429.58	
TEMENOS GROUP AG-REG	80	79.70	6,376.00		
	スイスフラン 小計	4,991		704,285.43	(100,684,645)
スウェーデンク ローナ	BOLIDEN AB	331	357.05	118,183.55	
	HOLMEN AB-B SHARES	114	461.80	52,645.20	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	735	161.75	118,886.25	
	ALFA LAVAL AB	358	307.50	110,085.00	
	ASSA ABLOY AB-B	1,205	238.90	287,874.50	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	3,229	116.70	376,824.30	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	1,880	104.48	196,422.40	
	EPIROC AB-A	794	173.15	137,481.10	
	EPIROC AB-B	471	155.15	73,075.65	
	HUSQVARNA AB-B SHS	424	75.56	32,037.44	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	1,826	100.90	184,243.40	
	SANDVIK AB	1,283	184.85	237,162.55	

	SKF AB-B SHARES	443	161.15	71,389.45	
	ELECTROLUX AB-B	275	145.22	39,935.50	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	881	127.48	112,309.88	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	735	265.00	194,775.00	
	NORDEA BANK ABP	3,974	102.42	407,017.08	
	EQT AB	358	253.90	90,896.20	
	ERICSSON LM-B SHS	3,512	80.84	283,910.08	
	TELE2 AB-B SHS	691	118.30	81,745.30	
	TELIA CO AB	3,051	38.74	118,195.74	
	スウェーデンクローナ 小計	26,570		3,325,095.57	(43,059,987)
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	379	340.40	129,011.60	
	EQUINOR ASA	1,174	374.95	440,191.30	
	NORSK HYDRO ASA	1,518	67.14	101,918.52	
	MOWI ASA	520	221.00	114,920.00	
	ORKLA ASA	905	84.50	76,472.50	
	SALMAR ASA	78	701.50	54,717.00	
	DNB BANK ASA	1,120	196.55	220,136.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	244	207.00	50,508.00	
	TELENOR ASA	792	114.90	91,000.80	
	ノルウェークローネ 小計	6,730		1,278,875.72	(17,840,316)
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	129	470.00	60,630.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	234	457.00	106,938.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	1,216	191.56	232,936.96	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	4	19,440.00	77,760.00	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-B	6	19,665.00	117,990.00	
	PANDORA A/S	117	485.50	56,803.50	
	COLOPLAST-B	143	907.60	129,786.80	
	DEMANT A/S	127	239.00	30,353.00	
	GN STORE NORD A/S	159	246.70	39,225.30	
	GENMAB A/S	79	2,669.00	210,851.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	2,021	771.00	1,558,191.00	
	ORSTED A/S	228	784.50	178,866.00	
		4,463		2,800,331.56	

デンマーククローネ 小計				(51,806,133)
オーストラリア ドル	SANTOS LTD	3,867	7.52	29,079.84
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	2,265	33.50	75,877.50
	BLUESCOPE STEEL LTD	603	17.39	10,486.17
	EVOLUTION MINING LTD	2,008	2.53	5,080.24
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	2,041	19.16	39,105.56
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	505	36.49	18,427.45
	MINERAL RESOURCES LTD	208	60.90	12,667.20
	NEWCREST MINING LTD	1,076	19.35	20,820.60
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	1,429	7.72	11,031.88
	ORICA LTD	514	15.61	8,023.54
	BRAMBLES LTD	1,728	12.97	22,412.16
	AURIZON HOLDINGS LTD	2,255	3.95	8,907.25
	TRANSURBAN GROUP	3,696	14.14	52,261.44
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	730	36.35	26,535.50
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	75	70.26	5,269.50
	IDP EDUCATION LTD	259	27.87	7,218.33
	REA GROUP LTD	54	130.59	7,051.86
	SEEK LTD	405	22.95	9,294.75
	COLES GROUP LTD	1,618	19.36	31,324.48
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	1,658	8.32	13,794.56
	COCHLEAR LTD	79	218.86	17,289.94
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	221	73.40	16,221.40
	SONIC HEALTHCARE LTD	521	34.09	17,760.89
	AUST AND NZ BANKING GROUP	3,592	23.10	82,975.20
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	2,048	99.95	204,697.60
	ASX LTD	235	82.00	19,270.00
	MACQUARIE GROUP LTD	438	182.28	79,838.64
	QBE INSURANCE GROUP LTD	1,786	12.10	21,610.60
	SUNCORP GROUP LTD	1,525	11.08	16,897.00
	LENDLEASE GROUP	769	10.40	7,997.60
	COMPUTERSHARE LTD	658	24.39	16,048.62
	XERO LTD	151	88.80	13,408.80
TELSTRA CORP LTD	4,977	4.12	20,505.24	
APA GROUP	1,437	11.68	16,784.16	

	オーストラリアドル 小計	45,431		965,975.50 (91,159,107)
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	1,292	7.62	9,845.04
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	782	19.85	15,522.70
	SPARK NEW ZEALAND LTD	2,037	5.25	10,694.25
	MERCURY NZ LTD	826	6.28	5,187.28
	MERIDIAN ENERGY LTD	1,514	5.26	7,963.64
	ニュージーランドドル 小計	6,451		49,212.91 (4,175,715)
香港ドル	MTR CORP	2,023	41.60	84,156.80
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	2,400	16.36	39,264.00
	WH GROUP LTD	10,500	5.46	57,330.00
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	4,242	27.25	115,594.50
	HANG SENG BANK LTD	861	126.10	108,572.10
	AIA GROUP LTD	14,600	75.40	1,100,840.00
	SINO LAND CO	4,000	12.02	48,080.00
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	672	56.00	37,632.00
	SWIRE PROPERTIES LTD	1,004	18.92	18,995.68
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	4,289	11.00	47,179.00
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD (CKI)	1,000	50.40	50,400.00
	HONG KONG & CHINA GAS	13,079	8.17	106,855.43
	香港ドル 小計	58,670		1,814,899.51 (31,724,443)
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	1,809	6.97	12,608.73
	SINGAPORE AIRLINES LTD	1,587	5.39	8,553.93
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	1,400	26.80	37,520.00
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	1,080	10.01	10,810.80
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	3,105	3.87	12,016.35
	CITY DEVELOPMENTS LTD	368	8.36	3,076.48
	UOL GROUP LTD	593	7.39	4,382.27
	シンガポールドル 小計	9,942		88,968.56 (8,757,175)
イスラエルシュケル	BANK LEUMI LE-ISRAEL	1,739	36.06	62,708.34
	イスラエルシュケル 小計	1,739		62,708.34 (2,632,282)

合計	679,870		4,033,392,928	(4,033,392,928)
----	---------	--	---------------	-----------------

(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	150,102.27	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	1,890	12,644.10	
		BOSTON PROPERTIES INC	180	15,543.00	
		CROWN CASTLE INC	519	93,492.66	
		EQUINIX INC	109	75,950.11	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	651	18,110.82	
		PROLOGIS INC	889	119,197.12	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	131	45,128.19	
		VENTAS INC	481	23,525.71	
		WELLTOWER INC	538	42,814.04	
		WEYERHAEUSER CO	898	32,507.60	
		米ドル 小計	6,833	629,015.62	(86,282,072)
	カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	88	4,110.48	
	カナダドル 小計	88	4,110.48	(433,573)	
ユーロ	COVIVIO	62	3,592.90		
	GECINA SA	51	4,771.05		
	KLEPIERRE	268	5,788.80		
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	132	7,406.52		
	ユーロ 小計	513	21,559.27	(2,965,477)	
英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	1,024	4,745.21		
	LAND SECURITIES GROUP PLC	819	5,791.96		
	SEGRO PLC	1,457	14,832.26		
	英ポンド 小計	3,300	25,369.43	(4,111,877)	

オーストラリアドル	DEXUS/AU	1,321	12,100.36	
	GOODMAN GROUP	2,029	41,574.21	
	GPT GROUP	2,220	9,457.20	
	MIRVAC GROUP	4,565	10,043.00	
	SCENTRE GROUP	6,335	17,611.30	
	STOCKLAND	2,945	10,984.85	
	VICINITY CENTRES	4,659	9,108.34	
オーストラリアドル 小計		24,074	110,879.26	(10,463,675)
シンガポールドル	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	6,392	13,423.20	
シンガポールドル 小計		6,392	13,423.20	(1,321,245)
合計			105,577,919	(105,577,919)

(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	97.2%		72.2%
	投資証券 11銘柄		2.8%	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%		8.3%
	投資証券 4銘柄		0.9%	0.1%
英ポンド	株式 45銘柄	97.9%		4.6%
	投資証券 3銘柄		2.1%	0.1%
スイスフラン	株式 17銘柄	100.0%		2.4%
スウェーデンクローナ	株式 21銘柄	100.0%		1.0%
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%		1.3%
オーストラリアドル	株式 34銘柄	89.7%		2.2%
	投資証券 7銘柄		10.3%	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%		0.8%
シンガポールドル	株式	7銘柄	86.9%		0.2%
	投資証券	1銘柄		13.1%	0.0%
イスラエルシェケル	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。

R M新興国株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2022年 8月22日現在

資産の部	
流動資産	
預金	2,151,441,113
コール・ローン	11,504,978
株式	16,730,134,828
投資証券	18,181,378
派生商品評価勘定	10,774,954
未収入金	81,765
未収配当金	75,200,539
差入委託証拠金	910,464,521
流動資産合計	19,907,784,076
資産合計	19,907,784,076
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	22,059,804
未払解約金	34,144,700
未払利息	31
流動負債合計	56,204,535
負債合計	56,204,535
純資産の部	
元本等	
元本	12,154,895,161

2022年 8月22日現在

剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	7,696,684,380
元本等合計	19,851,579,541
純資産合計	19,851,579,541
負債純資産合計	19,907,784,076

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>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。</p> <p>時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>投資証券</p> <p>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。</p> <p>時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則としてわが国における計算日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	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	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>派生商品取引等損益</p> <p>原則として、約定日基準で計上しております。</p> <p>為替予約取引による為替差損益</p> <p>原則として、約定日基準で計上しております。</p>
5. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産等については、投資信託財産の計算に関する規則第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分して整理する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2022年 8月22日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 8月21日
期首元本額	10,196,423,560円

期中追加設定元本額	6,422,444,008円
期中一部解約元本額	4,463,972,407円
期末元本額	12,154,895,161円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	673,523,876円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	1,711,144,587円
りそなラップ型ファンド(成長型)	1,922,252,423円
DCりそな グローバルバランス	15,218,534円
つみたてバランスファンド	776,741,726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	260,410,574円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	177,676,767円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	73,388,133円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	48,666,817円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	26,210,959円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	49,133,990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	142,071,319円
FWりそな新興国株式インデックスファンド	2,896,296,113円
Smart-i 新興国株式インデックス	1,930,642,845円
Smart-i 8資産バランス 安定型	84,110,775円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	258,865,802円
Smart-i 8資産バランス 成長型	311,945,935円
Smart-i Select 全世界株式インデックス	10,748,308円
Smart-i Select 全世界株式インデックス(除く日本)	10,968,537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)	896,535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)	12,955,746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)	68,438,139円
りそなDAAマルチアセットファンド(適格機関投資家専用)	54,207,501円
2. 計算日における受益権の総数	12,154,895,161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	1.6332円
(10,000口当たり純資産額)	(16,332円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2022年 8月22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。

金融商品の時価等に関する事項

2022年 8月22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 8月22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 8月22日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式		2,543,916,701
投資証券		538,683
合計		2,544,455,384

(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 8月22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	3,108,999,201	-	3,097,878,829	11,120,372	
	合計	3,108,999,201	-	3,097,878,829	11,120,372	

(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 8月22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	133,083	-	133,333	250	
	米ドル	133,083	-	133,333	250	
	売建	25,343,033	-	25,507,761	164,728	

米ドル	25,209,950	-	25,374,600	164,650
韓国ウォン	86,910	-	86,910	-
オフショア人民元	46,173	-	46,251	78
合計	25,476,116	-	25,641,094	164,478

(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。

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。

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	1.59	33,196.80	
	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	5.34	20,115.78	
	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	48.40	72,696.80	

ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	7,676	26.56	203,874.56
LI AUTO INC - ADR	10,277	29.94	307,693.38
NIO INC - ADR	24,653	19.05	469,639.65
XPENG INC - ADR	7,965	21.24	169,176.60
H WORLD GROUP LTD	3,654	38.93	142,250.22
TAL EDUCATION GROUP- ADR	8,474	4.40	37,285.60
TRIP.COM GROUP LTD	10,155	26.11	265,147.05
YUM CHINA HOLDINGS INC	7,972	47.16	375,959.52
AUTOHOME INC-ADR	1,487	34.79	51,732.73
IQIYI INC-ADR	6,995	3.59	25,112.05
JOYY INC	1,098	27.02	29,667.96
KANZHUN LTD	1,693	21.05	35,637.65
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	12,024	4.46	53,627.04
VK CO LTD	2,211	0.00	0.00
WEIBO CORP-SPON ADR	1,164	18.20	21,184.80
YANDEX NV-A	5,354	0.00	0.00
OZON HOLDINGS PLC - ADR	920	0.00	0.00
PINDUODUO INC-ADR	8,225	45.76	376,376.00
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	8,297	9.99	82,887.03
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	1	0.00	0.00
X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	2,296	0.00	0.00
RLX TECHNOLOGY INC-ADR	10,147	1.46	14,814.62
BEIGENE LTD-ADR	887	174.84	155,083.08
HUTCHMED CHINA-ADR	1,668	13.02	21,717.36
LEGEND BIOTECH CORP-ADR	929	45.43	42,204.47
ZAI LAB LTD-ADR	1,716	42.82	73,479.12
COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	33,401	1.84	61,457.84
CREDICORP LTD	1,372	132.37	181,611.64
TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	2,188	0.00	0.00
360 DIGITECH INC	1,806	14.46	26,114.76
LUFAX HOLDING LTD-ADR	16,053	3.96	63,569.88
KE HOLDINGS INC	6,358	15.38	97,786.04
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	10,080	0.86	8,729.28
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	9,490	3.26	30,956.38
DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	1,144	63.07	72,152.08

	米ドル 小計	316,924		3,622,937.77 (496,958,373)
メキシコペソ	CEMEX SAB-CPO	286,900	8.66	2,484,554.00
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	58,300	79.29	4,622,607.00
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	2,650	174.23	461,709.50
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	19,800	41.44	820,512.00
	ALFA S.A.B.-A	56,600	14.11	798,626.00
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	7,400	78.03	577,422.00
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	6,900	301.56	2,080,764.00
	GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	3,830	440.76	1,688,110.80
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	4,405	151.53	667,489.65
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	44,300	28.41	1,258,563.00
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	98,800	71.42	7,056,296.00
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	7,700	144.07	1,109,339.00
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	9,510	126.31	1,201,208.10
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	36,700	132.23	4,852,841.00
	GRUMA S.A.B.-B	4,125	231.85	956,381.25
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	26,700	73.56	1,964,052.00
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	30,200	30.07	908,114.00
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	48,600	127.11	6,177,546.00
GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	36,900	36.12	1,332,828.00	
AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	528,000	19.29	10,185,120.00	
	メキシコペソ 小計	1,318,320		51,204,083.30 (347,921,505)
ブラジルリアル	COSAN SA	23,200	20.83	483,256.00
	PETRO RIO SA	13,500	23.97	323,595.00
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	69,700	35.31	2,461,107.00
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	89,200	31.73	2,830,316.00
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	14,100	13.57	191,337.00
	BRASKEM SA-PREF A	2,900	33.71	97,759.00
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	12,400	15.37	190,588.00
	GERDAU SA-PREF	21,400	23.73	507,822.00
	KLABIN SA - UNIT	13,600	20.69	281,384.00
	SUZANO SA	14,007	49.97	699,929.79
	VALE SA	74,904	66.96	5,015,571.84

