

【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】	2023年3月10日提出
【計算期間】	第6期(自 2021年12月11日至 2022年12月12日)
【ファンド名】	F Wりそな国内債券インデックスファンド F Wりそな国内株式インデックスファンド F W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） F W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） F Wりそな新興国債券インデックスファンド F Wりそな先進国株式インデックスファンド F Wりそな新興国株式インデックスファンド F Wりそな国内リートインデックスファンド F Wりそな先進国リートインデックスファンド
【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

< F Wりそな国内債券インデックスファンド >

NOMURA - B P I 総合の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

< F Wりそな国内株式インデックスファンド >

東証株価指数（TOPIX、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。

< F W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） >

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指して運用を行います。

< F W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） >

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。

< F Wりそな新興国債券インデックスファンド >

J P モルガン G B I - E M 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指して運用を行います。

< F Wりそな先進国株式インデックスファンド >

M S C I - K O K U S A I 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。

< F Wりそな新興国株式インデックスファンド >

M S C I エマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

< F Wりそな国内リートインデックスファンド >

東証 R E I T 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。

< F Wりそな先進国リートインデックスファンド >

S & P 先進国 R E I T 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。

ファンドの基本的性格

< F Wりそな国内債券インデックスファンド >

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)	補足分類
単位型投信	国内	株 式	インデックス型
	海外	債 券	
追加型投信	内外	不動産投信	特殊型
		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	対象インデックス
株式 一般	年1回	グローバル		
大型株	年2回	日本		
中小型株	年4回	北米		日経225
債券			ファミリーファンド	
一般	年6回	欧州		
公債	(隔月)	アジア		
社債	年12回	オセアニア		TOPIX
その他債券 (クレジット属性 ())	(毎月)	中南米		
不動産投信	日々	アフリカ	ファンド・オブ・ ファンズ	その他 (NOMURA-BPI 総合)
その他資産 (投資信託証券(債券 一般))	その他 ()	中近東 (中東)		
資産複合 ()		エマージング		
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。

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(債券 一般)))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(債券)とが異なります。

< F Wりそな国内株式インデックスファンド >

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)	補足分類
単位型投信	国内	株式	インデックス型
	海外	債券	
追加型投信	内外	不動産投信	特殊型
		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	対象インデックス
株式 一般	年1回	グローバル		
大型株	年2回	日本		
中小型株	年4回	北米		日経 225
債券 一般	年6回	欧州	ファミリーファンド	
公債	(隔月)	アジア		東証株価指数
社債	年12回	オセアニア		(TOPIX、配 当込み)
その他債券 クレジット属性 ()	(毎月)	中南米		
不動産投信	日々	アフリカ	ファンド・オブ・ ファンズ	その他 ()
その他資産 (投資信託証券(株 式一般))	その他 ()	中近東 (中東)		
資産複合 ()		エマージング		
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。

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(株式一般)))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(株式)とが異なります。

< F W 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) >

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)	補足分類
単位型投信	国内	株式	インデックス型
	海外	債券	
追加型投信	内外	不動産投信	特殊型
		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	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (除く日本)			
	年2回	日本			
	年4回	北米	ファミリーファンド	あり	日経225
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年5回 (隔月)	欧州			
	年12回 (毎月)	アジア			TOPIX
	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(債券 公債))		アフリカ			その他 (FTSE世界国債イ ンデックス(除 く日本、円換算 ベース))
		中近東 (中東)			
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型		エマージング			

(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(債券 公債)))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(債券)とが異なります。

< F W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) >

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)	補足分類
単位型投信	国内	株 式	インデックス型
	海外	債 券	
追加型投信	内外	不動産投信	特殊型
		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	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (除く日本)			
	年2回	日本			
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年4回	北米	ファミリーファンド	あり (フルヘッジ)	日経225
	年6回 (隔月)	欧州			
不動産投信	年12回 (毎月)	アジア			TOPIX
	日々	オセアニア			
その他資産 (投資信託証券(債券 公債))	その他 ()	中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	なし	その他 (FTSE世界国債イ ンデックス(除 く日本、円ヘッ ジ・円ベー ス))
	資産複合 ()	アフリカ			
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型		中近東 (中東)			
		エマージング			

(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(債券 公債)))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(債券)とが異なります。

< F W りそな新興国債券インデックスファンド >

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)	補足分類
単位型投信	国内	株 式	インデックス型
	海外	債 券	
追加型投信	内外	不動産投信	特殊型
		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	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル			
	年2回	日本			
	年4回	北米			日経225
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	ファミリーファンド	あり	
	年12回 (毎月)	アジア			TOPIX
	日々	オセアニア			
不動産投信	日々	中南米			
その他資産 (投資信託証券(債券 公債))	その他 ()	アフリカ	ファンド・オブ・ ファンズ	なし	その他 (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))
資産複合 ()		中近東 (中東)			
資産配分固定型 資産配分変更型		エマージング			

(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(債券 公債)))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(債券)とが異なります。

< F Wりそな先進国株式インデックスファンド >

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)	補足分類
単位型投信	国内	株式	インデックス型
	海外	債券	
追加型投信	内外	不動産投信	特殊型
		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	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (除く日本)			
	年2回	日本			
	年4回	北米	ファミリーファンド	あり	日経225
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			TOPIX
	日々	オセアニア			
不動産投信	日々	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(株式一般))	その他 ()	アフリカ			その他 (MSCI-KOKUSAI 指数(配当込 み、円換算ベ ース))
資産複合 ()		中近東 (中東)			
資産配分固定型 資産配分変更型		エマージング			

(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(株式一般)))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(株式)とが異なります。

< F W I りそな新興国株式インデックスファンド >

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)	補足分類
単位型投信	国内	株式	インデックス型
	海外	債券	
		不動産投信	
追加型投信	内外	その他資産 ()	特殊型
		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	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル			
	年2回	日本			
	年4回	北米			日経225
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年5回 (隔月)	欧州	ファミリーファンド	あり	
	年12回 (毎月)	アジア			TOPIX
	日々	オセアニア			
不動産投信		中南米			
その他資産 (投資信託証券(株式 一般))	その他 ()	アフリカ	ファンド・オブ・ファンズ	なし	その他 (MSCI エマージング・マーケット 指数(配当込み、円換算ベース))
		中近東 (中東)			
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型		エマージング			

(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(株式 一般)))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(株式)とが異なります。

< F Wりそな国内リートインデックスファンド >

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)	補足分類
単位型投信	国内	株式	インデックス型
	海外	債券	
追加型投信	内外	不動産投信	特殊型
		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	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル		
	年2回	日本		
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年4回	北米	ファミリーファンド	日経 225
	年6回 (隔月)	欧州		
不動産投信	年12回 (毎月)	アジア		TOPIX
	日々	オセアニア		
その他資産 (投資信託証券(不動産投信))	日々	中南米	ファンド・オブ・ファンズ	その他 (東証 REIT 指数 (配当込み))
	その他 ()	アフリカ		
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型		中近東 (中東)		
		エマージング		

(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。

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(不動産投信)))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(不動産投信)とが異なります。

<FWりそな先進国リートインデックスファンド>

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)	補足分類
単位型投信	国内	株式 債券	インデックス型
	海外	不動産投信	特殊型
追加型投信	内外	その他資産 () 資産複合	

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

2) 属性区分

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回 年2回 年4回	グローバル (除く日本) 日本			日経225
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年6回 (隔月) 年12回 (毎月)	北米 欧州 アジア オセアニア	ファミリーファンド	あり	T O P I X
不動産投信	日々 その他 ()	中南米 アフリカ 中近東 (中東) エマージング	ファンド・オブ・ ファンズ	なし	その他 (S&P先進国REIT 指数(除く日 本、配当込み、 円換算ペー ス))
その他資産 (投資信託証券(不 動産投信))					
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(不動産投信)))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(不動産投信)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」による区分のほか、特にクレジットに対して明確な記載があるものについては、上記 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

「FW専用ファンド(スタンダードコース)」は、原則として、投資者と株式会社りそな銀行が締結する投資一任契約に基づいて、資産を管理する口座の資金を運用するための専用ファンドです。

- 「FW専用ファンド(スタンダードコース)」の受益権の取得申込者は、株式会社りそな銀行と投資一任契約を締結する必要があります。

※投資一任業者である株式会社りそな銀行は、投資者との投資一任契約に基づく運用財産の効率的な運営および維持のため、ファンドを買い付ける場合があります。

2

「FW専用ファンド(スタンダードコース)」を構成する各ファンドは、各マザーファンドを通じて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。

■ ファンドの仕組み



3 各ファンドの運用方針は以下の通りです。

FWりそな国内債券インデックスファンド

1. 国内の債券を実質的な主要投資対象とし、NOMURA-BPI総合*の動きに連動する投資成果を目指します。

*[NOMURA-BPI総合]は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表する、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で一定の組入基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスをもとに計算されます。

2. RM国内債券マザーファンドを通じて、国内の債券への投資を行います。
 - NOMURA-BPI総合への連動性を高めるため、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。

FWりそな国内株式インデックスファンド

1. 国内の株式を実質的な主要投資対象とし、東証株価指数(TOPIX、配当込み)*の動きに連動する投資成果を目指します。

*[東証株価指数(TOPIX、配当込み)]は、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、配当を考慮したものです。

2. RM国内株式マザーファンドを通じて、国内の株式への投資を行います。
 - 東証株価指数(TOPIX、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)または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。

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)

1. 日本を除く先進国の債券を実質的な主要投資対象とし、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指します。

*[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指数です。

2. RM先進国債券マザーファンドを通じて、日本を除く先進国の債券への投資を行います。
 - 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。
3. 実質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。

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)

1. 日本を除く先進国の債券を実質的な主要投資対象とし、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ます。

*[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指数で、為替ヘッジを考慮したものです。

2. RM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)を通じて、日本を除く先進国の債券への投資を行います。

- 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。

3. 為替ヘッジはマザーファンドにおいて行うため、当ファンドにおいては原則として為替ヘッジを行いません。

FWりそな新興国債券インデックスファンド

1. 新興国の現地通貨建て債券を実質的な主要投資対象とし、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指して運用を行います。

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

2. RM新興国債券マザーファンドを通じて、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)への投資を行います。

- 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)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。

3. 実質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。

FWりそな先進国株式インデックスファンド

1. 日本を除く先進国の株式を実質的な主要投資対象とし、MSCI-KOKUSAI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-KOKUSAI指数(配当込み、円換算ベース)]は、MSCI-KOKUSAI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指数(米ドルベース)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。

2. RM先進国株式マザーファンドを通じて、日本を除く先進国の株式*または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)への投資を行います。

- MSCI-KOKUSAI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。

*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券等を含みます。

3. 実質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。

FWりそな新興国株式インデックスファンド**1. 新興国の株式を実質的な主要投資対象とし、MSCIエマージング・マーケット指数(配当込み、円換算ベース)*の動きに連動する投資成果を目指します。**

*[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す。

2. RM新興国株式マザーファンドを通じて、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)への投資を行います。

- MSCIエマージング・マーケット指数(配当込み、円換算ベース)への連動性を高めるため、海外の金融商品取引市場に上場する株価指数先物取引を活用することがあります。

*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。

3. 実質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。**FWりそな国内リートインデックスファンド****1. 国内の不動産投資信託証券を実質的な主要投資対象とし、東証REIT指数(配当込み)*の動きに連動する投資成果を目指します。**

*[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。

2. RM国内リートマザーファンドを通じて、国内の不動産投資信託証券*への投資を行います。

- 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。

*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。

FWりそな先進国リートインデックスファンド**1. 日本を除く先進国の不動産投資信託証券を実質的な主要投資対象とし、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。**

*[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す。

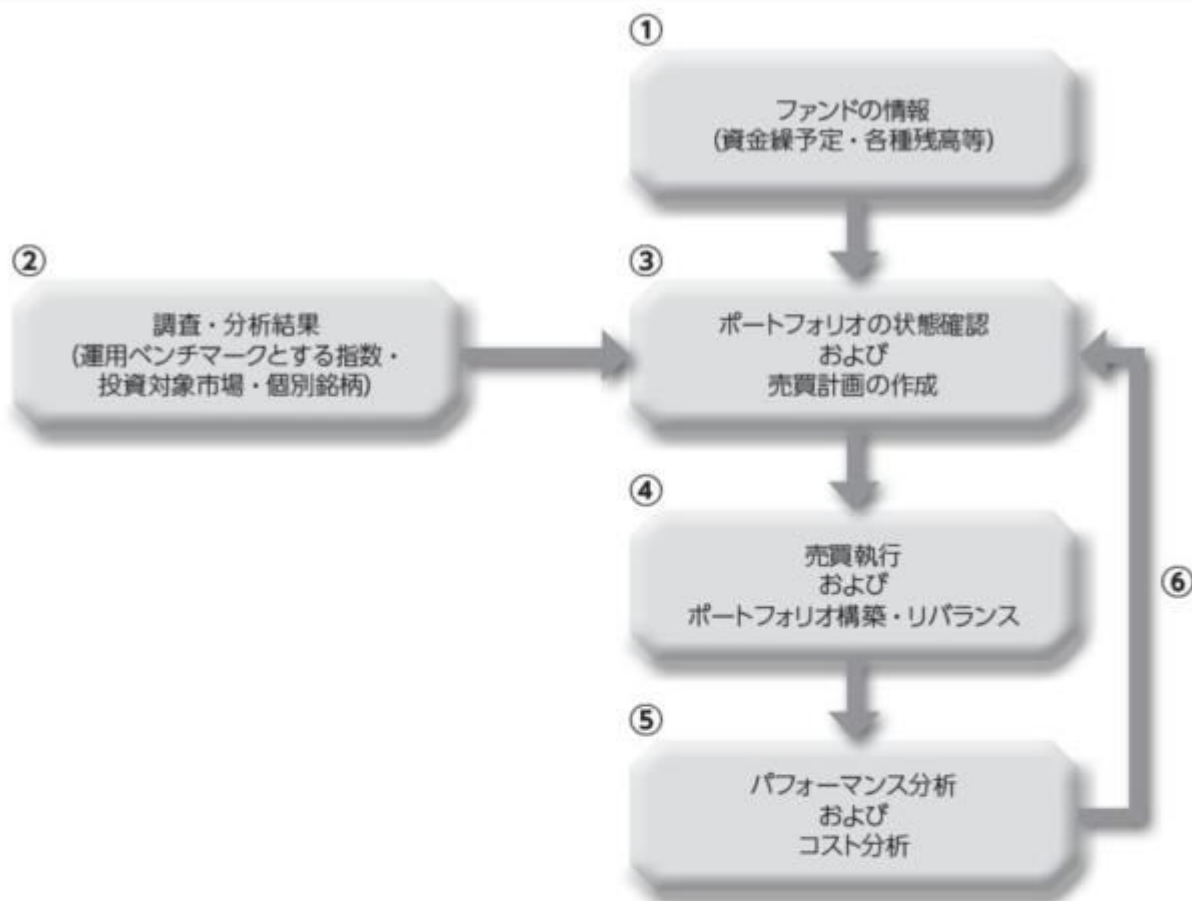
2. RM先進国リートマザーファンドを通じて、日本を除く先進国の不動産投資信託証券*および不動産関連株式または先進国の不動産投資信託証券に関する指数を対象指数としたETF(上場投資信託証券)への投資を行います。

- 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。

*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。

3. 実質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。

■ 運用プロセスのイメージ



- ① 設定・解約による資金繰予定のほか、個別銘柄・現金等の残高・取引履歴情報を確認します。
- ② 運用ベンチマークとする指数および投資対象となる市場・個別銘柄に関する調査・分析を行います。
- ③ 各種情報を基にポートフォリオの状態を確認し、必要に応じて個別銘柄の売買計画を作成します。
- ④ 売買執行（市場での個別銘柄等の売買）により、ポートフォリオの構築・リバランスを行います。
- ⑤ 運用パフォーマンスや運用ベンチマークとの連動性、売買執行に要したコストの分析等を行います。
- ⑥ 上記⑤の分析結果を反映し、継続的な運用の改善につなげます。

※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。

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

● FWりそな国内債券インデックスファンド

- 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限りま
す。）の行使等により取得したものに限りま。株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下
とします。
- 投資信託証券（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。

● FWりそな国内株式インデックスファンド

- 株式への実質投資割合には、制限を設けません。
- 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。

● 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）

● 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）

● FWりそな新興国債券インデックスファンド

- 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限りま
す。）の行使等により取得したものに限りま。株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下
とします。
- 投資信託証券（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。

● FWりそな先進国株式インデックスファンド

● FWりそな新興国株式インデックスファンド

- 株式への実質投資割合には、制限を設けません。
- 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。

● FWりそな国内リートインデックスファンド

- 不動産投資信託証券および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。

● FWりそな先進国リートインデックスファンド

- 不動産投資信託証券および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12月10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国内債券マザーファンド

「NOMURA-BPI総合」は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表する、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で一定の組入基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスをもとに計算されます。NOMURA-BPI総合の知的財産権とその他の一切の権利は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属しています。野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、NOMURA-BPI総合指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

●RM国内株式マザーファンド

「東証株価指数(TOPIX、配当込み)」は、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、配当を考慮したものです。なお、TOPIXに関する著作権、知的財産権その他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先進国株式マザーファンド

「MSCI-KOKUSAI指数(配当込み、円換算ベース)」は、MSCI-KOKUSAI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指数(米ドルベース)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。

信託金限度額

- ・ F Wりそな国内債券インデックスファンド：5,000億円を限度として信託金を追加することができます。
- ・ F Wりそな国内株式インデックスファンド：3,000億円を限度として信託金を追加することができます。
- ・ F W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)：3,000億円を限度として信託金を追加することができます。
- ・ F W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)：3,000億円を限度として信託金を追加

することができます。

- ・ F Wりそな新興国債券インデックスファンド：2,000億円を限度として信託金を追加することができます。
- ・ F Wりそな先進国株式インデックスファンド：3,000億円を限度として信託金を追加することができます。
- ・ F Wりそな新興国株式インデックスファンド：1,000億円を限度として信託金を追加することができます。
- ・ F Wりそな国内リートインデックスファンド：1,000億円を限度として信託金を追加することができます。
- ・ F Wりそな先進国リートインデックスファンド：1,000億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】

2017年1月5日

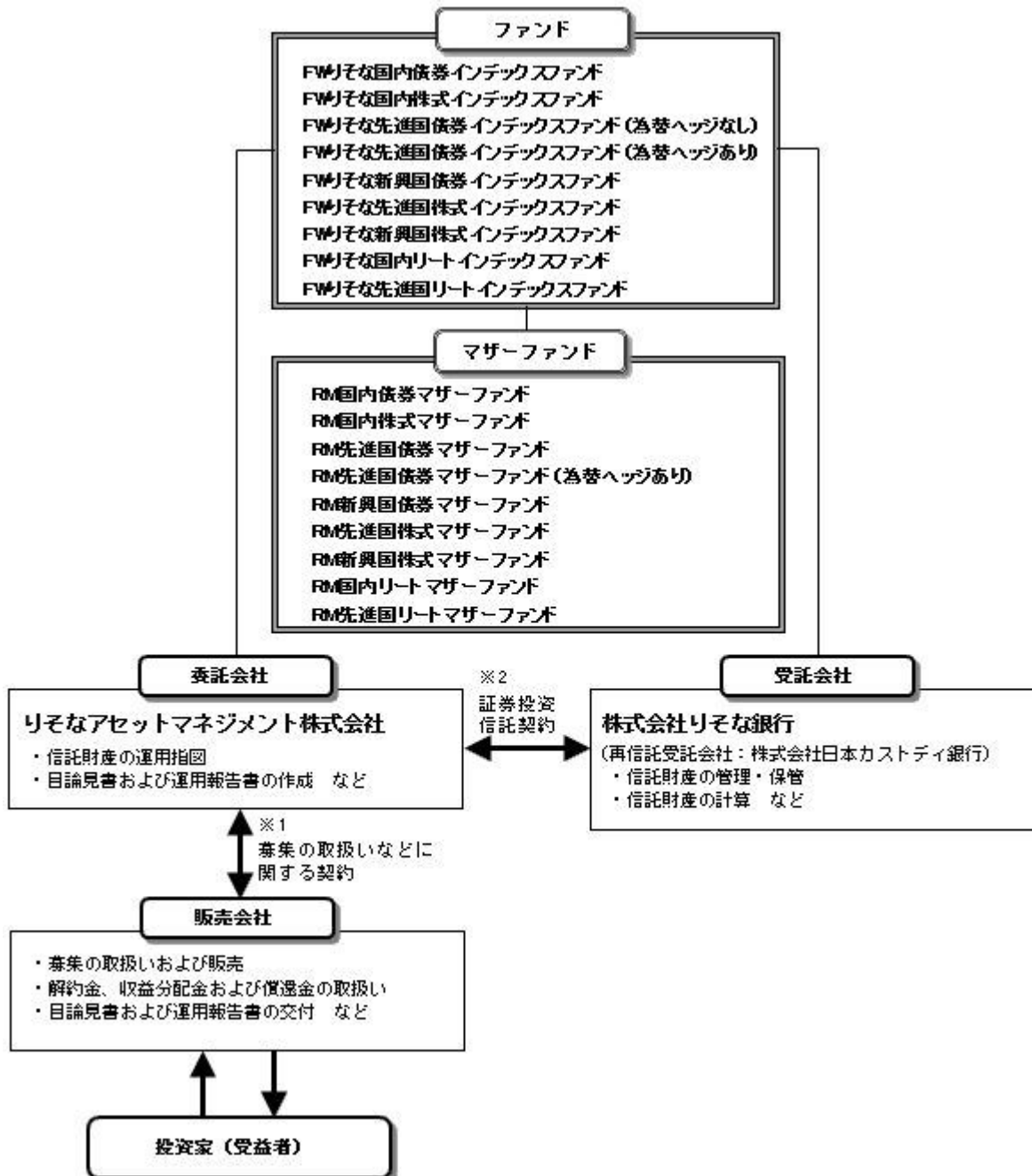
- ・ ファンドの信託契約締結、当初自己設定、運用開始

2021年3月11日

- ・ ファンド総称変更
新総称：F W専用ファンド(スタンダードコース)
旧総称：りそなファンドラップ(スタンダードコース)

(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です。販売会社が行なう募集の取扱い、収益分配金・償還金の支払い、解約請求の受付の業務範囲の取決めの内容などが含まれています。
- 2 投資信託を運営するルールを委託会社と受託会社の間で規定したものです。運用の基本方針、投資対象、投資制限、信託報酬、受益者の権利、募集方法の取決めの内容などが含まれています。

委託会社の概況（2022年12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】

< F Wりそな国内債券インデックスファンド >

主として、マザーファンド受益証券への投資を通じ、NOMURA - B P I 総合に採用されている国内の債券に投資し、NOMURA - B P I 総合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、NOMURA - B P I 総合への連動性を高めるため、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。

マザーファンド受益証券への投資比率は、原則として高位を保ちます。

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。

< F Wりそな国内株式インデックスファンド >

主として、マザーファンド受益証券への投資を通じ、東証株価指数（T O P I X、配当込み）に採用されている国内の株式に投資し、東証株価指数（T O P I X、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、東証株価指数（T O P I X、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E T F（上場投資信託証券）または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。

マザーファンド受益証券への投資比率は、原則として高位を保ちます。

非株式割合（株式以外の資産への実質投資割合）は、原則として信託財産総額の50%以下を基本とします。

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。

< F W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） >

主として、マザーファンド受益証券への投資を通じ、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E T F（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。

マザーファンド受益証券への投資比率は、原則として高位を保ちます。

実質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。

< F W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） >

主として、マザーファンド受益証券への投資を通じ、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E T F（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。

マザーファンド受益証券への投資比率は、原則として高位を保ちます。

為替ヘッジはマザーファンドにおいて行うため、当ファンドにおいては原則として為替ヘッジを行いません。

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。

< F Wりそな新興国債券インデックスファンド >

主として、マザーファンド受益証券への投資を通じ、J P モルガン G B I - E M グローバル・ダイバースファイド（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指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。

マザーファンド受益証券への投資比率は、原則として高位を保ちます。

実質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。

<FWりそな先進国株式インデックスファンド>

主として、マザーファンド受益証券への投資を通じ、先進国株式または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)に投資し、MSCI-KOKUSA I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-KOKUSA I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。

マザーファンド受益証券への投資比率は、原則として高位を保ちます。

実質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。

<FWりそな新興国株式インデックスファンド>

主として、マザーファンド受益証券への投資を通じ、新興国の株式または新興国株式の指数を対象指数としたETF(上場投資信託証券)に投資し、MSCIエマージング・マーケット指数(配当込み、円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、MSCIエマージング・マーケット指数(配当込み、円換算ベース)への連動性を高めるため、海外の金融商品取引市場に上場する株価指数先物取引を活用することがあります。

マザーファンド受益証券への投資比率は、原則として高位を保ちます。

実質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。

<FWりそな国内リートインデックスファンド>

主として、マザーファンド受益証券への投資を通じ、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目指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。

マザーファンド受益証券への投資比率は、原則として高位を保ちます。

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。

<FWりそな先進国リートインデックスファンド>

主として、マザーファンド受益証券への投資を通じ、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。

マザーファンド受益証券への投資比率は、原則として高位を保ちます。

実質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。

指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映するための手法については、前述の「運用プロセスのイメージ」をご参照ください。

（２）【投資対象】

< F Wりそな国内債券インデックスファンド >

R M国内債券マザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。なお、国内の債券に直接投資することがあります。

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（本邦通貨表示のものに限ります。）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20条、第21条および第22条に定めるものに限ります。）
 - ハ) 約束手形（イ）に掲げるものに該当するものを除きます。）
 - ニ) 金銭債権（イ）、ロ）およびハ）に掲げるものに該当するものを除きます。）
- 2) 次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ) 為替手形

有価証券の指図範囲

委託者は、信託金を、主として、親投資信託「R M国内債券マザーファンド」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) 転換社債の転換、新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した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) コマーシャル・ペーパー
- 8) 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7) までの証券または証書の性質を有するもの
- 9) 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。）
- 10) 投資証券、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。）
- 11) 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。）
- 12) 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。）
- 13) 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。）
- 14) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 15) 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。）
- 16) 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。）
- 17) 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって15) 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8) および13) 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10)の証券のうち投資法人債券ならびに8)および13)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、9)の証券および10)の証券(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、上記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

先物取引等の運用指図、スワップ取引の運用指図、金利先渡取引の運用指図、有価証券の貸付けの指図、資金の借入れの指図を行うことができます。

< F Wりそな国内株式インデックスファンド >

R M国内株式マザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。なお、国内の株式に直接投資することがあります。

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(本邦通貨表示のものに限ります。)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条および第23条に定めるものに限ります。)
- ハ) 約束手形(イ)に掲げるものに該当するものを除きます。)
- ニ) 金銭債権(イ)、ロ)およびハ)に掲げるものに該当するものを除きます。)
- 2) 次に掲げる特定資産以外の資産
- イ) 為替手形

有価証券の指図範囲

委託者は、信託金を、主として、親投資信託「R M国内株式マザーファンド」の受益証券、ならびに次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図することができます。

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

- 10) コマーシャル・ペーパー
- 11) 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
- 12) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1) から11) までの証券または証書の性質を有するもの
- 13) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
- 14) 投資証券、新投資口予約権証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
- 15) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
- 16) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。）
- 17) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
- 18) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 19) 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）
- 20) 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
- 21) 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって19) の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

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

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、金利先渡取引の運用指図、有価証券の貸付けの指図、資金の借入れの指図を行うことができます。

< F W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） >

R M先進国債券マザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。なお、日本を除く先進国の債券に直接投資することがあります。

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20条、第21条および第22条に定めるものに限ります。）
 - ハ) 約束手形（イ）に掲げるものに該当するものを除きます。）
 - ニ) 金銭債権（イ）、ロ）およびハ）に掲げるものに該当するものを除きます。）
- 2) 次に掲げる特定資産以外の資産

イ) 為替手形

有価証券の指図範囲

委託者は、信託金を、主として、親投資信託「RM先進国債券マザーファンド」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) 転換社債の転換、新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した株券または新株引受権証書
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券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) コマーシャル・ペーパー
- 8) 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7) までの証券または証書の性質を有するもの
- 9) 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。）
- 10) 投資証券、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。）
- 11) 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。）
- 12) 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。）
- 13) 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。）
- 14) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 15) 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。）
- 16) 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。）
- 17) 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって15) 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8) および13) 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10) の証券のうち投資法人債券ならびに8) および13) 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、9) の証券および10) の証券（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

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、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。

< F W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） >

R M先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）の受益証券を主要投資対象とします。なお、日本を除く先進国の債券に直接投資することがあります。

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20条、第21条および第22条に定めるものに限ります。）
 - ハ) 約束手形（イ）に掲げるものに該当するものを除きます。）
 - ニ) 金銭債権（イ）、ロ）およびハ）に掲げるものに該当するものを除きます。）
- 2) 次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ) 為替手形

有価証券の指図範囲

委託者は、信託金を、主として、親投資信託「R M先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）」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) 転換社債の転換、新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した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) コマーシャル・ペーパー
- 8) 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7) までの証券または証書の性質を有するもの
- 9) 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。）
- 10) 投資証券、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。）
- 11) 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。）
- 12) 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。）
- 13) 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。）
- 14) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 15) 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。）
- 16) 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。）
- 17) 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって15) 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8) および13) 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10) の証券のうち投資法人債券ならびに8) および13) 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、9) の証券および10) の証券（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

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、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。

< F Wりそな新興国債券インデックスファンド >

R M新興国債券マザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。なお、新興国の債券に直接投資することがあります。

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20条、第21条、第22条および第23条に定めるものに限り。)
 - 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、親投資信託「R M新興国債券マザーファンド」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) 転換社債の転換、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、社債権者割当または株主割当により取得した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) コマーシャル・ペーパー
- 8) 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7) までの証券または証書の性質を有するもの
- 9) 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。)
- 10) 投資証券、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。)
- 11) 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。)
- 12) 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。）

13) 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。）

14) 外国法人が発行する譲渡性預金証書

15) 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。）

16) 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。）

17) 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって15)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8)および13)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10)の証券のうち投資法人債券ならびに8)および13)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、9)の証券および10)の証券（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

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。

< F Wりそな先進国株式インデックスファンド >

R M先進国株式マザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。なお、日本を除く先進国の株式（D R（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。）および先進国株式の指数を対象指数としたE T F（上場投資信託証券）に直接投資することができます。

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条および第23条に定めるものに限ります。）

ハ) 約束手形（イ）に掲げるものに該当するものを除きます。）

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

2) 次に掲げる特定資産以外の資産

イ) 為替手形

有価証券の指図範囲

委託者は、信託金を、主として、親投資信託「R M先進国株式マザーファンド」の受益証券、ならびに次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。

1) 株券または新株引受権証書

2) 国債証券

3) 地方債証券

- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- 6) 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 7) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
- 8) 協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
- 9) 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
- 10) コマーシャル・ペーパー
- 11) 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
- 12) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1) から11) までの証券または証書の性質を有するもの
- 13) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
- 14) 投資証券、新投資口予約権証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
- 15) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
- 16) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。）
- 17) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
- 18) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 19) 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）
- 20) 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
- 21) 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって19) の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

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

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、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。

< F Wりそな新興国株式インデックスファンド >

R M新興国株式マザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。なお、新興国の株式（D R（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。)および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)に直接投資することがあります。

投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

有価証券の指図範囲

委託者は、信託金を、主として、親投資信託「RM新興国株式マザーファンド」の受益証券、ならびに次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図することができます。

- 1) 株券または新株引受権証書
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
- 6) 特定目的会社にかかる特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
- 7) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
- 8) 協同組織金融機関にかかる優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
- 9) 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
- 10) コマーシャル・ペーパー
- 11) 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。))および新株予約権証券
- 12) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1)から11)までの証券または証書の性質を有するもの
- 13) 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
- 14) 投資証券、新投資口予約権証券、投資法人債券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
- 15) 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
- 16) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。)
- 17) 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
- 18) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 19) 受益証券発行信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。)
- 20) 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
- 21) 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって19)の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

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

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。

< F Wりそな国内リートインデックスファンド >

R M国内リートマザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。なお、国内の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。）に直接投資することがあります。

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（本邦通貨表示のものに限ります。）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条および第23条に定めるものに限ります。）
 - ハ) 約束手形（イ）に掲げるものに該当するものを除きます。）
 - ニ) 金銭債権（イ）、ロ）およびハ）に掲げるものに該当するものを除きます。）
- 2) 次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ) 為替手形

有価証券の指図範囲

委託者は、信託金を、主として、親投資信託「R M国内リートマザーファンド」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。）および新

株予約権証券

- 12) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1) から11) までの証券または証書の性質を有するもの
- 13) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
- 14) 投資証券、新投資口予約権証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
- 15) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
- 16) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。）
- 17) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
- 18) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 19) 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）
- 20) 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
- 21) 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって19) の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

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

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、金利先渡取引の運用指図、有価証券の貸付けの指図、資金の借入れの指図を行うことができます。

< F Wりそな先進国リートインデックスファンド >

R M先進国リートマザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。なお、日本を除く先進国の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。）、不動産関連株式および不動産投資信託証券に関する指数を対象指数としたE T F（上場投資信託証券）に直接投資することがあります。

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条および第23条に定めるものに限ります。）
 - ハ) 約束手形（イ）に掲げるものに該当するものを除きます。）
 - ニ) 金銭債権（イ）、ロ）およびハ）に掲げるものに該当するものを除きます。）
- 2) 次に掲げる特定資産以外の資産

イ) 為替手形

有価証券の指図範囲

委託者は、信託金を、主として、親投資信託「RM先進国リートマザーファンド」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。）および新株予約権証券
- 12) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1) から11) までの証券または証書の性質を有するもの
- 13) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
- 14) 投資証券、新投資口予約権証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
- 15) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
- 16) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。）
- 17) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
- 18) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 19) 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）
- 20) 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
- 21) 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって19) の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

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

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、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

< R M国内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、NOMURA - B P I 総合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。 ・ NOMURA - B P I 総合に採用されている国内の債券
投資方針	主として、NOMURA - B P I 総合に採用されている国内の債券に投資し、NOMURA - B P I 総合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、NOMURA - B P I 総合への連動性を高めるため、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。債券の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。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

< R M国内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、東証株価指数（TOPIX、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。 ・東証株価指数（TOPIX、配当込み）に採用されている株式
投資方針	主として、東証株価指数（TOPIX、配当込み）に採用されている株式に投資し、東証株価指数（TOPIX、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、東証株価指数（TOPIX、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）または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。 株式（指数先物取引、ETF（上場投資信託証券）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。 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

< 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	<p>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。</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>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	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ません。）の行使等により取得したものに限りません。</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	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新興国債券マザーファンド >

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、J Pモルガン G B I E M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。 ・ J Pモルガン G B I E Mグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）に採用されている新興国の債券 ・ 新興国債券の指数を対象指数とした E T F（上場投資信託証券）
投資方針	主として、J Pモルガン G B I E Mグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）に採用されている新興国の現地通貨建て債券または新興国債券の指数を対象指数とした E T F（上場投資信託証券）に投資し、J Pモルガン G B I E Mグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、J Pモルガン G B I E M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 E T F（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。 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	<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ません。）の行使等により取得したものに限りません。</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先進国株式マザーファンド >

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、MSCI - K O K U S A I 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。）先進国株式（*）（日本の株式を除きます。以下同じ。） （*）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。 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）

投資方針	<p>主として、先進国株式または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）に投資し、MSCI-KOKUSAI指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。なお、MSCI-KOKUSAI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、通常の状態でも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>組入る有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。</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

< 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、MSCIエマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

主な投資対象	<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（*） （*）D R（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E T F（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E T F（上場投資信託証券）に投資し、M S C Iエマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。なお、M S C Iエマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の金融商品取引市場に上場する株価指数先物取引を活用することがあります。</p> <p>株式またはE T F（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。</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

< R M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	組入る有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
決算日	毎年1月25日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

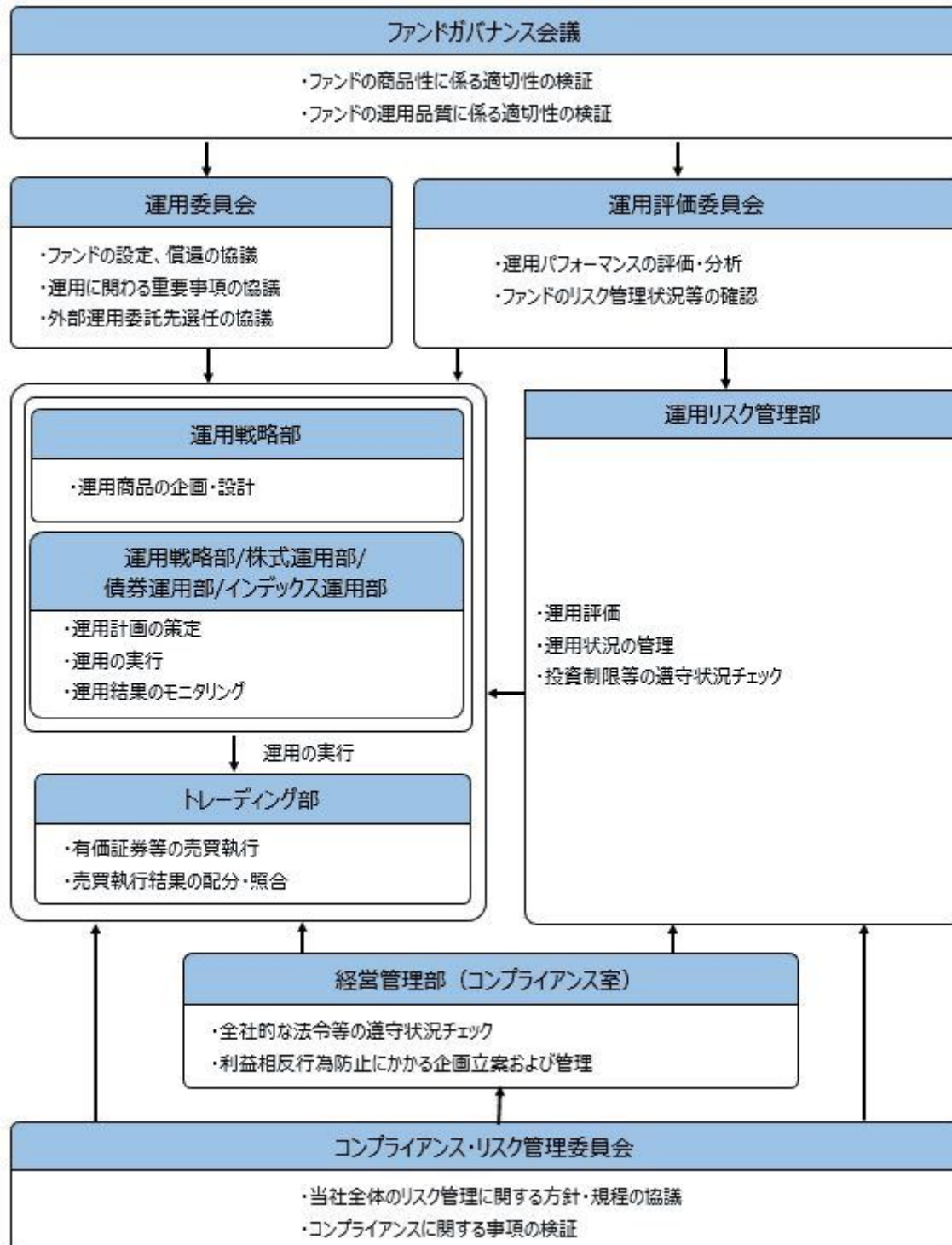
< R M先進国リートマザーファンド >

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

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12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) 留保金は、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

<FWりそな国内債券インデックスファンド>

- 1) 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限り、株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 2) 投資信託証券（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。
- 3) 外貨建資産への投資は、行いません。
- 4) デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。
- 5) 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 6) 一般社団法人投資信託協会規則に規定する一のもの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。
- 7) 投資する株式の範囲
 1. 委託者が投資することを指図する株式は、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。

8) 先物取引等の運用指図および範囲

1. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、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。以下同じ。)、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。以下同じ。)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。以下同じ。)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次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとします(以下同じ。)

イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする有価証券(以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。)の時価総額の範囲内とします。

ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額(組入ヘッジ対象有価証券を差し引いた額)に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権、組入抵当証券および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等(株式、株価指数にかかる先物取引の買建においては、信託財産が未収配当金として計上している額を含むものとし、この額には信託財産が当該限月を超えて受取る配当金も含まれます。)ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。

ハ) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、8)で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

2. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、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わが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。

イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品(信託財産が1年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。)の時価総額の範囲内とします。

ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。

ハ) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ8)で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

9) スワップ取引の運用指図および範囲

1. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。
2. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として、信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
3. スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下3.において「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総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スワップ取引の一部の解約

を指図するものとします。

4. 前記3.においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
5. 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。
6. 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。

10) 金利先渡取引の運用指図および範囲

1. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、金利先渡取引を行うことの指図をすることができます。
2. 金利先渡取引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. 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下3.において「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下3.において「ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額」といいます。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象金利商品の時価総額の合計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金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
4. 前記3.においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
5. 金利先渡取引の評価は、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。
6. 委託者は、金利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。

11) 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。

12) 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。

< F Wりそな国内株式インデックスファンド >

- 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) 外貨建資産への投資は、行いません。
- 5) デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。
- 6) 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 7) 一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- 8) 投資する株式等の範囲
 1. 委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
 2. 前記1.の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとします。
- 9) 信用取引の指図範囲
 1. 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
 2. 前記1.の信用取引の指図は、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
 - イ) 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
 - ロ) 株式分割により取得する株券
 - ハ) 有償増資により取得する株券
 - ニ) 売出しにより取得する株券
 - ホ) 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権(新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。)の新株予約権に限り、)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および範囲
 1. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、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。以下同

じ。)、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。以下同じ。)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。以下同じ。)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次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとします(以下同じ。)

イ)先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする有価証券(以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。)の時価総額の範囲内とします。

ロ)先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額(組入ヘッジ対象有価証券を差し引いた額)に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権、組入抵当証券および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等(株式、株価指数にかかる先物取引の買建においては、信託財産が未収配当金として計上している額を含むものとし、この額には信託財産が当該限月を超えて受取る配当金も含まれます。)ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。

ハ)コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、10)で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

2. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、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わが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。

イ)先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品(信託財産が1年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。)の時価総額の範囲内とします。

ロ)先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。

ハ)コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ10)で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

11) スワップ取引の運用指図および範囲

1. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。
2. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として、信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
3. スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下3.において「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総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スワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
4. 前記3.においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
5. 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。

6. 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) 金利先渡取引の運用指図および範囲

1. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、金利先渡取引を行うことの指図をすることができます。
2. 金利先渡取引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. 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下3.において「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。)が、信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下3.において「ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額」といいます。)を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象金利商品の時価総額の合計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金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
4. 前記3.においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
5. 金利先渡取引の評価は、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。
6. 委託者は、金利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) 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。

14) 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。

< F W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） >

- 1) 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限り、株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 2) 投資信託証券（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。
- 3) 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- 4) デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。
- 5) 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 6) 一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- 7) 投資する株式の範囲
 1. 委託者が投資することを指図する株式は、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、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。
- 8) 先物取引等の運用指図および範囲
 1. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、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。以下同じ。）、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。以下同じ。）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。以下同じ。）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次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。
 - イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする有価証券（以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。）の時価総額の範囲内とします。
 - ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額（組入ヘッジ対象有価証券を差し引いた額）に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権、組入抵当証券および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等（株式、株価指数にかかる先物取引の買建においては、信託財産が未収配当金として計上している額を含むものとし、この額には信託財産が当該限月を超えて受取る配当金も含まれます。）ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。
 - ハ) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、8)で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
 2. 委託者は、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、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次の範囲で行うことの指図をすることができます。
 - イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合わせてヘッジ対象と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ヘッ

ジ対象と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の純資産総額に占めるヘッジ対象とす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。)との合計額の範囲内とします。

ロ)先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合せて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。

ハ)コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ8)で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

3. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、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次の範囲で行うことの指図をすることができます。

イ)先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品(信託財産が1年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。)の時価総額の範囲内とします。

ロ)先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額(以下ロ)において「金融商品運用額等」といいます。)の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額(約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差引いた額。以下同じ。)に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。

ハ)コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ8)で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

9) スワップ取引の運用指図および範囲

1. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。

2. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として、信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

3. スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下3.において「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総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スワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

4. 前記3.においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

5. 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。

6. 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。

10) 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図および範囲

1. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利

先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

2. 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として、信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
 3. 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下3.において「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下3.において「ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額」といいます。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象金利商品の時価総額の合計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金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
 4. 為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下4.において「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかる保有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との合計額（以下「保有外貨建資産の時価総額の合計額」といいます。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額の合計額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額が保有外貨建資産の時価総額の合計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為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
 5. 前記3.および4.においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品および保有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とは、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品および保有外貨建資産の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
 6. 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。
 7. 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。
- 11) 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。
- 12) 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。
- 13) 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。

14) 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。

< F W 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) >

- 1) 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。)の行使等により取得したものに限り、株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 2) 投資信託証券(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。
- 3) 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- 4) デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。
- 5) 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 6) 一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- 7) 投資する株式の範囲
 1. 委託者が投資することを指図する株式は、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、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。
- 8) 先物取引等の運用指図および範囲
 1. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、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。以下同じ。)、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。以下同じ。)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。以下同じ。)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次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとします(以下同じ。)。イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする有価証券(以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。)の時価総額の範囲内とします。

- ロ)先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額(組入ヘッジ対象有価証券を差し引いた額)に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権、組入抵当証券および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等(株式、株価指数にかかる先物取引の買建においては、信託財産が未収配当金として計上している額を含むものとし、この額には信託財産が当該限月を超えて受取る配当金も含まれます。)ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。
- ハ)コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、8)で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
2. 委託者は、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、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次の範囲で行うことの指図をすることができます。
- イ)先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合せてヘッジ対象と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ヘッジ対象と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の純資産総額に占めるヘッジ対象とす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。)との合計額の範囲内とします。
- ロ)先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合せて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。
- ハ)コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ8)で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
3. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、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次の範囲で行うことの指図をすることができます。
- イ)先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品(信託財産が1年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。)の時価総額の範囲内とします。
- ロ)先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額(以下ロ)において「金融商品運用額等」といいます。)の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額(約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差引いた額。以下同じ。)に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。
- ハ)コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ8)で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- 9)スワップ取引の運用指図および範囲
1. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。
2. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として、信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

3. スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下3.において「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総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スワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
 4. 前記3.においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
 5. 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。
 6. 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。
- 10) 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図および範囲
1. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
 2. 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として、信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
 3. 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下3.において「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下3.において「ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額」といいます。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象金利商品の時価総額の合計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金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
 4. 為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下4.において「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかる保有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との合計額（以下「保有外貨建資産の時価総額の合計額」といいます。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額の合計額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額が保有外貨建資産の時価総額の合計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為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
 5. 前記3.および4.においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品および保有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とは、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品および保有外貨建資産の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
 6. 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。
 7. 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。
- 11) 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。

12) 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。

13) 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。

14) 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。

< F Wりそな新興国債券インデックスファンド >

1)株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。)の行使等により取得したものに限り、株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

2)投資信託証券(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。

3)外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

4)デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

5)一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。

6)一般社団法人投資信託協会規則に規定する一のもの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ものとします。

7) 投資する株式の範囲

1.委託者が投資することを指図する株式は、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。

8) 先物取引等の運用指図および範囲

1. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、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。以下同じ。)、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。以下同じ。)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。以下同じ。)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次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとします(以下同じ。)

イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする有価証券(以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。)の時価総額の範囲内とします。

ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額(組入ヘッジ対象有価証券を差し引いた額)に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権、組入抵当証券および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等(株式、株価指数にかかる先物取引の買建においては、信託財産が未収配当金として計上している額を含むものとし、この額には信託財産が当該限月を超えて受取る配当金も含まれます。)ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。

ハ) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、8)で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

2. 委託者は、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、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次の範囲で行うことの指図をすることができます。

イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合せてヘッジ対象と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ヘッジ対象と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の純資産総額に占めるヘッジ対象とす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。)との合計額の範囲内とします。

ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合せて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。

ハ) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ8)で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

3. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、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次の範囲で行うことの指図をすることができます。

イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品(信託財産が1年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。)の時価総額の範囲内とします。

ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額(以下ロ)において「金融商品運用額等」といいます。)の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外

貨建資産組入可能額（約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差引いた額。以下同じ。）に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。

八) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ8)で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

9) スワップ取引の運用指図および範囲

1. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。
2. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として、信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
3. スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下3.において「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総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スワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
4. 前記3.においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
5. 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。
6. 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。

10) 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図および範囲

1. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
2. 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として、信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
3. 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下3.において「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下3.において「ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額」といいます。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象金利商品の時価総額の合計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金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
4. 為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下4.において「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかる保有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との合計額（以下「保有外貨建資産の時価総額の合計額」といいます。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額の合計額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額が保

有外貨建資産の時価総額の合計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為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

5. 前記3.および4.においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品および保有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とは、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品および保有外貨建資産の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
6. 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。
7. 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。

11) 直物為替先渡取引の運用指図

1. 委託者は、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、直物為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
2. 直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として、信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
3. 直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる直物為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる直物為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下3.において「直物為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。)が、保有外貨建資産の時価総額の合計額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額の合計額が減少して、直物為替先渡取引の想定元本の合計額が保有外貨建資産の時価総額の合計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直物為替先渡取引の一部の解約(反対の売買による解消を含む。)を指図するものとします。
4. 前記3.においてマザーファンドの信託財産にかかる直物為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる直物為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
5. 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。
6. 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。

12) 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。

13) 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。

14) 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。

15) 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。

< F W りそな先進国株式インデックスファンド >

- 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、株券の引渡または買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
 2. 前記1.の信用取引の指図は、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
 - イ) 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
 - ロ) 株式分割により取得する株券
 - ハ) 有償増資により取得する株券
 - ニ) 売出しにより取得する株券
 - ホ) 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第

236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限り、）の行使により取得可能な株券

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

10) 先物取引等の運用指図および範囲

1. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、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。以下同じ。）、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。以下同じ。）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。以下同じ。）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次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。

イ）先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする有価証券（以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。）の時価総額の範囲内とします。

ロ）先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額（組入ヘッジ対象有価証券を差し引いた額）に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権、組入抵当証券および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等（株式、株価指数にかかる先物取引の買建においては、信託財産が未収配当金として計上している額を含むものとし、この額には信託財産が当該限月を超えて受取る配当金も含まれます。）ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。

ハ）コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、10)で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

2. 委託者は、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、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次の範囲で行うことの指図をすることができます。

イ）先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合せてヘッジ対象と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ヘッジ対象と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の純資産総額に占めるヘッジ対象とす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。）との合計額の範囲内とします。

ロ）先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合せて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。

ハ）コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ10)で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

3. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、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次の範囲で行うことの指図をすることができます。

イ）先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品（信託財産が1年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額の範囲内とします。

ロ）先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第16条第2項第1号

から第6号までに掲げる金融商品で運用している額（以下口）において「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建て、信託財産の外貨建資産組入可能額（約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差引いた額。以下同じ。）に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。

八）コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ10）で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

11) スワップ取引の運用指図および範囲

1. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。
2. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として、信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
3. スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下3.において「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総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スワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
4. 前記3.においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
5. 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。
6. 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および範囲

1. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
2. 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として、信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
3. 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下3.において「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下3.において「ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額」といいます。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象金利商品の時価総額の合計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金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
4. 為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下4.において「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかる保有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との合計額（以下「保有外貨建資産の時価総

額の合計額」といいます。)を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額の合計額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額が保有外貨建資産の時価総額の合計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為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

5. 前記3.および4.においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品および保有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とは、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品および保有外貨建資産の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
6. 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。
7. 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) 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。

14) 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。

15) 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。

16) 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。

- 1) 株式への実質投資割合には、制限を設けません。
- 2) 新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。
- 3) 投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 4) 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- 5) デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。
- 6) 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 7) 一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- 8) 投資する株式等の範囲
 1. 委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
 2. 前記1.の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとします。
- 9) 信用取引の指図範囲
 1. 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
 2. 前記1.の信用取引の指図は、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
 - イ) 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
 - ロ) 株式分割により取得する株券
 - ハ) 有償増資により取得する株券
 - ニ) 売出しにより取得する株券
 - ホ) 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使により取得可能な株券
 - ヘ) 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（ホ）に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券
- 10) 先物取引等の運用指図および範囲
 1. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、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。以下同じ。）、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。以下同じ。）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。以下同じ。）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次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。
 - イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする有価証券（以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。）の時価総額の範囲内とします。
 - ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有

価証券の組入可能額(組入ヘッジ対象有価証券を差し引いた額)に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権、組入抵当証券および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等(株式、株価指数にかかる先物取引の買建においては、信託財産が未収配当金として計上している額を含むものとし、この額には信託財産が当該限月を超えて受取る配当金も含まれます。)ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。

ハ)コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、10)で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

2. 委託者は、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、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次の範囲で行うことの指図をすることができます。

イ)先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合せてヘッジ対象と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ヘッジ対象と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の純資産総額に占めるヘッジ対象とす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。)との合計額の範囲内とします。

ロ)先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合せて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。

ハ)コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ10)で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

3. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、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次の範囲で行うことの指図をすることができます。

イ)先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品(信託財産が1年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。)の時価総額の範囲内とします。

ロ)先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額(以下ロ)において「金融商品運用額等」といいます。)の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額(約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差し引いた額。以下同じ。)に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。

ハ)コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ10)で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

11) スワップ取引の運用指図および範囲

1. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なる通貨、異なる受取金利または異なる受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。

2. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として、信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

3. スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマ

ザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下3．において「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総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スワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

- 4．前記3．においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- 5．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。
- 6．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および範囲

- 1．委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- 2．金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として、信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 3．金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下3．において「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下3．において「ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額」といいます。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象金利商品の時価総額の合計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金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- 4．為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下4．において「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかる保有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との合計額（以下「保有外貨建資産の時価総額の合計額」といいます。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額の合計額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額が保有外貨建資産の時価総額の合計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為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- 5．前記3．および4．においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品および保有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とは、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品および保有外貨建資産の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- 6．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。
- 7．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、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、直物為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

2. 直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として、信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
 3. 直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる直物為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる直物為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下3.において「直物為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。)が、保有外貨建資産の時価総額の合計額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額の合計額が減少して、直物為替先渡取引の想定元本の合計額が保有外貨建資産の時価総額の合計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直物為替先渡取引の一部の解約(反対の売買による解消を含む。)を指図するものとします。
 4. 前記3.においてマザーファンドの信託財産にかかる直物為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる直物為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
 5. 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。
 6. 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。

< F Wりそな国内リートインデックスファンド >

- 1) 不動産投資信託証券および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) 外貨建資産への投資は、行いません。
- 5) デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。
- 6) 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 7) 一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- 8) 投資する株式等の範囲
 1. 委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
 2. 前記1.の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとします。
- 9) 信用取引の指図範囲
 1. 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
 2. 前記1.の信用取引の指図は、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
 - イ) 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
 - ロ) 株式分割により取得する株券
 - ハ) 有償増資により取得する株券
 - ニ) 売出しにより取得する株券
 - ホ) 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限り、）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および範囲
 1. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、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。以下同じ。）、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。以下同じ。）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。以下同じ。）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次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。
 - イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする有価証券（以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。）の時価総額の範囲内としま

す。

ロ)先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額(組入ヘッジ対象有価証券を差し引いた額)に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権、組入抵当証券および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等(株式、株価指数にかかる先物取引の買建においては、信託財産が未収配当金として計上している額を含むものとし、この額には信託財産が当該限月を超えて受取る配当金も含まれます。)ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。

ハ)コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、10)で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

2. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、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わが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。

イ)先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品(信託財産が1年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。)の時価総額の範囲内とします。

ロ)先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。

ハ)コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ10)で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

11) スワップ取引の運用指図および範囲

1. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。

2. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として、信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

3. スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下3.において「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総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スワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

4. 前記3.においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

5. 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。

6. 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) 金利先渡取引の運用指図および範囲

1. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、金利先渡取引を行うことの指図をすることができます。

2. 金利先渡取引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. 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下3.において「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下3.において「ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額」といいます。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象金利商品の時価総額の合計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金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
4. 前記3.においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
5. 金利先渡取引の評価は、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。
6. 委託者は、金利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) 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。

14) 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。

< F Wりそな先進国リートインデックスファンド >

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

は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

- 4) 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- 5) デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。
- 6) 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 7) 一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- 8) 投資する株式等の範囲
 1. 委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
 2. 前記1.の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとします。
- 9) 信用取引の指図範囲
 1. 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
 2. 前記1.の信用取引の指図は、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
 - イ) 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
 - ロ) 株式分割により取得する株券
 - ハ) 有償増資により取得する株券
 - ニ) 売出しにより取得する株券
 - ホ) 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権(新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。))の新株予約権に限り、)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および範囲
 1. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、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。以下同じ。)、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。以下同じ。))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。以下同じ。))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次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとします(以下同じ。))。
 - イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする有価証券(以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。))の時価総額の範囲内とします。
 - ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額(組入ヘッジ対象有価証券を差し引いた額)に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権、組入抵当証券および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等(株式、株価指数にか

かる先物取引の買建においては、信託財産が未収配当金として計上している額を含むものとし、この額には信託財産が当該限月を超えて受取る配当金も含まれます。)ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。

ハ)コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、10)で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

2. 委託者は、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、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次の範囲で行うことの指図をすることができます。

イ)先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合せてヘッジ対象と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ヘッジ対象と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の純資産総額に占めるヘッジ対象とす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。)との合計額の範囲内とします。

ロ)先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合せて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。

ハ)コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ10)で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

3. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、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次の範囲で行うことの指図をすることができます。

イ)先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品(信託財産が1年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。)の時価総額の範囲内とします。

ロ)先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額(以下ロ)において「金融商品運用額等」といいます。)の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額(約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差引いた額。以下同じ。)に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。

ハ)コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ10)で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

11) スワップ取引の運用指図および範囲

1. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。

2. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として、信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

3. スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下3.において「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えるこ

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スワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

4. 前記3.においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
5. 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。
6. 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および範囲

1. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
2. 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として、信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
3. 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下3.において「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。)が、信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下3.において「ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額」といいます。)を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象金利商品の時価総額の合計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金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
4. 為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下4.において「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。)が、信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかる保有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との合計額(以下「保有外貨建資産の時価総額の合計額」といいます。)を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額の合計額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額が保有外貨建資産の時価総額の合計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為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
5. 前記3.および4.においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品および保有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とは、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品および保有外貨建資産の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
6. 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。
7. 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) 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。

八) 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。

14) 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。

15) 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。

16) 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

<FWりそな国内債券インデックスファンド>

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

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

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

市場リスク

・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。

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。

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）

当ファンドはマザーファンドへの投資を通じてNOMURA - B P I総合（以下、当項目において「指数」といいます。）に連動する投資成果を目指して運用しますが、主として以下の理由から、当ファンドの投資成果は指数の動きから乖離する場合があります。

- ・ 指数を構成する全ての銘柄を指数の算出方法どおりに組み入れない場合や、指数を構成する銘柄以外の銘柄や先物を組み入れる場合があること。
- ・ 有価証券等の売買価格や基準価額算出に使用される有価証券等の時価が、指数の算出に使用される有価証券等の時価と一致しない場合があること。
- ・ 運用管理費用（信託報酬）、監査費用および有価証券等の売買にかかる売買委託手数料等の費用負担が発生すること。

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かさ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。

< F Wりそな国内株式インデックスファンド >

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。

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。

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）

当ファンドはマザーファンドへの投資を通じて東証株価指数（TOPIX、配当込み）（以下、当項目において「指数」といいます。）に連動する投資成果を目指して運用しますが、主として以下の理由から、当ファンドの投資成果は指数の動きから乖離する場合があります。

- ・ 指数を構成する全ての銘柄を指数の算出方法どおりに組み入れない場合や、指数を構成する銘柄以外の銘柄や先物を組み入れる場合があること。
- ・ 有価証券等の売買価格や基準価額算出に使用される有価証券等の時価が、指数の算出に使用される有価証券等の時価と一致しない場合があること。
- ・ 運用管理費用（信託報酬）、監査費用および有価証券等の売買にかかる売買委託手数料等の費用負担が発生すること。

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入が生じた場合、その結果として、当該マザーファンドにおいても組入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。

< F W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） >

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

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

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

市場リスク

・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。

・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。

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・地域において、政治や経済、社会情勢等の変化または金融取引等に関する規制の新設や変更により、実質的に組み入れている有価証券等の価格が大きく変動することがあります。そのため基準価額が予想以上に下落することや、投資方針に沿った運用が困難となることがあります。

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

（その他の留意点）

当ファンドはマザーファンドへの投資を通じてFTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）（以下、当項目において「指数」といいます。）に連動する投資成果を目指して運用しますが、主として以下の理由から、当ファンドの投資成果は指数の動きから乖離する場合があります。

- ・指数を構成する全ての銘柄を指数の算出方法どおりに組み入れない場合や、指数を構成する銘柄以外の銘柄や先物を組み入れる場合があること。
- ・有価証券等の売買価格や基準価額算出に使用される有価証券等の時価が、指数の算出に使用される有価証券等の時価と一致しない場合があること。
- ・外貨取引時の為替レートや基準価額算出に使用される為替レートが、指数の算出に使用される為替レートと一致しない場合があること。
- ・運用管理費用（信託報酬）、監査費用および有価証券等の売買にかかる売買委託手数料等の費用負担が発生すること。

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入が生じた場合、その結果として、当該マザーファンドにおいても組入有価証券の売買等が生じ、当ファンドの基準価額に影響をおよぼすことがあります。

当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要がある場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響をおよぼす可能性や、換金のお申込みの受け付けが中止となる可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性があります。

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かさ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。

< F W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） >

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

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

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

市場リスク

・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の場合は、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。当ファンドは原則として為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を図ることとしていますが、為替変動リスクを完全に排除できるものではなく、為替変動の影響を受け、基準価額が下落する場合があります。また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。

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・地域において、政治や経済、社会情勢等の変化または金融取引等に関する規制の新設や変更により、実質的に組み入れている有価証券等の価格が大きく変動することがあります。そのため基準価額が予想以上に下落することや、投資方針に沿った運用が困難となることがあります。

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

（その他の留意点）

当ファンドはマザーファンドへの投資を通じてFTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）（以下、当項目において「指数」といいます。）に連動する投資成果を目指して運用しますが、主として以下の理由から、当ファンドの投資成果は指数の動きから乖離する場合があります。

- ・指数を構成する全ての銘柄を指数の算出方法どおりに組み入れない場合や、指数を構成する銘柄以外の銘柄や先物を組み入れる場合があること。
- ・有価証券等の売買価格や基準価額算出に使用される有価証券等の時価が、指数の算出に使用される有価証券等の時価と一致しない場合があること。
- ・外貨取引時の為替レートや基準価額算出に使用される為替レートが、指数の算出に使用される為替レートと一致しない場合があること。
- ・運用管理費用（信託報酬）、監査費用および有価証券等の売買にかかる売買委託手数料等の費用負担が発生すること。

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入が生じた場合、その結果として、当該マザーファンドにおいても組入有価証券の売買等が生じ、当ファンド

の基準価額に影響をおよぼすことがあります。

当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要がある場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響をおよぼす可能性や、換金のお申込みの受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かさ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。

< F Wりそな新興国債券インデックスファンド >

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

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

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

市場リスク

・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の場合は、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。

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・地域において、政治や経済、社会情勢等の変化または金融取引等に関する規制の新設や変更により、実質的に組み入れている有価証券等の価格が大きく変動することがあります。そのため基準価額が予想以上に下落することや、投資方針に沿った運用が困難となることがあります。

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

（その他の留意点）

当ファンドはマザーファンドへの投資を通じて「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）（以下、当項目において「指数」といいます。）に連動する投資成果を目指して運用しますが、主として以下の理由から、当ファンドの投資成果は指数の動きから乖離する場合があります。

- ・ 指数を構成する全ての銘柄を指数の算出方法どおりに組み入れない場合や、指数を構成する銘柄以外の銘柄や先物を組み入れる場合があること。
- ・ 有価証券等の売買価格や基準価額算出に使用される有価証券等の時価が、指数の算出に使用される有価証券等の時価と一致しない場合があること。
- ・ 外貨取引時の為替レートや基準価額算出に使用される為替レートが、指数の算出に使用される為替レートと一致しない場合があること。
- ・ 運用管理費用（信託報酬）、監査費用および有価証券等の売買にかかる売買委託手数料等の費用負担が発生すること。

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入が生じた場合、その結果として、当該マザーファンドにおいても組入有価証券の売買等が生じ、当ファンドの基準価額に影響をおよぼすことがあります。

当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要がある場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響をおよぼす可能性や、換金のお申込みの受け付けが中止となる可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性があります。

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かさ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。

< F Wりそな先進国株式インデックスファンド >

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

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

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

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。

・ 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。

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・地域において、政治や経済、社会情勢等の変化または金融取引等に関する規制の新設や変更により、実質的に組み入れている有価証券等の価格が大きく変動することがあります。そのため基準価額が予想以上に下落することや、投資方針に沿った運用が困難となることがあります。

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

（その他の留意点）

当ファンドはマザーファンドへの投資を通じてMSCI-KOUSA I指数（配当込み、円換算ベース）（以下、当項目において「指数」といいます。）に連動する投資成果を目指して運用しますが、主として以下の理由から、当ファンドの投資成果は指数の動きから乖離する場合があります。

- ・ 指数を構成する全ての銘柄を指数の算出方法どおりに組み入れない場合や、指数を構成する銘柄以外の銘柄や先物を組み入れる場合があること。
- ・ 有価証券等の売買価格や基準価額算出に使用される有価証券等の時価が、指数の算出に使用される有価証券等の時価と一致しない場合があること。
- ・ 外貨取引時の為替レートや基準価額算出に使用される為替レートが、指数の算出に使用される為替レートと一致しない場合があること。
- ・ 運用管理費用（信託報酬）、監査費用および有価証券等の売買にかかる売買委託手数料等の費用負担が発生すること。

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かつた場合も同様です。

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。

< F Wりそな新興国株式インデックスファンド >

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。

・ 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。

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・地域において、政治や経済、社会情勢等の変化または金融取引等に関する規制の新設や変更により、実質的に組み入れている有価証券等の価格が大きく変動することがあります。そのため基準価額が予想以上に下落することや、投資方針に沿った運用が困難となることがあります。

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

（その他の留意点）

当ファンドはマザーファンドへの投資を通じてMSCIエマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）（以下、当項目において「指数」といいます。）に連動する投資成果を目指して運用しますが、主として以下の理由から、当ファンドの投資成果は指数の動きから乖離する場合があります。

- ・ 指数を構成する全ての銘柄を指数の算出方法どおりに組み入れない場合や、指数を構成する銘柄以外の銘柄や先物を組み入れる場合があること。
- ・ 有価証券等の売買価格や基準価額算出に使用される有価証券等の時価が、指数の算出に使用される有価証券等の時価と一致しない場合があること。
- ・ 外貨取引時の為替レートや基準価額算出に使用される為替レートが、指数の算出に使用される為替レートと一致しない場合があること。
- ・ 運用管理費用（信託報酬）、監査費用および有価証券等の売買にかかる売買委託手数料等の費用負担が発生すること。

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。

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

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

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

市場リスク

・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。

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。

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)

当ファンドはマザーファンドへの投資を通じて東証REIT指数(配当込み)(以下、当項目において「指数」といいます。)に連動する投資成果を目指して運用しますが、主として以下の理由から、当ファンドの投資成果は指数の動きから乖離する場合があります。

- ・指数を構成する全ての銘柄を指数の算出方法どおりに組み入れない場合や、指数を構成する銘柄以外の銘柄や先物を組み入れる場合があること。
- ・有価証券等の売買価格や基準価額算出に使用される有価証券等の時価が、指数の算出に使用される有価証券等の時価と一致しない場合があること。
- ・運用管理費用(信託報酬)、監査費用および有価証券等の売買にかかる売買委託手数料等の費用負担が発生すること。

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入が生じた場合、その結果として、当該マザーファンドにおいても組入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かさ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。

< F Wりそな先進国リートインデックスファンド >

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

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

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

市場リスク

・ リートの価格変動リスク

リーートの価格は、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。

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・地域において、政治や経済、社会情勢等の変化または金融取引等に関する規制の新設や変更により、実質的に組み入れている有価証券等の価格が大きく変動することがあります。そのため基準価額が予想以上に下落することや、投資方針に沿った運用が困難となることがあります。

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

（その他の留意点）

当ファンドはマザーファンドへの投資を通じてS&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）（以下、当項目において「指数」といいます。）に連動する投資成果を目指して運用しますが、主として以下の理由から、当ファンドの投資成果は指数の動きから乖離する場合があります。

- ・ 指数を構成する全ての銘柄を指数の算出方法どおりに組み入れない場合や、指数を構成する銘柄以外の銘柄や先物を組み入れる場合があること。
- ・ 有価証券等の売買価格や基準価額算出に使用される有価証券等の時価が、指数の算出に使用される有価証券等の時価と一致しない場合があること。
- ・ 外貨取引時の為替レートや基準価額算出に使用される為替レートが、指数の算出に使用される為替レートと一致しない場合があること。
- ・ 運用管理費用（信託報酬）、監査費用および有価証券等の売買にかかる売買委託手数料等の費用負担が発生すること。

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入が生じた場合、その結果として、当該マザーファンドにおいても組入有価証券の売買等が生じ、当ファンドの基準価額に影響をおよぼすことがあります。

当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要がある場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響をおよぼす可能性や、換金のお申込みの受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かさ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。

(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。

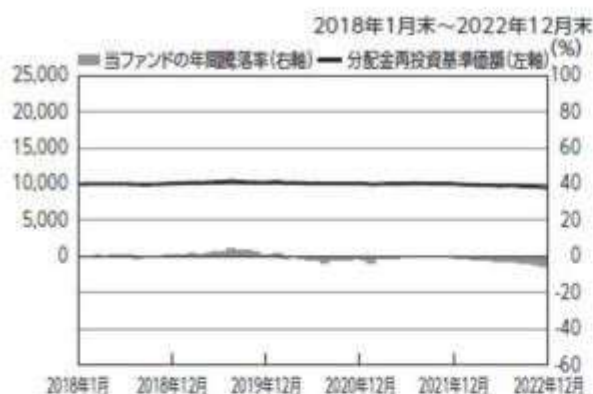
運用リスクを管理する部門は、運用業務等に係る情報のうち、経営に重要な影響を与えるまたは受益者の利益が著しく阻害される一切の事案についてはすみやかに、また法令・主な投資制限等の遵守状況については定期的に取り締り役会等に報告します。

上記体制は2022年12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】

FWりそな国内債券インデックスファンド

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

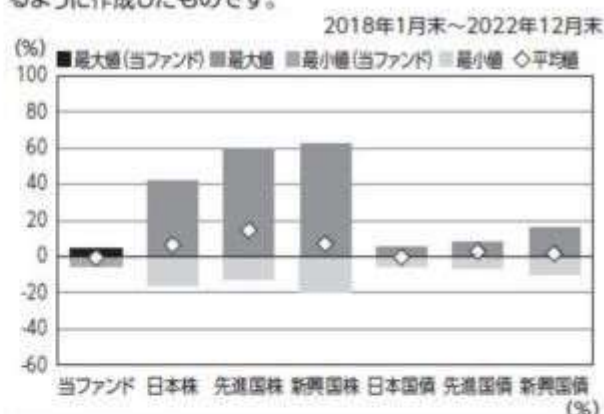


- * 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。2018年1月末を10,000として指数化しております。
- * 年間騰落率は、2018年1月から2022年12月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

※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	4.5	42.1	59.8	62.7	5.4	7.9	15.7
最小値	△5.5	△16.0	△12.4	△19.4	△5.5	△6.1	△9.4
平均値	△0.4	6.5	14.7	7.3	△0.1	2.9	1.8

- * 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。
- * 2018年1月から2022年12月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- * 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。

FWりそな国内株式インデックスファンド

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

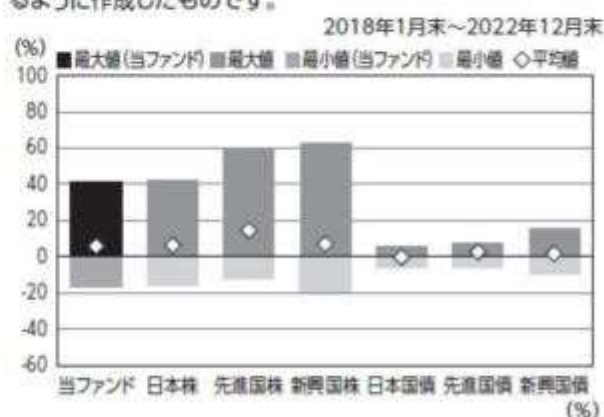


- * 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。2018年1月末を10,000として指数化しております。
- * 年間騰落率は、2018年1月から2022年12月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

※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。

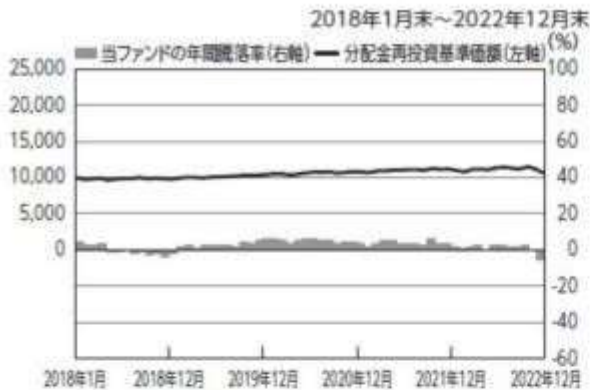


	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	41.6	42.1	59.8	62.7	5.4	7.9	15.7
最小値	△16.3	△16.0	△12.4	△19.4	△5.5	△6.1	△9.4
平均値	6.1	6.5	14.7	7.3	△0.1	2.9	1.8

- * 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。
- * 2018年1月から2022年12月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- * 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。

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)

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。2018年1月末を10,000として指数化しております。
- * 年間騰落率は、2018年1月から2022年12月の5年間の各月末における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。

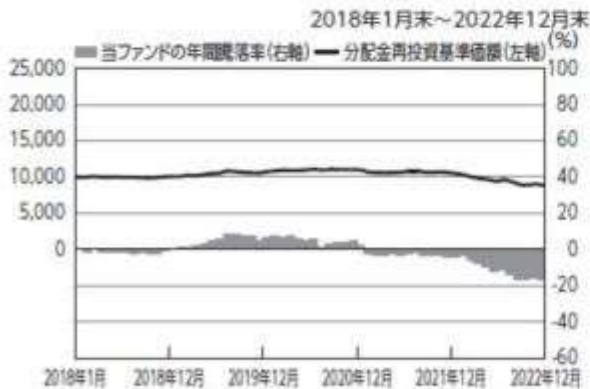


	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	6.5	42.1	59.8	62.7	5.4	7.9	15.7
最小値	△5.1	△16.0	△12.4	△19.4	△5.5	△6.1	△9.4
平均値	2.5	6.5	14.7	7.3	△0.1	2.9	1.8

- * 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。
- * 2018年1月から2022年12月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- * 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。

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)

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

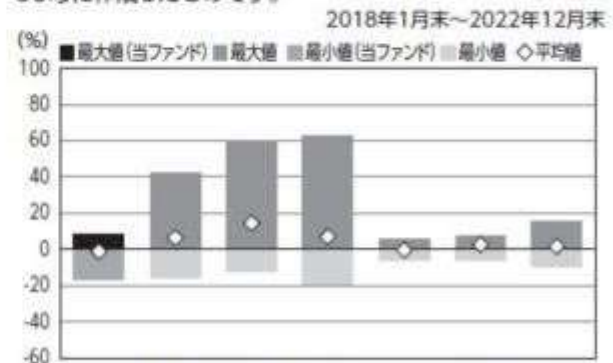


- * 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。2018年1月末を10,000として指数化しております。
- * 年間騰落率は、2018年1月から2022年12月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

※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	8.7	42.1	59.8	62.7	5.4	7.9	15.7
最小値	△16.4	△16.0	△12.4	△19.4	△5.5	△6.1	△9.4
平均値	△1.0	6.5	14.7	7.3	△0.1	2.9	1.8

- * 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。
- * 2018年1月から2022年12月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- * 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。

FWりそな新興国債券インデックスファンド

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

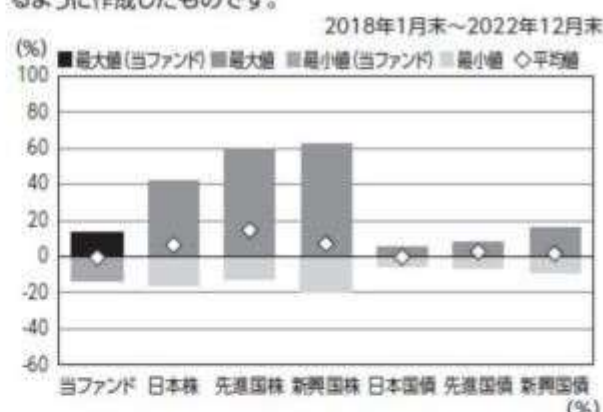


- * 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。2018年1月末を10,000として指数化しております。
- * 年間騰落率は、2018年1月から2022年12月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

※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	13.5	42.1	59.8	62.7	5.4	7.9	15.7
最小値	△13.5	△16.0	△12.4	△19.4	△5.5	△6.1	△9.4
平均値	△0.5	6.5	14.7	7.3	△0.1	2.9	1.8

- * 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。
- * 2018年1月から2022年12月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- * 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。

FWりそな先進国株式インデックスファンド

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

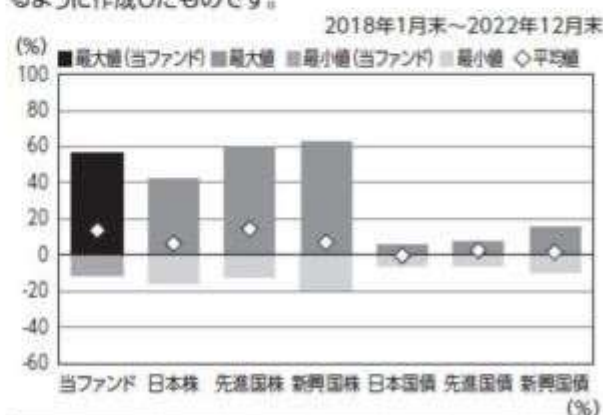


- * 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。2018年1月末を10,000として指数化しております。
- * 年間騰落率は、2018年1月から2022年12月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

※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	56.0	42.1	59.8	62.7	5.4	7.9	15.7
最小値	△11.4	△16.0	△12.4	△19.4	△5.5	△6.1	△9.4
平均値	13.8	6.5	14.7	7.3	△0.1	2.9	1.8

- * 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。
- * 2018年1月から2022年12月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- * 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。

FWりそな新興国株式インデックスファンド

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

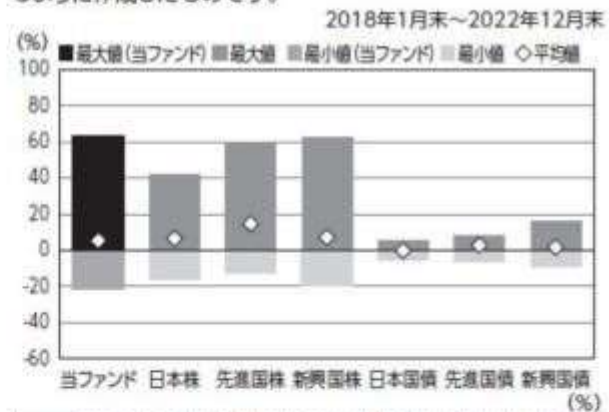


- * 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。2018年1月末を10,000として指数化しております。
- * 年間騰落率は、2018年1月から2022年12月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

※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。

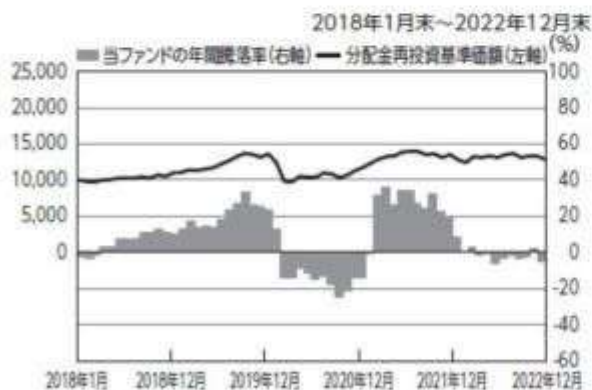


	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	62.8	42.1	59.8	62.7	5.4	7.9	15.7
最小値	△21.5	△16.0	△12.4	△19.4	△5.5	△6.1	△9.4
平均値	5.4	6.5	14.7	7.3	△0.1	2.9	1.8

- * 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。
- * 2018年1月から2022年12月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- * 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。

FWりそな国内リートインデックスファンド

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

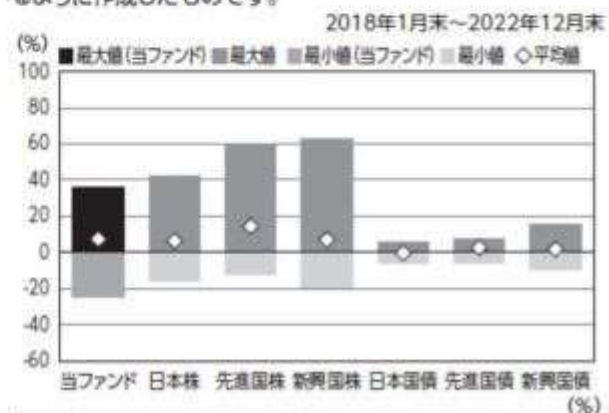


- * 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。2018年1月末を10,000として指数化しております。
- * 年間騰落率は、2018年1月から2022年12月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

※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。

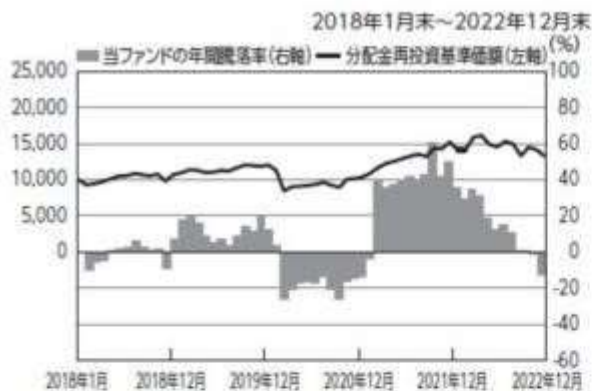


	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	35.9	42.1	59.8	62.7	5.4	7.9	15.7
最小値	△24.5	△16.0	△12.4	△19.4	△5.5	△6.1	△9.4
平均値	7.5	6.5	14.7	7.3	△0.1	2.9	1.8

- * 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。
- * 2018年1月から2022年12月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- * 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。

FWりそな先進国リートインデックスファンド

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

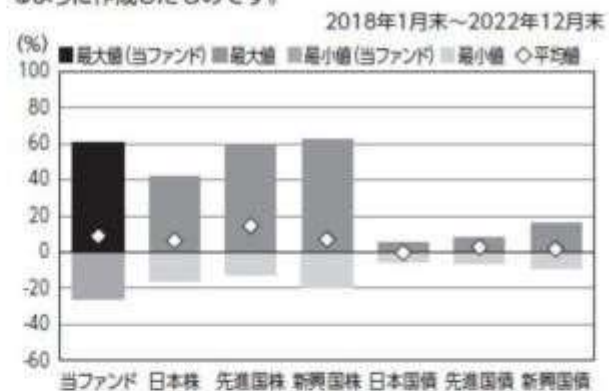


- * 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。2018年1月末を10,000として指数化しております。
- * 年間騰落率は、2018年1月から2022年12月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

※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	60.2	42.1	59.8	62.7	5.4	7.9	15.7
最小値	△25.6	△16.0	△12.4	△19.4	△5.5	△6.1	△9.4
平均値	9.1	6.5	14.7	7.3	△0.1	2.9	1.8

- * 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。
- * 2018年1月から2022年12月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- * 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、信憑性、正確性、完全性、最新性、網羅性、適時性を含む一切の保証を行いません。また、当該騰落率に関連して資産運用または投資判断をした結果生じた損害等、当該騰落率の利用に起因する損害及び一切の問題について、何らの責任も負いません。

東証株価指数(TOPIX, 配当込み)

東証株価指数(TOPIX, 配当込み)は、日本の株式市場を広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、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が発表している日本の国債市場の動向を的確に表すために開発された投資収益指数です。なお、NOMURA-BPI国債に関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。

FTSE世界国債インデックス(除く日本, 円ベース)

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

ありません。

(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】

< F Wりそな国内債券インデックスファンド >

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次の率を乗じて得た額とします。

< 2023年3月11日から2023年12月11日まで >

年率0.220%（税抜0.200%）

< 2023年12月12日以降 >

信託報酬率は、毎計算期間ごとに見直すものとし、各計算期間の信託報酬率は、当該計算期間の初日の属する月の前月の最終営業日における日本相互証券株式会社が発表する新発10年固定利付国債の利回り（終値）に応じて以下に掲げる率を毎計算期間開始日より適用するものとし、

新発10年固定利付国債の利回り（終値）	信託報酬
1%未満の場合	年率0.220%（税抜0.200%）
1%以上2%未満の場合	年率0.242%（税抜0.220%）
2%以上の場合	年率0.275%（税抜0.250%）

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。

< 2023年3月11日から2023年12月11日まで >

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
0.140%	0.030%	0.030%

< 2023年12月12日以降 >

新発10年固定利付国債の利回り（終値）	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
1%未満の場合	0.140%	0.030%	0.030%
1%以上2%未満の場合	0.160%	0.030%	0.030%
2%以上の場合	0.190%	0.030%	0.030%

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

< F Wりそな国内株式インデックスファンド >

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0.330%（税抜0.300%）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
0.240%	0.030%	0.030%

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

< F Wりそな先進国債インデックスファンド（為替ヘッジなし）>

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0.385%（税抜0.350%）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
0.290%	0.030%	0.030%