WEG SA	31,600	29.85	943,260.00
CCR SA	23,400	14.03	328,302.00
LOCALIZA RENT A CAR	13,810	62.75	866,577.50
RUMO SA	24,400	19.33	471,652.00
AMERICANAS SA	12,000	13.03	156,360.00
LOJAS RENNER S.A.	17,820	27.13	483,456.60
MAGAZINE LUIZA SA	48,800	3.78	184,464.00
VIBRA ENERGIA SA	21,700	18.68	405,356.00
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	8,000	20.20	161,600.00
RAIA DROGASIL SA	20,200	22.80	460,560.00
AMBEV SA	88,900	15.66	1,392,174.00
BRF SA	12,600	16.41	206,766.00
JBS SA	15,700	32.37	508,209.00
NATURA &CO HOLDING SA	14,800	14.47	214,156.00
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	88,792	7.66	680,146.72
REDE D'OR SAO LUIZ SA	7,200	34.83	250,776.00
HYPERA SA	8,000	41.77	334,160.00
BANCO BRADESCO S.A.	29,515	16.21	478,438.15
BANCO BRADESCO SA-PREF	99,936	19.61	1,959,744.96
BANCO DO BRASIL S.A.	15,800	41.05	648,590.00
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	8,100	30.01	243,081.00
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	90,800	26.64	2,418,912.00
ITAUSA SA	86,955	9.40	817,377.00
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	115,000	12.51	1,438,650.00
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	20,900	25.84	540,056.00
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	13,700	28.50	390,450.00
TOTVS SA	9,200	30.80	283,360.00
TELEFONICA BRASIL S.A.	9,700	44.37	430,389.00
TIM SA	17,100	12.26	209,646.00
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	4,800	50.04	240,192.00
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	19,700	48.17	948,949.00
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	26,934	12.82	345,293.88
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	6,600	46.57	307,362.00
CPFL ENERGIA SA	4,500	36.19	162,855.00
ENERGISA SA-UNITS	3,900	47.05	183,495.00

	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	4,075	41.80	170,335.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	18,000	24.96	449,280.00	
	ブラジルリアル 小計	1,411,848		33,797,097.44	(896,704,589)
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	7,351	7,621.00	56,021,971.00	
	EMPRESAS CMPC SA	23,076	1,723.80	39,778,408.80	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	2,663	85,000.00	226,355,000.00	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES	284,456	89.00	25,316,584.00	
	FALABELLA SA	14,299	2,010.00	28,740,990.00	
	CENCOSUD SA	25,901	1,196.00	30,977,596.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	3,292	5,038.80	16,587,729.60	
	BANCO DE CHILE	856,360	85.49	73,210,216.40	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	990	27,180.00	26,908,200.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	1,203,387	35.15	42,299,053.05	
	ENEL AMERICAS SA	383,577	98.90	37,935,765.30	
	ENEL CHILE SA	369,172	27.49	10,148,538.28	
	チリペソ 小計	3,174,524		614,280,052.43	(89,342,733)
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	89,323	2,267.00	202,495,241.00	
	BANCOLOMBIA SA	4,637	38,000.00	176,206,000.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	8,897	33,980.00	302,320,060.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	8,188	20,650.00	169,082,200.00	
	コロンビアペソ 小計	111,045		850,103,501.00	(26,600,588)
ユーロ	MYTILINEOS S.A.	1,925	16.10	30,992.50	
	OPAP SA	3,467	13.74	47,636.58	
	JUMBO SA	2,215	15.24	33,756.60	
	ALPHA SERVICES AND HOLDINGS	33,439	0.99	33,158.11	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	51,021	0.99	50,510.79	
	NATIONAL BANK OF GREECE	10,331	3.45	35,641.95	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	4,371	17.09	74,700.39	
	PUBLIC POWER CORP	3,599	5.95	21,414.05	
	ユーロ 小計	110,368		327,810.97	(45,090,398)
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	326.90	822,480.40
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	22,394	29.72	665,549.68
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	15,288	25.54	390,455.52
	KOC HOLDING AS	14,295	46.44	663,859.80
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	28,207	25.72	725,484.04
	TURK HAVA YOLLARI AO	11,099	68.50	760,281.50
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	1,092	334.80	365,601.60
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	8,276	106.40	880,566.40
	AKBANK T.A.S.	62,081	10.60	658,058.60
	HACI OMER SABANCI HOLDING	20,913	24.60	514,459.80
	TURKIYE IS BANKASI-C	55,641	6.99	388,930.59
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	19,091	18.71	357,192.61
	トルコリラ 小計	260,893		7,192,920.54 (54,558,302)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	1,528	615.00	939,720.00
	MONETA MONEY BANK AS	7,045	82.30	579,803.50
	CEZ AS	2,959	1,039.00	3,074,401.00
	チェココルナ 小計	11,532		4,593,924.50 (25,663,499)
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	7,310	2,834.00	20,716,540.00
	RICHTER GEDEON NYRT	2,477	7,970.00	19,741,690.00
	OTP BANK PLC	4,422	9,148.00	40,452,456.00
	ハンガリーフォリント 小計	14,209		80,910,686.00 (27,532,450)
ポーランドズロ チ	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	7,656	68.30	522,904.80
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	33,451	6.25	209,068.75
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	2,722	101.70	276,827.40
	LPP SA	18	9,680.00	174,240.00
	CD PROJEKT SA	1,104	88.93	98,178.72
	CYFROWY POLSAT SA	4,876	20.30	98,982.80
	ALLEGRO.EU SA	5,653	27.20	153,761.60
	DINO POLSKA SA	930	354.00	329,220.00
	BANK PEKAO SA	3,378	72.00	243,216.00

	MBANK SA	290	243.80	70,702.00	
	PKO BANK POLSKI SA	16,652	24.73	411,803.96	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	668	241.00	160,988.00	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	11,937	30.25	361,094.25	
	ORANGE POLSKA SA	11,699	6.26	73,259.13	
	PGE SA	17,929	8.96	160,715.55	
	ポーランドズロチ 小計	118,963		3,344,962.96	(96,904,580)
ロシアルーブル	GAZPROM PJSC	209,472	0.00	0.00	
	LUKOIL PJSC	7,345	0.00	0.00	
	SURGUTNEFTGAS-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	
	MAGNIT PJSC	1,334	0.00	0.00	
	SBERBANK OF RUSSIA PJSC	190,680	0.00	0.00	
	VTB BANK PJSC	65,736,000	0.00	0.00	
	MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ	22,980	0.00	0.00	
	MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JO	16,768	0.00	0.00	
	INTER RAO UES PJSC	725,000	0.00	0.00	
	ロシアルーブル 小計	67,142,439		0.00	(0)
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO-H	35,000	6.61	231,350.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	30,000	7.43	222,900.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	478,000	3.65	1,744,700.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	63,500	23.50	1,492,250.00	
	CHINA SUNTIEN GREEN ENERGY-H	38,000	3.72	141,360.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	396,000	3.43	1,358,280.00	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO-H	28,000	28.60	800,800.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	66,000	2.81	185,460.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	22,000	30.95	680,900.00	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	38,000	7.70	292,600.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	76,000	7.96	604,960.00	
	CHINA RESOURCES CEMENT	50,000	5.13	256,500.00	
	CMOC GROUP LTD-H	66,000	3.63	239,580.00	
	DONGYUE GROUP	28,000	8.44	236,320.00	

GANFENG LITHIUM CO LTD-H	6,440	70.10	451,444.00	
JIANGXI COPPER CO LTD-H	18,000	9.73	175,140.00	
MMG LTD	68,000	2.21	150,280.00	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	33,000	6.88	227,040.00	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	14,500	13.26	192,270.00	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	24,000	7.19	172,560.00	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	108,000	9.04	976,320.00	
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	44,000	4.01	176,440.00	
BOC AVIATION LTD	3,500	67.75	237,125.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	42,000	3.28	137,760.00	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	32,000	16.90	540,800.00	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	18,000	9.34	168,120.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	80,000	4.42	353,600.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	40,000	8.70	348,000.00	
CITIC LTD	110,000	8.43	927,300.00	
CRRC CORP LTD - H	81,000	2.88	233,280.00	
FOSUN INTERNATIONAL LTD	48,500	5.97	289,545.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	13,000	17.92	232,960.00	
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	19,000	8.35	158,650.00	
SINOTRUK HONG KONG LTD	11,500	8.49	97,635.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	36,000	10.80	388,800.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	12,800	14.72	188,416.00	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	10,300	39.30	404,790.00	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	31,400	3.66	114,924.00	
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL LIMITED	74,000	3.86	285,640.00	
AIR CHINA LTD-H	30,000	6.30	189,000.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	30,000	4.76	142,800.00	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	24,000	12.20	292,800.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	26,000	4.23	109,980.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	58,700	11.60	680,920.00	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	32,000	5.01	160,320.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	20,000	6.89	137,800.00	
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	2,500	235.00	587,500.00	
SHENZHEN INTL HOLDINGS	19,500	6.95	135,525.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	32,000	6.14	196,480.00	

BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	34,000	7.30	248,200.00	
BYD CO LTD-H	15,500	279.40	4,330,700.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	56,000	5.03	281,680.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	11,600	36.65	425,140.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	113,000	17.42	1,968,460.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	55,000	10.96	602,800.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	56,000	6.88	385,280.00	
MINTH GROUP LTD	14,000	20.50	287,000.00	
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	24,000	16.14	387,360.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	22,800	85.45	1,948,260.00	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	54,000	4.50	243,000.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	43,000	23.85	1,025,550.00	
LI NING CO LTD	44,000	69.10	3,040,400.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	15,500	84.10	1,303,550.00	
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	26,000	12.86	334,360.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	21,000	16.68	350,280.00	
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	14,000	17.62	246,680.00	
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	29,310	19.32	566,269.20	
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LT	23,600	15.92	375,712.00	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	200,000	0.62	124,000.00	
BAIDU INC-CLASS A	41,980	127.70	5,360,846.00	
BILIBILI INC-CLASS Z	3,497	180.70	631,907.90	
CHINA LITERATURE LTD	6,800	31.55	214,540.00	
KINGSOFT CORP LTD	17,800	24.50	436,100.00	
KUAISHOU TECHNOLOGY	32,800	74.00	2,427,200.00	
NETEASE INC	38,900	133.00	5,173,700.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	116,900	315.00	36,823,500.00	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	284,140	89.50	25,430,530.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	90,000	4.34	390,600.00	
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	10,000	16.48	164,800.00	
CHINA RUYI HOLDINGS LIMITED	92,000	2.12	195,040.00	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	21,050	59.55	1,253,527.50	
JD.COM INC - CL A	37,560	217.20	8,158,032.00	
MEITUAN	76,700	169.90	13,031,330.00	
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	10,300	19.76	203,528.00	

POP MART INTERNATIONAL GROUP	10,800	18.70	201,960.00
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	38,000	6.31	239,780.00
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	11,000	40.75	448,250.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	2,200	120.35	264,770.00
CHINA FEIHE LTD	64,000	6.65	425,600.00
CHINA MENGNIU DAIRY CO	60,000	33.30	1,998,000.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	30,000	58.10	1,743,000.00
DALI FOODS GROUP CO LTD	45,000	3.53	158,850.00
NONGFU SPRING CO LTD-H	33,200	45.80	1,520,560.00
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	32,000	16.30	521,600.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	38,000	12.34	468,920.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	12,000	76.40	916,800.00
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	21,000	6.78	142,380.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	91,000	6.22	566,020.00
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	9,000	22.00	198,000.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	12,500	38.80	485,000.00
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	6,000	20.40	122,400.00
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	6,400	41.45	265,280.00
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	32,000	5.54	177,280.00
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	12,000	17.48	209,760.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	48,800	9.70	473,360.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	16,400	10.90	178,760.00
SINOPHARM GROUP CO-H	26,400	17.04	449,856.00
3SBIO INC	31,000	5.07	157,170.00
CANSINO BIOLOGICS INC-H	1,600	60.10	96,160.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	28,000	12.04	337,120.00
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	56,000	3.31	185,360.00
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	168,000	7.96	1,337,280.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	22,000	26.95	592,900.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	1,900	74.50	141,550.00
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	24,000	15.50	372,000.00
INNOVENT BIOLOGICS INC	20,000	33.10	662,000.00
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	3,900	55.00	214,500.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	10,000	26.65	266,500.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	196,250	4.18	820,325.00

WUXI APPTTEC CO LTD-H	6,168	89.85	554,194.80
WUXI BIOLOGICS (CAYMAN) INC.	67,500	68.20	4,603,500.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	548,000	2.55	1,397,400.00
BANK OF CHINA LTD-H	1,488,000	2.75	4,092,000.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	161,000	4.59	738,990.00
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	167,000	3.30	551,100.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	1,800,000	4.91	8,838,000.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	47,000	2.37	111,390.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	73,000	40.45	2,952,850.00
CHINA MINSHENG BANKING-H	110,600	2.53	279,818.00
IND & COMM BK OF CHINA-H	1,057,000	4.05	4,280,850.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	148,000	4.81	711,880.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	181,000	1.08	195,480.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	56,000	4.15	232,400.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	27,200	14.16	385,152.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	40,000	16.26	650,400.00
FAR EAST HORIZON LTD	29,000	6.01	174,290.00
GF SECURITIES CO LTD-H	21,600	10.24	221,184.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	53,600	5.30	284,080.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	25,800	10.52	271,416.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	140,000	11.30	1,582,000.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	50,000	16.24	812,000.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	26,200	8.04	210,648.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	17,300	18.14	313,822.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	163,000	2.31	376,530.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	130,000	7.76	1,008,800.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	118,500	43.55	5,160,675.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	14,100	20.65	291,165.00
A-LIVING SMART CITY SERVICES	13,750	7.33	100,787.50
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	94,000	1.63	153,220.00
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	72,500	19.80	1,435,500.00
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	20,000	7.72	154,400.00
CHINA RESOURCES LAND LTD	60,000	30.65	1,839,000.00
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	13,400	33.15	444,210.00
CHINA VANKE CO LTD-H	32,100	14.72	472,512.00

CIFI EVER SUNSHINE SERVICES	12,000	4.95	59,400.00
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	85,280	2.17	185,057.60
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	155,000	2.49	385,950.00
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	39,000	15.38	599,820.00
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	15,000	15.14	227,100.00
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	24,000	6.82	163,680.00
HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	12,947	10.24	132,577.28
LOGAN GROUP CO LTD	23,000	2.18	50,140.00
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	34,500	25.00	862,500.00
SEAZEN GROUP LIMITED	36,000	2.89	104,040.00
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	9.39	289,212.00
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	48,000	7.26	348,480.00
GDS HOLDINGS LTD-CL A	17,324	27.10	469,480.40
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	46,000	16.02	736,920.00
MING YUAN CLOUD GROUP HOLDIN	12,000	6.18	74,160.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	20,000	13.16	263,200.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	14,000	14.68	205,520.00
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	11,000	21.40	235,400.00
KINGBOARD HOLDINGS LTD	13,000	22.30	289,900.00
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	16,500	7.18	118,470.00
LENOVO GROUP LTD	136,000	7.19	977,840.00
SUNNY OPTICAL TECH	13,400	117.20	1,570,480.00
XIAOMI CORP-CLASS B	286,800	11.66	3,344,088.00
ZTE CORP-H	15,400	17.02	262,108.00
CHINA TOWER CORP LTD-H	834,000	1.01	842,340.00
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	8,500	24.40	207,400.00
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	76,000	2.35	178,600.00
CGN POWER CO LTD-H	202,000	1.92	387,840.00
CHINA GAS HOLDINGS LTD	53,600	11.48	615,328.00
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	63,000	13.84	871,920.00
CHINA POWER INTERNATIONAL	99,000	4.67	462,330.00
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	18,000	32.45	584,100.00
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	36,000	16.40	590,400.00

	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	14,900	120.70	1,798,430.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD	56,000	7.76	434,560.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	76,000	4.28	325,280.00	
	KUNLUN ENERGY CO LTD	76,000	5.78	439,280.00	
	FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	7,000	24.80	173,600.00	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	10,000	23.90	239,000.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	92,000	11.74	1,080,080.00	
	香港ドル 小計	15,596,496		222,334,493.18 (3,886,406,940)	
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	69,800	2.32	161,936.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	5,900	22.66	133,694.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	44,400	8.74	388,056.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	68,600	4.85	332,710.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	12,300	7.49	92,127.00	
	SIME DARBY BERHAD	56,700	2.36	133,812.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	13,800	6.20	85,560.00	
	MISC BHD	26,800	6.90	184,920.00	
	GENTING BHD	41,300	4.72	194,936.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	55,700	2.98	165,986.00	
	MR DIY GROUP M BHD	47,550	2.09	99,379.50	
	IOI CORP BHD	49,600	4.23	209,808.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	8,300	22.80	189,240.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	1,300	135.00	175,500.00	
	PPB GROUP BERHAD	11,120	16.86	187,483.20	
	QL RESOURCES BHD	17,150	5.10	87,465.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	41,900	4.61	193,159.00	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	33,500	1.81	60,635.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	31,800	6.41	203,838.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	80,000	0.87	69,600.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	36,600	4.05	148,230.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	125,100	5.42	678,042.00	
HONG LEONG BANK BERHAD	12,300	20.86	256,578.00		
HONG LEONG FINANCIAL GROUP	5,300	19.62	103,986.00		
MALAYAN BANKING BHD	89,300	8.92	796,556.00		
PUBLIC BANK BERHAD	273,300	4.61	1,259,913.00		

	RHB BANK BHD	26,900	5.88	158,172.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	47,800	3.00	143,400.00	
	DIGI.COM BHD	52,900	3.66	193,614.00	
	MAXIS BHD	45,700	3.84	175,488.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	18,400	5.77	106,168.00	
	PETRONAS GAS BHD	14,000	17.20	240,800.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	48,900	8.70	425,430.00	
	INARI AMERTRON BHD	42,600	2.86	121,836.00	
	マレーシアリングット 小計	1,556,620		8,158,057.70 (249,590,880)	
タイパーツ	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	26,200	157.50	4,126,500.00	
	PTT PCL-NVDR	187,800	37.00	6,948,600.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	22,300	57.50	1,282,250.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	33,200	43.75	1,452,500.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	42,100	46.75	1,968,175.00	
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	19,800	58.00	1,148,400.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	14,700	363.00	5,336,100.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	80,600	72.00	5,803,200.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	154,900	8.95	1,386,355.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	157,400	8.40	1,322,160.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	190,600	5.50	1,048,300.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	59,300	33.50	1,986,550.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	33,225	39.75	1,320,693.75	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	111,200	14.00	1,556,800.00	
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	54,500	26.50	1,444,250.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	16,500	33.75	556,875.00	
	CP ALL PCL-NVDR	110,500	61.00	6,740,500.00	
	CARABAO GROUP PCL-NVDR	4,900	107.50	526,750.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	73,500	26.00	1,911,000.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	31,400	31.75	996,950.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	48,600	17.90	869,940.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	195,900	27.25	5,338,275.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	9,900	194.50	1,925,550.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	48,300	16.20	782,460.00	
	SCB X PCL-NVDR	15,400	105.00	1,617,000.00	

	BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR	37,300	18.60	693,780.00	
	JMT NETWORK SERVICES-NVDR	13,400	74.00	991,600.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	14,700	59.50	874,650.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	16,300	44.00	717,200.00	
	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	16,200	51.25	830,250.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	38,500	65.25	2,512,125.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	156,200	9.00	1,405,800.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	5,300	564.00	2,989,200.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	22,500	196.00	4,410,000.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	21,200	75.00	1,590,000.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	167,500	4.86	814,050.00	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	9,500	37.25	353,875.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	4,000	184.50	738,000.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	32,000	83.25	2,664,000.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	13,300	68.75	914,375.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	54,100	49.25	2,664,425.00	
	RATCH GROUP PCL-NVDR	21,900	42.25	925,275.00	
	タイパーツ 小計	2,386,625		85,484,738.75	(327,406,549)
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	29,260	60.40	1,767,304.00	
	AYALA CORPORATION	4,750	770.00	3,657,500.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	1,560	529.00	825,240.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	51,491	56.80	2,924,688.80	
	SM INVESTMENTS CORP	4,000	883.00	3,532,000.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	19,120	187.00	3,575,440.00	
	JOLLIBEE FOODS CORP	6,950	228.00	1,584,600.00	
	MONDE NISSIN CORP	123,700	16.30	2,016,310.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	17,410	127.00	2,211,070.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	34,680	95.80	3,322,344.00	
	BDO UNIBANK INC	35,410	129.30	4,578,513.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	36,812	53.50	1,969,442.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	283,000	3.78	1,069,740.00	
	AYALA LAND INC	152,200	29.55	4,497,510.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	220,800	37.95	8,379,360.00	
	CONVERGE INFORMATION AND COM	44,000	19.54	859,760.00	

	GLOBE TELECOM INC	450	2,360.00	1,062,000.00	
	PLDT INC	1,640	1,750.00	2,870,000.00	
	ACEN CORP	168,850	8.68	1,465,618.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	4,650	326.00	1,515,900.00	
	フィリピンペソ 小計	1,240,733		53,684,339.80 (131,639,369)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY TBK PT	278,800	3,250.00	906,100,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	33,800	31,650.00	1,069,770,000.00	
	ADARO MINERALS INDONESIA TBK	161,700	1,760.00	284,592,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK	175,600	2,060.00	361,736,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	559,600	910.00	509,236,000.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	53,900	8,000.00	431,200,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	220,109	4,310.00	948,669,790.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	55,300	6,575.00	363,597,500.00	
	VALE INDONESIA TBK	49,100	6,500.00	319,150,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	381,900	6,975.00	2,663,752,500.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	333,700	2,090.00	697,433,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	139,000	5,900.00	820,100,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	6,600	25,200.00	166,320,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	47,000	8,700.00	408,900,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	81,200	6,575.00	533,890,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	140,700	4,730.00	665,511,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	346,500	1,610.00	557,865,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	1,039,900	7,900.00	8,215,210,000.00	
	BANK JAGO TBK PT	70,000	9,550.00	668,500,000.00	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	351,000	8,500.00	2,983,500,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	136,500	8,500.00	1,160,250,000.00	
BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	1,279,245	4,300.00	5,500,753,500.00		
SARANA MENARA NUSANTARA PT	347,300	1,195.00	415,023,500.00		
TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	933,900	4,600.00	4,295,940,000.00		
TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	85,000	2,950.00	250,750,000.00		
	インドネシアルピア 小計	7,307,354		35,197,749,790.00 (327,339,073)	
韓国ウォン	HD HYUNDAI	813	59,200.00	48,129,600.00	
	S-OIL CORP	847	94,000.00	79,618,000.00	

SK INNOVATION CO LTD	1,042	204,500.00	213,089,000.00	
HANWHA SOLUTIONS CORP	2,345	46,600.00	109,277,000.00	
HYUNDAI STEEL CO	1,620	32,900.00	53,298,000.00	
KOREA ZINC CO LTD	158	587,000.00	92,746,000.00	
KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	307	130,500.00	40,063,500.00	
LG CHEM LTD	929	640,000.00	594,560,000.00	
LG CHEM LTD-PREFERENCE	133	308,500.00	41,030,500.00	
LOTTE CHEMICAL CORP	320	183,000.00	58,560,000.00	
POSCO CHEMICAL CO LTD	576	157,000.00	90,432,000.00	
POSCO HOLDINGS INC	1,472	255,000.00	375,360,000.00	
SK CHEMICALS CO LTD/NEW	263	99,000.00	26,037,000.00	
SK IE TECHNOLOGY CO LTD	491	89,700.00	44,042,700.00	
SKC CO LTD	401	128,000.00	51,328,000.00	
CJ CORP	193	81,000.00	15,633,000.00	
DOOSAN BOBCAT INC	883	33,400.00	29,492,200.00	
DOOSAN ENERBILITY	7,695	21,150.00	162,749,250.00	
ECOPRO BM CO LTD	940	114,000.00	107,160,000.00	
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	1,254	30,950.00	38,811,300.00	
GS HOLDINGS	848	44,350.00	37,608,800.00	
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	1,469	46,050.00	67,647,450.00	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO	355	138,500.00	49,167,500.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	1,409	56,300.00	79,326,700.00	
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	719	92,000.00	66,148,000.00	
LG CORP	1,793	83,800.00	150,253,400.00	
LG ENERGY SOLUTION	374	447,000.00	167,178,000.00	
SAMSUNG C&T CORP	1,591	120,000.00	190,920,000.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	2,961	22,450.00	66,474,450.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	12,107	6,010.00	72,763,070.00	
SK	724	231,500.00	167,606,000.00	
S-1 CORPORATION	228	60,100.00	13,702,800.00	
CJ LOGISTICS	135	124,500.00	16,807,500.00	
HMM CO LTD	4,920	23,250.00	114,390,000.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	365	178,000.00	64,970,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	3,186	26,200.00	83,473,200.00	
PAN OCEAN CO LTD	5,356	5,520.00	29,565,120.00	

HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	1,393	39,100.00	54,466,300.00	
HANON SYSTEMS	3,541	10,500.00	37,180,500.00	
HYUNDAI MOBIS CO LTD	1,161	214,500.00	249,034,500.00	
HYUNDAI MOTOR CO	2,609	190,000.00	495,710,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	610	90,600.00	55,266,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	336	89,600.00	30,105,600.00	
KIA CORP	4,953	77,200.00	382,371,600.00	
COWAY CO LTD	1,045	65,900.00	68,865,500.00	
F&F CO LTD / NEW	325	151,500.00	49,237,500.00	
HLB INC	1,659	46,350.00	76,894,650.00	
LG ELECTRONICS INC	2,001	101,000.00	202,101,000.00	
KANGWON LAND INC	1,879	26,550.00	49,887,450.00	
CHEIL WORLDWIDE INC	1,050	22,450.00	23,572,500.00	
CJ ENM CO LTD	195	98,800.00	19,266,000.00	
HYBE CO LTD	292	186,500.00	54,458,000.00	
KAKAO CORP	5,900	76,700.00	452,530,000.00	
KAKAO GAMES CORP	600	55,400.00	33,240,000.00	
KRAFTON INC	470	255,000.00	119,850,000.00	
NAVER CORP	2,475	248,000.00	613,800,000.00	
NCSOFT CORP	284	374,500.00	106,358,000.00	
NETMARBLE CORPORATION	392	66,800.00	26,185,600.00	
PEARL ABYSS CORP	460	57,800.00	26,588,000.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	602	71,900.00	43,283,800.00	
LOTTE SHOPPING CO	222	100,000.00	22,200,000.00	
BGF RETAIL CO LTD/NEW	138	171,500.00	23,667,000.00	
E-MART INC	374	104,000.00	38,896,000.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	160	416,000.00	66,560,000.00	
KT&G CORP	1,988	81,600.00	162,220,800.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	412	110,000.00	45,320,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	611	127,000.00	77,597,000.00	
AMOREPACIFIC GROUP	429	35,550.00	15,250,950.00	
LG H&H	176	714,000.00	125,664,000.00	
LG H&H-PRF	31	357,500.00	11,082,500.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	1,458	74,500.00	108,621,000.00	
SD BIOSENSOR INC	691	36,600.00	25,290,600.00	

ALTEOGEN INC	544	68,000.00	36,992,000.00	
CELLTRION INC	1,856	201,500.00	373,984,000.00	
CELLTRION PHARM INC	339	82,000.00	27,798,000.00	
GREEN CROSS CORP	90	166,500.00	14,985,000.00	
HANMI PHARM CO LTD	137	310,500.00	42,538,500.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	332	868,000.00	288,176,000.00	
SEEGENE INC	734	33,250.00	24,405,500.00	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	529	76,900.00	40,680,100.00	
SK BIOSCIENCE CO LTD	417	116,500.00	48,580,500.00	
YUHAN CORP	1,019	57,300.00	58,388,700.00	
HANA FINANCIAL GROUP	5,640	38,500.00	217,140,000.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	4,455	9,770.00	43,525,350.00	
KAKAOBANK CORP	2,253	28,650.00	64,548,450.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	7,410	50,800.00	376,428,000.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	8,726	35,700.00	311,518,200.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	9,741	12,450.00	121,275,450.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	832	60,800.00	50,585,600.00	
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	467	31,300.00	14,617,100.00	
MERITZ SECURITIES CO LTD	6,080	4,920.00	29,913,600.00	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	5,653	6,650.00	37,592,450.00	
NH INVESTMENT & SECURITIES C	2,964	9,990.00	29,610,360.00	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	1,222	35,000.00	42,770,000.00	
DB INSURANCE CO LTD	911	63,800.00	58,121,800.00	
MERITZ FIRE & MARINE INSURAN	581	39,200.00	22,775,200.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	598	201,000.00	120,198,000.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	1,532	62,200.00	95,290,400.00	
SAMSUNG SDS CO LTD	647	133,500.00	86,374,500.00	
ILJIN MATERIALS CO LTD	440	74,000.00	32,560,000.00	
L&F CO LTD	420	243,300.00	102,186,000.00	
LG DISPLAY CO LTD	4,329	16,900.00	73,160,100.00	
LG INNOTEK CO LTD	276	338,500.00	93,426,000.00	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	1,061	136,500.00	144,826,500.00	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	89,408	60,900.00	5,444,947,200.00	
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	15,431	55,800.00	861,049,800.00	
SAMSUNG SDI CO LTD	1,033	618,000.00	638,394,000.00	