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

< F Wりそな先進国債インデックスファンド（為替ヘッジあり）>

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次の率を乗じて得た額とします。

< 2023年3月11日から2023年12月11日まで >

年率0.330%（税抜0.300%）

< 2023年12月12日以降 >

信託報酬率は、毎計算期間ごとに見直すものとし、各計算期間の信託報酬率は、当該計算期間の初日の属する月の前月の最終営業日における日本相互証券株式会社が発表する新発10年固定利付国債の利回り（終値）に応じて以下に掲げる率を毎計算期間開始日より適用するものとします。

新発10年固定利付国債の利回り（終値）	信託報酬
1%未満の場合	年率0.330%（税抜0.300%）
1%以上2%未満の場合	年率0.352%（税抜0.320%）
2%以上の場合	年率0.385%（税抜0.350%）

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。

< 2023年3月11日から2023年12月11日まで >

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
0.240%	0.030%	0.030%

< 2023年12月12日以降 >

新発10年固定利付国債の利回り（終値）	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
1%未満の場合	0.240%	0.030%	0.030%
1%以上2%未満の場合	0.260%	0.030%	0.030%
2%以上の場合	0.290%	0.030%	0.030%

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

< F Wりそな新興国債インデックスファンド >

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0.440%（税抜0.400%）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
0.340%	0.030%	0.030%

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

< F Wりそな先進国株式インデックスファンド >

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0.440%（税抜0.400%）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
0.340%	0.030%	0.030%

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

< F Wりそな新興国株式インデックスファンド >

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0.495%（税抜0.450%）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
0.390%	0.030%	0.030%

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

< F Wりそな国内リートインデックスファンド >

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0.330%（税抜0.300%）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
0.240%	0.030%	0.030%

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

< F Wりそな先進国リートインデックスファンド >

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0.440%（税抜0.400%）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
0.340%	0.030%	0.030%

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

《支払先の役務の内容》

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。

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（「国内株インデックス」のみ配当控除の適用があります。その他のファンドは、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せん。)を控除した利益

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

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

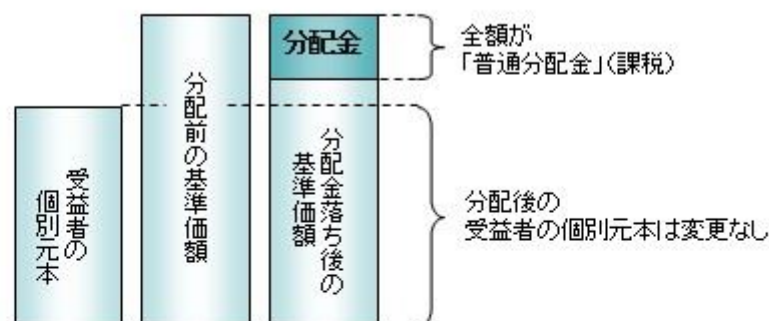
イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

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。

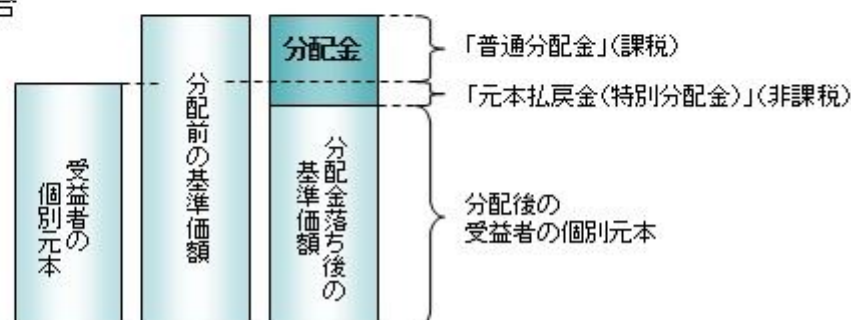
ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

<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12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】

【F Wりそな国内債券インデックスファンド】

以下の運用状況は2022年12月30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	103,831,465,098	99.85
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		155,104,564	0.15
合計（純資産総額）		103,986,569,662	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国内債券マザーファンド	104,237,993,272	1.0115	105,445,429,049	0.9961	103,831,465,098	99.85

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.85
合計	99.85

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

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 (2017年12月11日)	28,958	28,958	0.9997	0.9997
第2計算期間末 (2018年12月10日)	47,611	47,611	1.0020	1.0020
第3計算期間末 (2019年12月10日)	40,701	40,701	1.0188	1.0188
第4計算期間末 (2020年12月10日)	46,501	46,501	1.0102	1.0102
第5計算期間末 (2021年12月10日)	74,613	74,613	1.0064	1.0064
第6計算期間末 (2022年12月12日)	104,749	104,749	0.9640	0.9640
2021年12月末日	75,920		1.0041	
2022年 1月末日	74,900		0.9968	
2月末日	75,550		0.9916	
3月末日	76,495		0.9886	
4月末日	80,534		0.9859	
5月末日	81,379		0.9842	
6月末日	81,402		0.9749	
7月末日	80,301		0.9811	
8月末日	80,700		0.9786	
9月末日	80,446		0.9680	
10月末日	105,136		0.9667	
11月末日	104,466		0.9617	
12月末日	103,986		0.9490	

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	0.0000
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	0.0000
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	0.0000
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	0.0000
第5期	2020年12月11日～2021年12月10日	0.0000
第6期	2021年12月11日～2022年12月12日	0.0000

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	0.03
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	0.23

第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	1.68
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	0.84
第5期	2020年12月11日～2021年12月10日	0.38
第6期	2021年12月11日～2022年12月12日	4.21

(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	2017年 1月 5日～2017年12月11日	30,909,645,686	1,943,062,889
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	26,877,211,328	8,328,798,276
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	13,059,303,045	20,624,350,895
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	29,799,407,229	23,715,579,475
第5期	2020年12月11日～2021年12月10日	34,983,169,463	6,880,130,632
第6期	2021年12月11日～2022年12月12日	46,496,974,384	11,969,012,030

(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。

【F Wりそな国内株式インデックスファンド】

以下の運用状況は2022年12月30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	24,317,375,341	99.85
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		36,442,020	0.15
合計（純資産総額）		24,353,817,361	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国内株式マザーファンド	17,105,638,254	1.4682	25,115,815,033	1.4216	24,317,375,341	99.85

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.85
合 計	99.85

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

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 (2017年12月11日)	8,186	8,186	1.1849	1.1849
第2計算期間末 (2018年12月10日)	16,834	16,834	1.0571	1.0571
第3計算期間末 (2019年12月10日)	24,185	24,185	1.1689	1.1689
第4計算期間末 (2020年12月10日)	21,542	21,542	1.2313	1.2313
第5計算期間末 (2021年12月10日)	31,643	31,643	1.3938	1.3938
第6計算期間末 (2022年12月12日)	25,056	25,056	1.4130	1.4130
2021年12月末日	32,643		1.4071	
2022年 1月末日	34,922		1.3389	
2月末日	35,325		1.3328	
3月末日	37,529		1.3894	
4月末日	35,438		1.3558	
5月末日	36,246		1.3658	
6月末日	35,891		1.3375	
7月末日	24,020		1.3868	
8月末日	24,450		1.4031	
9月末日	23,358		1.3261	
10月末日	24,706		1.3931	
11月末日	25,404		1.4335	
12月末日	24,353		1.3678	

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
---	----	--------------

第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	0.0000
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	0.0000
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	0.0000
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	0.0000
第5期	2020年12月11日～2021年12月10日	0.0000
第6期	2021年12月11日～2022年12月12日	0.0000

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	18.49
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	10.79
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	10.58
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	5.34
第5期	2020年12月11日～2021年12月10日	13.20
第6期	2021年12月11日～2022年12月12日	1.38

(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	2017年 1月 5日～2017年12月11日	8,464,438,150	1,555,516,946
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	10,773,198,886	1,757,205,923
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	8,880,522,314	4,115,126,539
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	16,155,770,869	19,351,002,239
第5期	2020年12月11日～2021年12月10日	11,958,495,826	6,750,147,822
第6期	2021年12月11日～2022年12月12日	8,398,419,679	13,368,881,740

(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。

【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）】

以下の運用状況は2022年12月30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	33,182,925,940	99.85
コール・ローン等・その他資産（負債控除後）		49,513,164	0.15
合計（純資産総額）		33,232,439,104	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	31,417,275,081	1.1100	34,874,941,198	1.0562	33,182,925,940	99.85

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.85
合計	99.85

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

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 (2017年12月11日)	8,788	8,788	1.0508	1.0508
第2計算期間末 (2018年12月10日)	19,813	19,813	1.0139	1.0139
第3計算期間末 (2019年12月10日)	23,444	23,444	1.0437	1.0437
第4計算期間末 (2020年12月10日)	20,009	20,009	1.1028	1.1028
第5計算期間末 (2021年12月10日)	33,353	33,353	1.1358	1.1358
第6計算期間末 (2022年12月12日)	34,826	34,826	1.1404	1.1404
2021年12月末日	33,963		1.1433	
2022年 1月末日	36,504		1.1235	
2月末日	36,330		1.1028	
3月末日	38,082		1.1387	
4月末日	36,451		1.1411	
5月末日	36,510		1.1335	

6月末日	37,642		1.1604
7月末日	35,844		1.1679
8月末日	35,567		1.1536
9月末日	35,408		1.1430
10月末日	36,205		1.1768
11月末日	34,842		1.1405
12月末日	33,232		1.0848

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	0.0000
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	0.0000
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	0.0000
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	0.0000
第5期	2020年12月11日～2021年12月10日	0.0000
第6期	2021年12月11日～2022年12月12日	0.0000

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	5.08
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	3.51
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	2.94
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	5.66
第5期	2020年12月11日～2021年12月10日	2.99
第6期	2021年12月11日～2022年12月12日	0.41

(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	2017年 1月 5日～2017年12月11日	9,816,051,299	1,452,754,871
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	16,644,523,180	5,465,983,147
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	8,262,356,144	5,341,817,591
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	9,148,589,469	13,467,741,798
第5期	2020年12月11日～2021年12月10日	15,847,941,724	4,626,601,163
第6期	2021年12月11日～2022年12月12日	8,841,510,500	7,667,285,747

(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。

【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)】

以下の運用状況は2022年12月30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	157,075,363,534	99.85
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		232,926,002	0.15
合計(純資産総額)		157,308,289,536	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	RM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)	180,650,216,831	0.8912	161,010,779,218	0.8695	157,075,363,534	99.85

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.85
合計	99.85

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

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	(2017年12月11日)	28,986	28,986	1.0090	1.0090
第2計算期間末	(2018年12月10日)	47,560	47,560	0.9899	0.9899
第3計算期間末	(2019年12月10日)	60,513	60,513	1.0475	1.0475
第4計算期間末	(2020年12月10日)	107,828	107,828	1.0929	1.0929
第5計算期間末	(2021年12月10日)	174,814	174,814	1.0638	1.0638
第6計算期間末	(2022年12月12日)	160,031	160,031	0.9016	0.9016
	2021年12月末日	175,111		1.0521	
	2022年 1月末日	173,383		1.0387	
	2月末日	172,300		1.0169	
	3月末日	170,411		0.9892	
	4月末日	183,881		0.9674	
	5月末日	184,341		0.9572	
	6月末日	181,492		0.9311	
	7月末日	191,166		0.9581	
	8月末日	185,739		0.9249	
	9月末日	179,534		0.8858	
	10月末日	157,003		0.8837	
	11月末日	158,990		0.8963	
	12月末日	157,308		0.8792	

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	0.0000
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	0.0000
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	0.0000
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	0.0000
第5期	2020年12月11日～2021年12月10日	0.0000
第6期	2021年12月11日～2022年12月12日	0.0000

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	0.90
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	1.89
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	5.82
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	4.33
第5期	2020年12月11日～2021年12月10日	2.66
第6期	2021年12月11日～2022年12月12日	15.25

(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	2017年1月5日～2017年12月11日	30,662,448,431	1,934,517,343
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	27,497,514,870	8,180,419,930
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	25,565,889,158	15,842,703,502
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	56,096,556,318	15,203,108,711
第5期	2020年12月11日～2021年12月10日	80,271,983,006	14,598,777,195
第6期	2021年12月11日～2022年12月12日	59,407,448,646	46,250,562,340

(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。

【FWりそな新興国債券インデックスファンド】

以下の運用状況は2022年12月30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	4,044,549,987	99.85
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		6,007,588	0.15
合計(純資産総額)		4,050,557,575	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	RM新興国債券マザーファンド	3,627,724,448	1.1394	4,133,743,278	1.1149	4,044,549,987	99.85

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.85
合計	99.85

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

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 (2017年12月11日)	742	742	1.0790	1.0790
第2計算期間末 (2018年12月10日)	1,769	1,769	0.9796	0.9796
第3計算期間末 (2019年12月10日)	2,302	2,302	1.0120	1.0120
第4計算期間末 (2020年12月10日)	1,024	1,024	0.9926	0.9926
第5計算期間末 (2021年12月10日)	1,426	1,426	0.9714	0.9714
第6計算期間末 (2022年12月12日)	4,129	4,129	1.0318	1.0318
2021年12月末日	1,468		0.9883	
2022年 1月末日	1,527		0.9873	
2月末日	1,546		0.9907	
3月末日	1,570		0.9945	
4月末日	3,585		0.9868	
5月末日	3,689		1.0004	
6月末日	3,786		1.0156	
7月末日	3,597		0.9951	
8月末日	3,797		1.0444	
9月末日	3,724		1.0128	
10月末日	4,177		1.0382	
11月末日	4,131		1.0327	
12月末日	4,050		1.0092	

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	0.0000
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	0.0000
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	0.0000
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	0.0000

第5期	2020年12月11日～2021年12月10日	0.0000
第6期	2021年12月11日～2022年12月12日	0.0000

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	7.90
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	9.21
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	3.31
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	1.92
第5期	2020年12月11日～2021年12月10日	2.14
第6期	2021年12月11日～2022年12月12日	6.22

(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	2017年 1月 5日～2017年12月11日	735,295,511	47,003,360
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	1,230,517,990	112,441,673
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	1,175,865,521	706,944,106
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	748,245,689	1,991,499,982
第5期	2020年12月11日～2021年12月10日	651,451,475	214,615,821
第6期	2021年12月11日～2022年12月12日	2,938,967,339	405,515,768

(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。

【FWりそな先進国株式インデックスファンド】

以下の運用状況は2022年12月30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	61,785,581,140	99.85
コール・ローン等・その他資産（負債控除後）		91,773,026	0.15
合計（純資産総額）		61,877,354,166	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先進国株式マザーファンド	30,774,309,479	2.1067	64,834,028,760	2.0077	61,785,581,140	99.85

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.85
合 計	99.85

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

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 (2017年12月11日)	5,912	5,912	1.1507	1.1507
第2計算期間末 (2018年12月10日)	6,033	6,033	1.1001	1.1001
第3計算期間末 (2019年12月10日)	17,429	17,429	1.2657	1.2657
第4計算期間末 (2020年12月10日)	31,822	31,822	1.4153	1.4153
第5計算期間末 (2021年12月10日)	51,648	51,648	1.9064	1.9064
第6計算期間末 (2022年12月12日)	63,698	63,698	1.9578	1.9578
2021年12月末日	54,465		1.9807	
2022年 1月末日	50,802		1.8408	
2月末日	51,525		1.8273	
3月末日	58,279		2.0209	
4月末日	42,668		1.9336	
5月末日	43,888		1.9276	
6月末日	44,006		1.8819	
7月末日	60,455		1.9562	
8月末日	61,555		1.9680	
9月末日	59,705		1.8705	

10月末日	65,605		2.0492
11月末日	64,391		1.9878
12月末日	61,877		1.8651

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	0.0000
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	0.0000
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	0.0000
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	0.0000
第5期	2020年12月11日～2021年12月10日	0.0000
第6期	2021年12月11日～2022年12月12日	0.0000

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	15.07
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	4.40
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	15.05
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	11.82
第5期	2020年12月11日～2021年12月10日	34.70
第6期	2021年12月11日～2022年12月12日	2.70

(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	2017年 1月 5日～2017年12月11日	6,405,695,993	1,267,334,524
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	6,421,790,557	6,075,525,169
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	11,072,413,261	2,786,271,649
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	18,203,027,051	9,489,999,213
第5期	2020年12月11日～2021年12月10日	14,296,687,169	9,688,090,753
第6期	2021年12月11日～2022年12月12日	16,484,521,354	11,041,981,737

(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。

【FWりそな新興国株式インデックスファンド】

以下の運用状況は2022年12月30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	1,988,109,793	99.85
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		2,964,257	0.15
合計（純資産総額）		1,991,074,050	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新興国株式マザーファンド	1,307,622,858	1.5957	2,086,616,281	1.5204	1,988,109,793	99.85

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.85
合計	99.85

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

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 (2017年12月11日)	873	873	1.2449	1.2449
第2計算期間末 (2018年12月10日)	1,999	1,999	1.0986	1.0986
第3計算期間末 (2019年12月10日)	2,810	2,810	1.1520	1.1520
第4計算期間末 (2020年12月10日)	3,068	3,068	1.3227	1.3227

第5計算期間末 (2021年12月10日)	4,064	4,064	1.4467	1.4467
第6計算期間末 (2022年12月12日)	2,081	2,081	1.3900	1.3900
2021年12月末日	4,079		1.4343	
2022年 1月末日	4,891		1.4054	
2月末日	4,873		1.3842	
3月末日	5,157		1.4451	
4月末日	4,528		1.3811	
5月末日	4,686		1.3998	
6月末日	4,860		1.4294	
7月末日	4,624		1.3949	
8月末日	4,763		1.4267	
9月末日	4,491		1.3179	
10月末日	1,949		1.3056	
11月末日	2,061		1.3788	
12月末日	1,991		1.3239	

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	0.0000
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	0.0000
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	0.0000
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	0.0000
第5期	2020年12月11日～2021年12月10日	0.0000
第6期	2021年12月11日～2022年12月12日	0.0000

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	24.49
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	11.75
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	4.86
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	14.82
第5期	2020年12月11日～2021年12月10日	9.37
第6期	2021年12月11日～2022年12月12日	3.92

(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	2017年1月5日～2017年12月11日	814,658,599	112,792,530
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	1,273,924,653	155,611,382
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	1,307,480,891	687,984,458
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	1,443,169,223	1,563,370,580
第5期	2020年12月11日～2021年12月10日	1,505,271,269	1,014,998,282
第6期	2021年12月11日～2022年12月12日	1,342,540,996	2,654,543,369

(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。

【F Wりそな国内リートインデックスファンド】

以下の運用状況は2022年12月30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	6,706,963,190	99.85
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		9,963,360	0.15
合計(純資産総額)		6,716,926,550	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国内リートマザーファンド	4,680,038,511	1.4597	6,831,582,991	1.4331	6,706,963,190	99.85

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.85
合計	99.85

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

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 (2017年12月11日)	1,168	1,168	0.9275	0.9275
第2計算期間末 (2018年12月10日)	2,602	2,602	1.0343	1.0343
第3計算期間末 (2019年12月10日)	3,360	3,360	1.2962	1.2962
第4計算期間末 (2020年12月10日)	1,675	1,675	1.0464	1.0464
第5計算期間末 (2021年12月10日)	5,010	5,010	1.3215	1.3215
第6計算期間末 (2022年12月12日)	6,818	6,818	1.2782	1.2782
2021年12月末日	5,116		1.3217	
2022年 1月末日	6,174		1.2492	
2月末日	6,104		1.2123	
3月末日	6,649		1.2957	
4月末日	6,276		1.2801	
5月末日	6,520		1.3025	
6月末日	6,513		1.2806	
7月末日	6,584		1.3204	
8月末日	6,730		1.3356	
9月末日	6,552		1.2799	
10月末日	6,902		1.3012	
11月末日	6,933		1.3009	
12月末日	6,716		1.2547	

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	0.0000
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	0.0000
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	0.0000
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	0.0000
第5期	2020年12月11日～2021年12月10日	0.0000
第6期	2021年12月11日～2022年12月12日	0.0000

【収益率の推移】

期	期間	収益率(%)
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	7.25
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	11.51
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	25.32
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	19.27
第5期	2020年12月11日～2021年12月10日	26.29
第6期	2021年12月11日～2022年12月12日	3.28

(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	2017年 1月 5日～2017年12月11日	1,436,731,064	176,969,258
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	1,606,741,957	350,251,304
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	1,116,951,844	1,041,002,462
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	1,323,744,119	2,315,201,107
第5期	2020年12月11日～2021年12月10日	3,961,300,689	1,770,182,099
第6期	2021年12月11日～2022年12月12日	2,506,630,055	963,802,612

(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。

【FWりそな先進国リートインデックスファンド】

以下の運用状況は2022年12月30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	7,126,778,615	99.85
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		10,570,712	0.15
合計(純資産総額)		7,137,349,327	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	RM先進国リートマザーファンド	5,297,144,801	1.4150	7,495,640,491	1.3454	7,126,778,615	99.85

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.85
合 計	99.85

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

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 (2017年12月11日)	1,518	1,518	1.0266	1.0266
第2計算期間末 (2018年12月10日)	1,887	1,887	1.0271	1.0271
第3計算期間末 (2019年12月10日)	4,089	4,089	1.1296	1.1296
第4計算期間末 (2020年12月10日)	4,075	4,075	0.9678	0.9678
第5計算期間末 (2021年12月10日)	5,414	5,414	1.3700	1.3700
第6計算期間末 (2022年12月12日)	7,482	7,482	1.3303	1.3303
2021年12月末日	5,796		1.4495	
2022年 1月末日	6,084		1.3466	
2月末日	6,203		1.3466	
3月末日	7,092		1.5128	
4月末日	6,680		1.5371	
5月末日	6,332		1.4200	
6月末日	6,316		1.3853	
7月末日	6,998		1.4589	
8月末日	6,907		1.4266	
9月末日	6,266		1.2694	
10月末日	7,720		1.3817	
11月末日	7,575		1.3489	
12月末日	7,137		1.2645	

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	0.0000
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	0.0000
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	0.0000
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	0.0000
第5期	2020年12月11日～2021年12月10日	0.0000
第6期	2021年12月11日～2022年12月12日	0.0000

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	2.66
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	0.05
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	9.98
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	14.32
第5期	2020年12月11日～2021年12月10日	41.56
第6期	2021年12月11日～2022年12月12日	2.90

(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	2017年 1月 5日～2017年12月11日	1,618,331,745	138,782,803
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	1,601,705,660	1,243,412,814
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	2,308,663,405	525,928,645
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	3,083,593,311	2,492,581,409
第5期	2020年12月11日～2021年12月10日	2,372,238,888	2,631,489,022
第6期	2021年12月11日～2022年12月12日	2,551,720,696	879,474,526

(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

以下の運用状況は2022年12月30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	144,137,770,100	83.86
地方債証券	日本	9,026,525,150	5.25
特殊債証券	日本	10,350,464,572	6.02
社債券	日本	6,923,650,000	4.03
	フランス	396,424,000	0.23
	韓国	99,768,000	0.06
	小計	7,419,842,000	4.32
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		954,597,079	0.56
合計（純資産総額）		171,889,198,901	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
日本	国債証券	第142回利付国債(5年)	2,770,000,000	100.40	2,781,356,100	100.12	2,773,517,900	0.100	2024/12/20	1.61
日本	国債証券	第146回利付国債(5年)	2,470,000,000	100.53	2,483,244,200	100.11	2,472,914,600	0.100	2025/12/20	1.44
日本	国債証券	第147回利付国債(5年)	2,310,000,000	100.21	2,314,851,000	99.80	2,305,564,800	0.005	2026/3/20	1.34
日本	国債証券	第144回利付国債(5年)	2,260,000,000	100.46	2,270,620,500	100.12	2,262,757,200	0.100	2025/6/20	1.32
日本	国債証券	第143回利付国債(5年)	2,070,000,000	100.47	2,079,729,000	100.12	2,072,504,700	0.100	2025/3/20	1.21
日本	国債証券	第437回利付国債(2年)	2,070,000,000	100.16	2,073,313,400	99.98	2,069,689,500	0.005	2024/6/1	1.20
日本	国債証券	第359回利付国債(10年)	2,050,000,000	99.54	2,040,645,900	97.29	1,994,629,500	0.100	2030/6/20	1.16
日本	国債証券	第139回利付国債(5年)	1,980,000,000	100.37	1,987,444,800	100.10	1,982,138,400	0.100	2024/3/20	1.15
日本	国債証券	第140回利付国債(5年)	1,930,000,000	100.39	1,937,707,200	100.10	1,932,103,700	0.100	2024/6/20	1.12
日本	国債証券	第150回利付国債(5年)	1,930,000,000	100.01	1,930,303,100	99.40	1,918,593,700	0.005	2026/12/20	1.12
日本	国債証券	第366回日本国債(10年)	1,940,000,000	99.92	1,938,475,800	98.09	1,903,004,200	0.200	2032/3/20	1.11
日本	国債証券	第148回利付国債(5年)	1,890,000,000	100.15	1,892,956,800	99.70	1,884,462,300	0.005	2026/6/20	1.10
日本	国債証券	第149回利付国債(5年)	1,880,000,000	100.04	1,880,863,800	99.55	1,871,652,800	0.005	2026/9/20	1.09
日本	国債証券	第356回利付国債(10年)	1,880,000,000	100.21	1,884,085,500	98.00	1,842,531,600	0.100	2029/9/20	1.07
日本	国債証券	第145回利付国債(5年)	1,820,000,000	100.54	1,829,856,200	100.12	1,822,202,200	0.100	2025/9/20	1.06
日本	国債証券	第348回利付国債(10年)	1,820,000,000	100.51	1,829,306,800	99.39	1,808,970,800	0.100	2027/9/20	1.05
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	1,820,000,000	100.34	1,826,221,000	99.10	1,803,638,200	0.100	2028/3/20	1.05
日本	国債証券	第435回日本国債(2年)	1,780,000,000	100.13	1,782,392,500	100.00	1,780,000,000	0.005	2024/4/1	1.04

日本	国債証券	第362回利付国債（10年）	1,790,000,000	99.18	1,775,452,500	96.77	1,732,183,000	0.100	2031/3/20	1.01
日本	国債証券	第364回利付国債（10年）	1,770,000,000	99.25	1,756,834,900	96.62	1,710,191,700	0.100	2031/9/20	0.99
日本	国債証券	第353回利付国債（10年）	1,730,000,000	100.28	1,734,878,300	98.59	1,705,745,400	0.100	2028/12/20	0.99
日本	国債証券	第349回利付国債（10年）	1,690,000,000	100.43	1,697,358,200	99.26	1,677,578,500	0.100	2027/12/20	0.98
日本	国債証券	第440回利付国債（2年）	1,580,000,000	100.12	1,581,927,600	99.95	1,579,336,400	0.005	2024/9/1	0.92
日本	国債証券	第153回利付国債（5年）	1,510,000,000	99.78	1,506,770,100	99.09	1,496,319,400	0.005	2027/6/20	0.87
日本	国債証券	第358回利付国債（10年）	1,510,000,000	99.69	1,505,319,000	97.52	1,472,597,300	0.100	2030/3/20	0.86
日本	国債証券	第361回利付国債（10年）	1,470,000,000	99.53	1,463,200,800	96.90	1,424,444,700	0.100	2030/12/20	0.83
日本	国債証券	第360回利付国債（10年）	1,430,000,000	99.37	1,421,100,600	97.10	1,388,558,600	0.100	2030/9/20	0.81
日本	国債証券	第357回利付国債（10年）	1,410,000,000	99.99	1,409,904,700	97.77	1,378,557,000	0.100	2029/12/20	0.80
日本	国債証券	第355回利付国債（10年）	1,390,000,000	100.15	1,392,155,600	98.20	1,365,035,600	0.100	2029/6/20	0.79
日本	国債証券	第354回利付国債（10年）	1,330,000,000	99.97	1,329,689,000	98.42	1,308,999,300	0.100	2029/3/20	0.76

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	83.86
地方債証券	5.25
特殊債券	6.02
社債券	4.32
合計	99.44

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

R M国内株式マザーファンド

以下の運用状況は2022年12月30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	51,396,121,720	99.34
コール・ローン等・その他資産（負債控除後）		338,928,060	0.66

合計(純資産総額)	51,735,049,780	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	302,640,000	0.58

(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	1,035,300	2,127.29	2,202,387,310	1,812.50	1,876,481,250	3.63
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	133,400	11,415.57	1,522,837,098	10,035.00	1,338,669,000	2.59
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1,179,000	709.62	836,641,980	889.00	1,048,131,000	2.03
日本	株式	キーエンス	電気機器	18,900	54,176.82	1,023,941,950	51,420.00	971,838,000	1.88
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	242,300	3,716.05	900,399,786	3,762.00	911,532,600	1.76
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	135,700	4,164.63	565,141,032	5,296.00	718,667,200	1.39
日本	株式	第一三共	医薬品	164,700	3,495.18	575,656,396	4,250.00	699,975,000	1.35
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	167,300	3,620.70	605,743,857	4,111.00	687,770,300	1.33
日本	株式	任天堂	その他製品	119,000	5,726.42	681,444,532	5,532.00	658,308,000	1.27
日本	株式	日立製作所	電気機器	95,600	6,501.11	621,506,850	6,691.00	639,659,600	1.24
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	109,300	5,387.44	588,847,284	5,644.00	616,889,200	1.19
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	143,500	4,868.74	698,664,624	4,177.00	599,399,500	1.16
日本	株式	KDDI	情報・通信業	146,100	4,098.02	598,721,188	3,982.00	581,770,200	1.12
日本	株式	三井物産	卸売業	146,000	3,078.98	449,531,966	3,853.00	562,538,000	1.09
日本	株式	三菱商事	卸売業	124,700	4,085.22	509,427,402	4,283.00	534,090,100	1.03
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	187,000	2,489.06	465,455,390	2,827.50	528,742,500	1.02
日本	株式	信越化学工業	化学	31,900	16,998.71	542,258,849	16,225.00	517,577,500	1.00
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	13,300	48,925.46	650,708,716	38,880.00	517,104,000	1.00
日本	株式	HOYA	精密機器	40,300	13,972.32	563,084,496	12,705.00	512,011,500	0.99
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	122,900	3,793.71	466,247,610	4,146.00	509,543,400	0.98
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	268,500	1,582.37	424,868,830	1,856.00	498,336,000	0.96
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	153,300	3,413.72	523,324,364	3,032.00	464,805,600	0.90
日本	株式	ダイキン工業	機械	22,700	23,049.35	523,220,470	20,200.00	458,540,000	0.89
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	303,800	1,479.58	449,498,588	1,488.00	452,054,400	0.87
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	20,500	19,174.59	393,079,190	19,160.00	392,780,000	0.76

日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	68,700	5,441.86	373,856,124	5,660.00	388,842,000	0.75
日本	株式	村田製作所	電気機器	57,200	7,889.19	451,262,171	6,588.00	376,833,600	0.73
日本	株式	ファナック	電気機器	18,500	21,860.67	404,422,541	19,835.00	366,947,500	0.71
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	181,200	2,002.00	362,762,498	2,006.50	363,577,800	0.70
日本	株式	S M C	機械	6,200	63,218.32	391,953,640	55,580.00	344,596,000	0.67

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.10
		鉱業	0.31
		建設業	1.96
		食料品	3.50
		繊維製品	0.46
		パルプ・紙	0.18
		化学	6.08
		医薬品	5.76
		石油・石炭製品	0.49
		ゴム製品	0.71
		ガラス・土石製品	0.69
		鉄鋼	0.77
		非鉄金属	0.74
		金属製品	0.55
		機械	5.00
		電気機器	16.45
		輸送用機器	7.26
		精密機器	2.56
		その他製品	2.33
		電気・ガス業	1.27
		陸運業	3.12
		海運業	0.63
		空運業	0.52
		倉庫・運輸関連業	0.14
		情報・通信業	8.89
		卸売業	6.00
		小売業	4.74
		銀行業	6.42
		証券、商品先物取引業	0.75
		保険業	2.53
その他金融業	1.13		
不動産業	1.97		
サービス業	5.34		

合 計	99.34
-----	-------

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	16	日本円	309,708,800	302,640,000	0.58

(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先進国債券マザーファンド

以下の運用状況は2022年12月30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	23,092,172,500	50.24
	カナダ	927,968,597	2.02
	メキシコ	387,347,459	0.84
	ドイツ	3,061,489,230	6.66
	イタリア	3,412,094,290	7.42
	フランス	3,903,755,160	8.49
	オランダ	724,874,934	1.58
	スペイン	2,300,310,860	5.01
	ベルギー	848,814,522	1.85
	オーストリア	529,424,761	1.15
	フィンランド	232,627,744	0.51
	アイルランド	291,479,408	0.63
	イギリス	2,108,620,092	4.59
	スウェーデン	91,522,711	0.20
	ノルウェー	97,703,692	0.21
	デンマーク	150,388,588	0.33
	ポーランド	198,982,942	0.43
	オーストラリア	719,665,914	1.57
	ニュージーランド	100,822,909	0.22
	シンガポール	213,090,814	0.46
マレーシア	245,460,115	0.53	
中国	1,658,257,397	3.61	

	イスラエル	157,867,112	0.34
	小計	45,454,741,751	98.90
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		504,465,194	1.10
合計(純資産総額)		45,959,206,945	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		56,750,309	0.12

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,920,000	13,230.58	254,027,158	12,278.89	235,754,818	2.875	2032/5/15	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,070,000	13,143.49	272,070,441	11,214.44	232,139,030	1.625	2031/5/15	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,110,000	12,721.57	268,425,226	10,808.31	228,055,370	1.250	2031/8/15	0.50
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,100,000	12,375.82	259,892,407	10,654.09	223,736,085	0.875	2030/11/15	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,050,000	12,822.33	262,857,787	10,848.22	222,388,612	1.375	2031/11/15	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,700,000	13,171.66	223,918,378	12,762.63	216,964,739	0.750	2023/12/31	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,920,000	12,280.83	235,792,116	11,298.93	216,939,617	1.875	2032/2/15	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,650,000	12,420.58	204,939,618	12,129.60	200,138,554	2.750	2032/8/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,540,000	13,582.05	209,163,600	12,863.60	198,099,536	2.125	2024/3/31	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,580,000	13,107.75	207,102,497	12,396.04	195,857,526	0.750	2024/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,720,000	12,626.71	217,179,505	10,865.07	186,879,232	1.125	2031/2/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,360,000	13,447.02	182,879,496	13,353.45	181,606,999	4.125	2027/10/31	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,720,000	11,924.56	205,102,580	10,481.74	180,286,010	0.625	2030/8/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,520,000	12,825.41	194,946,310	11,790.86	179,221,095	1.875	2029/2/28	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,550,000	12,946.02	200,663,385	11,525.72	178,648,670	1.250	2028/5/31	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,360,000	13,001.28	176,817,442	13,026.37	177,158,646	3.500	2025/9/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,450,000	13,029.58	188,929,028	12,005.20	174,075,445	1.500	2027/1/31	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,330,000	13,041.92	173,457,560	12,614.79	167,776,757	0.125	2024/2/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,330,000	13,009.78	173,030,117	12,461.87	165,742,973	0.250	2024/6/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,440,000	12,640.04	182,016,672	11,479.84	165,309,782	1.375	2028/12/31	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,300,000	13,689.35	177,961,575	12,579.02	163,527,350	2.250	2025/11/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,360,000	12,773.92	173,725,431	11,845.54	161,099,459	0.500	2026/2/28	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,230,000	13,153.09	161,783,023	12,953.80	159,331,750	3.000	2024/7/31	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,320,000	12,726.24	167,986,373	11,827.92	156,128,598	0.375	2026/1/31	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,310,000	12,894.70	168,920,663	11,805.63	154,653,815	0.875	2026/9/30	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,430,000	12,176.26	174,120,538	10,543.68	150,774,750	0.625	2030/5/15	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,190,000	13,003.56	154,742,390	12,377.38	147,290,884	0.375	2024/9/15	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,170,000	14,273.02	166,994,391	12,535.74	146,668,204	2.875	2028/8/15	0.32

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,280,000	12,817.47	164,063,638	11,368.65	145,518,820	1.125	2028/8/31	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,210,000	13,110.86	158,641,448	11,929.26	144,344,087	1.250	2026/11/30	0.31

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

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	139,000.00	18,630,170	18,431,622	0.04
	カナダドル	買建	122,000.00	12,026,638	11,933,918	0.03
	ユーロ	買建	147,000.00	20,939,415	20,788,269	0.05
	英ポンド	買建	35,000.00	5,647,285	5,596,500	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。

R M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12月30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	110,542,247,894	48.61
	カナダ	4,444,427,880	1.95
	メキシコ	1,865,811,107	0.82
	ドイツ	14,613,647,276	6.43
	イタリア	16,355,600,930	7.19
	フランス	18,697,038,091	8.22
	オランダ	3,466,918,130	1.52
	スペイン	11,029,256,880	4.85
	ベルギー	4,053,280,494	1.78
	オーストリア	2,558,945,777	1.13
	フィンランド	1,120,314,528	0.49
	アイルランド	1,357,116,955	0.60

	イギリス	10,097,814,363	4.44
	スウェーデン	442,977,629	0.19
	ノルウェー	464,247,964	0.20
	デンマーク	725,530,637	0.32
	ポーランド	936,711,706	0.41
	オーストラリア	3,476,389,764	1.53
	ニュージーランド	485,256,681	0.21
	シンガポール	1,012,699,749	0.45
	マレーシア	1,200,132,839	0.53
	中国	7,907,702,625	3.48
	イスラエル	774,425,571	0.34
	小計	217,628,495,470	95.70
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		9,788,103,792	4.30
合計（純資産総額）		227,416,599,262	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		222,765,375,923	97.95

(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	10,050,000	12,515.26	1,257,784,509	12,278.89	1,234,029,135	2.875	2032/5/15	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,590,000	11,511.20	1,219,036,786	11,298.93	1,196,557,579	1.875	2032/2/15	0.53
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,740,000	11,048.31	1,186,588,670	10,848.22	1,165,099,365	1.375	2031/11/15	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,170,000	10,993.88	1,008,139,156	10,808.31	991,122,150	1.250	2031/8/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,260,000	10,826.45	1,002,529,637	10,654.09	986,569,601	0.875	2030/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,060,000	12,372.20	997,199,445	12,129.60	977,646,516	2.750	2032/8/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,100,000	11,402.86	923,632,436	11,214.44	908,370,121	1.625	2031/5/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,470,000	10,646.06	901,721,686	10,481.74	887,803,792	0.625	2030/8/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,740,000	12,881.74	868,229,873	12,890.04	868,788,872	2.500	2024/5/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,150,000	12,064.29	862,597,166	12,005.20	858,372,023	1.500	2027/1/31	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,480,000	12,812.80	830,269,900	12,687.88	822,174,778	3.125	2028/11/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,610,000	12,443.21	822,496,626	12,310.77	813,742,288	2.625	2029/2/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,330,000	11,044.68	809,575,280	10,865.07	796,409,752	1.125	2031/2/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,300,000	12,551.03	790,715,237	12,533.92	789,637,570	2.000	2025/8/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,110,000	12,812.28	782,830,835	12,819.54	783,274,244	2.375	2024/8/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,130,000	12,559.84	769,918,664	12,589.13	771,713,976	0.250	2024/3/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,090,000	12,673.10	771,792,347	12,566.84	765,320,892	2.875	2028/5/15	0.34

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,060,000	12,471.20	755,755,219	12,498.68	757,420,084	0.250	2024/5/15	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,890,000	12,737.26	750,224,687	12,762.63	751,719,010	0.750	2023/12/31	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,950,000	12,582.65	748,667,996	12,614.79	750,580,228	0.125	2024/2/15	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,500,000	11,625.24	755,640,972	11,525.72	749,171,847	1.250	2028/5/31	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,360,000	11,820.14	751,761,467	11,701.96	744,244,841	1.750	2029/1/31	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,970,000	12,426.11	741,838,823	12,432.84	742,241,119	1.000	2024/12/15	0.33
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	5,110,000	14,742.13	753,323,149	14,487.10	740,291,220	3.500	2026/4/25	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,850,000	12,612.72	737,844,137	12,510.34	731,855,146	2.750	2028/2/15	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,110,000	11,940.92	729,590,613	11,892.20	726,613,471	1.125	2026/10/31	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,730,000	12,668.18	725,886,989	12,583.69	721,045,562	2.750	2027/7/31	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,590,000	12,772.37	713,975,763	12,801.66	715,612,921	1.500	2024/2/29	0.31
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	13,454.53	713,090,404	13,353.45	707,733,158	4.125	2027/10/31	0.31
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,830,000	12,161.22	708,999,665	12,122.35	706,733,137	1.500	2026/8/15	0.31

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	95.70
合 計	95.70

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	841,705,000.00	111,070,970,947	111,119,284,814	48.86
	カナダドル	売建	46,597,000.00	4,536,283,185	4,538,627,014	2.00
	メキシコペソ	売建	282,756,000.00	1,903,654,770	1,901,675,478	0.84
	ユーロ	売建	544,761,000.00	76,803,685,241	76,867,302,430	33.80
	英ポンド	売建	66,888,000.00	10,655,131,312	10,655,813,570	4.69
	スウェーデンクローナ	売建	36,111,000.00	456,435,817	457,017,204	0.20
	ノルウェークローネ	売建	34,989,000.00	466,935,202	466,959,695	0.21
	デンマーククローネ	売建	40,001,000.00	758,528,634	759,054,975	0.33
	ポーランドズロチ	売建	31,346,000.00	940,138,635	940,141,770	0.41
	オーストラリアドル	売建	40,234,000.00	3,594,592,465	3,591,105,787	1.58
	ニュージーランドドル	売建	5,950,000.00	497,232,575	497,114,170	0.22
	シンガポールドル	売建	10,261,000.00	1,008,396,696	1,008,454,158	0.44
	マレーシアリングット	売建	40,080,000.00	1,211,269,704	1,203,117,432	0.53
	中国元	売建	419,684,000.00	7,975,129,146	7,972,569,074	3.51
	イスラエルシェケル	売建	20,944,000.00	788,227,440	787,138,352	0.35

(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新興国債券マザーファンド

以下の運用状況は2022年12月30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	1,918,684,931	19.30
	アイルランド	7,992,375,376	80.40
	小計	9,911,060,307	99.70
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		29,349,614	0.30
合計（純資産総額）		9,940,409,921	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アイルランド	投資信託受益証券	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	1,380,447	6,346.59	8,761,132,951	5,789.70	7,992,375,376	80.40
アメリカ	投資信託受益証券	VANECK J.P.MORGAN EM LOCAL	596,732	3,777.96	2,254,434,997	3,215.32	1,918,684,931	19.30

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	99.70
合計	99.70

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先進国株式マザーファンド

以下の運用状況は2022年12月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	96,619,537,381	61.45
	カナダ	5,345,978,038	3.40
	パナマ	23,281,026	0.01
	ドイツ	3,514,783,204	2.24
	イタリア	756,878,819	0.48
	フランス	4,760,207,906	3.03
	オランダ	2,687,177,224	1.71
	スペイン	1,077,043,734	0.69
	ベルギー	366,414,071	0.23
	オーストリア	83,040,278	0.05
	ルクセンブルク	99,564,070	0.06
	フィンランド	557,974,282	0.35
	アイルランド	2,636,855,244	1.68
	ポルトガル	85,540,736	0.05
	イギリス	6,343,753,032	4.03
	スイス	4,877,347,117	3.10
	スウェーデン	1,347,742,389	0.86
	ノルウェー	338,244,789	0.22
	デンマーク	1,286,779,589	0.82
	ケイマン	280,822,513	0.18
	リベリア	33,894,791	0.02
	オーストラリア	3,182,155,795	2.02
	バミューダ	214,461,286	0.14
	ニュージーランド	100,936,953	0.06
	香港	1,000,599,565	0.64
	シンガポール	514,447,555	0.33
	イスラエル	313,018,272	0.20
	キュラソー	227,780,375	0.14
	ジャージー	568,735,497	0.36
	マン島	30,899,707	0.02
小計		139,275,895,238	88.58
投資証券	アメリカ	2,854,484,536	1.82
	カナダ	13,793,431	0.01
	フランス	56,315,778	0.04
	ベルギー	15,806,737	0.01
	イギリス	62,009,625	0.04
	オーストラリア	180,736,622	0.11
	香港	50,463,619	0.03

	シンガポール	65,529,619	0.04
	小計	3,299,139,967	2.10
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		14,653,493,748	9.32
合計(純資産総額)		157,228,528,953	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	11,842,657,232	7.53
	買建	ドイツ	2,930,427,967	1.86

(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		948,319,073	0.60

(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	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	367,634	20,984.52	7,714,624,689	17,199.24	6,323,027,972	4.02
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	162,099	37,617.85	6,097,816,462	31,982.02	5,184,254,595	3.30
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	209,843	17,659.27	3,705,675,868	11,170.68	2,344,090,262	1.49
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	137,361	16,281.10	2,236,389,543	11,737.31	1,612,249,326	1.03
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	21,412	64,096.10	1,372,425,726	70,315.07	1,505,586,407	0.96
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	127,083	16,338.37	2,076,329,765	11,803.66	1,500,045,159	0.95
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	60,178	22,145.79	1,332,689,522	23,562.21	1,417,926,794	0.90
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	95,370	10,718.66	1,022,238,639	14,490.84	1,381,991,411	0.88
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	29,790	39,906.70	1,188,820,875	41,012.26	1,221,755,285	0.78
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	67,107	18,063.63	1,212,196,496	17,678.29	1,186,337,275	0.75
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	54,595	20,614.27	1,125,436,590	20,248.69	1,105,477,394	0.70
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	56,972	27,796.91	1,583,646,021	19,378.18	1,104,013,728	0.70

アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	37,442	27,089.45	1,014,283,468	27,609.56	1,033,757,220	0.66
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	42,560	18,384.94	782,463,243	23,663.06	1,007,100,004	0.64
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	23,451	45,276.02	1,061,768,113	42,518.40	997,099,163	0.63
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	60,981	37,660.69	2,296,586,795	16,165.51	985,789,209	0.63
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	63,016	16,778.74	1,057,329,702	15,561.29	980,610,402	0.62
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	19,762	45,891.46	906,907,066	46,207.46	913,151,963	0.58
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	18,493	36,281.65	670,956,711	48,703.55	900,674,824	0.57
アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	128,514	6,785.79	872,069,032	6,811.49	875,371,954	0.56
アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	40,486	18,396.35	744,794,763	21,571.71	873,352,332	0.56
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	58,009	11,230.48	651,469,126	14,705.81	853,069,564	0.54
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	52,352	33,944.55	1,777,065,182	15,958.50	835,459,497	0.53
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	94,099	8,095.26	761,756,750	8,486.16	798,539,640	0.51
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	31,610	23,012.39	727,421,935	24,148.74	763,341,861	0.49
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	165,519	5,420.27	897,158,057	4,397.67	727,899,265	0.46
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	9,242	71,103.51	657,138,731	74,021.38	684,105,659	0.44
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	9,325	78,919.43	735,923,773	73,097.54	681,634,644	0.43
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	37,965	13,013.19	494,046,018	17,895.91	679,418,527	0.43
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	16,108	48,283.03	777,743,131	42,094.25	678,054,324	0.43

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	エネルギー	5.39
		素材	4.08
		資本財	6.15
		商業・専門サービス	1.13
		運輸	1.73

	自動車・自動車部品	1.38
	耐久消費財・アパレル	1.50
	消費者サービス	1.72
	メディア・娯楽	4.32
	小売	3.98
	食品・生活必需品小売り	1.40
	食品・飲料・タバコ	4.11
	家庭用品・パーソナル用品	1.74
	ヘルスケア機器・サービス	4.65
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.83
	銀行	5.54
	各種金融	4.39
	保険	3.17
	不動産	0.31
	ソフトウェア・サービス	9.48
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.36
	電気通信サービス	1.33
	公益事業	3.05
	半導体・半導体製造装置	3.85
投資証券		2.10
合計		90.68

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	SP500MIN2303	買建	461	米ドル	91,915,142.5	12,197,139,409	89,243,837.5	11,842,657,232	7.53
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	STX E6002303	買建	963	ユーロ	20,955,330	2,964,550,537	20,714,130	2,930,427,967	1.86

(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	5,070,000.00	678,782,247	672,290,112	0.43
	カナダドル	買建	410,000.00	40,338,270	40,105,790	0.03
	ユーロ	買建	590,000.00	83,894,276	83,435,912	0.05
	英ポンド	買建	360,000.00	57,814,632	57,564,000	0.04

スイスフラン	買建	230,000.00	33,163,750	33,054,634	0.02
スウェーデンクローナ	買建	910,000.00	11,616,990	11,535,888	0.01
デンマーククローネ	買建	340,000.00	6,513,380	6,464,590	0.00
オーストラリアドル	買建	300,000.00	27,004,158	26,857,440	0.02
香港ドル	買建	710,000.00	12,143,755	12,076,177	0.01
シンガポールドル	買建	50,000.00	4,932,650	4,934,530	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新興国株式マザーファンド

以下の運用状況は2022年12月30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	74,663,221	0.43
	メキシコ	363,211,977	2.09
	ブラジル	845,095,479	4.86
	チリ	88,612,480	0.51
	コロンビア	18,239,843	0.10
	ペルー	3,769,102	0.02
	オランダ	4,155,342	0.02
	ルクセンブルク	18,448,820	0.11
	ギリシャ	51,337,468	0.29
	トルコ	107,207,229	0.62
	チェコ	22,219,433	0.13
	キプロス	0	0.00
	ハンガリー	30,291,489	0.17
	ポーランド	108,340,334	0.62
	ロシア	0	0.00
	ケイマン	3,000,248,246	17.24
	バミューダ	84,042,040	0.48
	香港	181,438,273	1.04
	シンガポール	3,821,415	0.02
	マレーシア	250,652,634	1.44
	タイ	358,428,860	2.06
	フィリピン	117,719,344	0.68
	インドネシア	306,041,323	1.76
韓国	1,831,885,284	10.52	
台湾	2,154,907,901	12.38	
中国	1,946,037,151	11.18	
インド	2,341,477,065	13.45	

	カタール	158,443,299	0.91
	エジプト	10,208,388	0.06
	南アフリカ	581,627,155	3.34
	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	218,936,010	1.26
	クウェート	152,002,638	0.87
	サウジアラビア	660,966,750	3.80
	小計	16,094,475,993	92.47
投資証券	メキシコ	13,780,396	0.08
	南アフリカ	7,217,687	0.04
	小計	20,998,083	0.12
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		1,290,165,378	7.41
合計（純資産総額）		17,405,639,454	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	1,286,959,763	7.39

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

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建		29,809,928	0.17
	売建		1,962,134	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。

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	473,000	2,735.11	1,293,710,994	1,924.80	910,431,441	5.23
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	120,100	7,530.90	904,461,905	5,705.10	685,182,990	3.94
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	91,798	7,725.35	709,171,983	5,834.15	535,563,302	3.08
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	小売	284,740	1,972.44	561,634,786	1,456.06	414,598,809	2.38
ケイマン	株式	MEITUAN	小売	84,700	3,800.53	321,904,971	3,128.27	264,964,977	1.52
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	58,593	3,918.10	229,573,326	4,094.71	239,921,519	1.38
ブラジル	株式	VALE SA	素材	73,804	2,063.92	152,326,141	2,229.48	164,544,815	0.95

インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	64,863	2,739.28	177,678,418	2,443.25	158,476,882	0.91
ケイマン	株式	JD.COM INC - CL A	小売	41,460	4,753.87	197,095,571	3,710.36	153,831,526	0.88
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	1,850,000	99.04	183,234,079	83.05	153,656,560	0.88
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	99,382	1,296.89	128,888,053	1,461.96	145,292,558	0.83
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	各種金融	33,264	4,057.86	134,980,973	4,307.39	143,281,154	0.82
ケイマン	株式	PINDUODUO INC-ADR	小売	9,736	8,321.66	81,019,732	10,935.80	106,471,017	0.61
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	122,500	1,067.09	130,719,053	862.91	105,706,965	0.61
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	241,800	448.35	108,413,116	430.27	104,040,565	0.60
サウジアラビア	株式	AL RAJHI BANK	銀行	37,883	3,255.71	123,336,156	2,659.82	100,762,113	0.58
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	小売	4,217	19,209.06	81,004,623	22,326.10	94,149,164	0.54
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	17,679	5,955.54	105,288,145	5,262.68	93,039,052	0.53
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	15,930	6,998.59	111,487,693	5,327.75	84,871,058	0.49
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	10,577	12,184.34	128,873,854	7,912.50	83,690,513	0.48
ケイマン	株式	BAIDU INC-CLASS A	メディア・娯楽	42,480	2,470.73	104,956,833	1,872.20	79,531,056	0.46
インドネシア	株式	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	銀行	1,077,600	66.94	72,140,197	72.88	78,543,570	0.45
台湾	株式	MEDIA TEK INC	半導体・半導体製造装置	28,800	4,469.29	128,715,718	2,714.57	78,179,769	0.45
サウジアラビア	株式	THE SAUDI NATIONAL BANK	銀行	42,526	2,510.06	106,742,970	1,786.18	75,959,303	0.44
中国	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	1,088,000	78.89	85,832,593	68.25	74,256,218	0.43
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	1,532,000	51.14	78,360,132	48.33	74,051,978	0.43
ケイマン	株式	NETEASE INC	メディア・娯楽	38,000	2,563.72	97,421,459	1,894.32	71,984,388	0.41
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	70,000	1,420.30	99,421,549	1,013.54	70,947,870	0.41
韓国	株式	SAMSUNG SDI CO LTD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,066	70,737.63	75,406,323	62,350.50	66,465,633	0.38
インド	株式	AXIS BANK LTD	銀行	44,140	1,147.83	50,665,412	1,504.62	66,414,170	0.38

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	4.51
		素材	8.21
		資本財	3.61
		商業・専門サービス	0.08

	運輸	1.90
	自動車・自動車部品	2.91
	耐久消費財・アパレル	1.48
	消費者サービス	1.36
	メディア・娯楽	6.37
	小売	7.34
	食品・生活必需品小売り	1.33
	食品・飲料・タバコ	3.82
	家庭用品・パーソナル用品	0.84
	ヘルスケア機器・サービス	1.02
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.76
	銀行	14.80
	各種金融	3.12
	保険	2.53
	不動産	1.68
	ソフトウェア・サービス	2.41
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.20
	電気通信サービス	2.79
	公益事業	2.81
	半導体・半導体製造装置	7.60
投資証券		0.12
合計		92.59

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 2303	買建	199	米ドル	9,877,340	1,310,723,016	9,698,265	1,286,959,763	7.39

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

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	買建	224,808.23	30,135,804	29,809,928	0.17
	ブラジルレアル	売建	77,267.18	1,965,339	1,938,183	0.01
	オフショア人民元	売建	1,260.00	24,165	23,951	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12月30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	31,245,406,200	98.70
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		411,319,184	1.30
合計（純資産総額）		31,656,725,384	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	356,250,000	1.13

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	3,437	659,723.55	2,267,469,843	588,000	2,020,956,000	6.38
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	2,946	619,329.24	1,824,543,942	577,000	1,699,842,000	5.37
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	14,866	99,571.66	1,480,232,392	104,700	1,556,470,200	4.92
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	9,528	158,508.07	1,510,264,977	163,000	1,553,064,000	4.91
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	4,966	345,057.92	1,713,557,642	308,500	1,532,011,000	4.84
日本	投資証券	G L P投資法人	9,509	173,192.28	1,646,885,410	151,300	1,438,711,700	4.54
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	4,441	320,035.03	1,421,275,608	293,400	1,302,989,400	4.12
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	5,870	174,681.79	1,025,382,150	186,500	1,094,755,000	3.46
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	2,946	349,006.57	1,028,173,367	339,000	998,694,000	3.15
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	6,591	138,746.33	914,477,075	150,600	992,604,600	3.14
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	2,015	381,585.89	768,895,575	370,500	746,557,500	2.36
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	9,501	62,726.35	595,963,116	77,500	736,327,500	2.33
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	4,403	183,108.15	806,225,213	151,800	668,375,400	2.11
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	12,968	39,284.2	509,437,568	51,000	661,368,000	2.09
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	8,853	78,882.3	698,345,081	74,600	660,433,800	2.09
日本	投資証券	アクティブピア・プロパティーズ投資法人	1,555	398,605.11	619,830,954	413,000	642,215,000	2.03
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	1,987	316,630.01	629,143,836	313,500	622,924,500	1.97
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	1,017	634,499.31	645,285,801	603,000	613,251,000	1.94

日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	3,607	173,515.56	625,870,636	160,100	577,480,700	1.82
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	1,164	544,835.39	634,188,401	481,000	559,884,000	1.77
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	1,093	501,170.03	547,778,843	512,000	559,616,000	1.77
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	1,714	337,238.1	578,026,113	320,000	548,480,000	1.73
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	3,465	148,147.46	513,330,979	157,400	545,391,000	1.72
日本	投資証券	イオンリート投資法人	3,261	149,348.23	487,024,605	154,500	503,824,500	1.59
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	4,083	113,450.47	463,218,274	114,900	469,136,700	1.48
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	2,757	163,715.29	451,363,077	163,900	451,872,300	1.43
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	2,161	208,429.7	450,416,588	205,600	444,301,600	1.40
日本	投資証券	三菱地所物流リート投資法人	1,012	452,812.75	458,246,507	422,000	427,064,000	1.35
日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人	1,975	190,311.36	375,864,946	207,500	409,812,500	1.29
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,371	319,071.54	437,447,090	296,600	406,638,600	1.28

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
投資証券	98.70
合計	98.70

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	190	日本円	361,522,500	356,250,000	1.13

(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12月30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	270,055,617	0.83
	オーストラリア	20,147,744	0.06
	小計	290,203,361	0.89
投資証券	アメリカ	24,572,614,664	75.68
	カナダ	599,727,016	1.85

	ドイツ	16,269,487	0.05
	イタリア	3,875,882	0.01
	フランス	572,317,788	1.76
	オランダ	63,205,605	0.19
	スペイン	138,355,947	0.43
	ベルギー	351,839,507	1.08
	アイルランド	13,319,415	0.04
	イギリス	1,499,287,863	4.62
	オーストラリア	2,118,955,308	6.53
	ニュージーランド	132,958,620	0.41
	香港	447,621,915	1.38
	シンガポール	1,226,827,867	3.78
	韓国	76,273,468	0.23
	イスラエル	47,173,432	0.15
	ガーンジー	73,395,532	0.23
	小計	31,954,019,316	98.41
	コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	225,488,625	0.69
	合計（純資産総額）	32,469,711,302	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	178,860	17,269.77	3,088,872,233	15,123.81	2,705,046,266	8.33
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	17,934	89,844.73	1,611,275,469	88,294.59	1,583,475,338	4.88
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	30,633	43,817.23	1,342,253,211	37,498.36	1,148,687,446	3.54
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	121,556	8,874.62	1,078,763,734	8,496.78	1,032,834,711	3.18
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	63,370	16,075.85	1,018,727,060	15,568.36	986,567,227	3.04
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	186,705	3,994.83	745,854,893	4,300.80	802,982,171	2.47
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	91,600	10,563.32	967,600,573	8,735.64	800,184,716	2.46
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	55,742	17,783.80	991,304,728	13,442.50	749,312,392	2.31
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	27,128	28,383.76	769,994,696	21,583.65	585,521,393	1.80
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	28,964	22,378.16	648,161,306	19,268.04	558,079,511	1.72
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	65,963	10,417.40	687,163,532	7,940.76	523,796,880	1.61
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	332,018	1,846.19	612,971,496	1,555.83	516,563,864	1.59
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	25,962	24,645.99	639,859,397	19,773.62	513,362,904	1.58
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	22,398	24,161.62	541,172,099	20,932.09	468,837,131	1.44
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	77,519	6,580.26	510,095,341	6,045.81	468,665,300	1.44
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	24,030	22,021.58	529,178,654	19,218.94	461,831,152	1.42
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	112,666	5,042.47	568,115,218	3,984.98	448,971,869	1.38
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	40,369	10,499.91	423,870,914	10,414.29	420,414,715	1.29

香港	投資証券	LINK REIT	408,300	1,109.51	453,013,311	966.73	394,718,309	1.22
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	56,398	6,345.46	357,871,523	6,652.25	375,173,652	1.16
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	12,564	38,636.03	485,423,197	28,433.62	357,240,115	1.10
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	104,284	3,928.30	409,659,034	3,344.03	348,729,867	1.07
アメリカ	投資証券	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	49,964	6,083.21	303,941,674	6,904.38	344,970,492	1.06
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	119,976	2,923.35	350,732,946	2,807.93	336,884,450	1.04
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	20,675	18,717.85	386,991,724	14,987.13	309,859,078	0.95
アメリカ	投資証券	UDR INC	59,131	6,534.48	386,390,386	5,163.35	305,314,463	0.94
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	33,955	9,598.41	325,914,182	8,667.96	294,320,718	0.91
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	138,840	2,289.70	317,903,018	2,097.98	291,284,515	0.90
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	234,959	1,733.54	407,311,787	1,238.40	290,973,226	0.90
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	1,008,773	251.73	253,945,804	260.64	262,935,371	0.81

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	0.89
投資証券			98.41
合計			99.31

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

参考情報

運用実績

FWりそな国内債券インデックスファンド

2022年12月30日現在

基準価額・純資産の推移



分配の推移

(1万円当たり、税引前)

2018年12月10日	0円
2019年12月10日	0円
2020年12月10日	0円
2021年12月10日	0円
2022年12月12日	0円
設定来累計	0円

主要な資産の状況

■ポートフォリオの状況

資産	組入比率
債券	99.4%
先物	0.0%
現金等	0.6%
合計	100.0%

■組入上位銘柄

	銘柄名	クーポン	償還日	組入比率
1	第142回利付国債(5年)	0.100%	2024/12/20	1.6%
2	第146回利付国債(5年)	0.100%	2025/12/20	1.4%
3	第147回利付国債(5年)	0.005%	2026/3/20	1.3%
4	第144回利付国債(5年)	0.100%	2025/6/20	1.3%
5	第143回利付国債(5年)	0.100%	2025/3/20	1.2%
6	第437回利付国債(2年)	0.005%	2024/6/1	1.2%
7	第359回利付国債(10年)	0.100%	2030/6/20	1.2%
8	第139回利付国債(5年)	0.100%	2024/3/20	1.2%
9	第140回利付国債(5年)	0.100%	2024/6/20	1.1%
10	第150回利付国債(5年)	0.005%	2026/12/20	1.1%

※組入比率は、マザーファンドの純資産総額に対する比率であり、四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。

年間収益率の推移(暦年ベース)



- ・2013年から2016年までは、対象インデックス(NOMURA-BPI総合)の年間騰落率です。
- ・対象インデックスはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。
- ・2017年は1月5日から12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。

FWりそな国内株式インデックスファンド

2022年12月30日現在

基準価額・純資産の推移



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

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

2018年12月10日	0円
2019年12月10日	0円
2020年12月10日	0円
2021年12月10日	0円
2022年12月12日	0円
設定来累計	0円

主要な資産の状況

■ポートフォリオの状況

資産	組入比率
株式	99.3%
先物	0.6%
現金等	0.1%
合計	100.0%

■組入上位業種

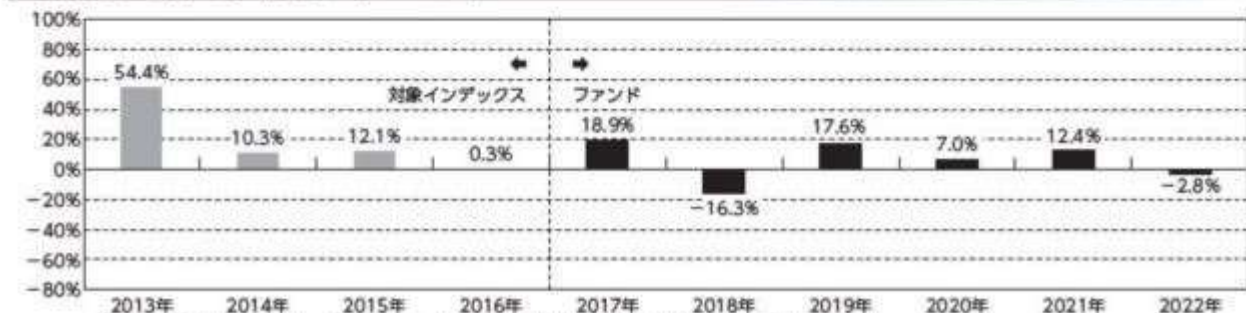
業種	組入比率
1 電気機器	16.4%
2 情報・通信業	8.9%
3 輸送用機器	7.3%
4 銀行業	6.4%
5 化学	6.1%

■組入上位銘柄

	銘柄名	業種	組入比率
1	トヨタ自動車	輸送用機器	3.6%
2	ソニーグループ	電気機器	2.6%
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	2.0%
4	キーエンス	電気機器	1.9%
5	日本電信電話	情報・通信業	1.8%
6	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.4%
7	第一三共	医薬品	1.4%
8	武田薬品工業	医薬品	1.3%
9	任天堂	その他製品	1.3%
10	日立製作所	電気機器	1.2%

※組入比率は、マザーファンドの純資産総額に対する比率であり、四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。
※業種は東証33業種の分類を基準としています。

年間収益率の推移(暦年ベース)



・2013年から2016年までは、対象インデックス(東証株価指数(TOPIX、配当込み))の年間騰落率です。
・対象インデックスはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。
・2017年は1月5日から12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。

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)

2022年12月30日現在

基準価額・純資産の推移



※基準価額は1万円当たり、運用管理費用(信託報酬)控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

分配の推移

(1万円当たり、税引前)

2018年12月10日	0円
2019年12月10日	0円
2020年12月10日	0円
2021年12月10日	0円
2022年12月12日	0円
設定来累計	0円

主要な資産の状況

■ポートフォリオの状況

資産	組入比率
債券	98.9%
先物	0.0%
現金等	1.1%
合計	100.0%

■通貨別資産配分

通貨	組入比率
米ドル	50.2%
ユーロ	33.3%
英ポンド	4.6%
中国元	3.6%
カナダドル	2.0%
その他	6.2%
合計	100.0%

■組入上位銘柄

	銘柄名	国・地域	クーポン	償還日	組入比率
1	US TREASURY N/B	アメリカ	2.875%	2032/5/15	0.5%
2	US TREASURY N/B	アメリカ	1.625%	2031/5/15	0.5%
3	US TREASURY N/B	アメリカ	1.250%	2031/8/15	0.5%
4	US TREASURY N/B	アメリカ	0.875%	2030/11/15	0.5%
5	US TREASURY N/B	アメリカ	1.375%	2031/11/15	0.5%
6	US TREASURY N/B	アメリカ	0.750%	2023/12/31	0.5%
7	US TREASURY N/B	アメリカ	1.875%	2032/2/15	0.5%
8	US TREASURY N/B	アメリカ	2.750%	2032/8/15	0.4%
9	US TREASURY N/B	アメリカ	2.125%	2024/3/31	0.4%
10	US TREASURY N/B	アメリカ	0.750%	2024/11/15	0.4%

※組入比率は、マザーファンドの純資産総額に対する比率であり、四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。

※国・地域は発行国もしくは投資国を表示しています。

年間収益率の推移(暦年ベース)



・2013年から2016年までは、対象インデックス (FTSE世界国債インデックス (除く日本、円換算ベース)) の年間騰落率です。

・対象インデックスはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

・2017年は1月5日から12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。

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)

2022年12月30日現在

基準価額・純資産の推移



※基準価額は1万円当たり、運用管理費用(信託報酬)控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

分配の推移

(1万円当たり、税引前)

2018年12月10日	0円
2019年12月10日	0円
2020年12月10日	0円
2021年12月10日	0円
2022年12月12日	0円
設定来累計	0円

主要な資産の状況

■ポートフォリオの状況

資産	組入比率
債券	95.7%
先物	0.0%
現金等	4.3%
合計	100.0%

■通貨別資産配分

通貨	組入比率
米ドル	48.6%
ユーロ	32.2%
英ポンド	4.4%
中国元	3.5%
カナダドル	2.0%
その他	9.3%
合計	100.0%

■組入上位銘柄

	銘柄名	国・地域	クーポン	償還日	組入比率
1	US TREASURY N/B	アメリカ	2.875%	2032/5/15	0.5%
2	US TREASURY N/B	アメリカ	1.875%	2032/2/15	0.5%
3	US TREASURY N/B	アメリカ	1.375%	2031/11/15	0.5%
4	US TREASURY N/B	アメリカ	1.250%	2031/8/15	0.4%
5	US TREASURY N/B	アメリカ	0.875%	2030/11/15	0.4%
6	US TREASURY N/B	アメリカ	2.750%	2032/8/15	0.4%
7	US TREASURY N/B	アメリカ	1.625%	2031/5/15	0.4%
8	US TREASURY N/B	アメリカ	0.625%	2030/8/15	0.4%
9	US TREASURY N/B	アメリカ	2.500%	2024/5/15	0.4%
10	US TREASURY N/B	アメリカ	1.500%	2027/1/31	0.4%

※組入比率は、マザーファンドの純資産総額に対する比率であり、四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。

※国・地域は発行国もしくは投資国を表示しています。

年間収益率の推移(暦年ベース)



・2013年から2016年までは、対象インデックス(FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース))の年間騰落率です。

・対象インデックスはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

・2017年は1月5日から12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。

FWりそな新興国債券インデックスファンド

2022年12月30日現在

基準価額・純資産の推移



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

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

2018年12月10日	0円
2019年12月10日	0円
2020年12月10日	0円
2021年12月10日	0円
2022年12月12日	0円
設定来累計	0円

主要な資産の状況

■ポートフォリオの状況

資産	組入比率
投資信託証券	99.7%
先物	0.0%
現金等	0.3%
合計	100.0%

■通貨別資産配分

通貨	組入比率
中国元	10.0%
インドネシアルピア	9.8%
メキシコペソ	9.7%
ブラジルレアル	9.6%
マレーシアリンギット	9.4%
その他	51.5%
合計	100.0%

■組入上位銘柄

	銘柄名	国・地域	クーポン	償還日	組入比率
1	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	アイルランド	—	—	80.4%
2	VANECK J.P.MORGAN EM LOCAL	アメリカ	—	—	19.3%
3	—	—	—	—	—
4	—	—	—	—	—
5	—	—	—	—	—
6	—	—	—	—	—
7	—	—	—	—	—
8	—	—	—	—	—
9	—	—	—	—	—
10	—	—	—	—	—

※組入比率は、マザーファンドの純資産総額に対する比率であり、四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。

※通貨別資産配分は、マザーファンドが実質的に保有している債券の通貨を基準に算出しています。

※国・地域は発行国もしくは投資国を表示しています。

年間収益率の推移(暦年ベース)



・2013年から2016年までは、対象インデックス(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))の年間騰落率です。

・対象インデックスはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

・2017年は1月5日から12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。

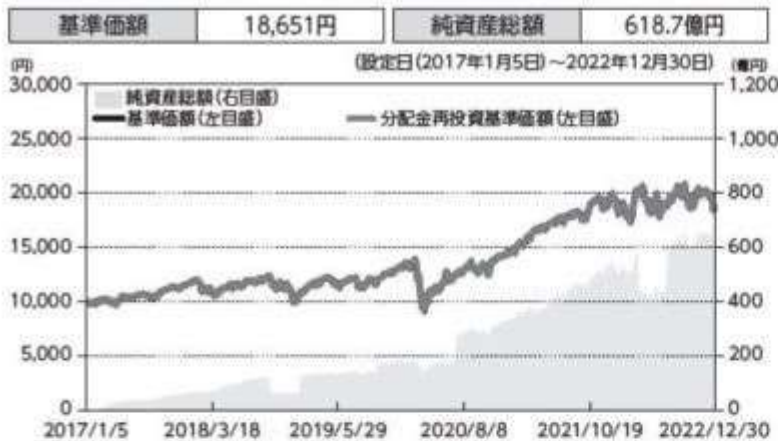
※運用実績は過去のものであり、将来の運用成果を約束するものではありません。

※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。

FWりそな先進国株式インデックスファンド

2022年12月30日現在

基準価額・純資産の推移



※基準価額は1万口当たり、運用管理費用(信託報酬)控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

2018年12月10日	0円
2019年12月10日	0円
2020年12月10日	0円
2021年12月10日	0円
2022年12月12日	0円
設定来累計	0円

主要な資産の状況

■ポートフォリオの状況

資産	組入比率
株式	90.7%
先物	9.4%
現金等	-0.1%
合計	100.0%

■国・地域別配分

国・地域	組入比率
アメリカ	65.1%
イギリス	4.1%
カナダ	3.4%
フランス	3.2%
スイス	3.1%
その他	21.2%
合計	100.0%

■組入上位銘柄

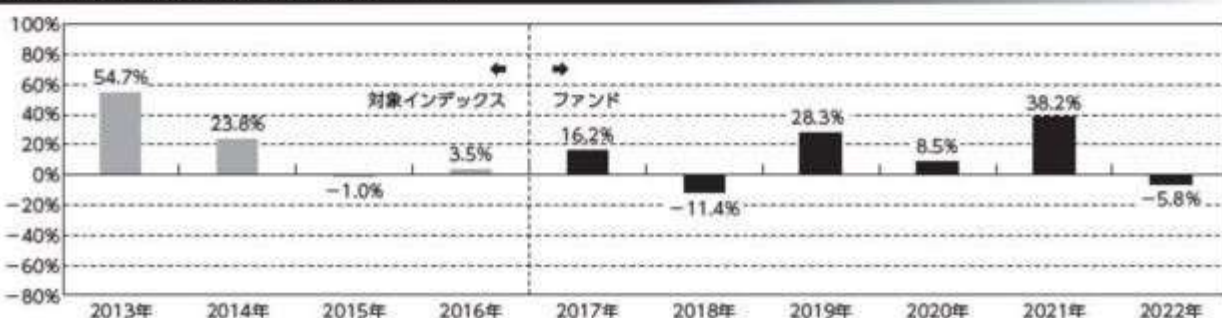
	銘柄名	国・地域	業種	組入比率
1	APPLE INC	アメリカ	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.0%
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	ソフトウェア・サービス	3.3%
3	AMAZON.COM INC	アメリカ	小売	1.5%
4	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	メディア・娯楽	1.0%
5	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	ヘルスケア機器・サービス	1.0%
6	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	メディア・娯楽	1.0%
7	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	製薬/化粧品/ヘルスケア	0.9%
8	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	エネルギー	0.9%
9	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	各種金融	0.8%
10	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	銀行	0.8%

※組入比率は、マザーファンドの純資産総額に対する比率であり、四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。

※国・地域は発行国もしくは投資国を表示しています。

※業種は世界産業分類基準(GICS)の分類を基準としています。

年間収益率の推移(暦年ベース)



・2013年から2016年までは、対象インデックス(MSCI-KOKUSAI指数(配当込み、円換算ベース))の年間騰落率です。

・対象インデックスはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

・2017年は1月5日から12月までの騰落率です。

・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。

FWりそな新興国株式インデックスファンド

2022年12月30日現在

基準価額・純資産の推移



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

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

2018年12月10日	0円
2019年12月10日	0円
2020年12月10日	0円
2021年12月10日	0円
2022年12月12日	0円
設定来累計	0円

主要な資産の状況

■ポートフォリオの状況

資産	組入比率
株式	92.6%
先物	7.4%
現金等	0.0%
合計	100.0%

■国・地域別配分

国・地域	組入比率
中国	29.1%
インド	13.5%
台湾	12.7%
韓国	10.5%
ブラジル	4.9%
その他	29.4%
合計	100.0%

■組入上位銘柄

	銘柄名	国・地域	業種	組入比率
1	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	半導体・半導体製造装置	5.2%
2	TENCENT HOLDINGS LTD	中国	メディア・娯楽	3.9%
3	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国	テクノロジー・ハードウェア及び機器	3.1%
4	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	中国	小売	2.4%
5	MEITUAN	中国	小売	1.5%
6	RELIANCE INDUSTRIES LTD	インド	エネルギー	1.4%
7	VALE SA	ブラジル	素材	0.9%
8	INFOSYS LTD	インド	ソフトウェア・サービス	0.9%
9	JD.COM INC - CL A	中国	小売	0.9%
10	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	中国	銀行	0.9%

※組入比率は、マザーファンドの純資産総額に対する比率であり、四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。

※国・地域は発行国もしくは投資国を表示しています。

※業種は世界産業分類基準(GICS)の分類を基準としています。

年間収益率の推移(暦年ベース)



・2013年から2016年までは、対象インデックス(MSCIエマージング・マーケット指数(配当込み、円換算ベース))の年間騰落率です。
・対象インデックスはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。
・2017年は1月5日から12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。

FWりそな国内リートインデックスファンド

2022年12月30日現在

基準価額・純資産の推移



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

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

2018年12月10日	0円
2019年12月10日	0円
2020年12月10日	0円
2021年12月10日	0円
2022年12月12日	0円
設定来累計	0円

主要な資産の状況

■ポートフォリオの状況

資産	組入比率
不動産投資信託証券	98.7%
先物	1.1%
現金等	0.2%
合計	100.0%

■組入上位銘柄

	銘柄名	組入比率
1	日本ビルファンド投資法人	6.4%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	5.4%
3	日本都市ファンド投資法人	4.9%
4	野村不動産マスターファンド投資法人	4.9%
5	日本プロロジスリート投資法人	4.8%
6	GLP投資法人	4.5%
7	大和ハウスリート投資法人	4.1%
8	オリックス不動産投資法人	3.5%
9	アドバンス・レジデンス投資法人	3.2%
10	ユナイテッド・アーバン投資法人	3.1%

※組入比率は、マザーファンドの純資産総額に対する比率であり、四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。

年間収益率の推移(暦年ベース)



・2013年から2016年までは、対象インデックス(東証REIT指数(配当込み))の年間騰落率です。
 ・対象インデックスはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。
 ・2017年は1月5日から12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。

FWりそな先進国リートインデックスファンド

2022年12月30日現在

基準価額・純資産の推移



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

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

2018年12月10日	0円
2019年12月10日	0円
2020年12月10日	0円
2021年12月10日	0円
2022年12月12日	0円
設定来累計	0円

主要な資産の状況

■ポートフォリオの状況

資産	組入比率
不動産投資信託証券	99.3%
先物	0.0%
現金等	0.7%
合計	100.0%

■国・地域別配分

国・地域	組入比率
アメリカ	76.5%
オーストラリア	6.6%
イギリス	4.7%
シンガポール	3.6%
カナダ	1.8%
その他	6.8%
合計	100.0%

■組入上位銘柄

	銘柄名	国・地域	組入比率
1	PROLOGIS INC	アメリカ	8.3%
2	EQUINIX INC	アメリカ	4.9%
3	PUBLIC STORAGE	アメリカ	3.5%
4	REALTY INCOME CORP	アメリカ	3.2%
5	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	3.0%
6	VICI PROPERTIES INC	アメリカ	2.5%
7	WELLTOWER INC	アメリカ	2.5%
8	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	2.3%
9	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	1.8%
10	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	アメリカ	1.7%

※組入比率は、マザーファンドの純資産総額に対する比率であり、四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。
※国・地域は発行国もしくは投資国を表示しています。

年間収益率の推移(暦年ベース)



・2013年から2016年までは、対象インデックス(S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース))の年間騰落率です。
・対象インデックスはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。
・2017年は1月5日から12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。

＜F W I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)＞

＜F W I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)＞

＜F W Iりそな新興国債券インデックスファンド＞

＜F W Iりそな先進国株式インデックスファンド＞

・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

＜F W Iりそな新興国株式インデックスファンド＞

・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

・香港の銀行の休業日

・香港証券取引所の休業日

＜F W Iりそな先進国リートインデックスファンド＞

・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

・シドニーの銀行の休業日

・オーストラリア証券取引所の休業日

(6) 申込金額

F W Iりそな国内債券インデックスファンド：取得申込受付日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額です。

F W Iりそな国内株式インデックスファンド：取得申込受付日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額です。

F W I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)：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です。

F W I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)：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です。

F W Iりそな新興国債券インデックスファンド：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です。

F W Iりそな先進国株式インデックスファンド：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です。

F W Iりそな新興国株式インデックスファンド：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です。

F W Iりそな国内リートインデックスファンド：取得申込受付日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た

額です。

F Wりそな先進国リートインデックスファンド：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(「国内債券インデックス」、「国内株インデックス」および「国内リートインデックス」を除きます。)、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。

< F W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) >

< F W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) >

< F Wりそな新興国債券インデックスファンド >

< F Wりそな先進国株式インデックスファンド >

・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

< F Wりそな新興国株式インデックスファンド >

・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

・香港の銀行の休業日

・香港証券取引所の休業日

< F Wりそな先進国リートインデックスファンド >

・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

・シドニーの銀行の休業日

・オーストラリア証券取引所の休業日

(4) 解約制限

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

（５）解約価額

F Wりそな国内債券インデックスファンド：解約請求受付日の基準価額とします。

F Wりそな国内株式インデックスファンド：解約請求受付日の基準価額とします。

F W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）：解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

F W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）：解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

F Wりそな新興国債券インデックスファンド：解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

F Wりそな先進国株式インデックスファンド：解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

F Wりそな新興国株式インデックスファンド：解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

F Wりそな国内リートインデックスファンド：解約請求受付日の基準価額とします。

F Wりそな先進国リートインデックスファンド：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

F Wりそな国内債券インデックスファンド：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。

F Wりそな国内株式インデックスファンド：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。

F W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）：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。

F W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）：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。

F Wりそな新興国債券インデックスファンド：原則として、解約請求受付日から起算して6営業日目からお支払いします。

F Wりそな先進国株式インデックスファンド：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。

F Wりそな新興国株式インデックスファンド：原則として、解約請求受付日から起算して6営業日目からお支払いします。

F Wりそな国内リートインデックスファンド：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。

F Wりそな先進国リートインデックスファンド：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（「国内債券インデックス」、「国内株インデックス」および「国内リートインデックス」を除きます。）、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。

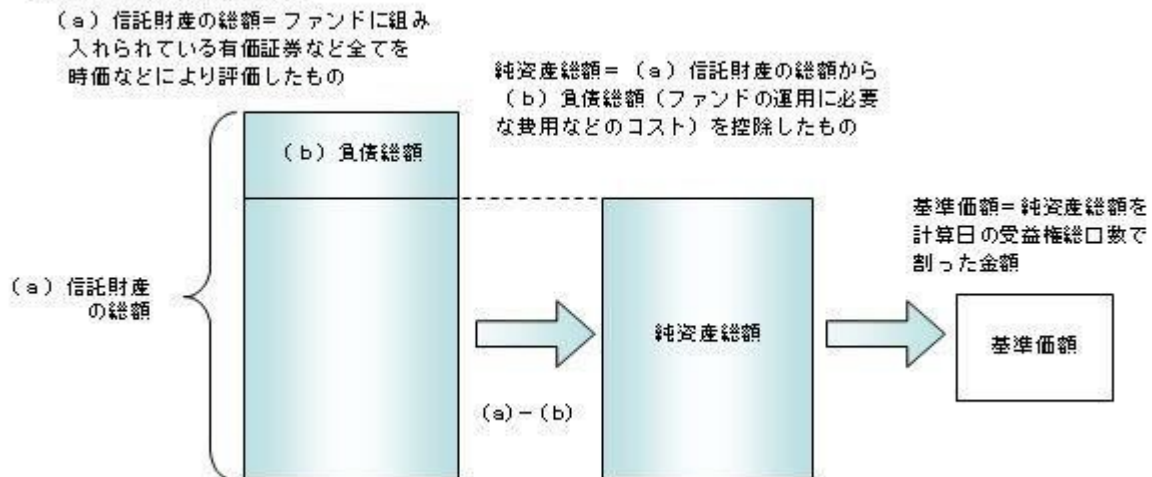
3【資産管理等の概要】

(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1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

<基準価額算出の流れ>



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】

無期限とします（2017年1月5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12月11日から翌年12月10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) 各ファンドの信託財産の純資産総額が20億円を下回ることとなったとき
 - ロ) 繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき
 - ハ) やむを得ない事情が発生したとき
- 2) この場合、委託会社は書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行ないます。（後述の「書面決議」をご覧ください。）
- 3) 委託会社は、次のいずれかの場合には、後述の「書面決議」の規定は適用せず、信託契約を解約し繰上償還させます。
 - イ) 信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合で、書面決議が困難な場合
 - ロ) 監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき
 - ハ) 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したとき（監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引き継ぐことを命じたときは、書面決議で可決された場合、存続します。）
 - 二) 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

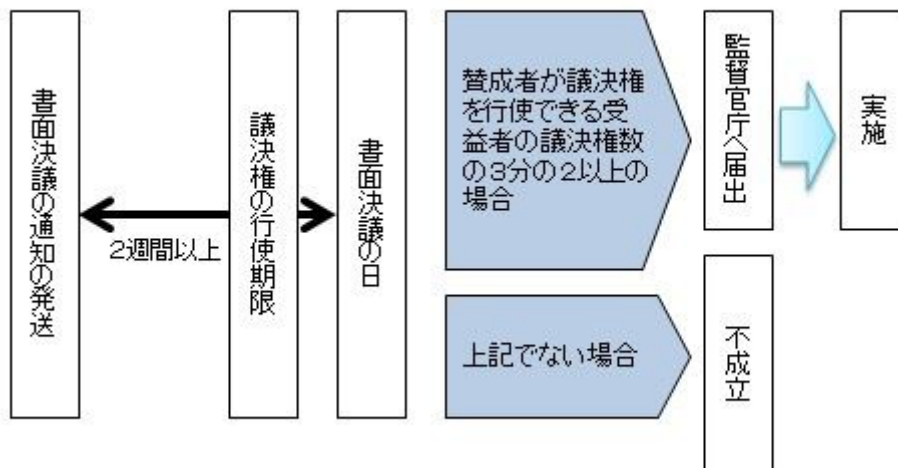
除きます。)については、書面決議を行ないます。(後述の「書面決議」をご覧ください。)

- 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週間前までに知れている受益者に対し書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。
- 2) 受益者は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行行使しないときは、書面決議について賛成するものとみなします。
- 3) 書面決議は、議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
- 4) 繰上償還、信託約款の重大な変更または併合に関する委託会社の提案に対して、すべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときは、書面決議を行ないません。
- 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】