	LG UPLUS CORP	4,303	12,350.00	53,142,050.00	
	SK TELECOM	476	51,000.00	24,276,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	4,725	21,500.00	101,587,500.00	
	SK HYNIX INC	10,232	96,400.00	986,364,800.00	
	SK SQUARE CO LTD	1,808	42,950.00	77,653,600.00	
	韓国ウォン 小計	301,795		19,014,427,700.00 (1,950,880,282)	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	19,000	85.70	1,628,300.00	
	ASIA CEMENT CORP	41,000	42.60	1,746,600.00	
	CHINA STEEL CORP	222,000	29.20	6,482,400.00	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	66,000	70.30	4,639,800.00	
	FORMOSA PLASTICS CORP	78,000	94.30	7,355,400.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	91,000	71.00	6,461,000.00	
	TAIWAN CEMENT	114,917	39.45	4,533,475.65	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	2,600	841.00	2,186,600.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	55,000	30.90	1,699,500.00	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	1,000	1,795.00	1,795,000.00	
	WALSIN LIHWA CORP	47,000	37.35	1,755,450.00	
	CHINA AIRLINES LTD	55,000	21.40	1,177,000.00	
	EVA AIRWAYS CORP	50,000	31.70	1,585,000.00	
	EVERGREEN MARINE CORP LTD	47,550	98.00	4,659,900.00	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	38,000	29.20	1,109,600.00	
	WAN HAI LINES LTD	12,650	100.50	1,271,325.00	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	33,000	86.40	2,851,200.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	30,000	35.35	1,060,500.00	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	4,020	456.00	1,833,120.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	8,080	176.00	1,422,080.00	
	GIANT MANUFACTURING	6,000	252.50	1,515,000.00	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	3,000	295.00	885,000.00	
	POU CHEN	45,000	29.00	1,305,000.00	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	6,000	605.00	3,630,000.00	
	MOMO.COM INC	1,200	742.00	890,400.00	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	10,000	277.50	2,775,000.00	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	92,000	65.80	6,053,600.00	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	94,265	17.70	1,668,490.50	

CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	328,000	24.60	8,068,800.00	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	241,123	28.05	6,763,500.15	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	199,168	26.80	5,337,702.40	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	165,430	23.35	3,862,790.50	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	210,125	35.80	7,522,475.00	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	183,814	17.30	3,179,982.20	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	196,708	17.50	3,442,390.00	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	184,741	27.60	5,098,851.60	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	67,000	51.00	3,417,000.00	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	26,245	219.00	5,747,655.00	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	189,437	20.80	3,940,289.60	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	149,000	47.50	7,077,500.00	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	282,000	13.90	3,919,800.00	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	133,500	60.00	8,010,000.00	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	215,835	9.02	1,946,831.70	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	23,072	63.00	1,453,536.00	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	9,000	283.00	2,547,000.00	
ACER INC	56,000	22.15	1,240,400.00	
ADVANTECH CO LTD	8,299	347.00	2,879,753.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	13,000	264.50	3,438,500.00	
AUO CORP	159,000	16.95	2,695,050.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	13,000	178.00	2,314,000.00	
COMPAL ELECTRONICS	78,000	22.90	1,786,200.00	
DELTA ELECTRONICS INC	37,000	272.50	10,082,500.00	
E INK HOLDINGS INC	16,000	241.50	3,864,000.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	233,800	111.00	25,951,800.00	
INNOLUX CORP	195,000	12.45	2,427,750.00	
INVENTEC CORP	52,000	24.05	1,250,600.00	
LARGAN PRECISION CO LTD	1,900	2,060.00	3,914,000.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	39,000	67.70	2,640,300.00	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	13,000	115.50	1,501,500.00	
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	4,000	295.00	1,180,000.00	
PEGATRON CORP	37,000	63.00	2,331,000.00	
QUANTA COMPUTER INC	48,000	79.80	3,830,400.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	26,000	56.30	1,463,800.00	

	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	24,000	163.50	3,924,000.00	
	WIWYNN CORP	1,500	760.00	1,140,000.00	
	WPG HOLDINGS LTD	26,960	49.90	1,345,304.00	
	YAGEO CORPORATION	8,198	332.00	2,721,736.00	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	13,000	116.00	1,508,000.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	72,000	121.50	8,748,000.00	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	30,000	74.20	2,226,000.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	30,000	100.00	3,000,000.00	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	62,000	90.00	5,580,000.00	
	ASMEDIA TECHNOLOGY INC	500	1,000.00	500,000.00	
	EEMORY TECHNOLOGY INC	1,000	1,455.00	1,455,000.00	
	GLOBALWAFERS CO LTD	4,000	514.00	2,056,000.00	
	MEDIATEK INC	28,800	693.00	19,958,400.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	21,000	54.30	1,140,300.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS COR	11,000	270.00	2,970,000.00	
	PARADE TECHNOLOGIES LTD	1,400	950.00	1,330,000.00	
	POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU	51,000	35.70	1,820,700.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	9,000	364.50	3,280,500.00	
	SILERGY CORP	5,640	656.00	3,699,840.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	461,000	519.00	239,259,000.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	223,000	43.00	9,589,000.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	15,000	75.00	1,125,000.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	6,000	174.00	1,044,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	50,000	22.75	1,137,500.00	
	新台湾ドル 小計	6,263,477		552,661,678.30 (2,524,503,280)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	16,143	338.25	5,460,369.75	
	COAL INDIA LTD	25,983	217.15	5,642,208.45	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	9,986	263.70	2,633,308.20	
	INDIAN OIL CORP LTD	52,920	72.15	3,818,178.00	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	43,103	134.60	5,801,663.80	
	PETRONET LNG LTD	12,992	212.95	2,766,646.40	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	56,982	2,613.85	148,942,400.70	
	ACC LTD	1,469	2,350.85	3,453,398.65	
	AMBUJA CEMENTS LTD	11,174	420.45	4,698,108.30	

ASIAN PAINTS LTD	7,189	3,482.55	25,036,051.95
BERGER PAINTS INDIA LTD	4,076	697.10	2,841,379.60
GRASIM INDUSTRIES LTD	4,892	1,605.85	7,855,818.20
HINDALCO INDUSTRIES LTD	25,302	427.35	10,812,809.70
JINDAL STEEL & POWER LTD	8,017	403.95	3,238,467.15
JSW STEEL LTD	14,544	664.55	9,665,215.20
PI INDUSTRIES LTD	1,583	3,320.65	5,256,588.95
PIDILITE INDUSTRIES LTD	2,744	2,720.80	7,465,875.20
SHREE CEMENT LTD	197	21,423.20	4,220,370.40
SRF LTD	2,838	2,455.10	6,967,573.80
TATA STEEL LTD	137,410	110.05	15,121,970.50
ULTRATECH CEMENT LTD	1,896	6,647.55	12,603,754.80
UPL LTD	9,171	768.25	7,045,620.75
VEDANTA LTD	13,970	262.00	3,660,140.00
ADANI ENTERPRISES LTD	5,192	3,130.20	16,251,998.40
BHARAT ELECTRONICS LTD	22,968	285.10	6,548,176.80
HAVELLS INDIA LTD	4,513	1,350.00	6,092,550.00
LARSEN & TOUBRO LTD	12,944	1,936.05	25,060,231.20
SIEMENS LTD	1,348	2,850.25	3,842,137.00
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	4,422	735.15	3,250,833.30
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	9,517	871.80	8,296,920.60
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	5,358	683.45	3,661,925.10
INTERGLOBE AVIATION LTD	1,928	1,970.30	3,798,738.40
BAJAJ AUTO LTD	1,154	4,074.55	4,702,030.70
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	1,609	2,168.85	3,489,679.65
BHARAT FORGE LTD	4,571	736.00	3,364,256.00
EICHER MOTORS LTD	2,527	3,424.10	8,652,700.70
HERO MOTOCORP LTD	2,256	2,838.65	6,403,994.40
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	16,376	1,239.40	20,296,414.40
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	2,272	8,778.95	19,945,774.40
MRF LTD	38	86,825.90	3,299,384.20
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN	23,659	128.15	3,031,900.85
TATA MOTORS LTD	31,271	471.00	14,728,641.00
PAGE INDUSTRIES LTD	118	50,031.95	5,903,770.10
TITAN CO LTD	6,665	2,440.60	16,266,599.00

JUBILANT FOODWORKS LTD	7,490	596.60	4,468,534.00
INFO EDGE INDIA LTD	1,429	4,454.45	6,365,409.05
TRENT LTD	3,269	1,398.15	4,570,552.35
ZOMATO LTD	27,665	61.45	1,700,014.25
AVENUE SUPERMARTS LTD	3,091	4,382.00	13,544,762.00
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	1,847	3,662.55	6,764,729.85
ITC LTD	55,909	312.00	17,443,608.00
MARICO LTD	9,787	515.95	5,049,602.65
NESTLE INDIA LTD	623	19,440.90	12,111,680.70
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	11,092	786.95	8,728,849.40
UNITED SPIRITS LTD	5,758	792.00	4,560,336.00
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	2,394	1,567.20	3,751,876.80
DABUR INDIA LTD	10,503	587.20	6,167,361.60
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	7,814	905.90	7,078,702.60
HINDUSTAN UNILEVER LTD	15,444	2,634.55	40,687,990.20
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	1,882	4,135.35	7,782,728.70
AUROBINDO PHARMA LTD	4,528	569.30	2,577,790.40
BIOCON LTD	8,322	308.15	2,564,424.30
CIPLA LTD	9,018	1,030.10	9,289,441.80
DIVI'S LABORATORIES LTD	2,293	3,696.20	8,475,386.60
DR. REDDY'S LABORATORIES	2,154	4,204.00	9,055,416.00
LUPIN LTD	4,421	688.95	3,045,847.95
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	18,064	901.35	16,281,986.40
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	1,744	1,542.75	2,690,556.00
AU SMALL FINANCE BANK LTD	3,156	638.95	2,016,526.20
AXIS BANK LTD	42,527	757.50	32,214,202.50
BANDHAN BANK LTD	12,468	281.80	3,513,482.40
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	32,231	2,468.05	79,547,719.55
ICICI BANK LTD	96,256	870.40	83,781,222.40
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	10,417	1,877.00	19,552,709.00
STATE BANK OF INDIA	33,485	520.35	17,423,919.75
YES BANK LTD	214,143	16.55	3,544,066.65
BAJAJ FINANCE LTD	5,094	7,301.70	37,194,859.80
BAJAJ FINSERV LTD	722	16,287.60	11,759,647.20
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	8,009	777.80	6,229,400.20

	MUTHOOT FINANCE LTD	2,371	1,044.05	2,475,442.55	
	PIRAMAL ENTERPRISES LTD	2,065	1,945.90	4,018,283.50	
	SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	4,350	921.00	4,006,350.00	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	3,848	1,346.85	5,182,678.80	
	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	16,905	576.65	9,748,268.25	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	4,188	1,289.30	5,399,588.40	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	6,031	576.50	3,476,871.50	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	8,533	1,296.95	11,066,874.35	
	DLF LTD	11,721	373.70	4,380,137.70	
	GODREJ PROPERTIES LTD	2,400	1,364.60	3,275,040.00	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	20,425	970.05	19,813,271.25	
	INFOSYS LTD	63,048	1,597.10	100,693,960.80	
	LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	1,030	4,892.70	5,039,481.00	
	MINDTREE LTD	1,148	3,520.70	4,041,763.60	
	MPHASIS LTD	1,375	2,394.15	3,291,956.25	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	17,341	3,385.75	58,712,290.75	
	TATA ELXSI LTD	666	10,138.75	6,752,407.50	
	TECH MAHINDRA LTD	11,055	1,104.15	12,206,378.25	
	WIPRO LTD	25,802	432.45	11,158,074.90	
	BHARTI AIRTEL LTD	41,224	732.30	30,188,335.20	
	INDUS TOWERS LTD	13,541	196.70	2,663,514.70	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	5,889	2,411.35	14,200,440.15	
	ADANI POWER LTD	15,041	411.95	6,196,139.95	
	ADANI TOTAL GAS LTD	5,050	3,390.90	17,124,045.00	
	ADANI TRANSMISSION LTD	5,050	3,635.25	18,358,012.50	
	GAIL INDIA LTD	29,821	133.15	3,970,666.15	
	INDRAPRASTHA GAS LTD	6,370	418.10	2,663,297.00	
	NTPC LTD	73,091	157.75	11,530,105.25	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	59,082	228.15	13,479,558.30	
	TATA POWER CO LTD	24,154	232.65	5,619,428.10	
	インドルピー 小計	1,782,951		1,394,164,579.55 (2,411,904,722)	
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	9,835	18.74	184,307.90	
	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	48,704	4.00	194,816.00	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	75,832	2.62	198,679.84	

	INDUSTRIES QATAR	27,513	18.12	498,535.56	
	COMMERCIAL BANK PQSC	37,796	7.61	287,892.13	
	MASRAF AL RAYAN	104,222	4.77	497,138.94	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	15,043	12.49	187,887.07	
	QATAR ISLAMIC BANK	30,915	27.06	836,559.90	
	QATAR NATIONAL BANK	86,382	22.31	1,927,182.42	
	BARWA REAL ESTATE CO	40,684	3.80	154,599.20	
	OOREDOO QPSC	12,412	9.12	113,197.44	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	8,098	20.00	161,960.00	
	カタールリアル 小計	497,436		5,242,756.40	(195,659,668)
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	4,207	213.59	898,573.13	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	2,290	231.55	530,249.50	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	983	1,168.06	1,148,202.98	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	7,937	251.70	1,997,742.90	
	GOLD FIELDS LTD	16,859	147.62	2,488,725.58	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	10,759	53.92	580,125.28	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	15,908	177.64	2,825,897.12	
	KUMBA IRON ORE LTD	1,067	415.58	443,423.86	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	5,936	168.65	1,001,106.40	
	SASOL LTD	10,618	331.36	3,518,380.48	
	SIBANYE STILLWATER LTD	53,218	38.29	2,037,717.22	
	BIDVEST GROUP LTD	5,290	225.95	1,195,275.50	
	MULTICHOICE GROUP LTD	7,242	120.20	870,488.40	
	MR PRICE GROUP LTD	4,651	192.59	895,736.09	
	NASPERS LTD-N SHS	4,085	2,473.40	10,103,839.00	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	33,135	20.55	680,924.25	
	THE FOSCHINI GROUP LTD	6,447	132.47	854,034.09	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	18,906	53.19	1,005,610.14	
	BID CORP LTD	6,193	323.00	2,000,339.00	
	CLICKS GROUP LTD	4,730	301.75	1,427,277.50	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	9,655	233.92	2,258,497.60		
SPAR GROUP LIMITED/THE	3,680	153.41	564,548.80		
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	7,294	147.43	1,075,354.42		
ABSA GROUP LTD	15,141	184.82	2,798,359.62		

	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	1,635	2,105.00	3,441,675.00	
	NEDBANK GROUP LTD	8,594	215.95	1,855,874.30	
	STANDARD BANK GROUP LTD	25,185	164.54	4,143,939.90	
	FIRSTRAND LTD	94,795	67.85	6,431,840.75	
	REINET INVESTMENTS SCA	2,729	289.47	789,963.63	
	REMGRO LTD	10,067	135.08	1,359,850.36	
	DISCOVERY LTD	8,947	132.59	1,186,282.73	
	OLD MUTUAL LTD	90,974	11.27	1,025,276.98	
	SANLAM LTD	32,128	56.89	1,827,761.92	
	NEPI ROCKCASTLE S.A.	7,950	93.63	744,358.50	
	MTN GROUP LTD	32,363	138.47	4,481,304.61	
	VODACOM GROUP LTD	11,161	133.29	1,487,649.69	
	南アフリカランド 小計	582,759		71,976,207.23 (579,408,468)	
アラブディールハム	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	59,313	4.61	273,432.93	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	50,749	9.45	479,578.05	
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	27,087	9.13	247,304.31	
	DUBAI ISLAMIC BANK	54,804	5.90	323,343.60	
	EMIRATES NBD PJSC	35,845	13.65	489,284.25	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	82,819	19.74	1,634,847.06	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	72,043	4.82	347,247.26	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	74,686	5.91	441,394.26	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	65,245	26.90	1,755,090.50	
	アラブディールハム 小計	522,591		5,991,522.22 (224,142,846)	
クウェートディナール	AGILITY	27,829	0.84	23,598.99	
	BOUBYAN BANK K.S.C	22,185	0.83	18,546.66	
	GULF BANK	31,180	0.35	10,913.00	
	KUWAIT FINANCE HOUSE	95,612	0.89	85,094.68	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	134,303	1.06	143,569.90	
	MABANEE CO KPSC	12,240	0.80	9,902.16	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	41,562	0.62	25,768.44	
	クウェートディナール 小計	364,911		317,393.83 (141,906,781)	
オフショア人民	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	32,500	4.14	134,550.00	

元

CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	8,900	29.70	264,330.00	
COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-A	3,400	14.36	48,824.00	
GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	9,700	12.50	121,250.00	
INNER MONGOLIA DIAN TON EN-A	2,700	16.41	44,307.00	
JIZHONG ENERGY RESOURCES-A	4,900	7.09	34,741.00	
OFFSHORE OIL ENGINEERING-A	500	4.24	2,120.00	
PETROCHINA CO LTD-A	21,700	5.18	112,406.00	
PINGDINGSHAN TIANAN COAL -A	3,200	12.80	40,960.00	
SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	11,700	21.08	246,636.00	
SHAN XI HUA YANG GROUP NEW-A	3,400	20.49	69,666.00	
SHANXI COKING COAL ENERGY-A	8,520	12.43	105,903.60	
SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	2,900	14.88	43,152.00	
YANKUANG ENERGY GROUP CO-A	2,891	44.63	129,025.33	
YANTAI JEREH OILFIELD-A	900	38.55	34,695.00	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	12,700	4.49	57,023.00	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	3,900	31.90	124,410.00	
ANHUI HONGLU STEEL CONSTRU-A	650	25.81	16,776.50	
ASIA-POTASH INTERNATIONAL-A	1,500	33.22	49,830.00	
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	24,500	5.35	131,075.00	
BBMG CORPORATION-A	900	2.62	2,358.00	
CHENGTON MINING GROUP CO -A	4,400	7.70	33,880.00	
CHENGXIN LITHIUM GROUP CO-A	1,400	54.76	76,664.00	
CHIFENG JILONG GOLD MINING-A	2,400	20.04	48,096.00	
CHINA JUSHI CO LTD -A	3,314	14.80	49,047.20	
CHINA MINMETALS RARE EARTH-A	1,900	28.22	53,618.00	
CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	3,500	31.33	109,655.00	
CMOC GROUP LTD-A	17,200	5.24	90,128.00	
CNGR ADVANCED MATERIAL CO -A	600	104.53	62,718.00	
CNNC HUA YUAN TITANIUM -A	4,785	8.72	41,725.20	
DO-FLUORIDE NEW MATERIALS -A	1,500	43.20	64,800.00	
GEM CO LTD-A	3,500	9.08	31,780.00	
GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	2,380	51.75	123,165.00	
HANGZHOU OXYGEN PLANT GROU-A	2,000	37.15	74,300.00	
HENAN SHENHUO COAL & POWER-A	3,500	16.98	59,430.00	
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	5,720	19.99	114,342.80	

HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	1,950	8.92	17,394.00
HESTEEL CO LTD-A	1,500	2.59	3,885.00
HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A	700	130.15	91,105.00
HUAFON CHEMICAL CO LTD -A	4,600	7.71	35,466.00
HUAI BEI MINING HOLDINGS CO-A	3,700	14.25	52,725.00
HUAXIN CEMENT CO LTD-A	1,100	17.47	19,217.00
HUBEI XINGFA CHEMICALS GRP-A	1,900	38.59	73,321.00
HUNAN VALIN STEEL CO LTD -A	3,500	4.65	16,275.00
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	44,300	2.13	94,359.00
INNER MONGOLIA EERDUOSI RE-A	2,100	18.82	39,522.00
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	3,500	4.37	15,295.00
INNER MONGOLIA YUAN XING-A	5,900	9.01	53,159.00
JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	3,200	22.65	72,480.00
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	300	108.25	32,475.00
JIANGSU YOKE TECHNOLOGY-A	500	72.01	36,005.00
JIANGXI COPPER CO LTD-A	2,000	16.85	33,700.00
JIANGXI GANFENG LITHIUM CO-A	1,540	89.09	137,198.60
KINGFA SCI.& TECH CO LTD-A	3,200	10.99	35,168.00
LB GROUP CO LTD-A	1,700	18.31	31,127.00
LUXI CHEMICAL GROUP CO LT-A	1,900	13.94	26,486.00
LUXIANG COMPANY,LTD.	400	120.07	48,028.00
MAANSHAN IRON & STEEL-A	10,000	3.04	30,400.00
NINGBO SHANSHAN CO LTD-A	2,300	28.78	66,194.00
NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	6,100	13.55	82,655.00
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	7,200	6.53	47,016.00
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	10,050	15.19	152,659.50
SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A	2,350	24.85	58,397.50
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	3,468	17.92	62,146.56
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	1,820	27.89	50,759.80
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	10,000	3.66	36,600.00
SHANDONG SUN PAPER INDUSTR-A	2,200	11.42	25,124.00
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	1,440	66.40	95,616.00
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	3,700	11.05	40,885.00
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	4,800	5.01	24,048.00
SHENGHE RESOURCES HOLDINGS-A	1,700	18.66	31,722.00

SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	1,080	47.96	51,796.80	
SHENZHEN DYNANONIC CO LTD-A	200	356.30	71,260.00	
SHENZHEN SENIOR TECHNOLOGY-A	1,798	24.51	44,068.98	
SICHUAN HEBANG BIOTECHNOL- A	14,200	3.92	55,664.00	
SICHUAN YAHUA INDUSTRIAL-A	1,900	28.46	54,074.00	
SINOMA SCIENCE&TECHNOLOGY -A	2,200	25.97	57,134.00	
SINOMINE RESOURCE GROUP CO-A	700	89.01	62,307.00	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A	600	3.19	1,914.00	
SKSHU PAINT CO LTD-A	560	91.05	50,988.00	
SUZHOU TA&A ULTRA CLEAN TE-A	800	75.16	60,128.00	
TANGSHAN JIDONG CEMENT INV-A	3,700	9.30	34,410.00	
TIANSHAN ALUMINUM GROUP CO-A	7,500	8.30	62,250.00	
TIBET SUMMIT RESOURCES CO-A	1,500	31.59	47,385.00	
TONGKUN GROUP CO LTD-A	1,500	15.23	22,845.00	
TONGLING NONFERROUS METALS-A	10,400	3.05	31,720.00	
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD-A	1,300	5.67	7,371.00	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	3,800	84.88	322,544.00	
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	400	72.84	29,136.00	
WESTERN MINING CO -A	3,300	11.02	36,366.00	
WESTERN SUPERCONDUCTING TE-A	1,000	108.05	108,050.00	
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD-A	1,200	26.01	31,212.00	
XINJIANG ZHONGTAI CHEMICAL-A	4,100	7.38	30,258.00	
YINTAI GOLD CO LTD-A	2,380	11.04	26,275.20	
YONGXING SPECIAL MATERIALS-A	700	151.81	106,267.00	
YUNNAN ALUMINIUM CO LTD-A	3,100	10.41	32,271.00	
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	1,000	197.90	197,900.00	
YUNNAN TIN CO LTD-A	3,500	15.13	52,955.00	
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	1,508	79.27	119,539.16	
ZHEJIANG JUHUA CO-A	2,300	16.49	37,927.00	
ZHEJIANG YONGTAI TECH-A	1,500	32.37	48,555.00	
ZIBO QIXIANG TENGDA CHEMIC-A	4,500	8.12	36,540.00	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	22,600	8.84	199,784.00	
AECC AERO-ENGINE CONTROL-A	1,000	30.32	30,320.00	
AECC AVIATION POWER CO-A	2,500	49.68	124,200.00	
AVIC ELECTROMECHANICAL SY-A	3,000	11.70	35,100.00	

AVICOPTER PLC-A	500	48.42	24,210.00
BEIJING EASPRING MATERIAL-A	700	85.03	59,521.00
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	1,400	27.07	37,898.00
BEIJING UNITED INFORMATION-A	580	100.76	58,440.80
CHINA BAOAN GROUP-A	4,500	16.39	73,755.00
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	4,400	26.27	115,588.00
CHINA ENERGY ENGINEERING COR	30,000	2.28	68,400.00
CHINA MEHECO CO LTD -A	2,240	13.32	29,836.80
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	9,700	9.34	90,598.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	21,400	5.59	119,626.00
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	45,100	4.95	223,245.00
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	2,700	532.00	1,436,400.00
COSCO SHIPPING DEVELOPMENT CO	18,400	2.77	50,968.00
CRRC CORP LTD-A	26,200	4.98	130,476.00
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	4,400	17.18	75,592.00
EVE ENERGY CO LTD-A	2,020	110.80	223,816.00
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	417	7.12	2,969.04
GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A	600	283.98	170,388.00
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	1,800	41.40	74,520.00
GUANGDONG KINLONG HARDWARE-A	400	88.12	35,248.00
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	1,680	41.55	69,804.00
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	1,436	50.07	71,900.52
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	5,300	24.76	131,228.00
JIANGXI SPECIAL ELECTRIC -A	2,500	24.00	60,000.00
KEDA INDUSTRIAL GROUP CO LTD	2,800	18.78	52,584.00
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A	2,200	17.12	37,664.00
LUOYANG XINQIANGLIAN SLEWI-A	340	88.90	30,226.00
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	21,800	3.19	69,542.00
MING YANG SMART ENERGY GRO-A	1,800	29.83	53,694.00
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	7,135	28.65	204,417.75
NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO -A	300	426.00	127,800.00
NINGBO ORIENT WIRES & CABL-A	1,000	80.91	80,910.00
NINGBO RONBAY NEW ENERGY T-A	450	109.40	49,230.00
NORTH INDUSTRIES GROUP RED-A	2,400	33.81	81,144.00
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	16,500	7.36	121,440.00

RIYUE HEAVY INDUSTRY CO LT-A	2,000	27.80	55,600.00	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	9,100	16.26	147,966.00	
SHANGHAI CONSTRUCTION GROU-A	5,600	2.72	15,232.00	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	10,400	4.47	46,488.00	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	2,700	62.40	168,480.00	
SICHUAN NEW ENERGY POWER CO	2,400	22.50	54,000.00	
SICHUAN ROAD&BRIDGE CO LT-A	4,500	10.17	45,765.00	
SIEYUAN ELECTRIC CO LTD-A	1,500	45.45	68,175.00	
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	1,500	138.37	207,555.00	
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	1,300	32.24	41,912.00	
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	256	522.98	133,882.88	
TBEA CO LTD-A	5,500	25.96	142,780.00	
TITAN WIND ENERGY SUZHOU-A	2,800	17.50	49,000.00	
WEICHAJ POWER CO LTD-A	9,500	11.64	110,580.00	
WUXI SHANGJI AUTOMATION CO-A	700	169.31	118,517.00	
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	7,700	5.37	41,349.00	
XIAMEN C & D INC-A	4,400	11.48	50,512.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	3,400	15.09	51,306.00	
ZHEFU HOLDING GROUP CO LTD-A	5,300	4.73	25,069.00	
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	2,000	36.25	72,500.00	
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	420	40.95	17,199.00	
ZHEJIANG HANGKE TECHNOLOGY-A	800	72.86	58,288.00	
ZHEJIANG WEIXING NEW BUILD-A	1,300	20.72	26,936.00	
ZHUZHOU CRRR TIMES ELECTRI-A	800	67.39	53,912.00	
ZHUZHOU KIBING GROUP CO LT-A	4,000	12.45	49,800.00	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	6,400	6.02	38,528.00	
BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A	2,600	5.58	14,508.00	
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	800	43.75	35,000.00	
ZHEJIANG WEIMING ENVIRONME-A	2,340	26.74	62,571.60	
AIR CHINA LTD-A	6,400	10.04	64,256.00	
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	44,000	4.57	201,080.00	
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	10,800	4.81	51,948.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	9,100	6.29	57,239.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	12,870	13.58	174,774.60	
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	16,200	6.26	101,412.00	

LIAONING PORT CO LTD-A	21,900	1.65	36,135.00
S F HOLDING CO LTD-A	5,600	49.88	279,328.00
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	1,000	56.44	56,440.00
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	8,900	5.25	46,725.00
SINOTRANS LIMITED-A	2,000	3.65	7,300.00
YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	4,000	21.21	84,840.00
YUNDA HOLDING CO LTD-A	4,870	18.87	91,896.90
BYD CO LTD -A	2,100	319.39	670,719.00
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	200	154.82	30,964.00
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	7,826	16.42	128,502.92
FAW JIEFANG GROUP CO LTD-A	3,200	8.82	28,224.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	1,900	38.99	74,081.00
GREAT WALL MOTOR CO LTD-A	3,300	30.59	100,947.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A	6,900	14.26	98,394.00
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	3,000	20.22	60,660.00
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	500	158.40	79,200.00
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	1,200	18.00	21,600.00
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	1,100	82.31	90,541.00
SAIC MOTOR CORP LTD-A	8,610	16.27	140,084.70
SAILUN GROUP CO LTD-A	3,100	11.95	37,045.00
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	1,300	24.93	32,409.00
SHENZHEN KEDALI INDUSTRY C-A	400	134.09	53,636.00
BEIJING ROBOROCK TECHNOLOG-A	280	343.00	96,040.00
ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A	600	89.36	53,616.00
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	3,100	30.46	94,426.00
HAIER SMART HOME CO LTD-A	6,900	24.31	167,739.00
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	1,000	26.16	26,160.00
JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	1,040	43.72	45,468.80
OPPEIN HOME GROUP INC-A	540	116.11	62,699.40
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	14,100	4.53	63,873.00
XIAMEN INTRETECH INC-A	510	23.86	12,168.60
ZHEJIANG SEMIR GARMENT CO-A	400	5.23	2,092.00
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	300	44.91	13,473.00
BTG HOTELS GROUP CO LTD-A	1,600	20.08	32,128.00
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	600	56.30	33,780.00

SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	8,300	5.43	45,069.00
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	1,080	12.48	13,478.40
37 INTERACTIVE ENTERTAINME-A	3,900	19.94	77,766.00
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	1,300	9.51	12,363.00
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	15,900	5.93	94,287.00
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY XI	100	298.94	29,894.00
GIANT NETWORK GROUP CO LTD-A	200	8.49	1,698.00
KUNLUN TECH CO LTD-A	800	14.98	11,984.00
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	3,110	29.54	91,869.40
PERFECT WORLD CO LTD-A	1,350	14.94	20,169.00
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	7,100	4.70	33,370.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	2,100	188.00	394,800.00
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	5,000	8.15	40,750.00
WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A	6,000	4.68	28,080.00
DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	864	30.71	26,533.44
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	546	50.17	27,392.82
ANGEL YEAST CO LTD-A	700	47.81	33,467.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	600	248.28	148,968.00
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	500	51.61	25,805.00
ANHUI YINGJIA DISTILLERY C-A	600	53.85	32,310.00
ANJOY FOODS GROUP CO LTD	400	143.65	57,460.00
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	6,600	7.46	49,236.00
BEIJING SHUNXIN AGRICULT-A	600	23.72	14,232.00
CHACHA FOOD CO LTD-A	400	47.50	19,000.00
CHONGQING BREWERY CO-A	400	110.50	44,200.00
CHONGQING FULING ZHACAI-A	700	30.19	21,133.00
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	4,609	78.17	360,285.53
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	900	19.23	17,307.00
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	1,800	62.90	113,220.00
HEILONGJIANG AGRICULTURE-A	2,500	14.35	35,875.00
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	4,800	26.21	125,808.00
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	6,900	35.78	246,882.00
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	1,000	45.41	45,410.00
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	1,600	170.85	273,360.00
JIANGXI ZHENGBANG TECH -A	2,000	5.87	11,740.00