FWりそな国内債券インデックスファンド
FWりそな国内株式インデックスファンド
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）
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）
FWりそな新興国債券インデックスファンド
FWりそな先進国株式インデックスファンド
FWりそな新興国株式インデックスファンド
FWりそな国内リートインデックスファンド
FWりそな先進国リートインデックスファンド

- (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6期計算期間(2021年12月11日から2022年12月12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】

【F Wりそな国内債券インデックスファンド】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第5期 2021年12月10日現在	第6期 2022年12月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	203,340,188	348,466,631
親投資信託受益証券	74,562,218,603	104,594,559,700
未収入金	-	2,000,000
流動資産合計	74,765,558,791	104,945,026,331
資産合計	74,765,558,791	104,945,026,331
負債の部		
流動負債		
未払解約金	59,391,577	68,442,531
未払受託者報酬	10,744,535	14,793,934
未払委託者報酬	78,793,205	108,488,792
未払利息	551	945
その他未払費用	2,793,482	3,846,339
流動負債合計	151,723,350	195,572,541
負債合計	151,723,350	195,572,541
純資産の部		
元本等		
元本	74,136,814,584	108,664,776,938
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()	477,020,857	3,915,323,148
(分配準備積立金)	719,782,179	903,666,866
元本等合計	74,613,835,441	104,749,453,790
純資産合計	74,613,835,441	104,749,453,790
負債純資産合計	74,765,558,791	104,945,026,331

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第5期		第6期	
	自	2020年12月11日	自	2021年12月11日
	至	2021年12月10日	至	2022年12月12日
営業収益				
有価証券売買等損益		2,058,855		3,195,258,903
営業収益合計		2,058,855		3,195,258,903
営業費用				
支払利息		146,129		221,794
受託者報酬		18,963,930		27,482,279
委託者報酬		139,068,697		201,536,600
その他費用		4,931,143		7,156,421
営業費用合計		163,109,899		236,397,094
営業利益又は営業損失（ ）		165,168,754		3,431,655,997
経常利益又は経常損失（ ）		165,168,754		3,431,655,997
当期純利益又は当期純損失（ ）		165,168,754		3,431,655,997
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（ ）		20,900,346		234,758,692
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		467,279,014		477,020,857
剰余金増加額又は欠損金減少額		218,552,641		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		218,552,641		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		64,542,390		1,195,446,700
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		64,542,390		36,191,680
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		1,159,255,020
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		477,020,857		3,915,323,148

(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12月11日から翌年12月10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12月11日から2022年12月12日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第5期 2021年12月10日現在		第6期 2022年12月12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	46,033,775,753円	期首元本額	74,136,814,584円
期中追加設定元本額	34,983,169,463円	期中追加設定元本額	46,496,974,384円
期中一部解約元本額	6,880,130,632円	期中一部解約元本額	11,969,012,030円
2. 計算期間の末日における受益権の総数	74,136,814,584口	2. 計算期間の末日における受益権の総数	108,664,776,938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	3,915,323,148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	1.0064円	4. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	0.9640円
1口当たり純資産額		1口当たり純資産額	
(10,000口当たり純資産額)	(10,064円)	(10,000口当たり純資産額)	(9,640円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10日		第6期 自 2021年12月11日 至 2022年12月12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	229,015,411円	A 費用控除後の配当等収益額	281,104,195円
B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	0円	B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	0円
C 収益調整金額	1,244,618,163円	C 収益調整金額	2,276,165,945円
D 分配準備積立金額	490,766,768円	D 分配準備積立金額	622,562,671円
E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D)	1,964,400,342円	E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D)	3,179,832,811円
F 当ファンドの期末残存口数	74,136,814,584口	F 当ファンドの期末残存口数	108,664,776,938口
G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000)	264円	G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000)	292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5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10日	第6期 自 2021年12月11日 至 2022年12月12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、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。</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5期 2021年12月10日現在	第6期 2022年12月12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</p> <p>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5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10日	第6期 自 2021年12月11日 至 2022年12月12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5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10日	第6期 自 2021年12月11日 至 2022年12月12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	14,121,340	2,997,993,363
合計	14,121,340	2,997,993,363

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	103,384,955,719	104,594,559,700	
合計		103,384,955,719	104,594,559,700	

(注)券面総額欄の数値は口数を表しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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」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。同親投資信託受益証券の状況は、後述の「F Wりそな先進国リートインデックスファンド」の参考に記載しております。

【F Wりそな国内株式インデックスファンド】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第5期 2021年12月10日現在	第6期 2022年12月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	92,341,257	99,134,209
親投資信託受益証券	31,627,850,409	25,020,058,497
流動資産合計	31,720,191,666	25,119,192,706
資産合計	31,720,191,666	25,119,192,706
負債の部		
流動負債		
未払解約金	25,367,539	17,881,738
未払受託者報酬	5,003,518	4,319,364
未払委託者報酬	45,031,544	38,874,151
未払利息	250	268
その他未払費用	1,300,813	1,122,932
流動負債合計	76,703,664	62,198,453
負債合計	76,703,664	62,198,453
純資産の部		
元本等		
元本	22,703,426,576	17,732,964,515
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()	8,940,061,426	7,324,029,738
(分配準備積立金)	4,028,818,882	2,748,099,472
元本等合計	31,643,488,002	25,056,994,253
純資産合計	31,643,488,002	25,056,994,253
負債純資産合計	31,720,191,666	25,119,192,706

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第5期		第6期	
	自	2020年12月11日 至 2021年12月10日	自	2021年12月11日 至 2022年12月12日
営業収益				
有価証券売買等損益		3,187,877,514		250,891,912
営業収益合計		3,187,877,514		250,891,912
営業費用				
支払利息		72,447		82,439
受託者報酬		8,968,031		10,075,458
委託者報酬		80,712,079		90,678,917
その他費用		2,331,813		2,624,132
営業費用合計		92,084,370		103,460,946
営業利益又は営業損失()		3,095,793,144		354,352,858
経常利益又は経常損失()		3,095,793,144		354,352,858
当期純利益又は当期純損失()		3,095,793,144		354,352,858
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()		755,728,428		765,464,193
期首剰余金又は期首欠損金()		4,047,257,818		8,940,061,426
剰余金増加額又は欠損金減少額		4,298,083,919		3,205,179,614
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		4,298,083,919		3,205,179,614
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,745,345,027		5,232,322,637
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,745,345,027		5,232,322,637
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金()		8,940,061,426		7,324,029,738

(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12月11日から翌年12月10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12月11日から2022年12月12日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第5期 2021年12月10日現在		第6期 2022年12月12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	17,495,078,572円	期首元本額	22,703,426,576円
期中追加設定元本額	11,958,495,826円	期中追加設定元本額	8,398,419,679円
期中一部解約元本額	6,750,147,822円	期中一部解約元本額	13,368,881,740円
2. 計算期間の末日における受益権の総数	22,703,426,576口	2. 計算期間の末日における受益権の総数	17,732,964,515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	1.3938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	1.4130円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額)	(13,938円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額)	(14,130円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10日		第6期 自 2021年12月11日 至 2022年12月12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	569,842,144円	A 費用控除後の配当等収益額	550,298,074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	1,770,222,572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	5,231,283,738円	C 収益調整金額	5,042,036,850円
D 分配準備積立金額	1,688,754,166円	D 分配準備積立金額	2,197,801,398円
E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D)	9,260,102,620円	E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D)	7,790,136,322円
F 当ファンドの期末残存口数	22,703,426,576口	F 当ファンドの期末残存口数	17,732,964,515口
G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000)	4,078円	G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000)	4,393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

<p style="text-align: center;">第5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10日</p>	<p style="text-align: center;">第6期 自 2021年12月11日 至 2022年12月12日</p>
<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

<p style="text-align: center;">第5期 2021年12月10日現在</p>	<p style="text-align: center;">第6期 2022年12月12日現在</p>
<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</p> <p>（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</p> <p>これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> <p>3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>親投資信託受益証券</p> <p>同左</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>同左</p> <p>3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>同左</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

第5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10日	第6期 自 2021年12月11日 至 2022年12月12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5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10日	第6期 自 2021年12月11日 至 2022年12月12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	2,638,070,047	463,304,596
合計	2,638,070,047	463,304,596

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

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	R M国内株式マザーファンド	17,038,993,801	25,020,058,497	
合計		17,038,993,801	25,020,058,497	

(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国内株式マザーファンド」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。同親投資信託受益証券の状況は、後述の「F Wりそな先進国リートインデックスファンド」の参考に記載しております。

【 F W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）】

（ 1 ）【貸借対照表】

（単位：円）

	第5期 2021年12月10日現在	第6期 2022年12月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	106,049,350	140,343,344
親投資信託受益証券	33,332,314,352	34,775,129,724
未収入金	-	5,300,000
流動資産合計	33,438,363,702	34,920,773,068
資産合計	33,438,363,702	34,920,773,068
負債の部		
流動負債		
未払解約金	23,504,965	23,349,623
未払受託者報酬	5,158,876	5,978,891
未払委託者報酬	55,027,970	63,774,820
未払利息	287	380
その他未払費用	1,341,210	1,554,413
流動負債合計	85,033,308	94,658,127
負債合計	85,033,308	94,658,127
純資産の部		
元本等		
元本	29,364,563,246	30,538,787,999
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,988,767,148	4,287,326,942
（分配準備積立金）	1,664,620,859	1,789,417,321
元本等合計	33,353,330,394	34,826,114,941
純資産合計	33,353,330,394	34,826,114,941
負債純資産合計	33,438,363,702	34,920,773,068

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第5期		第6期	
	自	2020年12月11日	自	2021年12月11日
	至	2021年12月10日	至	2022年12月12日
営業収益				
有価証券売買等損益		868,289,962		349,915,372
営業収益合計		868,289,962		349,915,372
営業費用				
支払利息		65,650		95,078
受託者報酬		9,050,083		11,904,186
委託者報酬		96,534,138		126,977,971
その他費用		2,353,188		3,100,008
営業費用合計		108,003,059		142,077,243
営業利益又は営業損失（ ）		760,286,903		207,838,129
経常利益又は経常損失（ ）		760,286,903		207,838,129
当期純利益又は当期純損失（ ）		760,286,903		207,838,129
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（ ）		60,970,638		78,220,928
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,865,964,603		3,988,767,148
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,918,120,797		1,205,650,781
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,918,120,797		1,205,650,781
剰余金減少額又は欠損金増加額		494,634,517		1,036,708,188
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		494,634,517		1,036,708,188
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		3,988,767,148		4,287,326,942

(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12月11日から翌年12月10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12月11日から2022年12月12日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第5期 2021年12月10日現在		第6期 2022年12月12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	18,143,222,685円	期首元本額	29,364,563,246円
期中追加設定元本額	15,847,941,724円	期中追加設定元本額	8,841,510,500円
期中一部解約元本額	4,626,601,163円	期中一部解約元本額	7,667,285,747円
2. 計算期間の末日における受益権の総数	29,364,563,246口	2. 計算期間の末日における受益権の総数	30,538,787,999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	1.1358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	1.1404円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額)	(11,358円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額)	(11,404円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10日		第6期 自 2021年12月11日 至 2022年12月12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	390,465,749円	A 費用控除後の配当等収益額	482,581,351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	308,850,516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	2,719,559,922円	C 収益調整金額	3,262,290,840円
D 分配準備積立金額	965,304,594円	D 分配準備積立金額	1,306,835,970円
E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D)	4,384,180,781円	E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D)	5,051,708,161円
F 当ファンドの期末残存口数	29,364,563,246口	F 当ファンドの期末残存口数	30,538,787,999口
G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000)	1,492円	G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000)	1,654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

<p style="text-align: center;">第5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10日</p>	<p style="text-align: center;">第6期 自 2021年12月11日 至 2022年12月12日</p>
<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、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。</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

<p style="text-align: center;">第5期 2021年12月10日現在</p>	<p style="text-align: center;">第6期 2022年12月12日現在</p>
<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</p> <p>(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</p> <p>これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> <p>3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>親投資信託受益証券</p> <p>同左</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>同左</p> <p>3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>同左</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

第5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10日	第6期 自 2021年12月11日 至 2022年12月12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5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10日	第6期 自 2021年12月11日 至 2022年12月12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	846,535,515	291,306,706
合計	846,535,515	291,306,706

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先進国債券マザーファンド	31,323,301,860	34,775,129,724	
合計		31,323,301,860	34,775,129,724	

(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先進国債券マザーファンド」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。同親投資信託受益証券の状況は、後述の「FWりそな先進国リートインデックスファンド」の参考に記載しております。

【F W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)】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第5期 2021年12月10日現在	第6期 2022年12月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	519,648,864	664,177,876
親投資信託受益証券	174,704,236,555	159,796,204,583
未収入金	-	6,100,000
流動資産合計	175,223,885,419	160,466,482,459
資産合計	175,223,885,419	160,466,482,459
負債の部		
流動負債		
未払解約金	109,625,381	86,532,522
未払受託者報酬	25,105,122	29,245,901
未払委託者報酬	267,787,887	311,956,195
未払利息	1,409	1,801
その他未払費用	6,527,244	7,603,826
流動負債合計	409,047,043	435,340,245
負債合計	409,047,043	435,340,245
純資産の部		
元本等		
元本	164,334,865,102	177,491,751,408
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	10,479,973,274	17,460,609,194
(分配準備積立金)	5,500,692,160	6,807,448,077
元本等合計	174,814,838,376	160,031,142,214
純資産合計	174,814,838,376	160,031,142,214
負債純資産合計	175,223,885,419	160,466,482,459

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第5期		第6期	
	自	2020年12月11日	自	2021年12月11日
	至	2021年12月10日	至	2022年12月12日
営業収益				
有価証券売買等損益		2,168,358,343		28,894,631,972
営業収益合計		2,168,358,343		28,894,631,972
営業費用				
支払利息		314,326		457,410
受託者報酬		44,068,920		58,209,295
委託者報酬		470,068,325		620,898,984
その他費用		11,459,381		15,158,432
営業費用合計		525,910,952		694,724,121
営業利益又は営業損失()		2,694,269,295		29,589,356,093
経常利益又は経常損失()		2,694,269,295		29,589,356,093
当期純利益又は当期純損失()		2,694,269,295		29,589,356,093
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()		255,827,724		5,402,219,138
期首剰余金又は期首欠損金()		9,167,230,260		10,479,973,274
剰余金増加額又は欠損金減少額		5,026,115,739		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		5,026,115,739		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,274,931,154		3,753,445,513
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,274,931,154		2,141,735,340
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		1,611,710,173
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金()		10,479,973,274		17,460,609,194

(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12月11日から翌年12月10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12月11日から2022年12月12日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第5期 2021年12月10日現在	第6期 2022年12月12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 98,661,659,291円	期首元本額 164,334,865,102円
期中追加設定元本額 80,271,983,006円	期中追加設定元本額 59,407,448,646円
期中一部解約元本額 14,598,777,195円	期中一部解約元本額 46,250,562,340円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 164,334,865,102口	2. 計算期間の末日における受益権の総数 177,491,751,408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 17,460,609,194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 1.0638円 1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,638円)	4. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 0.9016円 1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (9,016円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10日	第6期 自 2021年12月11日 至 2022年12月12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 1,670,242,208円	A 費用控除後の配当等収益額 2,523,912,802円
B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 0円	B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 0円
C 収益調整金額 9,399,695,810円	C 収益調整金額 11,857,186,145円
D 分配準備積立金額 3,830,449,952円	D 分配準備積立金額 4,283,535,275円
E 当ファンドの分配対象収益額 14,900,387,970円 (E=A+B+C+D)	E 当ファンドの分配対象収益額 18,664,634,222円 (E=A+B+C+D)
F 当ファンドの期末残存口数 164,334,865,102口	F 当ファンドの期末残存口数 177,491,751,408口
G 10,000口当たり収益分配対象額 906円 (G=E/F × 10,000)	G 10,000口当たり収益分配対象額 1,051円 (G=E/F × 10,000)

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5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10日	第6期 自 2021年12月11日 至 2022年12月12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、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。</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5期 2021年12月10日現在	第6期 2022年12月12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</p> <p>(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</p> <p>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</p> <p>同左</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>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5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10日	第6期 自 2021年12月11日 至 2022年12月12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5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10日	第6期 自 2021年12月11日 至 2022年12月12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	2,150,400,705	24,681,926,385
合計	2,150,400,705	24,681,926,385

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先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	179,244,200,318	159,796,204,583	
合計		179,244,200,318	159,796,204,583	

(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先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）」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。同親投資信託受益証券の状況は、後述の「FWりそな先進国リートインデックスファンド」の参考に記載しております。

【F Wりそな新興国債券インデックスファンド】

(1) 【貸借対照表】

(単位 : 円)

	第5期 2021年12月10日現在	第6期 2022年12月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	5,642,062	20,275,354
親投資信託受益証券	1,425,857,761	4,123,751,502
未収入金	-	70,000
流動資産合計	1,431,499,823	4,144,096,856
資産合計	1,431,499,823	4,144,096,856
負債の部		
流動負債		
未払解約金	645,796	2,482,466
未払受託者報酬	217,851	643,423
未払委託者報酬	3,775,996	11,152,613
未払利息	15	54
その他未払費用	56,546	167,200
流動負債合計	4,696,204	14,445,756
負債合計	4,696,204	14,445,756
純資産の部		
元本等		
元本	1,468,871,244	4,002,322,815
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()	42,067,625	127,328,285
(分配準備積立金)	111,244,024	221,514,981
元本等合計	1,426,803,619	4,129,651,100
純資産合計	1,426,803,619	4,129,651,100
負債純資産合計	1,431,499,823	4,144,096,856

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第5期		第6期	
	自	2020年12月11日 至 2021年12月10日	自	2021年12月11日 至 2022年12月12日
営業収益				
有価証券売買等損益		27,557,926		176,693,741
営業収益合計		27,557,926		176,693,741
営業費用				
支払利息		3,829		9,715
受託者報酬		392,907		1,002,417
委託者報酬		6,810,190		17,375,053
その他費用		101,992		260,862
営業費用合計		7,308,918		18,648,047
営業利益又は営業損失()		34,866,844		158,045,694
経常利益又は経常損失()		34,866,844		158,045,694
当期純利益又は当期純損失()		34,866,844		158,045,694
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()		2,225,338		7,020,077
期首剰余金又は期首欠損金()		7,601,919		42,067,625
剰余金増加額又は欠損金減少額		2,626,476		18,370,293
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,224,117		4,748,605
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,402,359		13,621,688
剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金()		42,067,625		127,328,285

(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12月11日から翌年12月10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12月11日から2022年12月12日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第5期 2021年12月10日現在	第6期 2022年12月12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 1,032,035,590円	期首元本額 1,468,871,244円
期中追加設定元本額 651,451,475円	期中追加設定元本額 2,938,967,339円
期中一部解約元本額 214,615,821円	期中一部解約元本額 405,515,768円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 1,468,871,244口	2. 計算期間の末日における受益権の総数 4,002,322,815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 42,067,625円	
4. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 0.9714円 1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (9,714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 1.0318円 1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,318円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10日	第6期 自 2021年12月11日 至 2022年12月12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 42,002,617円	A 費用控除後の配当等収益額 123,302,309円
B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 0円	B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 0円
C 収益調整金額 161,891,401円	C 収益調整金額 651,256,739円
D 分配準備積立金額 69,241,407円	D 分配準備積立金額 98,212,672円
E 当ファンドの分配対象収益額 273,135,425円 (E=A+B+C+D)	E 当ファンドの分配対象収益額 872,771,720円 (E=A+B+C+D)
F 当ファンドの期末残存口数 1,468,871,244口	F 当ファンドの期末残存口数 4,002,322,815口
G 10,000口当たり収益分配対象額 1,859円 (G=E/F × 10,000)	G 10,000口当たり収益分配対象額 2,180円 (G=E/F × 10,000)

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5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10日	第6期 自 2021年12月11日 至 2022年12月12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、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5期 2021年12月10日現在	第6期 2022年12月12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</p> <p>(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</p> <p>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</p> <p>同左</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>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5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10日	第6期 自 2021年12月11日 至 2022年12月12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5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10日	第6期 自 2021年12月11日 至 2022年12月12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	28,462,734	176,126,199
合計	28,462,734	176,126,199

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新興国債券マザーファンド	3,618,595,562	4,123,751,502	
合計		3,618,595,562	4,123,751,502	

(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新興国債券マザーファンド」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。同親投資信託受益証券の状況は、後述の「FWりそな先進国リートインデックスファンド」の参考に記載しております。

【F Wりそな先進国株式インデックスファンド】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第5期 2021年12月10日現在	第6期 2022年12月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	153,124,019	252,229,206
親投資信託受益証券	51,624,677,107	63,606,301,321
流動資産合計	51,777,801,126	63,858,530,527
資産合計	51,777,801,126	63,858,530,527
負債の部		
流動負債		
未払解約金	26,553,703	25,826,274
未払受託者報酬	7,546,701	9,877,071
未払委託者報酬	93,075,988	121,817,155
未払利息	415	684
その他未払費用	1,962,056	2,567,937
流動負債合計	129,138,863	160,089,121
負債合計	129,138,863	160,089,121
純資産の部		
元本等		
元本	27,092,392,723	32,534,932,340
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	24,556,269,540	31,163,509,066
（分配準備積立金）	13,111,484,009	10,176,823,434
元本等合計	51,648,662,263	63,698,441,406
純資産合計	51,648,662,263	63,698,441,406
負債純資産合計	51,777,801,126	63,858,530,527

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第5期		第6期	
	自	2020年12月11日	自	2021年12月11日
	至	2021年12月10日	至	2022年12月12日
営業収益				
有価証券売買等損益		11,766,653,699		2,667,524,214
営業収益合計		11,766,653,699		2,667,524,214
営業費用				
支払利息		102,525		144,014
受託者報酬		13,402,665		17,951,149
委託者報酬		165,299,409		221,397,453
その他費用		3,485,005		4,674,184
営業費用合計		182,289,604		244,166,800
営業利益又は営業損失（ ）		11,584,364,095		2,423,357,414
経常利益又は経常損失（ ）		11,584,364,095		2,423,357,414
当期純利益又は当期純損失（ ）		11,584,364,095		2,423,357,414
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（ ）		2,007,017,979		824,079,290
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		9,338,428,628		24,556,269,540
剰余金増加額又は欠損金減少額		10,046,689,463		15,002,197,646
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		10,046,689,463		15,002,197,646
剰余金減少額又は欠損金増加額		4,406,194,667		9,994,236,244
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		4,406,194,667		9,994,236,244
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		24,556,269,540		31,163,509,066

(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12月11日から翌年12月10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12月11日から2022年12月12日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第5期 2021年12月10日現在		第6期 2022年12月12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	22,483,796,307円	期首元本額	27,092,392,723円
期中追加設定元本額	14,296,687,169円	期中追加設定元本額	16,484,521,354円
期中一部解約元本額	9,688,090,753円	期中一部解約元本額	11,041,981,737円
2. 計算期間の末日における受益権の総数	27,092,392,723口	2. 計算期間の末日における受益権の総数	32,534,932,340口
3. 計算期間の末日における1単位の純資産の額	1.9064円	3. 計算期間の末日における1単位の純資産の額	1.9578円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額)	(19,064円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額)	(19,578円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10日		第6期 自 2021年12月11日 至 2022年12月12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	552,767,445円	A 費用控除後の配当等収益額	813,080,784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	9,024,578,671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	786,197,340円
C 収益調整金額	11,444,785,531円	C 収益調整金額	20,986,685,632円
D 分配準備積立金額	3,534,137,893円	D 分配準備積立金額	8,577,545,310円
E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D)	24,556,269,540円	E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D)	31,163,509,066円
F 当ファンドの期末残存口数	27,092,392,723口	F 当ファンドの期末残存口数	32,534,932,340口
G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000)	9,063円	G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000)	9,578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5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10日	第6期 自 2021年12月11日 至 2022年12月12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、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>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5期 2021年12月10日現在	第6期 2022年12月12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</p> <p>これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> <p>3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>親投資信託受益証券</p> <p>同左</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>同左</p> <p>3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>同左</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

第5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10日	第6期 自 2021年12月11日 至 2022年12月12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5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10日	第6期 自 2021年12月11日 至 2022年12月12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	10,334,489,862	1,892,840,962
合計	10,334,489,862	1,892,840,962

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先進国株式マザーファンド	30,185,222,723	63,606,301,321	
合計		30,185,222,723	63,606,301,321	

(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先進国株式マザーファンド」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。同親投資信託受益証券の状況は、後述の「F Wりそな先進国リートインデックスファンド」の参考に記載しております。

【F Wりそな新興国株式インデックスファンド】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第5期 2021年12月10日現在	第6期 2022年12月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	17,269,294	16,642,378
親投資信託受益証券	4,062,971,317	2,078,916,281
流動資産合計	4,080,240,611	2,095,558,659
資産合計	4,080,240,611	2,095,558,659
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,062,051	1,148,411
未払受託者報酬	658,913	621,152
未払委託者報酬	12,519,338	11,801,703
未払利息	46	45
その他未払費用	171,225	161,401
流動負債合計	15,411,573	13,732,712
負債合計	15,411,573	13,732,712
純資産の部		
元本等		
元本	2,809,747,403	1,497,745,030
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()	1,255,081,635	584,080,917
(分配準備積立金)	458,987,968	186,412,396
元本等合計	4,064,829,038	2,081,825,947
純資産合計	4,064,829,038	2,081,825,947
負債純資産合計	4,080,240,611	2,095,558,659

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第5期		第6期	
	自	2020年12月11日 至 2021年12月10日	自	2021年12月11日 至 2022年12月12日
営業収益				
有価証券売買等損益		301,976,246		308,555,036
営業収益合計		301,976,246		308,555,036
営業費用				
支払利息		12,872		14,390
受託者報酬		1,224,165		1,387,537
委託者報酬		23,259,049		26,362,902
その他費用		318,146		361,386
営業費用合計		24,814,232		28,126,215
営業利益又は営業損失()		277,162,014		336,681,251
経常利益又は経常損失()		277,162,014		336,681,251
当期純利益又は当期純損失()		277,162,014		336,681,251
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()		111,641,585		259,912,689
期首剰余金又は期首欠損金()		748,535,218		1,255,081,635
剰余金増加額又は欠損金減少額		703,311,217		588,734,451
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		703,311,217		588,734,451
剰余金減少額又は欠損金増加額		362,285,229		1,182,966,607
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		362,285,229		1,182,966,607
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金()		1,255,081,635		584,080,917

(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12月11日から翌年12月10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12月11日から2022年12月12日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第5期 2021年12月10日現在		第6期 2022年12月12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	2,319,474,416円	期首元本額	2,809,747,403円
期中追加設定元本額	1,505,271,269円	期中追加設定元本額	1,342,540,996円
期中一部解約元本額	1,014,998,282円	期中一部解約元本額	2,654,543,369円
2. 計算期間の末日における受益権の総数	2,809,747,403口	2. 計算期間の末日における受益権の総数	1,497,745,030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	1.4467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	1.3900円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額)	(14,467円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額)	(13,900円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10日		第6期 自 2021年12月11日 至 2022年12月12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	58,986,591円	A 費用控除後の配当等収益額	27,660,383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	106,533,838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	796,093,667円	C 収益調整金額	401,055,603円
D 分配準備積立金額	293,467,539円	D 分配準備積立金額	158,752,013円
E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D)	1,255,081,635円	E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D)	587,467,999円
F 当ファンドの期末残存口数	2,809,747,403口	F 当ファンドの期末残存口数	1,497,745,030口
G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000)	4,466円	G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000)	3,922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5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10日	第6期 自 2021年12月11日 至 2022年12月12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、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>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5期 2021年12月10日現在	第6期 2022年12月12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</p> <p>（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</p> <p>これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> <p>3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>親投資信託受益証券</p> <p>同左</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>同左</p> <p>3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>同左</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

第5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10日	第6期 自 2021年12月11日 至 2022年12月12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5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10日	第6期 自 2021年12月11日 至 2022年12月12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	218,270,518	68,681,213
合計	218,270,518	68,681,213

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新興国株式マザーファンド	1,302,660,744	2,078,916,281	
合計		1,302,660,744	2,078,916,281	

(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新興国株式マザーファンド」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。同親投資信託受益証券の状況は、後述の「FWりそな先進国リートインデックスファンド」の参考に記載しております。

【F Wりそな国内リートインデックスファンド】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第5期 2021年12月10日現在	第6期 2022年12月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	14,437,015	23,738,291
親投資信託受益証券	5,008,427,947	6,808,882,991
流動資産合計	5,022,864,962	6,832,621,282
資産合計	5,022,864,962	6,832,621,282
負債の部		
流動負債		
未払解約金	3,333,639	2,354,574
未払受託者報酬	839,333	1,106,320
未払委託者報酬	7,553,948	9,956,853
未払利息	39	64
その他未払費用	218,142	287,556
流動負債合計	11,945,101	13,705,367
負債合計	11,945,101	13,705,367
純資産の部		
元本等		
元本	3,791,863,443	5,334,690,886
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()	1,219,056,418	1,484,225,029
(分配準備積立金)	554,144,995	667,781,191
元本等合計	5,010,919,861	6,818,915,915
純資産合計	5,010,919,861	6,818,915,915
負債純資産合計	5,022,864,962	6,832,621,282

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第5期		第6期	
	自	2020年12月11日	自	2021年12月11日
	至	2021年12月10日	至	2022年12月12日
営業収益				
有価証券売買等損益		881,275,805		140,444,956
営業収益合計		881,275,805		140,444,956
営業費用				
支払利息		11,664		16,829
受託者報酬		1,489,579		2,099,080
委託者報酬		13,406,177		18,891,658
その他費用		387,170		546,440
営業費用合計		15,294,590		21,554,007
営業利益又は営業損失()		865,981,215		161,998,963
経常利益又は経常損失()		865,981,215		161,998,963
当期純利益又は当期純損失()		865,981,215		161,998,963
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()		274,318,646		20,677,659
期首剰余金又は期首欠損金()		74,341,363		1,219,056,418
剰余金増加額又は欠損金減少額		760,553,574		703,746,748
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		760,553,574		703,746,748
剰余金減少額又は欠損金増加額		207,501,088		297,256,833
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		207,501,088		297,256,833
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金()		1,219,056,418		1,484,225,029

(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12月11日から翌年12月10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12月11日から2022年12月12日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第5期 2021年12月10日現在		第6期 2022年12月12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	1,600,744,853円	期首元本額	3,791,863,443円
期中追加設定元本額	3,961,300,689円	期中追加設定元本額	2,506,630,055円
期中一部解約元本額	1,770,182,099円	期中一部解約元本額	963,802,612円
2. 計算期間の末日における受益権の総数	3,791,863,443口	2. 計算期間の末日における受益権の総数	5,334,690,886口
3. 計算期間の末日における1単位の純資産の額	1.3215円	3. 計算期間の末日における1単位の純資産の額	1.2782円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額)	(13,215円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額)	(12,782円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10日		第6期 自 2021年12月11日 至 2022年12月12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	158,221,660円	A 費用控除後の配当等収益額	211,258,227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	232,276,323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	951,346,943円	C 収益調整金額	1,663,359,821円
D 分配準備積立金額	163,647,012円	D 分配準備積立金額	456,522,964円
E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D)	1,505,491,938円	E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D)	2,331,141,012円
F 当ファンドの期末残存口数	3,791,863,443口	F 当ファンドの期末残存口数	5,334,690,886口
G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000)	3,970円	G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000)	4,369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

<p style="text-align: center;">第5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10日</p>	<p style="text-align: center;">第6期 自 2021年12月11日 至 2022年12月12日</p>
<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、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。</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

<p style="text-align: center;">第5期 2021年12月10日現在</p>	<p style="text-align: center;">第6期 2022年12月12日現在</p>
<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</p> <p>これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> <p>3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>親投資信託受益証券</p> <p>同左</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>同左</p> <p>3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>同左</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

第5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10日	第6期 自 2021年12月11日 至 2022年12月12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5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10日	第6期 自 2021年12月11日 至 2022年12月12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	657,619,316	128,605,269
合計	657,619,316	128,605,269

2 デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	RM国内リートマザーファンド	4,664,257,427	6,808,882,991	
合計		4,664,257,427	6,808,882,991	

(注)券面総額欄の数値は口数を表しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは「RM国内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。同親投資信託受益証券の状況は、後述の「FWりそな先進国リートインデックスファンド」の参考に記載しております。

【F Wりそな先進国リートインデックスファンド】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第5期 2021年12月10日現在	第6期 2022年12月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	17,308,502	28,715,824
親投資信託受益証券	5,412,016,252	7,471,840,491
流動資産合計	5,429,324,754	7,500,556,315
資産合計	5,429,324,754	7,500,556,315
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,775,828	2,152,465
未払受託者報酬	881,178	1,160,561
未払委託者報酬	10,867,786	14,313,498
未払利息	46	77
その他未払費用	229,016	301,663
流動負債合計	14,753,854	17,928,264
負債合計	14,753,854	17,928,264
純資産の部		
元本等		
元本	3,952,338,316	5,624,584,486
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()	1,462,232,584	1,858,043,565
(分配準備積立金)	1,221,326,291	1,203,542,704
元本等合計	5,414,570,900	7,482,628,051
純資産合計	5,414,570,900	7,482,628,051
負債純資産合計	5,429,324,754	7,500,556,315

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第5期		第6期	
	自	2020年12月11日	自	2021年12月11日
	至	2021年12月10日	至	2022年12月12日
営業収益				
有価証券売買等損益		1,694,346,269		111,375,761
その他収益		-		272
営業収益合計		1,694,346,269		111,375,489
営業費用				
支払利息		12,294		17,184
受託者報酬		1,638,568		2,181,442
委託者報酬		20,208,872		26,904,307
その他費用		425,902		567,894
営業費用合計		22,285,636		29,670,827
営業利益又は営業損失()		1,672,060,633		141,046,316
経常利益又は経常損失()		1,672,060,633		141,046,316
当期純利益又は当期純損失()		1,672,060,633		141,046,316
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()		473,641,613		75,620,946
期首剰余金又は期首欠損金()		135,657,820		1,462,232,584
剰余金増加額又は欠損金減少額		406,595,178		942,438,350
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		406,595,178		942,438,350
剰余金減少額又は欠損金増加額		7,123,794		329,960,107
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		7,123,794		329,960,107
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金()		1,462,232,584		1,858,043,565

(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12月11日から翌年12月10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12月11日から2022年12月12日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第5期 2021年12月10日現在		第6期 2022年12月12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	4,211,588,450円	期首元本額	3,952,338,316円
期中追加設定元本額	2,372,238,888円	期中追加設定元本額	2,551,720,696円
期中一部解約元本額	2,631,489,022円	期中一部解約元本額	879,474,526円
2. 計算期間の末日における受益権の総数	3,952,338,316口	2. 計算期間の末日における受益権の総数	5,624,584,486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	1.3700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	1.3303円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額)	(13,700円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額)	(13,303円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10日		第6期 自 2021年12月11日 至 2022年12月12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	134,720,115円	A 費用控除後の配当等収益額	196,374,857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	918,919,784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	636,159,560円	C 収益調整金額	1,641,772,441円
D 分配準備積立金額	167,686,392円	D 分配準備積立金額	1,007,167,847円
E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D)	1,857,485,851円	E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D)	2,845,315,145円
F 当ファンドの期末残存口数	3,952,338,316口	F 当ファンドの期末残存口数	5,624,584,486口
G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000)	4,699円	G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000)	5,058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

<p style="text-align: center;">第5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10日</p>	<p style="text-align: center;">第6期 自 2021年12月11日 至 2022年12月12日</p>
<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、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>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

<p style="text-align: center;">第5期 2021年12月10日現在</p>	<p style="text-align: center;">第6期 2022年12月12日現在</p>
<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</p> <p>（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</p> <p>これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> <p>3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>親投資信託受益証券</p> <p>同左</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>同左</p> <p>3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>同左</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

第5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10日	第6期 自 2021年12月11日 至 2022年12月12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5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10日	第6期 自 2021年12月11日 至 2022年12月12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	1,282,645,013	176,137,129
合計	1,282,645,013	176,137,129

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先進国リートマザーファンド	5,279,706,396	7,471,840,491	
合計		5,279,706,396	7,471,840,491	

(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。

「R M国内債券マザーファンド」「R M国内株式マザーファンド」「R M先進国債券マザーファンド」「R M先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）」「R M新興国債券マザーファンド」「R M先進国株式マザーファンド」「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」及び「R M先進国リートマザーファンド」の状況は次の通りです。

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

貸借対照表

（単位：円）

2022年12月12日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	284,296
コール・ローン	537,187,287
国債証券	146,015,806,800
地方債証券	8,828,172,510
特殊債券	10,075,049,042
社債券	7,487,243,000

2022年12月12日現在

未収入金	214,102,000
未収利息	293,069,367
前払費用	32,281,886
流動資産合計	173,483,196,188
資産合計	173,483,196,188
負債の部	
流動負債	
未払金	299,756,000
未払解約金	194,300,000
未払利息	1,457
流動負債合計	494,057,457
負債合計	494,057,457
純資産の部	
元本等	
元本	170,980,256,528
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	2,008,882,203
元本等合計	172,989,138,731
純資産合計	172,989,138,731
負債純資産合計	173,483,196,188

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、特殊債券、社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額、又は価格情報会社の提供する価額で評価しております。
-----------------	--

(貸借対照表に関する注記)

2022年12月12日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年12月11日
期首元本額	120,152,804,390円
期中追加設定元本額	84,131,988,543円
期中一部解約元本額	33,304,536,405円
期末元本額	170,980,256,528円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	13,625,681,644円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	11,382,404,664円
りそなラップ型ファンド(成長型)	3,535,799,305円
DCりそな グローバルバランス	854,943,484円
つみたてバランスファンド	5,467,311,210円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	4,440,214,273円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	1,199,290,268円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	375,395,425円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	552,655,638円

りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	165,014,215円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	39,178,006円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	39,744,767円
FWりそな円建債券アクティブファンド	208,739,687円
FWりそな国内債券インデックスファンド	103,384,955,719円
Smart-i 国内債券インデックス	1,911,753,048円
Smart-i 8資産バランス 安定型	1,534,549,560円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	1,251,865,027円
Smart-i 8資産バランス 成長型	505,959,018円
りそなFT 国内債券インデックス（適格機関投資家専用）	8,865,472,563円
りそなFT RCバランスファンド（適格機関投資家専用）	10,071,765,255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）	27,217,505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）	67,712,112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）	115,946,541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）	1,356,687,594円
2. 計算日における受益権の総数	170,980,256,528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	1.0117円
(10,000口当たり純資産額)	(10,117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12月12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12月12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、特殊債券、社債券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

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12月12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12月12日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	4,541,702,380
地方債証券	154,072,055
特殊債券	249,716,488
社債券	125,570,000
合計	5,071,060,923

（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 3 2 回利付国債（2年）	650,000,000	650,546,000	
	第4 3 3 回利付国債（2年）	470,000,000	470,371,300	
	第4 3 4 回利付国債（2年）	330,000,000	330,257,400	
	第4 3 5 回日本国債（2年）	1,780,000,000	1,781,370,600	
	第4 3 6 回利付国債（2年）	430,000,000	430,322,500	
	第4 3 7 回利付国債（2年）	2,070,000,000	2,071,345,500	
	第4 3 8 回利付国債（2年）	920,000,000	920,561,200	
	第4 3 9 回利付国債（2年）	820,000,000	820,467,400	
	第4 4 0 回利付国債（2年）	1,580,000,000	1,580,805,800	
	第4 4 1 回利付国債（2年）	100,000,000	100,054,000	
	第4 4 2 回利付国債（2年）	100,000,000	100,056,000	
	第1 3 9 回利付国債（5年）	1,980,000,000	1,983,742,200	
	第1 4 0 回利付国債（5年）	1,930,000,000	1,933,956,500	
	第1 4 1 回利付国債（5年）	1,170,000,000	1,172,585,700	
	第1 4 2 回利付国債（5年）	2,770,000,000	2,776,149,400	
	第1 4 3 回利付国債（5年）	2,070,000,000	2,074,905,900	
	第1 4 4 回利付国債（5年）	2,170,000,000	2,175,728,800	
	第1 4 5 回利付国債（5年）	1,820,000,000	1,825,023,200	
	第1 4 6 回利付国債（5年）	2,470,000,000	2,477,064,200	
	第1 4 7 回利付国債（5年）	2,310,000,000	2,309,607,300	
	第1 4 8 回利付国債（5年）	1,890,000,000	1,888,658,100	
	第1 4 9 回利付国債（5年）	1,880,000,000	1,877,161,200	
	第1 5 0 回利付国債（5年）	1,930,000,000	1,925,348,700	
	第1 5 1 回利付国債（5年）	920,000,000	917,065,200	
	第1 5 2 回利付国債（5年）	1,030,000,000	1,030,875,500	
	第1 5 3 回利付国債（5年）	1,510,000,000	1,503,537,200	
	第1 5 4 回利付国債（5年）	860,000,000	858,976,600	
	第1 回利付国債（40年）	100,000,000	123,504,000	
	第2 回利付国債（40年）	180,000,000	214,023,600	
	第3 回利付国債（40年）	110,000,000	131,116,700	

第4回利付国債(40年)	170,000,000	201,208,600
第5回利付国債(40年)	220,000,000	251,050,800
第6回利付国債(40年)	280,000,000	311,749,200
第7回利付国債(40年)	360,000,000	383,068,800
第8回利付国債(40年)	410,000,000	404,600,300
第9回利付国債(40年)	680,000,000	491,633,200
第10回利付国債(40年)	600,000,000	510,432,000
第11回利付国債(40年)	480,000,000	392,980,800
第12回利付国債(40年)	550,000,000	401,478,000
第13回利付国債(40年)	650,000,000	470,977,000
第14回利付国債(40年)	660,000,000	511,724,400
第15回利付国債(40年)	390,000,000	329,986,800
第333回利付国債(10年)	225,000,000	226,851,750
第334回利付国債(10年)	261,000,000	263,516,040
第335回利付国債(10年)	345,000,000	348,205,050
第336回利付国債(10年)	210,000,000	212,160,900
第337回利付国債(10年)	170,000,000	171,064,200
第338回利付国債(10年)	631,000,000	636,786,270
第339回利付国債(10年)	385,000,000	388,923,150
第340回利付国債(10年)	934,000,000	944,339,380
第341回利付国債(10年)	440,000,000	443,916,000
第342回利付国債(10年)	380,000,000	381,113,400
第343回利付国債(10年)	780,000,000	782,051,400
第344回利付国債(10年)	960,000,000	961,977,600
第345回利付国債(10年)	1,070,000,000	1,071,498,000
第346回利付国債(10年)	1,310,000,000	1,311,113,500
第347回利付国債(10年)	750,000,000	750,000,000
第348回利付国債(10年)	1,820,000,000	1,818,271,000
第349回利付国債(10年)	1,690,000,000	1,687,042,500
第350回利付国債(10年)	1,820,000,000	1,815,704,800
第351回利付国債(10年)	1,270,000,000	1,266,520,200
第352回利付国債(10年)	1,240,000,000	1,236,094,000
第353回利付国債(10年)	1,730,000,000	1,723,287,600
第354回利付国債(10年)	1,330,000,000	1,323,815,500
第355回利付国債(10年)	1,390,000,000	1,382,382,800
第356回利付国債(10年)	1,850,000,000	1,837,642,000
第357回利付国債(10年)	1,410,000,000	1,398,776,400
第358回利付国債(10年)	1,510,000,000	1,497,029,100
第359回利付国債(10年)	2,050,000,000	2,028,803,000
第360回利付国債(10年)	1,430,000,000	1,412,568,300
第361回利付国債(10年)	1,470,000,000	1,450,948,800
第362回利付国債(10年)	1,790,000,000	1,764,671,500

第363回利付国債(10年)	880,000,000	866,817,600
第364回利付国債(10年)	1,770,000,000	1,742,724,300
第365回利付国債(10年)	1,170,000,000	1,151,970,300
第366回日本国債(10年)	1,940,000,000	1,942,638,400
第367回日本国債(10年)	1,110,000,000	1,106,381,400
第368回日本国債(10年)	920,000,000	915,611,600
第1回利付国債(30年)	60,000,000	70,490,400
第7回利付国債(30年)	40,000,000	47,425,600
第10回利付国債(30年)	30,000,000	32,149,800
第11回利付国債(30年)	80,000,000	90,588,000
第12回利付国債(30年)	80,000,000	93,944,800
第13回利付国債(30年)	200,000,000	232,912,000
第14回利付国債(30年)	60,000,000	72,544,800
第15回利付国債(30年)	200,000,000	244,494,000
第16回利付国債(30年)	140,000,000	171,409,000
第17回利付国債(30年)	160,000,000	194,355,200
第18回利付国債(30年)	60,000,000	72,272,400
第19回利付国債(30年)	100,000,000	120,565,000
第20回利付国債(30年)	100,000,000	123,120,000
第21回利付国債(30年)	180,000,000	217,344,600
第22回利付国債(30年)	50,000,000	61,673,000
第23回利付国債(30年)	220,000,000	271,585,600
第24回利付国債(30年)	170,000,000	210,145,500
第25回利付国債(30年)	200,000,000	242,244,000
第26回利付国債(30年)	205,000,000	251,178,300
第27回利付国債(30年)	295,000,000	365,832,450
第28回利付国債(30年)	290,000,000	359,759,500
第29回利付国債(30年)	150,000,000	183,864,000
第30回利付国債(30年)	190,000,000	230,025,400
第31回利付国債(30年)	170,000,000	203,088,800
第32回利付国債(30年)	335,000,000	405,386,850
第33回利付国債(30年)	290,000,000	336,806,000
第34回利付国債(30年)	335,000,000	400,177,600
第35回利付国債(30年)	406,000,000	471,276,680
第36回利付国債(30年)	425,000,000	493,650,250
第37回利付国債(30年)	570,000,000	651,447,300
第38回利付国債(30年)	520,000,000	584,677,600
第39回利付国債(30年)	540,000,000	616,960,800
第40回利付国債(30年)	255,000,000	286,632,750
第41回利付国債(30年)	345,000,000	381,314,700
第42回利付国債(30年)	350,000,000	386,522,500
第43回利付国債(30年)	310,000,000	342,063,300
第44回利付国債(30年)	390,000,000	429,963,300

第45回利付国債(30年)	340,000,000	361,222,800	
第46回利付国債(30年)	560,000,000	594,216,000	
第47回利付国債(30年)	540,000,000	582,940,800	
第48回利付国債(30年)	443,000,000	460,077,650	
第49回利付国債(30年)	440,000,000	456,280,000	
第50回利付国債(30年)	510,000,000	466,114,500	
第51回利付国債(30年)	510,000,000	412,931,700	
第52回利付国債(30年)	450,000,000	381,163,500	
第53回利付国債(30年)	410,000,000	354,547,500	
第54回利付国債(30年)	500,000,000	451,795,000	
第55回利付国債(30年)	250,000,000	225,292,500	
第56回利付国債(30年)	410,000,000	368,139,000	
第57回利付国債(30年)	470,000,000	420,866,200	
第58回利付国債(30年)	720,000,000	642,362,400	
第59回利付国債(30年)	450,000,000	390,406,500	
第60回利付国債(30年)	340,000,000	308,682,600	
第61回利付国債(30年)	360,000,000	310,161,600	
第62回利付国債(30年)	400,000,000	325,548,000	
第63回利付国債(30年)	380,000,000	299,276,600	
第64回利付国債(30年)	440,000,000	345,246,000	
第65回利付国債(30年)	400,000,000	314,492,000	
第66回利付国債(30年)	500,000,000	392,425,000	
第67回利付国債(30年)	310,000,000	254,169,000	
第68回利付国債(30年)	500,000,000	408,575,000	
第69回利付国債(30年)	460,000,000	385,498,400	
第70回利付国債(30年)	710,000,000	593,126,900	
第71回利付国債(30年)	480,000,000	400,104,000	
第72回利付国債(30年)	460,000,000	382,963,800	
第73回利付国債(30年)	430,000,000	357,553,600	
第74回利付国債(30年)	540,000,000	487,069,200	
第75回利付国債(30年)	390,000,000	380,265,600	
第76回利付国債(30年)	360,000,000	357,742,800	
第67回利付国債(20年)	20,000,000	20,493,800	
第68回利付国債(20年)	90,000,000	92,564,100	
第69回利付国債(20年)	60,000,000	61,633,800	
第70回利付国債(20年)	110,000,000	114,066,700	
第71回利付国債(20年)	100,000,000	103,394,000	
第72回利付国債(20年)	210,000,000	217,900,200	
第73回利付国債(20年)	180,000,000	187,306,200	
第75回利付国債(20年)	100,000,000	104,769,000	
第76回利付国債(20年)	100,000,000	104,316,000	
第77回利付国債(20年)	20,000,000	20,908,600	

第78回利付国債(20年)	50,000,000	52,398,500
第79回利付国債(20年)	20,000,000	21,009,600
第80回利付国債(20年)	90,000,000	94,770,000
第81回利付国債(20年)	30,000,000	31,661,700
第82回利付国債(20年)	170,000,000	179,887,200
第83回利付国債(20年)	10,000,000	10,632,400
第84回利付国債(20年)	120,000,000	127,226,400
第85回利付国債(20年)	150,000,000	160,234,500
第86回利付国債(20年)	100,000,000	107,476,000
第87回利付国債(20年)	90,000,000	96,434,100
第88回利付国債(20年)	185,000,000	199,790,750
第89回利付国債(20年)	120,000,000	129,172,800
第90回利付国債(20年)	170,000,000	183,787,000
第91回利付国債(20年)	80,000,000	86,788,800
第92回利付国債(20年)	255,000,000	275,800,350
第93回利付国債(20年)	80,000,000	86,548,000
第94回利付国債(20年)	140,000,000	152,054,000
第95回利付国債(20年)	185,000,000	203,350,150
第96回利付国債(20年)	70,000,000	76,313,300
第97回利付国債(20年)	130,000,000	142,823,200
第98回利付国債(20年)	70,000,000	76,573,000
第99回利付国債(20年)	85,000,000	93,349,550
第100回利付国債(20年)	151,000,000	167,259,680
第101回利付国債(20年)	20,000,000	22,362,600
第102回利付国債(20年)	145,000,000	162,897,350
第103回利付国債(20年)	100,000,000	111,796,000
第104回利付国債(20年)	10,000,000	11,070,100
第105回利付国債(20年)	12,000,000	13,338,480
第106回利付国債(20年)	40,000,000	44,690,400
第107回利付国債(20年)	80,000,000	89,279,200
第108回利付国債(20年)	220,000,000	242,893,200
第109回利付国債(20年)	80,000,000	88,607,200
第110回利付国債(20年)	195,000,000	218,400,000
第111回利付国債(20年)	50,000,000	56,524,500
第112回利付国債(20年)	205,000,000	230,430,250
第113回利付国債(20年)	85,000,000	95,851,100
第114回利付国債(20年)	160,000,000	180,979,200
第115回利付国債(20年)	100,000,000	113,804,000
第116回利付国債(20年)	140,000,000	159,994,800
第117回利付国債(20年)	225,000,000	255,523,500
第118回利付国債(20年)	131,000,000	148,189,820
第119回利付国債(20年)	150,000,000	167,464,500
第120回利付国債(20年)	240,000,000	264,396,000

第121回利付国債(20年)	205,000,000	230,866,900	
第122回利付国債(20年)	190,000,000	212,526,400	
第123回利付国債(20年)	265,000,000	303,538,950	
第124回利付国債(20年)	200,000,000	227,514,000	
第125回利付国債(20年)	120,000,000	138,894,000	
第126回利付国債(20年)	100,000,000	114,125,000	
第127回利付国債(20年)	130,000,000	147,310,800	
第128回利付国債(20年)	225,000,000	255,642,750	
第129回利付国債(20年)	240,000,000	270,686,400	
第130回利付国債(20年)	220,000,000	248,941,000	
第131回利付国債(20年)	30,000,000	33,689,400	
第132回利付国債(20年)	80,000,000	90,072,000	
第133回利付国債(20年)	355,000,000	402,822,050	
第134回利付国債(20年)	45,000,000	51,223,500	
第135回利付国債(20年)	40,000,000	45,170,400	
第136回利付国債(20年)	220,000,000	246,448,400	
第137回利付国債(20年)	170,000,000	192,111,900	
第138回利付国債(20年)	90,000,000	100,039,500	
第139回利付国債(20年)	440,000,000	493,156,400	
第140回利付国債(20年)	520,000,000	587,979,600	
第141回利付国債(20年)	85,000,000	96,153,700	
第142回利付国債(20年)	290,000,000	330,861,000	
第143回利付国債(20年)	335,000,000	375,749,400	
第144回利付国債(20年)	580,000,000	644,815,000	
第145回利付国債(20年)	815,000,000	922,865,250	
第146回利付国債(20年)	830,000,000	939,950,100	
第147回利付国債(20年)	685,000,000	768,508,350	
第148回利付国債(20年)	795,000,000	883,078,050	
第149回利付国債(20年)	890,000,000	988,540,800	
第150回利付国債(20年)	760,000,000	835,095,600	
第151回利付国債(20年)	845,000,000	908,451,050	
第152回利付国債(20年)	920,000,000	988,144,400	
第153回利付国債(20年)	630,000,000	683,732,700	
第154回利付国債(20年)	688,000,000	737,398,400	
第155回利付国債(20年)	820,000,000	857,014,800	
第156回利付国債(20年)	800,000,000	773,680,000	
第157回利付国債(20年)	800,000,000	750,600,000	
第158回利付国債(20年)	500,000,000	487,130,000	
第159回利付国債(20年)	730,000,000	718,838,300	
第160回利付国債(20年)	820,000,000	816,293,600	
第161回利付国債(20年)	540,000,000	528,697,800	
第162回利付国債(20年)	660,000,000	643,836,600	

	第163回利付国債(20年)	650,000,000	631,722,000
	第164回利付国債(20年)	890,000,000	849,051,100
	第165回利付国債(20年)	660,000,000	627,039,600
	第166回利付国債(20年)	890,000,000	868,408,600
	第167回利付国債(20年)	620,000,000	584,455,400
	第168回利付国債(20年)	880,000,000	812,952,800
	第169回利付国債(20年)	500,000,000	452,305,000
	第170回利付国債(20年)	860,000,000	774,653,600
	第171回利付国債(20年)	560,000,000	502,252,800
	第172回利付国債(20年)	730,000,000	663,555,400
	第173回利付国債(20年)	730,000,000	661,255,900
	第174回利付国債(20年)	990,000,000	892,960,200
	第175回利付国債(20年)	710,000,000	649,841,700
	第176回利付国債(20年)	790,000,000	720,645,900
	第177回利付国債(20年)	810,000,000	722,771,100
	第178回利付国債(20年)	870,000,000	788,167,800
	第179回利付国債(20年)	310,000,000	280,081,900
	第180回利付国債(20年)	880,000,000	838,692,800
	第181回利付国債(20年)	610,000,000	590,870,400
	第182回利付国債(20年)	370,000,000	370,299,700
	国債証券合計	146,147,000,000	146,015,806,800
地方債証券	第14回東京都公募公債	100,000,000	110,555,000
	第746回東京都公募公債	100,000,000	100,965,000
	第751回東京都公募公債	100,000,000	100,736,000
	第761回東京都公募公債	100,000,000	99,644,000
	第785回東京都公募公債	100,000,000	99,573,000
	第789回東京都公募公債	100,000,000	98,639,000
	第808回東京都公募公債	100,000,000	97,663,000
	第817回東京都公募公債	100,000,000	96,798,000
	第829回東京都公募公債	100,000,000	98,404,000
	平成28年度第8回北海道公募公債	100,000,000	99,499,000
	第15回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	111,676,000
	第211回神奈川県公募公債	100,000,000	100,661,000
	第220回神奈川県公募公債	100,000,000	99,804,000
	第164回大阪府公募公債	100,000,000	99,838,000
	第170回大阪府公募公債	100,000,000	99,694,000
	第444回大阪府公募公債	100,000,000	98,431,000
	第451回大阪府公募公債	100,000,000	97,756,000
	第471回大阪府公募公債	140,000,000	135,584,400
	平成27年度第13回京都府公募公債	100,000,000	99,918,000
	平成29年度第4回京都府公募公債	100,000,000	99,843,000
	平成29年度第1回兵庫県公募公債	100,000,000	99,854,000

令和元年度第2回兵庫県公募公債	100,000,000	98,546,000	
第6回静岡県公募公債（15年）	100,000,000	104,614,000	
平成26年度第6回静岡県公募公債	100,000,000	100,801,000	
平成30年度第14回静岡県公募公債	100,000,000	98,994,000	
令和4年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	97,914,000	
平成22年度第8回愛知県公募公債	100,000,000	111,089,000	
平成28年度第8回愛知県公募公債	100,000,000	99,631,000	
平成29年度第11回愛知県公募公債	100,000,000	99,906,000	
令和3年度第12回愛知県公募公債	100,000,000	88,550,000	
平成29年度第3回広島県公募公債	100,000,000	99,554,000	
平成30年度第1回広島県公募公債	100,000,000	99,573,000	
令和3年度第1回広島県公募公債	100,000,000	97,505,000	
第8回埼玉県公募公債	100,000,000	112,140,000	
第16回埼玉県公募公債	100,000,000	105,690,000	
平成26年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	100,810,000	
令和3年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	93,655,000	
平成24年度第2回福岡県公募公債	100,000,000	110,221,000	
平成27年度第1回福岡県公募公債（20年）	200,000,000	213,370,000	
平成27年度第1回福岡県公募公債	100,000,000	101,158,000	
第11回千葉県公募公債	100,000,000	112,285,000	
第19回千葉県公募公債	100,000,000	104,992,000	
平成29年度第6回千葉県公募公債	100,000,000	99,888,000	
令和4年度第6回千葉県公募公債	100,000,000	99,835,000	
第15回千葉県公募公債	95,000,000	92,827,350	
令和3年度第3回茨城県公募公債	100,000,000	99,411,000	
令和4年度第2回大分県公募公債	100,000,000	99,034,000	
第133回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,831,000	
第156回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,869,000	
第169回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,956,000	
第172回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,978,000	
第174回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,531,000	
第181回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,472,000	
第185回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,720,000	
第187回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,820,000	
第191回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,875,000	
第197回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,109,000	
第207回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,141,000	
第209回共同発行市場公募地方債	100,000,000	97,825,000	
第216回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,075,000	
第217回共同発行市場公募地方債	100,000,000	97,989,000	
第231回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,038,000	
第234回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,450,000	

	令和3年度第2回堺市公募公債	95,000,000	92,841,600
	令和元年度第3回堺市公募公債	100,000,000	98,084,000
	令和4年度第2回長崎県公募公債(20年・定時償還)	100,000,000	98,587,000
	令和4年度第1回島根県公募公債	100,000,000	96,953,000
	令和2年度第1回佐賀県公募公債	100,000,000	97,755,000
	令和4年度第3回奈良県公募公債(20年・定時償還)	100,000,000	98,989,000
	平成27年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	101,032,000
	第11回大阪市公募公債	100,000,000	113,263,000
	第17回名古屋市公募公債	100,000,000	105,691,000
	令和元年度第4回京都市公募公債	114,500,000	112,597,010
	平成22年度第9回神戸市公募公債	100,000,000	113,024,000
	第23回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	113,548,000
	第26回横浜市公募公債	100,000,000	111,866,000
	第21回横浜市公募公債	100,000,000	111,555,000
	令和4年度第3回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	98,630,000
	第12回川崎市公募公債(30年)	100,000,000	77,652,000
	第37回川崎市公募公債	97,500,000	95,216,550
	平成26年度第5回福岡市公募公債	100,000,000	100,812,000
	平成27年度第2回広島市公募公債	100,000,000	101,009,000
	平成29年度第3回千葉市公募公債	120,000,000	119,697,600
	平成29年度第5回福井県公募公債	100,000,000	99,525,000
	令和2年度第1回山梨県公募公債(10年)	100,000,000	97,802,000
	平成29年度第2回岡山県公募公債	100,000,000	99,835,000
	地方債証券合計	8,762,000,000	8,828,172,510
特殊債券	第34回新関西国際空港株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	99,864,000
	第28回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,842,000
	第49回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	99,851,000
	第89回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	99,540,000
	第117回株式会社日本政策投資銀行無担保社債(社債間限定同順)	100,000,000	75,092,000
	第131回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	79,166,000
	第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,335,000
	第16回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	122,602,000
	第27回道路債券	100,000,000	102,932,000
	第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	150,000,000	166,692,000
	第127回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,013,000
	第138回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	112,726,000

第148回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	112,356,000	
第183回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	112,367,000	
第205回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,214,000	
第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	114,000,000	115,043,100	
第227回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	127,000,000	128,104,900	
第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,796,000	
第249回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,027,000	
第251回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	103,000,000	104,290,590	
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	133,000,000	133,954,940	
第270回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,231,000	
第300回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,815,000	
第330回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,755,000	
第339回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,850,000	
第345回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,417,000	
第375回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	98,959,000	
第387回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	98,199,000	
第283回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	95,611,000	
第1回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	109,017,000	
第5回地方公共団体金融機構債券(20年)	200,000,000	224,928,000	
第13回公営企業債券	100,000,000	105,047,000	
第18回公営企業債券(20年)	100,000,000	108,352,000	
第30回地方公共団体金融機構債券(5年)	100,000,000	99,023,000	
第78回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,866,000	
F82回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,440,000	
第95回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,632,000	
第96回政府保証地方公共団体金融機構債券	120,000,000	119,629,200	
第97回政府保証地方公共団体金融機構債券	145,000,000	144,675,200	
第97回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	199,192,000	
第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	213,000,000	212,693,280	
F132回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,476,000	
F228回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,191,000	
F305回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,461,000	

F 1 4 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	79,277,000
F 1 5 1 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	96,260,000
第 1 0 回株式会社日本政策金融公庫社債(一般担保付)	100,000,000	112,125,000
第 9 7 回都市再生債券	100,000,000	103,829,000
第 1 1 7 回都市再生債券	100,000,000	102,268,000
第 2 回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	108,118,000
第 6 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	55,741,000	54,929,968
第 7 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	59,636,000	58,885,779
第 9 7 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	112,345,000
第 1 1 7 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,227,000
第 1 2 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,388,000	74,221,747
第 1 2 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,176,000	73,822,080
第 1 2 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,153,000	75,586,794
第 1 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,127,000	74,714,844
第 1 3 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,609,000	77,784,361
第 1 3 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,098,000	78,694,683
第 1 5 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,467,000	83,117,268
第 1 5 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,106,000	85,159,735
第 1 6 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,828,000	87,996,891
第 1 6 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,903,000	90,275,703
第 1 7 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,946,000	90,936,909
第 1 7 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,186,000	91,699,336
第 1 7 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,973,000	91,474,194
第 1 7 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,487,000	92,065,700
第 1 7 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,465,000	92,491,265
第 1 7 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,368,000	93,167,618
第 1 8 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,699,000	96,524,661
第 1 8 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	198,418,000	193,528,980
第 1 8 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,431,000	97,635,276
第 1 8 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,845,000	99,389,706
第 1 8 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,533,000
第 2 2 3 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	98,236,000
第 3 5 1 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	96,357,000
第 1 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	38,762,000	38,458,881
第 2 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	39,814,000	39,528,533
第 3 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	40,977,000	40,654,920
第 3 3 4 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	87,407,000
第 2 7 回成田国際空港株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	92,993,000
い第 8 6 6 号商工債	100,000,000	99,478,000
い第 8 7 0 号商工債	100,000,000	99,587,000
第 3 5 8 回信金中金債(5年)	100,000,000	99,749,000

	第372回信金中金債	100,000,000	99,632,000
	第376回信金中金債	100,000,000	99,509,000
	第385回信金中金債	100,000,000	99,140,000
	第25回国際協力機構債券	100,000,000	108,905,000
	第31回国際協力機構債券	100,000,000	101,020,000
	第58回東日本高速道路株式会社社債(一般担保付、独立行政法人)	100,000,000	98,482,000
	第79回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,146,000
	第85回東日本高速道路株式会社社債(一般担保付、独立行政法人)	100,000,000	96,598,000
	第87回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,304,000
	第88回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,207,000
	第29回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,125,000
	第52回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,657,000
	第93回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	92,901,000
	第103回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	88,620,000
	特殊債券合計	10,029,603,000	10,075,049,042
社債券	第24回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	100,000,000	99,651,000
	第38回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債(202)	100,000,000	99,804,000
	第1回新韓銀行円貨社債(2022)(ソーシャルボンド)	100,000,000	99,942,000
	第27回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー期限前償還条項付円	100,000,000	99,413,000
	第17回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,921,000
	第13回大和ハウス工業株式会社無担保社債(特定社債間限定同順)	100,000,000	99,459,000
	第1回株式会社日清製粉グループ本社無担保社債	100,000,000	97,804,000
	第1回コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス社債	100,000,000	99,689,000
	第27回味の素株式会社無担保社債	100,000,000	97,977,000
	第18回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	96,639,000
	第35回昭和電工株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	96,149,000
	第13回イビデン株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	99,775,000
	第54回三井化学株式会社無担保社債	100,000,000	96,345,000
	第3回株式会社電通無担保社債	100,000,000	99,600,000
	第1回無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	99,978,000
	第20回株式会社オリエンタルランド無担保社債	100,000,000	99,233,000
	第12回Zホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	98,890,000
	第18回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	98,671,000

第10回株式会社資生堂無担保社債	100,000,000	99,621,000	
第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,139,000	
第15回旭硝子株式会社無担保社債	100,000,000	99,692,000	
第28回ジェイエフイーホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,700,000	
第12回株式会社小松製作所無担保社債	100,000,000	99,815,000	
第30回ダイキン工業株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約)	100,000,000	99,511,000	
第16回日本電産株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	99,766,000	
第19回パナソニック株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約)	100,000,000	98,056,000	
第38回ソニーグループ株式会社無担保社債	100,000,000	99,927,000	
第17回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,333,000	
第5回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	98,177,000	
第30回豊田通商株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	99,812,000	
第17回株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ無担保社債	100,000,000	98,618,000	
第19回三井住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	98,960,000	
第21回三井住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	98,686,000	
第18回NTTファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	98,789,000	
第21回NTTファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,132,000	
第71回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	98,985,000	
第73回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	98,879,000	
第29回SBIホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,753,000	
第96回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,403,000	
第81アコム株式会社無担保社債	100,000,000	98,547,000	
第205回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	97,928,000	
第16回三井住友ファイナンス&リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,893,000	
第75回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,732,000	
第5回三菱HCキャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	98,119,000	
第7回三井住友海上火災保険株式会社無担保社債	100,000,000	99,138,000	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	99,188,000	
第134回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	98,284,000	
第44回相鉄ホールディングス株式会社無担保社債(相模鉄道株式)	100,000,000	99,084,000	
第14回東急株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	99,858,000	
第98回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	100,635,000	

第112回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	100,247,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	91,185,000	
第3回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	96,735,000	
第26回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	111,818,000	
第10回九州旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	86,343,000	
第22回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	99,028,000	
第543回中部電力株式会社社債	100,000,000	99,506,000	
第536回関西電力株式会社社債	100,000,000	95,979,000	
第541回関西電力株式会社社債	100,000,000	94,849,000	
第413回中国電力株式会社社債	100,000,000	97,751,000	
第433回中国電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	98,705,000	
第338回北陸電力株式会社社債	100,000,000	95,770,000	
第343回北陸電力株式会社社債	100,000,000	94,863,000	
第531回東北電力株式会社社債	100,000,000	94,723,000	
第544回東北電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	96,229,000	
第462回九州電力株式会社社債	100,000,000	98,403,000	
第503回九州電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	98,706,000	
第375回北海道電力株式会社社債	100,000,000	99,459,000	
第32回沖縄電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	99,829,000	
第28回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	98,899,000	
第47回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	94,826,000	
第52回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	99,675,000	
第10回株式会社JERA無担保社債	100,000,000	99,432,000	
第70回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	99,044,000	
第49回大阪瓦斯株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	92,400,000	
第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	99,739,000	
社債券合計	7,600,000,000	7,487,243,000	
合計		172,406,271,352	

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国内株式マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2022年12月12日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	561,991,538
株式	52,622,517,490
派生商品評価勘定	1,361,250
未収配当金	35,189,735
差入委託証拠金	20,625,000
流動資産合計	53,241,685,013
資産合計	
53,241,685,013	
負債の部	
流動負債	
前受金	3,000,000
未払金	191,842,643
未払解約金	17,492,300
未払利息	1,524
流動負債合計	212,336,467
負債合計	
212,336,467	
純資産の部	
元本等	
元本	36,114,583,817
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	16,914,764,729
元本等合計	53,029,348,546
純資産合計	
53,029,348,546	
負債純資産合計	
53,241,685,013	

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。
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12月12日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年12月11日
期首元本額	44,120,726,991円
期中追加設定元本額	49,726,099,570円
期中一部解約元本額	57,732,242,744円
期末元本額	36,114,583,817円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド（安定型）	1,591,045,842円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	1,516,214,078円
りそなラップ型ファンド（成長型）	1,926,758,572円
DCりそな グローバルバランス	38,748,548円
つみたてバランスファンド	5,562,437,081円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	465,292,626円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	306,429,881円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	208,870,106円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	93,792,373円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	61,242,921円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	34,395,597円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	67,982,774円
FWりそな国内株式アクティブファンド	171,041,911円
FWりそな国内株式インデックスファンド	17,038,993,801円
Smart-i TOPIXインデックス	2,506,934,886円
Smart-i 8資産バランス 安定型	98,575,666円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	307,739,715円
Smart-i 8資産バランス 成長型	373,198,678円
TOPIXインデックスファンド（適格機関投資家専用）	512,456,603円
りそなFT TOPIXインデックス（適格機関投資家専用）	1,026,615,398円
りそなDAAファンド（適格機関投資家専用）	89,363,139円
りそなFT RCバランスファンド（適格機関投資家専用）	1,321,784,951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）	3,149,933円
りそなVIグローバル・バランスファンド（安定成長型）（適格機関投資家専用）	10,255,437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）	73,868,923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）	88,189,049円
りそなFT パッシブバランス（適格機関投資家専用）	429,998,097円
りそなDAAファンド202205（適格機関投資家専用）	189,207,231円
2. 計算日における受益権の総数	36,114,583,817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	1.4684円
(10,000口当たり純資産額)	(14,684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12月12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12月12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 (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12月12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12月12日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式		1,262,279,249
合計		1,262,279,249

(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12月12日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	486,513,750	-	487,875,000	1,361,250
合計		486,513,750	-	487,875,000	1,361,250

（注）時価の算定方法

先物取引

国内先物取引について

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

（単位：円）

	評価額
--	-----

銘柄	株式数	単価	金額	備考
極洋	1,000	3,625.00	3,625,000	
ニッスイ	26,100	523.00	13,650,300	
マルハニチロ	4,000	2,381.00	9,524,000	
雪国まいたけ	2,200	995.00	2,189,000	
カネコ種苗	900	1,415.00	1,273,500	
サカタのタネ	3,300	4,470.00	14,751,000	
ホクト	2,300	1,875.00	4,312,500	
ホクリヨウ	400	678.00	271,200	
住石ホールディングス	4,100	410.00	1,681,000	
日鉄鉱業	1,000	3,050.00	3,050,000	
三井松島ホールディングス	1,200	3,245.00	3,894,000	
I N P E X	96,500	1,429.00	137,898,500	
石油資源開発	3,000	3,905.00	11,715,000	
K & O エナジーグループ	1,200	2,273.00	2,727,600	
ショーボンドホールディングス	3,600	5,770.00	20,772,000	
ミライト・ワン	9,000	1,532.00	13,788,000	
タマホーム	1,800	2,573.00	4,631,400	
サンヨーホームズ	300	710.00	213,000	
日本アクア	1,100	868.00	954,800	
ファーストコーポレーション	700	713.00	499,100	
ベステラ	600	925.00	555,000	
R o b o t H o m e	4,400	176.00	774,400	
キャンディル	400	499.00	199,600	
ダイセキ環境ソリューション	500	826.00	413,000	
第一カッター興業	700	1,084.00	758,800	
安藤・間	15,100	839.00	12,668,900	
東急建設	7,400	631.00	4,669,400	
コムシスホールディングス	8,800	2,428.00	21,366,400	
ピーアールホールディングス	4,100	333.00	1,365,300	
高松コンストラクショングループ	1,700	1,904.00	3,236,800	
東建コーポレーション	800	7,400.00	5,920,000	
ソネック	300	960.00	288,000	
ヤマウラ	1,300	992.00	1,289,600	
オリエンタル白石	9,400	275.00	2,585,000	
大成建設	18,200	4,160.00	75,712,000	

大林組	65,300	1,005.00	65,626,500	
清水建設	54,900	715.00	39,253,500	
飛島建設	2,000	997.00	1,994,000	
長谷工コーポレーション	18,800	1,494.00	28,087,200	
松井建設	1,700	556.00	945,200	
銭高組	200	2,631.00	526,200	
鹿島建設	40,500	1,532.00	62,046,000	
不動テトラ	1,300	1,468.00	1,908,400	
大末建設	700	1,174.00	821,800	
鉄建建設	1,300	1,755.00	2,281,500	
西松建設	3,100	3,940.00	12,214,000	
三井住友建設	14,700	415.00	6,100,500	
大豊建設	800	4,095.00	3,276,000	
佐田建設	1,200	459.00	550,800	
ナカノフドー建設	1,300	319.00	414,700	
奥村組	3,000	2,935.00	8,805,000	
東鉄工業	2,500	2,525.00	6,312,500	
イチケン	400	1,762.00	704,800	
富士ピー・エス	800	442.00	353,600	
浅沼組	1,500	2,937.00	4,405,500	
戸田建設	22,500	722.00	16,245,000	
熊谷組	3,200	2,566.00	8,211,200	
北野建設	300	2,449.00	734,700	
植木組	500	1,297.00	648,500	
矢作建設工業	2,500	753.00	1,882,500	
ピーエス三菱	2,300	610.00	1,403,000	
日本ハウスホールディングス	3,600	399.00	1,436,400	
新日本建設	2,600	731.00	1,900,600	
東亜道路工業	400	5,800.00	2,320,000	
日本道路	400	5,910.00	2,364,000	
東亜建設工業	1,600	2,259.00	3,614,400	
日本国土開発	5,500	563.00	3,096,500	
若築建設	800	2,755.00	2,204,000	
東洋建設	5,900	832.00	4,908,800	
五洋建設	25,900	634.00	16,420,600	
世紀東急工業	2,400	768.00	1,843,200	

福田組	700	4,655.00	3,258,500
住友林業	14,000	2,407.00	33,698,000
日本基礎技術	1,200	506.00	607,200
巴コーポレーション	2,000	395.00	790,000
大和ハウス工業	51,000	3,104.00	158,304,000
ライト工業	3,500	1,931.00	6,758,500
積水ハウス	57,200	2,395.00	136,994,000
日特建設	1,700	904.00	1,536,800
北陸電気工事	1,300	666.00	865,800
ユアテック	4,000	720.00	2,880,000
日本リーテック	1,200	770.00	924,000
四電工	800	1,707.00	1,365,600
中電工	2,800	2,058.00	5,762,400
関電工	10,000	856.00	8,560,000
きんでん	12,800	1,445.00	18,496,000
東京エネシス	1,800	911.00	1,639,800
トーエネック	600	3,430.00	2,058,000
住友電設	1,700	2,410.00	4,097,000
日本電設工業	3,000	1,629.00	4,887,000
エクシオグループ	8,900	2,150.00	19,135,000
新日本空調	1,000	1,869.00	1,869,000
九電工	4,400	3,235.00	14,234,000
三機工業	4,000	1,546.00	6,184,000
日揮ホールディングス	18,100	1,730.00	31,313,000
中外炉工業	600	1,604.00	962,400
ヤマト	1,500	711.00	1,066,500
太平電業	1,100	3,045.00	3,349,500
高砂熱学工業	4,400	1,748.00	7,691,200
三晃金属工業	200	2,985.00	597,000
朝日工業社	800	2,075.00	1,660,000
明星工業	3,100	738.00	2,287,800
大気社	2,200	3,460.00	7,612,000
ダイダン	1,200	2,152.00	2,582,400
日比谷総合設備	1,600	1,901.00	3,041,600
フィル・カンパニー	300	1,020.00	306,000
テスホールディングス	2,000	1,085.00	2,170,000

インフロニア・ホールディングス	19,100	1,026.00	19,596,600	
東洋エンジニアリング	2,400	559.00	1,341,600	
レイズネクスト	2,600	1,232.00	3,203,200	
ニッポン	4,900	1,594.00	7,810,600	
日清製粉グループ本社	16,900	1,562.00	26,397,800	
日東富士製粉	300	4,365.00	1,309,500	
昭和産業	1,600	2,412.00	3,859,200	
鳥越製粉	1,500	622.00	933,000	
中部飼料	2,500	1,027.00	2,567,500	
フィード・ワン	2,700	668.00	1,803,600	
東洋精糖	300	856.00	256,800	
日本甜菜製糖	1,100	1,619.00	1,780,900	
D M三井製糖ホールディングス	1,800	1,967.00	3,540,600	
塩水港精糖	2,100	196.00	411,600	
日新製糖	900	1,734.00	1,560,600	
森永製菓	3,800	3,820.00	14,516,000	
中村屋	500	3,090.00	1,545,000	
江崎グリコ	5,200	3,625.00	18,850,000	
名糖産業	700	1,633.00	1,143,100	
井村屋グループ	1,000	2,204.00	2,204,000	
不二家	1,300	2,580.00	3,354,000	
山崎製パン	12,300	1,596.00	19,630,800	
第一屋製パン	300	399.00	119,700	
モロゾフ	600	3,530.00	2,118,000	
亀田製菓	1,200	4,330.00	5,196,000	
寿スピリッツ	1,900	7,540.00	14,326,000	
カルビー	8,400	3,020.00	25,368,000	
森永乳業	3,300	4,485.00	14,800,500	
六甲バター	1,300	1,373.00	1,784,900	
ヤクルト本社	13,100	8,760.00	114,756,000	
明治ホールディングス	11,400	6,730.00	76,722,000	
雪印メグミルク	4,400	1,741.00	7,660,400	
プリマハム	2,500	2,080.00	5,200,000	
日本ハム	7,200	3,630.00	26,136,000	
林兼産業	600	464.00	278,400	
丸大食品	1,800	1,397.00	2,514,600	

S Foods	2,000	2,891.00	5,782,000	
柿安本店	700	2,155.00	1,508,500	
伊藤ハム米久ホールディングス	14,200	677.00	9,613,400	
サッポロホールディングス	6,000	3,590.00	21,540,000	
アサヒグループホールディングス	42,300	4,273.00	180,747,900	
キリンホールディングス	82,700	2,110.50	174,538,350	
宝ホールディングス	12,500	1,050.00	13,125,000	
オエノンホールディングス	5,500	279.00	1,534,500	
養命酒製造	600	1,796.00	1,077,600	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	14,400	1,460.00	21,024,000	
サントリー食品インターナショナル	12,900	4,570.00	58,953,000	
ダイドーグループホールディングス	1,000	4,855.00	4,855,000	
伊藤園	6,800	5,110.00	34,748,000	
キーコーヒー	2,100	2,058.00	4,321,800	
ユニカフェ	600	980.00	588,000	
ジャパンフーズ	300	1,062.00	318,600	
日清オイリオグループ	2,600	3,200.00	8,320,000	
不二製油グループ本社	4,300	2,052.00	8,823,600	
かどや製油	200	3,520.00	704,000	
J - オイルミルズ	1,900	1,511.00	2,870,900	
キッコーマン	12,100	7,530.00	91,113,000	
味の素	44,800	4,486.00	200,972,800	
ブルドックソース	700	1,707.00	1,194,900	
キュービー	9,800	2,439.00	23,902,200	
ハウス食品グループ本社	5,600	2,757.00	15,439,200	
カゴメ	8,500	3,045.00	25,882,500	
焼津水産化学工業	800	809.00	647,200	
アリアケジャパン	1,600	4,635.00	7,416,000	
ピエトロ	300	1,803.00	540,900	
エバラ食品工業	500	3,090.00	1,545,000	
やまみ	200	1,310.00	262,000	
ニチレイ	8,400	2,800.00	23,520,000	
東洋水産	9,300	5,440.00	50,592,000	
イトアンドホールディングス	800	2,264.00	1,811,200	
大冷	200	1,884.00	376,800	

ヨシムラ・フード・ホールディングス	1,200	576.00	691,200	
日清食品ホールディングス	6,500	10,580.00	68,770,000	
永谷園ホールディングス	900	1,983.00	1,784,700	
一正蒲鉾	800	721.00	576,800	
フジッコ	1,900	1,869.00	3,551,100	
ロック・フィールド	2,200	1,476.00	3,247,200	
日本たばこ産業	120,600	2,824.00	340,574,400	
ケンコーマヨネーズ	1,300	1,561.00	2,029,300	
わらべや日洋ホールディングス	1,300	1,926.00	2,503,800	
なとり	1,200	2,038.00	2,445,600	
イフジ産業	300	912.00	273,600	
ファーマフーズ	2,800	1,492.00	4,177,600	
ユーグレナ	11,800	931.00	10,985,800	
紀文食品	1,400	947.00	1,325,800	
ピククルスホールディングス	1,100	1,069.00	1,175,900	
ミヨシ油脂	600	995.00	597,000	
理研ビタミン	1,600	1,752.00	2,803,200	
片倉工業	1,700	1,805.00	3,068,500	
ゲンゼ	1,400	4,005.00	5,607,000	
東洋紡	8,100	1,017.00	8,237,700	
ユニチカ	5,600	253.00	1,416,800	
富士紡ホールディングス	700	3,375.00	2,362,500	
倉敷紡績	1,400	2,204.00	3,085,600	
シキボウ	1,000	950.00	950,000	
日本毛織	4,900	986.00	4,831,400	
ダイトウボウ	2,800	84.00	235,200	
トーア紡コーポレーション	700	358.00	250,600	
ガイドーリミテッド	2,800	247.00	691,600	
帝国繊維	2,100	1,639.00	3,441,900	
帝人	17,900	1,300.00	23,270,000	
東レ	124,900	723.40	90,352,660	
住江織物	300	1,790.00	537,000	
日本フェルト	1,000	406.00	406,000	
イチカワ	200	1,295.00	259,000	
日東製網	200	1,360.00	272,000	
アツギ	1,100	387.00	425,700	

ダイニック	500	607.00	303,500
セーレン	3,600	2,538.00	9,136,800
ソトー	600	835.00	501,000
東海染工	200	1,120.00	224,000
小松マテーレ	2,700	785.00	2,119,500
ワコールホールディングス	3,600	2,282.00	8,215,200
ホギメディカル	2,500	3,485.00	8,712,500
クラウディアホールディングス	400	287.00	114,800
T S Iホールディングス	6,700	456.00	3,055,200
マツオカコーポレーション	500	1,059.00	529,500
ワールド	2,400	1,271.00	3,050,400
三陽商会	700	1,245.00	871,500
ナイガイ	600	262.00	157,200
オンワードホールディングス	12,100	321.00	3,884,100
ルックホールディングス	500	2,547.00	1,273,500
キムラタン	10,100	20.00	202,000
ゴールドウイン	3,300	9,530.00	31,449,000
デサント	3,200	3,255.00	10,416,000
キング	800	483.00	386,400
ヤマトインターナショナル	1,400	249.00	348,600
特種東海製紙	800	2,794.00	2,235,200
王子ホールディングス	77,600	536.00	41,593,600
日本製紙	9,700	970.00	9,409,000
三菱製紙	2,200	278.00	611,600
北越コーポレーション	11,800	788.00	9,298,400
中越パルプ工業	800	955.00	764,000
巴川製紙所	600	750.00	450,000
大王製紙	8,200	1,032.00	8,462,400
阿波製紙	400	300.00	120,000
レンゴー	17,000	868.00	14,756,000
トーモク	1,100	1,576.00	1,733,600
ザ・バック	1,400	2,429.00	3,400,600
北の達人コーポレーション	7,800	295.00	2,301,000
クラレ	29,600	1,105.00	32,708,000
旭化成	116,400	999.00	116,283,600
共和レザー	1,100	503.00	553,300

昭和電工	18,000	2,221.00	39,978,000	
住友化学	138,300	483.00	66,798,900	
住友精化	800	4,180.00	3,344,000	
日産化学	8,800	6,610.00	58,168,000	
ラサ工業	700	1,976.00	1,383,200	
クレハ	1,600	8,770.00	14,032,000	
多木化学	700	4,880.00	3,416,000	
テイカ	1,300	1,233.00	1,602,900	
石原産業	3,400	1,122.00	3,814,800	
片倉コープアグリ	400	1,601.00	640,400	
日本曹達	2,000	4,115.00	8,230,000	
東ソー	24,900	1,630.00	40,587,000	
トクヤマ	6,000	1,860.00	11,160,000	
セントラル硝子	3,000	3,250.00	9,750,000	
東亜合成	9,600	1,130.00	10,848,000	
大阪ソーダ	1,100	4,220.00	4,642,000	
関東電化工業	3,600	985.00	3,546,000	
デンカ	6,800	3,190.00	21,692,000	
信越化学工業	31,900	17,100.00	545,490,000	
日本カーバイド工業	700	1,262.00	883,400	
堺化学工業	1,400	1,810.00	2,534,000	
第一稀元素化学工業	1,700	1,132.00	1,924,400	
エア・ウォーター	17,600	1,563.00	27,508,800	
日本酸素ホールディングス	18,100	2,181.00	39,476,100	
日本化学工業	600	1,790.00	1,074,000	
東邦アセチレン	400	1,103.00	441,200	
日本パーカラライジング	9,200	949.00	8,730,800	
高圧ガス工業	2,700	671.00	1,811,700	
チタン工業	200	1,544.00	308,800	
四国化成工業	2,200	1,302.00	2,864,400	
戸田工業	400	2,718.00	1,087,200	
ステラ ケミファ	1,100	2,558.00	2,813,800	
保土谷化学工業	500	3,010.00	1,505,000	
日本触媒	2,800	5,360.00	15,008,000	
大日精化工業	1,300	1,716.00	2,230,800	
カネカ	4,300	3,365.00	14,469,500	

三菱瓦斯化学	13,900	1,911.00	26,562,900
三井化学	15,700	3,090.00	48,513,000
J S R	17,400	2,884.00	50,181,600
東京応化工業	3,300	6,730.00	22,209,000
大阪有機化学工業	1,400	2,091.00	2,927,400
三菱ケミカルグループ	125,800	718.30	90,362,140
K Hネオケム	3,100	2,800.00	8,680,000
ダイセル	27,400	1,008.00	27,619,200
住友ベークライト	2,800	4,240.00	11,872,000
積水化学工業	38,700	1,873.00	72,485,100
日本ゼオン	11,200	1,326.00	14,851,200
アイカ工業	4,700	3,250.00	15,275,000
U B E	9,600	1,950.00	18,720,000
積水樹脂	2,700	1,751.00	4,727,700
タキロンシーアイ	4,100	508.00	2,082,800
旭有機材	1,200	2,615.00	3,138,000
ニチバン	1,200	1,745.00	2,094,000
リケンテクノス	4,000	477.00	1,908,000
大倉工業	900	1,963.00	1,766,700
積水化成成品工業	2,600	391.00	1,016,600
群栄化学工業	400	2,385.00	954,000
タイガースポリマー	900	403.00	362,700
ミライアル	600	1,534.00	920,400
ダイキアクシス	700	722.00	505,400
ダイキョーニシカワ	4,100	559.00	2,291,900
竹本容器	600	750.00	450,000
森六ホールディングス	900	1,733.00	1,559,700
恵和	600	3,395.00	2,037,000
日本化薬	14,200	1,177.00	16,713,400
カーリットホールディングス	1,700	707.00	1,201,900
日本精化	1,100	2,343.00	2,577,300
扶桑化学工業	1,700	3,490.00	5,933,000
トリケミカル研究所	2,500	2,299.00	5,747,500
A D E K A	6,500	2,203.00	14,319,500
日油	5,800	5,610.00	32,538,000
新日本理化	2,500	238.00	595,000

ハリマ化成グループ	1,300	832.00	1,081,600	
花王	45,400	5,471.00	248,383,400	
第一工業製薬	700	1,930.00	1,351,000	
石原ケミカル	900	1,245.00	1,120,500	
日華化学	700	868.00	607,600	
ニイタカ	400	2,090.00	836,000	
三洋化成工業	1,100	4,125.00	4,537,500	
有機合成薬品工業	1,400	298.00	417,200	
大日本塗料	2,300	754.00	1,734,200	
日本ペイントホールディングス	82,500	1,189.00	98,092,500	
関西ペイント	17,100	1,764.00	30,164,400	
神東塗料	1,500	129.00	193,500	
中国塗料	3,500	980.00	3,430,000	
日本特殊塗料	1,200	851.00	1,021,200	
藤倉化成	2,500	410.00	1,025,000	
太陽ホールディングス	2,800	2,445.00	6,846,000	
D I C	7,300	2,438.00	17,797,400	
サカタインクス	4,100	1,085.00	4,448,500	
東洋インキSCホールディングス	3,700	1,843.00	6,819,100	
T & K T O K A	1,700	1,124.00	1,910,800	
富士フイルムホールディングス	35,800	7,018.00	251,244,400	
資生堂	39,000	6,562.00	255,918,000	
ライオン	22,400	1,466.00	32,838,400	
高砂香料工業	1,300	2,703.00	3,513,900	
マンダム	4,000	1,436.00	5,744,000	
ミルボン	2,800	5,570.00	15,596,000	
ファンケル	8,200	2,579.00	21,147,800	
コーセー	3,800	15,250.00	57,950,000	
コタ	1,600	1,700.00	2,720,000	
シーボン	200	1,591.00	318,200	
ポーラ・オルビスホールディングス	9,600	1,881.00	18,057,600	
ノエビアホールディングス	1,700	5,790.00	9,843,000	
アジュバンホールディングス	500	948.00	474,000	
新日本製薬	1,100	1,390.00	1,529,000	
エステー	1,400	1,506.00	2,108,400	
アグロ カネショウ	700	1,740.00	1,218,000	

コニシ	3,100	1,694.00	5,251,400
長谷川香料	3,900	3,115.00	12,148,500
星光PMC	900	533.00	479,700
小林製薬	5,700	8,240.00	46,968,000
荒川化学工業	1,600	999.00	1,598,400
メック	1,500	2,411.00	3,616,500
日本高純度化学	500	2,584.00	1,292,000
タカラバイオ	5,000	1,805.00	9,025,000
JCU	2,100	3,295.00	6,919,500
新田ゼラチン	1,200	975.00	1,170,000
OATアグリオ	800	1,626.00	1,300,800
デクセリアルズ	5,400	3,065.00	16,551,000
アース製薬	1,700	5,250.00	8,925,000
北興化学工業	1,900	860.00	1,634,000
大成ラミック	600	3,130.00	1,878,000
クミアイ化学工業	7,400	887.00	6,563,800
日本農薬	3,400	715.00	2,431,000
アキレス	1,200	1,280.00	1,536,000
有沢製作所	3,100	1,317.00	4,082,700
日東電工	13,500	8,430.00	113,805,000
レック	2,700	800.00	2,160,000
三光合成	2,600	449.00	1,167,400
きもと	2,700	232.00	626,400
藤森工業	1,500	3,165.00	4,747,500
前澤化成工業	1,200	1,372.00	1,646,400
未来工業	700	1,456.00	1,019,200
ウェーブロックホールディングス	600	635.00	381,000
JSP	1,300	1,484.00	1,929,200
エフピコ	3,500	3,675.00	12,862,500
天馬	1,600	2,032.00	3,251,200
信越ポリマー	3,400	1,213.00	4,124,200
東リ	4,100	223.00	914,300
ニフコ	6,700	3,435.00	23,014,500
バルカー	1,600	2,650.00	4,240,000
ユニ・チャーム	38,900	5,194.00	202,046,600
ショーエイコーポレーション	500	555.00	277,500

協和キリン	22,500	3,080.00	69,300,000
武田薬品工業	165,200	4,051.00	669,225,200
アステラス製薬	178,800	2,129.00	380,665,200
住友ファーマ	13,800	1,049.00	14,476,200
塩野義製薬	23,800	6,863.00	163,339,400
わかもと製薬	1,700	235.00	399,500
日本新薬	4,400	7,870.00	34,628,000
中外製薬	58,400	3,614.00	211,057,600
科研製薬	3,200	3,855.00	12,336,000
エーザイ	22,700	9,580.00	217,466,000
ロート製薬	9,000	4,465.00	40,185,000
小野薬品工業	36,000	3,423.00	123,228,000
久光製薬	4,100	3,860.00	15,826,000
持田製薬	2,200	3,360.00	7,392,000
参天製薬	35,100	1,135.00	39,838,500
扶桑薬品工業	600	1,993.00	1,195,800
日本ケミファ	200	1,670.00	334,000
ツムラ	5,900	2,964.00	17,487,600
日医工	5,500	110.00	605,000
キッセイ薬品工業	2,900	2,502.00	7,255,800
生化学工業	3,600	949.00	3,416,400
栄研化学	3,000	1,854.00	5,562,000
鳥居薬品	1,000	2,850.00	2,850,000
JCRファーマ	6,300	1,885.00	11,875,500
東和薬品	2,900	2,119.00	6,145,100
富士製薬工業	1,200	997.00	1,196,400
ゼリア新薬工業	2,600	2,246.00	5,839,600
第一三共	162,600	4,373.00	711,049,800
キョーリン製薬ホールディングス	4,000	1,729.00	6,916,000
大幸薬品	3,400	465.00	1,581,000
ダイト	1,400	2,474.00	3,463,600
大塚ホールディングス	42,700	4,561.00	194,754,700
大正製薬ホールディングス	4,100	5,410.00	22,181,000
ペプチドリーム	9,000	1,692.00	15,228,000
あすか製薬ホールディングス	1,900	1,225.00	2,327,500
サワイグループホールディングス	4,300	4,090.00	17,587,000

日本コークス工業	16,800	90.00	1,512,000	
ニチレキ	2,200	1,251.00	2,752,200	
ユシロ化学工業	1,000	814.00	814,000	
ピーピー・カストロール	700	933.00	653,100	
富士石油	3,800	252.00	957,600	
MORESCO	600	1,137.00	682,200	
出光興産	20,700	3,075.00	63,652,500	
ENEOSホールディングス	337,200	446.10	150,424,920	
コスモエネルギーホールディングス	7,100	3,855.00	27,370,500	
横浜ゴム	10,600	2,220.00	23,532,000	
TOYO TIRE	10,700	1,556.00	16,649,200	
ブリヂストン	59,600	5,061.00	301,635,600	
住友ゴム工業	18,300	1,174.00	21,484,200	
藤倉コンポジット	1,300	823.00	1,069,900	
オカモト	1,000	3,730.00	3,730,000	
フコク	1,000	1,068.00	1,068,000	
ニッタ	1,900	2,910.00	5,529,000	
住友理工	3,600	588.00	2,116,800	
三ツ星ベルト	2,700	3,395.00	9,166,500	
バンドー化学	3,000	991.00	2,973,000	
日東紡績	2,200	2,036.00	4,479,200	
A G C	19,000	4,575.00	86,925,000	
日本板硝子	9,500	612.00	5,814,000	
石塚硝子	300	1,443.00	432,900	
日本山村硝子	700	574.00	401,800	
日本電気硝子	7,600	2,504.00	19,030,400	
オハラ	900	1,207.00	1,086,300	
住友大阪セメント	2,600	3,150.00	8,190,000	
太平洋セメント	11,900	2,082.00	24,775,800	
日本ヒューム	1,600	643.00	1,028,800	
日本コンクリート工業	3,600	226.00	813,600	
三谷セキサン	800	3,975.00	3,180,000	
アジアパイルホールディングス	2,900	523.00	1,516,700	
東海カーボン	15,700	1,135.00	17,819,500	
日本カーボン	1,100	4,360.00	4,796,000	
東洋炭素	1,200	3,945.00	4,734,000	

ノリタケカンパニーリミテド	900	4,005.00	3,604,500	
TOTO	12,300	4,830.00	59,409,000	
日本碍子	22,100	1,794.00	39,647,400	
日本特殊陶業	14,200	2,561.00	36,366,200	
ダントーホールディングス	1,300	240.00	312,000	
MARUWA	700	17,520.00	12,264,000	
品川リフラクトリーズ	500	3,885.00	1,942,500	
黒崎播磨	400	4,870.00	1,948,000	
ヨータイ	1,200	1,398.00	1,677,600	
東京窯業	1,700	265.00	450,500	
ニッカトー	800	482.00	385,600	
フジインコーポレーテッド	1,500	7,330.00	10,995,000	
クニミネ工業	500	862.00	431,000	
エーアンドエーマテリアル	300	869.00	260,700	
ニチアス	4,700	2,431.00	11,425,700	
ニチハ	2,300	2,719.00	6,253,700	
日本製鉄	86,000	2,241.00	192,726,000	
神戸製鋼所	38,600	616.00	23,777,600	
中山製鋼所	4,000	736.00	2,944,000	
合同製鐵	1,000	1,950.00	1,950,000	
JFEホールディングス	51,300	1,551.00	79,566,300	
東京製鐵	5,400	1,273.00	6,874,200	
共英製鋼	2,200	1,226.00	2,697,200	
大和工業	3,200	4,570.00	14,624,000	
東京鐵鋼	900	1,398.00	1,258,200	
大阪製鐵	900	1,078.00	970,200	
淀川製鋼所	2,200	2,497.00	5,493,400	
丸一鋼管	5,800	2,777.00	16,106,600	
モリ工業	400	2,764.00	1,105,600	
大同特殊鋼	2,400	4,420.00	10,608,000	
日本高周波鋼業	600	313.00	187,800	
日本冶金工業	1,400	4,265.00	5,971,000	
山陽特殊製鋼	1,900	2,150.00	4,085,000	
愛知製鋼	1,100	2,208.00	2,428,800	
日立金属	8,900	2,178.00	19,384,200	
日本金属	400	942.00	376,800	

大平洋金属	1,400	2,041.00	2,857,400	
新日本電工	12,300	385.00	4,735,500	
栗本鐵工所	900	1,752.00	1,576,800	
虹技	200	910.00	182,000	
日本鑄鉄管	200	931.00	186,200	
三菱製鋼	1,200	1,007.00	1,208,400	
日亜鋼業	1,900	233.00	442,700	
日本精線	300	4,250.00	1,275,000	
エンビプロ・ホールディングス	1,300	714.00	928,200	
シンニッタン	2,000	222.00	444,000	
新家工業	400	2,172.00	868,800	
大紀アルミニウム工業所	2,700	1,294.00	3,493,800	
日本軽金属ホールディングス	5,200	1,543.00	8,023,600	
三井金属鉱業	5,600	3,180.00	17,808,000	
東邦亜鉛	1,100	2,192.00	2,411,200	
三菱マテリアル	12,800	2,231.00	28,556,800	
住友金属鉱山	22,300	4,799.00	107,017,700	
D O W Aホールディングス	4,300	4,380.00	18,834,000	
古河機械金属	2,800	1,287.00	3,603,600	
エス・サイエンス	10,800	26.00	280,800	
大阪チタニウムテクノロジーズ	2,800	4,195.00	11,746,000	
東邦チタニウム	3,500	2,814.00	9,849,000	
U A C J	2,700	2,307.00	6,228,900	
C Kサンエツ	500	4,075.00	2,037,500	
古河電気工業	6,400	2,634.00	16,857,600	
住友電気工業	66,300	1,580.00	104,754,000	
フジクラ	20,600	1,122.00	23,113,200	
昭和電線ホールディングス	2,100	1,775.00	3,727,500	
東京特殊電線	200	5,650.00	1,130,000	
タツタ電線	3,900	426.00	1,661,400	
カナレ電気	300	1,490.00	447,000	
平河ヒューテック	1,100	1,137.00	1,250,700	
リョービ	2,000	1,204.00	2,408,000	
アーレスティ	2,100	417.00	875,700	
アサヒホールディングス	7,800	2,004.00	15,631,200	
稲葉製作所	1,100	1,402.00	1,542,200	

宮地エンジニアリンググループ	500	3,430.00	1,715,000	
トーカロ	5,300	1,200.00	6,360,000	
アルファC o	700	937.00	655,900	
SUMCO	36,600	2,001.00	73,236,600	
川田テクノロジーズ	500	3,370.00	1,685,000	
RS Technologies	600	8,570.00	5,142,000	
ジェイテックコーポレーション	300	2,350.00	705,000	
信和	1,100	783.00	861,300	
東洋製罐グループホールディングス	12,700	1,607.00	20,408,900	
ホッカンホールディングス	1,000	1,304.00	1,304,000	
コロナ	1,100	869.00	955,900	
横河ブリッジホールディングス	2,500	1,880.00	4,700,000	
駒井ハルテック	300	1,610.00	483,000	
高田機工	200	2,431.00	486,200	
三和ホールディングス	17,700	1,259.00	22,284,300	
文化シャッター	5,500	1,089.00	5,989,500	
三協立山	2,600	551.00	1,432,600	
アルインコ	1,500	1,010.00	1,515,000	
東洋シャッター	400	489.00	195,600	
LIXIL	28,000	2,065.00	57,820,000	
日本フィルコン	1,200	451.00	541,200	
ノーリツ	2,800	1,491.00	4,174,800	
長府製作所	1,900	1,956.00	3,716,400	
リンナイ	3,500	10,100.00	35,350,000	
ダイニチ工業	1,000	670.00	670,000	
日東精工	2,800	518.00	1,450,400	
三洋工業	200	1,732.00	346,400	
岡部	3,100	715.00	2,216,500	
ジーテクト	2,100	1,455.00	3,055,500	
東プレ	3,400	1,198.00	4,073,200	
高周波熱錬	3,100	678.00	2,101,800	
東京製綱	1,100	846.00	930,600	
サンコール	1,700	629.00	1,069,300	
モリテック スチール	1,400	235.00	329,000	
パイオラックス	2,600	1,680.00	4,368,000	
エイチワン	2,000	622.00	1,244,000	

日本発條	17,000	892.00	15,164,000
中央発條	1,100	720.00	792,000
アドバネクス	200	1,126.00	225,200
立川ブラインド工業	900	1,123.00	1,010,700
三益半導体工業	1,700	2,564.00	4,358,800
日本ドライケミカル	400	1,515.00	606,000
日本製鋼所	5,200	2,850.00	14,820,000
三浦工業	7,800	3,205.00	24,999,000
タクマ	5,800	1,275.00	7,395,000
ツガミ	4,200	1,255.00	5,271,000
オークマ	1,900	5,040.00	9,576,000
芝浦機械	2,100	2,608.00	5,476,800
アマダ	30,000	1,073.00	32,190,000
アイダエンジニアリング	3,900	804.00	3,135,600
TAKISAWA	500	1,080.00	540,000
FUJI	8,200	2,088.00	17,121,600
牧野フライス製作所	2,100	4,505.00	9,460,500
オーエスジー	9,000	1,961.00	17,649,000
ダイジェット工業	200	820.00	164,000
旭ダイヤモンド工業	5,400	691.00	3,731,400
D M G 森精機	11,400	1,775.00	20,235,000
ソディック	5,200	749.00	3,894,800
ディスコ	3,000	40,650.00	121,950,000
日東工器	900	1,519.00	1,367,100
日進工具	1,600	1,085.00	1,736,000
パンチ工業	1,600	410.00	656,000
富士ダイス	900	596.00	536,400
豊和工業	1,000	918.00	918,000
ニデックオーケーケー	800	971.00	776,800
石川製作所	500	1,487.00	743,500
東洋機械金属	1,300	550.00	715,000
津田駒工業	300	593.00	177,900
エンシュウ	400	691.00	276,400
島精機製作所	3,000	1,987.00	5,961,000
オプトラン	2,800	2,461.00	6,890,800
N C ホールディングス	400	2,019.00	807,600

イワキポンプ	1,300	1,244.00	1,617,200	
フリー	2,000	1,207.00	2,414,000	
ヤマシンフィルタ	4,500	495.00	2,227,500	
日阪製作所	1,800	816.00	1,468,800	
やまびこ	3,100	1,132.00	3,509,200	
野村マイクロ・サイエンス	600	4,625.00	2,775,000	
平田機工	900	5,480.00	4,932,000	
ペガサスマシン製造	2,100	892.00	1,873,200	
マルマエ	900	1,798.00	1,618,200	
タツモ	1,000	1,658.00	1,658,000	
ナブテスコ	11,800	3,495.00	41,241,000	
三井海洋開発	2,400	1,390.00	3,336,000	
レオン自動機	2,000	1,115.00	2,230,000	
S M C	6,100	62,610.00	381,921,000	
ホソカワミクロン	1,400	2,836.00	3,970,400	
ユニオンツール	800	3,575.00	2,860,000	
オイレス工業	2,600	1,463.00	3,803,800	
日精エー・エス・ピー機械	900	4,750.00	4,275,000	
サトーホールディングス	2,700	1,876.00	5,065,200	
技研製作所	2,000	3,145.00	6,290,000	
日本エアーテック	900	1,222.00	1,099,800	
カワタ	500	838.00	419,000	
日精樹脂工業	1,400	973.00	1,362,200	
オカダアイヨン	600	1,522.00	913,200	
ワイエイシイホールディングス	800	1,627.00	1,301,600	
小松製作所	88,100	3,107.00	273,726,700	
住友重機械工業	11,100	2,880.00	31,968,000	
日立建機	7,500	3,120.00	23,400,000	
日工	2,800	611.00	1,710,800	
巴工業	800	2,385.00	1,908,000	
井関農機	1,800	1,234.00	2,221,200	
T O W A	1,900	1,945.00	3,695,500	
丸山製作所	300	1,547.00	464,100	
北川鉄工所	700	1,200.00	840,000	
ローツェ	1,000	8,290.00	8,290,000	
タカキタ	500	466.00	233,000	

クボタ	99,500	2,004.00	199,398,000	
荏原実業	900	2,313.00	2,081,700	
三菱化工機	600	2,040.00	1,224,000	
月島機械	2,500	958.00	2,395,000	
帝国電機製作所	1,400	2,274.00	3,183,600	
東京機械製作所	400	576.00	230,400	
新東工業	3,800	654.00	2,485,200	
澁谷工業	1,800	2,446.00	4,402,800	
アイチ コーポレーション	2,700	773.00	2,087,100	
小森コーポレーション	4,400	812.00	3,572,800	
鶴見製作所	1,400	1,967.00	2,753,800	
住友精密工業	200	3,645.00	729,000	
日本ギア工業	600	320.00	192,000	
酒井重工業	300	3,515.00	1,054,500	
荏原製作所	7,700	5,120.00	39,424,000	
石井鐵工所	200	2,460.00	492,000	
西島製作所	1,600	1,548.00	2,476,800	
北越工業	1,900	1,159.00	2,202,100	
ダイキン工業	22,400	21,980.00	492,352,000	
オルガノ	2,600	2,962.00	7,701,200	
トーヨーカネツ	700	2,491.00	1,743,700	
栗田工業	10,500	5,840.00	61,320,000	
榑本チエイン	2,700	3,040.00	8,208,000	
大同工業	800	738.00	590,400	
木村化工機	1,400	724.00	1,013,600	
アネスト岩田	3,200	900.00	2,880,000	
ダイフク	9,700	6,860.00	66,542,000	
サムコ	600	3,735.00	2,241,000	
加藤製作所	900	752.00	676,800	
油研工業	300	1,806.00	541,800	
タダノ	9,900	967.00	9,573,300	
フジテック	6,900	3,300.00	22,770,000	
C K D	5,200	2,017.00	10,488,400	
キトー	600	2,718.00	1,630,800	
平和	6,300	2,427.00	15,290,100	
理想科学工業	1,700	2,223.00	3,779,100	

SANKYO	3,700	5,300.00	19,610,000	
日本金銭機械	2,100	1,164.00	2,444,400	
マースグループホールディングス	1,100	2,306.00	2,536,600	
フクシマガリレイ	1,400	4,295.00	6,013,000	
オーイズミ	700	417.00	291,900	
ダイコク電機	1,000	1,795.00	1,795,000	
竹内製作所	3,400	2,978.00	10,125,200	
アマノ	5,300	2,407.00	12,757,100	
JUKI	2,900	673.00	1,951,700	
サンデン	2,800	217.00	607,600	
ジャノメ	1,900	602.00	1,143,800	
マックス	2,300	1,992.00	4,581,600	
グローリー	4,900	2,231.00	10,931,900	
新晃工業	1,900	1,477.00	2,806,300	
大和冷機工業	2,900	1,155.00	3,349,500	
セガサミーホールディングス	15,100	1,831.00	27,648,100	
日本ピストンリング	600	1,203.00	721,800	
リケン	700	2,228.00	1,559,600	
TPR	2,200	1,203.00	2,646,600	
ツバキ・ナカシマ	4,600	1,013.00	4,659,800	
ホシザキ	12,100	4,585.00	55,478,500	
大豊工業	1,600	667.00	1,067,200	
日本精工	34,500	728.00	25,116,000	
NTN	37,000	283.00	10,471,000	
ジェイテクト	16,700	953.00	15,915,100	
不二越	1,400	3,795.00	5,313,000	
日本トムソン	4,600	579.00	2,663,400	
THK	10,800	2,658.00	28,706,400	
ユーシン精機	1,500	670.00	1,005,000	
前澤給装工業	1,300	991.00	1,288,300	
イーグル工業	2,100	1,048.00	2,200,800	
前澤工業	1,200	601.00	721,200	
日本ピラー工業	1,700	2,854.00	4,851,800	
キッツ	6,900	819.00	5,651,100	
マキタ	23,400	3,155.00	73,827,000	
三井E&Sホールディングス	8,500	394.00	3,349,000	

日立造船	15,400	828.00	12,751,200
三菱重工業	32,900	5,436.00	178,844,400
I H I	11,800	3,870.00	45,666,000
サノヤスホールディングス	2,400	127.00	304,800
スター精密	3,500	1,726.00	6,041,000
日清紡ホールディングス	15,300	977.00	14,948,100
イビデン	10,800	5,530.00	59,724,000
コニカミノルタ	42,000	557.00	23,394,000
ブラザー工業	25,100	2,100.00	52,710,000
ミネベアミツミ	32,700	2,202.00	72,005,400
日立製作所	94,400	7,051.00	665,614,400
東芝	36,200	4,642.00	168,040,400
三菱電機	194,200	1,364.50	264,985,900
富士電機	11,400	5,580.00	63,612,000
東洋電機製造	700	863.00	604,100
安川電機	22,300	4,625.00	103,137,500
シンフォニアテクノロジー	2,100	1,470.00	3,087,000
明電舎	2,900	1,934.00	5,608,600
オリジン	400	1,245.00	498,000
山洋電気	800	6,040.00	4,832,000
デンヨー	1,400	1,544.00	2,161,600
P H Cホールディングス	2,600	1,580.00	4,108,000
ソシオネクスト	1,900	6,380.00	12,122,000
東芝テック	2,800	3,570.00	9,996,000
芝浦メカトロニクス	400	10,840.00	4,336,000
マブチモーター	4,700	3,885.00	18,259,500
日本電産	45,600	8,246.00	376,017,600
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1,400	501.00	701,400
トレックス・セミコンダクター	900	2,860.00	2,574,000
東光高岳	1,100	1,789.00	1,967,900
ダブル・スコープ	6,100	1,635.00	9,973,500
ダイヘン	1,700	4,035.00	6,859,500
ヤーマン	3,700	1,347.00	4,983,900
J V Cケンウッド	17,100	417.00	7,130,700
ミマキエンジニアリング	1,800	641.00	1,153,800
I - P E X	1,000	1,288.00	1,288,000

日新電機	4,500	1,292.00	5,814,000	
大崎電気工業	4,500	531.00	2,389,500	
オムロン	17,200	6,988.00	120,193,600	
日東工業	2,500	2,303.00	5,757,500	
I D E C	2,800	3,145.00	8,806,000	
正興電機製作所	700	1,003.00	702,100	
不二電機工業	400	1,127.00	450,800	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	6,200	2,094.00	12,982,800	
サクサホールディングス	400	1,271.00	508,400	
メルコホールディングス	500	3,035.00	1,517,500	
テクノメディカ	500	1,704.00	852,000	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	600	1,557.00	934,200	
日本電気	26,600	4,660.00	123,956,000	
富士通	18,700	18,495.00	345,856,500	
沖電気工業	8,500	708.00	6,018,000	
岩崎通信機	800	767.00	613,600	
電気興業	900	2,053.00	1,847,700	
サンケン電気	1,700	6,930.00	11,781,000	
ナカヨ	300	1,073.00	321,900	
アイホン	1,100	1,873.00	2,060,300	
ルネサスエレクトロニクス	122,600	1,295.50	158,828,300	
セイコーエプソン	25,000	2,091.00	52,275,000	
ワコム	14,900	631.00	9,401,900	
アルバック	4,500	6,090.00	27,405,000	
アクセル	700	1,514.00	1,059,800	
E I Z O	1,400	3,370.00	4,718,000	
ジャパンディスプレイ	71,900	46.00	3,307,400	
日本信号	4,300	1,022.00	4,394,600	
京三製作所	3,900	416.00	1,622,400	
能美防災	2,500	1,563.00	3,907,500	
ホーチキ	1,400	1,416.00	1,982,400	
星和電機	700	447.00	312,900	
エレコム	4,500	1,424.00	6,408,000	
パナソニック ホールディングス	222,000	1,222.00	271,284,000	
シャープ	22,600	1,041.00	23,526,600	

アンリツ	13,200	1,434.00	18,928,800
富士通ゼネラル	5,300	3,170.00	16,801,000
ソニーグループ	131,600	10,875.00	1,431,150,000
T D K	29,800	4,775.00	142,295,000
帝国通信工業	800	1,379.00	1,103,200
タムラ製作所	8,100	809.00	6,552,900
アルプスアルパイン	16,800	1,305.00	21,924,000
池上通信機	600	536.00	321,600
日本電波工業	2,300	1,818.00	4,181,400
鈴木	1,100	901.00	991,100
メイコー	2,100	2,938.00	6,169,800
日本トリム	400	2,470.00	988,000
ローランド ディー . ジー .	1,100	3,035.00	3,338,500
フォスター電機	1,700	910.00	1,547,000
S M K	500	2,360.00	1,180,000
ヨコオ	1,500	2,437.00	3,655,500
ティアック	2,900	121.00	350,900
ホシデン	4,500	1,575.00	7,087,500
ヒロセ電機	3,100	17,770.00	55,087,000
日本航空電子工業	3,900	2,262.00	8,821,800
T O A	2,200	779.00	1,713,800
マクセル	4,100	1,415.00	5,801,500
古野電気	2,400	1,012.00	2,428,800
スミダコーポレーション	1,700	1,531.00	2,602,700
アイコム	700	2,800.00	1,960,000
リオン	800	1,925.00	1,540,000
横河電機	20,600	2,421.00	49,872,600
新電元工業	700	3,150.00	2,205,000
アズビル	13,000	3,840.00	49,920,000
東亜ディーケーケー	900	824.00	741,600
日本光電工業	8,600	3,160.00	27,176,000
チノー	800	1,798.00	1,438,400
共和電業	1,800	368.00	662,400
日本電子材料	1,200	1,497.00	1,796,400
堀場製作所	4,100	6,240.00	25,584,000
アドバンテスト	14,700	9,810.00	144,207,000

小野測器	700	399.00	279,300
エスペック	1,500	1,974.00	2,961,000
キーエンス	18,600	55,950.00	1,040,670,000
日置電機	1,000	6,640.00	6,640,000
シスメックス	16,000	8,879.00	142,064,000
日本マイクロニクス	3,100	1,426.00	4,420,600
メガチップス	1,500	2,580.00	3,870,000
O B A R A G R O U P	900	3,520.00	3,168,000
澤藤電機	200	1,141.00	228,200
原田工業	800	842.00	673,600
コーセル	2,500	900.00	2,250,000
イリソ電子工業	1,700	4,485.00	7,624,500
オブテックスグループ	3,400	2,032.00	6,908,800
千代田インテグレ	800	2,379.00	1,903,200
レーザーテック	9,200	25,910.00	238,372,000
スタンレー電気	13,200	2,759.00	36,418,800
岩崎電気	600	2,420.00	1,452,000
ウシオ電機	9,700	1,791.00	17,372,700
岡谷電機産業	1,400	270.00	378,000
ヘリオス テクノ ホールディング	1,700	417.00	708,900
エノモト	500	1,879.00	939,500
日本セラミック	1,900	2,596.00	4,932,400
遠藤照明	800	724.00	579,200
古河電池	1,400	1,108.00	1,551,200
双信電機	700	401.00	280,700
山一電機	1,600	1,751.00	2,801,600
図研	1,600	3,210.00	5,136,000
日本電子	4,700	4,265.00	20,045,500
カシオ計算機	13,900	1,348.00	18,737,200
ファナック	18,300	21,080.00	385,764,000
日本シイエムケイ	4,000	526.00	2,104,000
エンプラス	500	4,405.00	2,202,500
大真空	2,300	791.00	1,819,300
ローム	8,600	10,640.00	91,504,000
浜松ホトニクス	14,900	7,070.00	105,343,000
三井ハイテック	1,900	7,220.00	13,718,000

新光電気工業	6,600	3,770.00	24,882,000	
京セラ	28,900	6,892.00	199,178,800	
太陽誘電	9,100	4,355.00	39,630,500	
村田製作所	56,400	7,354.00	414,765,600	
双葉電子工業	3,500	567.00	1,984,500	
北陸電気工業	700	1,259.00	881,300	
ニチコン	3,800	1,331.00	5,057,800	
日本ケミコン	1,800	1,730.00	3,114,000	
K O A	2,800	2,046.00	5,728,800	
市光工業	2,700	391.00	1,055,700	
小糸製作所	22,400	2,073.00	46,435,200	
ミツバ	3,500	474.00	1,659,000	
S C R E E Nホールディングス	3,200	9,230.00	29,536,000	
キャノン電子	2,100	1,566.00	3,288,600	
キャノン	102,100	3,105.00	317,020,500	
リコー	46,700	1,050.00	49,035,000	
象印マホービン	5,600	1,671.00	9,357,600	
M U T O Hホールディングス	300	1,697.00	509,100	
東京エレクトロン	13,100	45,250.00	592,775,000	
イノテック	1,200	1,270.00	1,524,000	
トヨタ紡織	7,800	1,823.00	14,219,400	
芦森工業	300	1,253.00	375,900	
ユニプレス	3,300	807.00	2,663,100	
豊田自動織機	13,600	7,620.00	103,632,000	
モリタホールディングス	3,300	1,137.00	3,752,100	
三櫻工業	2,800	635.00	1,778,000	
デンソー	38,400	7,255.00	278,592,000	
東海理化電機製作所	5,200	1,466.00	7,623,200	
川崎重工業	14,000	3,095.00	43,330,000	
名村造船所	4,800	449.00	2,155,200	
日本車輛製造	700	1,932.00	1,352,400	
三菱ロジスネクスト	3,000	840.00	2,520,000	
近畿車輛	300	1,053.00	315,900	
日産自動車	264,300	462.00	122,106,600	
いすゞ自動車	54,100	1,696.00	91,753,600	
トヨタ自動車	1,021,700	1,963.00	2,005,597,100	

日野自動車	23,700	594.00	14,077,800
三菱自動車工業	72,600	591.00	42,906,600
エフテック	1,300	514.00	668,200
レシップホールディングス	700	480.00	336,000
G M B	400	746.00	298,400
ファルテック	300	600.00	180,000
武蔵精密工業	4,500	1,686.00	7,587,000
日産車体	3,300	807.00	2,663,100
新明和工業	5,800	1,018.00	5,904,400
極東開発工業	3,300	1,351.00	4,458,300
トビー工業	1,500	1,622.00	2,433,000
ティラド	500	2,499.00	1,249,500
曙ブレーキ工業	11,300	161.00	1,819,300
タチエス	2,900	1,049.00	3,042,100
N O K	7,200	1,225.00	8,820,000
フタバ産業	5,000	359.00	1,795,000
K Y B	1,800	3,365.00	6,057,000
大同メタル工業	3,600	486.00	1,749,600
プレス工業	8,300	427.00	3,544,100
ミクニ	2,100	342.00	718,200
太平洋工業	4,300	1,066.00	4,583,800
河西工業	2,400	158.00	379,200
アイシン	14,400	3,660.00	52,704,000
マツダ	61,500	1,065.00	65,497,500
今仙電機製作所	1,200	675.00	810,000
本田技研工業	151,300	3,261.00	493,389,300
スズキ	34,200	4,655.00	159,201,000
S U B A R U	58,900	2,230.00	131,347,000
安永	800	689.00	551,200
ヤマハ発動機	29,200	3,325.00	97,090,000
T B K	1,800	250.00	450,000
エクセディ	3,000	1,616.00	4,848,000
豊田合成	5,400	2,110.00	11,394,000
愛三工業	3,100	696.00	2,157,600
盟和産業	300	917.00	275,100
日本プラスト	1,500	410.00	615,000

ヨロズ	1,700	742.00	1,261,400
エフ・シー・シー	3,300	1,383.00	4,563,900
シマノ	7,600	23,375.00	177,650,000
テイ・エス テック	8,500	1,578.00	13,413,000
ジャムコ	1,000	1,533.00	1,533,000
テルモ	58,100	3,997.00	232,225,700
クリエートメディック	600	896.00	537,600
日機装	4,700	1,006.00	4,728,200
日本エム・ディ・エム	1,100	981.00	1,079,100
島津製作所	22,700	4,050.00	91,935,000
JMS	1,700	505.00	858,500
クボテック	400	216.00	86,400
長野計器	1,400	1,126.00	1,576,400
ブイ・テクノロジー	900	2,666.00	2,399,400
東京計器	1,400	1,328.00	1,859,200
愛知時計電機	700	1,323.00	926,100
インターアクション	1,100	1,527.00	1,679,700
オーバル	1,600	500.00	800,000
東京精密	4,100	4,405.00	18,060,500
マニー	8,200	2,206.00	18,089,200
ニコン	28,900	1,236.00	35,720,400
トプコン	9,800	1,601.00	15,689,800
オリンパス	116,300	2,669.50	310,462,850
理研計器	1,200	4,970.00	5,964,000
タムロン	1,400	3,280.00	4,592,000
HOYA	40,200	13,795.00	554,559,000
シード	900	495.00	445,500
ノーリツ鋼機	1,800	2,730.00	4,914,000
A & D ホロンホールディングス	2,700	1,079.00	2,913,300
朝日インテック	24,600	2,544.00	62,582,400
シチズン時計	20,500	583.00	11,951,500
リズム	600	1,725.00	1,035,000
大研医器	1,400	452.00	632,800
メニコン	6,400	2,948.00	18,867,200
シンシア	200	553.00	110,600
松風	800	2,342.00	1,873,600

セイコーグループ	2,900	3,030.00	8,787,000
ニプロ	15,500	1,019.00	15,794,500
KYORITSU	2,600	121.00	314,600
中本パックス	600	1,559.00	935,400
スノーピーク	3,200	2,406.00	7,699,200
パラマウントベッドホールディングス	4,300	2,570.00	11,051,000
トランザクション	1,400	1,228.00	1,719,200
粧美堂	500	356.00	178,000
ニホンフラッシュ	1,700	900.00	1,530,000
前田工織	2,000	3,180.00	6,360,000
永大産業	1,900	225.00	427,500
アートネイチャー	1,900	780.00	1,482,000
バンダイナムコホールディングス	17,000	8,952.00	152,184,000
アイフィスジャパン	500	612.00	306,000
SHOEI	2,000	5,540.00	11,080,000
フランスベッドホールディングス	2,300	934.00	2,148,200
パイロットコーポレーション	2,900	4,845.00	14,050,500
萩原工業	1,200	1,101.00	1,321,200
フジシールインターナショナル	3,800	1,782.00	6,771,600
タカラトミー	8,600	1,242.00	10,681,200
広済堂ホールディングス	1,300	1,958.00	2,545,400
エステールホールディングス	400	631.00	252,400
タカノ	700	672.00	470,400
プロネクサス	1,500	952.00	1,428,000
ホクシン	1,300	157.00	204,100
ウッドワン	600	888.00	532,800
大建工業	1,100	2,130.00	2,343,000
凸版印刷	24,300	2,040.00	49,572,000
大日本印刷	22,100	2,710.00	59,891,000
共同印刷	500	2,811.00	1,405,500
NISSHA	3,500	1,870.00	6,545,000
光村印刷	200	1,175.00	235,000
TAKARA & COMPANY	1,300	2,107.00	2,739,100
アシックス	17,200	3,075.00	52,890,000
ツツミ	400	1,921.00	768,400
ローランド	1,400	3,855.00	5,397,000

小松ウオール工業	700	1,831.00	1,281,700	
ヤマハ	11,700	5,480.00	64,116,000	
河合楽器製作所	500	2,566.00	1,283,000	
クリナップ	2,100	674.00	1,415,400	
ピジョン	11,900	2,239.00	26,644,100	
兼松サステック	100	1,585.00	158,500	
キングジム	1,600	906.00	1,449,600	
リンテック	3,700	2,169.00	8,025,300	
イトーキ	3,800	544.00	2,067,200	
任天堂	117,500	5,684.00	667,870,000	
三菱鉛筆	2,600	1,394.00	3,624,400	
タカラスタANDARD	3,600	1,315.00	4,734,000	
コクヨ	9,000	1,812.00	16,308,000	
ナカバヤシ	2,000	485.00	970,000	
グローブライド	1,500	2,698.00	4,047,000	
オカムラ	5,600	1,368.00	7,660,800	
美津濃	1,800	2,890.00	5,202,000	
東京電力ホールディングス	167,700	510.00	85,527,000	
中部電力	68,600	1,284.00	88,082,400	
関西電力	71,900	1,166.00	83,835,400	
中国電力	29,600	656.00	19,417,600	
北陸電力	17,600	541.00	9,521,600	
東北電力	45,500	643.00	29,256,500	
四国電力	15,900	713.00	11,336,700	
九州電力	42,900	705.00	30,244,500	
北海道電力	18,000	441.00	7,938,000	
沖縄電力	4,400	1,020.00	4,488,000	
電源開発	14,000	2,086.00	29,204,000	
エフオン	1,400	523.00	732,200	
イーレックス	3,300	2,480.00	8,184,000	
レノバ	4,900	2,637.00	12,921,300	
東京瓦斯	39,300	2,598.00	102,101,400	
大阪瓦斯	37,700	2,152.00	81,130,400	
東邦瓦斯	7,300	2,669.00	19,483,700	
北海道瓦斯	1,100	1,640.00	1,804,000	
広島ガス	3,900	339.00	1,322,100	

西部ガスホールディングス	1,700	1,680.00	2,856,000	
静岡ガス	4,200	1,118.00	4,695,600	
メタウォーター	2,300	1,737.00	3,995,100	
SBSホールディングス	1,700	2,863.00	4,867,100	
東武鉄道	20,400	3,180.00	64,872,000	
相鉄ホールディングス	6,100	2,163.00	13,194,300	
東急	52,200	1,713.00	89,418,600	
京浜急行電鉄	21,100	1,354.00	28,569,400	
小田急電鉄	28,200	1,744.00	49,180,800	
京王電鉄	9,800	4,940.00	48,412,000	
京成電鉄	12,000	3,850.00	46,200,000	
富士急行	2,300	4,970.00	11,431,000	
東日本旅客鉄道	31,600	7,783.00	245,942,800	
西日本旅客鉄道	23,800	5,742.00	136,659,600	
東海旅客鉄道	14,300	16,380.00	234,234,000	
西武ホールディングス	22,500	1,416.00	31,860,000	
鴻池運輸	3,200	1,581.00	5,059,200	
西日本鉄道	5,000	2,642.00	13,210,000	
ハマキョウレックス	1,500	3,340.00	5,010,000	
サカイ引越センター	900	4,495.00	4,045,500	
近鉄グループホールディングス	18,600	4,505.00	83,793,000	
阪急阪神ホールディングス	24,800	4,120.00	102,176,000	
南海電気鉄道	8,900	2,927.00	26,050,300	
京阪ホールディングス	7,700	3,460.00	26,642,000	
神戸電鉄	500	3,225.00	1,612,500	
名古屋鉄道	20,500	2,182.00	44,731,000	
山陽電気鉄道	1,400	2,120.00	2,968,000	
アルプス物流	1,500	1,149.00	1,723,500	
ヤマトホールディングス	23,800	2,319.00	55,192,200	
山九	4,700	4,915.00	23,100,500	
丸運	900	217.00	195,300	
丸全昭和運輸	1,100	3,060.00	3,366,000	
センコーグループホールディングス	9,800	982.00	9,623,600	
トナミホールディングス	400	3,775.00	1,510,000	
ニッコンホールディングス	5,900	2,374.00	14,006,600	
日本石油輸送	200	2,209.00	441,800	

福山通運	1,600	3,345.00	5,352,000
セイノーホールディングス	11,600	1,202.00	13,943,200
エスライン	500	795.00	397,500
神奈川中央交通	500	3,330.00	1,665,000
日立物流	4,100	8,880.00	36,408,000
A Z - C O M丸和ホールディングス	4,500	1,509.00	6,790,500
C & F ロジホールディングス	1,800	1,198.00	2,156,400
九州旅客鉄道	13,100	2,966.00	38,854,600
S Gホールディングス	35,600	2,025.00	72,090,000
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	6,900	8,040.00	55,476,000
日本郵船	49,700	3,076.00	152,877,200
商船三井	32,700	3,315.00	108,400,500
川崎汽船	15,800	2,554.00	40,353,200
N Sユナイテッド海運	1,000	3,875.00	3,875,000
明治海運	1,800	729.00	1,312,200
飯野海運	6,800	946.00	6,432,800
共栄タンカー	300	932.00	279,600
乾汽船	2,400	1,935.00	4,644,000
日本航空	45,600	2,741.00	124,989,600
A N Aホールディングス	50,500	2,903.50	146,626,750
パスコ	400	1,331.00	532,400
トランコム	500	7,650.00	3,825,000
日新	1,400	1,997.00	2,795,800
三菱倉庫	4,000	3,180.00	12,720,000
三井倉庫ホールディングス	1,700	3,520.00	5,984,000
住友倉庫	5,100	1,957.00	9,980,700
澁澤倉庫	700	2,051.00	1,435,700
東陽倉庫	2,400	253.00	607,200
日本トランスシティ	3,700	510.00	1,887,000
ケイヒン	300	1,511.00	453,300
中央倉庫	900	928.00	835,200
川西倉庫	300	993.00	297,900
安田倉庫	1,300	924.00	1,201,200
ファイズホールディングス	300	945.00	283,500
東洋埠頭	500	1,277.00	638,500

上組	9,200	2,697.00	24,812,400
サンリツ	400	705.00	282,000
キムラユニティー	900	765.00	688,500
キューソー流通システム	1,100	994.00	1,093,400
東海運	1,100	279.00	306,900
エーアイティー	1,200	1,420.00	1,704,000
内外トランスライン	700	2,244.00	1,570,800
日本コンセプト	600	1,627.00	976,200
NEC ネットズエスアイ	6,200	1,617.00	10,025,400
クロスキャット	1,100	1,515.00	1,666,500
システナ	31,400	421.00	13,219,400
デジタルアーツ	1,200	6,290.00	7,548,000
日鉄ソリューションズ	3,200	3,335.00	10,672,000
キューブシステム	1,100	1,056.00	1,161,600
コア	800	1,454.00	1,163,200
手間いらず	300	5,020.00	1,506,000
ラクーンホールディングス	1,900	1,196.00	2,272,400
ソリトンシステムズ	1,000	1,081.00	1,081,000
ソフトクリエイトホールディングス	800	3,320.00	2,656,000
T I S	21,000	3,750.00	78,750,000
J N S ホールディングス	800	338.00	270,400
グリー	10,000	744.00	7,440,000
G M O ペパボ	300	2,022.00	606,600
コーエーテクモホールディングス	11,700	2,424.00	28,360,800
三菱総合研究所	900	4,915.00	4,423,500
ボルテージ	500	322.00	161,000
電算	200	1,611.00	322,200
A G S	800	669.00	535,200
ファインデックス	1,500	525.00	787,500
ブレインパッド	1,900	842.00	1,599,800
K L a b	3,700	447.00	1,653,900
ポルトウウィンホールディングス	3,200	858.00	2,745,600
ネクソン	48,200	3,030.00	146,046,000
アイスタイル	6,000	623.00	3,738,000
エムアップホールディングス	2,300	1,297.00	2,983,100
エイチーム	1,400	920.00	1,288,000

エニグモ	2,400	660.00	1,584,000
テクノスジャパン	1,500	484.00	726,000
e n i s h	1,400	403.00	564,200
コロブラ	7,200	668.00	4,809,600
オルトプラス	1,400	236.00	330,400
ブロードリーフ	10,900	439.00	4,785,100
クロス・マーケティンググループ	800	758.00	606,400
デジタルハーツホールディングス	1,200	1,928.00	2,313,600
システム情報	1,600	888.00	1,420,800
メディアドゥ	800	1,933.00	1,546,400
じげん	5,400	376.00	2,030,400
ブイキューブ	2,200	782.00	1,720,400
エンカレッジ・テクノロジー	400	511.00	204,400
サイバーリンクス	600	1,019.00	611,400
ディー・エル・イー	1,300	333.00	432,900
フィックスターズ	2,100	1,313.00	2,757,300
C A R T A H O L D I N G S	900	1,667.00	1,500,300
オブティム	1,500	1,146.00	1,719,000
セレス	700	928.00	649,600
S H I F T	1,400	28,770.00	40,278,000
ティーガイア	2,000	1,638.00	3,276,000
セック	300	2,604.00	781,200
テクマトリックス	3,400	1,724.00	5,861,600
プロシップ	800	1,510.00	1,208,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	5,700	2,130.00	12,141,000
GMOペイメントゲートウェイ	4,300	12,390.00	53,277,000
ザッパラス	700	365.00	255,500
システムリサーチ	600	2,054.00	1,232,400
インターネットイニシアティブ	10,400	2,474.00	25,729,600
さくらインターネット	2,100	515.00	1,081,500
ヴィンクス	600	1,616.00	969,600
GMOグローバルサイン・ホールディングス	600	3,890.00	2,334,000
S R A ホールディングス	1,000	3,105.00	3,105,000
システムインテグレータ	600	457.00	274,200
朝日ネット	2,000	573.00	1,146,000
e B A S E	2,600	592.00	1,539,200

アバントグループ	2,400	1,577.00	3,784,800	
アドソル日進	800	1,464.00	1,171,200	
ODKソリューションズ	400	598.00	239,200	
フリービット	1,100	1,004.00	1,104,400	
コムチュア	2,500	2,643.00	6,607,500	
サイバーコム	300	1,495.00	448,500	
アステリア	1,500	816.00	1,224,000	
アイル	1,000	2,050.00	2,050,000	
マークライنز	1,000	2,788.00	2,788,000	
メディカル・データ・ビジョン	2,800	998.00	2,794,400	
g u m i	3,100	775.00	2,402,500	
ショーケース	400	351.00	140,400	
モバイルファクトリー	400	892.00	356,800	
テラスカイ	800	2,721.00	2,176,800	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	1,000	1,953.00	1,953,000	
P C Iホールディングス	800	1,039.00	831,200	
アイビーシー	300	418.00	125,400	
ネオジャパン	600	1,001.00	600,600	
P R T I M E S	500	2,486.00	1,243,000	
ラクス	8,800	1,730.00	15,224,000	
ランドコンピュータ	500	900.00	450,000	
ダブルスタンダード	800	2,127.00	1,701,600	
オープンドア	1,300	1,848.00	2,402,400	
マイネット	600	456.00	273,600	
アカツキ	900	2,200.00	1,980,000	
ベネフィットジャパン	100	1,283.00	128,300	
U b i c o mホールディングス	600	2,120.00	1,272,000	
カナミックネットワーク	2,700	641.00	1,730,700	
ノムラシステムコーポレーション	1,600	122.00	195,200	
チェンジ	4,600	2,485.00	11,431,000	
シンクロ・フード	1,200	440.00	528,000	
オークネット	1,000	1,825.00	1,825,000	
キャピタル・アセット・プランニング	400	572.00	228,800	
セグエグループ	500	938.00	469,000	
エイトレッド	300	1,461.00	438,300	

マクロミル	4,200	1,041.00	4,372,200
ビーグリー	300	1,283.00	384,900
オロ	600	1,931.00	1,158,600
ユーザーローカル	700	1,590.00	1,113,000
テモナ	400	318.00	127,200
ニーズウェル	600	799.00	479,400
マネーフォワード	4,500	4,620.00	20,790,000
サインポスト	700	715.00	500,500
電算システムホールディングス	900	2,244.00	2,019,600
ソルクシーズ	1,500	365.00	547,500
フェイス	500	519.00	259,500
プロトコーポレーション	2,300	1,217.00	2,799,100
ハイマックス	600	1,452.00	871,200
野村総合研究所	38,300	3,245.00	124,283,500
サイバネットシステム	1,600	911.00	1,457,600
C Eホールディングス	1,000	576.00	576,000
日本システム技術	800	1,590.00	1,272,000
インテージホールディングス	2,500	1,399.00	3,497,500
東邦システムサイエンス	500	1,001.00	500,500
ソースネクスト	9,500	292.00	2,774,000
インフォコム	2,400	1,999.00	4,797,600
シンプレクス・ホールディングス	3,100	2,268.00	7,030,800
HEROZ	600	1,122.00	673,200
ラクスル	2,600	3,055.00	7,943,000
メルカリ	8,400	2,887.00	24,250,800
I P S	600	2,925.00	1,755,000
F I G	2,200	449.00	987,800
システムサポート	800	1,471.00	1,176,800
イーソル	1,200	883.00	1,059,600
アルテリア・ネットワークス	1,700	1,234.00	2,097,800
東海ソフト	300	909.00	272,700
ウイングアーク1 s t	1,900	2,250.00	4,275,000
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	500	1,641.00	820,500
サーバーワークス	400	2,567.00	1,026,800
東名	100	1,492.00	149,200

ヴィッツ	200	1,013.00	202,600
トピラシステムズ	500	918.00	459,000
Sansan	7,000	1,623.00	11,361,000
Link-U	400	941.00	376,400
ギフトィ	2,000	2,303.00	4,606,000
ベース	600	3,690.00	2,214,000
JMDC	3,100	5,040.00	15,624,000
フォーカスシステムズ	1,400	994.00	1,391,600
クレスコ	1,400	1,746.00	2,444,400
フジ・メディア・ホールディングス	17,900	1,071.00	19,170,900
オービック	6,200	20,760.00	128,712,000
ジャストシステム	2,700	3,115.00	8,410,500
TDCソフト	1,600	1,474.00	2,358,400
Zホールディングス	265,600	361.50	96,014,400
トレンドマイクロ	10,800	6,550.00	70,740,000
IDホールディングス	1,300	904.00	1,175,200
日本オラクル	3,600	8,070.00	29,052,000
アルファシステムズ	600	4,180.00	2,508,000
フューチャー	4,600	1,624.00	7,470,400
CAC Holdings	1,100	1,526.00	1,678,600
SBテクノロジー	800	1,973.00	1,578,400
トーセ	500	754.00	377,000
オービックビジネスコンサルタント	3,700	4,350.00	16,095,000
伊藤忠テクノソリューションズ	10,000	3,200.00	32,000,000
アイティフォー	2,500	827.00	2,067,500
東計電算	300	5,660.00	1,698,000
エクスネット	300	999.00	299,700
大塚商会	10,600	4,325.00	45,845,000
サイボウズ	2,600	2,441.00	6,346,600
電通国際情報サービス	2,300	4,270.00	9,821,000
ACCESS	2,200	900.00	1,980,000
デジタルガレージ	3,300	4,375.00	14,437,500
EMシステムズ	3,100	882.00	2,734,200
ウェザーニューズ	700	7,360.00	5,152,000
CIJ	1,700	918.00	1,560,600
ビジネスエンジニアリング	400	2,319.00	927,600

日本エンタープライズ	1,800	141.00	253,800
WOWOW	1,100	1,225.00	1,347,500
スカラ	1,800	745.00	1,341,000
インテリジェント ウェイブ	1,000	753.00	753,000
WOW WORLD GROUP	300	1,121.00	336,300
IMAGICA GROUP	1,600	710.00	1,136,000
ネットワンシステムズ	7,000	3,345.00	23,415,000
システムソフト	6,400	99.00	633,600
アルゴグラフィックス	1,700	3,610.00	6,137,000
マーベラス	3,000	669.00	2,007,000
エイベックス	3,200	1,546.00	4,947,200
BIPROGY	6,900	3,270.00	22,563,000
兼松エレクトロニクス	1,200	4,380.00	5,256,000
都築電気	1,000	1,289.00	1,289,000
TBSホールディングス	9,600	1,556.00	14,937,600
日本テレビホールディングス	16,500	1,039.00	17,143,500
朝日放送グループホールディングス	1,700	624.00	1,060,800
テレビ朝日ホールディングス	4,500	1,351.00	6,079,500
スカパーJ SATホールディングス	16,600	483.00	8,017,800
テレビ東京ホールディングス	1,300	1,837.00	2,388,100
日本BS放送	700	911.00	637,700
ビジョン	2,500	1,296.00	3,240,000
スマートバリュー	400	471.00	188,400
USEN-NEXT HOLDINGS	1,700	2,178.00	3,702,600
ワイヤレスゲート	800	273.00	218,400
コネクシオ	1,200	1,225.00	1,470,000
日本通信	17,200	221.00	3,801,200
クロップス	300	1,065.00	319,500
日本電信電話	239,100	3,730.00	891,843,000
KDDI	144,200	3,984.00	574,492,800
ソフトバンク	299,800	1,476.50	442,654,700
光通信	2,200	18,380.00	40,436,000
エムティーアイ	1,700	522.00	887,400
GMOインターネットグループ	6,900	2,487.00	17,160,300
ファイバーゲート	1,000	911.00	911,000
アイドママーケティングコミュニケーション	400	281.00	112,400

KADOKAWA	9,900	2,672.00	26,452,800
学研ホールディングス	3,100	963.00	2,985,300
ゼンリン	3,200	838.00	2,681,600
昭文社ホールディングス	800	290.00	232,000
インプレスホールディングス	1,600	213.00	340,800
アイネット	1,100	1,295.00	1,424,500
松竹	1,100	12,140.00	13,354,000
東宝	11,700	5,320.00	62,244,000
東映	500	18,950.00	9,475,000
エヌ・ティ・ティ・データ	58,600	2,057.00	120,540,200
ピー・シー・エー	1,100	1,300.00	1,430,000
ビジネスブレイン太田昭和	800	1,913.00	1,530,400
D T S	4,000	3,110.00	12,440,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	9,400	6,290.00	59,126,000
シーイーシー	2,600	1,531.00	3,980,600
カプコン	18,500	4,370.00	80,845,000
アイ・エス・ビー	1,000	1,290.00	1,290,000
ジャステック	1,100	1,181.00	1,299,100
S C S K	15,200	2,089.00	31,752,800
N S W	700	2,125.00	1,487,500
アイネス	1,300	1,366.00	1,775,800
T K C	3,300	3,620.00	11,946,000
富士ソフト	2,100	7,570.00	15,897,000
N S D	6,700	2,392.00	16,026,400
コナミグループ	8,000	6,220.00	49,760,000
福井コンピュータホールディングス	1,300	2,798.00	3,637,400
J B C Cホールディングス	1,400	1,917.00	2,683,800
ミロク情報サービス	1,700	1,445.00	2,456,500
ソフトバンクグループ	107,900	6,205.00	669,519,500
高千穂交易	700	2,173.00	1,521,100
オルバヘルスケアホールディングス	300	1,522.00	456,600
伊藤忠食品	400	5,120.00	2,048,000
エレマテック	1,800	1,522.00	2,739,600
あらた	1,500	4,020.00	6,030,000
トーメンデバイス	300	5,480.00	1,644,000
東京エレクトロン デバイス	700	6,810.00	4,767,000

円谷フィールズホールディングス	1,700	2,510.00	4,267,000	
双日	20,900	2,470.00	51,623,000	
アルフレッサホールディングス	19,800	1,617.00	32,016,600	
横浜冷凍	5,400	1,017.00	5,491,800	
神栄	300	801.00	240,300	
ラサ商事	900	1,023.00	920,700	
アルコニックス	2,600	1,323.00	3,439,800	
神戸物産	15,200	3,530.00	53,656,000	
ハイパー	400	507.00	202,800	
あいホールディングス	3,200	2,168.00	6,937,600	
ディーブイエックス	500	968.00	484,000	
ダイワボウホールディングス	8,000	2,010.00	16,080,000	
マクニカホールディングス	4,800	3,500.00	16,800,000	
ラクト・ジャパン	800	2,073.00	1,658,400	
グリムス	800	1,881.00	1,504,800	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,900	821.00	2,380,900	
八洲電機	1,600	1,019.00	1,630,400	
メディアスホールディングス	1,300	758.00	985,400	
レスターホールディングス	1,900	2,110.00	4,009,000	
ジューテックホールディングス	500	1,162.00	581,000	
大光	800	664.00	531,200	
OCHIホールディングス	400	1,226.00	490,400	
TOKAIホールディングス	9,700	874.00	8,477,800	
黒谷	500	585.00	292,500	
Cominix	400	725.00	290,000	
三洋貿易	2,000	1,107.00	2,214,000	
ビューティガレージ	400	2,881.00	1,152,400	
ウイン・パートナーズ	1,400	990.00	1,386,000	
ミタチ産業	500	1,128.00	564,000	
シップヘルスケアホールディングス	7,100	2,658.00	18,871,800	
明治電機工業	700	1,043.00	730,100	
デリカフーズホールディングス	800	479.00	383,200	
スターティアホールディングス	400	1,038.00	415,200	
コメダホールディングス	4,800	2,437.00	11,697,600	
ピーバンドットコム	300	522.00	156,600	
アセンテック	700	493.00	345,100	

富士興産	400	1,120.00	448,000	
協栄産業	200	1,734.00	346,800	
フルサト・マルカホールディングス	2,000	3,605.00	7,210,000	
ヤマエグループホールディングス	1,100	1,462.00	1,608,200	
小野建	1,800	1,436.00	2,584,800	
南陽	400	1,848.00	739,200	
佐鳥電機	1,200	1,261.00	1,513,200	
エコートレーディング	400	635.00	254,000	
伯東	1,100	3,860.00	4,246,000	
コンドーテック	1,500	976.00	1,464,000	
中山福	1,000	323.00	323,000	
ナガイレーベン	2,500	2,067.00	5,167,500	
三菱食品	1,800	3,140.00	5,652,000	
松田産業	1,500	2,272.00	3,408,000	
第一興商	3,800	3,950.00	15,010,000	
メディバルホールディングス	20,400	1,751.00	35,720,400	
S P K	900	1,392.00	1,252,800	
萩原電気ホールディングス	800	2,446.00	1,956,800	
アズワン	2,900	6,100.00	17,690,000	
スズデン	700	2,275.00	1,592,500	
尾家産業	500	942.00	471,000	
シモジマ	1,400	933.00	1,306,200	
ドウシシャ	2,100	1,507.00	3,164,700	
小津産業	400	1,447.00	578,800	
高速	1,000	1,792.00	1,792,000	
たけびし	700	1,511.00	1,057,700	
リックス	400	2,241.00	896,400	
丸文	1,800	891.00	1,603,800	
ハピネット	1,700	1,912.00	3,250,400	
橋本総業ホールディングス	800	995.00	796,000	
日本ライフライン	5,800	931.00	5,399,800	
タカショー	1,700	707.00	1,201,900	
I D O M	6,000	684.00	4,104,000	
進和	1,300	2,062.00	2,680,600	
エスケイジャパン	500	520.00	260,000	
ダイトロン	800	2,368.00	1,894,400	

シークス	2,800	1,425.00	3,990,000	
田中商事	600	565.00	339,000	
オーハシテクニカ	1,000	1,376.00	1,376,000	
白銅	700	2,443.00	1,710,100	
ダイコー通産	200	1,062.00	212,400	
伊藤忠商事	121,300	4,266.00	517,465,800	
丸紅	155,400	1,527.50	237,373,500	
高島	300	2,866.00	859,800	
長瀬産業	9,300	2,012.00	18,711,600	
蝶理	1,100	1,977.00	2,174,700	
豊田通商	17,200	5,310.00	91,332,000	
三共生興	2,800	477.00	1,335,600	
兼松	7,600	1,510.00	11,476,000	
ツカモトコーポレーション	300	1,340.00	402,000	
三井物産	144,100	3,999.00	576,255,900	
日本紙パルプ商事	1,000	4,905.00	4,905,000	
カメイ	2,100	1,174.00	2,465,400	
東都水産	100	5,300.00	530,000	
OUGホールディングス	300	2,405.00	721,500	
スターゼン	1,500	2,064.00	3,096,000	
山善	5,300	1,000.00	5,300,000	
椿本興業	300	3,990.00	1,197,000	
住友商事	121,900	2,223.00	270,983,700	
内田洋行	900	4,520.00	4,068,000	
三菱商事	123,100	4,422.00	544,348,200	
第一実業	700	4,275.00	2,992,500	
キャノンマーケティングジャパン	4,600	3,015.00	13,869,000	
西華産業	800	1,554.00	1,243,200	
佐藤商事	1,400	1,199.00	1,678,600	
菱洋エレクトロ	1,700	2,361.00	4,013,700	
東京産業	1,800	772.00	1,389,600	
ユアサ商事	1,800	3,490.00	6,282,000	
神鋼商事	500	4,475.00	2,237,500	
トルク	1,000	236.00	236,000	
阪和興業	3,500	3,605.00	12,617,500	
正栄食品工業	1,300	4,150.00	5,395,000	

カナデン	1,600	1,110.00	1,776,000
菱電商事	1,600	1,662.00	2,659,200
岩谷産業	4,500	5,550.00	24,975,000
ナイス	500	1,349.00	674,500
ニチモウ	200	2,606.00	521,200
極東貿易	1,200	1,330.00	1,596,000
アステナホールディングス	3,400	430.00	1,462,000
三愛オブリ	5,400	1,231.00	6,647,400
稲畑産業	4,000	2,352.00	9,408,000
G S I クレオス	1,100	1,447.00	1,591,700
明和産業	2,600	691.00	1,796,600
クワザワホールディングス	600	413.00	247,800
ワキタ	3,600	1,180.00	4,248,000
東邦ホールディングス	4,900	2,042.00	10,005,800
サンゲツ	4,900	2,105.00	10,314,500
ミツウロコグループホールディングス	2,500	1,007.00	2,517,500
シナネンホールディングス	600	3,715.00	2,229,000
伊藤忠エネクス	4,900	1,007.00	4,934,300
サンリオ	5,600	4,560.00	25,536,000
サンワテクノス	1,000	1,473.00	1,473,000
リョーサン	2,100	2,856.00	5,997,600
新光商事	2,600	1,153.00	2,997,800
トーホー	800	1,785.00	1,428,000
三信電気	800	2,181.00	1,744,800
東陽テクニカ	2,200	1,343.00	2,954,600
モスフードサービス	2,900	3,135.00	9,091,500
加賀電子	1,600	4,230.00	6,768,000
ソーダニッカ	1,400	608.00	851,200
立花エレテック	1,400	1,746.00	2,444,400
フォーバル	800	941.00	752,800
P A L T A C	3,100	4,450.00	13,795,000
三谷産業	3,400	316.00	1,074,400
太平洋興発	700	792.00	554,400
西本W i s m e t t a cホールディングス	500	3,690.00	1,845,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	200	1,588.00	317,600
コア商事ホールディングス	1,400	597.00	835,800

K P Pグループホールディングス	4,600	865.00	3,979,000	
ヤマタネ	900	1,663.00	1,496,700	
丸紅建材リース	200	1,717.00	343,400	
日鉄物産	1,300	5,020.00	6,526,000	
泉州電業	1,000	3,025.00	3,025,000	
トラスコ中山	4,100	2,137.00	8,761,700	
オートバックスセブン	6,900	1,424.00	9,825,600	
モリト	1,400	744.00	1,041,600	
加藤産業	2,400	3,415.00	8,196,000	
北恵	400	664.00	265,600	
イエローハット	3,500	1,727.00	6,044,500	
J Kホールディングス	1,600	1,024.00	1,638,400	
日伝	1,200	1,675.00	2,010,000	
北沢産業	1,000	192.00	192,000	
杉本商事	900	1,976.00	1,778,400	
因幡電機産業	5,100	2,769.00	14,121,900	
東テク	700	3,105.00	2,173,500	
ミスミグループ本社	29,700	3,385.00	100,534,500	
アルテック	1,100	300.00	330,000	
タキヒヨー	500	878.00	439,000	
蔵王産業	300	1,756.00	526,800	
スズケン	6,100	3,605.00	21,990,500	
ジェコス	1,300	797.00	1,036,100	
グローセル	2,200	437.00	961,400	
ローソン	4,900	5,040.00	24,696,000	
サンエー	1,500	4,220.00	6,330,000	
カワチ薬品	1,500	2,155.00	3,232,500	
エービーシー・マート	2,900	7,040.00	20,416,000	
ハードオフコーポレーション	800	1,401.00	1,120,800	
アスクル	4,800	1,560.00	7,488,000	
ゲオホールディングス	2,100	2,004.00	4,208,400	
アダストリア	2,400	2,006.00	4,814,400	
ジーフット	1,000	293.00	293,000	
シー・ヴィー・エス・バイエリア	300	399.00	119,700	
くら寿司	2,300	3,340.00	7,682,000	
キャンドウ	700	2,188.00	1,531,600	

I Kホールディングス	600	420.00	252,000	
パルグループホールディングス	1,900	2,421.00	4,599,900	
エディオン	7,800	1,263.00	9,851,400	
サーラコーポレーション	4,100	698.00	2,861,800	
ワッツ	1,000	707.00	707,000	
ハローズ	900	2,926.00	2,633,400	
フジオフードグループ本社	1,600	1,378.00	2,204,800	
あみやき亭	500	2,902.00	1,451,000	
ひらまつ	4,200	187.00	785,400	
大黒天物産	700	5,200.00	3,640,000	
ハニーズホールディングス	1,700	1,270.00	2,159,000	
ファーマライズホールディングス	400	668.00	267,200	
アルペン	1,600	2,057.00	3,291,200	
ハブ	600	628.00	376,800	
クオールホールディングス	2,700	1,162.00	3,137,400	
ジーンズホールディングス	1,200	4,735.00	5,682,000	
ビックカメラ	13,100	1,292.00	16,925,200	
D C Mホールディングス	12,000	1,155.00	13,860,000	
ペッパーフードサービス	4,100	190.00	779,000	
Monotaro	27,900	2,213.00	61,742,700	
東京一番フーズ	400	490.00	196,000	
D Dホールディングス	1,300	685.00	890,500	
きちりホールディングス	500	590.00	295,000	
アークランドサービスホールディングス	1,600	2,218.00	3,548,800	
J . フロント リテイリング	24,500	1,164.00	28,518,000	
ドトール・日レスホールディングス	3,500	1,695.00	5,932,500	
マツキヨココカラ&カンパニー	11,900	6,240.00	74,256,000	
ブロンコピリー	1,000	2,493.00	2,493,000	
Z O Z O	13,000	3,365.00	43,745,000	
トレジャー・ファクトリー	600	2,494.00	1,496,400	
物語コーポレーション	1,100	6,410.00	7,051,000	
三越伊勢丹ホールディングス	33,100	1,300.00	43,030,000	
H a m e e	800	848.00	678,400	
マーケットエンタープライズ	200	984.00	196,800	
ウエルシアホールディングス	10,200	3,100.00	31,620,000	
クリエイトSDホールディングス	3,300	3,220.00	10,626,000	

丸善C H Iホールディングス	2,300	329.00	756,700	
ミサワ	400	615.00	246,000	
ティーライフ	300	1,294.00	388,200	
エー・ピーホールディングス	400	472.00	188,800	
チムニー	600	1,123.00	673,800	
シュッピン	1,500	1,246.00	1,869,000	
オイシックス・ラ・大地	2,600	1,925.00	5,005,000	
ネクステージ	4,500	2,729.00	12,280,500	
ジョイフル本田	6,300	1,876.00	11,818,800	
鳥貴族ホールディングス	700	2,187.00	1,530,900	
ホットランド	1,500	1,507.00	2,260,500	
すかいらーくホールディングス	26,900	1,597.00	42,959,300	
S F Pホールディングス	1,100	1,733.00	1,906,300	
綿半ホールディングス	1,500	1,327.00	1,990,500	
ヨシックスホールディングス	400	2,142.00	856,800	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	6,400	1,100.00	7,040,000	
ゴルフダイジェスト・オンライン	900	1,680.00	1,512,000	
B E E N O S	1,100	2,559.00	2,814,900	
あさひ	1,600	1,377.00	2,203,200	
日本調剤	1,300	1,192.00	1,549,600	
コスモス薬品	2,200	14,070.00	30,954,000	
トーエル	900	721.00	648,900	
セブン&アイ・ホールディングス	67,900	5,588.00	379,425,200	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	14,800	937.00	13,867,600	
ツルハホールディングス	4,800	9,490.00	45,552,000	
サンマルクホールディングス	1,600	1,682.00	2,691,200	
フェリシモ	400	1,006.00	402,400	
トリドールホールディングス	4,900	2,731.00	13,381,900	
T O K Y O B A S E	2,000	297.00	594,000	
ウイルプラスホールディングス	400	1,101.00	440,400	
J Mホールディングス	1,700	1,728.00	2,937,600	
サツドラホールディングス	900	690.00	621,000	
アレンザホールディングス	1,500	984.00	1,476,000	
串カツ田中ホールディングス	500	1,765.00	882,500	
パロックジャパンリミテッド	1,300	815.00	1,059,500	

クスリのアオキホールディングス	2,000	8,160.00	16,320,000	
力の源ホールディングス	1,100	945.00	1,039,500	
FOOD & LIFE COMPANIES	11,300	2,845.00	32,148,500	
メディカルシステムネットワーク	1,700	413.00	702,100	
一家ホールディングス	400	624.00	249,600	
ジャパクラフトホールディングス	600	642.00	385,200	
はるやまホールディングス	800	438.00	350,400	
ノジマ	6,400	1,321.00	8,454,400	
カッパ・クリエイト	3,100	1,381.00	4,281,100	
ライトオン	1,500	616.00	924,000	
良品計画	25,400	1,541.00	39,141,400	
パリミキホールディングス	2,400	269.00	645,600	
アドヴァングループ	1,900	888.00	1,687,200	
アルビス	600	2,375.00	1,425,000	
コナカ	2,100	334.00	701,400	
ハウス オブ ローゼ	200	1,618.00	323,600	
G-7ホールディングス	2,500	1,511.00	3,777,500	
イオン北海道	2,900	1,136.00	3,294,400	
コジマ	3,800	612.00	2,325,600	
ヒマラヤ	600	927.00	556,200	
コーナン商事	2,700	3,280.00	8,856,000	
エコス	700	1,828.00	1,279,600	
ワタミ	2,400	1,031.00	2,474,400	
マルシェ	600	395.00	237,000	
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	44,100	2,346.00	103,458,600	
西松屋チェーン	4,400	1,369.00	6,023,600	
ゼンショーホールディングス	10,800	3,425.00	36,990,000	
幸楽苑ホールディングス	1,300	1,008.00	1,310,400	
ハークスレイ	700	800.00	560,000	
サイゼリヤ	3,300	3,030.00	9,999,000	
V Tホールディングス	7,500	503.00	3,772,500	
魚力	600	2,140.00	1,284,000	
ポブラ	600	144.00	86,400	
フジ・コーポレーション	1,100	1,271.00	1,398,100	
ユナイテッドアローズ	2,100	1,889.00	3,966,900	

ハイデイ日高	2,900	1,981.00	5,744,900
YU-WA Creation Holdings	1,100	204.00	224,400
コロワイド	9,100	1,800.00	16,380,000
ピーシーデボコーポレーション	2,200	267.00	587,400
壱番屋	1,600	4,580.00	7,328,000
トップカルチャー	600	197.00	118,200
PLANT	500	640.00	320,000
スギホールディングス	4,000	6,290.00	25,160,000
薬王堂ホールディングス	1,100	2,655.00	2,920,500
ヴィア・ホールディングス	2,600	101.00	262,600
スクロール	2,900	717.00	2,079,300
ヨンドシーホールディングス	1,700	1,734.00	2,947,800
木曾路	3,000	2,094.00	6,282,000
SRSホールディングス	3,200	858.00	2,745,600
千趣会	3,600	400.00	1,440,000
タカキュー	1,500	78.00	117,000
リテールパートナーズ	2,900	1,237.00	3,587,300
ケーヨー	3,200	903.00	2,889,600
上新電機	1,800	1,900.00	3,420,000
日本瓦斯	10,500	2,091.00	21,955,500
ロイヤルホールディングス	3,800	2,480.00	9,424,000
東天紅	100	793.00	79,300
いなげや	1,900	1,177.00	2,236,300
チヨダ	1,900	760.00	1,444,000
ライフコーポレーション	1,700	2,544.00	4,324,800
リンガーハット	2,500	2,219.00	5,547,500
MrMaxHD	2,800	650.00	1,820,000
テンアライド	2,100	258.00	541,800
AOKIホールディングス	3,700	669.00	2,475,300
オークワ	3,100	914.00	2,833,400
コメリ	3,000	2,579.00	7,737,000
青山商事	4,200	889.00	3,733,800
しまむら	2,300	12,580.00	28,934,000
はせがわ	900	348.00	313,200
高島屋	14,800	1,697.00	25,115,600

松屋	3,300	985.00	3,250,500
エイチ・ツー・オー リテイリング	9,600	1,178.00	11,308,800
近鉄百貨店	600	2,420.00	1,452,000
丸井グループ	14,500	2,253.00	32,668,500
アクシアル リテイリング	1,300	3,345.00	4,348,500
井筒屋	900	382.00	343,800
イオン	66,700	2,828.00	188,627,600
イズミ	3,000	2,985.00	8,955,000
平和堂	3,300	2,041.00	6,735,300
フジ	3,000	1,817.00	5,451,000
ヤオコー	2,200	6,800.00	14,960,000
ゼビオホールディングス	2,700	934.00	2,521,800
ケーズホールディングス	15,700	1,111.00	17,442,700
Olympicグループ	700	521.00	364,700
日産東京販売ホールディングス	2,500	289.00	722,500
シルバーライフ	500	1,739.00	869,500
Genky DrugStores	1,000	3,535.00	3,535,000
ナルミヤ・インターナショナル	300	866.00	259,800
ブックオフグループホールディングス	1,200	1,342.00	1,610,400
ギフトホールディングス	400	3,770.00	1,508,000
アインホールディングス	2,700	6,340.00	17,118,000
元気寿司	600	3,155.00	1,893,000
ヤマダホールディングス	80,700	469.00	37,848,300
アークランズ	2,900	1,513.00	4,387,700
ニトリホールディングス	8,000	16,035.00	128,280,000
グルメ杵屋	1,600	997.00	1,595,200
愛眼	1,400	173.00	242,200
ケーユーホールディングス	1,200	1,310.00	1,572,000
吉野家ホールディングス	7,700	2,355.00	18,133,500
松屋フーズホールディングス	900	3,915.00	3,523,500
サガミホールディングス	3,200	1,216.00	3,891,200
関西フードマーケット	1,800	1,304.00	2,347,200
王将フードサービス	1,300	6,040.00	7,852,000
プレナス	2,000	2,635.00	5,270,000
ミニストップ	1,400	1,431.00	2,003,400
アークス	3,600	2,092.00	7,531,200

パローホールディングス	3,800	1,761.00	6,691,800
ベルク	1,000	5,700.00	5,700,000
大庄	1,100	1,060.00	1,166,000
ファーストリテイリング	3,000	83,900.00	251,700,000
サンドラッグ	7,500	3,785.00	28,387,500
サックスパー ホールディングス	1,900	778.00	1,478,200
ヤマザワ	400	1,302.00	520,800
やまや	400	2,461.00	984,400
ペルーナ	4,700	677.00	3,181,900
いよぎんホールディングス	21,800	656.00	14,300,800
しずおかフィナンシャルグループ	41,400	959.00	39,702,600
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	15,400	933.00	14,368,200
島根銀行	600	443.00	265,800
じもとホールディングス	1,200	393.00	471,600
めぶきフィナンシャルグループ	90,900	296.00	26,906,400
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2,300	2,310.00	5,313,000
九州フィナンシャルグループ	32,200	388.00	12,493,600
ゆうちょ銀行	52,200	1,024.00	53,452,800
富山第一銀行	4,600	525.00	2,415,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	101,000	475.00	47,975,000
西日本フィナンシャルホールディングス	11,600	847.00	9,825,200
三十三フィナンシャルグループ	1,600	1,444.00	2,310,400
第四北越フィナンシャルグループ	2,900	2,511.00	7,281,900
ひろぎんホールディングス	23,900	618.00	14,770,200
おきなわフィナンシャルグループ	1,700	2,053.00	3,490,100
十六フィナンシャルグループ	2,400	2,569.00	6,165,600
北國フィナンシャルホールディングス	1,500	4,365.00	6,547,500
プロクレアホールディングス	2,200	2,092.00	4,602,400
あいちフィナンシャルグループ	2,600	2,180.00	5,668,000
新生銀行	5,400	2,244.00	12,117,600
あおぞら銀行	11,500	2,580.00	29,670,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,201,500	755.50	907,733,250
りそなホールディングス	233,900	641.30	150,000,070
三井住友トラスト・ホールディングス	33,900	4,205.00	142,549,500
三井住友フィナンシャルグループ	133,900	4,655.00	623,304,500
千葉銀行	51,100	830.00	42,413,000

群馬銀行	35,600	428.00	15,236,800	
武蔵野銀行	2,400	1,843.00	4,423,200	
千葉興業銀行	4,300	398.00	1,711,400	
筑波銀行	8,000	198.00	1,584,000	
七十七銀行	5,900	1,894.00	11,174,600	
秋田銀行	1,200	1,698.00	2,037,600	
山形銀行	2,000	1,139.00	2,278,000	
岩手銀行	1,300	1,847.00	2,401,100	
東邦銀行	14,400	206.00	2,966,400	
東北銀行	900	982.00	883,800	
ふくおかフィナンシャルグループ	14,600	2,644.00	38,602,400	
スルガ銀行	16,200	406.00	6,577,200	
八十二銀行	37,600	498.00	18,724,800	
山梨中央銀行	1,900	1,037.00	1,970,300	
大垣共立銀行	3,500	1,719.00	6,016,500	
福井銀行	1,600	1,429.00	2,286,400	
清水銀行	700	1,463.00	1,024,100	
富山銀行	300	1,650.00	495,000	
滋賀銀行	3,000	2,486.00	7,458,000	
南都銀行	2,800	2,261.00	6,330,800	
百五銀行	17,200	338.00	5,813,600	
京都銀行	5,800	5,420.00	31,436,000	
紀陽銀行	6,600	1,405.00	9,273,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	11,600	868.00	10,068,800	
山陰合同銀行	11,500	714.00	8,211,000	
鳥取銀行	600	1,075.00	645,000	
百十四銀行	1,700	1,703.00	2,895,100	
四国銀行	2,900	881.00	2,554,900	
阿波銀行	2,700	1,982.00	5,351,400	
大分銀行	1,100	1,851.00	2,036,100	
宮崎銀行	1,200	2,257.00	2,708,400	
佐賀銀行	1,100	1,549.00	1,703,900	
琉球銀行	4,200	800.00	3,360,000	
セブン銀行	65,600	256.00	16,793,600	
みずほフィナンシャルグループ	265,000	1,686.00	446,790,000	
高知銀行	600	656.00	393,600	

山口フィナンシャルグループ	20,200	773.00	15,614,600	
長野銀行	600	1,201.00	720,600	
名古屋銀行	1,200	3,060.00	3,672,000	
北洋銀行	27,700	228.00	6,315,600	
大光銀行	500	1,143.00	571,500	
愛媛銀行	2,500	841.00	2,102,500	
トマト銀行	600	992.00	595,200	
京葉銀行	8,500	520.00	4,420,000	
栃木銀行	8,400	298.00	2,503,200	
北日本銀行	600	1,885.00	1,131,000	
東和銀行	3,400	524.00	1,781,600	
福島銀行	1,900	215.00	408,500	
大東銀行	700	620.00	434,000	
トモニホールディングス	14,800	328.00	4,854,400	
フィデアホールディングス	1,900	1,319.00	2,506,100	
池田泉州ホールディングス	23,400	225.00	5,265,000	
F P G	7,400	1,131.00	8,369,400	
ジャパンインベストメントアドバイザー	1,500	1,216.00	1,824,000	
マーキュリアホールディングス	1,100	593.00	652,300	
S B Iホールディングス	26,500	2,575.00	68,237,500	
日本アジア投資	1,400	240.00	336,000	
ジャフコ グループ	6,100	2,373.00	14,475,300	
大和証券グループ本社	131,000	585.00	76,635,000	
野村ホールディングス	337,500	485.50	163,856,250	
岡三証券グループ	16,100	392.00	6,311,200	
丸三証券	6,100	404.00	2,464,400	
東洋証券	6,100	268.00	1,634,800	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	19,900	349.00	6,945,100	
光世証券	400	378.00	151,200	
水戸証券	4,900	216.00	1,058,400	
いちよし証券	3,400	621.00	2,111,400	
松井証券	10,800	776.00	8,380,800	
マネックスグループ	20,500	424.00	8,692,000	
極東証券	2,300	592.00	1,361,600	
岩井コスモホールディングス	2,100	1,254.00	2,633,400	
アイザワ証券グループ	2,600	682.00	1,773,200	

マネーパートナーズグループ	1,900	289.00	549,100
スパークス・グループ	2,000	1,693.00	3,386,000
小林洋行	800	222.00	177,600
かんぽ生命保険	22,200	2,175.00	48,285,000
S O M P Oホールディングス	31,500	5,639.00	177,628,500
アニコム ホールディングス	6,200	657.00	4,073,400
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	41,300	3,917.00	161,772,100
第一生命ホールディングス	93,300	2,607.50	243,279,750
東京海上ホールディングス	184,500	2,797.00	516,046,500
T & Dホールディングス	49,200	1,637.00	80,540,400
アドバンスクリエイト	1,100	1,060.00	1,166,000
全国保証	4,800	5,030.00	24,144,000
あんしん保証	900	256.00	230,400
ジェイリース	600	3,065.00	1,839,000
イントラスト	700	773.00	541,100
日本モーゲージサービス	1,000	855.00	855,000
C a s a	700	875.00	612,500
アルヒ	2,300	1,003.00	2,306,900
プレミアグループ	3,100	1,754.00	5,437,400
ネットプロテクションズホールディングス	6,100	497.00	3,031,700
クレディセゾン	11,600	1,706.00	19,789,600
芙蓉総合リース	1,700	8,490.00	14,433,000
みずほリース	2,700	3,255.00	8,788,500
東京センチュリー	3,400	4,575.00	15,555,000
日本証券金融	7,300	1,067.00	7,789,100
アイフル	30,300	408.00	12,362,400
リコーリース	1,700	3,620.00	6,154,000
イオンフィナンシャルサービス	10,500	1,398.00	14,679,000
アコム	32,700	314.00	10,267,800
ジャックス	2,000	4,140.00	8,280,000
オリエントコーポレーション	4,800	1,151.00	5,524,800
オリックス	122,600	2,202.50	270,026,500
三菱H C キャピタル	71,500	638.00	45,617,000
九州リースサービス	900	675.00	607,500
日本取引所グループ	51,500	1,927.00	99,240,500