JIUGUI LIQUOR CO LTD-A	400	147.00	58,800.00
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	300	37.56	11,268.00
JUEWEI FOOD CO LTD-A	300	47.10	14,130.00
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	1,400	1,895.01	2,653,014.00
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	1,600	216.30	346,080.00
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	5,716	58.28	333,128.48
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	7,600	15.45	117,420.00
SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT-A	1,372	23.45	32,173.40
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	1,320	265.04	349,852.80
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	400	69.69	27,876.00
TOLY BREAD CO LTD-A	980	13.68	13,406.40
TONGWEI CO LTD-A	4,900	59.96	293,804.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-A	900	103.52	93,168.00
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	7,060	24.34	171,840.40
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	4,500	173.66	781,470.00
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	2,200	45.89	100,958.00
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	1,100	15.25	16,775.00
BY-HEALTH CO LTD-A	1,300	17.05	22,165.00
PROYA COSMETICS CO LTD-A	140	163.70	22,918.00
YUNNAN BOTANEE BIO-TECHNOL-A	400	177.51	71,004.00
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	7,229	28.37	205,086.73
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	700	67.47	47,229.00
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	1,740	40.58	70,609.20
INTCO MEDICAL TECHNOLOGY C-A	540	22.77	12,295.80
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	1,180	44.40	52,392.00
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A	500	28.16	14,080.00
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	200	11.42	2,284.00
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	1,900	17.49	33,231.00
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	480	4.81	2,308.80
OVCTEK CHINA INC-A	920	43.31	39,845.20
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	4,400	16.79	73,876.00
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	1,400	289.50	405,300.00
SHENZHEN NEW INDUSTRIES BI-A	1,000	39.80	39,800.00
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	300	124.65	37,395.00
WINNING HEALTH TECHNOLOGY-A	1,040	7.89	8,205.60

APELOA PHARMACEUTICAL CO-A	900	18.44	16,596.00
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	280	171.76	48,092.80
BEIJING TIAN TAN BIOLOGICAL-A	1,296	20.60	26,697.60
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	725	133.12	96,512.00
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	300	47.85	14,355.00
BGI GENOMICS CO LTD-A	300	60.68	18,204.00
BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY COR-A	400	140.01	56,004.00
CANSINO BIOLOGICS INC-A	200	157.11	31,422.00
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	400	193.60	77,440.00
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	1,500	40.35	60,525.00
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	2,000	93.12	186,240.00
DAAN GENE CO LTD-A	960	17.60	16,896.00
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	100	36.50	3,650.00
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	1,400	27.76	38,864.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	300	103.50	31,050.00
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	1,780	19.63	34,941.40
HUMANWELL HEALTHCARE GROUP-A	1,400	20.41	28,574.00
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	300	544.50	163,350.00
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	6,916	35.90	248,284.40
JOINCARE PHARMACEUTICAL GR-A	1,600	11.00	17,600.00
JOINN LABORATORIES CHINA C-A	784	80.09	62,790.56
LIVZON PHARMACEUTICAL GROU-A	500	30.96	15,480.00
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	1,098	18.02	19,785.96
PHARMARON BEIJING CO LTD-A	1,050	71.66	75,243.00
SHANDONG BUCHANG PHARMACEU-A	260	17.88	4,648.80
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	1,900	42.62	80,978.00
SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCE-A	835	58.80	49,098.00
SHANGHAI MEDICILON INC-A	280	340.23	95,264.40
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	10,500	5.69	59,745.00
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	960	35.23	33,820.80
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	100	25.15	2,515.00
SHIJIAZHANG YILING PHARMA-A	1,400	21.52	30,128.00
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	200	21.90	4,380.00
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	1,500	44.62	66,930.00
WUXI APPTec CO LTD-A	3,128	90.41	282,802.48

YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	1,960	54.01	105,859.60	
ZHANGZHOU PIENZHEHUANG PHA-A	700	293.40	205,380.00	
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	1,210	19.96	24,151.60	
ZHEJIANG JIUZHOU PHARMACEU-A	1,300	41.39	53,807.00	
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	2,563	21.47	55,027.61	
ZHEJIANG ORIENT GENE BIOTE-A	280	108.21	30,298.80	
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A	400	44.93	17,972.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	101,400	2.83	286,962.00	
BANK OF BEIJING CO LTD -A	18,700	4.12	77,044.00	
BANK OF CHANGSHA CO LTD-A	7,500	6.92	51,900.00	
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	5,400	14.24	76,896.00	
BANK OF CHINA LTD-A	33,600	3.03	101,808.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	37,500	4.57	171,375.00	
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	5,800	13.29	77,082.00	
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	14,900	6.91	102,959.00	
BANK OF NANJING CO LTD -A	8,900	10.36	92,204.00	
BANK OF NINGBO CO LTD -A	7,900	28.71	226,809.00	
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	13,610	5.86	79,754.60	
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	9,200	5.47	50,324.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	56,300	2.84	159,892.00	
CHINA MERCHANTS BANK-A	23,600	33.85	798,860.00	
CHINA MINSHENG BANKING-A	29,800	3.63	108,174.00	
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	16,900	3.24	54,756.00	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-A	8,500	3.54	30,090.00	
HUAXIA BANK CO LTD-A	12,300	5.10	62,730.00	
IND & COMM BK OF CHINA-A	77,400	4.33	335,142.00	
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	22,400	17.80	398,720.00	
PING AN BANK CO LTD-A	23,000	12.57	289,110.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	29,400	4.52	132,888.00	
QINGDAO RURAL COMMERCIAL B-A	5,300	3.04	16,112.00	
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	36,600	7.20	263,520.00	
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A	13,900	3.28	45,592.00	
BOC INTERNATIONAL CHINA CO-A	3,000	12.67	38,010.00	
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	1,500	7.51	11,265.00	
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	6,800	5.54	37,672.00	

CHINA GALAXY SECURITIES CO-A	2,800	9.01	25,228.00
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	3,000	9.22	27,660.00
CHINA INTERNATIONAL CAPTAL-A	1,200	42.49	50,988.00
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	8,200	13.37	109,634.00
CITIC SECURITIES CO-A	13,500	19.98	269,730.00
CSC FINANCIAL CO LTD-A	5,000	26.57	132,850.00
DONGXING SECURITIES CO LT-A	6,200	8.44	52,328.00
EAST MONEY INFORMATION CO-A	15,844	22.90	362,827.60
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	3,200	16.20	51,840.00
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	500	6.34	3,170.00
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	7,200	6.87	49,464.00
GF SECURITIES CO LTD-A	5,900	16.34	96,406.00
GUANGZHOU YUEXIU FINANCIAL-A	4,374	6.49	28,387.26
GUOLIAN SECURITIES CO LTD-A	2,200	11.45	25,190.00
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	4,600	9.20	42,320.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	8,300	14.56	120,848.00
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	500	7.62	3,810.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	8,900	9.52	84,728.00
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	500	85.31	42,655.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	8,100	13.12	106,272.00
HUAXI SECURITIES CO LTD-A	300	8.11	2,433.00
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	6,700	6.31	42,277.00
NANJING SECURITIES CO LTD-A	1,600	8.61	13,776.00
NORTHEAST SECURITIES CO LT-A	3,000	7.16	21,480.00
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	10,800	8.93	96,444.00
SEALAND SECURITIES CO LTD -A	2,500	3.58	8,950.00
SHANXI SECURITIES CO LTD-A	400	5.73	2,292.00
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	27,200	4.19	113,968.00
SINOLINK SECURITIES CO LTD-A	4,300	8.70	37,410.00
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	9,700	6.77	65,669.00
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	3,800	3.89	14,782.00
WESTERN SECURITIES CO LTD-A	500	6.44	3,220.00
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	6,000	11.11	66,660.00
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD-A	10,500	7.41	77,805.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	2,500	27.17	67,925.00

CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	8,900	19.89	177,021.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	1,900	27.79	52,801.00	
PICC HOLDING CO-A	3,500	4.63	16,205.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	12,700	40.97	520,319.00	
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	8,000	14.91	119,280.00	
CHINA VANKE CO LTD -A	12,800	17.01	217,728.00	
FUTURE LAND HOLDINGS CO -A	2,400	21.51	51,624.00	
GEMDALE CORP-A	7,200	11.53	83,016.00	
JINKE PROPERTIES GROUP CO -A	700	2.56	1,792.00	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	12,800	16.81	215,168.00	
SHANGHAI LINGANG HOLDINGS-A	1,680	12.57	21,117.60	
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A	900	12.18	10,962.00	
YOUNGOR GROUP CO-A	3,100	6.30	19,530.00	
ZHEJIANG CHINA COMMODITIES-A	13,000	4.91	63,830.00	
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	8,400	7.49	62,916.00	
BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	600	170.12	102,072.00	
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	196	12.91	2,530.36	
BEIJING SINNET TECHNOLOGY-A	700	9.88	6,916.00	
DHC SOFTWARE CO LTD -A	400	6.08	2,432.00	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	3,073	31.22	95,939.06	
IFLYTEK CO LTD - A	2,500	38.94	97,350.00	
NAVINFO CO LTD-A	900	14.89	13,401.00	
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	400	98.65	39,460.00	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	2,496	38.01	94,872.96	
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	300	128.32	38,496.00	
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	3,708	20.39	75,606.12	
AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A	2,300	33.32	76,636.00	
BEIJING YUANLIU HONGYUAN E-A	200	134.03	26,806.00	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	41,400	3.95	163,530.00	
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	1,800	28.65	51,570.00	
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	2,600	9.89	25,714.00	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-A	11,000	4.41	48,510.00	
CHINA ZHENHUA GROUP SCIENC-A	500	121.35	60,675.00	
FIBERHOME TELECOM TECH CO-A	1,100	14.66	16,126.00	
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	13,500	9.52	128,520.00	

GOERTEK INC -A	3,300	36.50	120,450.00
GRG BANKING EQUIPMENT CO -A	2,200	9.20	20,240.00
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	6,900	5.76	39,744.00
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICAT-A	300	8.94	2,682.00
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	500	69.95	34,975.00
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO-A	3,700	17.47	64,639.00
HUAGONG TECH CO LTD-A	1,000	24.20	24,200.00
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	600	23.81	14,286.00
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	4,600	12.52	57,592.00
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	7,633	37.40	285,474.20
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	576	100.25	57,744.00
NINESTAR CORP-A	1,800	49.85	89,730.00
OFILM GROUP CO LTD-A	400	6.42	2,568.00
RAYTRON TECHNOLOGY CO LTD-A	700	49.95	34,965.00
SHANGHAI FRIENDESS ELECTRO-A	280	224.70	62,916.00
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	2,300	17.00	39,100.00
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	780	94.17	73,452.60
SHENZHEN SUNLORD ELECTRONI-A	800	27.46	21,968.00
SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	1,000	77.41	77,410.00
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	700	29.78	20,846.00
TIANJIN712 COMMUNICATION &-A	700	31.35	21,945.00
TIANMA MICROELECTRONICS-A	2,400	10.24	24,576.00
UNISPLENDOUR CORP LTD-A	1,876	18.38	34,480.88
WESTONE INFORMATION INDUST-A	1,300	35.50	46,150.00
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	1,200	68.71	82,452.00
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	2,665	14.63	38,988.95
WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHA-A	1,760	13.30	23,408.00
XIAMEN FARATRONIC CO LTD-A	400	190.30	76,120.00
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	900	72.66	65,394.00
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	2,400	14.41	34,584.00
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	500	33.45	16,725.00
ZHUZHOU HONGDA ELECTRONICS-A	700	58.10	40,670.00
ZTE CORP-A	3,800	24.68	93,784.00
CHINA UNITED NETWORK-A	46,500	3.58	166,470.00
CECEP SOLAR ENERGY CO LT-A	6,500	9.33	60,645.00

CECEP WIND POWER CORP-A	7,900	5.53	43,687.00
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	23,000	6.63	152,490.00
CHINA THREE GORGES RENEWAB-A	30,600	6.38	195,228.00
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	26,400	23.59	622,776.00
ENN NATURAL GAS CO LTD-A	1,900	18.61	35,359.00
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	31,000	4.00	124,000.00
HUADIAN POWER INTL CORP-A	12,500	5.74	71,750.00
HUANENG POWER INTL INC-A	11,300	7.92	89,496.00
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	6,600	10.74	70,884.00
SHENZHEN ENERGY GROUP CO L-A	600	6.68	4,008.00
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A	5,200	13.09	68,068.00
ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	943	136.80	129,002.40
AMLOGIC SHANGHAI INC-A	600	91.35	54,810.00
CHINA RESOURCES MICROELECT-A	1,200	56.38	67,656.00
FLAT GLASS GROUP CO LTD-A	2,300	40.42	92,966.00
GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A	4,300	4.31	18,533.00
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR I-A	756	119.30	90,190.80
HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	1,680	70.17	117,885.60
HANGZHOU LION ELECTRONICS -A	1,000	61.00	61,000.00
HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	2,000	43.19	86,380.00
INGENIC SEMICONDUCTOR CO -A	400	86.51	34,604.00
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	3,080	69.07	212,735.60
JCET GROUP CO LTD-A	1,900	27.14	51,566.00
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	8,736	56.12	490,264.32
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A	1,514	54.98	83,239.72
NATIONAL SILICON INDUSTRY -A	3,600	21.57	77,652.00
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	500	306.62	153,310.00
SG MICRO CORP-A	375	170.34	63,877.50
SHENZHEN SC NEW ENERGY TEC-A	300	161.14	48,342.00
STARPOWER SEMICONDUCTOR LT-A	200	415.60	83,120.00
TCL ZHONGHUAN RENEWABLE EN-A	4,300	53.78	231,254.00
TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	1,900	10.11	19,209.00
TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	800	20.18	16,144.00
TRINA SOLAR CO LTD-A	2,200	72.19	158,818.00
UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	800	227.65	182,120.00

	WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	1,485	105.45	156,593.25	
	YANGZHOU YANGJIE ELECTRONI-A	700	64.58	45,206.00	
	ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	1,800	82.06	147,708.00	
	オフショア人民元 小計	2,617,625		44,401,708.63 (890,573,950)	
サウジアラビア リアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	7,849	18.20	142,851.80	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	45,339	39.20	1,777,288.80	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	2,256	52.90	119,342.40	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	4,640	16.66	77,302.40	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	4,023	163.00	655,749.00	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	6,674	49.25	328,694.50	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	15,540	70.90	1,101,786.00	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	16,862	103.80	1,750,275.60	
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	6,906	27.10	187,152.60	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	13,830	16.04	221,833.20	
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	4,534	51.70	234,407.80	
	SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	714	217.60	155,366.40	
	JARIR MARKETING CO	1,096	182.80	200,348.80	
	ALMARAI CO	4,232	54.10	228,951.20	
	SAVOLA	4,558	33.30	151,781.40	
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	1,665	212.40	353,646.00	
	MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	955	238.80	228,054.00	
	AL RAJHI BANK	36,709	91.00	3,340,519.00	
	ALINMA BANK	18,025	39.10	704,777.50	
	ARAB NATIONAL BANK	11,172	31.60	353,035.20	
	BANK AL-JAZIRA	7,789	24.72	192,544.08	
	BANK ALBILAD	9,016	54.00	486,864.00	
	BANQUE SAUDI FRANSI	10,854	52.10	565,493.40	
	RIYAD BANK	25,334	36.65	928,491.10	
	SAUDI BRITISH BANK	17,365	42.00	729,330.00	
	SAUDI INVESTMENT BANK/THE	9,393	20.50	192,556.50	
THE SAUDI NATIONAL BANK	41,103	71.70	2,947,085.10		
SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING	708	224.60	159,016.80		
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	1,168	158.40	185,011.20		
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	10,941	14.38	157,331.58		