イー・ギャランティ	3,000	2,278.00	6,834,000	
アサックス	800	595.00	476,000	
NECキャピタルソリューション	900	2,055.00	1,849,500	
大東建託	6,700	14,300.00	95,810,000	
いちご	21,100	302.00	6,372,200	
日本駐車場開発	21,800	295.00	6,431,000	
スター・マイカ・ホールディングス	1,700	713.00	1,212,100	
SREホールディングス	900	4,290.00	3,861,000	
ADワークスグループ	4,600	154.00	708,400	
ヒューリック	42,700	1,139.00	48,635,300	
三栄建築設計	900	1,521.00	1,368,900	
野村不動産ホールディングス	11,500	3,110.00	35,765,000	
三重交通グループホールディングス	3,900	482.00	1,879,800	
サムティ	2,900	2,249.00	6,522,100	
ディア・ライフ	2,800	608.00	1,702,400	
コーセーアールイー	600	741.00	444,600	
地主	1,400	1,970.00	2,758,000	
プレサンスコーポレーション	2,400	1,535.00	3,684,000	
THEグローバル社	1,000	224.00	224,000	
ハウスコム	300	1,090.00	327,000	
JPMC	900	1,022.00	919,800	
サンセイランディック	500	852.00	426,000	
エストラスト	200	597.00	119,400	
フージャースホールディングス	2,800	745.00	2,086,000	
オープンハウスグループ	6,700	5,610.00	37,587,000	
東急不動産ホールディングス	55,100	695.00	38,294,500	
飯田グループホールディングス	16,100	2,101.00	33,826,100	
イーランド	300	1,562.00	468,600	
ムゲンエステート	1,200	487.00	584,400	
ビーロッド	1,300	615.00	799,500	
ファーストブラザーズ	400	850.00	340,000	
And Doホールディングス	1,100	841.00	925,100	
シーアールイー	800	1,366.00	1,092,800	
プロパティエージェント	200	1,236.00	247,200	
ケイアイスター不動産	900	4,875.00	4,387,500	
アグレ都市デザイン	300	1,590.00	477,000	

グッドコムアセット	1,700	725.00	1,232,500	
ジェイ・エス・ビー	500	4,230.00	2,115,000	
ロードスターキャピタル	800	1,752.00	1,401,600	
テンポイノベーション	600	985.00	591,000	
グローバル・リンク・マネジメント	300	1,308.00	392,400	
フェイスネットワーク	200	1,346.00	269,200	
パーク24	14,300	1,983.00	28,356,900	
パラカ	600	1,918.00	1,150,800	
宮越ホールディングス	800	767.00	613,600	
三井不動産	79,600	2,613.00	207,994,800	
三菱地所	116,200	1,836.50	213,401,300	
平和不動産	3,000	3,930.00	11,790,000	
東京建物	17,500	1,844.00	32,270,000	
京阪神ビルディング	2,300	1,271.00	2,923,300	
住友不動産	33,100	3,412.00	112,937,200	
テーオーシー	3,300	667.00	2,201,100	
東京楽天地	300	4,360.00	1,308,000	
レオパレス21	20,600	289.00	5,953,400	
スターツコーポレーション	2,600	2,658.00	6,910,800	
フジ住宅	2,600	653.00	1,697,800	
空港施設	2,200	528.00	1,161,600	
明和地所	900	629.00	566,100	
ゴールドクレスト	1,700	1,708.00	2,903,600	
エスリード	900	1,826.00	1,643,400	
日神グループホールディングス	2,900	435.00	1,261,500	
日本エスコン	4,100	845.00	3,464,500	
MIRARTHホールディングス	9,300	378.00	3,515,400	
AVANTIA	900	787.00	708,300	
イオンモール	9,500	1,710.00	16,245,000	
毎日コムネット	700	704.00	492,800	
ファースト住建	700	997.00	697,900	
ランド	109,100	11.00	1,200,100	
カチタス	4,900	3,155.00	15,459,500	
トーセイ	3,000	1,410.00	4,230,000	
穴吹興産	400	1,967.00	786,800	
サンフロンティア不動産	3,100	1,127.00	3,493,700	

F Jネクストホールディングス	1,900	962.00	1,827,800	
インテリックス	400	534.00	213,600	
ランドビジネス	700	226.00	158,200	
サンネクスタグループ	600	974.00	584,400	
グランディハウス	1,500	555.00	832,500	
日本空港ビルデング	6,500	6,310.00	41,015,000	
明豊ファシリティワークス	1,000	706.00	706,000	
日本工営	1,400	3,430.00	4,802,000	
L I F U L L	6,500	235.00	1,527,500	
M I X I	4,400	2,426.00	10,674,400	
ジェイエイシーリクルートメント	1,700	2,552.00	4,338,400	
日本M & Aセンターホールディングス	32,800	1,817.00	59,597,600	
メンバーズ	600	2,078.00	1,246,800	
中広	300	378.00	113,400	
U Tグループ	2,800	2,441.00	6,834,800	
アイティメディア	700	1,734.00	1,213,800	
E・Jホールディングス	1,200	1,282.00	1,538,400	
夢真ピーネックスグループ	7,000	1,806.00	12,642,000	
コシダカホールディングス	5,700	1,100.00	6,270,000	
アルトナー	500	1,013.00	506,500	
パソナグループ	2,300	1,940.00	4,462,000	
C D S	500	1,798.00	899,000	
リンクアンドモチベーション	5,500	711.00	3,910,500	
エス・エム・エス	7,300	3,490.00	25,477,000	
サニーサイドアップグループ	700	580.00	406,000	
パーソルホールディングス	21,400	3,000.00	64,200,000	
リニカル	1,100	668.00	734,800	
クックパッド	5,200	203.00	1,055,600	
エスクリ	800	327.00	261,600	
アイ・ケイ・ケイホールディングス	900	679.00	611,100	
学情	900	1,441.00	1,296,900	
スタジオアリス	1,000	2,060.00	2,060,000	
シミックホールディングス	1,100	1,669.00	1,835,900	
エプコ	400	710.00	284,000	
N J S	400	2,043.00	817,200	
総合警備保障	7,100	3,475.00	24,672,500	

カカクコム	14,300	2,233.00	31,931,900	
アイロムグループ	700	2,257.00	1,579,900	
セントケア・ホールディング	1,200	858.00	1,029,600	
サイネックス	300	551.00	165,300	
ルネサンス	1,300	877.00	1,140,100	
ディップ	3,300	3,805.00	12,556,500	
デジタルホールディングス	1,500	1,186.00	1,779,000	
新日本科学	2,000	2,239.00	4,478,000	
キャリアデザインセンター	400	1,659.00	663,600	
ベネフィット・ワン	8,900	2,104.00	18,725,600	
エムスリー	37,800	4,123.00	155,849,400	
ツカダ・グローバルホールディング	1,200	381.00	457,200	
プラス	300	975.00	292,500	
アウトソーシング	11,400	971.00	11,069,400	
ウェルネット	1,700	607.00	1,031,900	
ワールドホールディングス	900	2,779.00	2,501,100	
ディー・エヌ・エー	8,200	1,797.00	14,735,400	
博報堂D Yホールディングス	24,400	1,319.00	32,183,600	
ぐるなび	3,500	413.00	1,445,500	
タカミヤ	2,600	382.00	993,200	
ジャパンベストレスキューシステム	1,200	863.00	1,035,600	
ファンコミュニケーションズ	3,700	439.00	1,624,300	
ライク	700	1,990.00	1,393,000	
ビジネス・ブレークスルー	700	382.00	267,400	
エスプール	5,500	915.00	5,032,500	
WDBホールディングス	1,000	2,209.00	2,209,000	
ティア	1,100	420.00	462,000	
C D G	200	1,116.00	223,200	
アドウェイズ	2,600	515.00	1,339,000	
バリューコマース	1,400	1,955.00	2,737,000	
インフォマート	19,900	433.00	8,616,700	
J Pホールディングス	5,500	274.00	1,507,000	
エコナックホールディングス	3,100	92.00	285,200	
C Lホールディングス	500	810.00	405,000	
プレステージ・インターナショナル	8,000	701.00	5,608,000	
アミューズ	1,000	1,771.00	1,771,000	

ドリームインキュベータ	600	2,776.00	1,665,600	
クイック	1,500	2,000.00	3,000,000	
T A C	900	210.00	189,000	
電通グループ	20,100	4,225.00	84,922,500	
テイクアンドギヴ・ニーズ	700	1,412.00	988,400	
ぴあ	600	3,220.00	1,932,000	
イオンファンタジー	800	2,966.00	2,372,800	
シーティーエス	2,100	842.00	1,768,200	
ネクシィーズグループ	600	665.00	399,000	
H . U . グループホールディングス	5,600	2,751.00	15,405,600	
アルプス技研	1,700	2,105.00	3,578,500	
サニックス	3,000	224.00	672,000	
ダイオーズ	100	1,496.00	149,600	
日本空調サービス	2,100	693.00	1,455,300	
オリエンタルランド	20,200	19,595.00	395,819,000	
ダスキン	4,300	2,960.00	12,728,000	
明光ネットワークジャパン	2,500	618.00	1,545,000	
ファルコホールディングス	900	1,737.00	1,563,300	
秀英予備校	400	440.00	176,000	
田谷	300	544.00	163,200	
ラウンドワン	16,000	513.00	8,208,000	
リゾートトラスト	7,600	2,407.00	18,293,200	
ビー・エム・エル	2,400	3,370.00	8,088,000	
りらいあコミュニケーションズ	3,200	1,011.00	3,235,200	
リソー教育	8,700	345.00	3,001,500	
早稲田アカデミー	1,100	1,105.00	1,215,500	
ユー・エス・エス	19,700	2,179.00	42,926,300	
東京個別指導学院	2,300	530.00	1,219,000	
サイバーエージェント	45,800	1,219.00	55,830,200	
楽天グループ	88,500	635.00	56,197,500	
クリーク・アンド・リバー社	1,100	1,995.00	2,194,500	
モーニングスター	3,100	457.00	1,416,700	
テー・オー・ダブリュー	4,100	294.00	1,205,400	
山田コンサルティンググループ	1,000	1,146.00	1,146,000	
セントラルスポーツ	700	2,367.00	1,656,900	
フルキャストホールディングス	1,800	2,997.00	5,394,600	

エン・ジャパン	3,500	2,289.00	8,011,500	
リソルホールディングス	200	4,560.00	912,000	
テクノプロ・ホールディングス	12,800	3,775.00	48,320,000	
アトラグループ	500	203.00	101,500	
インターワークス	500	369.00	184,500	
アイ・アールジャパンホールディングス	1,000	1,817.00	1,817,000	
K e e P e r 技研	1,400	4,010.00	5,614,000	
ファーストロジック	300	829.00	248,700	
三機サービス	300	933.00	279,900	
G u n o s y	1,200	655.00	786,000	
デザインワン・ジャパン	600	212.00	127,200	
イー・ガーディアン	700	2,731.00	1,911,700	
リブセンス	900	301.00	270,900	
ジャパンマテリアル	5,900	2,399.00	14,154,100	
ベクトル	3,000	1,290.00	3,870,000	
ウチヤマホールディングス	800	277.00	221,600	
チャーム・ケア・コーポレーション	1,600	1,186.00	1,897,600	
キャリアリンク	700	3,115.00	2,180,500	
I B J	1,200	951.00	1,141,200	
アサンテ	900	1,600.00	1,440,000	
バリューHR	1,700	1,672.00	2,842,400	
M&Aキャピタルパートナーズ	1,800	4,695.00	8,451,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	700	1,118.00	782,600	
E R Iホールディングス	500	1,102.00	551,000	
アピスト	300	2,905.00	871,500	
シグマクス・ホールディングス	2,900	1,316.00	3,816,400	
ウィルグループ	1,600	1,288.00	2,060,800	
エスクロー・エージェント・ジャパン	1,900	152.00	288,800	
メドピア	1,500	1,568.00	2,352,000	
レアジョブ	400	929.00	371,600	
リクルートホールディングス	141,600	4,308.00	610,012,800	
エラン	2,500	976.00	2,440,000	
土木管理総合試験所	800	310.00	248,000	
日本郵政	250,700	1,043.00	261,480,100	
ベルシステム24ホールディングス	2,600	1,340.00	3,484,000	
鎌倉新書	2,200	995.00	2,189,000	

SMN	500	489.00	244,500	
一蔵	200	444.00	88,800	
グローバルキッズCOMPANY	300	576.00	172,800	
エアトリ	1,200	2,602.00	3,122,400	
アトラエ	1,500	1,422.00	2,133,000	
ストライク	900	4,655.00	4,189,500	
ソラスト	5,300	771.00	4,086,300	
セラク	700	1,199.00	839,300	
インソース	2,400	3,005.00	7,212,000	
ベйкаレント・コンサルティング	15,100	4,800.00	72,480,000	
Orchestra Holdings	400	2,006.00	802,400	
アイモバイル	1,000	1,172.00	1,172,000	
キャリアインデックス	600	354.00	212,400	
MS - Japan	600	1,007.00	604,200	
船場	300	739.00	221,700	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	6,800	1,696.00	11,532,800	
フルテック	300	1,238.00	371,400	
グリーンズ	700	1,120.00	784,000	
ツナググループ・ホールディングス	500	532.00	266,000	
GameWith	600	367.00	220,200	
MS&Consulting	200	625.00	125,000	
ウェルビー	1,400	782.00	1,094,800	
エル・ティー・エス	200	3,155.00	631,000	
ミダックホールディングス	1,200	2,835.00	3,402,000	
日総工産	1,400	588.00	823,200	
キュービーネットホールディングス	1,000	1,434.00	1,434,000	
RPAホールディングス	2,600	276.00	717,600	
スプリックス	700	928.00	649,600	
マネジメントソリューションズ	1,100	3,565.00	3,921,500	
プロレド・パートナーズ	500	522.00	261,000	
and factory	600	361.00	216,600	
テノ・ホールディングス	200	547.00	109,400	
フロンティア・マネジメント	600	1,357.00	814,200	
ピアラ	300	647.00	194,100	
コプロ・ホールディングス	300	1,029.00	308,700	

ギークス	300	850.00	255,000	
カーブスホールディングス	5,900	945.00	5,575,500	
フォーラムエンジニアリング	1,100	863.00	949,300	
Fast Fitness Japan	700	1,209.00	846,300	
ダイレクトマーケティングミックス	2,200	1,325.00	2,915,000	
ポピンズ	300	1,610.00	483,000	
LITALICO	1,500	2,253.00	3,379,500	
アドバンテッジリスクマネジメント	900	414.00	372,600	
リログループ	10,600	2,191.00	23,224,600	
東祥	1,300	1,143.00	1,485,900	
ビーウィズ	600	1,140.00	684,000	
TREホールディングス	4,000	1,453.00	5,812,000	
人・夢・技術グループ	900	1,971.00	1,773,900	
エイチ・アイ・エス	5,000	2,035.00	10,175,000	
ラックランド	600	2,981.00	1,788,600	
共立メンテナンス	3,300	5,800.00	19,140,000	
イチネンホールディングス	2,000	1,257.00	2,514,000	
建設技術研究所	1,000	3,350.00	3,350,000	
スペース	1,400	900.00	1,260,000	
燦ホールディングス	800	1,796.00	1,436,800	
スバル興業	100	9,120.00	912,000	
東京テアトル	700	1,118.00	782,600	
タナベコンサルティンググループ	700	639.00	447,300	
ナガワ	500	7,330.00	3,665,000	
東京都競馬	1,600	3,775.00	6,040,000	
常磐興産	700	1,191.00	833,700	
カナモト	3,500	2,335.00	8,172,500	
西尾レントオール	1,800	3,110.00	5,598,000	
アゴラ ホスピタリティグループ	9,900	22.00	217,800	
トランス・コスモス	2,400	3,140.00	7,536,000	
乃村工藝社	8,300	945.00	7,843,500	
藤田観光	800	2,926.00	2,340,800	
KNT-CTホールディングス	1,100	1,654.00	1,819,400	
日本管財	2,000	2,515.00	5,030,000	
トーカイ	1,700	1,938.00	3,294,600	
白洋舎	200	1,922.00	384,400	

セコム	19,500	8,192.00	159,744,000	
セントラル警備保障	1,000	2,351.00	2,351,000	
丹青社	3,700	714.00	2,641,800	
メイテック	7,600	2,506.00	19,045,600	
応用地質	1,900	2,075.00	3,942,500	
船井総研ホールディングス	4,000	2,767.00	11,068,000	
進学会ホールディングス	600	304.00	182,400	
オオバ	1,200	666.00	799,200	
いであ	400	1,693.00	677,200	
学究社	800	1,764.00	1,411,200	
ベネッセホールディングス	7,100	1,963.00	13,937,300	
イオンディライト	2,100	2,969.00	6,234,900	
ナック	800	928.00	742,400	
ダイセキ	3,900	4,545.00	17,725,500	
ステップ	800	1,790.00	1,432,000	
合 計	21,896,900		52,622,517,490	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

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12月12日現在

資産の部	
流動資産	
預金	62,125,654
コール・ローン	28,841,385
国債証券	47,605,315,773
未収利息	250,300,392
前払費用	17,536,975
流動資産合計	47,964,120,179
資産合計	47,964,120,179
負債の部	
流動負債	
未払解約金	13,670,900
未払利息	78
流動負債合計	13,670,978
負債合計	13,670,978
純資産の部	
元本等	
元本	43,191,461,509
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	4,758,987,692
元本等合計	47,950,449,201
純資産合計	47,950,449,201
負債純資産合計	47,964,120,179

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12月12日現在

1. 投資信託財産に係る元本の状況

期首	2021年12月11日
期首元本額	39,866,142,490円
期中追加設定元本額	10,915,190,515円
期中一部解約元本額	7,589,871,496円
期末元本額	43,191,461,509円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	3,560,736,378円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	990,373,433円
りそなラップ型ファンド(成長型)	607,734,864円
DCりそな グローバルバランス	86,919,299円
つみたてバランスファンド	1,244,476,663円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	895,139,391円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	237,686,978円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	72,783,947円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	111,674,660円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	33,223,604円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	7,943,830円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	7,540,363円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	314,747,453円
FWりそな先進国債券アクティブファンド	88,060,814円
FWりそな先進国+新興国債券アクティブファンド	45,345,878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)	31,323,301,860円
Smart-i 先進国債券インデックス(為替ヘッジなし)	1,457,458,966円
Smart-i 8資産バランス 安定型	309,647,194円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	250,681,711円
Smart-i 8資産バランス 成長型	98,558,903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)	874,749,256円
りそなVIグローバル・バランスファンド(安定型)(適格機関投資家専用)	7,074,189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)	6,295,890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)	22,728,301円
りそなFT パッシブバランス (適格機関投資家専用)	536,577,684円
2. 計算日における受益権の総数	43,191,461,509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	1.1102円
(10,000口当たり純資産額)	(11,102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12月12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12月12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。

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12月12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12月12日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
国債証券		6,491,830,752
合計		6,491,830,752

(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
国債証券	米ドル	US TREASURY N/B	440,000.00	429,209.23	
		US TREASURY N/B	340,000.00	334,264.91	
		US TREASURY N/B	720,000.00	691,570.13	
		US TREASURY N/B	1,000,000.00	955,437.67	
		US TREASURY N/B	140,000.00	136,517.90	
		US TREASURY N/B	450,000.00	440,512.70	
		US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,631,751.63	
		US TREASURY N/B	810,000.00	770,860.54	
		US TREASURY N/B	420,000.00	408,761.71	
		US TREASURY N/B	440,000.00	429,326.56	
		US TREASURY N/B	1,000,000.00	958,027.34	
		US TREASURY N/B	690,000.00	674,501.95	
		US TREASURY N/B	1,330,000.00	1,261,110.14	

US TREASURY N/B	490,000.00	475,300.00	
US TREASURY N/B	340,000.00	330,902.34	
US TREASURY N/B	380,000.00	365,750.00	
US TREASURY N/B	410,000.00	388,058.59	
US TREASURY N/B	1,540,000.00	1,490,912.50	
US TREASURY N/B	300,000.00	290,853.51	
US TREASURY N/B	240,000.00	226,762.50	
US TREASURY N/B	320,000.00	308,687.50	
US TREASURY N/B	700,000.00	677,496.09	
US TREASURY N/B	720,000.00	699,159.37	
US TREASURY N/B	850,000.00	825,130.86	
US TREASURY N/B	690,000.00	648,465.23	
US TREASURY N/B	650,000.00	626,031.25	
US TREASURY N/B	850,000.00	824,466.79	
US TREASURY N/B	1,330,000.00	1,246,511.32	
US TREASURY N/B	390,000.00	375,146.48	
US TREASURY N/B	600,000.00	574,875.00	
US TREASURY N/B	800,000.00	781,359.37	
US TREASURY N/B	1,050,000.00	983,595.70	
US TREASURY N/B	220,000.00	211,672.65	
US TREASURY N/B	730,000.00	698,062.50	
US TREASURY N/B	1,230,000.00	1,200,499.21	
US TREASURY N/B	950,000.00	917,232.41	
US TREASURY N/B	630,000.00	588,287.10	
US TREASURY N/B	650,000.00	621,917.97	
US TREASURY N/B	600,000.00	568,195.31	
US TREASURY N/B	700,000.00	685,931.63	
US TREASURY N/B	1,190,000.00	1,108,838.28	
US TREASURY N/B	220,000.00	211,337.50	
US TREASURY N/B	710,000.00	674,333.59	
US TREASURY N/B	500,000.00	498,398.44	
US TREASURY N/B	1,070,000.00	999,446.87	
US TREASURY N/B	310,000.00	298,132.81	
US TREASURY N/B	1,030,000.00	976,850.39	
US TREASURY N/B	200,000.00	199,906.25	

US TREASURY N/B	750,000.00	720,966.79
US TREASURY N/B	1,580,000.00	1,475,078.12
US TREASURY N/B	400,000.00	383,500.00
US TREASURY N/B	700,000.00	662,771.48
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,002,773.44
US TREASURY N/B	1,130,000.00	1,058,139.06
US TREASURY N/B	400,000.00	383,906.24
US TREASURY N/B	860,000.00	817,100.78
US TREASURY N/B	700,000.00	655,675.78
US TREASURY N/B	430,000.00	414,261.32
US TREASURY N/B	550,000.00	517,601.56
US TREASURY N/B	730,000.00	695,382.02
US TREASURY N/B	400,000.00	376,906.24
US TREASURY N/B	340,000.00	329,255.46
US TREASURY N/B	960,000.00	897,187.49
US TREASURY N/B	490,000.00	464,007.02
US TREASURY N/B	250,000.00	241,484.37
US TREASURY N/B	1,160,000.00	1,066,928.11
US TREASURY N/B	600,000.00	578,531.25
US TREASURY N/B	250,000.00	242,412.11
US TREASURY N/B	1,060,000.00	968,906.25
US TREASURY N/B	570,000.00	542,724.61
US TREASURY N/B	880,000.00	850,575.00
US TREASURY N/B	240,000.00	232,528.12
US TREASURY N/B	850,000.00	772,371.09
US TREASURY N/B	900,000.00	872,226.55
US TREASURY N/B	290,000.00	280,439.06
US TREASURY N/B	650,000.00	590,001.95
US TREASURY N/B	780,000.00	757,696.87
US TREASURY N/B	470,000.00	455,330.85
US TREASURY N/B	630,000.00	569,411.71
US TREASURY N/B	810,000.00	766,114.45
US TREASURY N/B	300,000.00	292,253.90
US TREASURY N/B	310,000.00	299,089.45
US TREASURY N/B	1,000,000.00	901,171.88

US TREASURY N/B	1,360,000.00	1,338,218.75	
US TREASURY N/B	230,000.00	223,243.75	
US TREASURY N/B	1,180,000.00	1,062,783.59	
US TREASURY N/B	500,000.00	501,757.81	
US TREASURY N/B	570,000.00	552,900.00	
US TREASURY N/B	770,000.00	690,533.59	
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,234,542.97	
US TREASURY N/B	480,000.00	463,706.25	
US TREASURY N/B	980,000.00	879,243.75	
US TREASURY N/B	300,000.00	287,906.25	
US TREASURY N/B	1,130,000.00	1,012,939.06	
US TREASURY N/B	330,000.00	316,503.51	
US TREASURY N/B	1,320,000.00	1,178,615.61	
US TREASURY N/B	1,060,000.00	984,516.40	
US TREASURY N/B	350,000.00	333,853.51	
US TREASURY N/B	1,360,000.00	1,216,296.87	
US TREASURY N/B	430,000.00	407,005.07	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	900,429.69	
US TREASURY N/B	450,000.00	427,113.27	
US TREASURY N/B	870,000.00	781,232.81	
US TREASURY N/B	880,000.00	813,553.12	
US TREASURY N/B	470,000.00	441,910.15	
US TREASURY N/B	1,090,000.00	976,742.18	
US TREASURY N/B	450,000.00	419,361.32	
US TREASURY N/B	280,000.00	251,551.56	
US TREASURY N/B	520,000.00	483,701.56	
US TREASURY N/B	1,050,000.00	932,531.25	
US TREASURY N/B	1,130,000.00	1,035,583.20	
US TREASURY N/B	320,000.00	291,812.49	
US TREASURY N/B	1,030,000.00	916,981.64	
US TREASURY N/B	400,000.00	368,046.87	
US TREASURY N/B	1,310,000.00	1,169,840.23	
US TREASURY N/B	350,000.00	321,453.12	
US TREASURY N/B	1,170,000.00	1,052,817.18	
US TREASURY N/B	850,000.00	791,064.45	

US TREASURY N/B	300,000.00	275,003.90	
US TREASURY N/B	1,210,000.00	1,092,544.92	
US TREASURY N/B	440,000.00	405,092.18	
US TREASURY N/B	900,000.00	811,195.30	
US TREASURY N/B	1,450,000.00	1,318,253.89	
US TREASURY N/B	140,000.00	131,250.00	
US TREASURY N/B	1,220,000.00	1,091,375.77	
US TREASURY N/B	470,000.00	433,538.28	
US TREASURY N/B	300,000.00	261,738.28	
US TREASURY N/B	1,040,000.00	983,937.50	
US TREASURY N/B	1,130,000.00	979,348.04	
US TREASURY N/B	350,000.00	334,455.07	
US TREASURY N/B	580,000.00	544,996.09	
US TREASURY N/B	1,120,000.00	966,918.74	
US TREASURY N/B	660,000.00	627,283.59	
US TREASURY N/B	1,180,000.00	1,016,413.28	
US TREASURY N/B	490,000.00	477,941.40	
US TREASURY N/B	250,000.00	213,730.47	
US TREASURY N/B	400,000.00	381,859.37	
US TREASURY N/B	800,000.00	746,328.12	
US TREASURY N/B	410,000.00	351,510.93	
US TREASURY N/B	650,000.00	631,236.32	
US TREASURY N/B	810,000.00	688,753.12	
US TREASURY N/B	580,000.00	587,929.69	
US TREASURY N/B	1,230,000.00	1,050,160.54	
US TREASURY N/B	1,360,000.00	1,378,912.50	
US TREASURY N/B	690,000.00	641,834.76	
US TREASURY N/B	1,180,000.00	1,011,757.81	
US TREASURY N/B	300,000.00	301,382.81	
US TREASURY N/B	1,040,000.00	889,768.75	
US TREASURY N/B	1,150,000.00	988,011.71	
US TREASURY N/B	850,000.00	807,898.43	
US TREASURY N/B	1,110,000.00	971,076.56	
US TREASURY N/B	980,000.00	861,289.84	
US TREASURY N/B	920,000.00	807,515.62	

US TREASURY N/B	840,000.00	802,216.40	
US TREASURY N/B	1,550,000.00	1,357,884.76	
US TREASURY N/B	1,220,000.00	1,066,928.12	
US TREASURY N/B	830,000.00	714,059.37	
US TREASURY N/B	1,170,000.00	1,115,407.61	
US TREASURY N/B	1,280,000.00	1,107,000.00	
US TREASURY N/B	920,000.00	800,076.56	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	874,804.69	
US TREASURY N/B	890,000.00	859,336.72	
US TREASURY N/B	1,110,000.00	977,016.79	
US TREASURY N/B	1,440,000.00	1,257,918.75	
US TREASURY N/B	890,000.00	792,760.54	
US TREASURY N/B	1,140,000.00	1,068,972.65	
US TREASURY N/B	1,520,000.00	1,364,556.25	
US TREASURY N/B	500,000.00	461,406.25	
US TREASURY N/B	510,000.00	484,689.25	
US TREASURY N/B	930,000.00	857,888.67	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	943,066.41	
US TREASURY N/B	480,000.00	466,218.74	
US TREASURY N/B	400,000.00	374,187.50	
US TREASURY N/B	850,000.00	748,531.25	
US TREASURY N/B	520,000.00	501,495.31	
US TREASURY N/B	710,000.00	716,656.25	
US TREASURY N/B	680,000.00	603,500.00	
US TREASURY N/B	500,000.00	505,156.25	
US TREASURY N/B	960,000.00	832,162.50	
US TREASURY N/B	120,000.00	139,532.81	
US TREASURY N/B	1,430,000.00	1,153,942.96	
US TREASURY N/B	1,720,000.00	1,379,896.86	
US TREASURY N/B	2,100,000.00	1,713,304.69	
US TREASURY N/B	160,000.00	179,187.50	
US TREASURY N/B	1,720,000.00	1,431,564.06	
US TREASURY N/B	2,070,000.00	1,778,744.54	
US TREASURY N/B	2,110,000.00	1,748,085.54	
US TREASURY N/B	2,050,000.00	1,706,785.14	

US TREASURY N/B	1,920,000.00	1,665,525.00	
US TREASURY N/B	1,510,000.00	1,424,118.75	
US TREASURY N/B	1,650,000.00	1,538,367.18	
US TREASURY N/B	570,000.00	595,471.87	
US TREASURY N/B	80,000.00	88,350.00	
US TREASURY N/B	90,000.00	104,222.46	
US TREASURY N/B	280,000.00	305,128.90	
US TREASURY N/B	100,000.00	110,498.04	
US TREASURY N/B	70,000.00	68,584.96	
US TREASURY N/B	140,000.00	150,051.56	
US TREASURY N/B	190,000.00	209,727.34	
US TREASURY N/B	40,000.00	43,457.81	
US TREASURY N/B	190,000.00	212,610.74	
US TREASURY N/B	210,000.00	227,579.29	
US TREASURY N/B	950,000.00	622,639.65	
US TREASURY N/B	150,000.00	152,291.01	
US TREASURY N/B	1,110,000.00	722,063.66	
US TREASURY N/B	210,000.00	223,518.75	
US TREASURY N/B	1,200,000.00	815,343.74	
US TREASURY N/B	230,000.00	260,542.38	
US TREASURY N/B	1,110,000.00	819,795.70	
US TREASURY N/B	250,000.00	270,234.37	
US TREASURY N/B	710,000.00	556,670.50	
US TREASURY N/B	230,000.00	228,054.88	
US TREASURY N/B	1,340,000.00	957,445.69	
US TREASURY N/B	130,000.00	117,413.86	
US TREASURY N/B	1,290,000.00	960,798.05	
US TREASURY N/B	180,000.00	162,390.23	
US TREASURY N/B	840,000.00	667,422.65	
US TREASURY N/B	200,000.00	176,164.06	
US TREASURY N/B	720,000.00	659,193.75	
US TREASURY N/B	200,000.00	168,503.90	
US TREASURY N/B	400,000.00	373,187.50	
US TREASURY N/B	870,000.00	731,666.59	
US TREASURY N/B	300,000.00	306,984.37	

US TREASURY N/B	320,000.00	285,975.00	
US TREASURY N/B	590,000.00	505,510.15	
US TREASURY N/B	360,000.00	347,076.56	
US TREASURY N/B	320,000.00	314,262.49	
US TREASURY N/B	410,000.00	395,361.72	
US TREASURY N/B	390,000.00	361,252.73	
US TREASURY N/B	430,000.00	382,246.48	
US TREASURY N/B	380,000.00	330,904.29	
US TREASURY N/B	530,000.00	422,095.31	
US TREASURY N/B	320,000.00	278,375.00	
US TREASURY N/B	410,000.00	348,740.23	
US TREASURY N/B	290,000.00	252,294.33	
US TREASURY N/B	530,000.00	420,708.20	
US TREASURY N/B	460,000.00	364,280.46	
US TREASURY N/B	620,000.00	466,816.40	
US TREASURY N/B	350,000.00	297,623.04	
US TREASURY N/B	570,000.00	495,321.09	
US TREASURY N/B	350,000.00	304,698.24	
US TREASURY N/B	620,000.00	516,028.90	
US TREASURY N/B	520,000.00	433,082.81	
US TREASURY N/B	640,000.00	559,324.99	
US TREASURY N/B	760,000.00	679,992.18	
US TREASURY N/B	630,000.00	551,902.15	
US TREASURY N/B	830,000.00	780,540.43	
US TREASURY N/B	810,000.00	713,385.35	
US TREASURY N/B	970,000.00	835,355.66	
US TREASURY N/B	800,000.00	605,171.87	
US TREASURY N/B	710,000.00	552,857.03	
US TREASURY N/B	860,000.00	614,261.71	
US TREASURY N/B	1,060,000.00	622,253.12	
US TREASURY N/B	1,150,000.00	697,636.71	
US TREASURY N/B	1,330,000.00	863,097.26	
US TREASURY N/B	1,140,000.00	788,025.00	
US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,087,078.13	
US TREASURY N/B	1,380,000.00	982,522.27	

	US TREASURY N/B	1,050,000.00	723,454.10	
	US TREASURY N/B	990,000.00	747,836.71	
	US TREASURY N/B	1,050,000.00	909,890.62	
	US TREASURY N/B	960,000.00	855,750.00	
	US TREASURY N/B	200,000.00	215,375.00	
	米ドル 小計	195,920,000.00	175,466,931.11 (23,996,857,498)	
カナダドル	GOV OF CANADA	130,000.00	125,244.47	
	GOV OF CANADA	210,000.00	205,628.85	
	GOV OF CANADA	530,000.00	505,302.53	
	GOV OF CANADA	100,000.00	96,668.00	
	GOV OF CANADA	170,000.00	166,606.12	
	GOV OF CANADA	230,000.00	225,774.44	
	GOV OF CANADA	180,000.00	173,107.98	
	GOV OF CANADA	160,000.00	151,548.96	
	GOV OF CANADA	270,000.00	265,950.81	
	GOV OF CANADA	200,000.00	189,698.20	
	GOV OF CANADA	190,000.00	180,885.32	
	GOV OF CANADA	150,000.00	145,450.05	
	GOV OF CANADA	590,000.00	543,630.13	
	GOV OF CANADA	110,000.00	108,410.06	
	GOV OF CANADA	350,000.00	316,651.65	
	GOV OF CANADA	130,000.00	122,555.94	
	GOV OF CANADA	360,000.00	331,463.16	
	GOV OF CANADA	400,000.00	370,146.40	
	GOV OF CANADA	160,000.00	146,770.40	
	GOV OF CANADA	190,000.00	187,481.36	
	GOV OF CANADA	40,000.00	40,950.80	
	GOV OF CANADA	150,000.00	143,489.40	
	GOV OF CANADA	120,000.00	140,415.96	
	GOV OF CANADA	130,000.00	125,677.76	
	GOV OF CANADA	80,000.00	77,239.20	
	GOV OF CANADA	590,000.00	527,229.31	
	GOV OF CANADA	470,000.00	391,930.65	
	GOV OF CANADA	670,000.00	602,042.57	

	GOV OF CANADA	570,000.00	509,240.85
	GOV OF CANADA	370,000.00	343,883.18
	GOV OF CANADA	230,000.00	222,874.37
	GOV OF CANADA	160,000.00	200,831.84
	GOV OF CANADA	120,000.00	149,071.20
	GOV OF CANADA	140,000.00	161,371.56
	GOV OF CANADA	200,000.00	220,802.80
	GOV OF CANADA	200,000.00	197,020.80
	GOV OF CANADA	730,000.00	613,410.97
	GOV OF CANADA	430,000.00	337,612.35
	GOV OF CANADA	110,000.00	108,890.76
	カナダドル 小計	10,320,000.00	9,672,961.16 (968,263,412)
メキシコペソ	UNITED MEXICAN STATE	4,070,000.00	3,968,763.83
	UNITED MEXICAN STATE	6,100,000.00	5,928,980.15
	UNITED MEXICAN STATE	4,770,000.00	4,784,843.52
	UNITED MEXICAN STATE	950,000.00	862,410.00
	UNITED MEXICAN STATE	7,470,000.00	6,777,829.80
	UNITED MEXICAN STATE	1,860,000.00	1,641,003.60
	UNITED MEXICAN STATE	5,980,000.00	5,680,282.40
	UNITED MEXICAN STATE	5,130,000.00	5,036,531.40
	UNITED MEXICAN STATE	7,560,000.00	7,034,088.60
	UNITED MEXICAN STATE	1,810,000.00	1,642,520.70
	UNITED MEXICAN STATE	1,470,000.00	1,589,408.10
	UNITED MEXICAN STATE	3,980,000.00	3,792,382.80
	UNITED MEXICAN STATE	4,230,000.00	3,713,094.00
	UNITED MEXICAN STATE	4,350,000.00	3,928,876.50
	UNITED MEXICAN STATE	770,000.00	695,268.11
	メキシコペソ 小計	60,500,000.00	57,076,283.51 (394,745,284)
ユーロ	GOV OF AUSTRIA	190,000.00	183,599.88
	GOV OF AUSTRIA	240,000.00	237,912.72
	GOV OF AUSTRIA	110,000.00	104,482.91
	GOV OF AUSTRIA	260,000.00	253,840.08
	GOV OF AUSTRIA	120,000.00	130,384.56
	GOV OF AUSTRIA	80,000.00	79,591.92

GOV OF AUSTRIA	310,000.00	295,197.50	
GOV OF AUSTRIA	220,000.00	205,066.40	
GOV OF AUSTRIA	130,000.00	153,450.70	
GOV OF AUSTRIA	220,000.00	204,494.40	
GOV OF AUSTRIA	60,000.00	52,483.74	
GOV OF AUSTRIA	230,000.00	206,203.97	
GOV OF AUSTRIA	190,000.00	160,171.90	
GOV OF AUSTRIA	250,000.00	205,066.50	
GOV OF AUSTRIA	150,000.00	130,324.65	
GOV OF AUSTRIA	160,000.00	158,117.44	
GOV OF AUSTRIA	120,000.00	87,935.52	
GOV OF AUSTRIA	260,000.00	308,315.02	
GOV OF AUSTRIA	130,000.00	83,233.41	
GOV OF AUSTRIA	160,000.00	177,933.92	
GOV OF AUSTRIA	90,000.00	74,978.28	
GOV OF AUSTRIA	80,000.00	71,363.52	
GOV OF AUSTRIA	110,000.00	73,618.82	
GOV OF AUSTRIA	70,000.00	93,312.45	
GOV OF AUSTRIA	60,000.00	32,595.66	
GOV OF AUSTRIA	80,000.00	40,661.36	
GOV OF AUSTRIA	104,000.00	91,078.72	
GOV OF AUSTRIA	50,000.00	36,629.85	
GOV OF BELGIUM	290,000.00	291,466.53	
GOV OF BELGIUM	170,000.00	164,811.94	
GOV OF BELGIUM	420,000.00	406,385.70	
GOV OF BELGIUM	190,000.00	204,520.18	
GOV OF BELGIUM	290,000.00	279,192.57	
GOV OF BELGIUM	270,000.00	254,203.65	
GOV OF BELGIUM	170,000.00	152,709.64	
GOV OF BELGIUM	350,000.00	408,632.35	
GOV OF BELGIUM	240,000.00	223,153.20	
GOV OF BELGIUM	360,000.00	330,570.00	
GOV OF BELGIUM	250,000.00	212,270.41	
GOV OF BELGIUM	340,000.00	304,152.10	
GOV OF BELGIUM	330,000.00	266,607.00	

GOV OF BELGIUM	110,000.00	123,540.34	
GOV OF BELGIUM	190,000.00	155,591.05	
GOV OF BELGIUM	150,000.00	133,310.40	
GOV OF BELGIUM	160,000.00	166,009.92	
GOV OF BELGIUM	370,000.00	460,299.24	
GOV OF BELGIUM	140,000.00	119,368.06	
GOV OF BELGIUM	180,000.00	161,853.84	
GOV OF BELGIUM	40,000.00	40,070.12	
GOV OF BELGIUM	150,000.00	101,686.65	
GOV OF BELGIUM	310,000.00	375,524.45	
GOV OF BELGIUM	170,000.00	199,689.82	
GOV OF BELGIUM	210,000.00	170,076.90	
GOV OF BELGIUM	200,000.00	162,689.20	
GOV OF BELGIUM	150,000.00	111,270.75	
GOV OF BELGIUM	90,000.00	83,178.73	
GOV OF BELGIUM	150,000.00	135,744.00	
GOV OF BELGIUM	100,000.00	50,531.80	
GOV OF FINLAND	50,000.00	49,942.88	
GOV OF FINLAND	130,000.00	125,341.84	
GOV OF FINLAND	80,000.00	83,826.72	
GOV OF FINLAND	100,000.00	96,713.80	
GOV OF FINLAND	130,000.00	123,206.17	
GOV OF FINLAND	80,000.00	73,653.96	
GOV OF FINLAND	40,000.00	38,454.56	
GOV OF FINLAND	120,000.00	110,418.04	
GOV OF FINLAND	70,000.00	71,665.58	
GOV OF FINLAND	140,000.00	126,347.62	
GOV OF FINLAND	120,000.00	106,107.31	
GOV OF FINLAND	120,000.00	99,672.12	
GOV OF FINLAND	60,000.00	52,413.06	
GOV OF FINLAND	100,000.00	82,052.20	
GOV OF FINLAND	20,000.00	18,293.00	
GOV OF FINLAND	80,000.00	69,036.96	
GOV OF FINLAND	80,000.00	58,341.92	
GOV OF FINLAND	70,000.00	47,422.30	

GOV OF FINLAND	110,000.00	112,313.85	
GOV OF FINLAND	100,000.00	69,065.40	
GOV OF FINLAND	70,000.00	58,246.86	
GOV OF FINLAND	70,000.00	39,123.70	
GOV OF FRANCE	460,000.00	448,252.33	
GOV OF FRANCE	720,000.00	699,791.04	
GOV OF FRANCE	710,000.00	709,901.66	
GOV OF FRANCE	700,000.00	693,174.30	
GOV OF FRANCE	460,000.00	437,857.10	
GOV OF FRANCE	890,000.00	845,875.11	
GOV OF FRANCE	770,000.00	738,841.18	
GOV OF FRANCE	340,000.00	375,882.58	
GOV OF FRANCE	890,000.00	861,034.95	
GOV OF FRANCE	1,010,000.00	942,755.21	
GOV OF FRANCE	550,000.00	573,137.40	
GOV OF FRANCE	900,000.00	850,850.10	
GOV OF FRANCE	810,000.00	752,517.54	
GOV OF FRANCE	700,000.00	640,014.90	
GOV OF FRANCE	560,000.00	532,873.60	
GOV OF FRANCE	940,000.00	965,693.96	
GOV OF FRANCE	540,000.00	501,647.04	
GOV OF FRANCE	1,020,000.00	945,117.72	
GOV OF FRANCE	1,020,000.00	939,114.00	
GOV OF FRANCE	620,000.00	740,737.56	
GOV OF FRANCE	940,000.00	845,227.32	
GOV OF FRANCE	920,000.00	790,497.12	
GOV OF FRANCE	940,000.00	959,991.92	
GOV OF FRANCE	940,000.00	788,314.08	
GOV OF FRANCE	1,030,000.00	974,092.63	
GOV OF FRANCE	780,000.00	637,056.42	
GOV OF FRANCE	590,000.00	473,986.53	
GOV OF FRANCE	720,000.00	933,027.84	
GOV OF FRANCE	410,000.00	396,155.94	
GOV OF FRANCE	720,000.00	628,578.00	
GOV OF FRANCE	580,000.00	712,321.20	

GOV OF FRANCE	630,000.00	534,648.87	
GOV OF FRANCE	130,000.00	107,650.01	
GOV OF FRANCE	480,000.00	565,715.04	
GOV OF FRANCE	480,000.00	429,700.80	
GOV OF FRANCE	360,000.00	253,961.28	
GOV OF FRANCE	730,000.00	925,171.34	
GOV OF FRANCE	130,000.00	127,172.11	
GOV OF FRANCE	280,000.00	186,583.88	
GOV OF FRANCE	520,000.00	576,477.20	
GOV OF FRANCE	530,000.00	473,401.30	
GOV OF FRANCE	590,000.00	470,471.90	
GOV OF FRANCE	570,000.00	365,570.64	
GOV OF FRANCE	430,000.00	270,251.56	
GOV OF FRANCE	370,000.00	482,054.50	
GOV OF FRANCE	290,000.00	389,428.41	
GOV OF FRANCE	280,000.00	231,675.68	
GOV OF FRANCE	170,000.00	82,124.96	
GOV OF GERMANY	370,000.00	362,601.85	
GOV OF GERMANY	440,000.00	438,801.00	
GOV OF GERMANY	260,000.00	253,466.20	
GOV OF GERMANY	430,000.00	418,906.00	
GOV OF GERMANY	410,000.00	407,064.40	
GOV OF GERMANY	290,000.00	281,971.06	
GOV OF GERMANY	480,000.00	471,971.04	
GOV OF GERMANY	300,000.00	291,247.31	
GOV OF GERMANY	440,000.00	423,825.91	
GOV OF GERMANY	110,000.00	110,117.37	
GOV OF GERMANY	640,000.00	619,516.80	
GOV OF GERMANY	370,000.00	353,189.05	
GOV OF GERMANY	490,000.00	477,478.37	
GOV OF GERMANY	510,000.00	482,692.56	
GOV OF GERMANY	650,000.00	621,415.60	
GOV OF GERMANY	470,000.00	441,202.06	
GOV OF GERMANY	570,000.00	531,795.18	
GOV OF GERMANY	380,000.00	352,986.56	

GOV OF GERMANY	660,000.00	616,918.83
GOV OF GERMANY	370,000.00	340,445.75
GOV OF GERMANY	140,000.00	167,540.38
GOV OF GERMANY	550,000.00	516,260.80
GOV OF GERMANY	530,000.00	514,698.90
GOV OF GERMANY	550,000.00	501,523.00
GOV OF GERMANY	170,000.00	200,144.23
GOV OF GERMANY	510,000.00	475,770.84
GOV OF GERMANY	190,000.00	218,026.71
GOV OF GERMANY	550,000.00	502,480.00
GOV OF GERMANY	470,000.00	421,355.94
GOV OF GERMANY	530,000.00	480,984.54
GOV OF GERMANY	570,000.00	504,041.88
GOV OF GERMANY	160,000.00	162,030.67
GOV OF GERMANY	210,000.00	270,016.32
GOV OF GERMANY	450,000.00	394,013.25
GOV OF GERMANY	530,000.00	460,228.68
GOV OF GERMANY	170,000.00	147,622.56
GOV OF GERMANY	370,000.00	467,155.71
GOV OF GERMANY	460,000.00	395,052.60
GOV OF GERMANY	800,000.00	680,580.80
GOV OF GERMANY	520,000.00	437,584.68
GOV OF GERMANY	420,000.00	411,917.52
GOV OF GERMANY	390,000.00	503,489.61
GOV OF GERMANY	390,000.00	305,839.56
GOV OF GERMANY	420,000.00	323,360.60
GOV OF GERMANY	540,000.00	675,749.52
GOV OF GERMANY	110,000.00	95,997.33
GOV OF GERMANY	340,000.00	449,590.16
GOV OF GERMANY	370,000.00	523,475.63
GOV OF GERMANY	320,000.00	391,510.08
GOV OF GERMANY	460,000.00	515,793.40
GOV OF GERMANY	600,000.00	686,023.20
GOV OF GERMANY	560,000.00	508,113.76
GOV OF GERMANY	640,000.00	405,838.08

GOV OF GERMANY	130,000.00	82,596.02	
GOV OF GERMANY	290,000.00	178,239.35	
GOV OF GERMANY	140,000.00	142,353.68	
GOV OF IRELAND	130,000.00	132,112.57	
GOV OF IRELAND	200,000.00	214,099.20	
GOV OF IRELAND	170,000.00	164,247.54	
GOV OF IRELAND	160,000.00	147,044.58	
GOV OF IRELAND	150,000.00	140,249.85	
GOV OF IRELAND	200,000.00	186,727.86	
GOV OF IRELAND	160,000.00	161,875.04	
GOV OF IRELAND	150,000.00	127,893.90	
GOV OF IRELAND	120,000.00	112,020.60	
GOV OF IRELAND	160,000.00	130,556.32	
GOV OF IRELAND	50,000.00	41,261.55	
GOV OF IRELAND	110,000.00	98,563.00	
GOV OF IRELAND	90,000.00	69,790.68	
GOV OF IRELAND	130,000.00	116,567.10	
GOV OF IRELAND	80,000.00	56,203.52	
GOV OF IRELAND	190,000.00	171,052.44	
GOV OF IRELAND	110,000.00	89,058.42	
GOV OF ITALY	250,000.00	243,087.50	
GOV OF ITALY	450,000.00	437,145.75	
GOV OF ITALY	200,000.00	204,475.20	
GOV OF ITALY	400,000.00	386,731.67	
GOV OF ITALY	330,000.00	326,530.71	
GOV OF ITALY	250,000.00	246,709.27	
GOV OF ITALY	260,000.00	256,741.68	
GOV OF ITALY	250,000.00	239,502.30	
GOV OF ITALY	270,000.00	275,370.57	
GOV OF ITALY	330,000.00	323,185.83	
GOV OF ITALY	550,000.00	548,957.64	
GOV OF ITALY	170,000.00	161,697.20	
GOV OF ITALY	440,000.00	419,385.56	
GOV OF ITALY	370,000.00	388,960.42	
GOV OF ITALY	350,000.00	340,654.30	

GOV OF ITALY	220,000.00	213,826.66	
GOV OF ITALY	340,000.00	332,374.14	
GOV OF ITALY	120,000.00	114,967.80	
GOV OF ITALY	310,000.00	307,526.82	
GOV OF ITALY	320,000.00	312,491.15	
GOV OF ITALY	30,000.00	30,435.06	
GOV OF ITALY	380,000.00	352,576.54	
GOV OF ITALY	530,000.00	555,679.03	
GOV OF ITALY	250,000.00	226,735.69	
GOV OF ITALY	440,000.00	420,657.60	
GOV OF ITALY	330,000.00	320,450.46	
GOV OF ITALY	270,000.00	242,690.58	
GOV OF ITALY	400,000.00	374,691.13	
GOV OF ITALY	360,000.00	330,660.36	
GOV OF ITALY	280,000.00	258,040.79	
GOV OF ITALY	400,000.00	386,499.60	
GOV OF ITALY	410,000.00	391,868.16	
GOV OF ITALY	340,000.00	307,934.94	
GOV OF ITALY	450,000.00	519,601.50	
GOV OF ITALY	170,000.00	165,547.58	
GOV OF ITALY	500,000.00	472,389.00	
GOV OF ITALY	400,000.00	342,148.00	
GOV OF ITALY	420,000.00	360,518.76	
GOV OF ITALY	350,000.00	376,841.50	
GOV OF ITALY	440,000.00	429,000.00	
GOV OF ITALY	300,000.00	251,342.70	
GOV OF ITALY	210,000.00	202,251.12	
GOV OF ITALY	440,000.00	430,380.72	
GOV OF ITALY	480,000.00	537,093.12	
GOV OF ITALY	510,000.00	513,037.56	
GOV OF ITALY	410,000.00	354,187.93	
GOV OF ITALY	350,000.00	289,736.65	
GOV OF ITALY	490,000.00	425,333.91	
GOV OF ITALY	520,000.00	421,226.00	
GOV OF ITALY	400,000.00	471,877.60	

GOV OF ITALY	390,000.00	304,019.82	
GOV OF ITALY	370,000.00	294,450.81	
GOV OF ITALY	440,000.00	372,075.00	
GOV OF ITALY	340,000.00	267,189.00	
GOV OF ITALY	310,000.00	277,636.00	
GOV OF ITALY	340,000.00	394,566.60	
GOV OF ITALY	80,000.00	83,172.00	
GOV OF ITALY	350,000.00	306,343.80	
GOV OF ITALY	430,000.00	470,953.63	
GOV OF ITALY	260,000.00	244,539.10	
GOV OF ITALY	150,000.00	150,975.81	
GOV OF ITALY	210,000.00	158,644.92	
GOV OF ITALY	320,000.00	266,912.64	
GOV OF ITALY	510,000.00	516,624.90	
GOV OF ITALY	270,000.00	186,476.58	
GOV OF ITALY	110,000.00	100,892.22	
GOV OF ITALY	320,000.00	283,685.12	
GOV OF ITALY	400,000.00	449,600.00	
GOV OF ITALY	280,000.00	250,136.60	
GOV OF ITALY	380,000.00	430,010.66	
GOV OF ITALY	290,000.00	210,979.06	
GOV OF ITALY	340,000.00	379,530.10	
GOV OF ITALY	230,000.00	150,622.40	
GOV OF ITALY	280,000.00	254,673.16	
GOV OF ITALY	310,000.00	257,473.91	
GOV OF ITALY	340,000.00	319,197.78	
GOV OF ITALY	230,000.00	229,901.56	
GOV OF ITALY	280,000.00	216,189.40	
GOV OF ITALY	270,000.00	176,743.62	
GOV OF ITALY	120,000.00	85,612.03	
GOV OF ITALY	160,000.00	125,896.48	
GOV OF ITALY	90,000.00	59,574.06	
GOV OF NETHERLANDS	280,000.00	273,750.96	
GOV OF NETHERLANDS	290,000.00	289,551.25	
GOV OF NETHERLANDS	380,000.00	362,593.10	

GOV OF NETHERLANDS	80,000.00	74,947.63	
GOV OF NETHERLANDS	360,000.00	340,870.32	
GOV OF NETHERLANDS	280,000.00	257,501.16	
GOV OF NETHERLANDS	300,000.00	283,172.70	
GOV OF NETHERLANDS	210,000.00	244,228.53	
GOV OF NETHERLANDS	330,000.00	307,406.88	
GOV OF NETHERLANDS	160,000.00	140,823.52	
GOV OF NETHERLANDS	210,000.00	186,159.96	
GOV OF NETHERLANDS	260,000.00	221,952.12	
GOV OF NETHERLANDS	270,000.00	225,400.05	
GOV OF NETHERLANDS	120,000.00	102,598.44	
GOV OF NETHERLANDS	250,000.00	256,512.25	
GOV OF NETHERLANDS	330,000.00	399,539.25	
GOV OF NETHERLANDS	130,000.00	93,643.81	
GOV OF NETHERLANDS	260,000.00	198,989.96	
GOV OF NETHERLANDS	330,000.00	411,059.55	
GOV OF NETHERLANDS	370,000.00	422,363.51	
GOV OF NETHERLANDS	240,000.00	141,274.08	
GOV OF NETHERLANDS	80,000.00	80,873.28	
GOV OF SPAIN	290,000.00	298,260.36	
GOV OF SPAIN	400,000.00	408,166.72	
GOV OF SPAIN	370,000.00	357,522.17	
GOV OF SPAIN	310,000.00	299,850.60	
GOV OF SPAIN	390,000.00	392,939.82	
GOV OF SPAIN	370,000.00	352,262.57	
GOV OF SPAIN	470,000.00	462,393.05	
GOV OF SPAIN	260,000.00	245,132.89	
GOV OF SPAIN	340,000.00	360,107.94	
GOV OF SPAIN	480,000.00	478,209.60	
GOV OF SPAIN	410,000.00	380,421.66	
GOV OF SPAIN	420,000.00	414,235.92	
GOV OF SPAIN	360,000.00	404,541.36	
GOV OF SPAIN	500,000.00	480,398.53	
GOV OF SPAIN	340,000.00	307,209.72	
GOV OF SPAIN	390,000.00	375,054.56	

GOV OF SPAIN	380,000.00	352,283.18	
GOV OF SPAIN	440,000.00	419,166.88	
GOV OF SPAIN	300,000.00	263,624.10	
GOV OF SPAIN	450,000.00	424,318.95	
GOV OF SPAIN	390,000.00	366,723.24	
GOV OF SPAIN	360,000.00	409,704.48	
GOV OF SPAIN	410,000.00	490,198.87	
GOV OF SPAIN	410,000.00	383,035.94	
GOV OF SPAIN	170,000.00	150,844.23	
GOV OF SPAIN	430,000.00	376,279.24	
GOV OF SPAIN	420,000.00	360,016.02	
GOV OF SPAIN	410,000.00	389,299.92	
GOV OF SPAIN	480,000.00	430,886.88	
GOV OF SPAIN	440,000.00	353,503.04	
GOV OF SPAIN	410,000.00	336,264.78	
GOV OF SPAIN	410,000.00	337,894.12	
GOV OF SPAIN	390,000.00	487,666.92	
GOV OF SPAIN	210,000.00	203,112.63	
GOV OF SPAIN	440,000.00	416,889.96	
GOV OF SPAIN	420,000.00	367,257.66	
GOV OF SPAIN	360,000.00	405,392.40	
GOV OF SPAIN	230,000.00	166,726.31	
GOV OF SPAIN	350,000.00	431,788.70	
GOV OF SPAIN	290,000.00	209,735.25	
GOV OF SPAIN	400,000.00	486,025.60	
GOV OF SPAIN	80,000.00	54,736.80	
GOV OF SPAIN	70,000.00	71,478.12	
GOV OF SPAIN	270,000.00	354,546.45	
GOV OF SPAIN	340,000.00	326,414.96	
GOV OF SPAIN	300,000.00	275,019.60	
GOV OF SPAIN	380,000.00	230,128.76	
GOV OF SPAIN	180,000.00	133,862.22	
GOV OF SPAIN	270,000.00	279,642.78	
GOV OF SPAIN	100,000.00	56,191.90	
ゴロ小計	118,064,000.00	112,522,766.21	

英ポンド	UK TREASURY	570,000.00	549,342.97
	UK TREASURY	280,000.00	271,207.88
	UK TREASURY	210,000.00	207,404.61
	UK TREASURY	510,000.00	475,639.66
	UK TREASURY	250,000.00	259,018.72
	UK TREASURY	240,000.00	225,228.00
	UK TREASURY	250,000.00	241,702.00
	UK TREASURY	240,000.00	218,601.84
	UK TREASURY	250,000.00	235,470.00
	UK TREASURY	380,000.00	340,670.00
	UK TREASURY	210,000.00	215,540.22
	UK TREASURY	220,000.00	201,487.00
	UK TREASURY	280,000.00	292,874.79
	UK TREASURY	230,000.00	196,728.20
	UK TREASURY	280,000.00	257,294.10
	UK TREASURY	140,000.00	160,450.97
	UK TREASURY	370,000.00	313,612.00
	UK TREASURY	260,000.00	224,016.00
	UK TREASURY	300,000.00	241,755.00
	UK TREASURY	280,000.00	311,605.00
	UK TREASURY	470,000.00	365,401.50
	UK TREASURY	510,000.00	419,628.00
	UK TREASURY	350,000.00	380,884.00
	UK TREASURY	270,000.00	211,315.50
	UK TREASURY	220,000.00	245,022.84
	UK TREASURY	390,000.00	278,989.23
	UK TREASURY	270,000.00	293,282.10
	UK TREASURY	330,000.00	262,838.40
	UK TREASURY	80,000.00	81,713.60
	UK TREASURY	280,000.00	320,222.28
	UK TREASURY	240,000.00	168,229.04
	UK TREASURY	210,000.00	226,712.01
	UK TREASURY	240,000.00	259,233.60
UK TREASURY	390,000.00	265,828.75	
	340,000.00	381,982.52	

	UK TREASURY			
	UK TREASURY	320,000.00	300,776.90	
	UK TREASURY	360,000.00	351,687.60	
	UK TREASURY	210,000.00	120,201.19	
	UK TREASURY	300,000.00	328,776.00	
	UK TREASURY	300,000.00	196,597.56	
	UK TREASURY	210,000.00	144,808.18	
	UK TREASURY	210,000.00	232,409.10	
	UK TREASURY	180,000.00	87,973.20	
	UK TREASURY	300,000.00	176,400.00	
	UK TREASURY	240,000.00	247,393.44	
	UK TREASURY	150,000.00	93,267.83	
	UK TREASURY	240,000.00	154,003.20	
	UK TREASURY	300,000.00	342,435.00	
	UK TREASURY	320,000.00	213,728.00	
	UK TREASURY	220,000.00	247,814.60	
	UK TREASURY	280,000.00	113,134.00	
	UK TREASURY	250,000.00	205,802.50	
	UK TREASURY	280,000.00	293,650.00	
	UK TREASURY	210,000.00	130,878.30	
	UK TREASURY	170,000.00	84,551.20	
	英ポンド 小計	15,390,000.00	13,667,220.13	(2,285,159,205)
スウェーデンクローナ	GOV OF SWEDEN	1,320,000.00	1,325,770.63	
	GOV OF SWEDEN	1,470,000.00	1,413,079.17	
	GOV OF SWEDEN	1,060,000.00	1,000,682.19	
	GOV OF SWEDEN	1,200,000.00	1,118,340.00	
	GOV OF SWEDEN	930,000.00	813,628.67	
	GOV OF SWEDEN	790,000.00	829,105.00	
	GOV OF SWEDEN	780,000.00	991,867.96	
	スウェーデンクローナ 小計	7,550,000.00	7,492,473.62	(98,975,576)
ノルウェークローネ	GOV OF NORWAY	1,210,000.00	1,209,710.24	
	GOV OF NORWAY	1,040,000.00	1,013,061.92	
	GOV OF NORWAY	930,000.00	890,765.16	
	GOV OF NORWAY	750,000.00	718,121.85	

	GOV OF NORWAY	720,000.00	690,991.20
	GOV OF NORWAY	890,000.00	832,567.94
	GOV OF NORWAY	1,060,000.00	953,676.70
	GOV OF NORWAY	640,000.00	560,835.84
	GOV OF NORWAY	540,000.00	506,680.59
	ノルウェークロネ 小計	7,780,000.00	7,376,411.44 (100,835,544)
デンマーククロネ	GOV OF DENMARK	950,000.00	910,171.25
	GOV OF DENMARK	860,000.00	849,661.76
	GOV OF DENMARK	1,160,000.00	1,073,416.09
	GOV OF DENMARK	1,240,000.00	1,112,405.48
	GOV OF DENMARK	1,170,000.00	968,376.04
	GOV OF DENMARK	2,090,000.00	2,815,779.67
	GOV OF DENMARK	910,000.00	594,360.90
	デンマーククロネ 小計	8,380,000.00	8,324,171.19 (160,906,229)
ポーランドズロチ	GOV OF POLAND	520,000.00	491,972.00
	GOV OF POLAND	140,000.00	125,657.00
	GOV OF POLAND	740,000.00	683,495.82
	GOV OF POLAND	570,000.00	497,923.50
	GOV OF POLAND	700,000.00	642,775.00
	GOV OF POLAND	840,000.00	728,162.40
	GOV OF POLAND	570,000.00	447,729.30
	GOV OF POLAND	430,000.00	383,538.50
	GOV OF POLAND	610,000.00	515,175.50
	GOV OF POLAND	590,000.00	492,024.60
	GOV OF POLAND	190,000.00	184,224.00
	GOV OF POLAND	820,000.00	657,783.50
	GOV OF POLAND	620,000.00	426,560.00
	GOV OF POLAND	520,000.00	353,470.00
		ポーランドズロチ 小計	7,860,000.00
オーストラリアドル	GOV OF AUSTRALIA	280,000.00	278,812.23
	GOV OF AUSTRALIA	510,000.00	483,336.97
	GOV OF AUSTRALIA	330,000.00	331,993.62

	GOV OF AUSTRALIA	310,000.00	286,047.37
	GOV OF AUSTRALIA	380,000.00	394,468.57
	GOV OF AUSTRALIA	420,000.00	381,767.09
	GOV OF AUSTRALIA	330,000.00	352,166.49
	GOV OF AUSTRALIA	330,000.00	324,579.64
	GOV OF AUSTRALIA	230,000.00	219,861.04
	GOV OF AUSTRALIA	200,000.00	195,657.18
	GOV OF AUSTRALIA	340,000.00	341,585.08
	GOV OF AUSTRALIA	330,000.00	320,893.89
	GOV OF AUSTRALIA	410,000.00	390,604.09
	GOV OF AUSTRALIA	310,000.00	261,009.15
	GOV OF AUSTRALIA	450,000.00	391,226.14
	GOV OF AUSTRALIA	590,000.00	486,485.51
	GOV OF AUSTRALIA	500,000.00	418,089.95
	GOV OF AUSTRALIA	420,000.00	365,384.02
	GOV OF AUSTRALIA	340,000.00	375,641.41
	GOV OF AUSTRALIA	280,000.00	271,623.78
	GOV OF AUSTRALIA	230,000.00	238,290.85
	GOV OF AUSTRALIA	190,000.00	176,786.46
	GOV OF AUSTRALIA	220,000.00	225,819.92
	GOV OF AUSTRALIA	190,000.00	182,194.30
	GOV OF AUSTRALIA	240,000.00	211,845.60
	GOV OF AUSTRALIA	240,000.00	215,650.70
	GOV OF AUSTRALIA	330,000.00	222,169.95
	オーストラリアドル 小計	8,930,000.00	8,343,991.00 (770,817,888)
ニュージーランドドル	GOV OF NEWZEALAND	150,000.00	141,075.04
	GOV OF NEWZEALAND	120,000.00	115,147.65
	GOV OF NEWZEALAND	150,000.00	131,716.76
	GOV OF NEWZEALAND	120,000.00	121,204.16
	GOV OF NEWZEALAND	100,000.00	81,259.85
	GOV OF NEWZEALAND	130,000.00	122,000.33
	GOV OF NEWZEALAND	120,000.00	98,282.66
	GOV OF NEWZEALAND	90,000.00	75,753.41
	GOV OF NEWZEALAND	80,000.00	76,257.90
	GOV OF NEWZEALAND	70,000.00	71,069.17

	GOV OF NEWZEALAND	100,000.00	84,418.54
	GOV OF NEWZEALAND	80,000.00	54,357.97
	GOV OF NEWZEALAND	80,000.00	61,007.07
	ニュージーランドドル 小計	1,390,000.00	1,233,550.51 (107,713,630)
シンガポールドル	GOV OF SINGAPORE	170,000.00	167,122.23
	GOV OF SINGAPORE	160,000.00	159,365.60
	GOV OF SINGAPORE	130,000.00	127,985.00
	GOV OF SINGAPORE	120,000.00	111,780.00
	GOV OF SINGAPORE	120,000.00	116,676.00
	GOV OF SINGAPORE	110,000.00	103,235.00
	GOV OF SINGAPORE	120,000.00	122,820.00
	GOV OF SINGAPORE	40,000.00	40,031.80
	GOV OF SINGAPORE	70,000.00	68,936.00
	GOV OF SINGAPORE	120,000.00	119,160.00
	GOV OF SINGAPORE	180,000.00	178,290.00
	GOV OF SINGAPORE	120,000.00	107,851.75
	GOV OF SINGAPORE	110,000.00	114,092.00
	GOV OF SINGAPORE	160,000.00	147,156.00
	GOV OF SINGAPORE	50,000.00	46,350.00
	GOV OF SINGAPORE	110,000.00	108,695.40
	GOV OF SINGAPORE	110,000.00	110,440.00
	GOV OF SINGAPORE	120,000.00	100,320.00
	GOV OF SINGAPORE	70,000.00	59,086.65
	GOV OF SINGAPORE	40,000.00	43,448.76
	シンガポールドル 小計	2,230,000.00	2,152,842.19 (217,307,890)
マレーシアリングgit	GOV OF MALAYSIA	260,000.00	260,276.22
	GOV OF MALAYSIA	270,000.00	273,095.06
	GOV OF MALAYSIA	240,000.00	242,306.06
	GOV OF MALAYSIA	100,000.00	100,536.51
	GOV OF MALAYSIA	520,000.00	523,961.04
	GOV OF MALAYSIA	210,000.00	214,196.19
	GOV OF MALAYSIA	280,000.00	280,979.60
	GOV OF MALAYSIA	440,000.00	441,438.97

	GOV OF MALAYSIA	270,000.00	265,782.45
	GOV OF MALAYSIA	620,000.00	621,199.76
	GOV OF MALAYSIA	80,000.00	79,216.09
	GOV OF MALAYSIA	160,000.00	164,534.00
	GOV OF MALAYSIA	470,000.00	467,657.44
	GOV OF MALAYSIA	250,000.00	257,947.57
	GOV OF MALAYSIA	430,000.00	387,773.82
	GOV OF MALAYSIA	210,000.00	212,578.77
	GOV OF MALAYSIA	110,000.00	105,726.38
	GOV OF MALAYSIA	190,000.00	185,242.77
	GOV OF MALAYSIA	280,000.00	292,470.58
	GOV OF MALAYSIA	420,000.00	408,046.58
	GOV OF MALAYSIA	220,000.00	221,140.45
	GOV OF MALAYSIA	330,000.00	349,276.75
	GOV OF MALAYSIA	150,000.00	160,508.16
	GOV OF MALAYSIA	500,000.00	465,393.82
	GOV OF MALAYSIA	180,000.00	187,722.61
	GOV OF MALAYSIA	140,000.00	150,005.39
	GOV OF MALAYSIA	180,000.00	187,788.99
	GOV OF MALAYSIA	250,000.00	267,300.87
	GOV OF MALAYSIA	460,000.00	430,671.29
	マレーシアリングット 小計	8,220,000.00	8,204,774.19 (254,290,566)
中国元	GOV OF CHINA	4,260,000.00	4,258,737.97
	GOV OF CHINA	3,270,000.00	3,293,892.58
	GOV OF CHINA	1,560,000.00	1,555,364.02
	GOV OF CHINA	2,470,000.00	2,473,320.17
	GOV OF CHINA	1,300,000.00	1,290,707.30
	GOV OF CHINA	2,200,000.00	2,193,607.59
	GOV OF CHINA	1,930,000.00	1,907,303.20
	GOV OF CHINA	3,140,000.00	3,119,662.06
	GOV OF CHINA	1,700,000.00	1,685,413.18
	GOV OF CHINA	3,540,000.00	3,591,497.08
	GOV OF CHINA	4,480,000.00	4,548,913.15
	GOV OF CHINA	4,650,000.00	4,660,245.34
	GOV OF CHINA	2,990,000.00	2,953,214.20

	GOV OF CHINA	2,740,000.00	2,719,358.00	
	GOV OF CHINA	3,130,000.00	3,149,020.68	
	GOV OF CHINA	1,700,000.00	1,684,572.50	
	GOV OF CHINA	2,080,000.00	2,143,260.49	
	GOV OF CHINA	4,070,000.00	4,128,137.91	
	GOV OF CHINA	2,860,000.00	2,878,497.33	
	GOV OF CHINA	2,250,000.00	2,247,970.56	
	GOV OF CHINA	2,320,000.00	2,310,202.68	
	GOV OF CHINA	2,880,000.00	2,837,736.00	
	GOV OF CHINA	3,530,000.00	3,486,754.07	
	GOV OF CHINA	2,140,000.00	2,206,700.80	
	GOV OF CHINA	2,040,000.00	2,063,212.14	
	GOV OF CHINA	1,200,000.00	1,200,342.96	
	GOV OF CHINA	1,260,000.00	1,247,083.75	
	GOV OF CHINA	2,460,000.00	2,429,500.15	
	GOV OF CHINA	1,400,000.00	1,373,806.00	
	GOV OF CHINA	500,000.00	486,693.62	
	GOV OF CHINA	740,000.00	833,712.26	
	GOV OF CHINA	860,000.00	935,601.22	
	GOV OF CHINA	950,000.00	955,031.86	
	GOV OF CHINA	1,950,000.00	2,112,125.92	
	GOV OF CHINA	1,340,000.00	1,423,795.42	
	GOV OF CHINA	1,880,000.00	1,940,019.00	
	GOV OF CHINA	2,150,000.00	2,162,529.98	
	中国元 小計	85,920,000.00	86,487,543.14 (1,699,419,681)	
イスラエルシュケル	GOV OF ISRAEL	260,000.00	255,853.00	
	GOV OF ISRAEL	300,000.00	308,985.00	
	GOV OF ISRAEL	250,000.00	236,262.50	
	GOV OF ISRAEL	430,000.00	402,716.50	
	GOV OF ISRAEL	280,000.00	269,542.00	
	GOV OF ISRAEL	190,000.00	175,161.00	
	GOV OF ISRAEL	260,000.00	288,548.00	
	GOV OF ISRAEL	380,000.00	364,477.00	
	GOV OF ISRAEL	320,000.00	304,608.00	

	GOV OF ISRAEL	490,000.00	420,934.50	
	GOV OF ISRAEL	70,000.00	59,444.00	
	GOV OF ISRAEL	350,000.00	276,885.00	
	GOV OF ISRAEL	340,000.00	451,758.00	
	GOV OF ISRAEL	430,000.00	457,176.00	
	イスラエルシユケル 小計	4,350,000.00	4,272,350.50	(170,430,469)
	合計		47,605,315,773	(47,605,315,773)

(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 263銘柄	100.0%	50.5%
カナダドル	国債証券 39銘柄	100.0%	2.0%
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%	34.0%
英ポンド	国債証券 55銘柄	100.0%	4.8%
スウェーデンクローナ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.2%
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 7銘柄	100.0%	0.3%
ポーランドズロチ	国債証券 14銘柄	100.0%	0.4%
オーストラリアドル	国債証券 27銘柄	100.0%	1.6%
ニュージーランドドル	国債証券 13銘柄	100.0%	0.2%
シンガポールドル	国債証券 20銘柄	100.0%	0.5%
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 37銘柄	100.0%	3.6%
イスラエルシユケル	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

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12月12日現在	
資産の部	
流動資産	
預金	264,930,558
コール・ローン	679,777,839
国債証券	228,041,065,910
派生商品評価勘定	1,709,419,586
未収入金	3,632,555
未収利息	1,255,226,662
前払費用	108,500,176
流動資産合計	232,062,553,286
資産合計	
232,062,553,286	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	463,155,123
未払金	55,551,680
未払解約金	6,100,000
未払利息	1,843
流動負債合計	524,808,646
負債合計	
524,808,646	
純資産の部	
元本等	
元本	259,708,895,692
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	28,171,151,052
元本等合計	231,537,744,640
純資産合計	
231,537,744,640	
負債純資産合計	232,062,553,286

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 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12月12日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年12月11日
期首元本額	289,108,179,101円
期中追加設定元本額	104,890,897,809円
期中一部解約元本額	134,290,181,218円
期末元本額	259,708,895,692円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	24,657,969,440円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	17,772,491,593円
りそなラップ型ファンド(成長型)	1,685,090,897円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	5,082,123,459円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	1,369,254,073円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	423,866,273円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	633,088,466円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	189,269,132円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	44,626,966円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	45,345,542円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	2,959,254,381円
FWりそな円建債券アクティブファンド	230,587,453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)	179,244,200,318円
Smart-i 先進国債券インデックス(為替ヘッジあり)	1,303,647,320円
Smart-i 8資産バランス 安定型	1,733,279,556円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	1,419,940,992円
Smart-i 8資産バランス 成長型	577,264,365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)	534,603,451円
りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	4,220,102,345円

りそなV I グローバル・バランスファンド(安定型)(適格機関投資家専用)	49,265,565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)	99,997,802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)	23,050,489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)	6,149,882,843円
りそなD A A ファンド202205(適格機関投資家専用)	1,131,911,046円
2. 計算日における受益権の総数	259,708,895,692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	28,171,151,052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	0.8915円
(10,000口当たり純資産額)	(8,915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12月12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12月12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12月12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12月12日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
国債証券		33,426,753,124
合計		33,426,753,124

（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12月12日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	時価	評価損益
			うち1年超	
市場取引以外	為替予約取引			

の取引	売建	229,375,192,231	-	228,128,927,768	1,246,264,463
	米ドル	115,838,358,942	-	114,326,734,295	1,511,624,647
	カナダドル	4,743,898,542	-	4,653,805,479	90,093,063
	メキシコペソ	2,019,716,872	-	1,942,618,545	77,098,327
	ユーロ	77,609,919,370	-	77,858,178,752	248,259,382
	英ポンド	11,027,062,859	-	11,114,640,899	87,578,040
	スウェーデンク ローナ	472,942,986	-	476,397,978	3,454,992
	ノルウェークロー ネ	484,523,785	-	477,487,884	7,035,901
	デンマーククロー ネ	770,110,452	-	772,523,312	2,412,860
	ポーランドズロチ	957,181,029	-	955,545,193	1,635,836
	オーストラリアド ル	3,701,209,881	-	3,688,743,553	12,466,328
	ニュージーランド ドル	510,739,130	-	518,413,979	7,674,849
	シンガポールドル	1,032,213,248	-	1,033,302,195	1,088,947
	マレーシアリン ギット	1,237,602,264	-	1,239,758,568	2,156,304
	中国元	8,127,569,910	-	8,236,592,278	109,022,368
	イスラエルシケ ル	842,142,961	-	834,184,858	7,958,103
	合計	229,375,192,231	-	228,128,927,768	1,246,264,463

(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

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	2,420,000.00	2,360,650.80	
		US TREASURY N/B	3,180,000.00	3,126,360.04	
		US TREASURY N/B	4,250,000.00	4,082,184.79	
		US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,910,875.34	
		US TREASURY N/B	1,920,000.00	1,872,245.60	
		US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,643,076.25	
		US TREASURY N/B	5,890,000.00	5,653,539.47	
		US TREASURY N/B	5,470,000.00	5,205,687.90	
		US TREASURY N/B	3,410,000.00	3,318,755.86	
		US TREASURY N/B	1,480,000.00	1,444,098.44	
		US TREASURY N/B	4,280,000.00	4,100,357.01	
		US TREASURY N/B	4,880,000.00	4,770,390.61	
		US TREASURY N/B	5,950,000.00	5,641,808.56	
		US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,746,000.00	
		US TREASURY N/B	3,360,000.00	3,270,093.75	
		US TREASURY N/B	5,590,000.00	5,380,375.00	
		US TREASURY N/B	6,130,000.00	5,801,949.24	
		US TREASURY N/B	2,350,000.00	2,275,093.75	
		US TREASURY N/B	2,800,000.00	2,714,632.81	
		US TREASURY N/B	4,280,000.00	4,043,931.25	
		US TREASURY N/B	2,320,000.00	2,237,984.38	
		US TREASURY N/B	2,940,000.00	2,845,483.58	
		US TREASURY N/B	3,870,000.00	3,757,981.65	
		US TREASURY N/B	6,740,000.00	6,542,802.36	
		US TREASURY N/B	6,060,000.00	5,695,216.42	
		US TREASURY N/B	3,140,000.00	3,024,212.50	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,939,921.88			

US TREASURY N/B	3,180,000.00	2,980,380.46
US TREASURY N/B	2,380,000.00	2,289,355.46
US TREASURY N/B	3,440,000.00	3,295,950.00
US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,367,378.90
US TREASURY N/B	4,990,000.00	4,674,421.47
US TREASURY N/B	1,480,000.00	1,423,979.69
US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,825,000.00
US TREASURY N/B	2,180,000.00	2,127,714.04
US TREASURY N/B	6,110,000.00	5,899,252.71
US TREASURY N/B	2,660,000.00	2,483,878.89
US TREASURY N/B	2,640,000.00	2,525,943.76
US TREASURY N/B	2,480,000.00	2,348,540.63
US TREASURY N/B	1,730,000.00	1,695,231.04
US TREASURY N/B	5,300,000.00	4,938,523.46
US TREASURY N/B	2,520,000.00	2,420,775.00
US TREASURY N/B	1,260,000.00	1,196,704.68
US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,987,187.52
US TREASURY N/B	3,740,000.00	3,493,393.75
US TREASURY N/B	2,420,000.00	2,327,359.37
US TREASURY N/B	1,990,000.00	1,887,312.89
US TREASURY N/B	5,460,000.00	5,248,638.26
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,800,781.25
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,246,375.00
US TREASURY N/B	2,380,000.00	2,253,423.05
US TREASURY N/B	5,970,000.00	5,590,345.31
US TREASURY N/B	2,400,000.00	2,303,437.48
US TREASURY N/B	3,800,000.00	3,610,445.32
US TREASURY N/B	4,100,000.00	3,840,386.72
US TREASURY N/B	2,620,000.00	2,524,103.91
US TREASURY N/B	3,290,000.00	3,096,198.43
US TREASURY N/B	4,250,000.00	4,048,457.01
US TREASURY N/B	3,340,000.00	3,147,167.17
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,227,316.41
US TREASURY N/B	2,630,000.00	2,457,919.91
US TREASURY N/B	5,140,000.00	4,867,339.03

US TREASURY N/B	2,530,000.00	2,443,821.87	
US TREASURY N/B	4,340,000.00	3,991,782.79	
US TREASURY N/B	4,550,000.00	4,387,195.31	
US TREASURY N/B	2,540,000.00	2,462,907.03	
US TREASURY N/B	3,490,000.00	3,190,078.12	
US TREASURY N/B	3,120,000.00	2,970,703.13	
US TREASURY N/B	4,920,000.00	4,755,487.50	
US TREASURY N/B	2,470,000.00	2,393,101.95	
US TREASURY N/B	2,520,000.00	2,289,853.13	
US TREASURY N/B	3,100,000.00	3,004,335.92	
US TREASURY N/B	2,120,000.00	2,050,106.25	
US TREASURY N/B	4,190,000.00	3,803,243.34	
US TREASURY N/B	3,090,000.00	3,001,645.31	
US TREASURY N/B	2,250,000.00	2,179,775.38	
US TREASURY N/B	2,980,000.00	2,693,407.78	
US TREASURY N/B	6,300,000.00	5,958,667.95	
US TREASURY N/B	3,260,000.00	3,175,825.78	
US TREASURY N/B	1,890,000.00	1,823,480.86	
US TREASURY N/B	4,920,000.00	4,433,765.64	
US TREASURY N/B	3,800,000.00	3,739,140.64	
US TREASURY N/B	2,430,000.00	2,358,618.75	
US TREASURY N/B	2,520,000.00	2,269,673.43	
US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,134,000.00	
US TREASURY N/B	5,200,000.00	4,663,343.77	
US TREASURY N/B	5,570,000.00	5,289,541.81	
US TREASURY N/B	1,720,000.00	1,661,614.06	
US TREASURY N/B	4,340,000.00	3,893,793.75	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,631,468.75	
US TREASURY N/B	5,700,000.00	5,109,515.62	
US TREASURY N/B	2,820,000.00	2,704,666.39	
US TREASURY N/B	3,190,000.00	2,848,321.07	
US TREASURY N/B	2,960,000.00	2,749,215.61	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,621,574.22	
US TREASURY N/B	3,650,000.00	3,264,326.18	
US TREASURY N/B	2,670,000.00	2,527,217.58	

US TREASURY N/B	3,070,000.00	2,764,319.14
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,372,851.55
US TREASURY N/B	2,820,000.00	2,532,271.87
US TREASURY N/B	5,420,000.00	5,010,747.66
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,538,632.82
US TREASURY N/B	3,880,000.00	3,476,843.75
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,516,167.96
US TREASURY N/B	4,070,000.00	3,656,481.64
US TREASURY N/B	2,600,000.00	2,418,507.80
US TREASURY N/B	2,800,000.00	2,486,750.00
US TREASURY N/B	5,830,000.00	5,342,876.15
US TREASURY N/B	1,280,000.00	1,167,249.99
US TREASURY N/B	4,670,000.00	4,157,576.96
US TREASURY N/B	2,360,000.00	2,171,476.56
US TREASURY N/B	4,600,000.00	4,107,835.92
US TREASURY N/B	2,520,000.00	2,314,462.50
US TREASURY N/B	6,110,000.00	5,498,045.31
US TREASURY N/B	5,740,000.00	5,342,011.70
US TREASURY N/B	2,550,000.00	2,337,533.20
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,708,789.07
US TREASURY N/B	2,720,000.00	2,504,206.24
US TREASURY N/B	3,300,000.00	2,974,382.79
US TREASURY N/B	7,150,000.00	6,500,355.43
US TREASURY N/B	5,530,000.00	5,184,375.00
US TREASURY N/B	1,000,000.00	894,570.31
US TREASURY N/B	5,060,000.00	4,667,454.71
US TREASURY N/B	2,800,000.00	2,442,890.63
US TREASURY N/B	3,200,000.00	3,027,500.00
US TREASURY N/B	2,650,000.00	2,296,701.17
US TREASURY N/B	2,900,000.00	2,771,199.22
US TREASURY N/B	4,620,000.00	4,341,175.79
US TREASURY N/B	3,600,000.00	3,107,953.11
US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,805,816.41
US TREASURY N/B	4,280,000.00	3,686,651.57
US TREASURY N/B	4,200,000.00	4,096,640.60

US TREASURY N/B	4,670,000.00	3,992,485.17	
US TREASURY N/B	5,730,000.00	5,470,135.56	
US TREASURY N/B	3,850,000.00	3,591,704.11	
US TREASURY N/B	4,290,000.00	3,678,004.68	
US TREASURY N/B	1,660,000.00	1,612,080.46	
US TREASURY N/B	4,270,000.00	3,630,834.37	
US TREASURY N/B	2,310,000.00	1,972,252.72	
US TREASURY N/B	5,300,000.00	5,373,703.12	
US TREASURY N/B	5,240,000.00	4,874,223.42	
US TREASURY N/B	5,250,000.00	4,501,464.87	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,018,437.52	
US TREASURY N/B	4,780,000.00	4,089,514.08	
US TREASURY N/B	5,590,000.00	4,802,596.05	
US TREASURY N/B	5,850,000.00	5,560,242.18	
US TREASURY N/B	5,800,000.00	5,074,093.75	
US TREASURY N/B	3,890,000.00	3,418,793.36	
US TREASURY N/B	3,770,000.00	3,309,058.61	
US TREASURY N/B	6,090,000.00	5,816,068.93	
US TREASURY N/B	6,500,000.00	5,694,355.48	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,186,328.12	
US TREASURY N/B	5,450,000.00	4,688,703.12	
US TREASURY N/B	3,890,000.00	3,708,491.97	
US TREASURY N/B	4,790,000.00	4,142,601.56	
US TREASURY N/B	3,600,000.00	3,130,734.38	
US TREASURY N/B	4,850,000.00	4,242,802.74	
US TREASURY N/B	6,480,000.00	6,256,743.78	
US TREASURY N/B	3,200,000.00	2,816,624.99	
US TREASURY N/B	4,120,000.00	3,599,045.32	
US TREASURY N/B	6,360,000.00	5,665,120.32	
US TREASURY N/B	6,610,000.00	6,198,165.99	
US TREASURY N/B	3,600,000.00	3,231,843.76	
US TREASURY N/B	4,620,000.00	4,263,393.75	
US TREASURY N/B	4,800,000.00	4,561,781.23	
US TREASURY N/B	5,320,000.00	4,907,492.20	
US TREASURY N/B	3,800,000.00	3,583,652.35	

US TREASURY N/B	3,030,000.00	2,943,005.85
US TREASURY N/B	3,800,000.00	3,554,781.25
US TREASURY N/B	4,900,000.00	4,315,062.50
US TREASURY N/B	3,880,000.00	3,947,293.75
US TREASURY N/B	2,830,000.00	2,511,625.00
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,536,093.75
US TREASURY N/B	4,300,000.00	3,727,394.54
US TREASURY N/B	780,000.00	906,963.28
US TREASURY N/B	6,040,000.00	4,873,996.84
US TREASURY N/B	8,470,000.00	6,795,189.80
US TREASURY N/B	9,260,000.00	7,554,857.85
US TREASURY N/B	1,210,000.00	1,355,105.47
US TREASURY N/B	7,330,000.00	6,100,793.37
US TREASURY N/B	8,100,000.00	6,960,304.72
US TREASURY N/B	9,170,000.00	7,597,130.04
US TREASURY N/B	10,740,000.00	8,941,889.00
US TREASURY N/B	10,590,000.00	9,186,411.35
US TREASURY N/B	10,050,000.00	9,478,406.25
US TREASURY N/B	8,060,000.00	7,514,690.62
US TREASURY N/B	540,000.00	596,362.50
US TREASURY N/B	730,000.00	845,359.95
US TREASURY N/B	690,000.00	751,924.80
US TREASURY N/B	1,620,000.00	1,790,068.36
US TREASURY N/B	960,000.00	940,593.75
US TREASURY N/B	1,290,000.00	1,382,617.97
US TREASURY N/B	1,340,000.00	1,479,129.68
US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,738,312.49
US TREASURY N/B	780,000.00	872,823.04
US TREASURY N/B	950,000.00	1,029,525.39
US TREASURY N/B	2,640,000.00	1,730,282.82
US TREASURY N/B	1,410,000.00	1,431,535.55
US TREASURY N/B	4,740,000.00	3,083,407.01
US TREASURY N/B	1,220,000.00	1,298,537.50
US TREASURY N/B	4,240,000.00	2,880,881.22
US TREASURY N/B	1,800,000.00	2,039,027.34

US TREASURY N/B	5,510,000.00	4,069,436.34	
US TREASURY N/B	1,130,000.00	1,221,459.37	
US TREASURY N/B	4,550,000.00	3,567,395.51	
US TREASURY N/B	1,080,000.00	1,070,866.40	
US TREASURY N/B	5,810,000.00	4,151,313.09	
US TREASURY N/B	1,040,000.00	939,310.93	
US TREASURY N/B	5,720,000.00	4,260,282.82	
US TREASURY N/B	1,340,000.00	1,208,905.07	
US TREASURY N/B	3,960,000.00	3,146,421.08	
US TREASURY N/B	1,070,000.00	942,477.73	
US TREASURY N/B	2,840,000.00	2,600,153.13	
US TREASURY N/B	240,000.00	202,204.68	
US TREASURY N/B	3,400,000.00	3,172,093.75	
US TREASURY N/B	1,860,000.00	1,564,252.72	
US TREASURY N/B	2,240,000.00	2,001,825.01	
US TREASURY N/B	2,720,000.00	2,330,487.51	
US TREASURY N/B	2,430,000.00	2,342,766.79	
US TREASURY N/B	2,260,000.00	2,219,478.90	
US TREASURY N/B	1,740,000.00	1,677,876.57	
US TREASURY N/B	1,210,000.00	1,120,809.76	
US TREASURY N/B	2,930,000.00	2,604,609.75	
US TREASURY N/B	1,370,000.00	1,192,997.06	
US TREASURY N/B	3,380,000.00	2,691,853.12	
US TREASURY N/B	1,100,000.00	956,914.06	
US TREASURY N/B	1,390,000.00	1,182,314.45	
US TREASURY N/B	1,220,000.00	1,061,376.17	
US TREASURY N/B	1,270,000.00	1,008,112.10	
US TREASURY N/B	2,090,000.00	1,655,100.38	
US TREASURY N/B	2,950,000.00	2,221,142.58	
US TREASURY N/B	1,260,000.00	1,071,442.96	
US TREASURY N/B	2,940,000.00	2,554,814.07	
US TREASURY N/B	2,290,000.00	1,993,597.07	
US TREASURY N/B	2,230,000.00	1,856,039.45	
US TREASURY N/B	3,200,000.00	2,665,124.99	
US TREASURY N/B	3,300,000.00	2,884,019.52	

	US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,236,816.40	
	US TREASURY N/B	4,190,000.00	3,670,587.32	
	US TREASURY N/B	4,880,000.00	4,589,201.58	
	US TREASURY N/B	2,980,000.00	2,624,553.52	
	US TREASURY N/B	4,090,000.00	3,522,272.86	
	US TREASURY N/B	4,100,000.00	3,101,505.84	
	US TREASURY N/B	3,540,000.00	2,756,498.45	
	US TREASURY N/B	4,190,000.00	2,992,740.22	
	US TREASURY N/B	5,760,000.00	3,381,300.00	
	US TREASURY N/B	4,720,000.00	2,863,343.72	
	US TREASURY N/B	6,070,000.00	3,939,098.03	
	US TREASURY N/B	5,760,000.00	3,981,600.00	
	US TREASURY N/B	5,440,000.00	4,224,075.02	
	US TREASURY N/B	5,010,000.00	3,566,983.02	
	US TREASURY N/B	5,940,000.00	4,092,683.22	
	US TREASURY N/B	4,740,000.00	3,580,551.53	
	US TREASURY N/B	5,340,000.00	4,627,443.75	
	US TREASURY N/B	4,910,000.00	4,376,804.67	
	US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,261,437.50	
	米ドル 小計	932,720,000.00	839,708,578.58 (114,838,545,206)	
カナダドル	GOV OF CANADA	810,000.00	780,369.39	
	GOV OF CANADA	840,000.00	822,515.40	
	GOV OF CANADA	1,860,000.00	1,773,325.86	
	GOV OF CANADA	1,310,000.00	1,266,350.80	
	GOV OF CANADA	530,000.00	519,419.08	
	GOV OF CANADA	1,360,000.00	1,335,014.08	
	GOV OF CANADA	810,000.00	778,985.91	
	GOV OF CANADA	1,260,000.00	1,193,448.06	
	GOV OF CANADA	1,420,000.00	1,398,704.26	
	GOV OF CANADA	840,000.00	796,732.44	
	GOV OF CANADA	950,000.00	904,426.60	
	GOV OF CANADA	1,250,000.00	1,212,083.75	
	GOV OF CANADA	2,770,000.00	2,552,297.39	
	GOV OF CANADA	1,320,000.00	1,194,229.08	

	GOV OF CANADA	850,000.00	801,327.30
	GOV OF CANADA	1,340,000.00	1,233,779.54
	GOV OF CANADA	1,380,000.00	1,277,005.08
	GOV OF CANADA	920,000.00	843,929.80
	GOV OF CANADA	1,170,000.00	1,154,490.48
	GOV OF CANADA	550,000.00	563,073.50
	GOV OF CANADA	690,000.00	660,051.24
	GOV OF CANADA	880,000.00	1,029,717.04
	GOV OF CANADA	220,000.00	212,685.44
	GOV OF CANADA	3,200,000.00	2,859,548.80
	GOV OF CANADA	2,220,000.00	1,851,246.90
	GOV OF CANADA	3,230,000.00	2,902,384.33
	GOV OF CANADA	2,560,000.00	2,287,116.80
	GOV OF CANADA	1,870,000.00	1,738,004.18
	GOV OF CANADA	700,000.00	678,313.30
	GOV OF CANADA	1,020,000.00	1,280,302.98
	GOV OF CANADA	690,000.00	857,159.40
	GOV OF CANADA	680,000.00	783,804.72
	GOV OF CANADA	910,000.00	1,004,652.74
	GOV OF CANADA	850,000.00	837,338.40
	GOV OF CANADA	3,350,000.00	2,814,968.15
	GOV OF CANADA	2,410,000.00	1,892,199.45
	GOV OF CANADA	550,000.00	544,453.80
	カナダドル 小計	49,570,000.00	46,635,455.47 (4,668,209,092)
メキシコペソ	UNITED MEXICAN STATE	13,120,000.00	12,793,656.40
	UNITED MEXICAN STATE	30,930,000.00	30,062,845.28
	UNITED MEXICAN STATE	21,730,000.00	21,797,620.50
	UNITED MEXICAN STATE	11,220,000.00	10,185,516.00
	UNITED MEXICAN STATE	36,180,000.00	32,827,561.20
	UNITED MEXICAN STATE	14,270,000.00	12,589,850.20
	UNITED MEXICAN STATE	26,870,000.00	25,523,275.60
	UNITED MEXICAN STATE	24,510,000.00	24,063,427.80
	UNITED MEXICAN STATE	34,076,000.00	31,705,503.06
	UNITED MEXICAN STATE	7,200,000.00	6,533,784.00
	UNITED MEXICAN STATE	6,100,000.00	6,595,503.00

	UNITED MEXICAN STATE	19,670,000.00	18,742,756.20
	UNITED MEXICAN STATE	20,320,000.00	17,836,896.00
	UNITED MEXICAN STATE	21,150,000.00	19,102,468.50
	UNITED MEXICAN STATE	5,100,000.00	4,605,022.56
	メキシコペソ 小計	292,446,000.00	274,965,686.30 (1,901,690,183)
ユーロ	GOV OF AUSTRIA	930,000.00	898,673.23
	GOV OF AUSTRIA	1,100,000.00	1,090,433.30
	GOV OF AUSTRIA	580,000.00	550,909.93
	GOV OF AUSTRIA	870,000.00	849,387.96
	GOV OF AUSTRIA	1,030,000.00	1,119,134.14
	GOV OF AUSTRIA	220,000.00	218,877.78
	GOV OF AUSTRIA	940,000.00	895,115.00
	GOV OF AUSTRIA	830,000.00	773,659.60
	GOV OF AUSTRIA	1,220,000.00	1,440,075.80
	GOV OF AUSTRIA	1,130,000.00	1,050,357.60
	GOV OF AUSTRIA	140,000.00	122,462.10
	GOV OF AUSTRIA	1,190,000.00	1,066,881.41
	GOV OF AUSTRIA	1,000,000.00	843,010.00
	GOV OF AUSTRIA	1,370,000.00	1,123,764.42
	GOV OF AUSTRIA	790,000.00	686,376.49
	GOV OF AUSTRIA	690,000.00	681,881.46
	GOV OF AUSTRIA	210,000.00	153,887.16
	GOV OF AUSTRIA	1,400,000.00	1,660,157.80
	GOV OF AUSTRIA	550,000.00	352,141.35
	GOV OF AUSTRIA	780,000.00	867,427.86
	GOV OF AUSTRIA	560,000.00	466,531.52
	GOV OF AUSTRIA	430,000.00	383,578.92
	GOV OF AUSTRIA	520,000.00	348,016.24
	GOV OF AUSTRIA	310,000.00	413,240.85
	GOV OF AUSTRIA	270,000.00	146,680.47
	GOV OF AUSTRIA	440,000.00	223,637.48
	GOV OF AUSTRIA	450,000.00	394,090.65
	GOV OF AUSTRIA	260,000.00	190,475.26
	GOV OF BELGIUM	1,190,000.00	1,196,017.83

GOV OF BELGIUM	1,140,000.00	1,105,209.48
GOV OF BELGIUM	1,860,000.00	1,799,708.10
GOV OF BELGIUM	920,000.00	990,308.24
GOV OF BELGIUM	1,510,000.00	1,453,726.83
GOV OF BELGIUM	1,130,000.00	1,063,889.35
GOV OF BELGIUM	1,030,000.00	925,240.76
GOV OF BELGIUM	1,770,000.00	2,066,512.17
GOV OF BELGIUM	1,140,000.00	1,059,977.70
GOV OF BELGIUM	1,570,000.00	1,441,652.50
GOV OF BELGIUM	1,150,000.00	976,443.90
GOV OF BELGIUM	1,460,000.00	1,306,064.90
GOV OF BELGIUM	1,100,000.00	888,690.00
GOV OF BELGIUM	870,000.00	977,091.78
GOV OF BELGIUM	1,250,000.00	1,023,625.38
GOV OF BELGIUM	410,000.00	364,381.76
GOV OF BELGIUM	780,000.00	809,298.36
GOV OF BELGIUM	2,100,000.00	2,612,509.20
GOV OF BELGIUM	420,000.00	358,104.18
GOV OF BELGIUM	680,000.00	611,447.84
GOV OF BELGIUM	1,110,000.00	752,481.21
GOV OF BELGIUM	1,580,000.00	1,913,963.33
GOV OF BELGIUM	810,000.00	951,463.26
GOV OF BELGIUM	880,000.00	712,703.20
GOV OF BELGIUM	960,000.00	780,908.16
GOV OF BELGIUM	760,000.00	563,771.80
GOV OF BELGIUM	700,000.00	646,945.78
GOV OF BELGIUM	620,000.00	561,075.20
GOV OF BELGIUM	440,000.00	222,339.92
GOV OF FINLAND	450,000.00	449,486.05
GOV OF FINLAND	260,000.00	250,683.68
GOV OF FINLAND	520,000.00	544,873.68
GOV OF FINLAND	320,000.00	309,484.16
GOV OF FINLAND	610,000.00	578,121.29
GOV OF FINLAND	230,000.00	211,755.13
GOV OF FINLAND	260,000.00	249,954.64

GOV OF FINLAND	630,000.00	579,694.75	
GOV OF FINLAND	470,000.00	481,183.18	
GOV OF FINLAND	510,000.00	460,266.33	
GOV OF FINLAND	460,000.00	406,744.69	
GOV OF FINLAND	430,000.00	357,158.43	
GOV OF FINLAND	490,000.00	428,040.03	
GOV OF FINLAND	430,000.00	352,824.46	
GOV OF FINLAND	550,000.00	503,057.50	
GOV OF FINLAND	390,000.00	336,555.18	
GOV OF FINLAND	480,000.00	350,051.52	
GOV OF FINLAND	100,000.00	67,746.15	
GOV OF FINLAND	550,000.00	561,569.25	
GOV OF FINLAND	330,000.00	227,915.82	
GOV OF FINLAND	380,000.00	316,197.24	
GOV OF FINLAND	400,000.00	223,564.00	
GOV OF FRANCE	1,780,000.00	1,734,541.73	
GOV OF FRANCE	3,190,000.00	3,100,463.08	
GOV OF FRANCE	3,590,000.00	3,589,502.78	
GOV OF FRANCE	3,560,000.00	3,525,286.44	
GOV OF FRANCE	2,090,000.00	1,989,394.33	
GOV OF FRANCE	3,700,000.00	3,516,559.54	
GOV OF FRANCE	3,340,000.00	3,204,843.56	
GOV OF FRANCE	3,250,000.00	3,592,995.25	
GOV OF FRANCE	3,760,000.00	3,637,630.80	
GOV OF FRANCE	2,190,000.00	2,044,191.99	
GOV OF FRANCE	5,110,000.00	5,324,967.48	
GOV OF FRANCE	3,740,000.00	3,535,754.86	
GOV OF FRANCE	3,980,000.00	3,697,555.32	
GOV OF FRANCE	3,430,000.00	3,136,073.01	
GOV OF FRANCE	3,550,000.00	3,378,038.00	
GOV OF FRANCE	4,070,000.00	4,181,249.38	
GOV OF FRANCE	2,040,000.00	1,895,111.04	
GOV OF FRANCE	5,050,000.00	4,679,259.30	
GOV OF FRANCE	4,940,000.00	4,548,258.00	
GOV OF FRANCE	4,140,000.00	4,946,215.32	

GOV OF FRANCE	3,870,000.00	3,479,818.86	
GOV OF FRANCE	3,480,000.00	2,990,141.28	
GOV OF FRANCE	4,830,000.00	4,932,724.44	
GOV OF FRANCE	4,280,000.00	3,589,344.96	
GOV OF FRANCE	4,260,000.00	4,028,771.46	
GOV OF FRANCE	4,410,000.00	3,601,818.99	
GOV OF FRANCE	2,590,000.00	2,080,720.53	
GOV OF FRANCE	3,240,000.00	4,198,625.28	
GOV OF FRANCE	1,950,000.00	1,884,156.30	
GOV OF FRANCE	3,380,000.00	2,950,824.50	
GOV OF FRANCE	2,480,000.00	3,045,787.20	
GOV OF FRANCE	3,970,000.00	3,369,136.53	
GOV OF FRANCE	280,000.00	231,861.56	
GOV OF FRANCE	2,000,000.00	2,357,146.00	
GOV OF FRANCE	2,820,000.00	2,524,492.20	
GOV OF FRANCE	1,810,000.00	1,276,860.88	
GOV OF FRANCE	3,460,000.00	4,385,058.68	
GOV OF FRANCE	200,000.00	195,649.40	
GOV OF FRANCE	1,450,000.00	966,237.95	
GOV OF FRANCE	2,630,000.00	2,915,644.30	
GOV OF FRANCE	2,540,000.00	2,268,753.40	
GOV OF FRANCE	2,580,000.00	2,057,317.80	
GOV OF FRANCE	2,850,000.00	1,827,853.20	
GOV OF FRANCE	2,080,000.00	1,307,263.36	
GOV OF FRANCE	1,820,000.00	2,371,187.00	
GOV OF FRANCE	1,390,000.00	1,866,570.67	
GOV OF FRANCE	1,240,000.00	1,025,992.34	
GOV OF FRANCE	850,000.00	410,624.80	
GOV OF GERMANY	560,000.00	548,802.80	
GOV OF GERMANY	2,530,000.00	2,523,105.75	
GOV OF GERMANY	1,580,000.00	1,540,294.60	
GOV OF GERMANY	2,550,000.00	2,484,210.00	
GOV OF GERMANY	2,490,000.00	2,472,171.60	
GOV OF GERMANY	1,460,000.00	1,419,578.44	
GOV OF GERMANY	1,870,000.00	1,838,720.51	

GOV OF GERMANY	1,240,000.00	1,203,822.27	
GOV OF GERMANY	2,060,000.00	1,984,275.94	
GOV OF GERMANY	750,000.00	750,800.25	
GOV OF GERMANY	2,350,000.00	2,274,788.25	
GOV OF GERMANY	1,800,000.00	1,718,217.00	
GOV OF GERMANY	2,530,000.00	2,465,347.54	
GOV OF GERMANY	2,100,000.00	1,987,557.60	
GOV OF GERMANY	350,000.00	332,114.09	
GOV OF GERMANY	2,930,000.00	2,801,150.32	
GOV OF GERMANY	2,280,000.00	2,140,299.50	
GOV OF GERMANY	2,510,000.00	2,341,764.74	
GOV OF GERMANY	2,130,000.00	1,978,582.56	
GOV OF GERMANY	2,400,000.00	2,243,341.20	
GOV OF GERMANY	1,880,000.00	1,729,832.47	
GOV OF GERMANY	1,680,000.00	2,010,484.56	
GOV OF GERMANY	2,150,000.00	2,018,110.40	
GOV OF GERMANY	1,880,000.00	1,825,724.40	
GOV OF GERMANY	2,460,000.00	2,243,175.60	
GOV OF GERMANY	1,730,000.00	2,036,761.87	
GOV OF GERMANY	2,170,000.00	2,024,358.28	
GOV OF GERMANY	1,630,000.00	1,870,439.67	
GOV OF GERMANY	1,930,000.00	1,763,248.00	
GOV OF GERMANY	2,520,000.00	2,259,185.04	
GOV OF GERMANY	2,000,000.00	1,815,036.00	
GOV OF GERMANY	2,090,000.00	1,848,153.56	
GOV OF GERMANY	600,000.00	607,615.02	
GOV OF GERMANY	1,150,000.00	1,478,660.80	
GOV OF GERMANY	2,140,000.00	1,873,751.90	
GOV OF GERMANY	2,750,000.00	2,387,979.00	
GOV OF GERMANY	700,000.00	607,857.60	
GOV OF GERMANY	2,370,000.00	2,992,321.71	
GOV OF GERMANY	1,670,000.00	1,434,212.70	
GOV OF GERMANY	3,150,000.00	2,679,786.90	
GOV OF GERMANY	500,000.00	425,784.30	
GOV OF GERMANY	2,740,000.00	2,305,734.66	

GOV OF GERMANY	1,880,000.00	1,843,821.28	
GOV OF GERMANY	2,160,000.00	2,788,557.84	
GOV OF GERMANY	1,780,000.00	1,395,883.12	
GOV OF GERMANY	1,780,000.00	1,370,433.24	
GOV OF GERMANY	2,420,000.00	3,028,358.96	
GOV OF GERMANY	580,000.00	506,167.74	
GOV OF GERMANY	1,830,000.00	2,419,852.92	
GOV OF GERMANY	1,860,000.00	2,631,526.14	
GOV OF GERMANY	1,460,000.00	1,786,264.74	
GOV OF GERMANY	2,290,000.00	2,567,754.10	
GOV OF GERMANY	2,780,000.00	3,178,574.16	
GOV OF GERMANY	3,100,000.00	2,812,772.60	
GOV OF GERMANY	3,500,000.00	2,219,427.00	
GOV OF GERMANY	1,580,000.00	971,097.20	
GOV OF GERMANY	330,000.00	335,547.96	
GOV OF IRELAND	590,000.00	599,587.85	
GOV OF IRELAND	930,000.00	995,561.28	
GOV OF IRELAND	850,000.00	821,237.70	
GOV OF IRELAND	770,000.00	707,652.07	
GOV OF IRELAND	700,000.00	654,499.30	
GOV OF IRELAND	770,000.00	718,902.28	
GOV OF IRELAND	900,000.00	910,547.10	
GOV OF IRELAND	530,000.00	451,891.78	
GOV OF IRELAND	660,000.00	616,113.30	
GOV OF IRELAND	740,000.00	603,822.98	
GOV OF IRELAND	280,000.00	231,064.68	
GOV OF IRELAND	500,000.00	448,013.66	
GOV OF IRELAND	310,000.00	240,390.12	
GOV OF IRELAND	570,000.00	511,101.90	
GOV OF IRELAND	280,000.00	196,712.32	
GOV OF IRELAND	890,000.00	801,245.64	
GOV OF IRELAND	680,000.00	550,542.96	
GOV OF ITALY	1,740,000.00	1,691,889.00	
GOV OF ITALY	1,640,000.00	1,593,153.40	
GOV OF ITALY	1,980,000.00	2,024,304.48	

GOV OF ITALY	1,530,000.00	1,479,248.67	
GOV OF ITALY	1,900,000.00	1,880,025.30	
GOV OF ITALY	180,000.00	177,630.67	
GOV OF ITALY	1,120,000.00	1,105,964.16	
GOV OF ITALY	1,080,000.00	1,034,649.98	
GOV OF ITALY	2,190,000.00	2,233,561.29	
GOV OF ITALY	1,680,000.00	1,645,309.68	
GOV OF ITALY	2,270,000.00	2,265,697.91	
GOV OF ITALY	1,180,000.00	1,122,368.80	
GOV OF ITALY	1,240,000.00	1,181,904.76	
GOV OF ITALY	2,350,000.00	2,470,424.34	
GOV OF ITALY	1,500,000.00	1,459,947.00	
GOV OF ITALY	1,460,000.00	1,419,031.48	
GOV OF ITALY	1,170,000.00	1,143,758.07	
GOV OF ITALY	460,000.00	440,709.90	
GOV OF ITALY	710,000.00	704,335.63	
GOV OF ITALY	1,880,000.00	1,835,885.53	
GOV OF ITALY	1,660,000.00	1,540,202.78	
GOV OF ITALY	2,660,000.00	2,788,879.66	
GOV OF ITALY	1,740,000.00	1,578,080.46	
GOV OF ITALY	1,930,000.00	1,845,157.20	
GOV OF ITALY	1,490,000.00	1,446,882.38	
GOV OF ITALY	1,800,000.00	1,617,937.20	
GOV OF ITALY	1,340,000.00	1,255,215.28	
GOV OF ITALY	1,520,000.00	1,396,121.52	
GOV OF ITALY	1,380,000.00	1,271,772.50	
GOV OF ITALY	1,630,000.00	1,574,985.87	
GOV OF ITALY	1,780,000.00	1,701,281.28	
GOV OF ITALY	1,800,000.00	1,630,243.80	
GOV OF ITALY	2,580,000.00	2,979,048.60	
GOV OF ITALY	900,000.00	876,428.37	
GOV OF ITALY	2,030,000.00	1,917,899.34	
GOV OF ITALY	1,290,000.00	1,103,427.30	
GOV OF ITALY	1,290,000.00	1,107,307.62	
GOV OF ITALY	2,660,000.00	2,863,995.40	

GOV OF ITALY	1,830,000.00	1,784,250.00	
GOV OF ITALY	1,620,000.00	1,357,250.58	
GOV OF ITALY	770,000.00	741,587.46	
GOV OF ITALY	1,910,000.00	1,868,243.58	
GOV OF ITALY	2,880,000.00	3,222,558.72	
GOV OF ITALY	2,260,000.00	2,273,460.56	
GOV OF ITALY	1,980,000.00	1,710,468.54	
GOV OF ITALY	2,140,000.00	1,771,532.66	
GOV OF ITALY	1,390,000.00	1,206,559.47	
GOV OF ITALY	1,110,000.00	899,155.50	
GOV OF ITALY	3,850,000.00	4,541,821.90	
GOV OF ITALY	1,780,000.00	1,387,577.64	
GOV OF ITALY	1,350,000.00	1,074,347.55	
GOV OF ITALY	2,180,000.00	1,843,462.50	
GOV OF ITALY	1,570,000.00	1,233,784.50	
GOV OF ITALY	1,360,000.00	1,218,016.00	
GOV OF ITALY	2,530,000.00	2,936,039.70	
GOV OF ITALY	1,550,000.00	1,356,665.40	
GOV OF ITALY	2,240,000.00	2,453,339.84	
GOV OF ITALY	1,390,000.00	1,307,343.65	
GOV OF ITALY	1,340,000.00	1,012,305.68	
GOV OF ITALY	1,370,000.00	1,142,719.74	
GOV OF ITALY	2,390,000.00	2,421,046.10	
GOV OF ITALY	1,300,000.00	897,850.20	
GOV OF ITALY	550,000.00	504,461.10	
GOV OF ITALY	1,090,000.00	966,302.44	
GOV OF ITALY	2,270,000.00	2,551,480.00	
GOV OF ITALY	1,320,000.00	1,179,215.40	
GOV OF ITALY	1,930,000.00	2,184,001.51	
GOV OF ITALY	1,200,000.00	873,016.80	
GOV OF ITALY	1,480,000.00	1,652,072.20	
GOV OF ITALY	970,000.00	635,233.60	
GOV OF ITALY	1,640,000.00	1,491,657.08	
GOV OF ITALY	1,410,000.00	1,171,091.01	
GOV OF ITALY	1,510,000.00	1,417,613.67	

GOV OF ITALY	1,310,000.00	1,309,439.32	
GOV OF ITALY	1,200,000.00	926,526.00	
GOV OF ITALY	1,320,000.00	864,079.92	
GOV OF ITALY	850,000.00	606,418.55	
GOV OF ITALY	930,000.00	731,773.29	
GOV OF ITALY	360,000.00	238,296.24	
GOV OF NETHERLANDS	1,130,000.00	1,104,780.66	
GOV OF NETHERLANDS	1,450,000.00	1,447,756.27	
GOV OF NETHERLANDS	1,700,000.00	1,622,127.06	
GOV OF NETHERLANDS	850,000.00	796,318.60	
GOV OF NETHERLANDS	1,530,000.00	1,448,698.86	
GOV OF NETHERLANDS	1,330,000.00	1,223,130.51	
GOV OF NETHERLANDS	1,270,000.00	1,198,764.43	
GOV OF NETHERLANDS	1,490,000.00	1,732,859.57	
GOV OF NETHERLANDS	1,070,000.00	996,743.52	
GOV OF NETHERLANDS	860,000.00	756,926.42	
GOV OF NETHERLANDS	1,090,000.00	966,258.84	
GOV OF NETHERLANDS	1,130,000.00	964,638.06	
GOV OF NETHERLANDS	1,080,000.00	901,600.20	
GOV OF NETHERLANDS	1,190,000.00	1,017,434.53	
GOV OF NETHERLANDS	1,050,000.00	1,077,351.45	
GOV OF NETHERLANDS	1,640,000.00	1,985,589.00	
GOV OF NETHERLANDS	870,000.00	626,693.19	
GOV OF NETHERLANDS	1,170,000.00	895,454.82	
GOV OF NETHERLANDS	1,560,000.00	1,943,190.60	
GOV OF NETHERLANDS	1,750,000.00	1,997,665.25	
GOV OF NETHERLANDS	1,160,000.00	682,824.72	
GOV OF NETHERLANDS	360,000.00	363,929.76	
GOV OF SPAIN	1,090,000.00	1,121,047.56	
GOV OF SPAIN	1,770,000.00	1,806,137.73	
GOV OF SPAIN	1,530,000.00	1,478,402.58	
GOV OF SPAIN	1,490,000.00	1,441,217.40	
GOV OF SPAIN	2,440,000.00	2,458,392.72	
GOV OF SPAIN	1,470,000.00	1,399,529.67	
GOV OF SPAIN	1,730,000.00	1,701,999.95	

GOV OF SPAIN	1,550,000.00	1,461,369.29	
GOV OF SPAIN	2,610,000.00	2,764,358.01	
GOV OF SPAIN	1,700,000.00	1,693,659.00	
GOV OF SPAIN	1,330,000.00	1,234,050.87	
GOV OF SPAIN	1,800,000.00	1,775,296.80	
GOV OF SPAIN	2,490,000.00	2,798,077.74	
GOV OF SPAIN	2,230,000.00	2,142,577.46	
GOV OF SPAIN	1,800,000.00	1,626,404.40	
GOV OF SPAIN	2,130,000.00	2,048,374.91	
GOV OF SPAIN	1,500,000.00	1,390,591.50	
GOV OF SPAIN	1,760,000.00	1,676,667.52	
GOV OF SPAIN	1,660,000.00	1,458,720.02	
GOV OF SPAIN	2,010,000.00	1,895,291.31	
GOV OF SPAIN	1,710,000.00	1,607,940.36	
GOV OF SPAIN	2,040,000.00	2,321,658.72	
GOV OF SPAIN	2,640,000.00	3,156,402.48	
GOV OF SPAIN	1,690,000.00	1,578,855.46	
GOV OF SPAIN	540,000.00	479,152.26	
GOV OF SPAIN	1,900,000.00	1,662,629.20	
GOV OF SPAIN	1,940,000.00	1,662,931.14	
GOV OF SPAIN	1,950,000.00	1,851,548.40	
GOV OF SPAIN	2,100,000.00	1,885,130.10	
GOV OF SPAIN	1,740,000.00	1,397,943.84	
GOV OF SPAIN	2,070,000.00	1,697,727.06	
GOV OF SPAIN	1,390,000.00	1,145,543.48	
GOV OF SPAIN	2,650,000.00	3,313,634.20	
GOV OF SPAIN	1,420,000.00	1,373,428.26	
GOV OF SPAIN	1,540,000.00	1,459,114.87	
GOV OF SPAIN	1,680,000.00	1,469,030.64	
GOV OF SPAIN	1,910,000.00	2,150,831.90	
GOV OF SPAIN	1,040,000.00	753,892.88	
GOV OF SPAIN	2,070,000.00	2,553,721.74	
GOV OF SPAIN	1,210,000.00	875,102.25	
GOV OF SPAIN	1,950,000.00	2,369,374.80	
GOV OF SPAIN	320,000.00	218,947.20	

	GOV OF SPAIN	300,000.00	306,334.80	
	GOV OF SPAIN	1,550,000.00	2,035,359.25	
	GOV OF SPAIN	1,470,000.00	1,411,264.68	
	GOV OF SPAIN	1,440,000.00	1,320,094.08	
	GOV OF SPAIN	1,700,000.00	1,029,523.40	
	GOV OF SPAIN	960,000.00	713,931.84	
	GOV OF SPAIN	1,200,000.00	1,242,856.80	
	GOV OF SPAIN	570,000.00	320,293.83	
	ユーロ 小計	560,360,000.00	538,849,540.35 (77,465,009,920)	
英ポンド	UK TREASURY	2,650,000.00	2,553,962.94	
	UK TREASURY	1,790,000.00	1,733,793.28	
	UK TREASURY	450,000.00	444,438.45	
	UK TREASURY	2,350,000.00	2,191,672.97	
	UK TREASURY	1,040,000.00	1,077,517.89	
	UK TREASURY	1,350,000.00	1,266,907.50	
	UK TREASURY	1,340,000.00	1,295,522.72	
	UK TREASURY	990,000.00	901,732.59	
	UK TREASURY	1,350,000.00	1,271,538.00	
	UK TREASURY	1,860,000.00	1,667,490.00	
	UK TREASURY	720,000.00	738,995.04	
	UK TREASURY	1,240,000.00	1,135,654.00	
	UK TREASURY	1,480,000.00	1,548,052.47	
	UK TREASURY	1,330,000.00	1,137,602.20	
	UK TREASURY	770,000.00	707,558.77	
	UK TREASURY	1,210,000.00	1,386,754.86	
	UK TREASURY	1,260,000.00	1,067,976.00	
	UK TREASURY	1,190,000.00	1,025,304.00	
	UK TREASURY	1,280,000.00	1,031,488.00	
	UK TREASURY	1,430,000.00	1,591,411.25	
	UK TREASURY	2,460,000.00	1,912,527.00	
	UK TREASURY	2,670,000.00	2,196,876.00	
	UK TREASURY	1,630,000.00	1,773,831.20	
	UK TREASURY	1,130,000.00	884,394.50	
	UK TREASURY	1,350,000.00	1,503,549.27	

	UK TREASURY	1,990,000.00	1,423,560.43
	UK TREASURY	1,220,000.00	1,325,200.60
	UK TREASURY	1,550,000.00	1,234,544.00
	UK TREASURY	360,000.00	367,711.20
	UK TREASURY	1,710,000.00	1,955,643.21
	UK TREASURY	790,000.00	553,753.96
	UK TREASURY	970,000.00	1,047,193.57
	UK TREASURY	1,320,000.00	1,425,784.80
	UK TREASURY	1,860,000.00	1,267,798.69
	UK TREASURY	1,510,000.00	1,696,451.78
	UK TREASURY	1,370,000.00	1,287,701.15
	UK TREASURY	1,570,000.00	1,533,748.70
	UK TREASURY	1,180,000.00	675,416.24
	UK TREASURY	1,430,000.00	1,567,165.60
	UK TREASURY	1,530,000.00	1,002,647.55
	UK TREASURY	980,000.00	675,771.52
	UK TREASURY	1,080,000.00	1,195,246.80
	UK TREASURY	820,000.00	400,766.80
	UK TREASURY	1,570,000.00	923,160.00
	UK TREASURY	1,010,000.00	1,041,114.06
	UK TREASURY	580,000.00	360,635.64
	UK TREASURY	1,290,000.00	827,767.20
	UK TREASURY	1,470,000.00	1,677,931.50
	UK TREASURY	1,400,000.00	935,060.00
	UK TREASURY	1,150,000.00	1,295,394.50
	UK TREASURY	1,470,000.00	593,953.50
	UK TREASURY	1,160,000.00	954,923.60
	UK TREASURY	1,280,000.00	1,342,400.00
	UK TREASURY	970,000.00	604,533.10
	UK TREASURY	840,000.00	417,782.40
	英bond 小計	73,750,000.00	65,657,313.00 (10,977,902,733)
スウェーデンクローナ	GOV OF SWEDEN	6,330,000.00	6,357,672.86
	GOV OF SWEDEN	7,460,000.00	7,171,136.49
	GOV OF SWEDEN	5,250,000.00	4,956,209.00
	GOV OF SWEDEN	5,400,000.00	5,032,530.00

	GOV OF SWEDEN	4,020,000.00	3,516,975.55	
	GOV OF SWEDEN	4,350,000.00	4,565,325.00	
	GOV OF SWEDEN	3,660,000.00	4,654,149.69	
	スウェーデンクローナ 小計	36,470,000.00	36,253,998.59	(478,915,321)
ノルウェークローネ	GOV OF NORWAY	6,250,000.00	6,248,503.31	
	GOV OF NORWAY	4,890,000.00	4,763,339.22	
	GOV OF NORWAY	4,030,000.00	3,859,982.36	
	GOV OF NORWAY	3,690,000.00	3,533,159.50	
	GOV OF NORWAY	3,230,000.00	3,099,863.30	
	GOV OF NORWAY	3,830,000.00	3,582,848.56	
	GOV OF NORWAY	4,650,000.00	4,183,581.75	
	GOV OF NORWAY	3,510,000.00	3,075,834.06	
	GOV OF NORWAY	2,880,000.00	2,702,296.50	
	ノルウェークローネ 小計	36,960,000.00	35,049,408.56	(479,125,415)
デンマーククローネ	GOV OF DENMARK	5,350,000.00	5,125,701.25	
	GOV OF DENMARK	3,120,000.00	3,082,493.85	
	GOV OF DENMARK	6,580,000.00	6,088,860.24	
	GOV OF DENMARK	5,670,000.00	5,086,563.80	
	GOV OF DENMARK	6,080,000.00	5,032,244.77	
	GOV OF DENMARK	9,360,000.00	12,610,381.68	
	GOV OF DENMARK	4,790,000.00	3,128,559.04	
	デンマーククローネ 小計	40,950,000.00	40,154,804.63	(776,192,373)
ポーランドズロチ	GOV OF POLAND	2,510,000.00	2,374,711.00	
	GOV OF POLAND	1,380,000.00	1,238,619.00	
	GOV OF POLAND	3,030,000.00	2,798,638.29	
	GOV OF POLAND	2,140,000.00	1,869,397.00	
	GOV OF POLAND	3,170,000.00	2,910,852.50	
	GOV OF POLAND	4,370,000.00	3,788,178.20	
	GOV OF POLAND	2,380,000.00	1,869,466.20	
	GOV OF POLAND	1,410,000.00	1,257,649.50	
	GOV OF POLAND	2,910,000.00	2,457,640.50	
	GOV OF POLAND	3,590,000.00	2,993,844.60	

	GOV OF POLAND	1,120,000.00	1,085,952.00
	GOV OF POLAND	3,550,000.00	2,847,721.25
	GOV OF POLAND	4,000,000.00	2,752,000.00
	GOV OF POLAND	1,420,000.00	965,245.00
	ポーランドズロチ 小計	36,980,000.00	31,209,915.04 (957,033,318)
オーストラリアドル	GOV OF AUSTRALIA	1,130,000.00	1,125,206.52
	GOV OF AUSTRALIA	2,470,000.00	2,340,867.33
	GOV OF AUSTRALIA	1,470,000.00	1,478,880.71
	GOV OF AUSTRALIA	2,010,000.00	1,854,694.27
	GOV OF AUSTRALIA	1,900,000.00	1,972,342.88
	GOV OF AUSTRALIA	1,440,000.00	1,308,915.75
	GOV OF AUSTRALIA	1,800,000.00	1,920,908.16
	GOV OF AUSTRALIA	1,560,000.00	1,534,376.50
	GOV OF AUSTRALIA	1,100,000.00	1,051,509.34
	GOV OF AUSTRALIA	1,140,000.00	1,115,245.96
	GOV OF AUSTRALIA	1,790,000.00	1,798,344.98
	GOV OF AUSTRALIA	1,400,000.00	1,361,368.05
	GOV OF AUSTRALIA	2,010,000.00	1,914,912.74
	GOV OF AUSTRALIA	1,520,000.00	1,279,786.80
	GOV OF AUSTRALIA	2,150,000.00	1,869,191.57
	GOV OF AUSTRALIA	2,660,000.00	2,193,307.57
	GOV OF AUSTRALIA	2,150,000.00	1,797,786.78
	GOV OF AUSTRALIA	2,480,000.00	2,157,505.65
	GOV OF AUSTRALIA	1,650,000.00	1,822,965.70
	GOV OF AUSTRALIA	1,470,000.00	1,426,024.84
	GOV OF AUSTRALIA	1,550,000.00	1,605,873.16
	GOV OF AUSTRALIA	600,000.00	558,273.06
	GOV OF AUSTRALIA	1,040,000.00	1,067,512.36
	GOV OF AUSTRALIA	910,000.00	872,614.83
	GOV OF AUSTRALIA	1,060,000.00	935,651.40
	GOV OF AUSTRALIA	1,110,000.00	997,384.49
	GOV OF AUSTRALIA	1,600,000.00	1,077,187.64
	オーストラリアドル 小計	43,170,000.00	40,438,639.04 (3,735,721,474)
ニュージーランドドル	GOV OF NEWZEALAND	700,000.00	658,350.21

	GOV OF NEWZEALAND	740,000.00	710,077.22
	GOV OF NEWZEALAND	510,000.00	447,836.99
	GOV OF NEWZEALAND	620,000.00	626,221.51
	GOV OF NEWZEALAND	450,000.00	365,669.35
	GOV OF NEWZEALAND	700,000.00	656,924.89
	GOV OF NEWZEALAND	540,000.00	442,271.99
	GOV OF NEWZEALAND	420,000.00	353,515.95
	GOV OF NEWZEALAND	400,000.00	381,289.53
	GOV OF NEWZEALAND	320,000.00	324,887.64
	GOV OF NEWZEALAND	480,000.00	405,209.00
	GOV OF NEWZEALAND	360,000.00	244,610.90
	GOV OF NEWZEALAND	420,000.00	320,287.15
	ニュージーランドドル 小計	6,660,000.00	5,937,152.33 (518,432,141)
シンガポールドル	GOV OF SINGAPORE	690,000.00	678,319.64
	GOV OF SINGAPORE	910,000.00	906,391.85
	GOV OF SINGAPORE	760,000.00	748,220.00
	GOV OF SINGAPORE	440,000.00	409,860.00
	GOV OF SINGAPORE	600,000.00	583,380.00
	GOV OF SINGAPORE	370,000.00	347,245.00
	GOV OF SINGAPORE	870,000.00	890,445.00
	GOV OF SINGAPORE	460,000.00	453,008.00
	GOV OF SINGAPORE	590,000.00	585,870.00
	GOV OF SINGAPORE	520,000.00	515,060.00
	GOV OF SINGAPORE	440,000.00	395,456.44
	GOV OF SINGAPORE	240,000.00	233,789.13
	GOV OF SINGAPORE	520,000.00	539,344.00
	GOV OF SINGAPORE	740,000.00	680,596.50
	GOV OF SINGAPORE	240,000.00	222,480.00
	GOV OF SINGAPORE	500,000.00	494,070.00
	GOV OF SINGAPORE	590,000.00	592,360.00
	GOV OF SINGAPORE	570,000.00	476,520.00
	GOV OF SINGAPORE	270,000.00	227,905.65
	GOV OF SINGAPORE	230,000.00	249,830.41
	シンガポールドル 小計	10,550,000.00	10,230,151.62

マレーシアリングット	GOV OF MALAYSIA	1,920,000.00	1,922,039.80
	GOV OF MALAYSIA	950,000.00	960,890.04
	GOV OF MALAYSIA	1,260,000.00	1,272,106.83
	GOV OF MALAYSIA	1,330,000.00	1,337,135.58
	GOV OF MALAYSIA	1,630,000.00	1,642,416.36
	GOV OF MALAYSIA	730,000.00	744,586.78
	GOV OF MALAYSIA	940,000.00	943,288.68
	GOV OF MALAYSIA	1,980,000.00	1,986,475.39
	GOV OF MALAYSIA	130,000.00	130,072.73
	GOV OF MALAYSIA	1,790,000.00	1,762,039.23
	GOV OF MALAYSIA	1,920,000.00	1,923,715.38
	GOV OF MALAYSIA	2,520,000.00	2,495,307.09
	GOV OF MALAYSIA	520,000.00	534,735.50
	GOV OF MALAYSIA	1,860,000.00	1,850,729.46
	GOV OF MALAYSIA	1,130,000.00	1,165,923.03
	GOV OF MALAYSIA	1,200,000.00	1,082,159.52
	GOV OF MALAYSIA	1,450,000.00	1,467,805.85
	GOV OF MALAYSIA	930,000.00	893,868.50
	GOV OF MALAYSIA	1,140,000.00	1,111,456.62
	GOV OF MALAYSIA	1,100,000.00	1,148,991.58
	GOV OF MALAYSIA	1,100,000.00	1,068,693.42
	GOV OF MALAYSIA	1,860,000.00	1,869,642.05
	GOV OF MALAYSIA	1,610,000.00	1,704,047.18
	GOV OF MALAYSIA	890,000.00	952,348.41
	GOV OF MALAYSIA	2,150,000.00	2,001,193.42
	GOV OF MALAYSIA	1,150,000.00	1,199,338.90
GOV OF MALAYSIA	860,000.00	921,461.70	
GOV OF MALAYSIA	700,000.00	730,290.54	
GOV OF MALAYSIA	1,280,000.00	1,368,580.48	
GOV OF MALAYSIA	2,050,000.00	1,919,295.99	
マレーシアリングット 小計		40,080,000.00	40,110,636.04 (1,243,148,942)
中国元	GOV OF CHINA	14,910,000.00	14,905,582.90
	GOV OF CHINA	17,330,000.00	17,456,623.37
	GOV OF CHINA	9,400,000.00	9,372,065.26

	GOV OF CHINA	12,400,000.00	12,416,668.08	
	GOV OF CHINA	18,010,000.00	17,881,260.37	
	GOV OF CHINA	14,370,000.00	14,328,245.95	
	GOV OF CHINA	9,490,000.00	9,378,397.60	
	GOV OF CHINA	7,880,000.00	7,828,960.84	
	GOV OF CHINA	17,280,000.00	17,531,375.61	
	GOV OF CHINA	15,990,000.00	16,235,964.57	
	GOV OF CHINA	20,200,000.00	20,244,506.66	
	GOV OF CHINA	15,880,000.00	15,684,629.30	
	GOV OF CHINA	12,100,000.00	12,008,843.80	
	GOV OF CHINA	10,920,000.00	10,986,359.74	
	GOV OF CHINA	19,690,000.00	19,511,313.25	
	GOV OF CHINA	11,890,000.00	12,251,618.89	
	GOV OF CHINA	12,240,000.00	12,414,842.28	
	GOV OF CHINA	14,250,000.00	14,342,163.30	
	GOV OF CHINA	13,700,000.00	13,687,643.01	
	GOV OF CHINA	12,740,000.00	12,686,199.22	
	GOV OF CHINA	18,000,000.00	17,735,850.00	
	GOV OF CHINA	13,050,000.00	12,890,124.84	
	GOV OF CHINA	10,600,000.00	10,930,387.16	
	GOV OF CHINA	13,590,000.00	13,744,633.81	
	GOV OF CHINA	6,250,000.00	6,251,786.25	
	GOV OF CHINA	6,960,000.00	6,888,653.10	
	GOV OF CHINA	6,400,000.00	6,320,650.81	
	GOV OF CHINA	8,220,000.00	8,066,203.80	
	GOV OF CHINA	3,110,000.00	3,503,844.80	
	GOV OF CHINA	4,600,000.00	5,004,378.64	
	GOV OF CHINA	5,670,000.00	5,700,032.28	
	GOV OF CHINA	11,170,000.00	12,098,690.55	
	GOV OF CHINA	7,470,000.00	7,937,128.23	
	GOV OF CHINA	9,640,000.00	9,947,757.00	
	GOV OF CHINA	5,800,000.00	5,833,801.82	
	中国元 小計	411,200,000.00	414,007,187.09 (8,134,951,421)	
イスラエルシュケル	GOV OF ISRAEL	990,000.00	974,209.50	

	GOV OF ISRAEL	1,470,000.00	1,514,026.50	
	GOV OF ISRAEL	1,460,000.00	1,379,773.00	
	GOV OF ISRAEL	1,940,000.00	1,816,907.00	
	GOV OF ISRAEL	1,840,000.00	1,771,276.00	
	GOV OF ISRAEL	1,580,000.00	1,456,602.00	
	GOV OF ISRAEL	1,490,000.00	1,653,602.00	
	GOV OF ISRAEL	1,230,000.00	1,179,754.50	
	GOV OF ISRAEL	1,350,000.00	1,285,065.00	
	GOV OF ISRAEL	2,150,000.00	1,846,957.50	
	GOV OF ISRAEL	650,000.00	551,980.00	
	GOV OF ISRAEL	1,520,000.00	1,202,472.00	
	GOV OF ISRAEL	1,520,000.00	2,019,624.00	
	GOV OF ISRAEL	2,110,000.00	2,243,352.00	
	イスラエルシェケル 小計	21,300,000.00	20,895,601.00 (833,556,867)	
	合計		228,041,065,910 (228,041,065,910)	

(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 256銘柄	100.0%	50.5%
カナダドル	国債証券 37銘柄	100.0%	2.0%
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%	34.0%
英ポンド	国債証券 55銘柄	100.0%	4.8%
スウェーデンクローナ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.2%
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 7銘柄	100.0%	0.3%
ポーランドズロチ	国債証券 14銘柄	100.0%	0.4%
オーストラリアドル	国債証券 27銘柄	100.0%	1.6%
ニュージーランドドル	国債証券 13銘柄	100.0%	0.2%
シンガポールドル	国債証券 20銘柄	100.0%	0.5%

マレーシアリングット	国債証券	30銘柄	100.0%	0.5%
中国元	国債証券	35銘柄	100.0%	3.6%
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新興国債券マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2022年12月12日現在

資産の部	
流動資産	
預金	12,496,238
コール・ローン	10,147,518
投資信託受益証券	10,096,355,093
流動資産合計	10,118,998,849
資産合計	10,118,998,849
負債の部	
流動負債	
未払解約金	70,000
未払利息	27
流動負債合計	70,027
負債合計	70,027
純資産の部	
元本等	
元本	8,879,397,999
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,239,530,823
元本等合計	10,118,928,822
純資産合計	10,118,928,822
負債純資産合計	10,118,998,849

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

(貸借対照表に関する注記)

2022年12月12日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年12月11日
期首元本額	6,641,823,507円
期中追加設定元本額	4,180,952,923円
期中一部解約元本額	1,943,378,431円
期末元本額	8,879,397,999円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	923,588,098円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	963,755,519円
りそなラップ型ファンド(成長型)	593,231,928円
DCりそな グローバルバランス	22,585,135円
つみたてバランスファンド	1,213,527,482円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	305,481,487円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	193,260,004円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	133,415,091円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	62,254,770円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	40,442,030円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	22,585,748円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	43,989,544円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	118,497,353円
九州SDGs・グローバルバランス	44,983,344円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定型)	938,314円

ラップ型ファンド・プラスESG(安定成長型)	4,152,981円
ラップ型ファンド・プラスESG(成長型)	7,670,649円
FWりそな先進国+新興国債券アクティブファンド	8,816,483円
FWりそな新興国債券インデックスファンド	3,618,595,562円
Smart-i 8資産バランス 安定型	63,483,323円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	199,905,626円
Smart-i 8資産バランス 成長型	237,771,804円
りそなVIグローバル・バランスファンド(安定型)(適格機関投資家専用)	1,844,883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)	6,129,680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)	22,124,336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)	26,366,825円
2. 計算日における受益権の総数	8,879,397,999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	1.1396円
(10,000口当たり純資産額)	(11,396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12月12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12月12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12月12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12月12日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
投資信託受益証券		1,213,053,963
合計		1,213,053,963

(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	1,373,147	59,402,339.22	
		VANECK J.P.MORGAN EM LOCAL	596,732	14,423,012.44	
		米ドル 小計	1,969,879	73,825,351.66 (10,096,355,093)	
合計				10,096,355,093 (10,096,355,093)	

(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。

R M先進国株式マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2022年12月12日現在

資産の部	
流動資産	
預金	7,757,417,424
コール・ローン	282,024,333
株式	146,322,143,192
投資証券	3,466,841,191
派生商品評価勘定	27,751,062
未収入金	72,361
未収配当金	201,584,165
差入委託証拠金	3,096,546,860
流動資産合計	161,154,380,588
資産合計	161,154,380,588
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	88,512,376
未払解約金	6,884,500
未払利息	764
流動負債合計	95,397,640
負債合計	95,397,640
純資産の部	
元本等	
元本	76,433,099,907
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	84,625,883,041
元本等合計	161,058,982,948
純資産合計	161,058,982,948
負債純資産合計	161,154,380,588

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12月12日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年12月11日
期首元本額	61,910,099,032円
期中追加設定元本額	61,079,994,329円
期中一部解約元本額	46,556,993,454円
期末元本額	76,433,099,907円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	2,842,984,622円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	8,191,072,296円
りそなラップ型ファンド(成長型)	8,147,608,487円
DCりそな グローバルバランス	70,014,266円
つみたてバランスファンド	2,543,801,858円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	1,963,933,980円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	1,279,452,007円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	855,517,429円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	395,590,833円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	257,428,667円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	144,261,656円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	279,711,982円
FWりそな先進国株式アクティブファンド	171,512,526円
FWりそな先進国+新興国株式アクティブファンド	175,423,741円
FWりそな先進国株式インデックスファンド	30,185,222,723円
Smart-i 先進国株式インデックス	12,643,751,494円
Smart-i 8資産バランス 安定型	425,833,631円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	1,285,034,686円
Smart-i 8資産バランス 成長型	1,553,015,501円
Smart-i Select 全世界株式インデックス	123,678,218円

Smart - i Select 全世界株式インデックス(除く日本)	103,291,355円
りそなFT 先進国株式インデックス(適格機関投資家専用)	342,646,765円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	61,297,496円
りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	917,589,249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)	5,694,435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)	61,041,856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)	315,423,084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)	401,110,231円
りそなFT パッシブバランス(適格機関投資家専用)	560,370,546円
りそなDAAファンド202205(適格機関投資家専用)	129,784,287円
2. 計算日における受益権の総数	76,433,099,907口
3. 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	2.1072円
(10,000口当たり純資産額)	(21,072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12月12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12月12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る場合、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12月12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12月12日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式		9,500,622,853
投資証券		574,636,004
合計		10,075,258,857

（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12月12日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	11,444,426,554	-	11,383,952,048	60,474,506
	合計	11,444,426,554	-	11,383,952,048	60,474,506

(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12月12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	413,940,961	-	413,654,153	286,808
	米ドル	335,062,962	-	334,956,532	106,430
	カナダドル	8,050,904	-	8,005,984	44,920
	ユーロ	34,604,093	-	34,499,096	104,997
	英ポンド	13,385,462	-	13,373,390	12,072
	スイスフラン	8,020,688	-	8,032,516	11,828
	デンマーククロー ネ	2,720,032	-	2,705,934	14,098
	オーストラリアド ル	5,555,988	-	5,541,756	14,232
	香港ドル	3,505,180	-	3,511,540	6,360
	シンガポールドル	3,035,652	-	3,027,405	8,247
	合計	413,940,961	-	413,654,153	286,808

(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	APA CORP	7,486	41.86	313,363.96	
	BAKER HUGHES COMPANY	23,300	27.11	631,663.00	
	CHENIERE ENERGY INC	5,017	158.53	795,345.01	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	2,373	94.72	224,770.56	
	CHEVRON CORP	42,560	168.00	7,150,080.00	
	CONOCOPHILLIPS	29,155	110.02	3,207,633.10	
	COTERRA ENERGY INC	18,362	24.48	449,501.76	
	DEVON ENERGY CORP	14,296	59.62	852,327.52	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	3,895	129.60	504,792.00	
	EOG RESOURCES INC	13,438	121.67	1,635,001.46	
	EQT CORP	7,361	35.67	262,566.87	
	EXXON MOBIL CORP	95,370	103.54	9,874,609.80	
	HALLIBURTON CO	20,869	33.01	688,885.69	
	HESS CORP	6,406	129.32	828,423.92	
	HF SINCLAIR CORP	3,758	48.72	183,089.76	
	KINDER MORGAN INC	46,839	17.45	817,340.55	
	MARATHON OIL CORP	15,148	26.17	396,423.16	
	MARATHON PETROLEUM CORP	11,442	106.83	1,222,348.86	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	21,372	62.60	1,337,887.20	
	ONEOK INC	10,291	63.55	653,993.05	
OVINTIV INC	5,876	46.71	274,467.96		
PHILLIPS 66	11,045	98.00	1,082,410.00		

PIONEER NATURAL RESOURCES CO	5,204	214.00	1,113,656.00
SCHLUMBERGER LTD	32,442	46.97	1,523,800.74
TARGA RESOURCES CORP	4,794	68.62	328,964.28
TEXAS PACIFIC LAND CORP	131	2,380.08	311,790.48
VALERO ENERGY CORP	8,923	114.65	1,023,021.95
WILLIAMS COS INC	28,005	32.59	912,682.95
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	5,093	314.41	1,601,290.13
ALBEMARLE CORP	2,701	253.25	684,028.25
ALCOA CORP	4,122	45.08	185,819.76
AMCOR PLC	33,475	12.37	414,085.75
AVERY DENNISON CORP	1,820	177.73	323,468.60
BALL CORP	7,123	53.56	381,507.88
CELANESE CORP	2,288	102.36	234,199.68
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	4,424	98.70	436,648.80
CLEVELAND-CLIFFS INC	11,727	15.50	181,768.50
CORTEVA INC	16,528	62.99	1,041,098.72
CROWN HOLDINGS INC	2,893	80.26	232,192.18
DOW INC	16,016	50.20	804,003.20
DUPONT DE NEMOURS INC	11,542	68.89	795,128.38
EASTMAN CHEMICAL CO	2,948	85.17	251,081.16
ECOLAB INC	5,907	150.35	888,117.45
FMC CORP	2,662	126.60	337,009.20
FREEMPORT-MCMORAN INC	32,856	38.59	1,267,913.04
INTERNATIONAL PAPER CO	7,843	36.08	282,975.44
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	5,891	107.26	631,868.66
LINDE PLC	11,417	332.21	3,792,841.57
LYONDELLBASELL INDU-CL A	6,040	81.46	492,018.40
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,443	356.94	515,064.42
MOSAIC CO/THE	7,681	46.81	359,547.61
NEWMONT CORP	18,287	46.40	848,516.80
NUCOR CORP	5,856	147.07	861,241.92
PACKAGING CORP OF AMERICA	2,087	135.11	281,974.57
PPG INDUSTRIES INC	5,420	130.41	706,822.20
RPM INTERNATIONAL INC	2,885	103.45	298,453.25
SEALED AIR CORP	3,468	50.78	176,105.04

SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	5,656	252.88	1,430,289.28
STEEL DYNAMICS INC	4,203	108.41	455,647.23
VULCAN MATERIALS CO	3,073	182.45	560,668.85
WESTLAKE CORP	709	106.66	75,621.94
WESTROCK CO	5,696	35.88	204,372.48
3M CO	12,717	125.76	1,599,289.92
AERCAP HOLDINGS NV	3,113	58.74	182,857.62
ALLEGION PLC	2,011	109.13	219,460.43
AMETEK INC	5,299	139.11	737,143.89
BOEING CO/THE	12,942	179.54	2,323,606.68
CARLISLE COS INC	1,097	248.33	272,418.01
CARRIER GLOBAL CORP	18,677	43.02	803,484.54
CATERPILLAR INC	12,104	227.29	2,751,118.16
CUMMINS INC	3,252	238.14	774,431.28
DEERE & CO	6,657	434.81	2,894,530.17
DOVER CORP	3,331	137.29	457,312.99
EATON CORP PLC	9,152	158.28	1,448,578.56
EMERSON ELECTRIC CO	13,596	94.19	1,280,607.24
FASTENAL CO	13,275	50.96	676,494.00
FERGUSON PLC	4,842	127.12	615,515.04
FORTIVE CORP	7,831	65.72	514,653.32
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	3,093	60.33	186,600.69
GENERAC HOLDINGS INC	1,351	92.67	125,197.17
GENERAL DYNAMICS CORP	5,359	247.04	1,323,887.36
GENERAL ELECTRIC CO	25,160	81.45	2,049,282.00
HEICO CORP	850	157.03	133,475.50
HEICO CORP-CLASS A	1,635	122.29	199,944.15
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	15,441	211.63	3,267,778.83
HOWMET AEROSPACE INC	8,389	38.00	318,782.00
HUBBELL INC	1,246	250.10	311,624.60
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	887	233.36	206,990.32
IDEX CORP	1,612	235.21	379,158.52
ILLINOIS TOOL WORKS	7,112	219.76	1,562,933.12
INGERSOLL-RAND INC	9,347	53.25	497,727.75
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	3,600	49.11	176,796.00

JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	15,857	65.77	1,042,914.89
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	4,406	215.53	949,625.18
LENNOX INTERNATIONAL INC	740	257.59	190,616.60
LOCKHEED MARTIN CORP	5,472	483.58	2,646,149.76
MASCO CORP	5,082	49.32	250,644.24
NORDSON CORP	1,109	232.90	258,286.10
NORTHROP GRUMMAN CORP	3,375	528.94	1,785,172.50
OTIS WORLDWIDE CORP	9,699	78.46	760,983.54
OWENS CORNING	2,008	92.80	186,342.40
PACCAR INC	8,018	101.26	811,902.68
PARKER HANNIFIN CORP	2,960	289.44	856,742.40
PENTAIR PLC	3,662	45.07	165,046.34
PLUG POWER INC	10,512	13.36	140,440.32
QUANTA SERVICES INC	3,318	148.14	491,528.52
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	33,842	98.27	3,325,653.34
ROCKWELL AUTOMATION INC	2,666	259.81	692,653.46
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	3,195	43.46	138,854.70
SMITH (A.O.) CORP	2,663	58.30	155,252.90
SNAP-ON INC	1,132	233.84	264,706.88
STANLEY BLACK & DECKER INC	3,460	79.23	274,135.80
TEXTRON INC	4,797	71.71	343,992.87
TRANE TECHNOLOGIES PLC	5,338	175.26	935,537.88
TRANSDIGM GROUP INC	1,190	609.70	725,543.00
UNITED RENTALS INC	1,620	352.63	571,260.60
WABTEC CORP	3,728	100.39	374,253.92
WW GRAINGER INC	1,058	588.06	622,167.48
XYLEM INC	4,182	111.23	465,163.86
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	2,829	104.83	296,564.07
CINTAS CORP	2,033	453.46	921,884.18
CLARIVATE PLC	5,086	9.00	45,774.00
COPART INC	9,918	63.79	632,669.22
COSTAR GROUP INC	9,166	80.70	739,696.20
EQUIFAX INC	2,845	197.45	561,745.25
JACOBS SOLUTIONS INC	2,891	121.36	350,851.76
LEIDOS HOLDINGS INC	2,918	106.85	311,788.30

REPUBLIC SERVICES INC	5,122	135.81	695,618.82
ROBERT HALF INTL INC	2,237	73.01	163,323.37
ROLLINS INC	4,981	38.51	191,818.31
TRANSUNION	4,324	58.93	254,813.32
VERISK ANALYTICS INC	3,639	182.51	664,153.89
WASTE CONNECTIONS INC	5,943	139.94	831,663.42
WASTE MANAGEMENT INC	9,507	166.83	1,586,052.81
AMERCO-NON VOTING	1,611	59.07	95,161.77
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	2,744	95.30	261,503.20
CSX CORP	49,426	31.42	1,552,964.92
DELTA AIR LINES INC	2,928	33.80	98,966.40
EXPEDITORS INTL WASH INC	3,580	107.91	386,317.80
FEDEX CORP	5,730	172.33	987,450.90
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	34,707	3.02	104,815.14
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	1,787	177.98	318,050.26
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	3,209	54.78	175,789.02
NORFOLK SOUTHERN CORP	5,430	244.05	1,325,191.50
OLD DOMINION FREIGHT LINE	2,222	292.23	649,335.06
SOUTHWEST AIRLINES CO	3,155	38.01	119,921.55
UBER TECHNOLOGIES INC	34,478	26.55	915,390.90
UNION PACIFIC CORP	14,352	211.35	3,033,295.20
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	16,819	177.64	2,987,727.16
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERV	1,867	18.57	34,670.19
APTIV PLC	6,301	93.28	587,757.28
BORGWARNER INC	5,370	40.47	217,323.90
FORD MOTOR CO	91,108	13.18	1,200,803.44
GENERAL MOTORS CO	31,952	38.28	1,223,122.56
LEAR CORP	1,321	130.39	172,245.19
LUCID GROUP INC	7,369	8.68	63,962.92
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	6,658	27.29	181,696.82
TESLA INC	60,981	179.05	10,918,648.05
DR HORTON INC	7,736	85.34	660,190.24
GARMIN LTD	3,296	95.03	313,218.88
HASBRO INC	2,959	59.49	176,030.91
LENNAR CORP-A	6,014	88.50	532,239.00

LULULEMON ATHLETICA INC	2,701	326.39	881,579.39
MOHAWK INDUSTRIES INC	1,164	99.45	115,759.80
NEWELL RUBBERMAID INC	9,042	13.44	121,524.48
NIKE INC -CL B	29,052	109.42	3,178,869.84
NVR INC	70	4,648.53	325,397.10
PULTEGROUP INC	5,004	43.92	219,775.68
VF CORP	7,064	28.20	199,204.80
WHIRLPOOL CORP	1,180	143.81	169,695.80
AIRBNB INC-CLASS A	8,762	94.70	829,761.40
ARAMARK	5,568	41.16	229,178.88
BOOKING HOLDINGS INC	912	2,019.98	1,842,221.76
CAESARS ENTERTAINMENT INC	5,148	49.34	254,002.32
CARNIVAL CORP	21,713	8.87	192,594.31
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	641	1,526.26	978,332.66
DARDEN RESTAURANTS INC	2,770	142.57	394,918.90
DOMINO'S PIZZA INC	770	362.65	279,240.50
EXPEDIA GROUP INC	3,366	94.10	316,740.60
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	6,112	137.43	839,972.16
LAS VEGAS SANDS CORP	7,277	47.31	344,274.87
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	6,363	161.16	1,025,461.08
MCDONALD'S CORP	16,859	272.04	4,586,322.36
MGM RESORTS INTERNATIONAL	7,436	36.35	270,298.60
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	5,129	56.21	288,301.09
STARBUCKS CORP	26,330	101.79	2,680,130.70
VAIL RESORTS INC	907	258.64	234,586.48
WYNN RESORTS LTD	2,440	84.99	207,375.60
YUM! BRANDS INC	6,575	127.71	839,693.25
ACTIVISION BLIZZARD INC	18,163	75.16	1,365,131.08
ALPHABET INC-CL A	137,361	92.83	12,751,221.63
ALPHABET INC-CL C	127,083	93.07	11,827,614.81
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	2,595	380.57	987,579.15
COMCAST CORP-CLASS A	101,295	35.32	3,577,739.40
DISH NETWORK CORP-A	5,559	14.74	81,939.66
ELECTRONIC ARTS INC	6,516	124.71	812,610.36
FOX CORP - CLASS A	6,268	31.31	196,251.08

FOX CORP- CLASS B	2,680	29.41	78,818.80
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	8,480	32.07	271,953.60
LIBERTY BROADBAND-C	2,684	88.15	236,594.60
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	4,198	61.67	258,890.66
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	3,736	41.36	154,520.96
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	1,676	41.48	69,520.48
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	3,704	71.77	265,836.08
MATCH GROUP INC	6,184	43.58	269,498.72
META PLATFORMS INC-CLASS A	52,352	115.90	6,067,596.80
NETFLIX INC	10,243	320.01	3,277,862.43
NEWS CORP - CLASS A	7,871	18.05	142,071.55
OMNICOM GROUP	4,650	75.65	351,772.50
PARAMOUNT GLOBAL	13,751	19.02	261,544.02
PINTEREST INC- CLASS A	12,990	23.16	300,848.40
ROBLOX CORP -CLASS A	7,627	31.65	241,394.55
ROKU INC	2,563	51.74	132,609.62
SEA LTD-ADR	8,556	60.65	518,921.40
SIRIUS XM HOLDINGS INC	18,628	6.11	113,817.08
SNAP INC - A	23,591	9.45	222,934.95
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	3,987	102.06	406,913.22
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	10,565	47.81	505,112.65
WALT DISNEY CO/THE	41,910	93.38	3,913,555.80
WARNER BROS DISCOVERY INC	54,588	11.09	605,380.92
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	5,643	29.04	163,872.72
ADVANCE AUTO PARTS INC	1,197	145.90	174,642.30
AMAZON.COM INC	209,843	89.09	18,694,912.87
AUTOZONE INC	450	2,454.99	1,104,745.50
BATH & BODY WORKS INC	4,827	42.31	204,230.37
BEST BUY CO INC	4,752	81.81	388,761.12
BURLINGTON STORES INC	1,583	194.92	308,558.36
CARMAX INC	3,422	65.70	224,825.40
CHEWY INC - CLASS A	1,778	43.65	77,609.70
DOLLAR GENERAL CORP	5,203	243.26	1,265,681.78
DOLLAR TREE INC	5,197	142.31	739,585.07
DOORDASH INC - A	5,455	55.27	301,497.85

EBAY INC	12,480	43.64	544,627.20
ETSY INC	2,859	126.78	362,464.02
GENUINE PARTS CO	3,295	182.26	600,546.70
HOME DEPOT INC	23,451	320.48	7,515,576.48
LKQ CORP	5,731	53.23	305,061.13
LOWE'S COS INC	14,250	201.77	2,875,222.50
MERCADOLIBRE INC	1,048	896.48	939,511.04
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	1,446	827.80	1,196,998.80
POOL CORP	850	331.01	281,358.50
ROSS STORES INC	8,099	114.89	930,494.11
TARGET CORP	10,595	152.28	1,613,406.60
TJX COMPANIES INC	26,695	78.06	2,083,811.70
TRACTOR SUPPLY COMPANY	2,589	218.32	565,230.48
ULTA BEAUTY INC	1,160	471.63	547,090.80
COSTCO WHOLESALE CORP	10,153	483.02	4,904,102.06
KROGER CO	15,290	46.47	710,526.30
SYSCO CORP	11,702	82.23	962,255.46
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	17,067	40.43	690,018.81
WALMART INC	34,555	145.31	5,021,187.05
ALTRIA GROUP INC	41,364	46.71	1,932,112.44
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	12,903	91.88	1,185,527.64
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	7,197	67.92	488,820.24
BUNGE LTD	3,397	95.51	324,447.47
CAMPBELL SOUP CO	4,494	55.66	250,136.04
COCA-COLA CO/THE	94,099	63.14	5,941,410.86
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	4,720	53.90	254,408.00
CONAGRA BRANDS INC	11,189	38.02	425,405.78
CONSTELLATION BRANDS INC-A	3,587	242.04	868,197.48
DARLING INGREDIENTS INC	3,733	62.33	232,677.89
GENERAL MILLS INC	13,720	85.84	1,177,724.80
HERSHEY CO/THE	3,393	236.77	803,360.61
HORMEL FOODS CORP	6,349	47.02	298,529.98
JM SMUCKER CO/THE	2,428	154.68	375,563.04
KELLOGG CO	5,674	72.34	410,457.16
KEURIG DR PEPPER INC	18,019	37.93	683,460.67

KRAFT HEINZ CO/THE	17,019	39.94	679,738.86
LAMB WESTON HOLDINGS INC	3,348	85.58	286,521.84
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	5,822	85.28	496,500.16
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	4,430	52.46	232,397.80
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	31,468	67.06	2,110,244.08
MONSTER BEVERAGE CORP	9,115	100.04	911,864.60
PEPSICO INC	31,610	183.10	5,787,791.00
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	35,538	102.09	3,628,074.42
TYSON FOODS INC-CL A	6,742	63.75	429,802.50
CHURCH & DWIGHT CO INC	5,609	80.03	448,888.27
CLOROX COMPANY	2,844	148.78	423,130.32
COLGATE-PALMOLIVE CO	18,181	77.78	1,414,118.18
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	5,312	240.41	1,277,057.92
KIMBERLY-CLARK CORP	7,754	136.20	1,056,094.80
PROCTER & GAMBLE CO/THE	54,595	150.92	8,239,477.40
ABBOTT LABORATORIES	40,136	107.51	4,315,021.36
ABIOMED INC	1,006	380.75	383,034.50
ALIGN TECHNOLOGY INC	1,588	188.81	299,830.28
AMERISOURCEBERGEN CORP	3,606	165.33	596,179.98
BAXTER INTERNATIONAL INC	11,671	52.38	611,326.98
BECTON DICKINSON AND CO	6,559	247.60	1,624,008.40
BOSTON SCIENTIFIC CORP	32,937	46.23	1,522,677.51
CARDINAL HEALTH INC	6,008	77.55	465,920.40
CENTENE CORP	12,787	86.25	1,102,878.75
CIGNA CORP	6,913	332.12	2,295,945.56
COOPER COS INC/THE	1,046	309.47	323,705.62
CVS HEALTH CORP	30,113	101.65	3,060,986.45
DAVITA INC	1,175	74.34	87,349.50
DENTSPLY SIRONA INC	4,858	30.26	147,003.08
DEXCOM INC	9,054	116.46	1,054,428.84
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	14,291	74.01	1,057,676.91
ELEVANCE HEALTH INC	5,506	524.92	2,890,209.52
HCA HEALTHCARE INC	5,165	237.59	1,227,152.35
HENRY SCHEIN INC	3,081	81.20	250,177.20
HOLOGIC INC	5,505	74.00	407,370.00

HUMANA INC	2,910	533.42	1,552,252.20
IDEXX LABORATORIES INC	1,925	420.63	809,712.75
INSULET CORP	1,616	302.32	488,549.12
INTUITIVE SURGICAL INC	8,200	270.60	2,218,920.00
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	1,965	233.56	458,945.40
MASIMO CORP	1,017	138.49	140,844.33
MCKESSON CORP	3,310	371.41	1,229,367.10
MEDTRONIC PLC	30,525	78.59	2,398,959.75
MOLINA HEALTHCARE INC	1,354	341.15	461,917.10
NOVOCURE LTD	2,101	75.30	158,205.30
QUEST DIAGNOSTICS INC	2,591	148.85	385,670.35
RESMED INC	3,386	219.68	743,836.48
STERIS PLC	2,331	191.96	447,458.76
STRYKER CORP	7,825	244.63	1,914,229.75
TELEFLEX INC	1,063	247.34	262,922.42
UNITEDHEALTH GROUP INC	21,412	539.20	11,545,350.40
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	1,578	127.33	200,926.74
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	3,249	172.17	559,380.33
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	4,870	124.40	605,828.00
ABBVIE INC	40,486	163.06	6,601,647.16
AGILENT TECHNOLOGIES INC	6,816	152.95	1,042,507.20
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	2,778	231.33	642,634.74
AMGEN INC	12,260	278.65	3,416,249.00
AVANTOR INC	15,657	21.51	336,782.07
BIO-RAD LABORATORIES-A	437	416.09	181,831.33
BIO-TECHNE CORP	3,324	80.73	268,346.52
BIOGEN INC	3,343	285.37	953,991.91
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	4,308	102.33	440,837.64
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	48,928	78.83	3,856,994.24
CATALENT INC	3,320	44.68	148,337.60
CHARLES RIVER LABORATORIES	1,128	210.17	237,071.76
DANAHER CORP	15,834	269.34	4,264,729.56
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	9,434	12.67	119,528.78
ELI LILLY & CO	18,493	360.99	6,675,788.07
EXACT SCIENCES CORP	3,857	44.60	172,022.20

GILEAD SCIENCES INC	28,750	87.97	2,529,137.50
HORIZON THERAPEUTICS PLC	4,848	97.29	471,661.92
ILLUMINA INC	3,630	205.62	746,400.60
INCYTE CORP	3,980	82.34	327,713.20
IQVIA HOLDINGS INC	4,152	208.53	865,816.56
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	1,394	151.95	211,818.30
JOHNSON & JOHNSON	60,178	175.74	10,575,681.72
MERCK & CO. INC.	58,009	108.78	6,310,219.02
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	520	1,455.56	756,891.20
MODERNA INC	7,645	177.35	1,355,840.75
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	2,222	117.24	260,507.28
PERKINELMER INC	2,800	139.15	389,620.00
PFIZER INC	128,514	51.72	6,646,744.08
REGENERON PHARMACEUTICALS	2,461	750.06	1,845,897.66
REPLIGEN CORP	1,261	163.32	205,946.52
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	8,124	41.75	339,177.00
SEAGEN INC	3,213	124.00	398,412.00
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	27,916	8.44	235,611.04
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	8,974	560.23	5,027,504.02
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	5,888	312.22	1,838,351.36
VIATRIS INC	25,584	10.78	275,795.52
WATERS CORP	1,390	336.53	467,776.70
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	1,720	239.01	411,097.20
ZOETIS INC	10,754	153.39	1,649,556.06
BANK OF AMERICA CORP	165,519	32.38	5,359,505.22
CITIGROUP INC	44,379	44.86	1,990,841.94
CITIZENS FINANCIAL GROUP	10,929	39.82	435,192.78
FIFTH THIRD BANCORP	15,801	32.89	519,694.89
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	253	777.43	196,689.79
FIRST HORIZON CORP	12,379	24.48	303,037.92
FIRST REPUBLIC BANK/CA	4,210	116.98	492,485.80
HUNTINGTON BANCSHARES INC	33,237	14.55	483,598.35
JPMORGAN CHASE & CO	67,107	132.16	8,868,861.12
KEYCORP	21,515	17.42	374,791.30
M & T BANK CORP	4,039	151.38	611,423.82

PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	9,404	154.08	1,448,968.32
REGIONS FINANCIAL CORP	21,539	22.02	474,288.78
SIGNATURE BANK	1,320	118.56	156,499.20
SVB FINANCIAL GROUP	1,242	220.27	273,575.34
TRUIST FINANCIAL CORP	30,422	42.08	1,280,157.76
US BANCORP	32,372	43.11	1,395,556.92
WEBSTER FINANCIAL CORP	3,958	47.21	186,857.18
WELLS FARGO & CO	86,841	42.50	3,690,742.50
ALLY FINANCIAL INC	6,518	25.01	163,015.18
AMERICAN EXPRESS CO	14,637	153.90	2,252,634.30
AMERIPRISE FINANCIAL INC	2,502	321.04	803,242.08
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	9,280	62.88	583,526.40
ARES MANAGEMENT CORP - A	3,613	69.16	249,875.08
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	17,760	44.71	794,049.60
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	29,790	306.39	9,127,358.10
BLACKROCK INC	3,461	706.95	2,446,753.95
BLACKSTONE INC	16,152	78.48	1,267,608.96
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	8,656	94.41	817,212.96
CARLYLE GROUP INC/THE	3,559	29.55	105,168.45
CBOE GLOBAL MARKETS INC	2,271	124.39	282,489.69
CME GROUP INC	8,273	178.83	1,479,460.59
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	2,729	40.24	109,814.96
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	6,332	103.00	652,196.00
EQUITABLE HOLDINGS INC	7,916	29.70	235,105.20
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	886	449.74	398,469.64
FRANKLIN RESOURCES INC	5,894	26.59	156,721.46
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	1,496	66.67	99,738.32
GOLDMAN SACHS GROUP INC	7,832	359.14	2,812,784.48
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	12,859	103.33	1,328,720.47
INVESCO LTD	7,706	18.35	141,405.10
KKR & CO INC	12,961	48.00	622,128.00
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	1,862	221.04	411,576.48
MARKETAXESS HOLDINGS INC	905	280.93	254,241.65
MOODY'S CORP	3,808	287.97	1,096,589.76
MORGAN STANLEY	29,553	89.47	2,644,106.91

MSCI INC	1,859	492.55	915,650.45
NASDAQ INC	8,045	63.20	508,444.00
NORTHERN TRUST CORP	4,621	87.86	406,001.06
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	4,520	113.46	512,839.20
S&P GLOBAL INC	7,819	346.75	2,711,238.25
SCHWAB (CHARLES) CORP	33,376	79.82	2,664,072.32
SEI INVESTMENTS COMPANY	2,390	60.67	145,001.30
STATE STREET CORP	8,531	79.03	674,204.93
SYNCHRONY FINANCIAL	11,238	35.11	394,566.18
T ROWE PRICE GROUP INC	5,236	119.83	627,429.88
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	2,509	64.55	161,955.95
AFLAC INC	13,396	69.96	937,184.16
ALLSTATE CORP	6,234	128.55	801,380.70
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	1,681	135.97	228,565.57
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	17,327	62.51	1,083,110.77
AON PLC	4,847	305.68	1,481,630.96
ARCH CAPITAL GROUP LTD	8,018	60.04	481,400.72
ARTHUR J GALLAGHER & CO	4,846	191.83	929,608.18
ASSURANT INC	1,121	130.36	146,133.56
BROWN & BROWN INC	5,303	57.50	304,922.50
CHUBB LTD	9,585	217.33	2,083,108.05
CINCINNATI FINANCIAL CORP	3,369	105.91	356,810.79
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	563	266.90	150,264.70
EVEREST RE GROUP LTD	878	332.56	291,987.68
FNF GROUP	5,699	37.33	212,743.67
GLOBE LIFE INC	1,918	116.52	223,485.36
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	7,482	74.64	558,456.48
LINCOLN NATIONAL CORP	3,629	31.66	114,894.14
LOEWS CORP	4,757	56.48	268,675.36
MARKEL CORP	300	1,298.06	389,418.00
MARSH & MCLENNAN COS	11,455	171.06	1,959,492.30
METLIFE INC	15,598	72.19	1,126,019.62
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	5,566	88.07	490,197.62
PROGRESSIVE CORP	13,429	129.38	1,737,444.02
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	8,573	101.37	869,045.01

TRAVELERS COS INC/THE	5,465	185.65	1,014,577.25
WILLIS TOWERS WATSON PLC	2,453	244.53	599,832.09
WR BERKLEY CORP	4,929	73.56	362,577.24
CBRE GROUP INC - A	7,515	75.84	569,937.60
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	20,100	4.51	90,651.00
ZILLOW GROUP INC - C	3,663	35.10	128,571.30
ACCENTURE PLC-CL A	14,500	288.41	4,181,945.00
ADOBE INC	10,732	330.64	3,548,428.48
AFFIRM HOLDINGS INC	4,245	11.34	48,138.30
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	3,418	89.02	304,270.36
ANSYS INC	2,029	242.21	491,444.09
ASPEN TECHNOLOGY INC	677	217.05	146,942.85
AUTODESK INC	5,016	194.31	974,658.96
AUTOMATIC DATA PROCESSING	9,539	257.20	2,453,430.80
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	4,314	39.63	170,963.82
BILL.COM HOLDINGS INC	1,987	111.85	222,245.95
BLACK KNIGHT INC	3,497	59.89	209,435.33
BLOCK INC	12,260	64.60	791,996.00
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	2,738	142.11	389,097.18
CADENCE DESIGN SYS INC	6,319	163.67	1,034,230.73
CERIDIAN HCM HOLDING INC	3,080	64.90	199,892.00
CHECK POINT SOFTWARE TECH	2,181	131.53	286,866.93
CLOUDFLARE INC - CLASS A	5,395	48.42	261,225.90
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	11,994	58.34	699,729.96
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	4,702	115.08	541,106.16
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,022	135.87	138,859.14
DATADOG INC - CLASS A	5,770	74.56	430,211.20
DOCUSIGN INC	4,585	49.16	225,398.60
DROPBOX INC-CLASS A	6,720	22.39	150,460.80
DYNATRACE INC	4,836	36.96	178,738.56
EPAM SYSTEMS INC	1,338	343.88	460,111.44
FAIR ISAAC CORP	579	615.45	356,345.55
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	14,045	70.27	986,942.15
FISERV INC	13,987	100.64	1,407,651.68
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	1,512	183.45	277,376.40

FORTINET INC	15,029	52.13	783,461.77
GARTNER INC	1,835	343.30	629,955.50
GEN DIGITAL INC	13,976	22.67	316,835.92
GLOBAL PAYMENTS INC	6,430	97.82	628,982.60
GODADDY INC - CLASS A	3,564	74.72	266,302.08
HUBSPOT INC	1,014	291.38	295,459.32
INTL BUSINESS MACHINES CORP	20,721	147.05	3,047,023.05
INTUIT INC	6,153	399.83	2,460,153.99
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	1,553	181.54	281,931.62
MASTERCARD INC-CLASS A	19,762	348.83	6,893,578.46
MICROSOFT CORP	162,099	245.42	39,782,336.58
MONGODB INC	1,448	191.75	277,654.00
OKTA INC	3,626	64.42	233,586.92
ORACLE CORP	36,685	79.86	2,929,664.10
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	36,959	7.11	262,778.49
PALO ALTO NETWORKS INC	6,890	158.90	1,094,821.00
PAYCHEX INC	7,484	119.51	894,412.84
PAYCOM SOFTWARE INC	1,092	314.13	343,029.96
PAYLOCITY HOLDING CORP	968	202.70	196,213.60
PAYPAL HOLDINGS INC	25,243	73.57	1,857,127.51
PTC INC	2,369	121.19	287,099.11
ROPER TECHNOLOGIES INC	2,446	431.33	1,055,033.18
SALESFORCE INC	22,933	131.11	3,006,745.63
SERVICENOW INC	4,643	393.58	1,827,391.94
SNOWFLAKE INC-CLASS A	5,157	144.53	745,341.21
SPLUNK INC	3,594	87.54	314,618.76
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	4,920	51.74	254,560.80
SYNOPSYS INC	3,525	325.75	1,148,268.75
TOAST INC-CLASS A	5,782	19.30	111,592.60
TWILIO INC - A	3,661	45.55	166,758.55
TYLER TECHNOLOGIES INC	926	323.08	299,172.08
UNITY SOFTWARE INC	5,673	33.93	192,484.89
VERISIGN INC	2,101	197.67	415,304.67
VISA INC-CLASS A SHARES	37,442	208.70	7,814,145.40
VMWARE INC-CLASS A	4,910	120.94	593,815.40