EMAAR ECONOMIC CITY	8,295	10.58	87,761.10	
ELM CO	483	328.60	158,713.80	
ETIHAD ETISALAT CO	7,054	37.40	263,819.60	
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	9,085	12.38	112,472.30	
SAUDI TELECOM CO	11,271	106.00	1,194,726.00	
ACWA POWER CO	1,553	174.80	271,464.40	
SAUDI ELECTRICITY CO	15,559	26.50	412,313.50	
サウジアラビアリアル 小計	394,550		21,358,158.06	(781,495,003)
合 計	115,412,936		16,730,134,828	(16,730,134,828)

(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	1,236,900.00	
		OPERADORA DE SITIOS MEX- A-1	19,700	430,839.00	
	メキシコペソ 小計		78,600	1,667,739.00	(11,331,952)
	南アフリカランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	63,261	850,860.45	
	南アフリカランド 小計		63,261	850,860.45	(6,849,426)
合 計				18,181,378	(18,181,378)

(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%		3.0%

メキシコペソ	株式	20銘柄	96.8%		2.1%
	投資証券	2銘柄		3.2%	0.1%
ブラジルリアル	株式	48銘柄	100.0%		5.4%
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%		0.3%
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	11銘柄			
香港ドル	株式	196銘柄	100.0%		23.1%
マレーシアリングット	株式	34銘柄	100.0%		1.5%
タイバーツ	株式	42銘柄	100.0%		2.0%
フィリピンペソ	株式	20銘柄	100.0%		0.8%
インドネシアルピア	株式	25銘柄	100.0%		2.0%
韓国ウォン	株式	112銘柄	100.0%		11.6%
新台湾ドル	株式	87銘柄	100.0%		15.0%
インドルピー	株式	109銘柄	100.0%		14.3%
カタールリアル	株式	12銘柄	100.0%		1.2%
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%		5.3%
サウジアラビアリアル	株式	37銘柄	100.0%		4.7%

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

R M国内リートマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2022年 8月22日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	230,780,661
投資証券	31,751,888,000
派生商品評価勘定	7,454,410
未収配当金	183,794,003
差入委託証拠金	21,122,000
流動資産合計	32,195,039,074
資産合計	
32,195,039,074	
負債の部	
流動負債	
前受金	9,174,600
未払金	49,656,300
未払解約金	22,358,900
未払利息	625
流動負債合計	81,190,425
負債合計	
81,190,425	
純資産の部	
元本等	
元本	21,244,694,454
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	10,869,154,195
元本等合計	32,113,848,649
純資産合計	
32,113,848,649	
負債純資産合計	
32,195,039,074	

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 8月22日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 8月21日
期首元本額	21,134,985,630円
期中追加設定元本額	16,740,376,530円
期中一部解約元本額	16,630,667,706円
期末元本額	21,244,694,454円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	1,081,533,589円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	1,189,358,635円
りそなラップ型ファンド(成長型)	1,023,218,924円
DCりそな グローバルバランス	24,456,364円
つみたてバランスファンド	1,648,883,822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	134,541,179円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	92,691,045円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	39,651,787円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	26,211,733円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	14,094,507円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	26,400,154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)	118,603,257円
FWりそな国内リートインデックスオープン	5,181,534,374円
FWりそな国内リートインデックスファンド	4,380,716,136円
Smart-i Jリートインデックス	2,773,582,701円
Smart-i 8資産バランス 安定型	44,476,009円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	133,467,693円
Smart-i 8資産バランス 成長型	163,687,397円
J-REITインデックスファンド(適格機関投資家専用)	2,366,458,065円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	144,594,768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)	1,439,965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)	8,373,531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)	34,643,134円
りそなDAAマルチアセットファンド(適格機関投資家専用)	11,967,510円
J-REITインデックスファンド202102(適格機関投資家専用)	141,813,569円
りそなDAAファンド202205(適格機関投資家専用)	85,635,726円
2. 計算日における受益権の総数	21,244,694,454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	1.5116円
(10,000口当たり純資産額)	(15,116円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2022年 8月22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。

金融商品の時価等に関する事項

2022年 8月22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 8月22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 8月22日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
投資証券		1,515,759,820
合計		1,515,759,820

(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 8月22日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	不動産投信指数先物取引				
	買建	353,499,090	-	360,953,500	7,454,410
	合計	353,499,090	-	360,953,500	7,454,410

（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	572	69,154,800	
	サンケイリアルエステート投資法人	902	89,929,400	
	S O S i L A 物流リート投資法人	1,316	206,217,200	
	東海道リート投資法人	341	42,386,300	
	日本アコモデーションファンド投資法人	972	666,792,000	
	森ヒルズリート投資法人	3,311	508,238,500	
	産業ファンド投資法人	4,207	769,881,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	2,815	1,024,660,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	2,019	446,602,800	
	アクティピア・プロパティーズ投資法人	1,486	636,008,000	
	G L P 投資法人	8,671	1,506,152,700	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,310	441,470,000	
	日本プロロジスリート投資法人	4,614	1,619,514,000	
	星野リゾート・リート投資法人	492	316,356,000	
	O n e リート投資法人	491	135,761,500	
	イオンリート投資法人	3,117	483,446,700	
	ヒューリックリート投資法人	2,634	439,087,800	
	日本リート投資法人	915	340,837,500	
	積水ハウス・リート投資法人	8,556	717,848,400	
	トーセイ・リート投資法人	625	86,562,500	
	ケネディクス商業リート投資法人	1,183	337,628,200	
	ヘルスケア&メディカル投資法人	694	125,336,400	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	732	92,158,800	
野村不動産マスターファンド投資法人	9,105	1,554,223,500		
いちごホテルリート投資法人	466	44,176,800		
ラサールロジポート投資法人	3,447	598,054,500		

スターアジア不動産投資法人	3,515	199,300,500	
マリモ地方創生リート投資法人	352	46,745,600	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	1,112	606,040,000	
大江戸温泉リート投資法人	454	30,599,600	
投資法人みらい	3,421	174,813,100	
森トラスト・ホテルリート投資法人	661	87,648,600	
三菱地所物流リート投資法人	869	415,816,500	
C R E ロジスティクスファンド投資法人	1,090	226,502,000	
ザイマックス・リート投資法人	457	58,724,500	
タカラレーベン不動産投資法人	1,110	124,542,000	
アドバンス・ロジスティクス投資法人	1,098	171,397,800	
日本ビルファンド投資法人	3,285	2,292,930,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	2,816	1,810,688,000	
日本都市ファンド投資法人	14,206	1,592,492,600	
オリックス不動産投資法人	5,610	1,098,438,000	
日本プライムリアルティ投資法人	1,925	781,550,000	
N T T 都市開発リート投資法人	2,706	401,299,800	
東急リアル・エステート投資法人	1,888	368,915,200	
グローバル・ワン不動産投資法人	1,929	213,926,100	
ユナイテッド・アーバン投資法人	6,338	929,784,600	
森トラスト総合リート投資法人	2,012	290,532,800	
インヴィンシブル投資法人	12,392	526,660,000	
フロンティア不動産投資法人	1,045	558,030,000	
平和不動産リート投資法人	1,924	298,027,600	
日本ロジスティクスファンド投資法人	1,898	615,901,000	
福岡リート投資法人	1,456	249,849,600	
ケネディクス・オフィス投資法人	827	588,824,000	
いちごオフィスリート投資法人	2,307	199,094,100	
大和証券オフィス投資法人	588	406,896,000	
阪急阪神リート投資法人	1,272	198,050,400	
スターツプロシード投資法人	438	110,726,400	
大和ハウスリート投資法人	4,244	1,347,470,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	9,079	629,174,700	
大和証券リビング投資法人	3,809	466,221,600	
ジャパンエクセレント投資法人	2,583	335,790,000	
合計	165,709	31,751,888,000	

(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。

R M先進国リートマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)	
2022年 8月22日現在	
資産の部	
流動資産	
預金	188,001,561
コール・ローン	27,371,372
株式	272,163,097
投資証券	30,447,747,948
派生商品評価勘定	321,874
未収入金	3,546,571
未収配当金	61,936,209
流動資産合計	31,001,088,632
資産合計	
31,001,088,632	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	26,770
未払解約金	17,301,500
未払利息	74
流動負債合計	17,328,344
負債合計	
17,328,344	
純資産の部	
元本等	
元本	19,547,199,916
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	11,436,560,372
元本等合計	30,983,760,288
純資産合計	
30,983,760,288	
負債純資産合計	
31,001,088,632	

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 8月22日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 8月21日
期首元本額	19,584,896,436円
期中追加設定元本額	15,809,486,826円
期中一部解約元本額	15,847,183,346円
期末元本額	19,547,199,916円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	1,038,651,054円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	1,239,938,689円
りそなラップ型ファンド(成長型)	1,409,885,358円
DCりそな グローバルバランス	23,490,049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	74,927,032円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	49,685,988円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	26,759,309円

りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	50,399,054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	5,811,877,499円
FWりそな先進国リートインデックスファンド	4,527,827,168円
Smart-i 先進国リートインデックス	2,354,602,013円
Smart-i 8資産バランス 安定型	87,304,241円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	265,019,457円
Smart-i 8資産バランス 成長型	320,121,824円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	134,400,255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)	1,382,884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)	3,339,908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)	55,479,272円
りそなDAAマルチアセットファンド(適格機関投資家専用)	57,917,152円
りそなDAAファンド202205(適格機関投資家専用)	78,867,377円
2. 計算日における受益権の総数	19,547,199,916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	1.5851円
(10,000口当たり純資産額)	(15,851円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2022年 8月22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。

金融商品の時価等に関する事項

2022年 8月22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 8月22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 8月22日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式		3,517,574
投資証券		975,459,979
合計		971,942,405

(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 8月22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	18,880,526	-	19,202,400	321,874
	米ドル	18,880,526	-	19,202,400	321,874
	売建	11,068,635	-	11,095,405	26,770
	オーストラリアドル	5,172,915	-	5,190,031	17,116
	シンガポールドル	5,895,720	-	5,905,374	9,654
	合計	29,949,161	-	30,297,805	295,104

(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。

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。

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	42,042	31.01	1,303,722.42	
	BROADSTONE NET LEASE INC-A	26,377	20.93	552,070.61	
		68,419		1,855,793.03	

米ドル 小計				(254,559,129)	
オーストラリア ドル	CENTURIA CAPITAL GROUP	98,180	1.90	186,542.00	
オーストラリアドル 小計		98,180		186,542.00	(17,603,968)
合 計		166,599		272,163,097	(272,163,097)

(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	14,773	253,947.87	
		AGREE REALTY CORP	11,727	930,068.37	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	11,290	218,461.50	
		ALEXANDER'S INC	350	88,630.50	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	23,180	3,781,817.00	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	1,626	29,690.76	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	8,183	242,953.27	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	46,131	1,734,986.91	
		APARTMENT INCOME REIT CO	24,523	1,086,859.36	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	23,828	219,455.88	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	33,166	562,495.36	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	10,490	148,433.50	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	5,488	53,178.72	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	21,827	4,692,368.46	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	4,380	113,135.40	
		BOSTON PROPERTIES INC	22,249	1,921,201.15	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	10,664	58,225.44	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	26,610	230,442.60	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	46,731	1,079,018.79	
		BRT APARTMENTS CORP	1,983	49,396.53	
CAMDEN PROPERTY TRUST	16,629	2,366,306.70			
CARETRUST REIT INC	15,126	332,620.74			

CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	4,000	124,080.00	
CEDAR REALTY TRUST INC	1,951	56,539.98	
CENTERSPACE	2,398	203,925.92	
CHATHAM LODGING TRUST	7,545	98,613.15	
CITY OFFICE REIT INC	7,499	93,887.48	
CLIPPER REALTY INC	2,188	19,123.12	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	3,668	146,646.64	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	17,503	476,781.72	
COUSINS PROPERTIES INC	23,187	688,885.77	
CREATIVE MEDIA & COMMUNITY T	2,000	14,060.00	
CTO REALTY GROWTH INC	3,121	68,630.79	
CUBESMART	35,044	1,756,054.84	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	32,805	310,007.25	
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	53,000	45,050.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	44,444	5,793,275.40	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	38,904	68,860.08	
DOUGLAS EMMETT INC	27,385	579,466.60	
DUKE REALTY CORP	60,021	3,810,733.29	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	82,000		
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	14,104	266,142.48	
EASTGROUP PROPERTIES INC	6,508	1,135,320.60	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	21,184	160,574.72	
EPR PROPERTIES	11,683	566,508.67	
EQUINIX INC	14,210	9,901,385.90	
EQUITY COMMONWEALTH	17,542	488,895.54	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	27,005	2,050,489.65	
EQUITY RESIDENTIAL	53,420	4,191,333.20	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	21,616	519,432.48	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	10,199	2,957,811.99	
EXTRA SPACE STORAGE INC	20,964	4,437,030.60	
FARMLAND PARTNERS INC	5,189	76,485.86	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	11,152	1,227,277.60	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	20,610	1,126,336.50	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	12,561	357,737.28	

FRANKLIN STREET PROPERTIES C	15,600	47,892.00	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	36,721	1,919,039.46	
GETTY REALTY CORP	6,324	188,581.68	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	5,979	123,526.14	
GLADSTONE LAND CORP	4,877	117,877.09	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	9,576	113,475.60	
GLOBAL NET LEASE INC	16,130	234,207.60	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	59,411	1,585,679.59	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	84,215	2,342,861.30	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	5,354	59,804.18	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	16,380	549,385.20	
HOST HOTELS & RESORTS INC	111,528	2,094,495.84	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	22,494	326,163.00	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	34,482	731,018.40	
INDUS REALTY TRUST INC	1,064	68,074.72	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	11,288	99,334.40	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	4,368	446,103.84	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	10,496	299,555.84	
INVITATION HOMES INC	95,277	3,694,842.06	
IRON MOUNTAIN INC	45,368	2,489,795.84	
JBG SMITH PROPERTIES	16,920	398,973.60	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	118,500	77,617.50	
KILROY REALTY CORP	16,375	837,090.00	
KIMCO REALTY CORP	96,448	2,192,263.04	
KITE REALTY GROUP TRUST	34,162	716,377.14	
LIFE STORAGE INC	13,173	1,797,324.12	
LTC PROPERTIES INC	6,150	276,442.50	
LXP INDUSTRIAL TRUST	44,648	492,467.44	
MACERICH CO/THE	33,447	362,231.01	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	270,600	144,771.00	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	93,654	1,493,781.30	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	18,019	3,313,153.53	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	27,447	1,288,362.18	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	13,142	737,003.36	
NATL HEALTH INVESTORS INC	7,151	475,040.93	

NECESSITY RETAIL REIT INC/TH	20,680	164,819.60	
NETSTREIT CORP	7,447	156,089.12	
NEXPOINT RESIDENTIAL	3,610	219,812.90	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	7,497	148,515.57	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	36,706	1,223,778.04	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,621	68,958.51	
ORION OFFICE REIT INC	9,765	101,556.00	
PARAMOUNT GROUP INC	25,486	192,164.44	
PARK HOTELS & RESORTS INC	36,362	542,157.42	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	20,450	393,049.00	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	611	3,421.60	
PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	17,761	607,781.42	
PHYSICIANS REALTY TRUST	35,145	625,932.45	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	19,158	248,670.84	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	6,271	135,265.47	
POSTAL REALTY TRUST INC- A	2,739	44,344.41	
PRIME US REIT	97,600	63,928.00	
PROLOGIS INC	115,566	15,495,089.28	
PUBLIC STORAGE	23,841	8,373,674.43	
REALTY INCOME CORP	93,907	6,846,759.37	
REGENCY CENTERS CORP	24,206	1,568,790.86	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	19,351	346,382.90	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	25,764	1,722,323.40	
RLJ LODGING TRUST	25,963	336,220.85	
RPT REALTY	13,222	138,698.78	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	8,597	762,124.05	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	36,026	576,776.26	
SAFEHOLD INC	2,427	106,521.03	
SAUL CENTERS INC	2,267	109,428.09	
SERVICE PROPERTIES TRUST	25,637	196,123.05	
SIMON PROPERTY GROUP INC	51,252	5,689,484.52	
SITE CENTERS CORP	28,326	409,593.96	
SL GREEN REALTY CORP	9,985	485,370.85	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	20,951	894,398.19	
STAG INDUSTRIAL INC	27,982	942,993.40	

	STORE CAPITAL CORP	39,381	1,111,331.82
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	16,588	142,159.16
	SUN COMMUNITIES INC	18,985	3,196,314.60
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	33,502	393,648.50
	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	16,257	276,206.43
	TERRENO REALTY CORP	11,795	769,151.95
	UDR INC	46,722	2,281,435.26
	UMH PROPERTIES INC	7,872	149,174.40
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1,993	109,973.74
	URBAN EDGE PROPERTIES	17,190	290,167.20
	URSTADT BIDDLE - CLASS A	4,921	89,709.83
	VENTAS INC	62,388	3,051,397.08
	VERIS RESIDENTIAL INC	12,419	176,101.42
	VICI PROPERTIES INC	150,349	5,205,082.38
	VORNADO REALTY TRUST	24,803	716,806.70
	WASHINGTON REIT	13,596	288,915.00
	WELLTOWER INC	70,864	5,639,357.12
	WHITESTONE REIT	7,537	80,645.90
	WP CAREY INC	30,099	2,648,712.00
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	17,789	312,019.06
	米ドル 小計	4,014,561	173,014,999.95 (23,732,467,543)
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	9,713	320,043.35
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	10,190	117,898.30
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	2,822	36,742.44
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	3,522	175,360.38
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	5,776	21,833.28
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	13,278	620,215.38
	CHOICE PROPERTIES REIT	24,945	358,958.55
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	7,888	130,467.52
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	8,053	137,464.71
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	19,388	241,186.72
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	4,007	78,096.43
	EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	7,098	26,191.62
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	16,692	262,565.16

	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	5,030	401,947.30
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	20,911	279,998.29
	INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	2,543	13,121.88
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	10,686	137,849.40
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	8,795	156,199.20
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	2,991	47,407.35
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	3,128	55,803.52
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	4,813	51,884.14
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	18,035	236,078.15
	PLAZA RETAIL REIT	7,567	32,689.44
	PRIMARIS REIT	7,634	109,318.88
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	23,581	502,039.49
	SLATE GROCERY REIT	4,386	65,526.84
	SLATE OFFICE REIT	6,335	28,634.20
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	11,002	323,568.82
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	14,461	274,903.61
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	7,115	44,753.35
	カナダドル 小計	292,385	5,288,747.70 (557,857,107)
ユーロ	AEDIFICA	6,118	622,812.40
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	2,209	28,937.90
	ALTAREA	737	101,853.40
	BEFIMMO	725	34,365.00
	CARE PROPERTY INVEST	4,155	93,279.75
	CARMILA	6,972	114,061.92
	COFINIMMO	4,595	493,043.50
	COVIVIO	7,371	427,149.45
	CROMWELL REIT EUR	47,140	99,936.80
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	6,180	139,050.00
	GECINA SA	8,475	792,836.25
	HAMBORNER REIT AG	10,857	93,695.91
	ICADE	4,972	226,524.32
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	8,670	31,645.50
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	41,712	262,368.48
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	3,647	95,916.10

	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	66,238	85,049.59
	KLEPIERRE	30,414	656,942.40
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	10,240	48,435.20
	MERCIALYS	7,777	66,415.58
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	51,810	502,038.90
	MONTEA NV	1,597	147,882.20
	NSI NV	2,715	87,287.25
	RETAIL ESTATES	1,763	118,826.20
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	18,182	1,020,192.02
	VASTNED RETAIL NV	2,964	67,727.40
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	22,058	726,149.36
	WERELDHAVE NV	6,199	90,443.41
	XIOR STUDENT HOUSING NV	3,246	139,740.30
	ユーロ 小計	389,738	7,414,606.49 (1,019,879,122)
英ポンド	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	66,618	53,161.16
	AEW UK REIT PLC	25,892	29,775.80
	ASSURA PLC	459,682	318,559.62
	BALANCED COMM PROPERTY TRUST	123,159	134,489.62
	BIG YELLOW GROUP PLC	26,955	369,822.60
	BRITISH LAND CO PLC	146,036	676,730.82
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	131,587	172,115.79
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	107,240	85,899.24
	CUSTODIAN REIT PLC	76,132	83,288.40
	DERWENT LONDON PLC	17,455	454,179.10
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	93,183	92,344.35
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	39,295	222,802.65
	HAMMERSON PLC	539,285	141,454.45
	HOME REIT PLC	122,590	150,540.52
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	66,388	79,001.72
	INTU PROPERTIES PLC	117,549	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	117,031	827,643.23
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	152,252	359,010.21
	LXI REIT PLC	293,497	435,549.54
	NEWRIVER REIT PLC	48,868	42,515.16
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	83,802	78,187.26

	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	207,178	301,858.34
	PRS REIT PLC/THE	84,848	90,617.66
	REGIONAL REIT LTD	74,637	55,306.01
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	32,855	373,889.90
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	97,686	53,141.18
	SEGRO PLC	187,642	1,910,195.56
	SHAFTESBURY PLC	44,671	200,304.76
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	192,207	237,375.64
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	58,694	52,002.88
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	291,333	532,556.72
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	131,485	97,693.35
	UNITE GROUP PLC	62,224	700,020.00
	WORKSPACE GROUP PLC	21,508	122,595.60
	英債券 小計	4,341,464	9,534,628.84 (1,545,372,642)
オーストラリアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	63,524	176,596.72
	ARENA REIT	53,969	237,463.60
	BWP TRUST	74,965	308,106.15
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	83,716	256,170.96
	CENTURIA OFFICE REIT	76,117	127,495.97
	CHARTER HALL GROUP	73,711	947,923.46
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	95,572	426,251.12
	CHARTER HALL RETAIL REIT	81,412	328,090.36
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	52,084	194,273.32
	CROMWELL PROPERTY GROUP	218,501	176,985.81
	DEXUS INDUSTRIA REIT	36,946	105,296.10
	DEXUS/AU	167,710	1,536,223.60
	GDI PROPERTY GROUP	81,966	76,638.21
	GOODMAN GROUP	265,414	5,438,332.86
	GPT GROUP	298,671	1,272,338.46
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	45,334	160,029.02
	HEALTHCO REIT	42,260	75,645.40
	HOME CONSORTIUM LTD	29,137	142,479.93
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	227,653	292,534.10
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	31,845	106,999.20

	INGENIA COMMUNITIES GROUP	57,243	271,904.25
	MIRVAC GROUP	614,802	1,352,564.40
	NATIONAL STORAGE REIT	170,086	418,411.56
	RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE	50,842	42,198.86
	RURAL FUNDS GROUP	59,941	158,843.65
	SCENTRE GROUP	809,929	2,251,602.62
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	173,920	488,715.20
	STOCKLAND	372,245	1,388,473.85
	VICINITY CENTRES	603,577	1,179,993.03
	WAYPOINT REIT	110,730	284,576.10
	オーストラリアドル 小計	5,123,822	20,223,157.87 (1,908,459,408)
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	145,447	194,898.98
	GOODMAN PROPERTY TRUST	161,443	360,017.89
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	240,997	247,021.92
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	199,396	281,148.36
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	73,151	201,896.76
	ニュージーランドドル 小計	820,434	1,284,983.91 (109,030,884)
香港ドル	CHAMPION REIT	290,000	1,009,200.00
	FORTUNE REIT	222,000	1,511,820.00
	LINK REIT	329,100	20,782,665.00
	PROSPERITY REIT	204,000	491,640.00
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	174,000	645,540.00
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	348,000	873,480.00
	香港ドル 小計	1,567,100	25,314,345.00 (442,494,750)
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LT	78,200	107,134.00
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	523,700	1,560,626.00
	ASCOTT TRUST	300,996	346,145.40
	CAPITALAND CHINA TRUST	174,900	197,637.00
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	795,032	1,669,567.20
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	128,400	165,636.00
	DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	52,700	37,417.00
	EC WORLD REIT	50,000	27,750.00
	ESR-LOGOS REIT	808,450	339,549.00

	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	182,200	115,697.00	
	FIRST REAL ESTATE INVNT TRUST	199,000	55,720.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	166,100	385,352.00	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL	453,979	649,189.97	
	IREIT GLOBAL	87,300	51,070.50	
	KEPPEL DC REIT	205,800	413,658.00	
	KEPPEL REIT	304,600	335,060.00	
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	284,100	238,644.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	304,500	822,150.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	498,900	893,031.00	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	340,800	661,152.00	
	MOUE COMMERCIAL REAL ESTATE INVESTMENT	415,500	153,735.00	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	59,900	291,114.00	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT	78,900	62,331.00	
	SPH REIT	145,700	136,229.50	
	STARHILL GLOBAL REIT	215,300	125,950.50	
	SUNTEC REIT	338,400	541,440.00	
	シンガポールドル 小計	7,193,357	10,382,986.07	(1,021,997,318)
韓国ウォン	D&D PLATFORM REIT CO LTD	8,140	37,647,500.00	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	21,679	120,318,450.00	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	4,000	20,720,000.00	
	JR REIT XXVII	23,911	112,859,920.00	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	4,199	23,556,390.00	
	LOTTE REIT CO LTD	21,452	110,263,280.00	
	MIRAE ASIA PAC REAL ESTATE-1	13,249	60,150,460.00	
	NH ALL-ONE REIT CO LTD	4,876	22,917,200.00	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	9,512	75,620,400.00	
	SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LTD	4,632	22,650,480.00	
	SK REITS CO LTD	12,904	71,746,240.00	
	韓国ウォン 小計	128,554	678,450,320.00	(69,609,002)
イスラエルシェケル	REIT 1 LTD	28,821	605,817.42	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LTD	33,762	360,915.78	
	イスラエルシェケル 小計	62,583	966,733.20	(40,580,172)

合計		30,447,747,948	
		(30,447,747,948)	

(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%		0.8%
	投資証券 146銘柄		98.9%	77.4%
カナダドル	投資証券 30銘柄		100.0%	1.8%
ユーロ	投資証券 29銘柄		100.0%	3.3%
英ポンド	投資証券 34銘柄		100.0%	5.0%
オーストラリアドル	株式 1銘柄	0.9%		0.1%
	投資証券 30銘柄		99.1%	6.2%
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%	1.4%
シンガポールドル	投資証券 26銘柄		100.0%	3.3%
韓国ウォン	投資証券 11銘柄		100.0%	0.2%
イスラエルシェケル	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 8月31日現在です。

【埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG】

【純資産額計算書】

資産総額	6,845,028,312円
負債総額	1,509,103円
純資産総額（ - ）	6,843,519,209円
発行済口数	6,360,107,209口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0760円

（参考）

RM国内債券マザーファンド（埼玉重視型）

純資産額計算書

資産総額	1,178,958,240円
負債総額	33円
純資産総額（ - ）	1,178,958,207円
発行済口数	1,188,701,069口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9918円

RM先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

純資産額計算書

資産総額	265,388,824,131円
負債総額	3,989,157,971円
純資産総額（ - ）	261,399,666,160円
発行済口数	286,150,350,759口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9135円

RM先進国債券マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	48,229,725,429円
負債総額	10,018,865円
純資産総額(-)	48,219,706,564円
発行済口数	42,984,468,138口
1口当たり純資産額(/)	1.1218円

R M新興国債券マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	9,675,769,068円
負債総額	73円
純資産総額(-)	9,675,768,995円
発行済口数	8,402,645,003口
1口当たり純資産額(/)	1.1515円

R M国内株式E S Gマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	2,895,583,542円
負債総額	386,876,727円
純資産総額(-)	2,508,706,815円
発行済口数	1,972,943,081口
1口当たり純資産額(/)	1.2716円

R M先進国株式E S Gマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	4,262,560,659円
負債総額	2,207,167円
純資産総額(-)	4,260,353,492円
発行済口数	2,735,742,796口
1口当たり純資産額(/)	1.5573円

R M新興国株式マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	20,203,985,311円
負債総額	302,594,363円
純資産総額（ - ）	19,901,390,948円
発行済口数	12,172,152,251口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6350円

R M国内リートマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	32,400,126,676円
負債総額	12,876,278円
純資産総額（ - ）	32,387,250,398円
発行済口数	21,251,339,564口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5240円

R M先進国リートマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	31,943,743,639円
負債総額	2,482,043,436円
純資産総額（ - ）	29,461,700,203円
発行済口数	19,435,717,531口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5159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

譲渡制限はありません。

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るときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

受益権の譲渡の対抗要件

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

(4) 受益証券の再発行

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

(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。

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

2022年8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8月末現在）

会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は取締役会の決議をもって決定します。

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

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

取締役会の決議は、議決に加わることができる取締役の過半数が出席し、出席した取締役の過半数をもって行います。

取締役は株主総会において選任されます。取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までです。監査等委員である取締役の任期は、選任後2年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までです。

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

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

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8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	120	1,321,654
単体型株式投資信託	3	10,157
単体型公社債投資信託	4	7,069
合計	127	1,338,881

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	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					株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		
		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					株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		
		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。

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。

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。

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

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。

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

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。

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)
	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)	5,202,291	未収運用 受託報酬	2,880,437
							投資助言 報酬(注2)	762,418	未収投資 助言報酬	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) 通常の見積り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
株式会社埼玉りそな銀行	70,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

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【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2021年11月19日	有価証券届出書
2021年11月19日	有価証券報告書
2022年 5月20日	有価証券届出書
2022年 5月20日	半期報告書

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

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. X B R L 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11月7日

りそなアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中有限責任監査法人トーマツ
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 山田 信之
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている埼玉りそな・グローバルバランス・プラスE S Gの2021年8月21日から2022年8月22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、埼玉りそな・グローバルバランス・プラスE S Gの2022年8月22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. X B R L データは監査の対象には含まれていません。