WESTERN UNION CO	7,286	13.98	101,858.28
WIX.COM LTD	1,409	82.74	116,580.66
WORKDAY INC-CLASS A	4,660	169.60	790,336.00
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	4,828	72.16	348,388.48
ZSCALER INC	1,891	117.21	221,644.11
AMPHENOL CORP-CL A	13,668	78.51	1,073,074.68
APPLE INC	367,634	142.16	52,262,849.44
ARISTA NETWORKS INC	5,604	127.90	716,751.60
ARROW ELECTRONICS INC	1,364	106.74	145,593.36
CDW CORP/DE	3,119	185.48	578,512.12
CISCO SYSTEMS INC	94,820	48.46	4,594,977.20
COGNEX CORP	3,981	48.33	192,401.73
CORNING INC	18,514	33.02	611,332.28
DELL TECHNOLOGIES -C	6,107	41.83	255,455.81
F5 INC	1,224	149.49	182,975.76
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	30,029	16.15	484,968.35
HP INC	23,819	28.21	671,933.99
JUNIPER NETWORKS INC	7,685	32.38	248,840.30
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	4,129	180.72	746,192.88
MOTOROLA SOLUTIONS INC	3,835	265.57	1,018,460.95
NETAPP INC	4,730	64.29	304,091.70
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	4,380	54.14	237,133.20
TE CONNECTIVITY LTD	7,090	121.73	863,065.70
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	1,045	405.69	423,946.05
TRIMBLE INC	5,583	57.50	321,022.50
WESTERN DIGITAL CORP	6,591	35.71	235,364.61
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	1,172	251.45	294,699.40
AT&T INC	163,673	19.09	3,124,517.57
LIBERTY GLOBAL PLC-A	2,864	19.03	54,501.92
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	6,233	19.67	122,603.11
LUMEN TECHNOLOGIES INC	19,713	5.49	108,224.37
T-MOBILE US INC	14,427	141.57	2,042,430.39
VERIZON COMMUNICATIONS INC	96,395	37.40	3,605,173.00
AES CORP	15,531	28.52	442,944.12
ALLIANT ENERGY CORP	5,300	55.31	293,143.00

AMEREN CORPORATION	5,992	88.61	530,951.12
AMERICAN ELECTRIC POWER	11,827	96.58	1,142,251.66
AMERICAN WATER WORKS CO INC	4,207	156.14	656,880.98
ATMOS ENERGY CORP	3,253	117.67	382,780.51
CENTERPOINT ENERGY INC	14,634	30.45	445,605.30
CMS ENERGY CORP	6,748	62.22	419,860.56
CONSOLIDATED EDISON INC	7,867	96.53	759,401.51
CONSTELLATION ENERGY	7,553	89.72	677,655.16
DOMINION ENERGY INC	19,162	58.28	1,116,761.36
DTE ENERGY COMPANY	4,494	117.19	526,651.86
DUKE ENERGY CORP	17,686	100.35	1,774,790.10
EDISON INTERNATIONAL	8,839	65.79	581,517.81
ENERGY CORP	4,717	116.87	551,275.79
ESSENTIAL UTILITIES INC	5,291	48.23	255,184.93
EVERGY INC	4,852	62.39	302,716.28
EVERSOURCE ENERGY	8,013	84.05	673,492.65
EXELON CORP	22,866	41.42	947,109.72
FIRSTENERGY CORP	12,600	41.48	522,648.00
NEXTERA ENERGY INC	45,029	84.51	3,805,400.79
NISOURCE INC	8,577	27.39	234,924.03
NRG ENERGY INC	5,306	32.28	171,277.68
P G & E CORP	34,575	15.54	537,295.50
PPL CORP	17,089	28.95	494,726.55
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	11,535	59.77	689,446.95
SEMPRA ENERGY	7,234	161.15	1,165,759.10
SOUTHERN CO/THE	25,003	68.36	1,709,205.08
UGI CORP	4,854	38.36	186,199.44
VISTRA CORP	8,462	23.86	201,903.32
WEC ENERGY GROUP INC	7,016	95.73	671,641.68
XCEL ENERGY INC	12,616	69.84	881,101.44
ADVANCED MICRO DEVICES	36,961	68.59	2,535,154.99
ANALOG DEVICES INC	11,781	168.68	1,987,219.08
APPLIED MATERIALS INC	19,703	107.34	2,114,920.02
BROADCOM INC	9,242	544.72	5,034,302.24
ENPHASE ENERGY INC	3,107	319.55	992,841.85

	ENTEGRIS INC	3,427	69.83	239,307.41
	FIRST SOLAR INC	2,207	150.96	333,168.72
	INTEL CORP	94,009	28.24	2,654,814.16
	KLA CORP	3,258	393.41	1,281,729.78
	LAM RESEARCH CORP	3,139	450.20	1,413,177.80
	MARVELL TECHNOLOGY INC	19,562	41.50	811,823.00
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	12,672	75.88	961,551.36
	MICRON TECHNOLOGY INC	25,279	54.87	1,387,058.73
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	934	386.10	360,617.40
	NVIDIA CORP	56,972	170.01	9,685,809.72
	NXP SEMICONDUCTORS NV	6,022	169.72	1,022,053.84
	ON SEMICONDUCTOR CORP	9,946	70.53	701,491.38
	QORVO INC	2,183	97.60	213,060.80
	QUALCOMM INC	25,709	119.05	3,060,656.45
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	3,548	94.52	335,356.96
	SOLAREGE TECHNOLOGIES INC	1,280	314.80	402,944.00
	TERADYNE INC	3,421	92.41	316,134.61
	TEXAS INSTRUMENTS INC	20,915	174.26	3,644,647.90
	WOLFSPEED INC	2,944	82.67	243,380.48
	米ドル 小計	7,764,445		776,641,661.27 (106,213,513,595)
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	14,325	17.80	254,985.00
	CAMECO CORP	9,839	29.55	290,742.45
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	25,247	74.65	1,884,688.55
	CENOVUS ENERGY INC	32,136	24.19	777,369.84
	ENBRIDGE INC	46,509	53.39	2,483,115.51
	IMPERIAL OIL LTD	5,025	68.22	342,805.50
	KEYERA CORP	5,549	29.70	164,805.30
	PARKLAND CORP	2,817	29.92	84,284.64
	PEMBINA PIPELINE CORP	12,921	45.83	592,169.43
	SUNCOR ENERGY INC	31,491	40.38	1,271,606.58
	TC ENERGY CORP	23,312	57.74	1,346,034.88
	TOURMALINE OIL CORP	7,440	74.16	551,750.40
	AGNICO EAGLE MINES LTD	10,636	69.51	739,308.36
	BARRICK GOLD CORP	41,118	22.66	931,733.88

CCL INDUSTRIES INC - CL B	3,584	60.59	217,154.56
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	12,743	32.68	416,441.24
FRANCO-NEVADA CORP	4,449	192.23	855,231.27
IVANHOE MINES LTD-CL A	14,737	12.17	179,349.29
KINROSS GOLD CORP	27,690	5.74	158,940.60
LUNDIN MINING CORP	12,629	8.30	104,820.70
NUTRIEN LTD	12,151	104.80	1,273,424.80
PAN AMERICAN SILVER CORP	4,015	22.42	90,016.30
TECK RESOURCES LTD-CLS B	10,239	50.06	512,564.34
WEST FRASER TIMBER CO LTD	1,240	103.87	128,798.80
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	10,165	53.22	540,981.30
CAE INC	6,696	27.77	185,947.92
TOROMONT INDUSTRIES LTD	1,967	99.89	196,483.63
WSP GLOBAL INC	2,813	161.73	454,946.49
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	4,269	38.46	164,185.74
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	2,324	77.19	179,389.56
THOMSON REUTERS CORP	3,974	156.92	623,600.08
AIR CANADA	3,291	18.90	62,199.90
CANADIAN NATL RAILWAY CO	13,579	170.04	2,308,973.16
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	21,491	107.77	2,316,085.07
TFI INTERNATIONAL INC	2,080	141.74	294,819.20
MAGNA INTERNATIONAL INC	6,389	79.45	507,606.05
BRP INC/CA- SUB VOTING	766	104.71	80,207.86
GILDAN ACTIVEWEAR INC	3,962	39.46	156,340.52
RESTAURANT BRANDS INTERN	6,826	90.82	619,937.32
QUEBECOR INC -CL B	3,143	28.11	88,349.73
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	11,777	36.66	431,744.82
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	1,201	149.75	179,849.75
DOLLARAMA INC	5,999	82.43	494,497.57
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	18,329	61.78	1,132,365.62
EMPIRE CO LTD 'A'	3,510	36.97	129,764.70
LOBLAW COMPANIES LTD	3,547	125.55	445,325.85
METRO INC	5,501	78.38	431,168.38
WESTON (GEORGE) LTD	1,755	178.57	313,390.35
SAPUTO INC	5,255	34.11	179,248.05

BANK OF MONTREAL	15,435	126.16	1,947,279.60
BANK OF NOVA SCOTIA	27,504	68.66	1,888,424.64
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	20,846	58.52	1,219,907.92
NATIONAL BANK OF CANADA	7,797	94.96	740,403.12
ROYAL BANK OF CANADA	31,908	130.91	4,177,076.28
TORONTO-DOMINION BANK	41,712	90.55	3,777,021.60
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	32,425	58.88	1,909,184.00
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	10,091	19.30	194,756.30
IGM FINANCIAL INC	1,623	38.65	62,728.95
ONEX CORPORATION	1,383	64.25	88,857.75
TMX GROUP LTD	1,422	138.04	196,292.88
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	536	791.49	424,238.64
GREAT-WEST LIFECO INC	5,509	30.45	167,749.05
IA FINANCIAL CORP INC	2,549	76.72	195,559.28
INTACT FINANCIAL CORP	4,086	203.97	833,421.42
MANULIFE FINANCIAL CORP	44,202	24.19	1,069,246.38
POWER CORP OF CANADA	12,454	33.00	410,982.00
SUN LIFE FINANCIAL INC	13,631	63.25	862,160.75
FIRSTSERVICE CORP	953	168.71	160,780.63
CGI INC	4,885	116.16	567,441.60
CONSTELLATION SOFTWARE INC	469	2,088.99	979,736.31
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	2,169	93.38	202,541.22
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	829	36.82	30,523.78
OPEN TEXT CORP	6,497	38.40	249,484.80
SHOPIFY INC - CLASS A	27,469	52.40	1,439,375.60
BCE INC	1,259	63.34	79,745.06
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	8,465	60.83	514,925.95
TELUS CORP	9,885	28.10	277,768.50
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	14,143	9.78	138,318.54
ALTAGAS LTD	5,431	24.50	133,059.50
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	2,056	42.15	86,660.40
CANADIAN UTILITIES LTD-A	2,375	37.32	88,635.00
EMERA INC	6,490	53.36	346,306.40
FORTIS INC	11,220	54.98	616,875.60
HYDRO ONE LTD	7,776	37.28	289,889.28

	NORTHLAND POWER INC	5,997	37.86	227,046.42
	カナダドル 小計	915,932		54,763,955.99 (5,481,871,994)
ユーロ	ENI SPA	57,490	13.52	777,609.74
	GALP ENERGIA SGPS SA	13,641	11.67	159,190.47
	NESTE OYJ	9,889	45.74	452,322.86
	OMV AG	3,282	47.23	155,008.86
	REPSOL SA	30,744	14.15	435,027.60
	TENARIS SA	10,411	15.38	160,173.23
	TOTALENERGIES SE	57,050	56.29	3,211,344.50
	AIR LIQUIDE SA	12,036	136.84	1,647,006.24
	AKZO NOBEL	4,402	65.14	286,746.28
	ARCELORMITTAL	11,999	25.95	311,434.04
	ARKEMA	1,423	85.84	122,150.32
	BASF SE	21,247	47.72	1,013,906.84
	COVESTRO AG	4,419	36.67	162,044.73
	CRH PLC	17,317	37.63	651,638.71
	EVONIK INDUSTRIES AG	3,922	18.12	71,086.25
	HEIDELBERGCEMENT AG	3,445	52.10	179,484.50
	KONINKLIJKE DSM NV	4,150	121.85	505,677.50
	OCI NV	1,927	37.54	72,339.58
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	5,917	35.64	210,881.88
	SOLVAY SA	1,924	94.70	182,202.80
	STORA ENSO OYJ-R SHS	13,282	14.71	195,444.63
	SYMRISE AG	2,879	105.10	302,582.90
	UMICORE	4,473	34.95	156,331.35
	UPM-KYMMENE OYJ	12,540	36.95	463,353.00
	VOESTALPINE AG	3,116	25.82	80,455.12
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	5,784	27.26	157,671.84
	AIRBUS SE	13,614	111.64	1,519,866.96
	ALSTOM	7,511	24.04	180,564.44
	BOUYGUES SA	4,570	29.44	134,540.80
	BRENTAG SE	3,573	59.94	214,165.62
	CNH INDUSTRIAL NV	23,050	15.35	353,817.50
	COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	11,526	46.80	539,416.80

DAIMLER TRUCK HOLDING AG	9,751	30.91	301,403.41
DASSAULT AVIATION SA	468	156.10	73,054.80
EIFFAGE	1,969	96.10	189,220.90
FERROVIAL SA	11,692	25.69	300,367.48
GEA GROUP AG	3,741	39.91	149,303.31
IMCD NV	1,315	147.05	193,370.75
KINGSPAN GROUP PLC	3,621	53.16	192,492.36
KNORR-BREMSE AG	1,728	51.70	89,337.60
KONE OYJ-B	7,679	48.60	373,199.40
LEGRAND SA	6,229	79.12	492,838.48
MTU AERO ENGINES AG	1,320	205.00	270,600.00
PRYSMIAN SPA	6,238	35.50	221,449.00
RATIONAL AG	80	600.50	48,040.00
RHEINMETALL AG	1,007	196.55	197,925.85
SAFRAN SA	7,905	117.18	926,307.90
SCHNEIDER ELECTRIC SE	12,481	138.38	1,727,120.78
SIEMENS AG-REG	17,593	133.44	2,347,609.92
SIEMENS ENERGY AG	10,387	16.93	175,903.84
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY, S.A .	4,128	18.02	74,407.20
THALES SA	2,408	120.00	288,960.00
VINCI SA	12,405	98.62	1,223,381.10
WARTSILA OYJ ABP	11,668	8.36	97,591.15
BUREAU VERITAS SA	7,102	24.99	177,478.98
RANDSTAD NV	2,469	56.20	138,757.80
TELEPERFORMANCE	1,407	224.70	316,152.90
WOLTERS KLUWER	6,208	104.85	650,908.80
ADP	539	133.80	72,118.20
AENA SME SA	1,629	127.10	207,045.90
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	10,938	7.71	84,408.54
DEUTSCHE POST AG-REG	23,190	38.25	887,133.45
GETLINK	10,511	15.75	165,600.80
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	7,767	84.54	656,622.18
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	1,050	80.70	84,735.00
CONTINENTAL AG	2,088	57.14	119,308.32
DR ING HC F PORSCHE AG	2,738	101.40	277,633.20

FERRARI NV	2,932	209.40	613,960.80
MERCEDES-BENZ GROUP AG	18,616	64.79	1,206,130.64
MICHELIN(CGDE)	15,288	26.65	407,425.20
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	3,290	56.64	186,345.60
RENAULT SA	4,503	34.40	154,925.71
STELLANTIS NV	51,038	13.72	700,445.51
VALEO SA	3,692	16.72	61,730.24
VOLKSWAGEN AG	591	177.70	105,020.70
VOLKSWAGEN AG-PREF	4,365	137.24	599,052.60
ADIDAS AG	4,127	118.90	490,700.30
HERMES INTERNATIONAL	737	1,528.50	1,126,504.50
KERING	1,747	523.50	914,554.50
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	6,358	720.30	4,579,667.40
MONCLER SPA	4,725	49.37	233,273.25
PUMA SE	2,198	52.08	114,471.84
SEB SA	417	79.65	33,214.05
ACCOR SA	3,306	26.04	86,088.24
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	3,851	139.45	537,021.95
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	2,283	38.71	88,374.93
SODEXO	2,000	95.78	191,560.00
BOLLORE SE	14,850	5.28	78,408.00
PUBLICIS GROUPE	5,586	61.04	340,969.44
SCOUT24 SE	1,621	51.28	83,124.88
UBISOFT ENTERTAINMENT	1,775	26.96	47,854.00
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	16,732	22.74	380,569.34
VIVENDI	16,007	9.00	144,063.00
D'IETEREN GROUP	470	181.40	85,258.00
DELIVERY HERO SE	3,729	40.00	149,160.00
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	24,659	24.48	603,652.32
JUST EAT TAKEAWAY	3,517	21.37	75,175.87
PROSUS NV	19,369	64.98	1,258,597.62
ZALANDO SE	5,091	31.25	159,093.75
CARREFOUR SA	13,184	16.52	217,865.60
HELLOFRESH SE	3,031	24.12	73,107.72
JERONIMO MARTINS	6,820	20.46	139,537.20

KESKO OYJ-B SHS	5,801	20.95	121,530.95
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N.V.	24,758	28.55	706,840.90
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	20,178	56.88	1,147,724.64
DANONE	14,905	50.21	748,380.05
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	12,123	9.95	120,696.58
HEINEKEN HOLDING NV	1,820	73.40	133,588.00
HEINEKEN NV	6,163	89.74	553,067.62
JDE PEET'S BV	1,184	27.68	32,773.12
KERRY GROUP PLC-A	3,473	85.94	298,469.62
PERNOD RICARD SA	4,613	186.35	859,632.55
REMY COINTREAU	422	160.20	67,604.40
BEIERSDORF AG	2,145	105.95	227,262.75
HENKEL AG & CO KGAA	2,048	63.20	129,433.60
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	3,792	67.62	256,415.04
L'OREAL	5,546	355.00	1,968,830.00
AMPLIFON SPA	3,038	27.97	84,972.86
BIOMERIEUX	820	96.96	79,507.20
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	869	121.65	105,713.85
DIASORIN ITALIA SPA	614	130.70	80,249.80
ESSILORLUXOTTICA	6,718	179.75	1,207,560.50
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	4,431	30.34	134,436.54
FRESENIUS SE & CO KGAA	10,090	26.67	269,100.30
KONINKLIJKE PHILIPS NV	19,924	13.54	269,890.50
SIEMENS HEALTHINEERS AG	6,726	49.98	336,165.48
ARGENX SE	1,304	369.40	481,697.60
BAYER AG-REG	22,697	52.88	1,200,217.36
EUROFINS SCIENTIFIC	2,880	66.18	190,598.40
GRIFOLS SA	5,405	10.19	55,076.95
IPSEN	693	102.60	71,101.80
MERCK KGAA	3,028	180.00	545,040.00
ORION OYJ-CLASS B	2,029	50.34	102,139.86
QIAGEN N.V.	5,387	46.99	253,135.13
RECORDATI SPA	1,969	40.84	80,413.96
SANOFI	26,208	88.73	2,325,435.84
SARTORIUS AG-VORZUG	526	350.80	184,520.80

SARTORIUS STEDIM BIOTECH	663	313.70	207,983.10
UCB SA	2,890	71.66	207,097.40
ABN AMRO BANK NV-CVA	7,957	12.59	100,178.63
AIB GROUP PLC	25,437	3.17	80,635.29
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	140,748	5.53	778,758.68
BANCO SANTANDER SA	377,195	2.78	1,050,865.27
BANK OF IRELAND GROUP PLC	25,460	8.01	204,138.28
BNP PARIBAS	25,546	52.89	1,351,127.94
CAIXABANK S.A	104,486	3.30	345,221.74
COMMERZBANK AG	25,045	7.91	198,206.13
CREDIT AGRICOLE SA	26,413	9.55	252,323.38
ERSTE GROUP BANK AG	7,178	28.82	206,869.96
FINECOBANK SPA	13,301	15.48	205,899.48
ING GROEP NV-CVA	85,903	11.35	975,342.66
INTESA SANPAOLO	383,841	2.06	793,399.34
KBC GROEP NV	5,579	56.12	313,093.48
MEDIOBANCA SPA	14,388	9.18	132,110.61
SOCIETE GENERALE SA	18,766	22.63	424,674.58
UNICREDIT SPA	44,731	12.53	560,479.43
AMUNDI SA	1,142	54.85	62,638.70
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	46,931	10.14	475,880.34
DEUTSCHE BOERSE AG	4,430	172.15	762,624.50
EURAZEO	846	60.25	50,971.50
EURONEXT NV	1,663	70.76	117,673.88
EXOR NV	2,215	73.82	163,511.30
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	2,398	76.84	184,262.32
SOFINA	272	219.40	59,676.80
WENDEL	663	89.70	59,471.10
AEGON NV	41,151	4.69	192,998.19
AGEAS	3,491	42.23	147,424.93
ALLIANZ SE-REG	9,404	204.70	1,924,998.80
ASSICURAZIONI GENERALI	24,617	17.31	426,243.35
AXA SA	43,126	27.35	1,179,496.10
HANNOVER RUECK SE	1,434	187.45	268,803.30
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	3,247	308.40	1,001,374.80

NN GROUP NV	6,780	41.13	278,861.40
POSTE ITALIANE SPA	12,729	9.37	119,347.10
SAMPO OYJ-A SHS	10,633	49.44	525,695.52
AROUNDTOWN SA	15,379	2.38	36,725.05
LEG IMMOBILIEN SE	1,545	63.12	97,520.40
VONOVIA SE	17,142	23.37	400,608.54
ADYEN NV	511	1,411.00	721,021.00
AMADEUS IT GROUP SA	10,618	51.90	551,074.20
BECHTLE AG	1,242	36.19	44,947.98
CAPGEMINI SA	3,815	171.95	655,989.25
DASSAULT SYSTEMES SE	15,591	34.78	542,332.93
EDENRED	5,637	52.50	295,942.50
NEMETSCHKE SE	886	47.57	42,147.02
NEXI SPA	14,056	7.74	108,821.55
SAP SE	24,025	102.34	2,458,718.50
WORLDLINE SA	5,197	41.13	213,752.61
NOKIA OYJ	126,022	4.68	590,854.14
CELLNEX TELECOM SA	12,433	32.79	407,678.07
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	75,062	19.32	1,450,498.08
ELISA OYJ	3,078	50.92	156,731.76
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	5,911	9.48	56,036.28
KONINKLIJKE KPN NV	72,379	2.99	216,557.96
ORANGE	47,229	9.29	439,182.47
TELECOM ITALIA SPA	148,026	0.20	30,123.29
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	22,275	2.27	50,564.25
TELEFONICA SA	124,289	3.47	431,779.98
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	1,747	19.76	34,529.45
ACCIONA SA	470	178.30	83,801.00
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVA	1,625	36.46	59,247.50
E.ON SE	52,782	9.18	484,644.32
EDF	13,021	12.00	156,252.00
EDP RENOVAVEIS SA	5,568	21.53	119,879.04
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	61,699	4.57	282,458.02
ELIA GROUP SA/NV	575	138.90	79,867.50
ENAGAS SA	4,788	17.04	81,611.46

	ENDESA SA	6,805	17.83	121,367.17
	ENEL SPA	187,418	5.22	978,696.79
	ENGIE	42,512	14.38	611,492.60
	FORTUM OYJ	10,734	15.51	166,484.34
	IBERDROLA SA	139,576	10.99	1,534,638.12
	NATURGY ENERGY GROUP SA	3,070	26.56	81,539.20
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	10,476	17.10	179,139.60
	RWE AG	15,001	42.32	634,842.32
	SNAM SPA	44,814	4.87	218,423.43
	TERNA SPA	32,839	7.36	241,760.71
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	15,053	25.23	379,787.19
	VERBUND AG	1,686	83.80	141,286.80
	ASM INTERNATIONAL NV	1,005	273.25	274,616.25
	ASML HOLDING NV	9,325	577.30	5,383,322.50
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	30,147	31.28	943,148.89
	STMICROELECTRONICS NV	15,799	36.89	582,904.10
	ユーロ 小計	4,116,416		100,799,113.86 (14,490,880,608)
英bond	BP PLC	431,862	4.61	1,994,986.50
	SHELL PLC-NEW	166,465	22.86	3,805,389.90
	ANGLO AMERICAN PLC	29,328	31.90	935,563.20
	ANTOFAGASTA PLC	7,429	14.57	108,240.53
	CRODA INTERNATIONAL PLC	2,969	67.96	201,773.24
	GLENCORE PLC	225,012	5.42	1,220,690.10
	JOHNSON MATTHEY PLC	4,353	20.72	90,194.16
	MONDI PLC	11,896	14.87	176,953.00
	RIO TINTO PLC	25,875	58.35	1,509,806.25
	ASHTREAD GROUP PLC	10,256	49.02	502,749.12
	BAE SYSTEMS PLC	72,706	8.25	600,260.73
	BUNZL PLC	7,683	30.23	232,257.09
	DCC PLC	1,785	42.96	76,683.60
	MELROSE INDUSTRIES PLC	89,877	1.27	114,458.35
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	205,443	0.94	193,219.14
	SMITHS GROUP PLC	8,753	16.14	141,273.42
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	1,807	109.95	198,679.65

EXPERIAN PLC	20,547	28.95	594,835.65
INTERTEK GROUP PLC	3,717	40.80	151,653.60
RELX PLC	44,361	23.29	1,033,167.69
RENTOKIL INITIAL PLC	59,316	5.35	317,340.60
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	20,828	4.07	84,957.41
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	2,062	38.10	78,562.20
BURBERRY GROUP PLC	9,077	21.37	193,975.49
PERSIMMON PLC	6,187	12.82	79,317.34
TAYLOR WIMPEY PLC	77,119	1.04	80,435.11
COMPASS GROUP PLC	40,956	19.19	786,150.42
ENTAIN PLC	14,526	13.99	203,291.37
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	4,214	49.86	210,110.04
WHITBREAD PLC	4,984	26.37	131,428.08
AUTO TRADER GROUP PLC	22,112	5.62	124,313.66
INFORMA PLC	36,951	6.26	231,534.96
PEARSON PLC	14,318	9.36	134,102.38
WPP PLC	26,173	8.40	219,853.20
JD SPORTS FASHION PLC	46,411	1.22	57,039.11
KINGFISHER PLC	48,904	2.41	118,152.06
NEXT PLC	3,213	58.46	187,831.98
OCADO GROUP PLC	11,932	6.86	81,877.38
SAINSBURY (J) PLC	39,265	2.26	88,895.96
TESCO PLC	176,051	2.27	401,220.22
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	8,443	16.39	138,380.77
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	49,184	33.16	1,630,941.44
COCA-COLA HBC AG-DI	3,818	19.90	75,978.20
DIAGEO PLC	52,345	37.43	1,959,273.35
IMPERIAL BRANDS PLC	21,117	20.77	438,600.09
HALEON PLC	113,045	3.14	355,639.57
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	16,485	58.40	962,724.00
UNILEVER PLC	58,388	41.25	2,408,796.94
NMC HEALTH PLC	438	0.00	0.00
SMITH & NEPHEW PLC	18,768	10.98	206,072.64
ASTRAZENECA PLC	35,525	113.54	4,033,508.50
GSK PLC	93,688	14.57	1,365,783.66

	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	2,679	14.81	39,675.99
	BARCLAYS PLC	371,820	1.59	592,978.53
	HSBC HOLDINGS PLC	458,083	4.96	2,273,007.84
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,533,797	0.46	712,295.32
	NATWEST GROUP PLC	124,130	2.63	327,330.81
	STANDARD CHARTERED PLC	54,932	5.99	329,042.68
	3I GROUP PLC	22,306	13.38	298,454.28
	ABRDN PLC	51,021	1.85	94,490.89
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	5,595	8.64	48,385.56
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	7,342	74.06	543,748.52
	M&G PLC	53,635	1.83	98,661.58
	SCHRODERS PLC	11,347	4.52	51,288.44
	ST JAMES'S PLACE PLC	12,910	11.38	146,980.35
	ADMIRAL GROUP PLC	3,709	20.15	74,736.35
	AVIVA PLC	60,105	4.48	269,270.40
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	140,152	2.54	356,967.14
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	16,924	6.03	102,187.11
	PRUDENTIAL PLC	63,864	10.90	696,436.92
	AVEVA GROUP PLC	2,041	32.00	65,312.00
	SAGE GROUP PLC/THE	23,420	7.78	182,394.96
	HALMA PLC	8,955	21.33	191,010.15
	BT GROUP PLC	167,081	1.13	189,720.47
	VODAFONE GROUP PLC	595,452	0.86	516,554.61
	NATIONAL GRID PLC	84,651	10.17	860,900.67
	SEVERN TRENT PLC	5,734	27.40	157,111.60
	SSE PLC	24,979	16.96	423,643.84
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	15,622	10.34	161,531.48
	英ポンド 小計	6,430,253		41,073,041.54 (6,867,412,545)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	4,450	14.96	66,572.00
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	128	655.50	83,904.00
	GIVAUDAN-REG	215	3,051.00	655,965.00
	HOLCIM LTD	12,903	48.63	627,472.89
	SIG GROUP AG	7,130	21.26	151,583.80
	SIKA AG-REG	3,387	238.80	808,815.60

ABB LTD-REG	36,239	29.18	1,057,454.02
GEBERIT AG-REG	779	454.20	353,821.80
SCHINDLER HOLDING AG-REG	370	170.80	63,196.00
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	879	179.95	158,176.05
VAT GROUP AG	557	275.00	153,175.00
ADECCO SA-REG	3,318	31.11	103,222.98
SGS SA-REG	140	2,175.00	304,500.00
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	1,260	218.30	275,058.00
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	12,111	123.30	1,493,286.30
SWATCH GROUP AG/THE-BR	667	261.60	174,487.20
SWATCH GROUP AG/THE-REG	959	47.78	45,821.02
BARRY CALLEBAUT AG-REG	70	1,837.00	128,590.00
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	29	9,740.00	282,460.00
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	2	96,700.00	193,400.00
NESTLE SA-REG	63,016	109.24	6,883,867.84
ALCON INC	11,636	64.58	751,452.88
SONOVA HOLDING AG-REG	1,216	244.40	297,190.40
STRAUMANN HOLDING AG-REG	2,527	109.00	275,443.00
BACHEM HOLDING AG-REG B	580	85.65	49,677.00
LONZA GROUP AG-REG	1,727	457.30	789,757.10
NOVARTIS AG-REG	49,627	85.48	4,242,115.96
ROCHE HOLDING AG-BR	608	375.20	228,121.60
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	16,108	304.60	4,906,496.80
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	737	89.75	66,145.75
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	69,392	3.14	217,960.27
JULIUS BAER GROUP LTD	4,582	54.32	248,894.24
PARTNERS GROUP HOLDING AG	534	874.20	466,822.80
UBS GROUP AG-REG	77,494	17.12	1,327,084.75
BALOISE HOLDING AG - REG	1,130	143.50	162,155.00
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	682	495.00	337,590.00
SWISS RE AG	7,040	87.04	612,761.60
ZURICH INSURANCE GROUP AG	3,468	452.60	1,569,616.80
SWISS PRIME SITE-REG	1,443	79.70	115,007.10
TEMENOS GROUP AG-REG	1,169	53.34	62,354.46
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	4,113	56.66	233,042.58

	SWISSCOM AG-REG	600	512.60	307,560.00	
	BKW AG	522	127.50	66,555.00	
	スイスフラン 小計	405,544		31,398,634.59 (4,585,770,581)	
スウェーデン ローナ	BOLIDEN AB	6,926	399.20	2,764,859.20	
	HOLMEN AB-B SHARES	1,774	442.00	784,108.00	
	SVENSKA CELLULOZA AB SCA-B	14,303	144.85	2,071,789.55	
	ALFA LAVAL AB	6,202	308.10	1,910,836.20	
	ASSA ABLOY AB-B	23,916	236.70	5,660,917.20	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	63,273	131.00	8,288,763.00	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	36,070	118.66	4,280,066.20	
	EPIROC AB-A	15,455	193.95	2,997,497.25	
	EPIROC AB-B	7,209	170.20	1,226,971.80	
	HUSQVARNA AB-B SHS	8,099	81.10	656,828.90	
	INDUTRADE AB	5,147	220.50	1,134,913.50	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	2,737	208.20	569,843.40	
	LIFCO AB-B SHS	4,582	186.20	853,168.40	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	37,034	104.70	3,877,459.80	
	SANDVIK AB	25,633	189.35	4,853,608.55	
	SKANSKA AB-B SHS	8,250	168.60	1,390,950.00	
	SKF AB-B SHARES	9,296	172.95	1,607,743.20	
	VOLVO AB-A SHS	3,298	204.40	674,111.20	
	VOLVO AB-B SHS	35,764	194.50	6,956,098.00	
	SECURITAS AB-B SHS	12,044	84.86	1,022,053.84	
	VOLVO CAR AB-B	10,746	50.41	541,705.86	
	ELECTROLUX AB-B	3,653	148.38	542,032.14	
	EVOLUTION AB	4,204	1,073.00	4,510,892.00	
	EMBRACER GROUP AB	12,140	50.05	607,607.00	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	16,091	117.60	1,892,301.60		
ESSITY AKTIEBOLAG-B	14,757	267.50	3,947,497.50		
GETINGE AB-B SHS	4,823	241.50	1,164,754.50		
SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	3,105	212.50	659,812.50		
NORDEA BANK ABP	78,807	108.52	8,552,135.64		
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	38,702	118.75	4,595,862.50		
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	33,754	102.65	3,464,848.10		

	SWEDBANK AB - A SHARES	20,969	169.60	3,556,342.40	
	EQT AB	6,572	243.40	1,599,624.80	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	2,067	259.40	536,179.80	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	3,625	258.70	937,787.50	
	INVESTOR AB-A SHS	10,067	200.70	2,020,446.90	
	INVESTOR AB-B SHS	43,029	193.90	8,343,323.10	
	KINNEVIK AB - B	5,852	151.70	887,748.40	
	LUNDBERGS AB-B SHS	1,611	453.50	730,588.50	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	10,369	50.18	520,316.42	
	SAGAX AB-B	3,246	243.40	790,076.40	
	ERICSSON LM-B SHS	70,119	67.69	4,746,355.11	
	HEXAGON AB-B SHS	46,331	119.55	5,538,871.05	
	TELE2 AB-B SHS	13,442	94.08	1,264,623.36	
	TELIA CO AB	59,405	28.29	1,680,567.45	
	スウェーデンクローナ 小計	844,498		117,214,887.72 (1,548,408,666)	
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	7,243	296.90	2,150,446.70	
	EQUINOR ASA	22,244	358.20	7,967,800.80	
	NORSK HYDRO ASA	30,507	74.66	2,277,652.62	
	YARA INTERNATIONAL ASA	3,696	432.50	1,598,520.00	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	1,670	411.80	687,706.00	
	ADEVINTA ASA	3,943	69.40	273,644.20	
	MOWI ASA	10,271	155.70	1,599,194.70	
	ORKLA ASA	18,647	70.16	1,308,273.52	
	SALMAR ASA	1,148	360.60	413,968.80	
	DNB BANK ASA	22,114	184.95	4,089,984.30	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	4,317	192.60	831,454.20	
	TELENOR ASA	17,808	93.16	1,658,993.28	
	ノルウェークローネ 小計	143,608		24,857,639.12 (339,803,926)	
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	2,533	444.20	1,125,158.60	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	4,472	431.00	1,927,432.00	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	129	1,557.50	200,917.50	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	23,577	203.30	4,793,204.10	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	57	14,660.00	835,620.00	

	AP MOELLER-MAERSK A/S-B	122	14,920.00	1,820,240.00	
	DSV A/S	4,405	1,087.00	4,788,235.00	
	PANDORA A/S	2,289	533.40	1,220,952.60	
	CARLSBERG AS-B	2,199	913.40	2,008,566.60	
	COLOPLAST-B	2,586	853.80	2,207,926.80	
	DEMANT A/S	1,941	192.75	374,127.75	
	GENMAB A/S	1,532	3,212.00	4,920,784.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	37,965	921.70	34,992,340.50	
	DANSKE BANK A/S	15,836	129.00	2,042,844.00	
	TRYG A/S	8,276	163.35	1,351,884.60	
	ORSTED A/S	4,095	639.20	2,617,524.00	
	デンマーククローネ 小計	112,014		67,227,758.05 (1,299,512,563)	
オーストラリア ドル	AMPOL LTD	4,435	27.09	120,144.15	
	SANTOS LTD	68,005	7.06	480,115.30	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	3,985	27.76	110,623.60	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	43,479	34.18	1,486,112.22	
	BHP GROUP LTD	115,964	47.48	5,505,970.72	
	BLUESCOPE STEEL LTD	10,228	18.22	186,354.16	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	38,941	21.39	832,947.99	
	IGO LTD	16,726	15.04	251,559.04	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	10,937	29.26	320,016.62	
	MINERAL RESOURCES LTD	3,996	90.50	361,638.00	
	NEWCREST MINING LTD	20,981	21.38	448,573.78	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	27,345	11.14	304,623.30	
	ORICA LTD	9,000	15.44	138,960.00	
	PILBARA MINERALS LTD	62,262	4.47	278,311.14	
	RIO TINTO LTD	8,529	117.16	999,257.64	
	SOUTH32 LTD	99,280	4.19	415,983.20	
	REECE LTD	5,105	14.60	74,533.00	
	BRAMBLES LTD	32,920	11.94	393,064.80	
	AURIZON HOLDINGS LTD	45,292	3.80	172,109.60	
	QANTAS AIRWAYS LTD	17,415	6.21	108,147.15	
TRANSURBAN GROUP	71,475	13.88	992,073.00		
ARISTOCRAT LEISURE LTD	12,771	34.01	434,341.71		

	IDP EDUCATION LTD	4,049	27.68	112,076.32	
	LOTTERY CORP LTD/THE	47,158	4.80	226,358.40	
	REA GROUP LTD	942	121.22	114,189.24	
	SEEK LTD	7,251	21.80	158,071.80	
	WESFARMERS LTD	26,180	47.92	1,254,545.60	
	COLES GROUP LTD	31,219	16.83	525,415.77	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	31,223	6.98	217,936.54	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	28,085	34.45	967,528.25	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	15,054	13.72	206,540.88	
	COCHLEAR LTD	1,631	208.68	340,357.08	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	4,302	65.88	283,415.76	
	SONIC HEALTHCARE LTD	10,672	30.20	322,294.40	
	CSL LTD	11,036	298.46	3,293,804.56	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	68,419	23.64	1,617,425.16	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	38,927	104.98	4,086,556.46	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	72,464	30.19	2,187,688.16	
	WESTPAC BANKING CORP	80,114	23.44	1,877,872.16	
	ASX LTD	4,690	68.01	318,966.90	
	MACQUARIE GROUP LTD	8,446	168.04	1,419,265.84	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	57,437	4.79	275,123.23	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	64,169	3.02	193,790.38	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	32,943	12.95	426,611.85	
	SUNCORP GROUP LTD	30,987	11.79	365,336.73	
	LENDLEASE GROUP	13,105	7.33	96,059.65	
	COMPUTERSHARE LTD	12,831	26.52	340,278.12	
	WISETECH GLOBAL LTD	2,666	53.50	142,631.00	
	XERO LTD	2,838	70.01	198,688.38	
	TELSTRA GROUP LTD	89,416	4.00	357,664.00	
	APA GROUP	29,125	10.93	318,336.25	
	ORIGIN ENERGY LTD	41,376	7.80	322,732.80	
	オーストラリアドル 小計	1,597,826		36,983,021.79 (3,416,491,552)	
ニュージーランド ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	22,815	8.07	184,117.05	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	15,859	22.58	358,096.22	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	46,094	5.27	242,915.38	

	MERCURY NZ LTD	15,009	5.52	82,849.68	
	MERIDIAN ENERGY LTD	22,959	5.05	115,942.95	
	ニュージーランドドル 小計	122,736		983,921.28	(85,916,006)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	59,000	45.45	2,681,550.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	33,000	94.55	3,120,150.00	
	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	30,000	15.40	462,000.00	
	MTR CORP	35,000	38.70	1,354,500.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	24,000	17.46	419,040.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	54,000	52.90	2,856,600.00	
	SANDS CHINA LTD	54,600	26.30	1,435,980.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	31,300	24.50	766,850.00	
	WH GROUP LTD	210,000	4.63	972,300.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	81,500	24.90	2,029,350.00	
	HANG SENG BANK LTD	18,600	125.50	2,334,300.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	28,100	345.80	9,716,980.00	
	AIA GROUP LTD	275,000	85.50	23,512,500.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	47,000	47.35	2,225,450.00	
	ESR GROUP LTD	39,200	17.36	680,512.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	45,000	15.00	675,000.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	32,916	26.50	872,274.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	38,000	22.25	845,500.00	
	SINO LAND CO	58,000	10.28	596,240.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	35,200	102.50	3,608,000.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	9,700	64.20	622,740.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	21,400	19.44	416,016.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	40,000	42.90	1,716,000.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	69,000	9.48	654,120.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD (CKI)	11,900	40.55	482,545.00	
	CLP HOLDINGS LTD	38,500	56.35	2,169,475.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	65,000	5.47	355,550.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	266,717	7.19	1,917,695.23	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	28,500	41.60	1,185,600.00	
	香港ドル 小計	1,780,133		70,684,817.23	(1,241,225,390)

シンガポールドル	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	2,400	28.17	67,608.00	
	KEPPEL CORP LTD	34,600	7.48	258,808.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	33,900	3.33	112,887.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	27,000	5.49	148,230.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	134,800	0.89	119,972.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	45,400	4.05	183,870.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	41,400	33.39	1,382,346.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	77,400	12.30	952,020.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	27,000	31.05	838,350.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	18,300	9.21	168,543.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	62,600	3.63	227,238.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	7,800	8.20	63,960.00	
	UOL GROUP LTD	9,400	6.70	62,980.00	
	VENTURE CORP LTD	6,500	17.36	112,840.00	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	193,000	2.64	509,520.00		
シンガポールドル 小計		721,500		5,209,172.00	(525,813,821)
イスラエルシュケル	ICL GROUP LTD	17,069	28.15	480,492.35	
	ELBIT SYSTEMS LTD	724	589.00	426,436.00	
	BANK HAPOLIM BM	26,257	32.21	845,737.97	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	33,124	31.15	1,031,812.60	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	26,569	20.05	532,708.45	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	3,321	123.30	409,479.30	
	AZRIELI GROUP	723	242.50	175,327.50	
	NICE SYSTEMS LTD	1,508	675.80	1,019,106.40	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	53,789	5.92	318,430.88	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	2,636	157.00	413,852.00	
イスラエルシュケル 小計		165,720		5,653,383.45	(225,521,945)
合 計		25,120,625		146,322,143,192	(146,322,143,192)

(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	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	3,631	541,963.06	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	6,649	218,486.14	
		AMERICAN TOWER CORP	10,709	2,290,012.56	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	9,689	209,960.63	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	3,274	555,204.92	
		BOSTON PROPERTIES INC	3,163	210,687.43	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	2,283	264,828.00	
		CROWN CASTLE INC	9,997	1,397,780.54	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	6,692	715,776.32	
		EQUINIX INC	2,102	1,420,531.60	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	3,754	243,296.74	
		EQUITY RESIDENTIAL	8,377	525,489.21	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,474	316,600.46	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	3,146	492,600.68	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	5,439	283,371.90	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	9,221	181,561.49	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	11,461	290,536.35	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	16,124	285,233.56	
		INVITATION HOMES INC	14,364	453,758.76	
		IRON MOUNTAIN INC	6,841	372,218.81	
		KIMCO REALTY CORP	13,105	284,509.55	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	13,440	158,592.00	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	2,717	439,175.88	
		PROLOGIS INC	21,226	2,469,008.32	
		PUBLIC STORAGE	3,658	1,088,620.80	
		REALTY INCOME CORP	14,331	923,632.95	
		REGENCY CENTERS CORP	3,278	215,462.94	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	2,511	723,645.09	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	7,597	886,949.75	
		SUN COMMUNITIES INC	2,902	412,983.62	
UDR INC	7,646	304,998.94			
VENTAS INC	9,406	427,314.58			
VICI PROPERTIES INC	21,420	726,780.60			

	WELLTOWER INC	10,789	719,302.63
	WEYERHAEUSER CO	17,340	545,863.20
	WP CAREY INC	4,540	357,979.00
	米ドル 小計	294,296	21,954,719.01 (3,002,527,371)
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	1,821	78,357.63
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	2,998	62,658.20
	カナダドル 小計	4,819	141,015.83 (14,115,684)
ユーロ	COVIVIO	968	54,982.40
	GECINA SA	1,087	104,895.50
	KLEPIERRE	5,091	113,987.49
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	2,561	134,426.89
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	4,126	110,494.28
	ユーロ 小計	13,833	518,786.56 (74,580,755)
英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	19,992	79,288.27
	LAND SECURITIES GROUP PLC	14,625	91,640.25
	SEGRO PLC	27,922	224,157.81
	英ポンド 小計	62,539	395,086.33 (66,058,434)
オーストラリアドル	DEXUS/AU	25,345	203,013.45
	GOODMAN GROUP	39,454	717,273.72
	GPT GROUP	46,863	203,385.42
	MIRVAC GROUP	83,568	183,849.60
	SCENTRE GROUP	121,583	350,159.04
	STOCKLAND	56,253	217,699.11
	VICINITY CENTRES	97,692	192,941.70
	オーストラリアドル 小計	470,758	2,068,322.04 (191,071,590)
香港ドル	LINK REIT	52,200	2,897,100.00
	香港ドル 小計	52,200	2,897,100.00 (50,873,076)
シンガポールドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	81,100	223,025.00
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	126,063	254,647.26
	MAPLE TREE LOGISTICS TRUST	73,000	116,800.00

	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA	44,600	75,374.00
	シンガポールドル 小計	324,763	669,846.26 (67,614,281)
	合計		3,466,841,191 (3,466,841,191)

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(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 601銘柄	97.3%		70.9%
	投資証券 36銘柄		2.7%	2.0%
カナダドル	株式 85銘柄	99.7%		3.7%
	投資証券 2銘柄		0.3%	0.0%
ユーロ	株式 223銘柄	99.5%		9.7%
	投資証券 5銘柄		0.5%	0.0%
英ポンド	株式 79銘柄	99.0%		4.6%
	投資証券 3銘柄		1.0%	0.0%
スイスフラン	株式 43銘柄	100.0%		3.1%
スウェーデンクローナ	株式 45銘柄	100.0%		1.0%
ノルウェークローネ	株式 12銘柄	100.0%		0.2%
デンマーククローネ	株式 16銘柄	100.0%		0.9%
オーストラリアドル	株式 52銘柄	94.7%		2.3%
	投資証券 7銘柄		5.3%	0.1%
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 29銘柄	96.1%		0.8%
	投資証券 1銘柄		3.9%	0.0%
シンガポールドル	株式 15銘柄	88.6%		0.4%
	投資証券 4銘柄		11.4%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 10銘柄	100.0%		0.2%

(注)時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

R M新興国株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）	
2022年12月12日現在	
資産の部	
流動資産	
預金	816,608,007
コール・ローン	12,462,352
株式	16,919,249,108
投資証券	21,286,501
派生商品評価勘定	103,908,881
未収入金	12,127,354
未収配当金	24,635,798
差入委託証拠金	250,479,816
流動資産合計	18,160,757,817
資産合計	18,160,757,817
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	487,326
未払解約金	513,100
未払利息	33
流動負債合計	1,000,459
負債合計	1,000,459
純資産の部	
元本等	
元本	11,379,332,176
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	6,780,425,182
元本等合計	18,159,757,358
純資産合計	18,159,757,358
負債純資産合計	18,160,757,817

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
--------------------	----

	<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	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</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12月12日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年12月11日
期首元本額	11,234,901,391円
期中追加設定元本額	5,535,885,378円
期中一部解約元本額	5,391,454,593円
期末元本額	11,379,332,176円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	667,818,570円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	1,761,138,094円
りそなラップ型ファンド(成長型)	2,080,062,602円
DCりそな グローバルバランス	16,248,065円
つみたてバランスファンド	858,486,707円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	444,392,533円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	291,432,609円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	197,900,021円

りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	90,504,783円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	58,720,650円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	32,964,689円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	64,376,995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	97,709,556円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定型)	666,348円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定成長型)	8,398,072円
ラップ型ファンド・プラスESG(成長型)	25,081,822円
FWりそな先進国+新興国株式アクティブファンド	150,892,372円
FWりそな新興国株式インデックスファンド	1,302,660,744円
Smart-i 新興国株式インデックス	2,120,805,591円
Smart-i 8資産バランス 安定型	93,718,474円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	293,031,629円
Smart-i 8資産バランス 成長型	359,083,585円
Smart-i Select 全世界株式インデックス	21,859,243円
Smart-i Select 全世界株式インデックス(除く日本)	18,238,768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)	1,333,799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)	12,605,841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)	83,406,963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)	80,556,576円
2. 計算日における受益権の総数	11,379,332,176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	1.5959円
(10,000口当たり純資産額)	(15,959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12月12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12月12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12月12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12月12日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式		2,668,515,931

投資証券	680,621
合計	2,667,835,310

(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12月12日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	1,116,888,148	-	1,220,320,420	103,432,272
	合計	1,116,888,148	-	1,220,320,420	103,432,272

(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12月12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	9,581,299	-	9,570,582	10,717
	米ドル	9,581,299	-	9,570,582	10,717
	合計	9,581,299	-	9,570,582	10,717

(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	1.44	30,097.60	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	1,600	0.00	0.00	
	SURGUTNEFTEGAS-SP ADR	13,769	0.00	0.00	
	TATNEFT PAO-SPONSORED ADR	4,090	0.00	0.00	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	3,767	8.10	30,512.70	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	11,117	0.00	0.00	
	NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR	2,773	0.00	0.00	
	PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	2,330	0.00	0.00	
	PHOSAGRO PJSC(BLOCKED)-GDR	15	0.00	0.00	
	POLYUS PJSC-REG S-GDR	1,288	0.00	0.00	
	SEVERSTAL - GDR REG S	3,862	0.00	0.00	
	SOUTHERN COPPER CORP	1,777	60.67	107,810.59	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	7,987	25.72	205,425.64	
	LI AUTO INC - ADR	10,344	21.12	218,465.28	
	NIO INC - ADR	26,994	12.63	340,934.22	
	XPENG INC - ADR	8,032	10.94	87,870.08	
	H WORLD GROUP LTD	3,663	42.98	157,435.74	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	8,474	6.61	56,013.14	
	TRIP.COM GROUP LTD	10,563	32.41	342,346.83	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	8,101	56.53	457,949.53	
AUTOHOME INC-ADR	1,487	32.95	48,996.65		
IQIYI INC-ADR	6,995	3.67	25,671.65		

JOYY INC	1,098	34.88	38,298.24	
KANZHUN LTD	3,270	20.07	65,628.90	
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	14,100	8.21	115,761.00	
VK CO LTD	2,211	0.00	0.00	
WEIBO CORP-SPON ADR	1,164	18.04	20,998.56	
YANDEX NV-A	5,354	0.00	0.00	
OZON HOLDINGS PLC - ADR	920	0.00	0.00	
PINDUODUO INC-ADR	9,736	89.71	873,416.56	
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	8,077	13.03	105,243.31	
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	1	0.00	0.00	
X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	2,296	0.00	0.00	
BEIGENE LTD-ADR	892	197.00	175,724.00	
LEGEND BIOTECH CORP-ADR	929	53.55	49,747.95	
ZAI LAB LTD-ADR	1,716	35.40	60,746.40	
COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	63,788	1.34	85,475.92	
CREDICORP LTD	1,322	147.78	195,365.16	
TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	2,188	0.00	0.00	
360 DIGITECH INC	1,992	17.95	35,756.40	
LUFAX HOLDING LTD-ADR	13,127	2.30	30,192.10	
KE HOLDINGS INC	13,004	15.39	200,131.56	
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	10,080	0.80	8,084.16	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	9,490	2.96	28,156.83	
DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	1,144	49.61	56,753.84	
米ドル 小計	327,727		4,255,010.54 (581,915,241)	
メキシコペソ				
CEMEX SAB-CPO	275,200	8.33	2,292,416.00	
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	58,100	78.28	4,548,068.00	
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	2,650	281.74	746,611.00	
ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	19,800	36.72	727,056.00	
ALFA S.A.B. -A	56,600	13.21	747,686.00	
GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	7,400	84.32	623,968.00	
GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	6,600	308.08	2,033,328.00	
GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	3,830	486.12	1,861,839.60	
PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	4,405	173.33	763,518.65	
GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	44,300	19.57	866,951.00	

	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	101,500	70.87	7,193,305.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	7,700	162.65	1,252,405.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	9,510	129.92	1,235,539.20	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	37,800	154.17	5,827,626.00	
	GRUMA S.A.B. -B	4,125	249.67	1,029,888.75	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	26,700	85.99	2,295,933.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	30,200	32.97	995,694.00	
	BANCO DEL BAJIO SA	16,500	61.15	1,008,975.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	50,300	143.32	7,208,996.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	46,100	35.10	1,618,110.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	524,300	17.99	9,432,157.00	
	メキシコペソ 小計	1,333,620		54,310,071.20	(375,613,883)
ブラジルリアル	COSAN SA	23,200	16.64	386,048.00	
	PETRO RIO SA	13,500	33.65	454,275.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	72,600	28.06	2,037,156.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	92,800	24.71	2,293,088.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	14,100	12.65	178,365.00	
	BRASKEM SA-PREF A	2,900	25.08	72,732.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	12,400	14.81	183,644.00	
	GERDAU SA-PREF	21,200	31.47	667,164.00	
	KLABIN SA - UNIT	13,600	21.11	287,096.00	
	SUZANO SA	14,007	54.99	770,244.93	
	VALE SA	73,804	88.74	6,549,366.96	
	WEG SA	33,100	37.10	1,228,010.00	
	CCR SA	23,400	10.78	252,252.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	13,910	52.81	734,587.10	
	RUMO SA	24,000	17.64	423,360.00	
	AMERICANAS SA	12,000	8.37	100,440.00	
	LOJAS RENNER S.A.	18,320	20.74	379,956.80	
	MAGAZINE LUIZA SA	55,000	2.80	154,000.00	
	VIBRA ENERGIA SA	21,400	14.93	319,502.00	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	11,300	14.86	167,918.00	
	RAIA DROGASIL SA	20,200	23.54	475,508.00	
	SENDAS DISTRIBUIDORA SA	17,600	19.28	339,328.00	

	AMBEV SA	93,000	15.51	1,442,430.00	
	BRF SA	12,600	7.52	94,752.00	
	JBS SA	15,700	21.11	331,427.00	
	NATURA &CO HOLDING SA	16,400	11.53	189,092.00	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	87,092	4.73	411,945.16	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	7,200	26.41	190,152.00	
	HYPERA SA	8,000	42.46	339,680.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	29,515	12.81	378,087.15	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	100,536	14.30	1,437,664.80	
	BANCO DO BRASIL S.A.	16,100	34.98	563,178.00	
	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	8,100	27.05	219,105.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	94,400	24.33	2,296,752.00	
	ITAUSA SA	95,870	8.17	783,257.90	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	115,000	11.74	1,350,100.00	
	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	22,200	22.85	507,270.00	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	13,700	31.72	434,564.00	
	TOTVS SA	9,500	26.76	254,220.00	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	9,700	37.60	364,720.00	
	TIM SA	17,100	12.57	214,947.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	4,800	45.22	217,056.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	24,100	42.67	1,028,347.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	26,934	11.08	298,428.72	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	6,600	55.77	368,082.00	
	CPFL ENERGIA SA	4,500	32.21	144,945.00	
	ENERGISA SA-UNITS	3,900	41.81	163,059.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	4,075	38.31	156,113.25	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	18,700	26.38	493,306.00	
	ブラジルリアル 小計	1,469,663		33,126,722.77	(863,239,330)
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	7,351	6,148.00	45,193,948.00	
	EMPRESAS CMPC SA	23,076	1,449.90	33,457,892.40	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	2,827	81,500.00	230,400,500.00	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES	284,456	69.30	19,712,800.80	
	FALABELLA SA	14,299	1,580.00	22,592,420.00	
	CENCOSUD SA	25,901	1,320.10	34,191,910.10	

	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	3,292	5,156.00	16,973,552.00	
	BANCO DE CHILE	856,360	83.35	71,377,606.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	1,072	24,000.00	25,728,000.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	1,221,401	33.30	40,672,653.30	
	ENEL AMERICAS SA	383,577	114.39	43,877,373.03	
	ENEL CHILE SA	486,150	37.10	18,036,165.00	
	チリペソ 小計	3,309,762		602,214,820.63 (95,537,768)	
コロンビアペソ	BANCOLOMBIA SA	4,637	39,980.00	185,387,260.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	8,897	31,950.00	284,259,150.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	8,188	18,900.00	154,753,200.00	
	コロンビアペソ 小計	21,722		624,399,610.00 (17,750,432)	
ユーロ	MYTILINEOS S.A.	1,925	18.86	36,305.50	
	OPAP SA	3,372	13.29	44,813.88	
	JUMBO SA	2,215	15.16	33,579.40	
	ALPHA SERVICES AND HOLDINGS	50,929	1.00	51,209.10	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	51,021	1.04	53,061.84	
	NATIONAL BANK OF GREECE	10,331	3.65	37,708.15	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	3,522	14.80	52,125.60	
	PUBLIC POWER CORP	3,599	6.75	24,293.25	
	TERNA ENERGY SA	1,400	20.40	28,560.00	
	ユーロ 小計	128,314		361,656.72 (51,991,770)	
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	437.40	1,100,498.40	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	25,453	40.50	1,030,846.50	
	HEKTAS TICARET T.A.S	23,334	38.70	903,025.80	
	SASA POLYESTER SANAYI	8,934	113.90	1,017,582.60	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	15,288	53.50	817,908.00	
	KOC HOLDING AS	14,295	68.65	981,351.75	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	28,207	39.38	1,110,791.66	
	TURK HAVA YOLLARI AO	11,099	141.00	1,564,959.00	

	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	1,092	428.80	468,249.60	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	8,350	123.00	1,027,050.00	
	AKBANK T.A.S.	62,081	16.67	1,034,890.27	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	20,913	40.10	838,611.30	
	TURKIYE IS BANKASI-C	55,641	10.57	588,125.37	
	YAPI VE KREDI BANKASI	60,107	11.35	682,214.45	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	19,091	32.38	618,166.58	
	トルコリラ 小計	356,401		13,784,271.28	(101,106,251)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	1,528	652.50	997,020.00	
	MONETA MONEY BANK AS	7,045	71.60	504,422.00	
	CEZ AS	2,922	748.50	2,187,117.00	
	チェココルナ 小計	11,495		3,688,559.00	(21,834,793)
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	7,310	2,600.00	19,006,000.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	2,562	8,800.00	22,545,600.00	
	OTP BANK PLC	4,422	10,000.00	44,220,000.00	
	ハンガリーフォリント 小計	14,294		85,771,600.00	(29,491,106)
ポーランドズロ チ	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	12,040	62.20	748,888.00	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	2,722	121.55	330,859.10	
	LPP SA	26	9,600.00	249,600.00	
	CD PROJEKT SA	1,104	131.38	145,043.52	
	CYFROWY POLSAT SA	4,876	18.16	88,548.16	
	ALLEGRO.EU SA	6,496	24.25	157,528.00	
	PEPCO GROUP NV	3,432	39.88	136,868.16	
	DINO POLSKA SA	885	369.10	326,653.50	
	BANK PEKAO SA	3,378	82.64	279,157.92	
	MBANK SA	290	281.20	81,548.00	
	PKO BANK POLSKI SA	16,652	28.59	476,080.68	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	668	258.80	172,878.40	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	11,937	32.47	387,594.39	
	PGE SA	17,929	6.89	123,674.24	
	ポーランドズロチ 小計	82,435		3,704,922.07	(113,609,212)

ロシアルーブル	GAZPROM PJSC	209,472	0.00	0.00
	LUKOIL PJSC	7,345	0.00	0.00
	ROSNEFT OIL CO PJSC	20,180	0.00	0.00
	SURGUTNEFTEGAS-PREFERENCE	131,600	0.00	0.00
	ALROSA PJSC	46,260	0.00	0.00
	UNITED CO RUSAL INTERNATIONA	55,000	0.00	0.00
	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		67,162,619		0.00 (0)
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO-H	35,000	6.67	233,450.00
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	32,000	9.25	296,000.00
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	494,000	3.70	1,827,800.00
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	65,500	22.70	1,486,850.00
	PETROCHINA CO LTD-H	394,000	3.47	1,367,180.00
	YANKUANG ENERGY GROUP CO-H	28,000	24.90	697,200.00
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	66,000	3.57	235,620.00
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	23,500	30.00	705,000.00
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	43,500	7.51	326,685.00
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	76,000	7.08	538,080.00
	CHINA RESOURCES CEMENT	50,000	4.45	222,500.00
	CMOC GROUP LTD-H	66,000	3.88	256,080.00
	DONGYUE GROUP	28,000	9.36	262,080.00
	GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD-H	6,840	70.25	480,510.00
	JIANGXI COPPER CO LTD-H	24,000	11.98	287,520.00
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	33,000	6.65	219,450.00
	SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	14,500	15.32	222,140.00
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	24,000	8.69	208,560.00
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	108,000	11.26	1,216,080.00
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	44,000	3.73	164,120.00
BOC AVIATION LTD	3,500	62.10	217,350.00	

CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	42,000	2.69	112,980.00
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	32,000	17.52	560,640.00
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	18,000	9.18	165,240.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	80,000	4.52	361,600.00
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	40,000	8.60	344,000.00
CITIC LTD	108,000	7.88	851,040.00
CRRC CORP LTD - H	81,000	3.17	256,770.00
FOSUN INTERNATIONAL LTD	48,500	6.41	310,885.00
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	13,000	20.40	265,200.00
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	19,000	7.79	148,010.00
WEICHAI POWER CO LTD-H	36,000	10.84	390,240.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	12,800	7.88	100,864.00
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	10,300	38.25	393,975.00
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL LIMITED	74,000	3.49	258,260.00
AIR CHINA LTD-H	30,000	7.18	215,400.00
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	30,000	5.66	169,800.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	24,000	11.44	274,560.00
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	46,000	5.14	236,440.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	57,700	8.31	479,487.00
COSCO SHIPPING PORTS LTD	32,000	6.07	194,240.00
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	30,000	6.86	205,800.00
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	2,500	137.90	344,750.00
SHENZHEN INTL HOLDINGS	32,500	7.39	240,175.00
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	32,000	5.95	190,400.00
BYD CO LTD-H	16,000	215.00	3,440,000.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	56,000	4.66	260,960.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	11,600	34.30	397,880.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	114,000	12.54	1,429,560.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	59,000	10.76	634,840.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	56,000	5.57	311,920.00
MINTH GROUP LTD	14,000	21.05	294,700.00
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	24,000	13.76	330,240.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	23,800	100.40	2,389,520.00
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	60,000	3.90	234,000.00
HAIER SMART HOME CO LTD-H	43,400	26.85	1,165,290.00

LI NING CO LTD	45,500	63.05	2,868,775.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	15,600	86.65	1,351,740.00	
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	26,000	10.06	261,560.00	
HAICHANG OCEAN PARK HOLDINGS	65,000	1.66	107,900.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	21,000	21.90	459,900.00	
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	14,000	19.94	279,160.00	
KOOLEARN TECHNOLOGY HOLDING	8,500	45.20	384,200.00	
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	29,310	25.50	747,405.00	
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LT	23,600	17.88	421,968.00	
BAIDU INC-CLASS A	42,480	123.00	5,225,040.00	
BILIBILI INC-CLASS Z	3,497	196.50	687,160.50	
CHINA LITERATURE LTD	7,400	31.90	236,060.00	
CHINA RUYI HOLDINGS LIMITED	92,000	1.88	172,960.00	
KINGSOFT CORP LTD	17,800	25.10	446,780.00	
KUAISHOU TECHNOLOGY	34,200	70.10	2,397,420.00	
NETEASE INC	38,000	112.50	4,275,000.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	120,100	325.60	39,104,560.00	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	284,740	91.85	26,153,369.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	90,000	9.40	846,000.00	
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	10,000	16.82	168,200.00	
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-H	1,400	213.40	298,760.00	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	39,400	14.92	587,848.00	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	21,100	84.65	1,786,115.00	
JD.COM INC - CL A	41,460	236.80	9,817,728.00	
MEITUAN	84,700	188.50	15,965,950.00	
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	10,300	30.80	317,240.00	
POP MART INTERNATIONAL GROUP	10,800	22.05	238,140.00	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	38,000	6.02	228,760.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	11,000	41.00	451,000.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	2,200	119.06	261,932.00	
CHINA FEIHE LTD	66,000	7.47	493,020.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	60,000	34.80	2,088,000.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	32,000	55.00	1,760,000.00	
DALI FOODS GROUP CO LTD	45,000	3.65	164,250.00	
ONGFU SPRING CO LTD-H	33,200	43.45	1,442,540.00	

SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	34,000	14.34	487,560.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	38,000	13.60	516,800.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	12,000	74.85	898,200.00
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	21,000	6.96	146,160.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	91,000	5.07	461,370.00
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	9,000	26.60	239,400.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	12,500	37.40	467,500.00
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	6,000	19.14	114,840.00
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	6,400	49.50	316,800.00
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	12,000	21.40	256,800.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	48,800	11.64	568,032.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	16,400	13.56	222,384.00
SINOPHARM GROUP CO-H	26,400	20.15	531,960.00
3SBIO INC	31,000	8.45	261,950.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	28,000	13.20	369,600.00
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	34,000	6.60	224,400.00
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	56,000	3.91	218,960.00
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	170,000	8.32	1,414,400.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	22,000	23.95	526,900.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	2,700	75.90	204,930.00
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	24,000	15.44	370,560.00
INNOVENT BIOLOGICS INC	20,000	32.25	645,000.00
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	3,900	48.70	189,930.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	10,000	25.85	258,500.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	196,250	4.54	890,975.00
WUXI APPTec CO LTD-H	6,668	78.75	525,105.00
WUXI BIOLOGICS (CAYMAN) INC.	70,000	53.90	3,773,000.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	552,000	2.60	1,435,200.00
BANK OF CHINA LTD-H	1,532,000	2.75	4,213,000.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	166,000	4.42	733,720.00
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	167,000	3.46	577,820.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	1,850,000	4.73	8,750,500.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	69,000	2.37	163,530.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	75,500	42.30	3,193,650.00
CHINA MINSHENG BANKING-H	110,600	2.70	298,620.00

IND & COMM BK OF CHINA-H	1,088,000	3.89	4,232,320.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	148,000	4.89	723,720.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	181,000	1.11	200,910.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	82,000	4.00	328,000.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	29,200	15.10	440,920.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	40,000	16.36	654,400.00
FAR EAST HORIZON LTD	29,000	6.09	176,610.00
GF SECURITIES CO LTD-H	21,600	11.32	244,512.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	53,600	5.02	269,072.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	35,800	9.20	329,360.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	141,000	12.40	1,748,400.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	50,000	18.52	926,000.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	26,200	9.91	259,642.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	17,300	19.62	339,426.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	163,000	2.64	430,320.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	130,000	7.69	999,700.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	122,500	52.75	6,461,875.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	14,100	22.45	316,545.00
C&D INTERNATIONAL INVESTMENT	13,000	20.80	270,400.00
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	94,000	2.01	188,940.00
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	74,500	21.95	1,635,275.00
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	25,000	8.87	221,750.00
CHINA RESOURCES LAND LTD	62,000	35.50	2,201,000.00
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	13,400	39.70	531,980.00
CHINA VANKE CO LTD-H	32,100	17.64	566,244.00
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	200,000	3.06	612,000.00
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	39,000	23.95	934,050.00
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	15,500	14.38	222,890.00
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	24,000	5.88	141,120.00
HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	1,294	9.95	12,875.30
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	37,000	29.50	1,091,500.00
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	20,000	4.42	88,400.00
YUEXIU PROPERTY CO LTD	24,800	9.70	240,560.00
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	48,000	6.91	331,680.00
GDS HOLDINGS LTD-CL A	17,324	20.50	355,142.00

	KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	48,000	15.88	762,240.00	
	TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	20,000	16.00	320,000.00	
	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	14,000	17.94	251,160.00	
	BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	12,500	27.25	340,625.00	
	KINGBOARD HOLDINGS LTD	13,000	26.35	342,550.00	
	KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	16,500	8.71	143,715.00	
	LENOVO GROUP LTD	136,000	6.21	844,560.00	
	SUNNY OPTICAL TECH	13,500	107.10	1,445,850.00	
	XIAOMI CORP-CLASS B	295,200	11.48	3,388,896.00	
	ZTE CORP-H	15,400	17.90	275,660.00	
	CHINA TOWER CORP LTD-H	838,000	0.83	695,540.00	
	BEIJING ENTERPRISES HLDGS	8,500	24.75	210,375.00	
	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	76,000	2.02	153,520.00	
	CGN POWER CO LTD-H	202,000	1.85	373,700.00	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	55,200	11.32	624,864.00	
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	63,000	9.10	573,300.00	
	CHINA POWER INTERNATIONAL	99,000	2.87	284,130.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	18,000	31.50	567,000.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	36,000	14.10	507,600.00	
	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	15,600	112.80	1,759,680.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD	56,000	7.84	439,040.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	76,000	3.34	253,840.00	
	KUNLUN ENERGY CO LTD	76,000	5.98	454,480.00	
	FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	7,000	19.32	135,240.00	
	GCL TECHNOLOGY HOLDINGS LTD	410,000	2.06	844,600.00	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	10,000	26.80	268,000.00	
	SHANGHAI FUDAN MICROELECT-H	7,000	32.45	227,150.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	92,000	8.51	782,920.00	
	香港ドル 小計	15,926,463		232,392,190.80 (4,080,806,870)	
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	69,800	2.31	161,238.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	5,900	22.20	130,980.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	44,500	8.53	379,585.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	68,600	4.84	332,024.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	12,300	6.22	76,506.00	

	SIME DARBY BERHAD	56,700	2.19	124,173.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	13,800	6.35	87,630.00	
	MISC BHD	26,800	7.19	192,692.00	
	GENTING BHD	41,300	4.36	180,068.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	55,700	2.64	147,048.00	
	MR DIY GROUP M BHD	47,550	2.07	98,428.50	
	IOI CORP BHD	49,600	3.82	189,472.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	8,300	20.80	172,640.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	1,300	136.80	177,840.00	
	PPB GROUP BERHAD	11,320	17.50	198,100.00	
	QL RESOURCES BHD	17,150	5.54	95,011.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	41,900	4.35	182,265.00	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	33,500	1.63	54,605.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	31,800	6.00	190,800.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	153,200	0.84	128,688.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	36,600	4.22	154,452.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	127,400	5.65	719,810.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	12,300	20.62	253,626.00	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	5,300	18.42	97,626.00	
	MALAYAN BANKING BHD	89,700	8.69	779,493.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	287,000	4.41	1,265,670.00	
	RHB BANK BHD	26,900	5.61	150,909.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	47,800	3.09	147,702.00	
	DIGI.COM BHD	54,900	3.91	214,659.00	
	MAXIS BHD	45,700	3.88	177,316.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	19,100	5.42	103,522.00	
	PETRONAS GAS BHD	17,400	16.84	293,016.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	48,900	9.33	456,237.00	
	INARI AMERTRON BHD	46,700	2.69	125,623.00	
	マレーシアリングット 小計	1,656,720		8,239,454.50	(255,365,413)
タイパーツ	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	25,600	171.50	4,390,400.00	
	PTT PCL-NVDR	185,800	32.00	5,945,600.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	22,300	54.25	1,209,775.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	33,200	40.75	1,352,900.00	

PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	42,100	46.00	1,936,600.00	
SCG PACKAGING PCL-NVDR	22,100	57.75	1,276,275.00	
SIAM CEMENT PCL-NVDR	15,700	334.00	5,243,800.00	
AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	80,000	73.50	5,880,000.00	
BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	154,900	9.60	1,487,040.00	
BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	157,400	8.30	1,306,420.00	
ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	190,600	6.20	1,181,720.00	
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	59,300	30.75	1,823,475.00	
CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	33,225	43.50	1,445,287.50	
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	111,200	14.40	1,601,280.00	
PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	54,500	24.30	1,324,350.00	
BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	19,100	34.75	663,725.00	
CP ALL PCL-NVDR	116,100	64.50	7,488,450.00	
CARABAO GROUP PCL-NVDR	4,900	95.50	467,950.00	
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	73,500	23.60	1,734,600.00	
OSOTSPA PCL-NVDR	31,400	28.75	902,750.00	
THAI UNION GROUP PCL-NVDR	48,600	16.80	816,480.00	
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	192,600	28.25	5,440,950.00	
BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	10,700	210.00	2,247,000.00	
KASIKORNBANK PCL-NVDR	13,200	143.00	1,887,600.00	
KRUNG THAI BANK - NVDR	84,100	17.60	1,480,160.00	
SCB X PCL-NVDR	15,400	103.00	1,586,200.00	
JMT NETWORK SERVICES-NVDR	13,400	70.00	938,000.00	
KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	14,700	59.50	874,650.00	
MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	16,300	39.00	635,700.00	
SRISAWAD CORP PCL-NVDR	16,200	49.75	805,950.00	
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	38,500	71.00	2,733,500.00	
LAND & HOUSES PUB - NVDR	156,200	9.55	1,491,710.00	
DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	6,400	700.00	4,480,000.00	
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	22,500	187.00	4,207,500.00	
INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	21,200	74.25	1,574,100.00	
TRUE CORP PCL-NVDR	195,800	4.60	900,680.00	
B GRIMM POWER PCL-NVDR	25,200	37.75	951,300.00	
ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	4,300	170.00	731,000.00	
ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	32,000	97.00	3,104,000.00	

	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	13,300	70.00	931,000.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	54,100	54.00	2,921,400.00	
	RATCH GROUP PCL-NVDR	21,900	42.00	919,800.00	
	タイパーツ 小計	2,449,525		90,321,077.50 (354,961,834)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	29,260	54.00	1,580,040.00	
	AYALA CORPORATION	4,750	700.00	3,325,000.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	51,771	46.50	2,407,351.50	
	SM INVESTMENTS CORP	4,290	930.00	3,989,700.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	19,120	203.00	3,881,360.00	
	JOLLIBEE FOODS CORP	7,680	236.80	1,818,624.00	
	MONDE NISSIN CORP	123,700	11.24	1,390,388.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	17,410	136.60	2,378,206.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	34,680	98.50	3,415,980.00	
	BDO UNIBANK INC	35,730	129.00	4,609,170.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	36,812	55.00	2,024,660.00	
	AYALA LAND INC	152,200	29.20	4,444,240.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	227,000	34.70	7,876,900.00	
	GLOBE TELECOM INC	450	2,160.00	972,000.00	
	PLDT INC	1,640	1,730.00	2,837,200.00	
ACEN CORP	168,850	7.25	1,224,162.50		
MANILA ELECTRIC COMPANY	4,650	280.00	1,302,000.00		
	フィリピンペソ 小計	919,993		49,476,982.00 (122,163,616)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY TBK PT	278,800	3,680.00	1,025,984,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	33,800	26,125.00	883,025,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK	175,600	1,935.00	339,786,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	559,600	775.00	433,690,000.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	53,900	9,275.00	499,922,500.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	221,709	4,380.00	971,085,420.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	55,300	6,950.00	384,335,000.00	
	VALE INDONESIA TBK	49,100	7,250.00	355,975,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	382,300	5,675.00	2,169,552,500.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	333,700	2,500.00	834,250,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	139,000	5,725.00	795,775,000.00	

	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	47,000	10,150.00	477,050,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	81,200	6,925.00	562,310,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	140,700	4,620.00	650,034,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	386,200	2,130.00	822,606,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	1,077,600	8,575.00	9,240,420,000.00	
	BANK JAGO TBK PT	70,000	3,530.00	247,100,000.00	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	352,100	9,925.00	3,494,592,500.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	136,500	9,550.00	1,303,575,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	1,333,145	4,800.00	6,399,096,000.00	
	SARANA MENARA NUSANTARA PT	412,300	1,110.00	457,653,000.00	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	933,800	3,650.00	3,408,370,000.00	
	インドネシアルピア 小計	7,253,354		35,756,186,920.00 (314,654,444)	
韓国ウォン	HD HYUNDAI	824	63,800.00	52,571,200.00	
	S-OIL CORP	847	84,400.00	71,486,800.00	
	SK INNOVATION CO LTD	1,033	168,500.00	174,060,500.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORP	2,345	46,950.00	110,097,750.00	
	HYUNDAI STEEL CO	1,620	33,100.00	53,622,000.00	
	KOREA ZINC CO LTD	189	602,000.00	113,778,000.00	
	KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	307	142,000.00	43,594,000.00	
	LG CHEM LTD	957	627,000.00	600,039,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	133	289,000.00	38,437,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORP	320	186,000.00	59,520,000.00	
	POSCO CHEMICAL CO LTD	576	193,000.00	111,168,000.00	
	POSCO HOLDINGS INC	1,533	284,000.00	435,372,000.00	
	SK IE TECHNOLOGY CO LTD	491	62,600.00	30,736,600.00	
	SKC CO LTD	401	98,100.00	39,338,100.00	
	CJ CORP	425	80,800.00	34,340,000.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	883	35,300.00	31,169,900.00	
	DOOSAN ENERBILITY	7,590	16,000.00	121,440,000.00	
	ECOPRO BM CO LTD	940	101,000.00	94,940,000.00	
	GS HOLDINGS	848	45,900.00	38,923,200.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONST	1,469	38,600.00	56,703,400.00	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO	355	116,000.00	41,180,000.00	
	HYUNDAI MIPO DOCKYARD	517	83,700.00	43,272,900.00	

KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	1,409	45,900.00	64,673,100.00	
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	749	73,600.00	55,126,400.00	
LG CORP	1,793	80,400.00	144,157,200.00	
LG ENERGY SOLUTION	686	515,000.00	353,290,000.00	
SAMSUNG C&T CORP	1,563	118,500.00	185,215,500.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	2,961	22,850.00	67,658,850.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	12,107	5,140.00	62,229,980.00	
SK	724	203,500.00	147,334,000.00	
S-1 CORPORATION	428	64,200.00	27,477,600.00	
HMM CO LTD	4,898	22,050.00	108,000,900.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	365	173,000.00	63,145,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	3,876	26,050.00	100,969,800.00	
PAN OCEAN CO LTD	5,356	5,950.00	31,868,200.00	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	1,393	33,300.00	46,386,900.00	
HANON SYSTEMS	3,541	8,620.00	30,523,420.00	
HYUNDAI MOBIS CO LTD	1,155	208,500.00	240,817,500.00	
HYUNDAI MOTOR CO	2,726	162,500.00	442,975,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	610	79,500.00	48,495,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	533	79,500.00	42,373,500.00	
KIA CORP	4,959	65,200.00	323,326,800.00	
COWAY CO LTD	1,045	58,900.00	61,550,500.00	
F&F CO LTD / NEW	325	150,500.00	48,912,500.00	
LG ELECTRONICS INC	1,985	91,000.00	180,635,000.00	
KANGWON LAND INC	1,879	24,650.00	46,317,350.00	
CHEIL WORLDWIDE INC	1,050	23,750.00	24,937,500.00	
HYBE CO LTD	434	156,500.00	67,921,000.00	
KAKAO CORP	5,849	58,100.00	339,826,900.00	
KAKAO GAMES CORP	600	42,750.00	25,650,000.00	
KRAFTON INC	600	180,500.00	108,300,000.00	
NAVER CORP	2,557	195,000.00	498,615,000.00	
NCSOFT CORP	302	468,000.00	141,336,000.00	
NETMARBLE CORPORATION	392	50,000.00	19,600,000.00	
PEARL ABYSS CORP	460	44,650.00	20,539,000.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	602	79,600.00	47,919,200.00	
LOTTE SHOPPING CO	222	90,100.00	20,002,200.00	

BGF RETAIL CO LTD/NEW	138	205,000.00	28,290,000.00	
E-MART INC	374	100,000.00	37,400,000.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	160	378,500.00	60,560,000.00	
KT&G CORP	2,051	98,000.00	200,998,000.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	412	118,000.00	48,616,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	611	139,500.00	85,234,500.00	
LG H&H	177	722,000.00	127,794,000.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	1,613	65,200.00	105,167,600.00	
HLB INC	2,173	32,700.00	71,057,100.00	
SD BIOSENSOR INC	691	32,850.00	22,699,350.00	
CELLTRION INC	1,850	180,500.00	333,925,000.00	
CELLTRION PHARM INC	339	65,600.00	22,238,400.00	
HANMI PHARM CO LTD	137	269,500.00	36,921,500.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	334	827,000.00	276,218,000.00	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	783	72,900.00	57,080,700.00	
SK BIOSCIENCE CO LTD	417	82,900.00	34,569,300.00	
YUHAN CORP	1,019	58,500.00	59,611,500.00	
HANA FINANCIAL GROUP	5,500	46,450.00	255,475,000.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	4,455	11,050.00	49,227,750.00	
KAKAOBANK CORP	3,051	28,100.00	85,733,100.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	7,363	52,600.00	387,293,800.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	8,671	38,000.00	329,498,000.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	10,023	12,950.00	129,797,850.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	832	58,500.00	48,672,000.00	
MERITZ SECURITIES CO LTD	6,080	5,700.00	34,656,000.00	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	5,653	6,460.00	36,518,380.00	
NH INVESTMENT & SECURITIES C	2,964	9,690.00	28,721,160.00	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	1,222	35,000.00	42,770,000.00	
DB INSURANCE CO LTD	911	63,100.00	57,484,100.00	
MERITZ FIRE & MARINE INSURAN	581	44,400.00	25,796,400.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	598	207,000.00	123,786,000.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	1,532	73,700.00	112,908,400.00	
SAMSUNG SDS CO LTD	647	127,500.00	82,492,500.00	
ILJIN MATERIALS CO LTD	440	58,300.00	25,652,000.00	
L&F CO LTD	425	193,300.00	82,152,500.00	

	LG DISPLAY CO LTD	4,329	13,950.00	60,389,550.00	
	LG INNOTEK CO LTD	276	286,500.00	79,074,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	1,031	138,000.00	142,278,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	91,798	60,400.00	5,544,599,200.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	15,930	54,700.00	871,371,000.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	1,066	645,000.00	687,570,000.00	
	LG UPLUS CORP	4,303	12,050.00	51,851,150.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	4,725	21,000.00	99,225,000.00	
	SK HYNIX INC	10,577	81,500.00	862,025,500.00	
	SK SQUARE CO LTD	1,754	35,900.00	62,968,600.00	
	韓国ウォン 小計	304,753		18,642,265,040.00 (1,949,980,923)	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	24,000	81.50	1,956,000.00	
	ASIA CEMENT CORP	41,000	41.35	1,695,350.00	
	CHINA STEEL CORP	221,000	29.05	6,420,050.00	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	66,000	70.90	4,679,400.00	
	FORMOSA PLASTICS CORP	82,000	87.90	7,207,800.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	94,000	73.50	6,909,000.00	
	TAIWAN CEMENT	112,917	33.70	3,805,302.90	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	2,600	947.00	2,462,200.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	57,000	33.20	1,892,400.00	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	1,500	1,715.00	2,572,500.00	
	WALSIN LIHWA CORP	47,000	46.95	2,206,650.00	
	CHINA AIRLINES LTD	55,000	19.65	1,080,750.00	
	EVA AIRWAYS CORP	50,000	28.35	1,417,500.00	
	EVERGREEN MARINE CORP LTD	19,420	154.50	3,000,390.00	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	38,000	28.50	1,083,000.00	
	WAN HAI LINES LTD	12,650	70.10	886,765.00	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	33,000	62.80	2,072,400.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	30,000	35.00	1,050,000.00	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	4,020	480.00	1,929,600.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	8,080	194.50	1,571,560.00	
	GIANT MANUFACTURING	6,000	231.50	1,389,000.00	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	3,000	275.50	826,500.00	
	POU CHEN	45,000	33.05	1,487,250.00	

HOTAI MOTOR COMPANY LTD	6,000	624.00	3,744,000.00	
MOMO.COM INC	1,200	636.00	763,200.00	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	11,000	273.00	3,003,000.00	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	96,000	66.00	6,336,000.00	
PHARMAESSENTIA CORP	4,000	537.00	2,148,000.00	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	94,265	17.45	1,644,924.25	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	346,000	22.70	7,854,200.00	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	241,123	24.65	5,943,681.95	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	198,168	26.20	5,192,001.60	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	165,430	22.65	3,746,989.50	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	209,125	31.15	6,514,243.75	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	188,814	17.75	3,351,448.50	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	206,445	15.05	3,106,997.25	
TAIWAN BUSINESS BANK	128,000	13.00	1,664,000.00	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	183,741	26.25	4,823,201.25	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	78,000	47.80	3,728,400.00	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	28,245	212.50	6,002,062.50	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	185,437	22.40	4,153,788.80	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	166,000	41.10	6,822,600.00	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	286,000	12.95	3,703,700.00	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	146,825	57.50	8,442,437.50	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	237,835	8.71	2,071,542.85	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	34,608	44.85	1,552,168.80	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	10,000	250.50	2,505,000.00	
ACER INC	56,000	23.60	1,321,600.00	
ADVANTECH CO LTD	8,299	334.50	2,776,015.50	
ASUSTEK COMPUTER INC	13,000	268.50	3,490,500.00	
AUO CORP	127,200	15.70	1,997,040.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	13,000	173.50	2,255,500.00	
COMPAL ELECTRONICS	78,000	21.95	1,712,100.00	
DELTA ELECTRONICS INC	37,000	294.50	10,896,500.00	
E INK HOLDINGS INC	16,000	170.00	2,720,000.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	241,800	102.00	24,663,600.00	
INNOLUX CORP	176,475	12.00	2,117,700.00	
INVENTEC CORP	52,000	24.50	1,274,000.00	

	LARGAN PRECISION CO LTD	1,900	2,190.00	4,161,000.00	
	LITE-ON TECHNOLOGY CORP	39,000	63.70	2,484,300.00	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	13,000	119.00	1,547,000.00	
	NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	4,000	281.50	1,126,000.00	
	PEGATRON CORP	37,000	63.10	2,334,700.00	
	QUANTA COMPUTER INC	51,000	72.50	3,697,500.00	
	SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	26,000	59.80	1,554,800.00	
	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	23,000	149.50	3,438,500.00	
	WIWYNN CORP	2,000	906.00	1,812,000.00	
	WPG HOLDINGS LTD	35,960	48.50	1,744,060.00	
	YAGEO CORPORATION	6,524	479.00	3,124,996.00	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	13,000	116.00	1,508,000.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	75,000	112.00	8,400,000.00	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	30,000	67.50	2,025,000.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	32,000	95.40	3,052,800.00	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	61,000	99.50	6,069,500.00	
	EEMORY TECHNOLOGY INC	1,400	1,490.00	2,086,000.00	
	GLOBALWAFERS CO LTD	4,000	463.00	1,852,000.00	
	MEDIATEK INC	28,800	729.00	20,995,200.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	21,000	53.70	1,127,700.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS COR	11,000	299.00	3,289,000.00	
	PARADE TECHNOLOGIES LTD	1,400	821.00	1,149,400.00	
	POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU	52,000	33.45	1,739,400.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	9,000	299.50	2,695,500.00	
	SILERGY CORP	6,640	477.00	3,167,280.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	473,000	481.50	227,749,500.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	232,000	43.50	10,092,000.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	15,000	83.20	1,248,000.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	6,000	149.50	897,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	51,000	20.70	1,055,700.00	
	新台湾ドル 小計	6,486,846		540,867,347.90 (2,415,134,968)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	16,143	338.45	5,463,598.35	
	COAL INDIA LTD	28,317	228.85	6,480,345.45	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	14,851	240.00	3,564,240.00	

INDIAN OIL CORP LTD	52,920	77.00	4,074,840.00
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	53,062	140.70	7,465,823.40
PETRONET LNG LTD	12,992	213.75	2,777,040.00
RELIANCE INDUSTRIES LTD	58,593	2,609.10	152,874,996.30
ACC LTD	1,469	2,619.50	3,848,045.50
AMBUJA CEMENTS LTD	11,174	581.00	6,492,094.00
ASIAN PAINTS LTD	7,515	3,226.95	24,250,529.25
BERGER PAINTS INDIA LTD	4,076	615.15	2,507,351.40
GRASIM INDUSTRIES LTD	4,892	1,799.90	8,805,110.80
HINDALCO INDUSTRIES LTD	25,015	462.85	11,578,192.75
JINDAL STEEL & POWER LTD	8,017	545.80	4,375,678.60
JSW STEEL LTD	14,544	740.40	10,768,377.60
PI INDUSTRIES LTD	1,583	3,452.85	5,465,861.55
PIDILITE INDUSTRIES LTD	2,828	2,739.65	7,747,730.20
SHREE CEMENT LTD	197	24,441.55	4,814,985.35
SRF LTD	2,838	2,365.50	6,713,289.00
TATA STEEL LTD	136,984	110.45	15,129,882.80
ULTRATECH CEMENT LTD	1,884	7,077.40	13,333,821.60
UPL LTD	9,171	763.70	7,003,892.70
VEDANTA LTD	13,970	308.85	4,314,634.50
ABB INDIA LTD	1,147	2,976.65	3,414,217.55
ADANI ENTERPRISES LTD	5,330	3,996.80	21,302,944.00
BHARAT ELECTRONICS LTD	68,904	105.80	7,290,043.20
HAVELLS INDIA LTD	4,586	1,182.00	5,420,652.00
LARSEN & TOUBRO LTD	13,413	2,154.05	28,892,272.65
SIEMENS LTD	1,348	2,967.00	3,999,516.00
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	4,422	722.15	3,193,347.30
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	9,831	890.75	8,756,963.25
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	5,358	774.05	4,147,359.90
INTERGLOBE AVIATION LTD	1,928	1,992.05	3,840,672.40
BAJAJ AUTO LTD	1,477	3,616.95	5,342,235.15
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	1,609	2,058.10	3,311,482.90
BHARAT FORGE LTD	4,571	857.40	3,919,175.40
EICHER MOTORS LTD	2,553	3,358.20	8,573,484.60
HERO MOTOCORP LTD	2,256	2,751.50	6,207,384.00

MAHINDRA & MAHINDRA LTD	16,349	1,265.40	20,688,024.60	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	2,270	8,613.35	19,552,304.50	
MRF LTD	38	91,510.70	3,477,406.60	
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN	35,488	73.10	2,594,172.80	
TATA MOTORS LTD	31,104	413.30	12,855,283.20	
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LT	2,245	3,010.20	6,757,899.00	
TVS MOTOR CO LTD	4,621	1,036.15	4,788,049.15	
PAGE INDUSTRIES LTD	118	46,395.95	5,474,722.10	
TITAN CO LTD	6,651	2,615.45	17,395,357.95	
INDIAN HOTELS CO LTD	17,870	330.10	5,898,887.00	
JUBILANT FOODWORKS LTD	7,490	535.65	4,012,018.50	
INFO EDGE INDIA LTD	1,429	4,015.00	5,737,435.00	
TRENT LTD	3,264	1,458.00	4,758,912.00	
ZOMATO LTD	64,296	64.15	4,124,588.40	
AVENUE SUPERMARTS LTD	3,025	4,002.40	12,107,260.00	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	2,009	4,410.30	8,860,292.70	
ITC LTD	58,436	341.40	19,950,050.40	
MARICO LTD	9,787	523.75	5,125,941.25	
NESTLE INDIA LTD	629	20,241.75	12,732,060.75	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	11,092	803.30	8,910,203.60	
UNITED SPIRITS LTD	5,758	938.00	5,401,004.00	
VARUN BEVERAGES LTD	4,760	1,410.25	6,712,790.00	
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	2,394	1,656.95	3,966,738.30	
DABUR INDIA LTD	11,508	598.75	6,890,415.00	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	7,814	923.60	7,217,010.40	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	15,945	2,722.25	43,406,276.25	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	1,846	4,685.10	8,648,694.60	
AUROBINDO PHARMA LTD	4,528	454.00	2,055,712.00	
BIOCON LTD	8,322	272.25	2,265,664.50	
CIPLA LTD	9,019	1,107.90	9,992,150.10	
DIVI'S LABORATORIES LTD	2,471	3,274.05	8,090,177.55	
DR. REDDY'S LABORATORIES	2,168	4,407.10	9,554,592.80	
LUPIN LTD	4,421	751.50	3,322,381.50	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	17,980	992.85	17,851,443.00	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	1,744	1,617.60	2,821,094.40	

AU SMALL FINANCE BANK LTD	3,156	682.15	2,152,865.40
AXIS BANK LTD	44,140	933.70	41,213,518.00
BANDHAN BANK LTD	12,468	246.95	3,078,972.60
ICICI BANK LTD	99,382	929.90	92,415,321.80
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	10,427	1,888.05	19,686,697.35
STATE BANK OF INDIA	33,468	616.50	20,633,022.00
YES BANK LTD	214,143	19.70	4,218,617.10
BAJAJ FINANCE LTD	5,290	6,517.45	34,477,310.50
BAJAJ FINSERV LTD	7,153	1,598.60	11,434,785.80
BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMEN	576	6,209.80	3,576,844.80
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	8,009	744.10	5,959,496.90
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	33,264	2,672.10	88,884,734.40
MUTHOOT FINANCE LTD	2,371	1,103.30	2,615,924.30
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	4,344	801.40	3,481,281.60
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	5,012	1,344.05	6,736,378.60
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	19,418	579.60	11,254,672.80
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	4,343	1,247.95	5,419,846.85
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	6,031	456.85	2,755,262.35
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	8,394	1,269.65	10,657,442.10
DLF LTD	11,721	402.25	4,714,772.25
GODREJ PROPERTIES LTD	2,400	1,277.65	3,066,360.00
HCL TECHNOLOGIES LTD	20,335	1,027.50	20,894,212.50
INFOSYS LTD	64,863	1,569.30	101,789,505.90
LTIMINDTREE LTD	1,868	4,401.75	8,222,469.00
MPHASIS LTD	1,924	1,997.30	3,842,805.20
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	17,679	3,292.75	58,212,527.25
TATA ELXSI LTD	666	6,745.75	4,492,669.50
TECH MAHINDRA LTD	10,874	1,035.30	11,257,852.20
WIPRO LTD	25,430	394.05	10,020,691.50
BHARTI AIRTEL LTD	43,209	834.90	36,075,194.10
INDUS TOWERS LTD	13,541	194.60	2,635,078.60
ADANI GREEN ENERGY LTD	5,918	2,053.45	12,152,317.10
ADANI POWER LTD	15,041	316.05	4,753,708.05
ADANI TOTAL GAS LTD	5,150	3,621.30	18,649,695.00
ADANI TRANSMISSION LTD	5,228	2,646.40	13,835,379.20

	GAIL INDIA LTD	44,731	90.85	4,063,811.35	
	INDRAPRASTHA GAS LTD	6,370	435.75	2,775,727.50	
	NTPC LTD	72,336	169.50	12,260,952.00	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	58,540	217.20	12,714,888.00	
	TATA POWER CO LTD	30,523	219.40	6,696,746.20	
	インドルピー 小計	1,970,393		1,485,239,482.95 (2,480,349,936)	
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	12,160	18.08	219,852.80	
	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	48,704	3.80	185,513.53	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	75,832	2.19	166,602.90	
	INDUSTRIES QATAR	27,992	14.31	400,565.52	
	COMMERCIAL BANK PQSC	59,454	5.45	324,024.30	
	MASRAF AL RAYAN	103,454	3.38	350,398.69	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	20,296	10.80	219,196.80	
	QATAR ISLAMIC BANK	31,001	22.88	709,302.88	
	QATAR NATIONAL BANK	89,395	18.29	1,635,034.55	
	BARWA REAL ESTATE CO	40,684	3.10	126,120.40	
	QOOREDOO QPSC	18,307	9.15	167,509.05	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	8,098	16.97	137,423.06	
	カタールリアル 小計	535,377		4,641,544.48 (173,454,517)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	4,374	225.35	985,680.90	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	2,290	294.26	673,855.40	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	983	1,589.56	1,562,537.48	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	8,389	326.30	2,737,330.70	
	GOLD FIELDS LTD	17,714	192.56	3,411,007.84	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	10,759	61.41	660,710.19	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	15,902	214.06	3,403,982.12	
	KUMBA IRON ORE LTD	1,067	507.45	541,449.15	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	7,347	190.66	1,400,779.02	
	SASOL LTD	10,609	271.01	2,875,145.09	
	SIBANYE STILLWATER LTD	56,870	49.26	2,801,416.20	
	BIDVEST GROUP LTD	5,191	220.75	1,145,913.25	
	MULTICHOICE GROUP LTD	7,242	117.59	851,586.78	
MR PRICE GROUP LTD	4,651	163.85	762,066.35		

	NASPERS LTD-N SHS	4,217	2,797.05	11,795,159.85
	PEPKOR HOLDINGS LTD	33,135	20.47	678,273.45
	THE FOSCHINI GROUP LTD	6,447	101.77	656,111.19
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	18,906	67.96	1,284,851.76
	BID CORP LTD	6,170	342.26	2,111,744.20
	CLICKS GROUP LTD	4,730	289.22	1,368,010.60
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	9,655	238.00	2,297,890.00
	SPAR GROUP LIMITED/THE	3,680	137.00	504,160.00
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	7,294	140.95	1,028,089.30
	ABSA GROUP LTD	16,641	195.14	3,247,324.74
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	1,631	1,900.00	3,098,900.00
	NEDBANK GROUP LTD	8,478	211.70	1,794,792.60
	STANDARD BANK GROUP LTD	26,201	169.55	4,442,379.55
	FIRSTRAND LTD	98,265	60.87	5,981,390.55
	REINET INVESTMENTS SCA	2,729	330.00	900,570.00
	REMGRO LTD	10,067	137.34	1,382,601.78
	DISCOVERY LTD	9,011	122.83	1,106,821.13
	OLD MUTUAL LTD	90,974	10.16	924,295.84
	SANLAM LTD	32,787	48.37	1,585,907.19
	NEPI ROCKCASTLE N.V.	7,950	104.28	829,026.00
	MTN GROUP LTD	31,824	130.70	4,159,396.80
	VODACOM GROUP LTD	13,461	129.20	1,739,161.20
	南アフリカランド 小計	597,641		76,730,318.20 (603,100,301)
アラブディルハム	MULTIPLY GROUP	68,027	4.98	338,774.46
	Q HOLDING PJSC	43,518	4.33	188,432.94
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	59,313	4.53	268,687.89
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	52,651	9.20	484,389.20
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	27,087	9.12	247,033.44
	DUBAI ISLAMIC BANK	54,804	5.60	306,902.40
	EMIRATES NBD PJSC	35,922	13.05	468,782.10
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	83,486	16.54	1,380,858.44
	ALDAR PROPERTIES PJSC	72,429	4.44	321,584.76
	EMAAR PROPERTIES PJSC	75,511	6.13	462,882.43
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	67,496	23.64	1,595,605.44

	アラブディルハム 小計	640,244		6,063,933.50 (226,124,080)	
クウェートディ ナール	AGILITY	27,829	0.75	21,038.72	
	BOUBYAN BANK K.S.C	27,890	0.82	22,981.36	
	GULF BANK	31,180	0.33	10,320.58	
	KUWAIT FINANCE HOUSE	139,070	0.84	117,792.29	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	138,795	1.09	151,841.73	
	MABANEE CO KPSC	12,240	0.85	10,404.00	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	41,562	0.58	24,105.96	
	クウェートディナール 小計	418,566		358,484.64 (160,113,579)	
オフショア人民 元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	9,800	6.15	60,270.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	32,500	4.51	146,575.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	8,900	29.11	259,079.00	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-A	3,400	13.65	46,410.00	
	GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	9,700	10.09	97,873.00	
	INNER MONGOLIA DIAN TOU EN-A	2,700	13.31	35,937.00	
	JIZHONG ENERGY RESOURCES-A	4,900	6.82	33,418.00	
	OFFSHORE OIL ENGINEERING-A	500	5.97	2,985.00	
	PETROCHINA CO LTD-A	21,700	5.14	111,538.00	
	PINGDINGSHAN TIANAN COAL -A	3,200	12.28	39,296.00	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	11,700	19.68	230,256.00	
	SHAN XI HUA YANG GROUP NEW-A	3,400	16.19	55,046.00	
	SHANXI COKING COAL ENERGY-A	4,420	12.84	56,752.80	
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	2,900	18.58	53,882.00	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO-A	2,891	38.74	111,997.34	
	YANTAI JEREH OILFIELD-A	900	30.20	27,180.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	12,700	4.91	62,357.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	3,900	30.25	117,975.00	
	ANHUI HONGLU STEEL CONSTRU-A	650	31.62	20,553.00	
	ASIA-POTASH INTERNATIONAL-A	1,500	29.99	44,985.00	
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	24,500	5.88	144,060.00		
BBMG CORPORATION-A	900	2.70	2,430.00		
CHENGTUN MINING GROUP CO -A	4,400	6.37	28,028.00		
CHENGXIN LITHIUM GROUP CO-A	1,400	43.56	60,984.00		

CHINA JUSHI CO LTD -A	3,314	14.75	48,881.50
CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	3,500	26.82	93,870.00
CHINA RARE EARTH RESOURCES-A	1,900	35.20	66,880.00
CMOC GROUP LTD-A	17,200	5.01	86,172.00
CNGR ADVANCED MATERIAL CO -A	600	79.15	47,490.00
CNNC HUA YUAN TITANIUM -A	4,785	7.05	33,734.25
DO-FLUORIDE NEW MATERIALS -A	1,500	37.62	56,430.00
GANFENG LITHIUM GROUP CO L-A	1,940	80.71	156,577.40
GEM CO LTD-A	3,500	8.18	28,630.00
GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	2,380	50.52	120,237.60
HANGZHOU OXYGEN PLANT GROU-A	2,000	39.61	79,220.00
HENAN SHENHUO COAL & POWER-A	3,500	17.67	61,845.00
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	5,720	17.50	100,100.00
HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	1,950	7.40	14,430.00
HESTEEL CO LTD-A	1,500	2.44	3,660.00
HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A	700	101.00	70,700.00
HUAFON CHEMICAL CO LTD -A	4,600	7.36	33,856.00
HUAIBEI MINING HOLDINGS CO-A	3,700	14.03	51,911.00
HUAXIN CEMENT CO LTD-A	1,100	15.70	17,270.00
HUBEI XINGFA CHEMICALS GRP-A	1,900	33.60	63,840.00
HUNAN VALIN STEEL CO LTD -A	3,500	4.96	17,360.00
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	44,300	2.02	89,486.00
INNER MONGOLIA EERDUOSI RE-A	2,100	16.54	34,734.00
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	3,500	4.28	14,980.00
INNER MONGOLIA YUAN XING-A	5,900	8.60	50,740.00
JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	7,600	14.74	112,024.00
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	300	105.89	31,767.00
JIANGSU YOKE TECHNOLOGY-A	500	53.53	26,765.00
JIANGXI COPPER CO LTD-A	2,000	18.08	36,160.00
LB GROUP CO LTD-A	1,700	19.78	33,626.00
LUXI CHEMICAL GROUP CO LT-A	1,900	13.32	25,308.00
LUXIANG COMPANY,LTD.	400	116.68	46,672.00
NINGBO SHANSHAN CO LTD-A	2,300	19.55	44,965.00
NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	6,100	14.26	86,986.00
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	7,200	5.33	38,376.00

QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY-A	5,600	25.46	142,576.00	
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	10,050	13.42	134,871.00	
SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A	3,290	15.70	51,653.00	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	3,468	20.59	71,406.12	
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	1,820	32.30	58,786.00	
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	10,000	3.62	36,200.00	
SHANDONG SUN PAPER INDUSTR-A	2,200	11.26	24,772.00	
SHANDONG WEIFANG RAINBOW C-A	400	92.85	37,140.00	
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	1,440	58.77	84,628.80	
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	3,700	10.13	37,481.00	
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	4,800	4.69	22,512.00	
SHENGHE RESOURCES HOLDINGS-A	1,700	15.02	25,534.00	
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	1,080	43.27	46,731.60	
SHENZHEN DYNANONIC CO LTD-A	200	265.56	53,112.00	
SHENZHEN SENIOR TECHNOLOGY-A	1,798	24.34	43,763.32	
SHENZHEN YUTO PACKAGING TE-A	1,700	31.77	54,009.00	
SICHUAN HEBANG BIOTECHNOL- A	14,200	3.20	45,440.00	
SICHUAN YAHUA INDUSTRIAL-A	1,900	26.54	50,426.00	
SINOMA SCIENCE&TECHNOLOGY -A	2,200	24.15	53,130.00	
SINOMINE RESOURCE GROUP CO-A	700	77.30	54,110.00	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A	600	3.29	1,974.00	
SKSHU PAINT CO LTD-A	560	124.96	69,977.60	
SUZHOU TA&A ULTRA CLEAN TE-A	800	62.63	50,104.00	
TANGSHAN JIDONG CEMENT INV-A	3,700	8.98	33,226.00	
TIANQI LITHIUM CORP-A	1,600	88.90	142,240.00	
TIANSHAN ALUMINUM GROUP CO-A	7,500	8.53	63,975.00	
TIBET SUMMIT RESOURCES CO-A	1,500	23.89	35,835.00	
TONGKUN GROUP CO LTD-A	1,500	15.31	22,965.00	
TONGLING NONFERROUS METALS-A	10,400	3.27	34,008.00	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	3,800	93.40	354,920.00	
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	400	71.19	28,476.00	
WESTERN MINING CO -A	3,300	11.39	37,587.00	
WESTERN SUPERCONDUCTING TE-A	400	95.01	38,004.00	
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD-A	1,200	21.78	26,136.00	
XINJIANG ZHONGTAI CHEMICAL-A	4,100	7.40	30,340.00	

YINTAI GOLD CO LTD-A	2,380	13.09	31,154.20
YONGXING SPECIAL MATERIALS-A	700	104.25	72,975.00
YUNNAN ALUMINIUM CO LTD-A	3,100	12.30	38,130.00
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	1,000	139.95	139,950.00
YUNNAN TIN CO LTD-A	3,500	14.30	50,050.00
YUNNAN YUNTIANHUA CO-A	1,500	24.04	36,060.00
ZANGGE MINING CO LTD-A	3,300	28.19	93,027.00
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	1,708	65.35	111,617.80
ZHEJIANG JUHUA CO-A	2,300	16.73	38,479.00
ZHEJIANG YONGTAI TECH-A	1,500	25.53	38,295.00
ZIBO QIXIANG TENGDA CHEMIC-A	4,500	7.33	32,985.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	22,600	10.61	239,786.00
AECC AERO-ENGINE CONTROL-A	1,000	26.91	26,910.00
AECC AVIATION POWER CO-A	3,100	44.00	136,400.00
AVIC ELECTROMECHANICAL SY-A	3,000	10.94	32,820.00
AVICOPTER PLC-A	500	46.37	23,185.00
BEIJING EASPRING MATERIAL-A	700	63.55	44,485.00
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	1,400	27.53	38,542.00
BEIJING UNITED INFORMATION-A	580	99.70	57,826.00
CHINA BAOAN GROUP-A	4,500	13.33	59,985.00
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	4,400	23.42	103,048.00
CHINA ENERGY ENGINEERING COR	30,000	2.45	73,500.00
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	9,700	8.89	86,233.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	21,400	6.09	130,326.00
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	45,900	5.94	272,646.00
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	2,800	424.60	1,188,880.00
COSCO SHIPPING DEVELOPMENT CO	18,400	2.63	48,392.00
CRRC CORP LTD-A	26,200	5.36	140,432.00
DAJIN HEAVY INDUSTRY CO LT-A	1,200	40.37	48,444.00
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	4,400	21.06	92,664.00
EVE ENERGY CO LTD-A	2,020	90.60	183,012.00
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	417	6.56	2,735.52
GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A	600	193.45	116,070.00
GOODWE TECHNOLOGIES CO LTD-A	200	312.20	62,440.00
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	1,800	32.73	58,914.00

GUANGDONG KINLONG HARDWARE-A	400	109.80	43,920.00
GUANGZHOU GREAT POWER ENER-A	1,000	82.00	82,000.00
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	1,680	32.90	55,272.00
HUBEI FEILIHUA QUARTZ GLAS-A	1,000	54.50	54,500.00
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	1,436	65.49	94,043.64
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	5,300	15.80	83,740.00
JIANGXI SPECIAL ELECTRIC -A	2,500	19.60	49,000.00
KEDA INDUSTRIAL GROUP CO LTD	2,800	15.50	43,400.00
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A	2,200	17.15	37,730.00
LUOYANG XINQIANGLIAN SLEWI-A	340	60.42	20,542.80
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	21,800	3.46	75,428.00
MING YANG SMART ENERGY GRO-A	1,800	25.91	46,638.00
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	7,135	26.40	188,364.00
NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO -A	300	354.69	106,407.00
NINGBO ORIENT WIRES & CABL-A	1,000	67.59	67,590.00
NINGBO RONBAY NEW ENERGY T-A	450	77.76	34,992.00
NORTH INDUSTRIES GROUP RED-A	2,400	21.02	50,448.00
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	16,500	7.63	125,895.00
PYLON TECHNOLOGIES CO LTD-A	200	345.58	69,116.00
RIYUE HEAVY INDUSTRY CO LT-A	2,000	19.48	38,960.00
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	9,100	16.91	153,881.00
SHANGHAI CONSTRUCTION GROU-A	5,600	2.78	15,568.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	10,400	4.24	44,096.00
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	2,700	69.37	187,299.00
SHENZHEN KSTAR SCIENCE AND-A	1,200	52.64	63,168.00
SICHUAN NEW ENERGY POWER CO	2,400	19.88	47,712.00
SICHUAN ROAD&BRIDGE GROUP-A	4,500	11.29	50,805.00
SIEYUAN ELECTRIC CO LTD-A	1,500	37.65	56,475.00
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	1,500	106.80	160,200.00
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	1,300	24.34	31,642.00
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	256	451.63	115,617.28
TBEA CO LTD-A	5,500	21.06	115,830.00
TITAN WIND ENERGY SUZHOU-A	2,800	14.42	40,376.00
WEICHAJ POWER CO LTD-A	9,500	10.91	103,645.00
WUXI SHANGJI AUTOMATION CO-A	700	114.95	80,465.00

XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	7,700	5.38	41,426.00	
XIAMEN C & D INC-A	4,400	15.20	66,880.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	3,400	11.38	38,692.00	
ZHEFU HOLDING GROUP CO LTD-A	5,300	4.12	21,836.00	
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	2,000	29.85	59,700.00	
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	420	52.41	22,012.20	
ZHEJIANG HANGKE TECHNOLOGY-A	800	45.77	36,616.00	
ZHEJIANG WEIXING NEW BUILD-A	1,300	22.16	28,808.00	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-A	800	56.81	45,448.00	
ZHUZHOU KIBING GROUP CO LT-A	4,000	10.93	43,720.00	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	6,400	5.97	38,208.00	
BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A	2,600	5.05	13,130.00	
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	800	53.42	42,736.00	
ZHEJIANG WEIMING ENVIRONME-A	2,340	19.41	45,419.40	
AIR CHINA LTD-A	6,400	10.92	69,888.00	
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	10,800	5.57	60,156.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	17,600	7.47	131,472.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	15,070	13.30	200,431.00	
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	16,200	6.76	109,512.00	
LIAONING PORT CO LTD-A	21,900	1.66	36,354.00	
S F HOLDING CO LTD-A	5,600	58.03	324,968.00	
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	1,000	58.26	58,260.00	
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	8,900	5.56	49,484.00	
YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	4,000	21.55	86,200.00	
YUNDA HOLDING CO LTD-A	4,870	14.29	69,592.30	
BETHEL AUTOMOTIVE SAFETY S-A	900	80.65	72,585.00	
BYD CO LTD -A	2,100	274.70	576,870.00	
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	200	131.30	26,260.00	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	10,226	13.90	142,141.40	
FAW JIEFANG GROUP CO LTD-A	3,200	8.64	27,648.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	1,900	37.79	71,801.00	
GREAT WALL MOTOR CO LTD-A	3,300	31.55	104,115.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A	6,900	12.10	83,490.00	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	3,000	18.41	55,230.00	
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	500	114.88	57,440.00	

NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	1,200	14.55	17,460.00
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	1,100	62.84	69,124.00
SAIC MOTOR CORP LTD-A	8,610	15.24	131,216.40
SAILUN GROUP CO LTD-A	3,100	9.45	29,295.00
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	1,300	21.05	27,365.00
SHENZHEN KEDALI INDUSTRY C-A	400	118.67	47,468.00
ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A	600	83.90	50,340.00
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	3,100	33.88	105,028.00
HAIER SMART HOME CO LTD-A	6,900	25.45	175,605.00
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	1,000	29.38	29,380.00
JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	1,040	45.80	47,632.00
OPPEIN HOME GROUP INC-A	540	119.20	64,368.00
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	14,100	3.98	56,118.00
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	300	49.50	14,850.00
BTG HOTELS GROUP CO LTD-A	1,600	24.20	38,720.00
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	600	54.98	32,988.00
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	8,300	5.98	49,634.00
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	1,080	14.41	15,562.80
37 INTERACTIVE ENTERTAINME-A	3,900	17.36	67,704.00
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	1,300	8.64	11,232.00
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	15,900	6.86	109,074.00
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY XI	100	337.07	33,707.00
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	3,110	26.51	82,446.10
PERFECT WORLD CO LTD-A	1,350	13.58	18,333.00
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	7,100	4.13	29,323.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	2,300	213.23	490,429.00
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	5,000	7.87	39,350.00
WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A	6,000	5.15	30,900.00
DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	864	43.90	37,929.60
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	546	66.85	36,500.10
ANGEL YEAST CO LTD-A	700	47.03	32,921.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	600	266.18	159,708.00
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	500	61.35	30,675.00
ANHUI YINGJIA DISTILLERY C-A	600	58.89	35,334.00
ANJOY FOODS GROUP CO LTD	400	167.23	66,892.00

BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	6,600	8.97	59,202.00	
BEIJING YANJING BREWERY CO-A	3,900	10.74	41,886.00	
CHACHA FOOD CO LTD-A	400	53.24	21,296.00	
CHONGQING BREWERY CO-A	400	126.03	50,412.00	
CHONGQING FULING ZHACAI-A	700	27.25	19,075.00	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	4,609	80.20	369,641.80	
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	900	24.03	21,627.00	
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	1,800	59.70	107,460.00	
HEILONGJIANG AGRICULTURE-A	2,500	14.48	36,200.00	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	4,800	25.66	123,168.00	
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	6,900	31.99	220,731.00	
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	1,000	47.92	47,920.00	
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	1,800	161.03	289,854.00	
JIUGUI LIQUOR CO LTD-A	400	140.80	56,320.00	
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	300	39.95	11,985.00	
JUEWEI FOOD CO LTD-A	300	56.25	16,875.00	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	1,500	1,730.00	2,595,000.00	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	1,700	212.88	361,896.00	
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	6,216	48.79	303,278.64	
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	7,600	13.46	102,296.00	
SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT-A	1,372	39.00	53,508.00	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	1,420	284.19	403,549.80	
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	400	72.79	29,116.00	
TOLY BREAD CO LTD-A	980	16.02	15,699.60	
TONGWEI CO LTD-A	4,900	41.99	205,751.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-A	900	110.96	99,864.00	
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	7,060	18.20	128,492.00	
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	4,400	183.27	806,388.00	
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	2,200	44.48	97,856.00	
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	1,100	16.02	17,622.00	
BY-HEALTH CO LTD-A	1,300	21.93	28,509.00	
PROYA COSMETICS CO LTD-A	140	162.18	22,705.20	
YUNNAN BOTANEE BIO-TECHNOL-A	400	136.21	54,484.00	
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	8,229	28.93	238,064.97	
CHINA MEHECO CO LTD -A	2,240	16.43	36,803.20	

GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	1,400	32.15	45,010.00
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	700	71.30	49,910.00
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	1,740	44.30	77,082.00
IRAY TECHNOLOGY CO LTD-A	200	429.86	85,972.00
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	1,180	32.24	38,043.20
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A	500	36.39	18,195.00
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	200	14.52	2,904.00
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	1,900	24.35	46,265.00
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	480	5.52	2,649.60
OVCTEK CHINA INC-A	920	33.22	30,562.40
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	4,400	19.53	85,932.00
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	1,400	311.44	436,016.00
SHENZHEN NEW INDUSTRIES BI-A	1,000	47.32	47,320.00
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	300	139.77	41,931.00
APELOA PHARMACEUTICAL CO-A	900	21.48	19,332.00
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	280	136.12	38,113.60
BEIJING TONGRENTANG CO-A	1,200	48.91	58,692.00
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	725	144.48	104,748.00
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	300	49.99	14,997.00
BGI GENOMICS CO LTD-A	300	57.87	17,361.00
BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY COR-A	400	125.56	50,224.00
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	400	178.27	71,308.00
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	1,500	52.08	78,120.00
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	2,000	86.77	173,540.00
DAAN GENE CO LTD-A	960	17.20	16,512.00
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	100	38.50	3,850.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	300	91.50	27,450.00
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	1,780	20.71	36,863.80
HUBEI JUMPCAN PHARMACEUT-A	1,300	30.65	39,845.00
HUMANWELL HEALTHCARE GROUP-A	1,400	23.19	32,466.00
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	300	528.93	158,679.00
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	7,916	38.82	307,299.12
JOINCARE PHARMACEUTICAL GR-A	1,600	12.08	19,328.00
JOINN LABORATORIES CHINA C-A	784	59.47	46,624.48
LIVZON PHARMACEUTICAL GROU-A	500	36.22	18,110.00

NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	1,098	17.33	19,028.34
PHARMARON BEIJING CO LTD-A	1,050	64.41	67,630.50
PORTON PHARMA SOLUTIONS L-A	800	41.80	33,440.00
SHANDONG BUCHANG PHARMACEU-A	260	26.09	6,783.40
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	1,900	37.00	70,300.00
SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCE-A	835	61.82	51,619.70
SHANGHAI MEDICILON INC-A	280	210.18	58,850.40
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	10,500	5.79	60,795.00
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	960	34.79	33,398.40
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	1,700	32.16	54,672.00
SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A	2,600	50.88	132,288.00
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	2,400	23.47	56,328.00
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	1,500	40.70	61,050.00
WUXI APPTec CO LTD-A	3,128	80.00	250,240.00
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	1,960	58.99	115,620.40
ZHANGZHOU PIENZEHUANG PHA-A	700	273.00	191,100.00
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	1,210	20.00	24,200.00
ZHEJIANG JIUZHOU PHARMACEU-A	1,300	39.14	50,882.00
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	2,563	19.75	50,619.25
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A	400	50.67	20,268.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	101,400	2.89	293,046.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	18,700	4.37	81,719.00
BANK OF CHANGSHA CO LTD-A	7,500	6.97	52,275.00
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	5,400	15.32	82,728.00
BANK OF CHINA LTD-A	33,600	3.16	106,176.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	49,100	4.76	233,716.00
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	5,800	13.50	78,300.00
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	14,900	7.47	111,303.00
BANK OF NANJING CO LTD -A	8,900	10.36	92,204.00
BANK OF NINGBO CO LTD -A	7,900	33.00	260,700.00
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	13,610	6.05	82,340.50
BANK OF SUZHOU CO LTD-A	5,100	7.86	40,086.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	9,200	5.60	51,520.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	56,300	3.12	175,656.00
CHINA MERCHANTS BANK-A	23,600	36.75	867,300.00

CHINA MINSHENG BANKING-A	46,000	3.57	164,220.00
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	16,900	3.08	52,052.00
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-A	8,500	3.63	30,855.00
HUAXIA BANK CO LTD-A	12,300	5.30	65,190.00
IND & COMM BK OF CHINA-A	77,400	4.30	332,820.00
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	24,100	18.00	433,800.00
PING AN BANK CO LTD-A	23,000	13.70	315,100.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	29,400	4.65	136,710.00
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	36,600	7.32	267,912.00
SHANGHAI RURAL COMMERCIAL -A	13,500	6.01	81,135.00
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A	13,900	3.68	51,152.00
BOC INTERNATIONAL CHINA CO-A	3,000	11.30	33,900.00
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	1,500	7.56	11,340.00
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	6,800	5.60	38,080.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-A	2,800	10.06	28,168.00
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	3,000	8.81	26,430.00
CHINA INTERNATIONAL CAPTAL-A	1,200	40.43	48,516.00
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	8,200	13.89	113,898.00
CITIC SECURITIES CO-A	14,500	20.64	299,280.00
CSC FINANCIAL CO LTD-A	5,000	25.65	128,250.00
DONGXING SECURITIES CO LT-A	6,200	8.28	51,336.00
EAST MONEY INFORMATION CO-A	15,844	20.58	326,069.52
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	3,200	16.06	51,392.00
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	500	5.98	2,990.00
GF SECURITIES CO LTD-A	5,900	16.36	96,524.00
GUANGZHOU YUEXIU CAPITAL H-A	4,374	6.52	28,518.48
GUOLIAN SECURITIES CO LTD-A	2,200	12.10	26,620.00
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	4,600	9.27	42,642.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	8,300	14.30	118,690.00
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	500	6.97	3,485.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	18,700	9.10	170,170.00
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	500	104.10	52,050.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	8,100	13.30	107,730.00
HUAXI SECURITIES CO LTD-A	300	8.27	2,481.00
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	6,700	6.16	41,272.00

ORIENT SECURITIES CO LTD-A	10,800	9.21	99,468.00
SEALAND SECURITIES CO LTD -A	2,500	3.50	8,750.00
SHANXI SECURITIES CO LTD-A	400	5.60	2,240.00
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	27,200	4.18	113,696.00
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	9,700	6.91	67,027.00
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	3,800	4.02	15,276.00
WESTERN SECURITIES CO LTD-A	500	6.48	3,240.00
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	6,000	10.68	64,080.00
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD-A	10,500	6.95	72,975.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	4,500	36.20	162,900.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	8,900	25.28	224,992.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	1,900	30.51	57,969.00
PICC HOLDING CO-A	15,500	5.41	83,855.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	12,700	47.60	604,520.00
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	8,000	14.62	116,960.00
CHINA VANKE CO LTD -A	12,800	20.46	261,888.00
GEMDALE CORP-A	7,200	11.84	85,248.00
HANGZHOU BINJIANG REAL EST-A	5,600	10.23	57,288.00
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	13,800	16.45	227,010.00
SHANGHAI LINGANG HOLDINGS-A	1,680	12.75	21,420.00
YOUNGOR GROUP CO-A	3,100	6.48	20,088.00
ZHEJIANG CHINA COMMODITIES-A	13,000	5.70	74,100.00
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	8,400	6.95	58,380.00
BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	600	250.17	150,102.00
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	196	14.83	2,906.68
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	900	63.21	56,889.00
DHC SOFTWARE CO LTD -A	400	6.10	2,440.00
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	3,073	39.50	121,383.50
IFLYTEK CO LTD - A	2,500	34.00	85,000.00
NAVINFO CO LTD-A	900	11.54	10,386.00
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	400	112.86	45,144.00
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	2,496	40.77	101,761.92
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	300	109.50	32,850.00
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	3,708	22.62	83,874.96
AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A	2,300	28.35	65,205.00

BEIJING YUANLIU HONGYUAN E-A	200	100.51	20,102.00
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	41,400	3.61	149,454.00
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	1,800	30.00	54,000.00
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	2,600	11.03	28,678.00
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-A	11,000	4.79	52,690.00
CHINA ZHENHUA GROUP SCIENC-A	500	110.00	55,000.00
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	13,500	9.46	127,710.00
GOERTEK INC -A	3,300	17.61	58,113.00
GRG BANKING EQUIPMENT CO -A	2,200	9.85	21,670.00
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	6,900	4.82	33,258.00
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICAT-A	300	8.49	2,547.00
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	500	62.01	31,005.00
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO-A	3,700	15.20	56,240.00
HUAGONG TECH CO LTD-A	1,000	17.69	17,690.00
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	600	22.55	13,530.00
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	4,600	10.91	50,186.00
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	8,333	31.95	266,239.35
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	576	112.59	64,851.84
NINESTAR CORP-A	1,800	51.44	92,592.00
OFILM GROUP CO LTD-A	400	5.12	2,048.00
RAYTRON TECHNOLOGY CO LTD-A	700	41.33	28,931.00
SHANGHAI FRIENDESS ELECTRO-A	280	221.39	61,989.20
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	2,300	14.81	34,063.00
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	780	76.15	59,397.00
SHENZHEN SUNLORD ELECTRONI-A	800	26.50	21,200.00
SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	1,000	82.33	82,330.00
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	700	24.50	17,150.00
TIANJIN712 COMMUNICATION &-A	700	36.15	25,305.00
TIANMA MICROELECTRONICS-A	2,400	9.14	21,936.00
UNISPLENDOR CORP LTD-A	1,876	19.70	36,957.20
WESTONE INFORMATION INDUST-A	1,300	34.03	44,239.00
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	1,200	56.20	67,440.00
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	2,665	11.60	30,914.00
WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHA-A	1,760	12.25	21,560.00
XIAMEN FARATRONIC CO LTD-A	400	155.30	62,120.00

YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	900	62.81	56,529.00
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	2,400	12.54	30,096.00
ZHEJIANG SUPCON TECHNOLOGY-A	600	89.93	53,958.00
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	500	28.18	14,090.00
ZHUZHOU HONGDA ELECTRONICS-A	700	45.06	31,542.00
ZTE CORP-A	3,800	26.51	100,738.00
CHINA UNITED NETWORK-A	46,500	4.95	230,175.00
CECEP SOLAR ENERGY CO LT-A	6,500	7.38	47,970.00
CECEP WIND POWER CORP-A	7,900	4.03	31,837.00
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	23,000	6.26	143,980.00
CHINA THREE GORGES RENEWAB-A	30,600	5.68	173,808.00
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	26,100	20.92	546,012.00
DATANG INTL POWER GEN CO-A	20,000	2.89	57,800.00
ENN NATURAL GAS CO LTD-A	1,900	17.95	34,105.00
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	31,000	4.09	126,790.00
HUADIAN POWER INTL CORP-A	12,500	5.36	67,000.00
HUANENG POWER INTL INC-A	11,300	7.01	79,213.00
SHANGHAI ELECTRIC POWER CO-A	7,100	9.80	69,580.00
SHENZHEN ENERGY GROUP CO L-A	600	6.08	3,648.00
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A	5,200	11.59	60,268.00
3PEAK INC-A	200	337.99	67,598.00
ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	943	107.00	100,901.00
AMLOGIC SHANGHAI INC-A	600	79.67	47,802.00
CHINA RESOURCES MICROELECT-A	1,200	54.86	65,832.00
FLAT GLASS GROUP CO LTD-A	2,300	34.50	79,350.00
GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A	4,300	3.17	13,631.00
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR I-A	756	99.36	75,116.16
HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	1,680	63.52	106,713.60
HANGZHOU LION ELECTRONICS -A	1,000	48.95	48,950.00
HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	2,000	36.32	72,640.00
INGENIC SEMICONDUCTOR CO -A	400	78.29	31,316.00
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	3,080	57.37	176,699.60
JCET GROUP CO LTD-A	1,900	24.22	46,018.00
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	8,736	46.30	404,476.80
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A	1,514	68.50	103,709.00

	NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	600	244.81	146,886.00	
	SG MICRO CORP-A	375	174.80	65,550.00	
	SHANGHAI FUDAN MICROELE-DO-A	800	77.00	61,600.00	
	SHENZHEN SC NEW ENERGY TEC-A	300	118.14	35,442.00	
	STARPOWER SEMICONDUCTOR LT-A	200	335.32	67,064.00	
	TCL ZHONGHUAN RENEWABLE EN-A	4,300	40.30	173,290.00	
	TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	1,900	8.76	16,644.00	
	TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	800	16.50	13,200.00	
	TRINA SOLAR CO LTD-A	2,200	58.25	128,150.00	
	UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	1,119	135.80	151,960.20	
	WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	1,485	84.70	125,779.50	
	YANGZHOU YANGJIE ELECTRONI-A	700	55.48	38,836.00	
	ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	1,800	70.78	127,404.00	
	オフショア人民元 小計	2,680,038		44,592,804.68 (874,259,772)	
サウジアラビア リアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	7,849	10.52	82,571.48	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	47,034	30.85	1,450,998.90	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	2,256	39.55	89,224.80	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	8,294	11.24	93,224.56	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	4,015	131.00	525,965.00	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	6,681	33.05	220,807.05	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	16,192	68.50	1,109,152.00	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	17,543	81.30	1,426,245.90	
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	6,906	19.98	137,981.88	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	13,830	11.80	163,194.00	
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	4,583	39.80	182,403.40	
	SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	714	186.00	132,804.00	
	JARIR MARKETING CO	1,096	155.80	170,756.80	
	NAHDI MEDICAL CO	871	166.00	144,586.00	
	ALMARAI CO	4,633	52.60	243,695.80	
	SAVOLA	4,558	26.85	122,382.30	
	DALLAH HEALTHCARE CO	835	154.60	129,091.00	
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	1,665	214.80	357,642.00	
	MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	955	183.00	174,765.00	
	AL RAJHI BANK	37,883	74.30	2,814,706.90	

ALINMA BANK	18,395	30.05	552,769.75	
ARAB NATIONAL BANK	11,172	29.95	334,601.40	
BANK AL-JAZIRA	7,789	19.46	151,573.94	
BANK ALBILAD	9,170	46.25	424,112.50	
BANQUE SAUDI FRANSI	11,056	36.90	407,966.40	
RIYAD BANK	25,367	31.05	787,645.35	
SAUDI BRITISH BANK	17,357	36.45	632,662.65	
SAUDI INVESTMENT BANK/THE	9,393	17.66	165,880.38	
THE SAUDI NATIONAL BANK	42,526	47.85	2,034,869.10	
SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING	911	152.20	138,654.20	
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	1,168	169.00	197,392.00	
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	10,941	13.02	142,451.82	
EMAAR ECONOMIC CITY	8,295	8.08	67,023.60	
ARABIAN INTERNET & COMMUNICA	542	233.80	126,719.60	
ELM CO	483	318.80	153,980.40	
ETIHAD ETISALAT CO	7,054	33.55	236,661.70	
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	9,085	10.12	91,940.20	
SAUDI TELECOM CO	28,199	36.70	1,034,903.30	
ACWA POWER CO	1,553	138.00	214,314.00	
SAUDI ELECTRICITY CO	15,540	23.02	357,730.80	
サウジアラビアリアル 小計	424,389		18,026,051.86 (656,689,069)	
合 計	116,488,302		16,919,249,108 (16,919,249,108)	

(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	1,409,477.00	
		OPERADORA DE SITES MEX- A-1	33,000	671,880.00	
		メキシコペソ 小計	91,900	2,081,357.00 (14,394,873)	
	南アフリカランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	63,261	876,797.46	

	南アフリカランド 小計	63,261	876,797.46 (6,891,628)
	合計		21,286,501 (21,286,501)

(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 45銘柄	100.0%		3.4%
メキシコペソ	株式 21銘柄	96.3%		2.2%
	投資証券 2銘柄		3.7%	0.1%
ブラジルリアル	株式 49銘柄	100.0%		5.1%
チリペソ	株式 12銘柄	100.0%		0.6%
コロンビアペソ	株式 3銘柄	100.0%		0.1%
ユーロ	株式 9銘柄	100.0%		0.3%
英ポンド	株式 1銘柄			
トルコリラ	株式 15銘柄	100.0%		0.6%
チェココルナ	株式 3銘柄	100.0%		0.1%
ハンガリーフォリント	株式 3銘柄	100.0%		0.2%
ポーランドズロチ	株式 14銘柄	100.0%		0.7%
ロシアルーブル	株式 12銘柄			
香港ドル	株式 189銘柄	100.0%		24.1%
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%		2.1%
フィリピンペソ	株式 17銘柄	100.0%		0.7%
インドネシアルピア	株式 22銘柄	100.0%		1.9%
韓国ウォン	株式 102銘柄	100.0%		11.5%
新台湾ドル	株式 88銘柄	100.0%		14.3%
インドルピー	株式 113銘柄	100.0%		14.6%
カタールリアル	株式 12銘柄	100.0%		1.0%
南アフリカランド	株式 36銘柄	98.9%		3.6%
	投資証券 1銘柄		1.1%	0.0%

アラブディルハム	株式	11銘柄	100.0%		1.3%
クウェートディナール	株式	7銘柄	100.0%		0.9%
オフショア人民元	株式	492銘柄	100.0%		5.2%
サウジアラビアリアル	株式	40銘柄	100.0%		3.9%

（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12月12日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	162,741,039
投資証券	30,692,845,000
未収配当金	182,836,366
前払金	431,500
差入委託証拠金	18,645,000
流動資産合計	31,057,498,905
資産合計	31,057,498,905
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	449,650
未払解約金	3,700,000
未払利息	441
流動負債合計	4,150,091
負債合計	4,150,091
純資産の部	
元本等	
元本	21,272,724,570
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	9,780,624,244
元本等合計	31,053,348,814
純資産合計	31,053,348,814

2022年12月12日現在

負債純資産合計

31,057,498,905

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12月12日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年12月11日
期首元本額	18,682,018,215円
期中追加設定元本額	18,925,965,275円
期中一部解約元本額	16,335,258,920円
期末元本額	21,272,724,570円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	350,272,007円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	469,436,331円
りそなラップ型ファンド(成長型)	644,525,919円
DCりそな グローバルバランス	8,524,688円
つみたてバランスファンド	1,882,346,478円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	238,540,528円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	150,241,609円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	102,382,859円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	47,904,872円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	31,244,609円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	17,265,748円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	33,676,202円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	90,837,886円
九州SDGs・グローバルバランス	43,301,546円
りそな国内リートインデックス(ラップ専用)	356,044,569円

ラップ型ファンド・プラスESG(安定型)	371,737円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定成長型)	4,138,604円
ラップ型ファンド・プラスESG(成長型)	5,981,542円
FWりそな国内リートインデックスオープン	5,130,085,417円
FWりそな国内リートインデックスファンド	4,664,257,427円
Smart-i Jリートインデックス	2,960,063,736円
Smart-i 8資産バランス 安定型	48,598,124円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	153,036,409円
Smart-i 8資産バランス 成長型	182,021,505円
J-REITインデックスファンド(適格機関投資家専用)	3,212,069,049円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	82,545,418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)	699,416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)	3,375,185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)	24,380,991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)	20,424,792円
J-REITインデックスファンド202102(適格機関投資家専用)	139,356,828円
りそなDAAファンド202205(適格機関投資家専用)	174,772,539円
2. 計算日における受益権の総数	21,272,724,570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	1.4598円
(10,000口当たり純資産額)	(14,598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12月12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12月12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12月12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12月12日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
投資証券		128,525,072
合計		128,525,072

(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12月12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	315,682,150	-	315,232,500	449,650
合計		315,682,150	-	315,232,500	449,650

(注) 時価の算定方法

先物取引

国内先物取引について

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	576	68,832,000	
	サンケイリアルエステート投資法人	908	83,536,000	
	S O S i L A 物流リート投資法人	1,411	196,411,200	
	東海道リート投資法人	344	41,624,000	
	日本アコモデーションファンド投資法人	979	607,959,000	
	森ヒルズリート投資法人	3,334	531,439,600	
	産業ファンド投資法人	4,238	665,366,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	2,835	973,822,500	

ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	2,079	440,124,300	
アクティビア・プロパティーズ投資法人	1,497	620,506,500	
G L P 投資法人	9,152	1,408,492,800	
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,319	410,209,000	
日本プロロジスリート投資法人	4,646	1,528,534,000	
星野リゾート・リート投資法人	496	344,720,000	
O n e リート投資法人	495	124,938,000	
イオンリート投資法人	3,139	487,800,600	
ヒューリックリート投資法人	2,653	453,397,700	
日本リート投資法人	921	335,704,500	
積水ハウス・リート投資法人	8,521	665,490,100	
トーセイ・リート投資法人	629	83,468,300	
ケネディクス商業リート投資法人	1,233	321,566,400	
ヘルスケア&メディカル投資法人	699	126,449,100	
サムティ・レジデンシャル投資法人	737	87,850,400	
野村不動産マスターファンド投資法人	9,170	1,525,888,000	
いちごホテルリート投資法人	470	49,397,000	
ラサールロジポート投資法人	3,471	563,343,300	
スターアジア不動産投資法人	3,540	192,576,000	
マリモ地方創生リート投資法人	354	48,108,600	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	1,120	558,320,000	
大江戸温泉リート投資法人	458	29,312,000	
投資法人みらい	3,445	160,881,500	
森トラスト・ホテルリート投資法人	665	88,112,500	
三菱地所物流リート投資法人	974	425,638,000	
C R E ロジスティクスファンド投資法人	1,098	222,235,200	
ザイマックス・リート投資法人	460	55,108,000	
タカラレーベン不動産投資法人	1,242	123,827,400	
アドバンス・ロジスティクス投資法人	1,236	181,939,200	
日本ビルファンド投資法人	3,308	2,034,420,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	2,836	1,693,092,000	
日本都市ファンド投資法人	14,307	1,492,220,100	
オリックス不動産投資法人	5,650	1,062,765,000	
日本プライムリアルティ投資法人	1,939	744,576,000	
N T T 都市開発リート投資法人	2,726	385,729,000	

東急リアル・エステート投資法人	1,901	404,722,900	
グローバル・ワン不動産投資法人	2,087	224,352,500	
ユナイテッド・アーバン投資法人	6,343	943,838,400	
森トラスト総合リート投資法人	2,027	290,671,800	
インヴィンシブル投資法人	12,481	627,794,300	
フロンティア不動産投資法人	1,052	545,988,000	
平和不動産リート投資法人	1,938	301,165,200	
日本ロジスティクスファンド投資法人	1,912	611,840,000	
福岡リート投資法人	1,467	253,791,000	
ケネディクス・オフィス投資法人	1,650	536,250,000	
いちごオフィスリート投資法人	2,324	198,934,400	
大和証券オフィス投資法人	593	386,636,000	
阪急阪神リート投資法人	1,281	194,712,000	
スタートアップリート投資法人	492	113,406,000	
大和ハウスリート投資法人	4,274	1,280,063,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	9,144	714,146,400	
大和証券リビング投資法人	3,929	465,586,500	
ジャパンエクセレント投資法人	2,601	353,215,800	
合計	168,806	30,692,845,000	

(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12月12日現在

資産の部	
流動資産	
預金	237,949,843
コール・ローン	27,369,796
株式	306,637,872
投資証券	33,294,122,279
未収入金	1,775,403
未収配当金	70,503,953
流動資産合計	33,938,359,146
資産合計	33,938,359,146
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	16,841
未払解約金	10,113,000
未払利息	74
流動負債合計	10,129,915
負債合計	10,129,915
純資産の部	
元本等	
元本	23,974,718,974
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	9,953,510,257
元本等合計	33,928,229,231
純資産合計	33,928,229,231
負債純資産合計	33,938,359,146

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	外貨建取引等の処理基準

なる事項	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12月12日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年12月11日
期首元本額	18,523,702,477円
期中追加設定元本額	20,033,982,333円
期中一部解約元本額	14,582,965,836円
期末元本額	23,974,718,974円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	1,813,666,886円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	2,119,479,310円
りそなラップ型ファンド(成長型)	2,118,496,937円
DCりそな グローバルバランス	45,409,222円
つみたてバランスファンド	950,540,815円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	485,808,048円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	318,454,707円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	214,441,598円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	98,900,506円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	64,173,665円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	36,019,409円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	70,175,026円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	178,624,485円
九州SDGs・グローバルバランス	85,206,151円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定型)	1,890,814円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定成長型)	13,599,402円
ラップ型ファンド・プラスESG(成長型)	21,661,815円
FWりそな先進国リートインデックスオープン	6,309,504,632円
FWりそな先進国リートインデックスファンド	5,279,706,396円
Smart-i 先進国リートインデックス	2,510,723,286円
Smart-i 8資産バランス 安定型	102,061,545円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	317,655,208円
Smart-i 8資産バランス 成長型	385,222,936円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	77,500,000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)	3,621,537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)	8,445,820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)	88,380,206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)	91,258,852円
りそなDAAファンド202205(適格機関投資家専用)	164,089,760円

2. 計算日における受益権の総数	23,974,718,974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	1.4152円
(10,000口当たり純資産額)	(14,152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12月12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12月12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る場合、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12月12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12月12日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式		15,858,435
投資証券		4,034,503,335
合計		4,050,361,770

(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12月12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	15,056,327	-	15,039,486	16,841
	米ドル	15,056,327	-	15,039,486	16,841
	合計	15,056,327	-	15,039,486	16,841

(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	51,735	29.15	1,508,075.25	
	BROADSTONE NET LEASE INC-A	33,451	17.27	577,698.77	
米ドル 小計		85,186		2,085,774.02 (285,250,454)	
オーストラリアドル	CENTURIA CAPITAL GROUP	131,543	1.76	231,515.68	
オーストラリアドル 小計		131,543		231,515.68 (21,387,418)	
合計		216,729		306,637,872 (306,637,872)	

(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	18,153	266,849.10	
		AGREE REALTY CORP	15,379	1,102,366.72	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	14,000	274,820.00	
		ALEXANDER'S INC	402	93,983.58	

ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	28,546	4,260,775.96	
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	1,626	30,926.52	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	9,837	267,172.92	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	58,184	1,911,926.24	
APARTMENT INCOME REIT CO	29,692	1,095,931.72	
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	29,619	237,544.38	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	41,187	692,353.47	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	12,747	152,199.18	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	6,888	40,776.96	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	26,865	4,555,766.70	
BLUEROCK HOMES TRUST INC	607	14,179.52	
BOSTON PROPERTIES INC	27,466	1,829,510.26	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	10,664	41,163.04	
BRANDYWINE REALTY TRUST	33,841	213,536.71	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	57,694	1,300,422.76	
BRT APARTMENTS CORP	1,983	39,897.96	
CAMDEN PROPERTY TRUST	20,480	2,375,680.00	
CARETRUST REIT INC	18,227	364,904.54	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	4,482	119,714.22	
CENTERSPACE	2,838	185,945.76	
CHATHAM LODGING TRUST	8,860	117,926.60	
CITY OFFICE REIT INC	7,609	71,372.42	
CLIPPER REALTY INC	2,188	16,169.32	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	4,418	154,895.08	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	21,395	551,563.10	
COUSINS PROPERTIES INC	29,223	729,113.85	
CTO REALTY GROWTH INC	3,129	59,044.23	
CUBESMART	43,143	1,853,423.28	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	39,748	361,309.32	
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	53,000	32,595.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	55,213	5,905,582.48	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	38,904	29,905.50	
DOUGLAS EMMETT INC	34,101	543,228.93	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	82,000		
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES	17,118	261,563.04	

INC			
EASTGROUP PROPERTIES INC	8,368	1,293,023.36	
ELME COMMUNITIES	16,493	316,170.81	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	24,969	169,539.51	
EPR PROPERTIES	14,495	591,106.10	
EQUINIX INC	17,491	11,820,417.80	
EQUITY COMMONWEALTH	21,580	560,432.60	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	33,631	2,179,625.11	
EQUITY RESIDENTIAL	65,041	4,080,021.93	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	27,277	634,735.79	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	12,518	2,688,741.22	
EXTRA SPACE STORAGE INC	25,722	4,027,550.76	
FARMLAND PARTNERS INC	9,217	118,899.30	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	14,014	1,508,607.10	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	25,368	1,239,987.84	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	15,777	424,716.84	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	15,600	46,020.00	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	49,124	2,559,360.40	
GETTY REALTY CORP	8,278	275,326.28	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	7,573	144,341.38	
GLADSTONE LAND CORP	6,161	117,613.49	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	10,900	109,218.00	
GLOBAL NET LEASE INC	20,186	272,712.86	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	73,254	1,442,371.26	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	103,745	2,629,935.75	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	5,354	50,970.08	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	20,401	584,488.65	
HOST HOTELS & RESORTS INC	137,539	2,433,064.91	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	24,314	250,434.20	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	42,772	763,052.48	
INDUS REALTY TRUST INC	782	50,071.46	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	11,286	41,081.04	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	5,375	603,075.00	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	12,668	308,339.12	
INVITATION HOMES INC	111,427	3,519,978.93	
	55,880	3,040,430.80	

IRON MOUNTAIN INC			
ISTAR INC	16,058	118,829.20	
JBG SMITH PROPERTIES	19,014	377,047.62	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	159,300	86,818.50	
KILROY REALTY CORP	20,336	816,287.04	
KIMCO REALTY CORP	118,907	2,581,470.97	
KITE REALTY GROUP TRUST	42,234	922,390.56	
LIFE STORAGE INC	16,220	1,739,595.00	
LTC PROPERTIES INC	7,613	293,861.80	
LXP INDUSTRIAL TRUST	54,093	572,303.94	
MACERICH CO/THE	41,509	517,202.14	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	335,500	120,780.00	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	115,303	1,360,575.40	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	22,183	3,585,660.12	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	34,084	1,571,272.40	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	16,436	632,292.92	
NATL HEALTH INVESTORS INC	8,514	482,743.80	
NECESSITY RETAIL REIT INC/TH	24,802	163,941.22	
NETSTREIT CORP	9,343	180,787.05	
NEXPOINT RESIDENTIAL	4,219	196,056.93	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	9,235	132,614.60	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	45,070	1,343,536.70	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	3,119	73,296.50	
ORION OFFICE REIT INC	10,993	100,146.23	
PARAMOUNT GROUP INC	33,360	194,155.20	
PARK HOTELS & RESORTS INC	43,600	537,152.00	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	25,206	389,936.82	
PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	22,521	733,734.18	
PHYSICIANS REALTY TRUST	43,710	650,841.90	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	23,737	219,092.51	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	7,075	141,924.50	
POSTAL REALTY TRUST INC- A	2,739	41,221.95	
PRIME US REIT	114,900	53,428.50	
PROLOGIS INC	177,258	20,618,650.56	
PUBLIC STORAGE	30,339	9,028,886.40	

REALTY INCOME CORP	118,624	7,645,316.80	
REGENCY CENTERS CORP	29,623	1,947,119.79	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	23,381	365,445.03	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	32,853	1,790,159.97	
RLJ LODGING TRUST	30,666	352,965.66	
RPT REALTY	16,114	175,159.18	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	10,647	946,411.83	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	44,659	562,703.40	
SAFEHOLD INC	4,674	129,516.54	
SAUL CENTERS INC	2,332	96,474.84	
SERVICE PROPERTIES TRUST	32,383	254,530.38	
SIMON PROPERTY GROUP INC	62,879	7,341,123.25	
SITE CENTERS CORP	35,408	469,864.16	
SL GREEN REALTY CORP	12,253	436,329.33	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	26,265	1,084,481.85	
STAG INDUSTRIAL INC	34,425	1,140,844.50	
STORE CAPITAL CORP	51,134	1,635,265.32	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	20,164	159,295.60	
SUN COMMUNITIES INC	23,700	3,372,747.00	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	40,651	420,331.34	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	20,226	375,799.08	
TERRENO REALTY CORP	12,773	728,955.11	
UDR INC	58,719	2,342,300.91	
UMH PROPERTIES INC	9,621	163,364.58	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	2,501	128,451.36	
URBAN EDGE PROPERTIES	22,059	333,311.49	
URSTADT BIDDLE - CLASS A	5,560	102,526.40	
VENTAS INC	76,825	3,490,159.75	
VERIS RESIDENTIAL INC	15,608	250,508.40	
VICI PROPERTIES INC	185,018	6,277,660.74	
VORNADO REALTY TRUST	30,193	666,963.37	
WELLTOWER INC	89,017	5,934,763.39	
WHITESTONE REIT	8,812	85,476.40	
WP CAREY INC	39,894	3,145,641.90	
XENIA HOTELS & RESORTS INC	21,549	327,329.31	

	米ドル 小計	4,875,776	188,309,335.65 (25,753,184,743)
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	12,056	320,569.04
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	10,001	92,909.29
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	2,822	31,916.82
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	4,259	214,611.01
	BSR REAL ESTATE INVESTMENT T	3,438	61,884.00
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	5,776	21,486.72
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	16,201	697,129.03
	CHOICE PROPERTIES REIT	30,660	449,475.60
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	10,132	162,517.28
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	10,234	157,398.92
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	24,736	297,574.08
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	4,430	66,582.90
	EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	7,098	22,500.66
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	20,937	351,741.60
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	6,106	467,597.48
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	26,154	319,078.80
	INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	2,543	10,655.17
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	13,658	170,861.58
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	10,996	182,203.72
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	2,991	43,070.40
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	3,128	49,735.20
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	4,813	47,744.96
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	23,768	234,827.84
	PRIMARIS REIT	9,796	145,470.60
	PRO REAL ESTATE INVESTMENT T	4,341	25,742.13
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	29,162	609,485.80
SLATE GROCERY REIT	5,585	89,304.15	
SLATE OFFICE REIT	6,335	28,000.70	
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	13,556	367,503.16	
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	18,030	408,559.80	
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	7,115	41,622.75	
	カナダドル 小計	350,857	6,189,761.19 (619,595,095)

ユーロ	AEDIFICA	7,711	599,144.70	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	2,209	16,379.73	
	ALTAREA	852	114,338.40	
	CARE PROPERTY INVEST	5,604	84,172.08	
	CARMILA	10,798	150,092.20	
	COFINIMMO	5,727	491,662.95	
	COVIVIO	8,972	509,609.60	
	CROMWELL REIT EUR	70,240	110,276.80	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	8,022	184,666.44	
	GECINA SA	10,453	1,008,714.50	
	HAMBORNER REIT AG	12,600	89,964.00	
	ICADE	6,228	252,483.12	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	8,670	28,134.15	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	56,608	339,364.96	
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	4,708	93,500.88	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	85,591	92,095.91	
	KLEPIERRE	37,512	839,893.68	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	10,240	45,056.00	
	MERCIALYS	14,780	142,257.50	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	64,691	585,453.55	
	MONTEA NV	2,294	149,110.00	
	NSI NV	3,649	86,846.20	
	RETAIL ESTATES	2,074	126,721.40	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	20,539	1,078,092.11	
VASTNED RETAIL NV	3,612	75,671.40		
WAREHOUSES DE PAUW SCA	27,281	730,585.18		
WERELDHAVE NV	8,005	103,024.35		
XIOR STUDENT HOUSING NV	4,064	112,572.80		
	ユーロ 小計	503,734	8,239,884.59	(1,184,565,808)
英ポンド	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	66,618	37,639.17	
	AEW UK REIT PLC	25,892	25,063.45	
	ASSURA PLC	576,294	312,639.49	
	BALANCED COMM PROPERTY TRUST	151,988	143,324.68	
	BIG YELLOW GROUP PLC	33,424	376,020.00	
	BRITISH LAND CO PLC	181,200	718,639.20	

	CAPITAL & COUNTIES PROPRTIE	167,463	170,142.40
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	124,345	76,596.52
	CUSTODIAN PROPERTY INCOME REIT PLC	83,137	75,238.98
	DERWENT LONDON PLC	21,821	513,229.92
	EDISTON PROPERTY INVESTMENT	31,999	19,391.39
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	117,232	95,895.77
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	48,404	241,923.19
	HAMMERSON PLC	671,443	160,004.86
	HOME REIT PLC	147,401	68,394.06
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	73,393	74,860.86
	INTU PROPERTIES PLC	117,549	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	144,974	908,407.08
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	190,663	336,710.85
	LXI REIT PLC	332,786	386,697.33
	NEWRIVER REIT PLC	48,868	38,361.38
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	110,489	91,595.38
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	259,822	288,142.59
	PRS REIT PLC/THE	106,747	91,375.43
	REGIONAL REIT LTD	74,637	43,214.82
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	39,723	372,800.35
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	97,686	43,470.27
	SEGRE PLC	232,359	1,865,378.05
	SHAFTESBURY PLC	55,842	194,218.47
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	235,162	241,041.05
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	74,108	51,134.52
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	360,030	525,283.77
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	166,479	96,890.77
	UNITE GROUP PLC	77,252	716,898.56
	URBAN LOGISTICS REIT PLC	88,817	125,676.05
	WAREHOUSE REIT PLC	81,986	89,364.74
	WORKSPACE GROUP PLC	26,649	110,806.54
	英bond 小計	5,444,682	9,726,471.94 (1,626,266,108)
オーストラリアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	78,033	210,689.10
	ARENA REIT	65,345	246,350.65

	BWP TRUST	92,517	372,843.51	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	105,985	333,852.75	
	CENTURIA OFFICE REIT	78,185	126,268.77	
	CHARTER HALL GROUP	91,350	1,157,404.50	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	125,053	557,736.38	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	99,171	395,692.29	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	63,568	207,231.68	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	273,456	187,317.36	
	DEXUS INDUSTRIA REIT	36,946	111,207.46	
	DEXUS/AU	207,897	1,665,254.97	
	GDI PROPERTY GROUP	81,966	63,523.65	
	GOODMAN GROUP	326,541	5,936,515.38	
	GPT GROUP	369,502	1,603,638.68	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	56,926	178,178.38	
	HEALTHCO REIT	42,260	72,053.30	
	HMC CAPITAL LTD	37,664	169,488.00	
	HOMEKO DAILY NEEDS REIT	299,624	395,503.68	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	38,659	137,626.04	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	72,023	316,901.20	
	MIRVAC GROUP	761,059	1,674,329.80	
	NATIONAL STORAGE REIT	203,621	478,509.35	
	RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE	50,842	37,877.29	
	REGION RE LTD	210,451	566,113.19	
	RURAL FUNDS GROUP	74,150	181,667.50	
	SCENTRE GROUP	999,045	2,877,249.60	
	STOCKLAND	460,331	1,781,480.97	
	VICINITY CENTRES	746,699	1,474,730.52	
	WAYPOINT REIT	139,336	387,354.08	
	オーストラリアドル 小計	6,288,205	23,904,590.03	(2,208,306,026)
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	165,709	198,850.80	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	202,736	419,663.52	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	297,491	278,154.08	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	267,913	356,324.29	
	STRIDE STAPLED GROUP	96,336	136,797.12	

	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	90,322	213,159.92
	ニュージーランドドル 小計	1,120,507	1,602,949.73 (139,969,570)
香港ドル	CHAMPION REIT	362,000	1,060,660.00
	FORTUNE REIT	286,000	1,704,560.00
	LINK REIT	406,200	22,544,100.00
	PROSPERITY REIT	204,000	401,880.00
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	174,000	546,360.00
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	450,000	931,500.00
	香港ドル 小計	1,882,200	27,189,060.00 (477,439,893)
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LT	105,900	127,080.00
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	647,000	1,779,250.00
	CAPITALAND ASCOTT TRUST	374,896	369,272.56
	CAPITALAND CHINA TRUST	220,200	251,028.00
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	971,232	1,961,888.64
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	161,400	196,908.00
	DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	87,800	55,314.00
	EC WORLD REIT	50,000	22,250.00
	ESR-LOGOS REIT	1,060,150	381,654.00
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	221,100	134,871.00
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	199,000	49,750.00
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	202,800	411,684.00
	FRASERS LOGISTICS & COMMERC I	550,179	627,204.06
	KEPPEL DC REIT	251,000	474,390.00
	KEPPEL REIT	376,200	338,580.00
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	371,600	267,552.00
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	384,100	848,861.00
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	620,800	993,280.00
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA	438,700	741,403.00
	OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	498,600	177,003.00
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	72,500	275,500.00
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	102,900	77,175.00
	SPH REIT	205,400	182,806.00
STARHILL GLOBAL REIT	288,000	154,080.00	
SUNTEC REIT	436,900	616,029.00	

	シンガポールドル 小計	8,898,357	11,514,813.26 (1,162,305,250)	
韓国ウォン	D&D PLATFORM REIT CO LTD	8,140	28,205,100.00	
	E KOCREF CR-REIT CO LTD	3,951	21,335,400.00	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	28,989	112,332,375.00	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	7,910	36,227,800.00	
	JR REIT XXVII	31,820	139,848,900.00	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	8,199	40,708,035.00	
	LOTTE REIT CO LTD	21,452	85,915,260.00	
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	18,410	75,757,150.00	
	NH ALL-ONE REIT CO LTD	4,876	15,920,140.00	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	12,006	80,680,320.00	
	SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LT	4,632	17,601,600.00	
	SK REITS CO LTD	12,904	67,100,800.00	
		韓国ウォン 小計	163,289	721,632,880.00 (75,482,799)
イスラエルシュケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	127,380	213,488.88	
	REIT 1 LTD	34,475	605,036.25	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	42,849	359,845.90	
	イスラエルシュケル 小計	204,704	1,178,371.03 (47,006,987)	
	合計		33,294,122,279 (33,294,122,279)	

(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 143銘柄		98.9%	76.7%
カナダドル	投資証券 31銘柄		100.0%	1.8%
ユーロ	投資証券 28銘柄		100.0%	3.5%

英ポンド	投資証券	37銘柄		100.0%	4.8%
オーストラリアドル	株式	1銘柄	1.0%		0.1%
	投資証券	30銘柄		99.0%	6.7%
ニュージーランドドル	投資証券	6銘柄		100.0%	0.4%
香港ドル	投資証券	6銘柄		100.0%	1.4%
シンガポールドル	投資証券	25銘柄		100.0%	3.5%
韓国ウォン	投資証券	12銘柄		100.0%	0.2%
イスラエルシェケル	投資証券	3銘柄		100.0%	0.1%

(注) 時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2022年12月30日現在です。

【FWりそな国内債券インデックスファンド】

【純資産額計算書】

資産総額	104,088,514,771円
負債総額	101,945,109円
純資産総額（ - ）	103,986,569,662円
発行済口数	109,575,442,290口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9490円

【FWりそな国内株式インデックスファンド】

【純資産額計算書】

資産総額	24,382,253,823円
負債総額	28,436,462円
純資産総額（ - ）	24,353,817,361円
発行済口数	17,804,809,886口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3678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）】

【純資産額計算書】

資産総額	33,263,452,884円
負債総額	31,013,780円
純資産総額（ - ）	33,232,439,104円
発行済口数	30,634,824,125口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0848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）】

【純資産額計算書】

資産総額	157,442,474,326円
負債総額	134,184,790円

純資産総額（ - ）	157,308,289,536円
発行済口数	178,914,219,868口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8792円

【FWりそな新興国債券インデックスファンド】

【純資産額計算書】

資産総額	4,053,259,286円
負債総額	2,701,711円
純資産総額（ - ）	4,050,557,575円
発行済口数	4,013,721,258口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0092円

【FWりそな先進国株式インデックスファンド】

【純資産額計算書】

資産総額	61,928,501,515円
負債総額	51,147,349円
純資産総額（ - ）	61,877,354,166円
発行済口数	33,175,966,072口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8651円

【FWりそな新興国株式インデックスファンド】

【純資産額計算書】

資産総額	1,992,492,800円
負債総額	1,418,750円
純資産総額（ - ）	1,991,074,050円
発行済口数	1,503,973,065口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3239円

【FWりそな国内リートインデックスファンド】

【純資産額計算書】

資産総額	6,722,112,186円
------	----------------

負債総額	5,185,636円
純資産総額（ - ）	6,716,926,550円
発行済口数	5,353,529,326口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2547円

【FWりそな先進国リートインデックスファンド】

【純資産額計算書】

資産総額	7,142,914,129円
負債総額	5,564,802円
純資産総額（ - ）	7,137,349,327円
発行済口数	5,644,193,391口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2645円

（参考）

RM国内債券マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	171,892,169,488円
負債総額	2,970,587円
純資産総額（ - ）	171,889,198,901円
発行済口数	172,559,043,145口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9961円

RM国内株式マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	51,890,552,083円
負債総額	155,502,303円
純資産総額（ - ）	51,735,049,780円
発行済口数	36,393,082,961口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4216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	45,968,182,852円
負債総額	8,975,907円
純資産総額（ - ）	45,959,206,945円
発行済口数	43,515,295,337口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0562円

R M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	227,567,933,798円
負債総額	151,334,536円
純資産総額（ - ）	227,416,599,262円
発行済口数	261,563,110,552口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8695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	9,940,719,470円
負債総額	309,549円
純資産総額（ - ）	9,940,409,921円
発行済口数	8,915,949,464口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1149円

R M先進国株式マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	157,645,837,713円
負債総額	417,308,760円
純資産総額（ - ）	157,228,528,953円
発行済口数	78,314,679,367口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0077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	17,431,528,204円
負債総額	25,888,750円
純資産総額（ - ）	17,405,639,454円
発行済口数	11,447,735,177口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5204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	31,668,502,363円
負債総額	11,776,979円
純資産総額（ - ）	31,656,725,384円
発行済口数	22,089,435,693口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4331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	32,686,860,284円
負債総額	217,148,982円
純資産総額（ - ）	32,469,711,302円
発行済口数	24,134,699,484口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3454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なわないものとします。

(5) 受益権の再分割

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

(6) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第二部【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12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12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12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	137	1,482,676
単体型株式投資信託	3	15,884
単体型公社債投資信託	6	11,192
合計	146	1,509,753

3【委託会社等の経理状況】

(1) 委託会社であるりそなアセットマネジメント株式会社（以下、「当社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

また、中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

(2) 財務諸表及び中間財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

(3) 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第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、第8期事業年度に係る中間会計期間（自2022年4月1日至2022年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツにより中間監査を受けております。

(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	
	資本剰余金	利益剰余金

	資本金	資本準備金	資本剰余金 合計	その他 利益剰余金	利益剰余金 合計	株主資本 合計
				繰越利益 剰余金		
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	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) (注4)
----	--------	-----	-------------------	-------	--------------------	-----------	-------	--------------	----	----------------------

親会社 の子会社	株式会社 りそな銀行	大阪市 中央区	279,928	銀行業務 及び 信託業務	投資信託の 販売委託 投資助言 投資一任	運用受託 報酬 (注1)	4,459,201	未収運用 受託報酬	2,531,968
						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。

(1)中間貸借対照表

(単位：千円)

第8期中間会計期間 (2022年9月30日現在)		
資産の部		
流動資産		
預金		8,356,287
前払費用		217,654
未収入金		245
未収委託者報酬		948,060
未収運用受託報酬		2,829,020
未収投資助言報酬		494,028
流動資産計		12,845,296
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	9,499
器具備品	1	21,413
有形固定資産計		30,912
無形固定資産		
ソフトウェア		13,217
無形固定資産計		13,217
投資その他の資産		
投資有価証券		35,910
繰延税金資産		105,862
投資その他の資産計		141,772

固定資産計	185,902
資産合計	13,031,199

(単位：千円)

第8期中間会計期間
(2022年9月30日現在)

負債の部	
流動負債	
未払金	
未払手数料	240,761
その他未払金	285,686
未払費用	112,078
未払法人税等	730,903
未払事業所税	2,619
未払消費税等	2 117,638
賞与引当金	207,789
預り金	2,341
流動負債計	1,699,819
負債合計	1,699,819
純資産の部	
株主資本	
資本金	1,000,000
資本剰余金	
資本準備金	490,000
資本剰余金計	490,000
利益剰余金	
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	9,842,603
利益剰余金計	9,842,603
株主資本計	11,332,603
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	1,223
評価・換算差額等計	1,223
純資産合計	11,331,379
負債・純資産合計	13,031,199

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

第8期中間会計期間
(自 2022年4月1日
至 2022年9月30日)

営業収益	
委託者報酬	2,300,642
運用受託報酬	2,596,274
投資助言報酬	483,191
営業収益計	5,380,108
営業費用	
支払手数料	586,822
広告宣伝費	24,388
調査費	

調査費		869,172
委託調査費		84,550
委託計算費		146,218
事務委託費		12,840
営業雑経費		
印刷費		49,348
協会費		10,814
販売促進費		521
その他		33,942
営業費用計		1,818,619
一般管理費		
給料		
役員報酬		64,179
給料・手当		675,953
賞与		22,708
賞与引当金繰入額		207,789
旅費交通費		9,760
租税公課		42,925
不動産賃借料		51,972
固定資産減価償却費	1	6,075
諸経費		133,319
一般管理費計		1,214,682
営業利益		2,346,806
営業外収益		
受取利息		99
受取配当金		44
投資有価証券売却益		564
雑収入		1,173
営業外収益計		1,882
営業外費用		
投資有価証券売却損		290
為替差損		4,655
雑損失		22
営業外費用計		4,967
経常利益		2,343,721
税引前中間純利益		2,343,721
法人税、住民税及び事業税		691,097
法人税等調整額		13,831
法人税等計		704,928
中間純利益		1,638,792

(3) 中間株主資本等変動計算書

第8期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

（単位：千円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計	
当期首残高	1,000,000	490,000	490,000	8,203,810	8,203,810	9,693,810

当中間期変動額						
当中間純利益				1,638,792	1,638,792	1,638,792
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)						
当中間期変動額合計		-	-	1,638,792	1,638,792	1,638,792
当中間期末残高	1,000,000	490,000	490,000	9,842,603	9,842,603	11,332,603

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	1,318	1,318	9,695,129
当中間期変動額			
当中間純利益			1,638,792
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)	2,542	2,542	2,542
当中間期変動額合計	2,542	2,542	1,636,250
当中間期末残高	1,223	1,223	11,331,379

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

時価法(評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)を採用しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

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

その他の有形固定資産につきましては、定率法を採用しております。

なお、主な耐用年数は次のとおりであります。

建物 6～15年

器具備品 3～20年

(2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

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

3. 引当金の計上基準

賞与引当金

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

4. 収益および費用の計上基準

当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行義務の内容及び当該履行義務を充足する通常の時点(収益を認識する通常の時点)は以下のとおりであります。

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。

（追加情報）

（グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い）

当社は、当中間会計期間から、連結納税制度からグループ通算制度へ移行しております。これに伴い、法人税及び地方法人税並びに税効果会計の会計処理及び開示については、「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第42号 2021年8月12日。以下「実務対応報告第42号」という。）に従っております。また、実務対応報告第42号第32項(1)に基づき、実務対応報告第42号の適用に伴う会計方針の変更による影響はないものとみなしております。

（会計方針の変更）

（時価の算定に関する会計基準の適用指針の適用）

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日。以下「時価算定会計基準適用指針」という。）を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準適用指針が定める新たな会計方針を将来にわたって適用することといたしました。これによる当中間財務諸表に与える影響はありません。また、「金融商品関係」注記において、金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項等の注記を行うことといたしました。

注記事項

（中間貸借対照表関係）

1 有形固定資産の減価償却累計額

第8期中間会計期間 (2022年9月30日)	
建物	2,490千円
器具備品	36,692千円

2 消費税等の取扱い

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

（中間損益計算書関係）

1 減価償却実施額は、次のとおりであります。

第8期中間会計期間 (2022年9月30日)	
有形固定資産	4,693千円
無形固定資産	1,382千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第8期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 配当に関する事項

該当事項はありません。

（金融商品関係）

1 金融商品の時価等に関する事項

中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、預金、未収委

託者報酬、未収運用受託報酬、未収投資助言報酬、未払手数料、その他未払金は短期間で決済されるため時価が帳簿価額に近似することから、注記を省略しております。

第8期中間会計期間（2022年9月30日現在）

（単位：千円）

	中間貸借対照表 計上額	時価	差額
投資有価証券	35,910	35,910	-
資産計	35,910	35,910	-

2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

金融商品の時価を、時価の算定に用いたインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産または負債に関する相場価格により算定した時価

レベル2の時価：観察可能な時価に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

（単位：千円）

区分	時価			合計
	レベル1	レベル2	レベル3	
投資有価証券 投資信託	-	35,910	-	35,910
資産計	-	35,910	-	35,910

（有価証券関係）

1. その他有価証券

第8期中間会計期間（2022年9月30日現在）

（単位：千円）

	種類	中間貸借対照表 計上額	取得原価	差額
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	-	-	-
	(3)その他	9,425	8,100	1,325
	小計	9,425	8,100	1,325
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	-	-	-
	(3)その他	26,484	29,574	3,089
	小計	26,484	29,574	3,089
資産計		35,910	37,674	1,763

（収益認識関係）

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

（セグメント情報等）

第8期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

1. セグメント情報

当社は、「資産運用業」の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

単一の商品・サービスの区分の外部顧客からの営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

(2) 地域ごとの情報

営業収益

本邦の外部顧客への営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。なお、営業収益の地域区分は、契約相手方の所在地（ファンドの場合は組成地）を基礎として分類しております。

有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が中間貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

(3) 主要な顧客ごとの情報

(単位：千円)

顧客の名称又は氏名	営業収益額
株式会社りそな銀行	2,811,251

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

(1 株当たり情報)

	第8期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)
1株当たり純資産額	2,861円45銭
1株当たり中間純利益金額	413円83銭

(注) 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は以下のとおりであります。

	第8期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)
中間純利益(千円)	1,638,792
普通株主に帰属しない金額(千円)	-
普通株式に係る中間純利益(千円)	1,638,792
普通株式の期中平均株式数(株)	3,960,000

(重要な後発事象)

第8期中間会計期間(自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

- (1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (2) 運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (3) 通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下（4）、（5）において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または金融デリバティブ取引を行なうこと。
- (4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。
- (5) 上記（3）、（4）に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

- (1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項
該当事項はありません。
- (2) 訴訟事件その他の重要事項
委託会社に重要な影響を与えた事実、または与えると予想される訴訟事件などは発生していません。

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
株式会社関西みらい銀行	38,971百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社京葉銀行	49,759百万円	
株式会社埼玉りそな銀行	70,000百万円	
株式会社七十七銀行	24,658百万円	

株式会社みなと銀行	39,984百万円	
株式会社横浜銀行	215,628百万円	
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。

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・計算事務などを行いません。

(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いません。

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
2022年 3月10日	有価証券届出書
2022年 3月10日	有価証券報告書
2022年 9月 9日	有価証券届出書
2022年 9月 9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

2023年2月24日

りそなアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中有限責任監査法人トーマツ
東京事務所指定有限責任社員 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FWRりそな国内債券インデックスファンドの2021年12月11日から2022年12月12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、FWRりそな国内債券インデックスファンドの2022年12月12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。

独立監査人の監査報告書

2023年2月24日

りそなアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中有限責任監査法人トーマツ
東京事務所指定有限責任社員 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FWRりそな国内株式インデックスファンドの2021年12月11日から2022年12月12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、FWRりそな国内株式インデックスファンドの2022年12月12日現在の信託財産の状況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。

独立監査人の監査報告書

2023年2月24日

りそなアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中有限責任監査法人トーマツ
東京事務所指定有限責任社員 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FWR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）の2021年12月11日から2022年12月12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、FWR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）の2022年12月12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、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業的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。

独立監査人の監査報告書

2023年2月24日

りそなアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中有限責任監査法人トーマツ
東京事務所指定有限責任社員 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FWR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）の2021年12月11日から2022年12月12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、FWR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）の2022年12月12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。

独立監査人の監査報告書

2023年2月24日

りそなアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中有限責任監査法人トーマツ
東京事務所指定有限責任社員 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FWRりそな新興国債券インデックスファンドの2021年12月11日から2022年12月12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、FWRりそな新興国債券インデックスファンドの2022年12月12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。

独立監査人の監査報告書

2023年2月24日

りそなアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中有限責任監査法人トーマツ
東京事務所指定有限責任社員 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FWRりそな先進国株式インデックスファンドの2021年12月11日から2022年12月12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、FWRりそな先進国株式インデックスファンドの2022年12月12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。

独立監査人の監査報告書

2023年2月24日

りそなアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中有限責任監査法人トーマツ
東京事務所指定有限責任社員 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FWRりそな新興国株式インデックスファンドの2021年12月11日から2022年12月12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、FWRりそな新興国株式インデックスファンドの2022年12月12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。

独立監査人の監査報告書

2023年2月24日

りそなアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中有限責任監査法人トーマツ
東京事務所指定有限責任社員 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FWRりそな国内リートインデックスファンドの2021年12月11日から2022年12月12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、FWRりそな国内リートインデックスファンドの2022年12月12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。

独立監査人の監査報告書

2023年2月24日

りそなアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中有限責任監査法人トーマツ
東京事務所指定有限責任社員 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FWRりそな先進国リートインデックスファンドの2021年12月11日から2022年12月12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、FWRりそな先進国リートインデックスファンドの2022年12月12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。

独立監査人の中間監査報告書

2022年12月2日

りそなアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中有限責任監査法人トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	松崎	雅則
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	石坂	武嗣

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているりそなアセットマネジメント株式会社の2022年4月1日から2023年3月31日までの第8期事業年度の中間会計期間（2022年4月1日から2022年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、りそなアセットマネジメント株式会社の2022年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2022年4月1日から2022年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査等委員会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。

- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査等委員会に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

監査人は、監査等委員会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去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、中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれておりません。