【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2023年10月20日提出
【発行者名】	りそなアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役 西山　明宏
【本店の所在の場所】	東京都江東区木場一丁目５番６５号
【事務連絡者氏名】	塚田　光子
【電話番号】	03-6704-3821
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	九州ＳＤＧｓ・グローバルバランス
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

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

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

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

（５）【申込手数料】

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

（６）【申込単位】

販売会社にお問い合わせください。

（７）【申込期間】

2023年10月21日から2024年4月19日までとします。
・上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

（８）【申込取扱場所】

販売会社につきましては、委託会社の照会先にお問い合わせください。

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

（９）【払込期日】

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

（１０）【払込取扱場所】

申込金額は、販売会社にお支払いいただきます。

（１１）【振替機関に関する事項】

振替機関は、株式会社証券保管振替機構とします。

（１２）【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

① ファンドの目的

安定した収益の確保と信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

② ファンドの基本的性格

１）商品分類

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

２）属性区分

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

＜商品分類の定義＞

1. 単位型投信・追加型投信の区分
   (1)単位型投信：当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われないファンドをいう。
   (2)追加型投信：一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。
2. 投資対象地域による区分
   (1)国内：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
   (2)海外：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
   (3)内外：目論見書又は投資信託約款において、国内及び海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。
3. 投資対象資産による区分
   (1)株式：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいう。
   (2)債券：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいう。
   (3)不動産投信(リート)：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券及び不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいう。
   (4)その他資産：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に上記(1)から(3)に掲げる資産以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、その他資産と併記して具体的な収益の源泉となる資産の名称記載も可とする。
   (5)資産複合：目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(4)に掲げる資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。
4. 独立した区分
   (1)MMF(マネー・マネージメント・ファンド)：「MMF等の運営に関する規則」に定めるMMFをいう。
   (2)MRF(マネー・リザーブ・ファンド)：「MMF等の運営に関する規則」に定めるMRFをいう。
   (3)ETF：投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号及び第2号に規定する証券投資信託並びに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいう。

＜補足として使用する商品分類＞

(1)インデックス型：目論見書又は投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいう。
(2)特殊型：目論見書又は投資信託約款において、投資者に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。なお、下記の属性区分で特殊型の小分類において「条件付運用型」に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記するものとし、それ以外の小分類に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記できるものとする。

＜属性区分の定義＞

1. 投資対象資産による属性区分
   (1)株式
      ①一般：次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。
      ②大型株：目論見書又は投資信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいう。
      ③中小型株：目論見書又は投資信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいう。
   (2)債券
      ①一般：次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。
      ②公債：目論見書又は投資信託約款において、日本国又は各国の政府の発行する国債(地方債、政府保証債、政府機関

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

③社債：目論見書又は投資信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいう。

④その他債券：目論見書又は投資信託約款において、公債又は社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいう。

⑤格付等クレジットによる属性：目論見書又は投資信託約款において、上記①から④の「発行体」による区分のほか、特にクレジットに対して明確な記載があるものについては、上記①から④に掲げる区分に加え「高格付債」「低格付債」等を併記することも可とする。

(3)不動産投信

これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産

組入れている資産を記載するものとする。

(5)資産複合

以下の小分類に該当する場合には当該小分類を併記することができる。

①資産配分固定型：目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

②資産配分変更型：目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

2. 決算頻度による属性区分

①年1回：目論見書又は投資信託約款において、年１回決算する旨の記載があるものをいう。

②年2回：目論見書又は投資信託約款において、年２回決算する旨の記載があるものをいう。

③年4回：目論見書又は投資信託約款において、年４回決算する旨の記載があるものをいう。

④年6回(隔月)：目論見書又は投資信託約款において、年６回決算する旨の記載があるものをいう。

⑤年12回(毎月)：目論見書又は投資信託約款において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるものをいう。

⑥日々：目論見書又は投資信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいう。

⑦その他：上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

3. 投資対象地域による属性区分(重複使用可能)

①グローバル：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。

②日本：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

③北米：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

④欧州：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

⑤アジア：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

⑥オセアニア：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

⑦中南米：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

⑧アフリカ：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

⑨中近東(中東)：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

⑩エマージング：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域(新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

4. 投資形態による属性区分

①ファミリーファンド：目論見書又は投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいう。

②ファンド・オブ・ファンズ：「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいう。

5. 為替ヘッジによる属性区分
①為替ヘッジあり：目論見書又は投資信託約款において、為替のフルヘッジ又は一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいう。
②為替ヘッジなし：目論見書又は投資信託約款において、為替のヘッジを行なわない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。
6. インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分
①日経225
②TOPIX
③その他の指数：前記指数にあてはまらない全てのものをいう。
7. 特殊型
①ブル・ベア型：目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
②条件付運用型：目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
③ロング・ショート型／絶対収益追求型：目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨若しくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。
④その他型：目論見書又は投資信託約款において、上記①から③に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

※上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。また、商品分類および属性区分の定義は一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」を基に委託会社が作成したものです。なお、一般社団法人投資信託協会のホームページ（https://www.toushin.or.jp/）でもご覧頂けます。

③　ファンドの特色

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

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

※ 2023年7月31日現在、上記の組入比率は、以下の通りです。

	組入比率
①特にESG/SDGsを重視した運用を行うマザーファンド	69.5%
②九州に関連した運用を行うマザーファンド	10.3%
①と②の合計	79.9%

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

- 先進国債券、国内株式および先進国株式に投資を行う4つのマザーファンドにおいて、特にESG/SDGsを重視した運用*1を行います。
  - RM米ドル建SDGs債券マザーファンド(為替ヘッジあり)およびRMユーロ建SDGs債券マザーファンド(為替ヘッジあり)は、残存期間が10年程度までのSDGs債*2および先進国(日本を除く)の国債を、各残存期間の投資金額がほぼ同程度となるように組み入れることにより、金利変動に対するリスク分散効果や、利息収入の平準化を図り、安定した収益の確保を目指します。
  - RM国内株式ESGマザーファンドおよびRM先進国株式ESGマザーファンドは、ESG関連インデックス*3に連動する投資成果を目指します。

- 国内債券に投資を行うマザーファンドにおいて、九州に関連した運用を行い、九州の地方公共団体が発行する公募地方債も主要投資対象とします*4。
  - RM国内債券マザーファンド(九州重視型)は、投資するわが国の国債および九州の地方公共団体が発行する公募地方債の残存年限を幅広く分散させることにより、金利変動に対するリスク分散効果や、利息収入の平準化を図り、安定した収益の確保を目指します。

＊1 ESG/SDGsを重視した運用の詳細は、「ESG/SDGsを重視した運用について」をご参照ください。
＊2 マザーファンドにおける投資対象としてのSDGs債の詳細は、「ESG/SDGsを重視した運用について」をご参照ください。SDGs債の発行状況や市況状況および純資産総額の水準等により、SDGs債への投資比率が低位となる場合があります。
＊3 ESG関連インデックスとは、MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数(配当込み)およびMSCI-KOKUSAI ESG リーダーズ指数(配当込み、円換算ベース)をいいます。詳細は、「ESG/SDGsを重視した運用について」をご参照ください。
＊4 九州の地方公共団体が発行する公募地方債の発行状況や市況状況および純資産総額の水準等により、当該地方債に投資を行わない、もしくは投資比率が低位となる場合があります。

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

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

■ 特にESG/SDGsを重視した運用を行うマザーファンド　■ 九州に関連した運用を行うマザーファンド
＊ 発行国が先進国以外の場合があります。
※ 各対象指数については、「各マザーファンドが対象とする指数の著作権等について」をご参照ください。

ESGとは

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

SDGsとは

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

2 中長期的な運用に理想的なポートフォリオ構築を目指します。

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

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

運用プロセスのイメージ

マーケットシナリオの作成

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

▼

基本的資産配分比率の算出(原則として年1回程度見直し)

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

▼

ポートフォリオ構築

基本的資産配分比率に基づき、ポートフォリオを構築

※上記の運用プロセスおよびイメージ図は、今後変更になる場合があります。

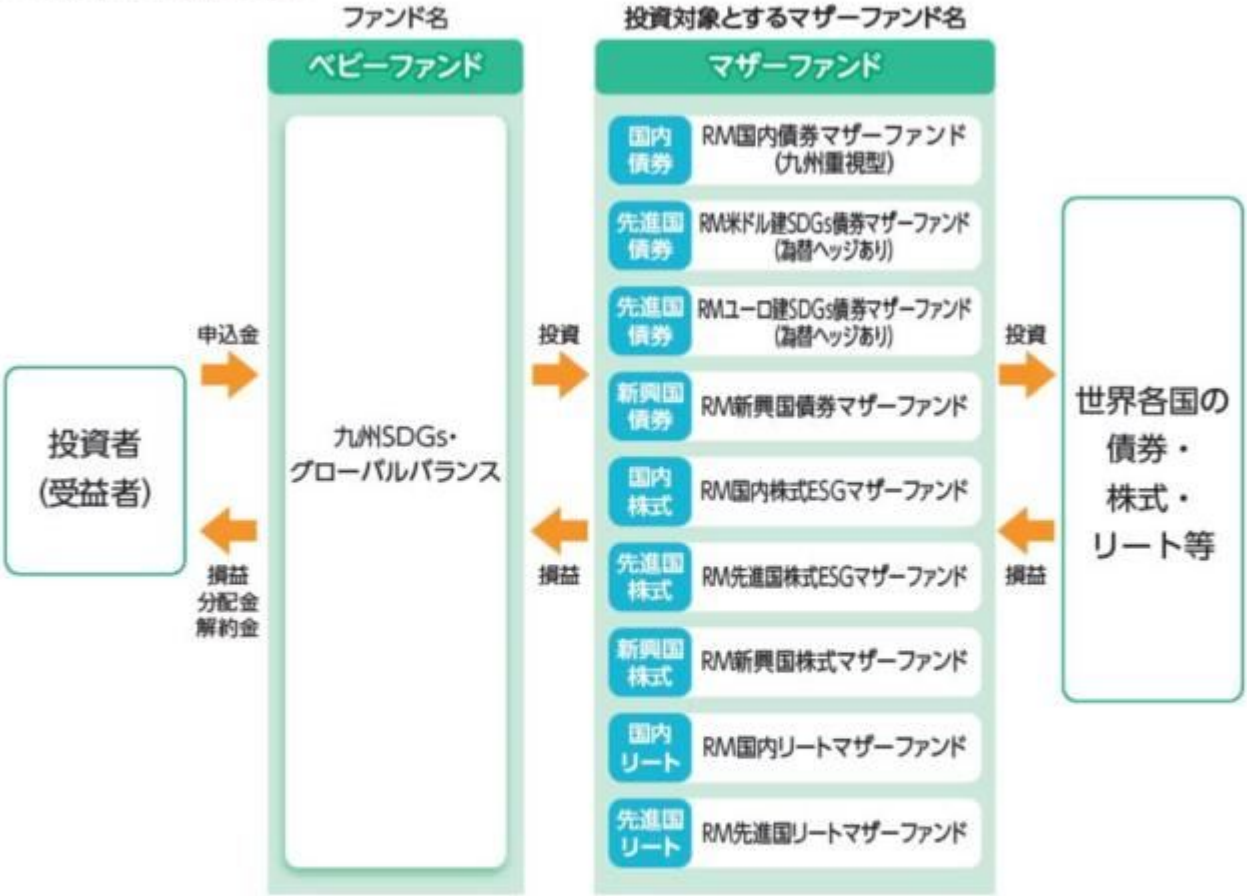
3 実質組入外貨建資産の一部について、対円での為替ヘッジを行います。

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

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

ファンドの仕組み

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



主な投資制限

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

分配方針

原則、毎年7月20日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、以下の収益分配方針に基づいて分配を行います。
①分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等とします。
②原則として、基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。
③留保益は、運用の基本方針に基づいて運用します。

★将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

各マザーファンドが対象とする指数の著作権等について

- **RM新興国債券マザーファンド**

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

- **RM国内株式ESGマザーファンド**

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

- **RM先進国株式ESGマザーファンド**

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

- **RM新興国株式マザーファンド**

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

- **RM国内リートマザーファンド**

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

- **RM先進国リートマザーファンド**

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

ESG/SDGsを重視した運用について

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

－先進国債券の投資について－

- RM米ドル建SDGs債券マザーファンド(為替ヘッジあり)およびRMユーロ建SDGs債券マザーファンド(為替ヘッジあり)は、SDGs債および先進国(日本を除く)の国債を主要投資対象とします。(以下、上記マザーファンドを総称して「SDGs債券マザーファンド」といいます。)
  - ・SDGs債券マザーファンドにおける投資対象としてのSDGs債とは、調達資金がSDGsに貢献する事業に充当される債券であり、国際資本市場協会(ICMA)*によるグリーンボンド原則、ソーシャルボンド原則、サステナビリティボンド・ガイドライン等に沿って発行された債券および事業全体がSDGsに貢献すると考えられている機関が発行する債券(国際機関債等)等をいいます。

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

※SDGs債券マザーファンドそれぞれにおけるSDGs債の組入比率は合計90%以上とすることを目標としています。
※SDGs債の発行状況や市況状況および純資産総額の水準等により、SDGs債への投資比率が低位となる場合があります。

《 代表的なSDGs債の種類と特徴 》

代表的なSDGs債の種類	概要	特徴
グリーン・ボンド	温暖化問題、再生可能エネルギー等、環境プロジェクトに充当するために発行する債券です。	●以下の4要素の観点から、それぞれの債券の要件が設定されています。 ・資金調達の使途 ・プロジェクトの評価と選定のプロセス ・調達資金の管理 ・レポーティング ●要件のほか、発行体に対する推奨項目も設定されています。 ・フレームワーク等によって、原則やガイドラインへの適合性等を説明すること ・外部評価機関を用いて、原則やガイドラインへの適合性を評価したり、資金管理の検証等を行うこと など
ソーシャル・ボンド	貧困問題、女性活躍の機会増進など、社会的課題解決のためのプロジェクトに充当するために発行する債券です。	
サスティナブル・ボンド	グリーンとソーシャル両方のプロジェクト、両方の性格を持つプロジェクトに充当するために発行する債券です。	

※上記の記載内容については、今後変更される可能性があります。

ー国内株式および先進国株式の投資についてー

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

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

・MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数（配当込み）は、MSCI Inc.が開発し、国内株式を対象とした株価指数であるMSCI ジャパン IMI指数*1の構成銘柄から、相対的にESG評価の高い銘柄を選定することで構築される指数で、配当を考慮したものです。

・MSCI-KOKUSAI ESG リーダーズ指数(配当込み、円換算ベース)は、MSCI Inc.が開発したMSCI-KOKUSAI ESG リーダーズ指数(米ドルベース)をもとに委託会社が円換算して計算したものです。MSCI-KOKUSAI ESG リーダーズ指数(米ドルベース)は、日本を除く世界の先進国の株式から、相対的にESG評価の高い銘柄を選定することで構築される指数で、配当を考慮したものです。

《 両指数の特徴 》

① MSCI Inc.独自のESG評価モデルを用います。当該モデルは、評価対象企業に対し、当該企業が属する業種が直面するESG上のリスクや機会は何か、当該企業にとってそれらがどの程度大きく、どの程度マネジメントを行っているかを測定・分析し、同業種他社と比較することを目的としています。

② 企業に対するESG評価は最終的にAAA～CCCの7段階のESG格付で表され、格付がBB以上(7段階のうち上位5段階目まで)の企業が選別されます。

③ E/S/Gそれぞれの要素に負の影響を与える可能性がある不祥事について分析し、11段階のうち上位8段階目までの企業が選別されます。

④ MSCI ジャパン IMI指数*1を構成する銘柄、またはMSCI-KOKUSAI指数*2を構成する日本を除く先進国の銘柄の中から、業種分類(GICS：Global Industry Classification Standard)ごとに時価総額50%を目標として、指数を構成する企業が選別されます。

⑤ MSCI-KOKUSAI ESG リーダーズ指数においては、非人道的兵器や核兵器製造などに関与する企業、アルコールやギャンブルなどから一定以上の収益を得ている企業は指数の構成銘柄から除外されます。

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

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

〈ESG格付決定プロセス〉

1. 業種別に、MSCI Inc.が独自にE/S/Gそれぞれに設定している細項目(Key Issue)のうち関連が深いものを選定し、それがリスクまたは機会として顕在化するまでの時間の長短および環境・社会に与える影響の大小の2軸をもとにウエイト配分を決定する。

2. E/S/Gそれぞれに選定された細項目をもとに、E/Sに対しては、エクスポージャー(経済的なリスクの程度)の大きさとそれに対するマネジメントがどの程度なされているかを、Gに対しては、企業統治上のリスクに関する評価を減点方式で勘案し、E/S/Gそれぞれに0～10の点数を付与する。

3. 上記1.で決定したウエイト配分をもとに、上記2.でE/S/Gそれぞれに付与した点数を、加重平均したうえで同業種他社との比較を踏まえ調整を行い、0～10の点数を算出する。

4. 算出された点数を格付表にあてはめ、格付を決定する。

*1 ：0～10の点数を算出
*2 ：業種別にMSCI Inc.が独自にE/S/Gそれぞれに設定している細項目(Key Issue)
*3 ：経済的なリスクの程度

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

〈MSCI Inc.のESG細項目(Key Issue)の例〉(ご参考)

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

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

④　信託金限度額

・1兆円を限度として信託金を追加することができます。

・委託会社は受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

（２）【ファンドの沿革】

2021年11月18日

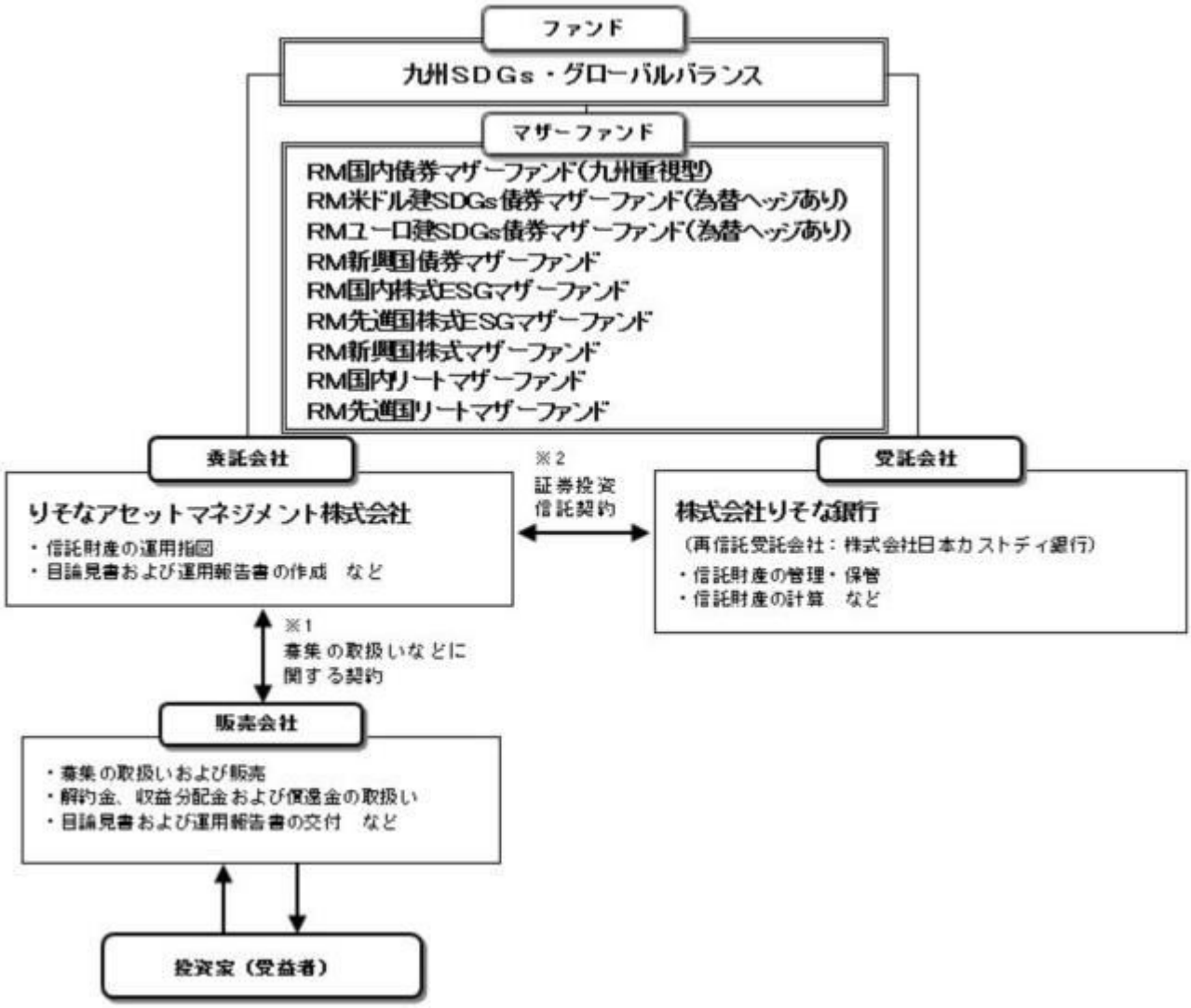
・ファンドの信託契約締結、運用開始

2023年4月21日

・信託期間を無期限に変更

（３）【ファンドの仕組み】

①　ファンドの仕組み



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

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

② 委託会社の概況（2023年7月末現在）

１）資本金

1,000百万円

２）沿革

2015年8月3日：　りそなアセットマネジメント株式会社設立

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

３）大株主の状況

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

２【投資方針】

（１）【投資方針】

RM国内債券マザーファンド（九州重視型）、RM米ドル建ＳＤＧｓ債券マザーファンド(為替ヘッジあり)、RMユーロ建ＳＤＧｓ債券マザーファンド(為替ヘッジあり)、RM新興国債券マザーファンド、RM国内株式ＥＳＧマザーファンド、RM先進国株式ＥＳＧマザーファンド、RM新興国株式マザーファンド、RM国内リートマザーファンド、RM先進国リートマザーファンド（以下、各々を「マザーファ

ンド」といいます。）の各受益証券を主要投資対象とします。

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

（２）【投資対象】

① 投資の対象とする資産の種類
この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
１）次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。）
イ）有価証券
ロ）デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第21条、第22条、第23条および第24条に定めるものに限ります。）
ハ）約束手形（イ）に掲げるものに該当するものを除きます。）
ニ）金銭債権（イ）、ロ）およびハ）に掲げるものに該当するものを除きます。）
２）次に掲げる特定資産以外の資産
イ）為替手形
② 有価証券の指図範囲
委託者は、信託金を、主として、各マザーファンドの受益証券、ならびに次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。
１）株券または新株引受権証書
２）国債証券
３）地方債証券
４）特別の法律により法人の発行する債券
５）社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
６）特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
７）特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
８）協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
９）特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
10）コマーシャル・ペーパー
11）新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
12）外国または外国の者の発行する証券または証書で、1）から11）までの証券または証書の性質を有するもの
13）投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）

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

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

③　金融商品の指図範囲

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

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

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

④　その他の投資対象と指図範囲

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

《参考情報》

◆投資対象とするマザーファンドの概要

＜RM国内債券マザーファンド（九州重視型）＞

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。
主な投資対象	わが国の国債および九州の地方公共団体が発行する公募地方債を主要投資対象とします。

投資方針	①　主として、わが国の国債および九州の地方公共団体が発行する公募地方債に投資を行い、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長を目指します。なお、国内債券を対象とした債券先物取引を活用することがあります。 ②　投資する債券の残存年限を幅広く分散させることにより、金利変動に対するリスク分散効果や、利息収入の平準化を図り、安定した収益の確保を目指します。 ③　債券の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。 ④　資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	①　株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ②　投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③　外貨建資産への投資は行いません。 ④　デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。 ⑤　一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ⑥　一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
決算日	毎年7月20日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

＜RM米ドル建ＳＤＧｓ債券マザーファンド（為替ヘッジあり）＞

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。
主な投資対象	米ドル建のＳＤＧｓ債および先進国（日本を除く）の国債を主要投資対象とします。

投資方針	①　主として、米ドル建のＳＤＧｓ債および先進国（日本を除く）の国債に投資し、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。なお、先進国債券（除く日本）を対象とした債券先物取引を活用することがあります。 ②　米ドル建のＳＤＧｓ債は、発行体の信用力・ＥＳＧ評価および当該債券の流動性等を勘案して投資を行います。 ③　ポートフォリオの構築は、残存期間が10年程度までの米ドル建のＳＤＧｓ債および先進国（日本を除く）の国債を、各残存期間の投資金額がほぼ同程度となるように組み入れることにより、金利変動に対するリスク分散効果や、利息収入の平準化を図り、安定した収益の確保を目指します。 ④　債券の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。 ⑤　組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行います。 ⑥　資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	①　株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ②　投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③　外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ④　デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。 ⑤　一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ⑥　一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
決算日	毎年5月10日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

＜RMユーロ建ＳＤＧｓ債券マザーファンド（為替ヘッジあり）＞

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。

主な投資対象	ユーロ建のＳＤＧｓ債および先進国（日本を除く）の国債を主要投資対象とします。
投資方針	①　主として、ユーロ建のＳＤＧｓ債および先進国（日本を除く）の国債に投資し、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。なお、先進国債券（除く日本）を対象とした債券先物取引を活用することがあります。 ②　ユーロ建のＳＤＧｓ債は、発行体の信用力・ＥＳＧ評価および当該債券の流動性等を勘案して投資を行います。 ③　ポートフォリオの構築は、残存期間が10年程度までのユーロ建のＳＤＧｓ債および先進国（日本を除く）の国債を、各残存期間の投資金額がほぼ同程度となるように組み入れることにより、金利変動に対するリスク分散効果や、利息収入の平準化を図り、安定した収益の確保を目指します。 ④　債券の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。 ⑤　組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行います。 ⑥　資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	①　株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ②　投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③　外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ④　デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。 ⑤　一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ⑥　一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
決算日	毎年5月10日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

＜RM新興国債券マザーファンド＞

運用の基本方針

基本方針	この投資信託は、ＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	次の有価証券を主要投資対象とします。 ・ＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）に採用されている新興国の債券 ・新興国債券の指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）
投資方針	①　主として、ＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）に採用されている新興国の現地通貨建て債券または新興国債券の指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）に投資し、ＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、ＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の債券先物取引を活用することがあります。 ②　債券またはＥＴＦ（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。 ③　為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。 ④　資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	①　株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限ります。 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ②　投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ④　デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。 ⑤　一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ⑥　一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
決算日	毎年1月25日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社

受託会社	株式会社りそな銀行

＜RM国内株式ＥＳＧマザーファンド＞

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、ＭＳＣＩ　ジャパン　ＥＳＧ　セレクト・リーダーズ指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
主な投資対象	国内の金融商品取引所上場株式（上場予定を含みます。）のうち、ＭＳＣＩ　ジャパン　ＥＳＧ　セレクト・リーダーズ指数（配当込み）に採用されている株式を主要投資対象とします。
投資方針	①　主として、国内の金融商品取引所上場株式（上場予定を含みます。）のうち、ＭＳＣＩ　ジャパン　ＥＳＧ　セレクト・リーダーズ指数（配当込み）に採用されている株式に投資し、ＭＳＣＩ　ジャパン　ＥＳＧ　セレクト・リーダーズ指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、ＭＳＣＩ　ジャパン　ＥＳＧ　セレクト・リーダーズ指数（配当込み）への連動性を高めるため、国内株式の指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）、国内株式を対象とした株価指数先物取引を活用することがあります。 ②　株式（ＥＴＦ（上場投資信託証券）、株価指数先物取引を含みます。）の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。 ③　非株式割合（株式以外の資産への投資割合）は、原則として信託財産総額の50%以下を基本とします。 ④　資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	①　株式への投資割合には、制限を設けません。 ②　新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ③　投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ④　外貨建資産への投資は行いません。 ⑤　デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。 ⑥　一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ⑦　一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。

その他	
決算日	毎年11月25日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

＜ＲＭ先進国株式ＥＳＧマザーファンド＞

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、ＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ　ＥＳＧ　リーダーズ指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
主な投資対象	金融商品取引所上場または店頭登録（上場予定および店頭登録予定を含みます。）されている日本を除く先進国の株式*のうち、ＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ　ＥＳＧ　リーダーズ指数（配当込み、円換算ベース）に採用されている株式を主要投資対象とします。 ＊ＤＲ（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。
投資方針	①　主として、金融商品取引所に上場または店頭登録（上場予定および店頭登録予定を含みます。）されている日本を除く先進国の株式のうち、ＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ　ＥＳＧ　リーダーズ指数（配当込み、円換算ベース）に採用されている株式に投資し、ＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ　ＥＳＧ　リーダーズ指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、ＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ　ＥＳＧ　リーダーズ指数（配当込み、円換算ベース）への連動性を高めるため、先進国株式の指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）、海外の金融商品取引所に上場されている株価指数先物取引を活用することがあります。 ②　株式（ＥＴＦ（上場投資信託証券）、株価指数先物取引を含みます。）の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。 ③　組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。 ④　資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	①　株式への投資割合には、制限を設けません。 ②　新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ③　投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ④　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ⑤　デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。 ⑥　一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ⑦　一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
決算日	毎年11月25日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

＜ＲＭ新興国株式マザーファンド＞

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、ＭＳＣＩエマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	次の有価証券を主要投資対象とします。 ・金融商品取引所に上場されているまたは店頭登録されている（上場予定および店頭登録予定を含みます。）新興国株式（*） （*）ＤＲ（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。 ・新興国株式の指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）
投資方針	①　主として、新興国の株式または新興国株式の指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）に投資し、ＭＳＣＩエマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。なお、ＭＳＣＩエマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の金融商品取引市場に上場する株価指数先物取引を活用することがあります。 ②　株式またはＥＴＦ（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。 ③　為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。 ④　資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	①　株式への投資割合には、制限を設けません。 ②　新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ③　投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ④　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ⑤　デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。 ⑥　一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ⑦　一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。

その他	
決算日	毎年1月25日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

＜RM国内リートマザーファンド＞

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	次の有価証券を主要投資対象とします。 ・東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）に採用されている不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に規定する不動産投資信託証券をいいます。）
投資方針	①　主として、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）に採用されている不動産投資信託証券に投資し、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。なお、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）への連動性を高めるため、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）または不動産投信指数先物取引を活用することがあります。 ②　不動産投資信託証券またはＥＴＦ（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。 ③　資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	①　不動産投資信託証券および株式への投資割合には、制限を設けません。 ②　新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ③　投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ④　外貨建資産への投資は、行いません。 ⑤　デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。 ⑥　一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ⑦　一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。

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

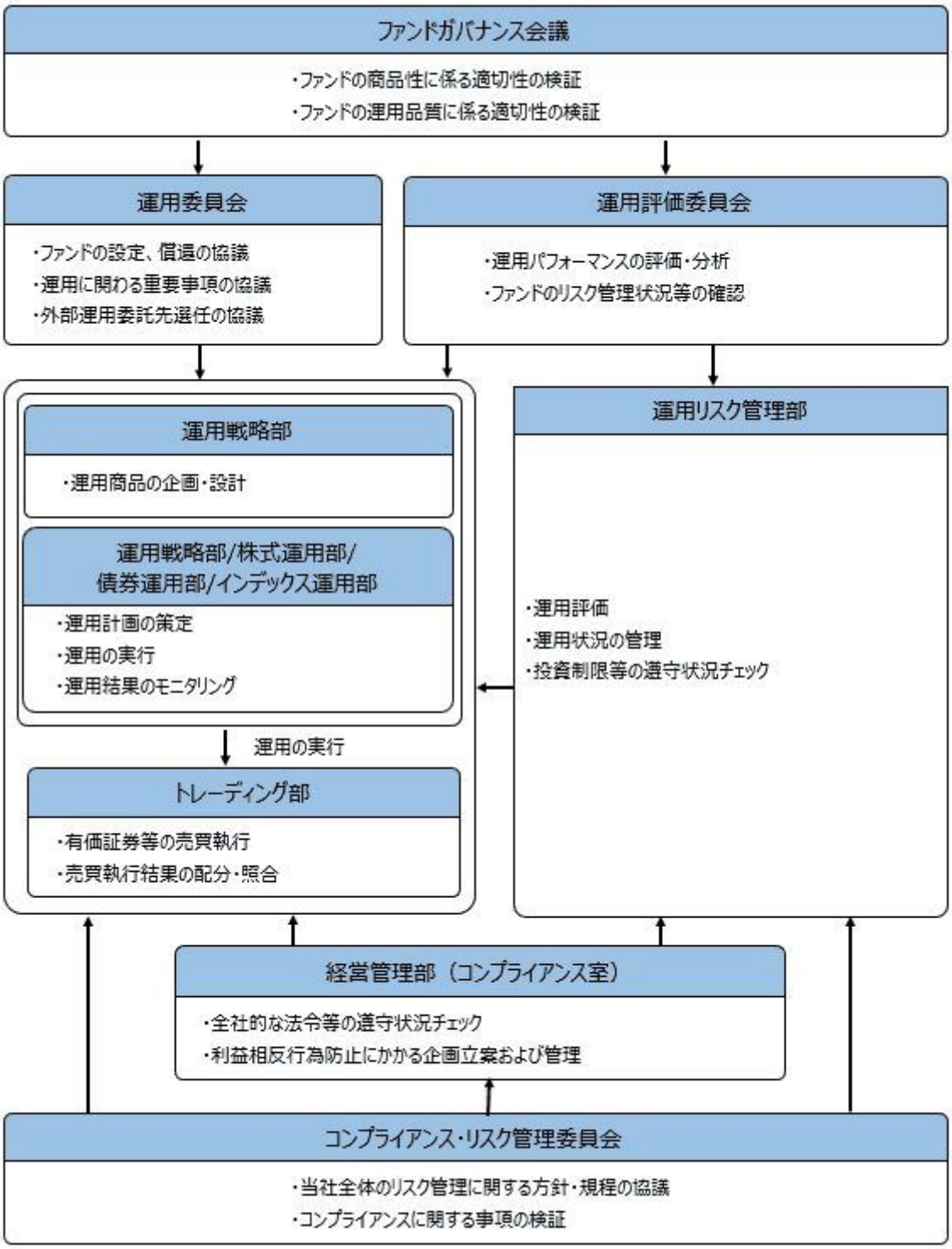
＜RM先進国リートマザーファンド＞

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	次の有価証券を主要投資対象とします。 ・先進国（除く日本）の金融商品取引所に上場（上場予定を含みます。）されているまたは店頭登録されている（登録予定を含みます。）不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に規定する不動産投資信託証券をいいます。） ・先進国（除く日本）の金融商品取引所に上場（上場予定を含みます。）されているまたは店頭登録されている（登録予定を含みます。）不動産関連株式 ・先進国の不動産投資信託証券に関する指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）
投資方針	①　主として、先進国の不動産投資信託証券および不動産関連株式または先進国の不動産投資信託証券に関する指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）に投資し、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の金融商品取引市場に上場する指数先物取引を活用することがあります。 ②　不動産投資信託証券またはＥＴＦ（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。 ③　為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。 ④　資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	①　不動産投資信託証券および株式への投資割合には、制限を設けません。 ②　新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ③　投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ④　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ⑤　デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。 ⑥　一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ⑦　一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
決算日	毎年1月25日（休業日の場合は翌営業日）

委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

（３）【運用体制】

①　ファンドの運用体制は以下のとおりです。



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

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

③　ファンドの関係法人に対する管理体制

委託会社は、受託会社または再信託受託会社に対して、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行っています。また、外部監査法人による内部統制の整備および運用状況の報告書を受託会社より受け取っております。

※上記の運用体制は、2023年7月末現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

（４）【分配方針】

①　収益分配方針

原則として毎決算時に以下の収益分配方針に基づいて分配を行います。

１）分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。

２）原則として、基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

３）留保益は、運用の基本方針に基づいて運用します。

※委託会社の判断により分配を行わない場合もあります。また、将来の分配金の支払いおよびその金額について示唆、保証するものではありません。

②　収益分配金の支払い

＜分配金再投資コース（自動けいぞく投資コース）＞

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

＜分配金受取りコース（一般コース）＞

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

（５）【投資制限】

①　約款に定める投資制限

１）株式への実質投資割合には、制限を設けません。

２）新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。

３）投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

４）外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

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

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

７）一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

８）投資する株式等の範囲

１．委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

２．前記１．の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとします。

９）信用取引の指図範囲

１．委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

２．前記１．の信用取引の指図は、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

イ）信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券

ロ）株式分割により取得する株券

ハ）有償増資により取得する株券

ニ）売出しにより取得する株券

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

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

10）先物取引等の運用指図

１．委託者は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。

２．委託者は、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。

３．委託者は、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

11）スワップ取引の運用指図

１．委託者は、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。

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

３．スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。

４．委託者は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

12）金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図

１．委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

２．金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として、信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

３．金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。

４．委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

13）直物為替先渡取引の運用指図

１．委託者は、直物為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

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

３．直物為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。

４．委託者は、直物為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、

担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

14）有価証券の貸付けの指図および範囲

１．委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式、公社債および投資信託証券を次の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。

イ）株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。

ロ）公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

ハ）投資信託証券の貸付けは、貸付時点において、貸付投資信託証券の時価合計額が、信託財産で保有する投資信託証券の時価合計額を超えないものとします。

２．前記１．に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかにその超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

３．委託者は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

15）特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

16）外国為替予約取引の指図および範囲

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

17）資金の借入れ

１．委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

２．一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から、信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間、または解約代金の入金日までの間、もしくは償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。

３．収益分配金の再投資にかかる借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

４．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

② 法令による投資制限

同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律）

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

3【投資リスク】

（1）ファンドのリスク

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

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

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

① 市場リスク

・株価変動リスク

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

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

・リートの価格変動リスク
リートの価格は、不動産市況（不動産価格、賃貸料等）、金利・景気動向、社会情勢の変化、関係法令・各種規制等の変更、災害等の要因により変動します。リートの価格および分配金がその影響を受け下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

・為替変動リスク
為替相場は、各国の経済状況、金利動向、政治情勢等のさまざまな要因により変動します。当ファンドは、実質的に外貨建資産に投資を行いますので、投資先の通貨に対して円高となった場合には、基準価額の下落要因となります。また当ファンドは原則として為替ヘッジにより為替変動リスクの一部低減を図ることとしていますが、当該部分の為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。なお、為替ヘッジを行う通貨の短期金利より円短期金利が低い場合には、その金利差相当分のコストがかかります。

② 資産配分リスク
複数資産（国内・外の株式、債券、リート等）への投資を行うため、投資割合が高い資産の価格が下落した場合、当ファンドの基準価額はより大きく影響を受け損失を被ることがあります。

③ 信用リスク
実質的に組み入れている有価証券等の発行体が倒産した場合、発行体の財務状況が悪化した場合またはそれらが予想された場合等には、当該有価証券等の価格が下落することやその価値がなくなることにより、基準価額の下落要因となります。

④ 流動性リスク
時価総額や取引量が少ない市場で流動性が低い場合、市場の混乱・取引規制等の理由から流動性が低下している場合、急激かつ多量の売買により市場が大きな影響を受けた場合等、市場実勢から期待できる価格よりも大幅に不利な価格で売買せざるを得ないことがあり、この場合、基準価額が下落する要因となります。

⑤ カントリーリスク
投資対象国・地域（特に新興国）において、政治や経済、社会情勢等の変化または金融取引等に関する規制の新設や変更により、実質的に組み入れている有価証券等の価格が大きく変動することがあります。そのため基準価額が予想以上に下落することや、投資方針に沿った運用が困難となることがあります。

※基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

（その他の留意点）

①ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリングオフ）の適用はありません。

②当ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行います。そのため、当ファンドと同じマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドの追加設定・解約により資金の流出入が生じた場合、その結果として、当該マザーファンドにおいても組入有価証券の売買等が生じ、当ファンドの基準価額に影響をおよぼすことがあります。

③当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要が生じた場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響をおよぼす可能性や、換金のお申込みの受付けが中止となる可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性があります。

④分配金はファンドの純資産から支払われますので、分配金支払い後は純資産が減少し、基準価額が下落する要因となります。収益分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益の水準を示すものではありません。収益分配は、計算期間に生じた収益を超えて行われる場合があります。投資者の購入価額によっては、収益分配金の一部または全部が、実質的な元本の一部払戻しに

相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

⑤ファンドは、預金や保険契約ではなく、預金保険機構、保険契約者保護機構の対象ではありません。また、登録金融機関で取扱う場合、投資者保護基金の補償対象ではありません。

⑥当資料に記載している指数の知的財産権、その他の一切の権利は、その発行者および許諾者に帰属します。

（２）リスク管理体制

〇委託会社における投資リスクに対する管理体制

①運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス評価を実施するとともに、流動性リスクを含む運用リスクの状況、法令・主な投資制限等の遵守状況および運用事務状況をモニタリングし、定期的に運用評価委員会に報告します。

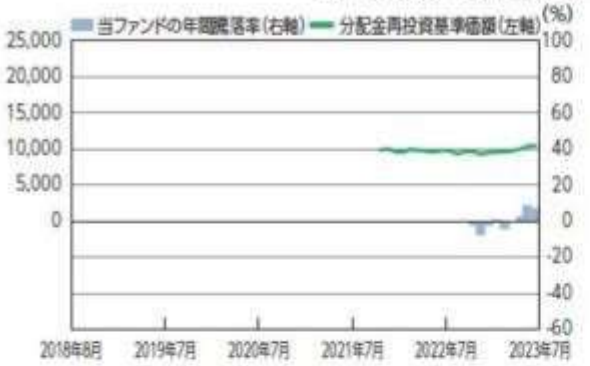
②運用評価委員会は、運用実績、流動性リスクを含む運用リスクの状況、主な投資制限等の遵守状況および運用事務状況等を確認することを通じ、信託財産の適切な運用に寄与することを目的に運用部門に対する管理・指導、改善提案等を行います。なお、流動性リスクについては、緊急時対応策の有効性検証結果や流動性リスク管理プロセスの見直し結果についても確認を行います。
運用リスクを管理する部門は、運用業務等に係る情報のうち、経営に重要な影響を与えるまたは受益者の利益が著しく阻害される一切の事案についてはすみやかに、また法令・主な投資制限等の遵守状況については定期的に取締役会等に報告します。

※上記体制は2023年7月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

〔参考情報〕

ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

2018年8月末～2023年7月末

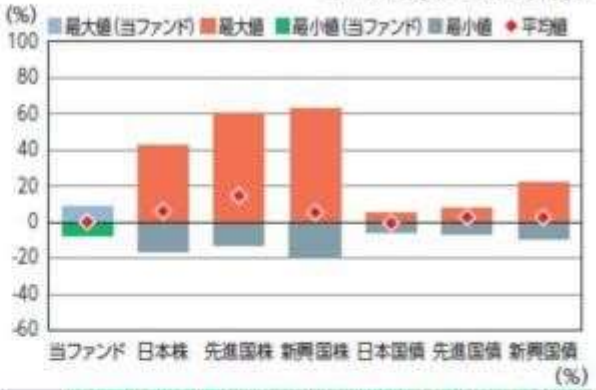


＊分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
＊年間騰落率は、2022年11月から2023年7月の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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

2018年8月末～2023年7月末



(%)

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	8.6	42.1	59.8	62.7	5.4	7.9	21.5
最小値	△7.5	△16.0	△12.4	△19.4	△5.5	△6.1	△9.4
平均値	0.3	6.3	14.6	5.5	△0.5	2.8	2.7

＊全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
＊2018年8月から2023年7月の5年間(当ファンドは2022年11月から2023年7月)の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
＊決算日に対応した数値とは異なります。
＊当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算しており、実際の基準価額と異なる場合があります。

各資産クラスの指数

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

○代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

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

東証株価指数(TOPIX、配当込み)

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

MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み、円ベース)

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

MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)

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

NOMURA-BPI国債

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

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

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

JPモルガンGBI－EMグローバル・ダイバーシファイド(円ベース)

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

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

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

・販売会社における申込手数料率は2.2%（税抜2.0%）が上限となっております。
・申込手数料の額（１口当たり）は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に申込手数料率を乗じて得

た額とします。

・＜分配金再投資コース（自動けいぞく投資コース）＞の場合、収益分配金の再投資により取得する口数については、申込手数料はかかりません。

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

（２）【換金（解約）手数料】

① 換金手数料
ありません。

② 信託財産留保額
ありません。

（３）【信託報酬等】

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

② 信託報酬の配分
信託報酬の配分（年率）は、以下の通りとします。

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

※表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

支払先	主な役務
委託会社	ファンドの運用・調査、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
販売会社	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

③ 支払時期
信託報酬（信託報酬に係る消費税等相当額を含みます。）は、日々計上され、毎計算期間の最初の６ヵ月終了日（当該終了日が休業日の場合はその翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のときに、信託財産から支払います。

（４）【その他の手数料等】

① 監査法人に支払うファンドの監査費用および当該監査費用にかかる消費税等に相当する金額は、計算期間を通じて日々計上され毎計算期間の最初の６ヵ月終了日（当該終了日が休業日の場合は翌営業日）、および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支払われます。

② 有価証券等の売買の際に発生する売買委託手数料、先物取引・オプション取引等に要する費用は証券会社等に信託財産中から都度支払われます。また、外貨建資産の保管等に要する費用は海外の保管機関に信託財産中から都度支払われます。（消費税等相当額を含みます。）

③ 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、信託財産中から都度支払われます。信託財産において資金借入れを行った場合、当該借入金の利息は信託財産中から都度支払われます。

④ 信託財産に属する有価証券等に関連して発生した訴訟係争物たる権利その他の権利に基づいて益金が生じた場合、当該支払いに際して特別に必要となる費用（データ処理費用、郵送料等）は、受益者の負担とし、当該益金から支払われます。

⑤ その他諸費用（法律・税務顧問への報酬、法定書類の作成・印刷・交付費用、公告費用等）および当該諸費用にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁することができま

す（現在、その他諸費用として受益者負担項目はありません。）。
※これらのその他の手数料等は、信託財産の運用状況等により変動するため、事前に料率、上限額またはその計算方法の概要等を記載することができません。

○上場投資信託証券、上場不動産投資信託証券は市場の需給により価格形成されるため、これら費用を表示することができません。
○上記の手数料等の合計額については、購入金額や保有期間等に応じて異なりますので、上限額等を事前に示すことができません。

（５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度（NISA）の適用対象であり、2024年1月1日以降は一定の要件を満たした場合にNISAの適用対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

① 個人受益者の場合

１）収益分配金に対する課税

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

２）解約金および償還金に対する課税

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

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

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

※少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」は、少額上場株式等に関する非課税制度です。

・少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」および未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA」をご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。なお、他の口座で生じた配当所得・譲渡所得との損益通算はできません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

・2024年1月1日以降は、NISAをご利用の場合、一定の額を上限として、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が無期限で非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。また、税法上の要件を満たした商品を購入した場合に限り、非課税の適用を受けることができます。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

② 法人受益者の場合

１）収益分配金、解約金、償還金に対する課税

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

２）益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

※買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

③ 個別元本

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

２）受益者が同一ファンドを複数回お申込みの場合、１口当たりの個別元本は、申込口数で加重平均した値となります。ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。

④　普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

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

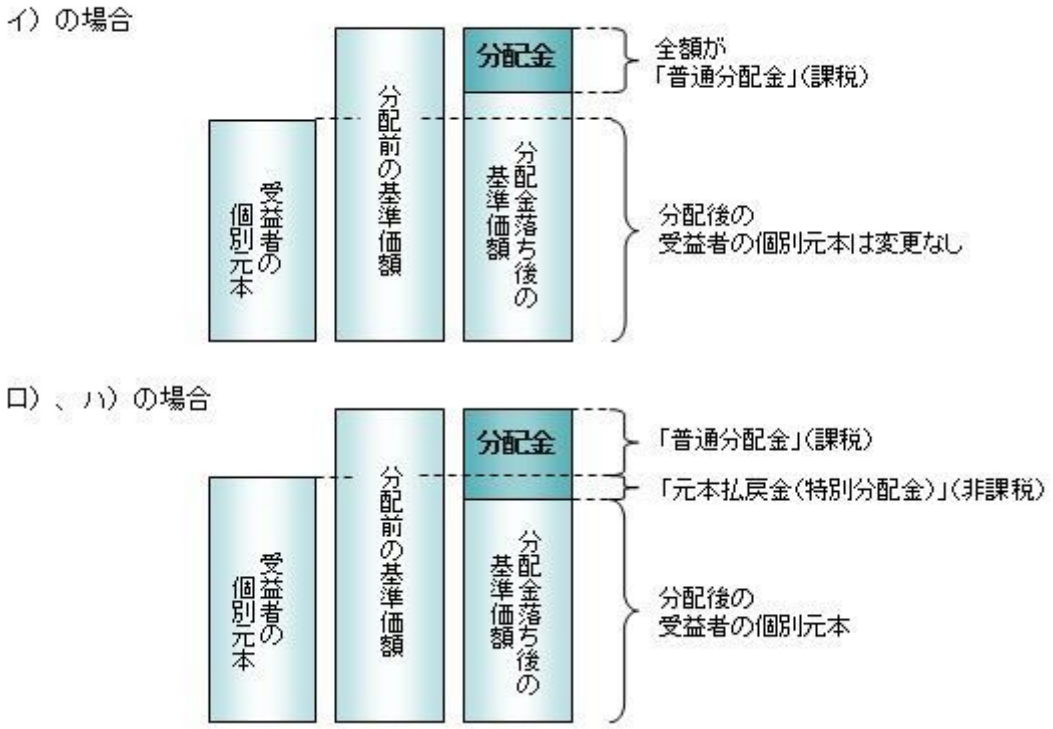
２）受益者が収益分配金を受け取る際

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

ロ）収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の１口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。

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

＜分配金に関するイメージ図＞



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

※上記は2023年7月末現在のものですので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

５【運用状況】

【九州ＳＤＧｓ・グローバルバランス】

以下の運用状況は2023年 7月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

（１）【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）

親投資信託受益証券	日本	2,333,518,863	99.85
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	―	3,541,222	0.15
合計（純資産総額）		2,337,060,085	100.00

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	RM先進国株式ＥＳＧマザーファンド	419,041,242	1.8581	778,620,532	1.8777	786,833,740	33.67
日本	親投資信託受益証券	RM米ドル建ＳＤＧｓ債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	385,258,141	0.8796	338,873,061	0.8708	335,482,789	14.35
日本	親投資信託受益証券	RM国内株式ＥＳＧマザーファンド	179,738,088	1.4936	268,456,809	1.5352	275,933,912	11.81
日本	親投資信託受益証券	RM国内債券マザーファンド（九州重視型）	246,756,687	0.9835	242,685,202	0.9788	241,525,445	10.33
日本	親投資信託受益証券	RMユーロ建ＳＤＧｓ債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	260,784,613	0.8724	227,508,497	0.8710	227,143,397	9.72
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	119,634,945	1.5180	181,605,847	1.5135	181,067,489	7.75
日本	親投資信託受益証券	RM新興国株式マザーファンド	83,565,205	1.7307	144,626,300	1.7850	149,163,890	6.38
日本	親投資信託受益証券	RM国内リートマザーファンド	61,839,718	1.4542	89,927,318	1.4555	90,007,709	3.85
日本	親投資信託受益証券	RM新興国債券マザーファンド	35,517,117	1.2953	46,005,322	1.3053	46,360,492	1.98

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

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第1計算期間末　(2022年 7月20日)	2,698	2,698	0.9719	0.9719
第2計算期間末　(2023年 7月20日)	2,347	2,347	1.0411	1.0411
2022年 7月末日	2,720	—	0.9803	—
8月末日	2,690	—	0.9710	—
9月末日	2,530	—	0.9295	—
10月末日	2,629	—	0.9653	—
11月末日	2,617	—	0.9621	—
12月末日	2,517	—	0.9269	—
2023年 1月末日	2,574	—	0.9488	—
2月末日	2,566	—	0.9553	—
3月末日	2,562	—	0.9583	—
4月末日	2,588	—	0.9729	—
5月末日	2,599	—	0.9976	—
6月末日	2,480	—	1.0398	—
7月末日	2,337	—	1.0475	—

②【分配の推移】

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

③【収益率の推移】

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

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

（４）【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	2021年11月18日～2022年 7月20日	2,879,487,008	103,252,540
第2期	2022年 7月21日～2023年 7月20日	30,165,358	551,988,172

(注)第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

（参考）

ＲＭ国内債券マザーファンド（九州重視型）

以下の運用状況は2023年 7月31日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	日本	424,398,660	34.84
地方債証券	日本	781,631,000	64.17
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	―	12,088,992	0.99
合計（純資産総額）		1,218,118,652	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
日本	国債証券	第１４８回利付国債（５年）	100,000,000	100.14	100,145,000	99.98	99,985,000	0.005	2026/6/20	8.21
日本	地方債証券	令和４年度第１回宮崎県公募公債	100,000,000	100.15	100,151,000	99.87	99,870,000	0.210	2027/11/30	8.20
日本	地方債証券	令和４年度第１回鹿児島県公募公債	100,000,000	99.89	99,893,000	99.64	99,641,000	0.145	2027/10/29	8.18
日本	地方債証券	令和３年度第１回鹿児島県公募公債	100,000,000	99.67	99,678,000	99.50	99,504,000	0.001	2026/10/29	8.17
日本	国債証券	第１４３回利付国債（５年）	98,000,000	100.28	98,277,340	100.21	98,207,760	0.100	2025/3/20	8.06
日本	地方債証券	令和４年度第３回熊本県公募公債	100,000,000	98.50	98,501,000	97.49	97,496,000	0.444	2032/10/28	8.00
日本	地方債証券	令和４年度第２回大分県公募公債	100,000,000	98.50	98,500,000	97.45	97,453,000	0.444	2032/10/29	8.00
日本	地方債証券	令和３年度第４回熊本県公募公債	100,000,000	96.64	96,640,000	95.92	95,929,000	0.135	2031/10/28	7.88
日本	地方債証券	令和３年度第２回大分県公募公債	100,000,000	96.63	96,639,000	95.92	95,927,000	0.135	2031/10/29	7.88
日本	地方債証券	令和３年度第１回宮崎県公募公債	100,000,000	96.52	96,529,000	95.81	95,811,000	0.130	2031/11/28	7.87
日本	国債証券	第４２７回利付国債（２年）	88,000,000	100.00	88,004,400	100.00	88,000,000	0.005	2023/8/1	7.22
日本	国債証券	第３５３回利付国債（１０年）	80,000,000	99.78	79,827,200	99.36	79,488,800	0.100	2028/12/20	6.53
日本	国債証券	第３６０回利付国債（１０年）	50,000,000	98.73	49,367,500	97.98	48,993,000	0.100	2030/9/20	4.02
日本	国債証券	第３６７回日本国債（１０年）	10,000,000	98.10	9,810,900	97.24	9,724,100	0.200	2032/6/20	0.80

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	34.84
地方債証券	64.17
合　　計	99.01

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

ＲＭ米ドル建ＳＤＧｓ債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

以下の運用状況は2023年 7月31日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	アメリカ	126,542,907	5.64
特殊債券	ドイツ	126,402,561	5.64
	国際機関	2,042,595,820	91.12
	小計	2,168,998,381	96.75
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	―	△53,797,061	△2.40
合計（純資産総額）		2,241,744,227	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	売建	―	2,322,442,529	△103.60

(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	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000	13,773.90	137,739,031	13,790.86	137,908,697	2.250	2024/3/28	6.15

国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000	14,062.48	140,624,892	13,646.20	136,462,075	3.625	2029/9/21	6.09
国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000	13,780.80	137,808,015	13,559.08	135,590,881	2.875	2025/6/13	6.05
国際機関	特殊債券	INTER-AMERICAN DEVEL BK	1,000,000	13,958.71	139,587,148	13,552.57	135,525,782	3.500	2029/9/14	6.05
国際機関	特殊債券	EUROPEAN BK RECON & DEV	1,000,000	13,555.92	135,559,257	13,499.29	134,992,924	1.625	2024/9/27	6.02
国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000	13,806.52	138,065,211	13,429.58	134,295,830	3.125	2027/6/15	5.99
国際機関	特殊債券	INTER-AMERICAN DEVEL BK	1,000,000	13,801.14	138,011,448	13,391.12	133,911,288	3.500	2033/4/12	5.97
国際機関	特殊債券	INTL FINANCE CORP	1,000,000	13,442.12	134,421,272	13,199.52	131,995,249	2.125	2026/4/7	5.89
国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000	12,980.78	129,807,881	12,813.53	128,135,338	0.500	2025/10/28	5.72
ドイツ	特殊債券	KFW	1,000,000	12,886.53	128,865,390	12,640.25	126,402,561	1.000	2026/10/1	5.64
国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000	12,836.48	128,364,803	12,467.82	124,678,249	2.500	2032/3/29	5.56
国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000	12,666.58	126,665,810	12,335.43	123,354,372	1.375	2028/4/20	5.50
国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000	12,377.05	123,770,517	12,104.83	121,048,304	0.625	2027/10/21	5.40
国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000	12,381.56	123,815,645	12,039.85	120,398,543	1.125	2028/9/13	5.37
国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000	12,000.65	120,006,563	11,693.92	116,939,276	1.625	2031/11/3	5.22
国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000	11,756.87	117,568,794	11,386.65	113,866,547	0.875	2030/5/17	5.08
国際機関	特殊債券	INTER-AMERICAN DEVEL BK	1,000,000	11,753.58	117,535,848	11,349.24	113,492,465	1.125	2031/1/13	5.06
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	370,000	14,625.68	54,115,034	14,248.98	52,721,237	4.125	2032/11/15	2.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	420,000	12,142.69	50,999,312	11,893.79	49,953,930	1.625	2031/5/15	2.23
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	170,000	13,981.61	23,768,748	14,039.84	23,867,740	2.875	2023/9/30	1.06

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	5.64
特殊債券	96.75
合　　計	102.40

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	16,533,900.00	2,211,886,485	2,322,442,529	△103.60

(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。

ＲＭユーロ建ＳＤＧｓ債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

以下の運用状況は2023年 7月31日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	フランス	137,596,836	8.52
特殊債券	ドイツ	133,424,056	8.26
	国際機関	1,396,609,515	86.48
	小計	1,530,033,571	94.75
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	―	△52,753,576	△3.27
合計（純資産総額）		1,614,876,831	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	売建	―	1,671,350,882	△103.50

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000	15,323.52	153,235,220	15,407.10	154,071,003	0.500	2023/11/15	9.54
国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000	15,307.36	153,073,656	15,217.07	152,170,762	2.900	2033/1/19	9.42
国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000	14,919.37	149,193,790	14,810.09	148,100,903	2.250	2030/3/15	9.17
国際機関	特殊債券	ASIAN DEVELOPMENT BANK	1,000,000	14,619.44	146,194,448	14,609.51	146,095,176	0.350	2025/7/16	9.05
国際機関	特殊債券	EUROPEAN UNION	1,000,000	14,475.12	144,751,247	14,475.28	144,752,800	0.000	2025/11/4	8.96
国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000	13,959.20	139,592,072	13,914.56	139,145,643	0.000	2027/1/15	8.62
国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000	13,708.14	137,081,462	13,665.99	136,659,997	0.000	2027/11/15	8.46
ドイツ	特殊債券	KFW	1,000,000	13,400.84	134,008,483	13,342.40	133,424,056	0.000	2028/9/15	8.26
国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000	12,964.18	129,641,876	12,930.09	129,300,990	0.050	2029/11/15	8.01
国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000	12,512.19	125,121,997	12,493.49	124,934,956	0.010	2030/11/15	7.74
国際機関	特殊債券	INTL DEVELOPMENT ASSOC	1,000,000	12,161.26	121,612,640	12,137.72	121,377,285	0.000	2031/7/15	7.52

フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	160,000	15,409.93	24,655,897	15,376.72	24,602,767	2.250	2024/5/25	1.52
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	150,000	15,280.93	22,921,406	15,215.50	22,823,261	1.750	2024/11/25	1.41
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	120,000	14,171.42	17,005,705	14,068.55	16,882,270	0.750	2028/5/25	1.05
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	110,000	14,574.93	16,032,431	14,497.06	15,946,766	0.500	2026/5/25	0.99
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	110,000	13,690.99	15,060,094	13,606.11	14,966,726	0.500	2029/5/25	0.93
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	100,000	14,577.56	14,577,562	14,469.62	14,469,625	1.000	2027/5/25	0.90
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	120,000	12,061.87	14,474,247	12,034.77	14,441,734	0.000	2032/5/25	0.89
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	110,000	12,269.34	13,496,280	12,239.71	13,463,687	0.000	2031/11/25	0.83

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	8.52
特殊債券	94.75
合　　計	103.27

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（%）
為替予約取引	ユーロ	売建	10,785,400.00	1,574,292,852	1,671,350,882	△103.50

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

ＲＭ新興国債券マザーファンド

以下の運用状況は2023年 7月31日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資信託受益証券	アメリカ	1,992,899,769	19.00
	アイルランド	8,262,464,617	78.76
	小計	10,255,364,386	97.76
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	―	234,662,720	2.24
合計（純資産総額）		10,490,027,106	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	1,282,247	6,267.39	8,036,343,851	6,443.73	8,262,464,617	78.76
アメリカ	投資信託受益証券	VANECK J.P.MORGAN EM LOCAL	545,832	3,566.54	1,946,732,207	3,651.12	1,992,899,769	19.00

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	97.76
合　　計	97.76

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

ＲＭ国内株式ＥＳＧマザーファンド

以下の運用状況は2023年 7月31日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	日本	3,312,128,290	90.80
投資証券	日本	42,202,500	1.16
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	―	293,413,737	8.04
合計（純資産総額）		3,647,744,527	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	288,548,000	7.91

(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	105,800	2,023.53	214,090,334	2,386.00	252,438,800	6.92
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	12,600	11,634.37	146,593,181	13,315.00	167,769,000	4.60
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	4,500	15,691.27	70,610,745	21,245.00	95,602,500	2.62
日本	株式	日立製作所	電気機器	9,400	7,420.55	69,753,220	9,298.00	87,401,200	2.40
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	13,000	4,932.61	64,123,987	6,694.00	87,022,000	2.39
日本	株式	第一三共	医薬品	18,500	4,558.79	84,337,667	4,347.00	80,419,500	2.20
日本	株式	ダイキン工業	機械	2,600	23,430.56	60,919,474	28,690.00	74,594,000	2.04
日本	株式	三井物産	卸売業	13,100	4,077.81	53,419,338	5,541.00	72,587,100	1.99
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	14,400	4,285.47	61,710,774	4,933.00	71,035,200	1.95
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	11,900	4,401.20	52,374,324	5,750.00	68,425,000	1.88
日本	株式	任天堂	その他製品	10,400	5,818.23	60,509,680	6,450.00	67,080,000	1.84
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	14,900	4,112.66	61,278,741	4,187.00	62,386,300	1.71
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	1,700	27,143.46	46,143,887	35,560.00	60,452,000	1.66
日本	株式	ＨＯＹＡ	精密機器	3,600	17,492.38	62,972,586	16,530.00	59,508,000	1.63
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	10,900	4,254.12	46,370,006	5,450.00	59,405,000	1.63
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	18,000	2,824.71	50,844,940	3,259.00	58,662,000	1.61
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	24,100	2,062.62	49,709,209	2,404.00	57,936,400	1.59
日本	株式	村田製作所	電気機器	5,700	7,688.92	43,826,859	8,325.00	47,452,500	1.30
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	28,700	1,507.50	43,265,279	1,578.00	45,288,600	1.24
日本	株式	ファナック	電気機器	9,600	4,234.24	40,648,726	4,348.00	41,740,800	1.14
日本	株式	パナソニック　ホールディングス	電気機器	22,000	1,288.24	28,341,317	1,760.00	38,720,000	1.06
日本	株式	丸紅	卸売業	15,300	1,667.85	25,518,231	2,513.50	38,456,550	1.05
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	18,100	2,089.62	37,822,263	2,080.50	37,657,050	1.03
日本	株式	アドバンテスト	電気機器	1,900	10,638.64	20,213,424	19,525.00	37,097,500	1.02
日本	株式	小松製作所	機械	9,200	3,219.54	29,619,799	3,964.00	36,468,800	1.00
日本	株式	ルネサスエレクトロニクス	電気機器	12,700	2,313.43	29,380,679	2,755.50	34,994,850	0.96
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	5,700	5,267.77	30,026,289	5,893.00	33,590,100	0.92
日本	株式	富士通	電気機器	1,800	18,525.68	33,346,239	18,385.00	33,093,000	0.91
日本	株式	オリックス	その他金融業	11,700	2,267.44	26,529,129	2,731.00	31,952,700	0.88
日本	株式	富士フイルムホールディングス	化学	3,700	7,356.16	27,217,795	8,247.00	30,513,900	0.84

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	鉱業	0.49
		建設業	1.55
		食料品	3.11

		繊維製品	0.40
		化学	5.11
		医薬品	4.75
		石油・石炭製品	0.41
		ゴム製品	0.93
		ガラス・土石製品	0.38
		鉄鋼	1.18
		非鉄金属	0.58
		金属製品	0.14
		機械	5.48
		電気機器	20.14
		輸送用機器	7.41
		精密機器	2.07
		その他製品	2.62
		電気・ガス業	0.97
		陸運業	2.51
		海運業	0.45
		空運業	0.15
		倉庫・運輸関連業	0.02
		情報・通信業	5.14
		卸売業	5.06
		小売業	3.31
		銀行業	4.93
		証券、商品先物取引業	0.75
		保険業	3.08
		その他金融業	0.94
		不動産業	1.91
		サービス業	4.83
投資証券	—	—	1.16
合　　計			91.96

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	5	日本円	111,912,750	116,350,000	3.19
	大阪取引所	ミニＴＯＰＩＸ先物	買建	74	日本円	167,164,890	172,198,000	4.72

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

ＲＭ先進国株式ＥＳＧマザーファンド

以下の運用状況は2023年 7月31日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	アメリカ	4,508,015,854	66.17
	カナダ	228,183,291	3.35
	ドイツ	95,988,748	1.41
	イタリア	33,520,617	0.49
	フランス	249,406,171	3.66
	オランダ	158,901,162	2.33
	スペイン	34,505,451	0.51
	ベルギー	6,147,608	0.09
	オーストリア	2,875,419	0.04
	ルクセンブルク	1,859,540	0.03
	フィンランド	29,336,639	0.43
	アイルランド	175,789,901	2.58
	ポルトガル	3,455,237	0.05
	イギリス	267,393,209	3.92
	スイス	169,890,178	2.49
	スウェーデン	57,157,213	0.84
	ノルウェー	21,886,282	0.32
	デンマーク	100,216,240	1.47
	ケイマン	2,524,421	0.04
	オーストラリア	99,474,579	1.46
	バミューダ	12,032,119	0.18
	ニュージーランド	6,166,824	0.09
	香港	39,055,821	0.57
	シンガポール	12,305,865	0.18
	イスラエル	2,937,261	0.04
	キュラソー	18,964,849	0.28
	ジャージー	22,251,470	0.33
	小計	6,360,241,969	93.36
投資証券	アメリカ	116,712,485	1.71
	カナダ	1,243,589	0.02
	フランス	2,367,956	0.03
	イギリス	2,936,844	0.04
	オーストラリア	15,341,453	0.23
	シンガポール	1,865,280	0.03

	小計	140,467,607	2.06
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	—	312,073,240	4.58
合計（純資産総額）		6,812,782,816	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	253,257,534	3.72
	買建	ドイツ	58,709,872	0.86

(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	—	11,416,291	0.17

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	11,815	35,201.61	415,907,125	47,700.01	563,575,723	8.27
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	4,126	24,947.46	102,933,224	65,903.47	271,917,738	3.99
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	9,953	13,792.50	137,276,800	18,689.80	186,019,605	2.73
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	4,762	25,648.08	122,136,166	37,560.04	178,860,943	2.63
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	8,969	13,853.12	124,248,650	18,750.41	168,172,514	2.47
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	4,336	24,465.34	106,081,729	24,596.44	106,650,188	1.57
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	2,713	30,157.71	81,817,873	33,233.67	90,162,967	1.32
アメリカ	株式	ELI LILLY & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1,348	50,338.97	67,856,942	64,631.92	87,123,836	1.28
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	3,938	20,622.50	81,211,410	22,049.11	86,829,425	1.27
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	一般消費財・サービス流通・小売り	1,689	44,783.34	75,639,078	46,713.22	78,898,644	1.16
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	金融サービス	1,421	49,618.62	70,508,060	55,395.57	78,717,107	1.16

オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	673	90,531.76	60,927,878	101,443.54	68,271,509	1.00
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	4,232	15,078.15	63,810,736	14,990.74	63,440,853	0.93
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	2,296	25,801.73	59,240,793	26,828.00	61,597,090	0.90
デンマーク	株式	NOVO NORDISK A/S-B	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2,760	18,389.07	50,753,846	22,034.28	60,814,613	0.89
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	6,852	8,771.15	60,099,943	8,807.80	60,351,084	0.89
フランス	株式	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	耐久消費財・アパレル	461	117,261.28	54,057,454	130,680.42	60,243,674	0.88
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	765	47,922.75	36,660,905	74,554.80	57,034,425	0.84
アメリカ	株式	SALESFORCE INC	ソフトウェア・サービス	1,667	22,025.15	36,715,930	31,802.83	53,015,321	0.78
イギリス	株式	ASTRAZENECA PLC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2,583	19,982.73	51,615,407	20,037.09	51,755,819	0.76
アメリカ	株式	MCDONALD'S CORP	消費者サービス	1,216	38,427.01	46,727,247	41,449.40	50,402,481	0.74
スイス	株式	NOVARTIS AG-REG	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	3,417	14,119.91	48,247,766	14,620.49	49,958,248	0.73
アイルランド	株式	ACCENTURE PLC-CL A	ソフトウェア・サービス	1,053	41,022.26	43,196,450	44,483.08	46,840,687	0.69
アイルランド	株式	LINDE PLC	素材	817	48,159.58	39,346,378	54,796.44	44,768,699	0.66
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア・娯楽	7,012	5,547.16	38,896,753	6,376.07	44,709,025	0.66
アメリカ	株式	DANAHER CORP	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1,153	32,369.53	37,322,069	36,662.06	42,271,364	0.62
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	33,272	925.93	30,807,609	1,172.00	38,994,836	0.57
アメリカ	株式	TEXAS INSTRUMENTS INC	半導体・半導体製造装置	1,513	25,160.32	38,067,573	25,144.81	38,044,111	0.56
アメリカ	株式	WALT DISNEY CO/THE	メディア・娯楽	3,045	13,913.73	42,367,335	12,141.74	36,971,617	0.54
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	6,953	4,167.07	28,973,660	5,191.92	36,099,455	0.53

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／国外	業種	投資比率（%）
株式	国外	エネルギー	3.04
		素材	3.97
		資本財	5.78

		商業・専門サービス	1.76
		運輸	2.62
		自動車・自動車部品	3.18
		耐久消費財・アパレル	2.49
		消費者サービス	1.67
		メディア・娯楽	7.07
		一般消費財・サービス流通・小売り	3.32
		生活必需品流通・小売り	0.94
		食品・飲料・タバコ	2.99
		家庭用品・パーソナル用品	3.00
		ヘルスケア機器・サービス	2.66
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.41
		銀行	3.77
		金融サービス	7.10
		保険	3.35
		ソフトウェア・サービス	14.07
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	0.58
		電気通信サービス	1.07
		公益事業	1.88
		半導体・半導体製造装置	7.39
		不動産管理・開発	0.26
投資証券	—	—	2.06
合　　計			95.42

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	SP500MIN2309	買建	3	米ドル	666,975	94,023,465	690,975	97,406,745	1.43
	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP500MIC2309	買建	48	米ドル	1,084,140	152,831,220	1,105,560	155,850,789	2.29
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	STX E6002309	買建	16	ユーロ	365,400	56,764,893	377,920	58,709,872	0.86

(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	70,000.00	9,862,902	9,863,294	0.14

	ユーロ	買建	10,000.00	1,552,921	1,552,997	0.02

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

ＲＭ新興国株式マザーファンド

以下の運用状況は2023年 7月31日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	アメリカ	121,099,170	0.43
	メキシコ	711,612,389	2.53
	ブラジル	1,435,868,938	5.11
	チリ	145,290,420	0.52
	コロンビア	27,188,648	0.10
	ペルー	5,923,619	0.02
	オランダ	15,496,077	0.06
	ルクセンブルク	27,156,351	0.10
	ギリシャ	117,855,909	0.42
	トルコ	161,808,275	0.58
	チェコ	40,475,320	0.14
	キプロス	0	0.00
	ハンガリー	59,925,845	0.21
	ポーランド	206,052,294	0.73
	ロシア	0	0.00
	ケイマン	4,650,634,273	16.54
	バミューダ	118,536,889	0.42
	香港	266,157,723	0.95
	シンガポール	7,157,691	0.03
	マレーシア	359,979,094	1.28
	タイ	512,696,982	1.82
	フィリピン	168,533,557	0.60
	インドネシア	506,929,889	1.80
	韓国	3,255,405,842	11.58
	台湾	3,854,278,181	13.70
	中国	2,987,992,883	10.62
	インド	3,712,706,873	13.20
	カタール	242,589,554	0.86
	エジプト	18,521,864	0.07
	南アフリカ	874,656,353	3.11
	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	335,360,281	1.19
	クウェート	214,058,357	0.76
	サウジアラビア	1,088,139,621	3.87
	小計	26,250,089,162	93.34
投資証券	メキシコ	20,790,331	0.07
	南アフリカ	8,252,404	0.03
	小計	29,042,735	0.10
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	―	1,844,961,927	6.56
合計（純資産総額）		28,124,093,824	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	1,850,201,627	6.58

(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。

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	―	22,645,379	0.08
	売建	―	520,556	△0.00

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	652,000	2,261.73	1,474,654,435	2,543.61	1,658,439,392	5.90
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	164,400	7,003.46	1,151,370,271	6,335.23	1,041,512,141	3.70
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	126,333	6,850.40	865,432,303	7,801.30	985,561,633	3.50
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	一般消費財・サービス流通・小売り	437,740	1,958.38	857,265,065	1,733.87	758,985,129	2.70
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	80,649	4,123.74	332,575,529	4,347.90	350,653,948	1.25
ケイマン	株式	MEITUAN	消費者サービス	133,810	2,930.85	392,177,491	2,574.59	344,506,156	1.22
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	136,870	1,501.16	205,463,955	1,713.46	234,521,818	0.83
インド	株式	HDFC BANK LIMITED	銀行	73,394	2,823.49	207,227,869	2,826.81	207,471,627	0.74
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	2,546,000	92.70	236,028,142	80.99	206,221,926	0.73

韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	14,474	9,679.03	140,094,411	14,144.00	204,720,256	0.73
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	87,548	2,607.55	228,286,173	2,305.66	201,855,922	0.72
ブラジル	株式	VALE SA	素材	89,704	2,750.83	246,760,613	2,014.27	180,688,829	0.64
ケイマン	株式	JD.COM INC - CL A	一般消費財・サービス流通・小売り	62,210	3,917.72	243,721,951	2,773.47	172,537,693	0.61
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	168,000	1,093.56	183,719,651	1,015.19	170,552,256	0.61
ケイマン	株式	PDD HOLDINGS INC	一般消費財・サービス流通・小売り	13,382	13,021.76	174,257,198	12,595.66	168,555,249	0.60
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	330,800	443.56	146,732,171	491.22	162,498,206	0.58
ケイマン	株式	BAIDU INC-CLASS A	メディア・娯楽	59,530	2,380.90	141,735,560	2,688.49	160,046,167	0.57
ケイマン	株式	NETEASE INC	メディア・娯楽	52,100	2,532.24	131,930,169	3,046.48	158,721,608	0.56
サウジアラビア	株式	AL RAJHI BANK	銀行	51,979	2,963.21	154,025,050	2,823.00	146,736,717	0.52
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	一般消費財・サービス流通・小売り	5,199	27,333.80	142,108,450	27,721.88	144,126,101	0.51
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	21,845	6,135.33	134,026,304	6,475.30	141,452,929	0.50
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	24,319	5,843.36	142,104,870	5,771.28	140,351,953	0.50
韓国	株式	POSCO HOLDINGS INC	素材	1,912	34,775.30	66,490,387	68,399.50	130,779,844	0.47
中国	株式	BYD CO LTD-H	自動車・自動車部品	26,500	4,118.93	109,151,818	4,903.29	129,937,344	0.46
インドネシア	株式	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	銀行	1,473,900	78.43	115,609,300	85.77	126,423,772	0.45
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL SAB DE CV	電気通信サービス	830,200	166.10	137,901,292	151.34	125,645,027	0.45
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	39,800	3,068.32	122,119,474	2,951.85	117,483,781	0.42
サウジアラビア	株式	THE SAUDI NATIONAL BANK	銀行	78,054	1,354.75	105,744,043	1,494.30	116,636,717	0.41
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	エネルギー	126,500	785.93	99,421,260	886.36	112,125,285	0.40
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	銀行	129,000	756.78	97,624,962	850.02	109,653,825	0.39

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	4.57
		素材	7.73
		資本財	3.94
		商業・専門サービス	0.05

		運輸	1.94
		自動車・自動車部品	3.56
		耐久消費財・アパレル	1.28
		消費者サービス	2.69
		メディア・娯楽	6.33
		一般消費財・サービス流通・小売り	5.58
		生活必需品流通・小売り	1.51
		食品・飲料・タバコ	3.58
		家庭用品・パーソナル用品	0.76
		ヘルスケア機器・サービス	1.08
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.49
		銀行	15.22
		金融サービス	2.43
		保険	2.61
		ソフトウェア・サービス	2.11
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8.50
		電気通信サービス	2.84
		公益事業	2.39
		半導体・半導体製造装置	8.55
		不動産管理・開発	1.59
投資証券	—	—	0.10
合　　計			93.44

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	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 2309	買建	249	米ドル	12,679,485	1,787,427,000	13,124,790	1,850,201,627	6.58

(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。

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	160,689.20	22,402,344	22,645,379	0.08
	オフショア人民元	売建	26,401.82	513,609	520,556	△0.00

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

RM国内リートマザーファンド

以下の運用状況は2023年 7月31日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資証券	日本	45,965,456,900	98.76
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	―	575,922,196	1.24
合計（純資産総額）		46,541,379,096	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	561,214,500	1.21

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	5,052	568,094.47	2,870,013,269	596,000	3,010,992,000	6.47
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	4,449	553,407.31	2,462,109,133	572,000	2,544,828,000	5.47
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	14,005	155,121.18	2,172,472,171	169,200	2,369,646,000	5.09
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	7,545	293,649.48	2,215,585,390	290,700	2,193,331,500	4.71
日本	投資証券	ＧＬＰ投資法人	14,629	144,261.6	2,110,403,084	140,100	2,049,522,900	4.40
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	20,759	98,725.95	2,049,451,996	97,500	2,024,002,500	4.35
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	6,528	280,021.73	1,827,981,857	280,000	1,827,840,000	3.93
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	8,629	176,893.57	1,526,414,686	180,900	1,560,986,100	3.35
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	9,688	148,236.2	1,436,112,346	153,500	1,487,108,000	3.20
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	4,114	330,843.9	1,361,091,804	346,500	1,425,501,000	3.06
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	20,968	55,804.35	1,170,105,679	58,900	1,235,015,200	2.65
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	13,014	74,422.8	968,538,329	84,400	1,098,381,600	2.36
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	2,962	354,139.02	1,048,959,784	354,000	1,048,548,000	2.25
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	1,495	601,769.44	899,645,319	674,000	1,007,630,000	2.17
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	13,966	80,641.65	1,126,241,341	70,600	985,999,600	2.12
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	6,608	148,421.75	980,770,950	148,800	983,270,400	2.11
日本	投資証券	アクティビア・プロパティーズ投資法人	2,272	393,051.55	893,013,133	414,000	940,608,000	2.02
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	1,711	465,531.03	796,523,608	506,000	865,766,000	1.86
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	2,520	315,516.78	795,102,290	338,000	851,760,000	1.83
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	5,536	156,350.19	865,554,675	152,100	842,025,600	1.81

日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	2,774	303,471.09	841,828,803	300,500	833,587,000	1.79
日本	投資証券	イオンリート投資法人	5,312	149,077.38	791,899,052	149,700	795,206,400	1.71
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	1,607	491,638.17	790,062,552	472,500	759,307,500	1.63
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	5,093	150,207.56	765,007,153	144,700	736,957,100	1.58
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	3,179	205,046.22	651,841,961	222,500	707,327,500	1.52
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	2,074	310,979	644,970,450	340,500	706,197,000	1.52
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	6,008	110,485.97	663,799,733	113,900	684,311,200	1.47
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	4,052	155,213.44	628,924,886	165,000	668,580,000	1.44
日本	投資証券	森トラストリート投資法人	8,348	72,136.46	602,195,179	73,300	611,908,400	1.31
日本	投資証券	三菱地所物流リート投資法人	1,495	404,789.4	605,160,153	407,000	608,465,000	1.31

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
投資証券	98.76
合　　計	98.76

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	301	日本円	556,863,210	561,214,500	1.21

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

ＲＭ先進国リートマザーファンド

以下の運用状況は2023年 7月31日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	アメリカ	546,692,569	0.91
	オーストラリア	36,145,608	0.06
	小計	582,838,177	0.97
投資証券	アメリカ	46,022,814,653	76.58
	カナダ	1,001,005,272	1.67
	ドイツ	24,338,420	0.04
	イタリア	5,676,376	0.01

	フランス	1,041,243,814	1.73
	オランダ	117,403,147	0.20
	スペイン	245,822,292	0.41
	ベルギー	627,666,526	1.04
	アイルランド	19,959,578	0.03
	イギリス	2,734,911,424	4.55
	オーストラリア	3,906,572,656	6.50
	ニュージーランド	244,930,917	0.41
	香港	747,069,396	1.24
	シンガポール	2,257,025,117	3.76
	韓国	134,695,402	0.22
	イスラエル	74,344,505	0.12
	ガーンジー	123,333,177	0.21
	小計	59,328,812,672	98.72
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	―	186,721,454	0.31
合計（純資産総額）		60,098,372,303	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	―	17,754,914	0.03
	売建	―	2,034,529	△0.00

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	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	299,967	17,447.13	5,233,563,606	17,430.94	5,228,706,929	8.70
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	30,377	100,425.49	3,050,625,265	112,403.83	3,414,491,423	5.68
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	51,400	42,306.29	2,174,543,739	39,687.28	2,039,926,403	3.39
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	218,732	9,020.72	1,973,121,790	8,665.42	1,895,405,938	3.15
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	106,242	16,448.83	1,747,556,864	17,547.94	1,864,328,836	3.10
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	161,467	10,497.49	1,694,998,597	11,419.97	1,843,949,862	3.07
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	94,644	14,149.25	1,339,142,074	17,308.29	1,638,126,423	2.73
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	326,234	4,668.25	1,522,942,274	4,481.43	1,461,996,890	2.43
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	68,617	21,090.58	1,447,172,982	19,854.21	1,362,336,657	2.27
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	46,138	24,165.27	1,114,937,254	26,238.74	1,210,603,268	2.01
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	556,344	1,822.16	1,013,748,645	1,926.18	1,071,618,686	1.78
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	110,810	8,622.75	955,486,930	9,136.26	1,012,389,602	1.68
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	188,908	4,494.13	848,977,666	5,000.20	944,578,896	1.57

アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	51,174	19,350.76	990,256,089	17,834.11	912,642,986	1.52
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	130,004	6,656.15	865,326,782	6,784.88	882,062,333	1.47
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	94,767	7,459.02	706,869,448	8,537.14	809,039,450	1.35
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	37,914	21,760.33	825,021,229	20,967.87	794,976,119	1.32
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	40,433	20,322.34	821,693,313	18,537.55	749,528,961	1.25
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	20,861	30,276.64	631,601,078	33,453.59	697,875,356	1.16
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	69,537	11,081.37	770,565,918	9,604.28	667,853,243	1.11
香港	投資証券	LINK REIT	828,600	993.09	822,878,201	797.32	660,665,981	1.10
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	230,278	2,404.28	553,654,195	2,562.83	590,164,426	0.98
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	201,600	2,862.57	577,095,327	2,844.77	573,506,559	0.95
アメリカ	投資証券	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	85,362	7,257.22	619,491,129	6,690.43	571,109,015	0.95
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	56,903	9,456.94	538,128,414	10,035.65	571,058,837	0.95
アメリカ	投資証券	UDR INC	100,586	5,709.50	574,296,395	5,672.63	570,587,443	0.95
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	177,827	3,387.36	602,364,416	3,063.27	544,733,555	0.91
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	398,356	1,430.74	569,944,577	1,366.61	544,397,452	0.91
アメリカ	投資証券	AMERICAN HOMES 4 RENT- A	102,151	4,594.36	469,319,476	5,214.48	532,664,377	0.89
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	34,709	15,559.35	540,049,537	15,296.65	530,931,588	0.88

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／国外	業種	投資比率（%）
株式	国外	エクイティ不動産投資信託（REIT）	0.97
投資証券	―	―	98.72
合　　計			99.69

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	英ポンド	買建	98,000.00	17,754,189	17,754,914	0.03
	オーストラリアドル	売建	18,000.00	1,690,808	1,691,065	△0.00
	香港ドル	売建	19,000.00	343,400	343,464	△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。

≪参考情報≫

運用実績

2023年7月31日現在

基準価額・純資産の推移

基準価額	10,475円	純資産総額	23.3億円

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

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

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

主要な資産の状況

■資産の組入比率

資産	比率(%)
RM国内債券マザーファンド(九州重視型)	10.3
RM米ドル建SDGs債券マザーファンド(為替ヘッジあり)	14.4
RMユーロ建SDGs債券マザーファンド(為替ヘッジあり)	9.7
RM新興国債券マザーファンド	2.0
RM国内株式ESGマザーファンド	11.8
RM先進国株式ESGマザーファンド	33.7
RM新興国株式マザーファンド	6.4
RM国内リートマザーファンド	3.9
RM先進国リートマザーファンド	7.7
その他	0.2
合計	100.0

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

■通貨別組入比率

通貨	比率(%)
日本円	50.3
米ドル	31.8
ユーロ	3.6
英ポンド	1.7
香港ドル	1.7
その他	10.9
合計	100.0

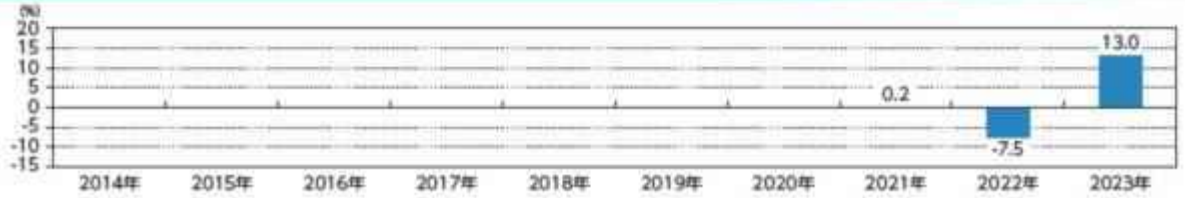
※比率はファンドの純資産総額に対する組入比率であり、四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。
※上記通貨別組入比率は、各マザーファンドが実質的に保有している株式・債券等の通貨を基準に算出しています。
※為替ヘッジをかけている外貨建資産については、日本円に含めています。

■各マザーファンドにおける組入上位銘柄

	国・地域	銘柄名	償還期限	比率(%)
国内債券(九州重視型)	日本	第148回利付国債(5年)	2026/6/20	8.21
	日本	令和4年度第1回宮崎県公募公債	2027/11/30	8.20
	日本	令和4年度第1回鹿児島県公募公債	2027/10/29	8.18
米ドル建SDGs債券(為替ヘッジあり)	国際機関	INTL BK RECON & DEVELOP	2024/3/28	6.15
	国際機関	INTL BK RECON & DEVELOP	2029/9/21	6.09
	国際機関	EUROPEAN INVESTMENT BANK	2025/6/13	6.05
ユーロ建SDGs債券(為替ヘッジあり)	国際機関	EUROPEAN INVESTMENT BANK	2023/11/15	9.54
	国際機関	INTL BK RECON & DEVELOP	2033/1/19	9.42
	国際機関	EUROPEAN INVESTMENT BANK	2030/3/15	9.17
新興国債券	アイルランド	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	—	78.76
	アメリカ	VANECK J.P.MORGAN EM LOCAL	—	19.00
国内株式ESG	日本	トヨタ自動車	—	6.92
	日本	ソニーグループ	—	4.60
	日本	東京エレクトロン	—	2.62
先進国株式ESG	アメリカ	MICROSOFT CORP	—	8.27
	アメリカ	NVIDIA CORP	—	3.99
	アメリカ	ALPHABET INC-CL A	—	2.73
新興国株式	台湾	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	—	5.90
	ケイマン	TENCENT HOLDINGS LTD	—	3.70
	韓国	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	—	3.50
国内リート	日本	日本ビルファンド投資法人	—	6.47
	日本	ジャパンリアルエステイト投資法人	—	5.47
	日本	野村不動産マスターファンド投資法人	—	5.09
先進国リート	アメリカ	PROLOGIS INC	—	8.70
	アメリカ	EQUINIX INC	—	5.68
	アメリカ	PUBLIC STORAGE	—	3.39

※比率は、各マザーファンドの純資産総額に対する組入比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)



※ファンドにベンチマークはありません。
※2021年11月18日が設定日のため、2020年以前の実績はありません。2021年は11月18日から12月末までの騰落率です。2023年は7月末までの騰落率です。
※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※運用実績は過去のものであり、将来の運用成果を約束するものではありません。
※運用実績については、別途、委託会社のホームページで開示しています。

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

（１）申込方法

販売会社所定の方法でお申し込みください。

（２）コースの選択

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

＜分配金再投資コース（自動けいぞく投資コース）＞

収益分配金を自動的に再投資するコースです。

＜分配金受取りコース（一般コース）＞

収益分配金を再投資せず、その都度受け取るコースです。

（３）申込みの受付

販売会社の営業日に受け付けます。

（４）取扱時間

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

（５）取得申込不可日

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

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

（６）申込金額

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

（７）申込単位

最低単位を1円または1口単位として販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

（８）申込代金の支払い

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

（９）受付の中止および取消

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

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

２【換金（解約）手続等】

（１）解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

（２）取扱時間

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

（３）解約請求不可日

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

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

（４）解約制限

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

い。

（５）解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

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

（６）手取額

１口当たりの手取額は、解約価額から解約に係る所定の税金を差し引いた金額となります。

※税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。

詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

（７）解約単位

最低単位を1口単位として販売会社が定める単位とします。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

（８）解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

（９）受付の中止および取消

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

・解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日（この計算日が解約請求を受け付けない日であるときは、この計算日以降の最初の解約請求を受け付けることができる日とします。）に解約請求を受け付けたものとして取り扱います。

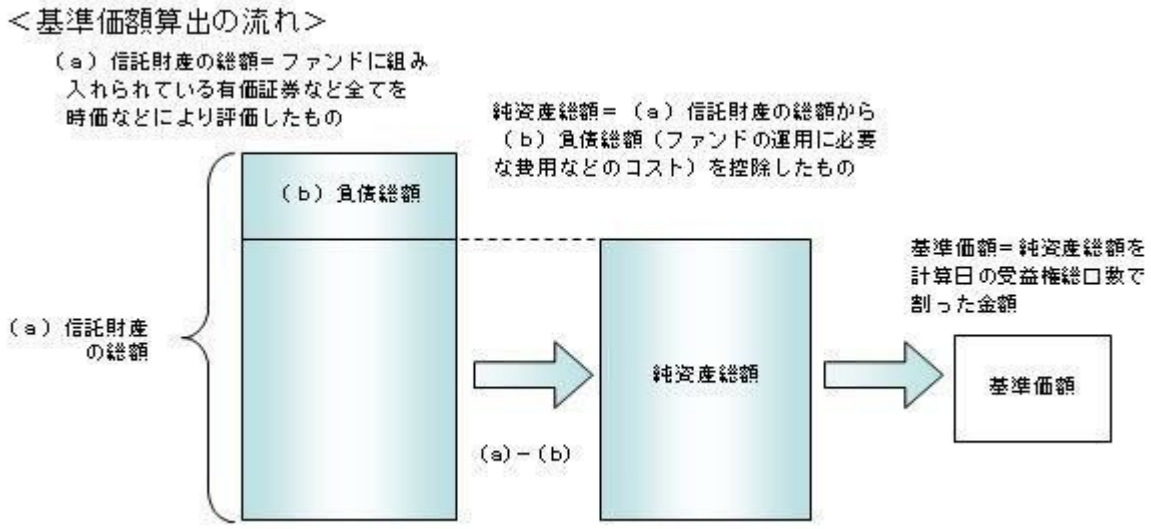
３【資産管理等の概要】

（１）【資産の評価】

① 基準価額の算出

・基準価額は委託会社の営業日において日々算出されます。

・基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）を評価して得た信託財産の総額から負債総額を控除した金額（純資産総額）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。なお、ファンドは１万口当たりに換算した価額で表示することがあります。



② 有価証券などの評価基準

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

＜主な資産の評価方法＞

◇マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

◇国内上場株式

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

◇外国株式

原則として、基準価額計算日に知りうる直近の日における外国金融商品市場の最終相場で評価します。

◇公社債（国内・外国）

原則として、基準価額計算日*における以下のいずれかの価額で評価します。

・日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

・金融商品取引業者（第一種金融商品取引業者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。）、銀行などの提示する価額（売気配相場を除きます。）

・価格情報会社の提供する価額

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

＊外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

◇国内上場不動産投信

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

◇海外上場不動産投信

原則として、基準価額計算日に知りうる直近の日における外国金融商品市場の最終相場で評価します。

・外貨建資産（外国通貨表示の有価証券、預金その他の資産をいいます。）の円換算については、原則としてわが国における計算日の対顧客相場の仲値によって計算します。

③　基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

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

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

無期限とします（2021年11月18日設定）。ただし、約款の規定に基づき、信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

（４）【計算期間】

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

（５）【その他】

①　信託の終了（繰上償還）

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

イ）信託財産の純資産総額が20億円を下回ることとなったとき

ロ）繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき
ハ）やむを得ない事情が発生したとき

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

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

イ）信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合で、書面決議が困難な場合
ロ）監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき
ハ）委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したとき（監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引き継ぐことを命じたときは、書面決議で可決された場合、存続します。）
ニ）受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合またはその任務に違反するなどして解任された場合に、委託会社が新受託会社を選任できないとき

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

② 償還金について

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

③ 信託約款の変更など

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

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

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

④ 書面決議

１）繰上償還、信託約款の重大な変更または併合に対して、委託会社は書面決議を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびにその内容および理由などの事項を定め、決議の日の２週間前までに知れている受益者に対し書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。

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

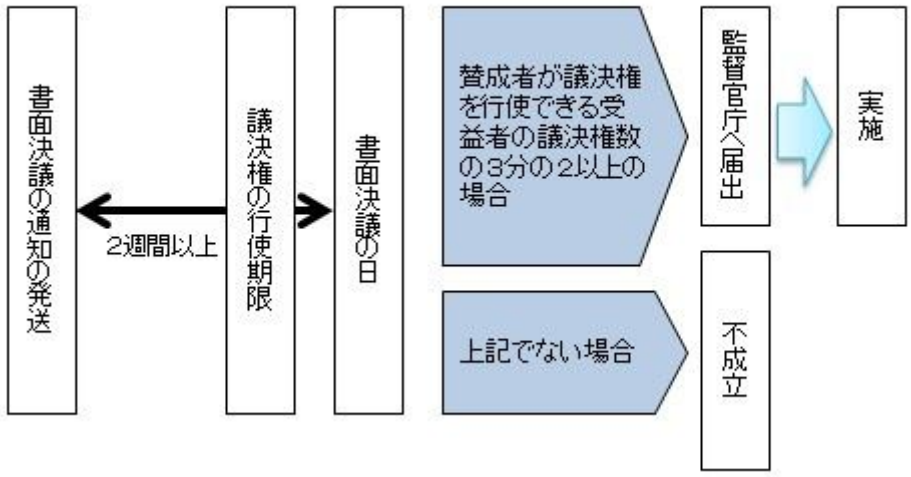
３）書面決議は、議決権を行使することができる受益者の議決権の３分の２以上にあたる多数をもって行ないます。

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

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

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

＜書面決議の主な流れ＞



⑤　公告

公告は電子公告により行ない、委託会社のホームページに掲載します。

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

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

⑥　運用報告書の作成

・委託会社は、毎期決算後および償還後に期中の運用経過、組入有価証券の内容および有価証券の売買状況などを記載した運用報告書を作成します。

・交付運用報告書は、原則として知れている受益者に対して交付されます。

・運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページに掲載されます。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の交付請求があった場合には、交付します。

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

⑦　関係法人との契約について

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

⑧　他の受益者の氏名などの開示の請求の制限

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

１．他の受益者の氏名または名称および住所

２．他の受益者が有する受益権の内容

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

（１）収益分配金・償還金受領権

・受益者は、ファンドの収益分配金・償還金を、自己に帰属する受益権の口数に応じて受領する権利を有します。

・ただし、受益者が収益分配金については支払開始日から５年間、償還金については支払開始日から10年間請求を行なわない場合はその権利を失い、その金銭は委託会社に帰属します。

（２）解約請求権

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

（３）帳簿閲覧権

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

第３【ファンドの経理状況】

（１）　当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

（２）　当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期計算期間(2022年 7月21日から2023年 7月20日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

１【財務諸表】

【九州ＳＤＧｓ・グローバルバランス】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

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

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自　2021年11月18日 至　2022年 7月20日	第2期 自　2022年 7月21日 至　2023年 7月20日
営業収益		
有価証券売買等損益	△48,285,287	204,315,150
営業収益合計	△48,285,287	204,315,150
営業費用		
支払利息	17,856	13,791
受託者報酬	568,859	854,895
委託者報酬	18,393,004	27,641,389
その他費用	148,755	174,152
営業費用合計	19,128,474	28,684,227
営業利益又は営業損失（△）	△67,413,761	175,630,923
経常利益又は経常損失（△）	△67,413,761	175,630,923
当期純利益又は当期純損失（△）	△67,413,761	175,630,923
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	△3,024,388	19,614,449
期首剰余金又は期首欠損金（△）	-	△77,982,759
剰余金増加額又は欠損金減少額	298,788	15,536,530
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	298,788	15,536,530
剰余金減少額又は欠損金増加額	13,892,174	975,794
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	13,892,174	975,794
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△77,982,759	92,594,451

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

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

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

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

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

第1期 自 2021年11月18日 至 2022年 7月20日	第2期 自 2022年 7月21日 至 2023年 7月20日
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	1.金融商品に対する取組方針 同左
2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、株価変動リスク、金利変動リスク、リートの価格変動リスク、投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。	2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左
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。	3.金融商品に係るリスク管理体制 同左

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

第1期 2022年 7月20日現在	第2期 2023年 7月20日現在
1.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	1.貸借対照表計上額、時価及び差額 同左
2.時価の算定方法 親投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	2.時価の算定方法 親投資信託受益証券 同左 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左
3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	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。	同左

（関連当事者との取引に関する注記）

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

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1　有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	第1期 自 2021年11月18日 至 2022年 7月20日	第2期 自 2022年 7月21日 至 2023年 7月20日
	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	△43,727,140	169,154,134
合計	△43,727,140	169,154,134

2　デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

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

(注)券面総額欄の数値は口数を表しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは「RM国内債券マザーファンド（九州重視型）」、「RM米ドル建ＳＤＧｓ債券マザーファンド（為替ヘッジあり）」、「RMユーロ建ＳＤＧｓ債券マザーファンド（為替ヘッジあり）」、「RM新興国債券マザーファンド」、「RM国内株式ＥＳＧマザーファンド」、「RM先進国株式ＥＳＧマザーファンド」、「RM新興国株式マザーファンド」、「RM国内リートマザーファンド」および「RM先進国リートマザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同親投資信託の受益証券です。

なお、以下に記載した状況は監査意見の対象外となっております。

RM国内債券マザーファンド（九州重視型）

貸借対照表

（単位：円）

	2023年 7月20日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	12,904,636
国債証券	425,432,340
地方債証券	786,531,000
未収利息	398,536
流動資産合計	1,225,266,512
資産合計	1,225,266,512
負債の部	
流動負債	
未払利息	35
流動負債合計	35
負債合計	35
純資産の部	
元本等	
元本	1,245,851,646
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△20,585,169
元本等合計	1,225,266,477
純資産合計	1,225,266,477
負債純資産合計	1,225,266,512

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

2023年 7月20日現在	
１． 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月21日
期首元本額	1,335,668,450円
期中追加設定元本額	10,612,535円
期中一部解約元本額	100,429,339円
期末元本額	1,245,851,646円
期末元本の内訳※	
九州ＳＤＧｓ・グローバルバランス	248,049,358円
りそな国内債券ファンド（九州重視型）（適格機関投資家専用）	997,802,288円

2．　計算日における受益権の総数	
	1,245,851,646口
3．　元本の欠損	
純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	20,585,169円
4．　計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	0.9835円
(10,000口当たり純資産額)	(9,835円)

（注）※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

2023年 7月20日現在
1．金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2．金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 3．金融商品に係るリスク管理体制 運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

2023年 7月20日現在
1．貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 2．時価の算定方法 国債証券、地方債証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。 3．金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

2023年 7月20日現在

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1　有価証券に関する注記

売買目的有価証券

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

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

2　デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種　類	銘　柄	券面総額	評価額	備考

国債証券	第４２７回利付国債（２年）	88,000,000	88,004,400	
	第１４３回利付国債（５年）	98,000,000	98,277,340	
	第１４８回利付国債（５年）	100,000,000	100,145,000	
	第３５３回利付国債（１０年）	80,000,000	79,827,200	
	第３６０回利付国債（１０年）	50,000,000	49,367,500	
	第３６７回日本国債（１０年）	10,000,000	9,810,900	
	国債証券合計	426,000,000	425,432,340	
地方債証券	令和３年度第２回大分県公募公債	100,000,000	96,639,000	
	令和４年度第２回大分県公募公債	100,000,000	98,500,000	
	令和３年度第４回熊本県公募公債	100,000,000	96,640,000	
	令和４年度第３回熊本県公募公債	100,000,000	98,501,000	
	令和３年度第１回宮崎県公募公債	100,000,000	96,529,000	
	令和４年度第１回宮崎県公募公債	100,000,000	100,151,000	
	令和３年度第１回鹿児島県公募公債	100,000,000	99,678,000	
	令和４年度第１回鹿児島県公募公債	100,000,000	99,893,000	
	地方債証券合計	800,000,000	786,531,000	
合計			1,211,963,340	

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

ＲＭ米ドル建ＳＤＧｓ債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

貸借対照表

（単位：円）

	2023年 7月20日現在
資産の部	
流動資産	
預金	4,520,478

	2023年 7月20日現在
コール・ローン	30,450,525
国債証券	127,050,230
特殊債券	2,168,065,097
派生商品評価勘定	26,510
未収利息	11,618,718
前払費用	868,912
流動資産合計	2,342,600,470
資産合計	2,342,600,470
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	85,811,466
未払金	1,359,268
未払解約金	1,853,000
未払利息	82
流動負債合計	89,023,816
負債合計	89,023,816
純資産の部	
元本等	
元本	2,562,031,575
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△308,454,921
元本等合計	2,253,576,654
純資産合計	2,253,576,654
負債純資産合計	2,342,600,470

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

2023年 7月20日現在
1． 投資信託財産に係る元本の状況

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

（注）※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

2023年 7月20日現在
１.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 ２.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。 ３.金融商品に係るリスク管理体制 運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

2023年 7月20日現在
１.貸借対照表計上額、時価及び差額

貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2.時価の算定方法

国債証券、特殊債券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

デリバティブ取引

（その他の注記）の2　デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明

金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

2023年 7月20日現在
該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1　有価証券に関する注記

売買目的有価証券

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

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

2　デリバティブ取引に関する注記

(通貨関連)

（2023年 7月20日現在）　（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	2,211,886,485	－	2,297,671,441	△85,784,956
	米ドル	2,211,886,485	－	2,297,671,441	△85,784,956
合計		2,211,886,485	－	2,297,671,441	△85,784,956

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

①計算日において為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

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

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種　類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY N/B	170,000.00	169,164.93	
		US TREASURY N/B	420,000.00	359,879.29	
		US TREASURY N/B	370,000.00	380,406.25	
	米ドル 小計		960,000.00	909,450.47 (127,050,230)	
				127,050,230	

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

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。

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

外貨建有価証券の内訳

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

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

ＲＭユーロ建ＳＤＧｓ債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

貸借対照表

（単位：円）

	2023年 7月20日現在
資産の部	
流動資産	
預金	4,048,721
コール・ローン	32,984,788
国債証券	138,956,263
特殊債券	1,544,453,319
未収利息	3,313,716
前払費用	1,203,652
流動資産合計	1,724,960,459
資産合計	1,724,960,459
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	110,027,474
未払金	966,094
未払解約金	808,000
未払利息	89
流動負債合計	111,801,657
負債合計	111,801,657
純資産の部	
元本等	
元本	1,849,111,108
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△235,952,306
元本等合計	1,613,158,802
純資産合計	1,613,158,802
負債純資産合計	1,724,960,459

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

2023年 7月20日現在	
１． 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月21日
期首元本額	775,039,813円
期中追加設定元本額	1,366,824,450円
期中一部解約元本額	292,753,155円
期末元本額	1,849,111,108円
期末元本の内訳※	
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスＥＳＧ	1,071,853,404円
九州ＳＤＧｓ・グローバルバランス	263,687,720円
ラップ型ファンド・プラスＥＳＧ（安定型）	42,702,010円
ラップ型ファンド・プラスＥＳＧ（安定成長型）	156,758,850円
ラップ型ファンド・プラスＥＳＧ（成長型）	15,450,545円
りそなユーロ建ＳＤＧｓ債券ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	298,658,579円
２． 計算日における受益権の総数	
	1,849,111,108口
３． 元本の欠損	
純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	235,952,306円
４． 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	0.8724円
(10,000口当たり純資産額)	(8,724円)

（注）※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

2023年 7月20日現在
１.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 ２.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。 ３.金融商品に係るリスク管理体制 運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

2023年 7月20日現在
１.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 ２.時価の算定方法 国債証券、特殊債券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 デリバティブ取引 （その他の注記）の2　デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。 ３.金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

2023年 7月20日現在
該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1　有価証券に関する注記

売買目的有価証券

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

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

2　デリバティブ取引に関する注記

(通貨関連)

（2023年 7月20日現在）　　（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	1,574,292,852	－	1,684,320,326	△110,027,474
	ユーロ	1,574,292,852	－	1,684,320,326	△110,027,474
合計		1,574,292,852	－	1,684,320,326	△110,027,474

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

①計算日において為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

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

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

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

特殊債券合計		1,544,453,319 (1,544,453,319)	
合計		1,683,409,582 (1,683,409,582)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の(　)内は、邦貨換算額（単位:円）であります。

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

外貨建有価証券の内訳

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

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

ＲＭ新興国債券マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2023年 7月20日現在
資産の部	
流動資産	
預金	6,751,420
コール・ローン	34,495,053
投資信託受益証券	10,132,519,198
未収配当金	212,695,680
流動資産合計	10,386,461,351
資産合計	10,386,461,351

	2023年 7月20日現在
負債の部	
流動負債	
未払解約金	2,707,400
未払利息	93
流動負債合計	2,707,493
負債合計	2,707,493
純資産の部	
元本等	
元本	8,016,360,322
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	2,367,393,536
元本等合計	10,383,753,858
純資産合計	10,383,753,858
負債純資産合計	10,386,461,351

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

2023年 7月20日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月21日
期首元本額	8,217,837,630円
期中追加設定元本額	1,908,647,534円
期中一部解約元本額	2,110,124,842円
期末元本額	8,016,360,322円

期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド（安定型）	796,807,353円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	923,908,425円
りそなラップ型ファンド（成長型）	574,429,492円
ＤＣりそな　グローバルバランス	21,325,951円
つみたてバランスファンド	1,372,083,901円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	303,158,851円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	218,805,194円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	149,121,741円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	76,956,662円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	52,390,313円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	28,867,198円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	59,940,132円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスＥＳＧ	111,489,487円
九州ＳＤＧｓ・グローバルバランス	35,686,190円
ラップ型ファンド・プラスＥＳＧ（安定型）	3,320,596円
ラップ型ファンド・プラスＥＳＧ（安定成長型）	22,440,648円
ラップ型ファンド・プラスＥＳＧ（成長型）	28,436,162円
りそな　つみたてラップ型ファンド（安定型）	6,900,032円
りそな　つみたてラップ型ファンド（安定成長型）	7,131,514円
りそな　つみたてラップ型ファンド（成長型）	4,962,069円
ターゲットリターンバランスファンド（目標２％）	15,642円
ターゲットリターンバランスファンド（目標３％）	16,302円
ターゲットリターンバランスファンド（目標４％）	16,779円
ターゲットリターンバランスファンド（目標５％）	17,089円
ターゲットリターンバランスファンド（目標６％）	17,324円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６５	37,433円
ＦＷりそな先進国＋新興国債券アクティブファンド	51,802,522円
ＦＷりそな新興国債券インデックスファンド	2,477,907,702円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	76,595,370円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	245,376,010円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	318,983,804円
りそなＶＩグローバル・バランスファンド（安定型）（適格機関投資家専用）	9,532,998円
りそなＶＩグローバル・バランスファンド（安定成長型）（適格機関投資家専用）	4,749,077円
りそなＶＩグローバル・バランスファンド（成長型）（適格機関投資家専用）	13,150,387円
りそなＦＴ　マルチアセットファンド（適格機関投資家専用）	14,899,990円
りそなＤＡＡマルチアセットファンド（適格機関投資家専用）	5,079,982円
２．　計算日における受益権の総数	
	8,016,360,322口
３．　計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.2953円
(10,000口当たり純資産額)	(12,953円)

（注）※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

2023年 7月20日現在
1 .金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2 .金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。 3 .金融商品に係るリスク管理体制 運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

2023年 7月20日現在
1 .貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 2 .時価の算定方法 投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。 3 .金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

2023年 7月20日現在
該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1　有価証券に関する注記

売買目的有価証券

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

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

2　デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

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

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

外貨建有価証券の内訳

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

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

ＲＭ国内株式ＥＳＧマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2023年 7月20日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	258,270,997
株式	3,221,661,810
投資証券	42,656,700
派生商品評価勘定	1,702,320
未収配当金	3,681,923
差入委託証拠金	10,177,500
流動資産合計	3,538,151,250
資産合計	3,538,151,250
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	426,500
前受金	4,333,000
未払金	940
未払解約金	8,600,000
未払利息	700
流動負債合計	13,361,140

	2023年 7月20日現在
負債合計	13,361,140
純資産の部	
元本等	
元本	2,359,889,618
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	1,164,900,492
元本等合計	3,524,790,110
純資産合計	3,524,790,110
負債純資産合計	3,538,151,250

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

2023年 7月20日現在	
1． 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月21日
期首元本額	1,950,746,165円
期中追加設定元本額	1,432,968,206円
期中一部解約元本額	1,023,824,753円
期末元本額	2,359,889,618円
期末元本の内訳※	
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスＥＳＧ	404,943,794円
国内株式ＥＳＧインデックス・オープン	93,491,642円
九州ＳＤＧｓ・グローバルバランス	182,517,280円
ラップ型ファンド・プラスＥＳＧ（安定型）	11,787,954円
ラップ型ファンド・プラスＥＳＧ（安定成長型）	121,766,225円

ラップ型ファンド・プラスＥＳＧ（成長型）	163,519,559円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　国内株式ＥＳＧインデックス	790,570,789円
国内株式ＥＳＧインデックスファンド（適格機関投資家専用）	591,292,375円
２．　計算日における受益権の総数	
	2,359,889,618口
３．　計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.4936円
(10,000口当たり純資産額)	(14,936円)

（注）※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

2023年 7月20日現在
１.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 ２.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、株価変動リスク、リートの価格変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。 ３.金融商品に係るリスク管理体制 運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

2023年 7月20日現在
１.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 ２.時価の算定方法 株式、投資証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 デリバティブ取引 （その他の注記）の2　デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。 ３.金融商品の時価等に関する事項の補足説明

金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

2023年 7月20日現在
該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1　有価証券に関する注記

売買目的有価証券

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

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

2　デリバティブ取引に関する注記

(株式関連)

（2023年 7月20日現在）　（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	253,934,680	－	255,210,500	1,275,820
合計		253,934,680	－	255,210,500	1,275,820

（注）時価の算定方法

先物取引

国内先物取引について

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

（単位：円）

銘　柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
ＩＮＰＥＸ	9,700	1,726.00	16,742,200	
大林組	6,500	1,252.00	8,138,000	
清水建設	5,500	913.40	5,023,700	
大和ハウス工業	6,000	3,706.00	22,236,000	
積水ハウス	6,100	2,910.00	17,751,000	
高砂熱学工業	400	2,485.00	994,000	
大氣社	200	4,135.00	827,000	
明治ホールディングス	2,200	3,340.00	7,348,000	
サッポロホールディングス	600	3,603.00	2,161,800	
アサヒグループホールディングス	4,800	5,487.00	26,337,600	
キリンホールディングス	7,800	2,070.50	16,149,900	
サントリー食品インターナショナル	1,400	5,021.00	7,029,400	
伊藤園	400	3,985.00	1,594,000	
キッコーマン	1,400	7,951.00	11,131,400	
味の素	4,500	5,546.00	24,957,000	
キユーピー	1,000	2,365.00	2,365,000	
カゴメ	800	3,157.00	2,525,600	
ニチレイ	1,100	3,186.00	3,504,600	
日清食品ホールディングス	600	11,855.00	7,113,000	
東洋紡	800	1,058.50	846,800	
帝人	1,800	1,465.00	2,637,000	
東レ	13,800	780.10	10,765,380	
クラレ	2,800	1,373.00	3,844,400	

旭化成	12,500	947.50	11,843,750	
住友化学	14,000	433.20	6,064,800	
東ソー	2,600	1,791.00	4,656,600	
デンカ	800	2,706.00	2,164,800	
カネカ	500	4,123.00	2,061,500	
三井化学	1,700	4,027.00	6,845,900	
ＪＳＲ	1,800	4,070.00	7,326,000	
東京応化工業	300	8,663.00	2,598,900	
三菱ケミカルグループ	12,800	828.30	10,602,240	
ダイセル	2,600	1,276.50	3,318,900	
積水化学工業	3,600	2,027.00	7,297,200	
ＵＢＥ	900	2,486.50	2,237,850	
花王	4,600	5,158.00	23,726,800	
日本ペイントホールディングス	9,500	1,182.50	11,233,750	
関西ペイント	1,600	2,193.50	3,509,600	
ＤＩＣ	800	2,616.00	2,092,800	
富士フイルムホールディングス	3,700	8,161.00	30,195,700	
日東電工	1,500	10,115.00	15,172,500	
信越ポリマー	400	1,444.00	577,600	
ニフコ	800	4,052.00	3,241,600	
ユニ・チャーム	4,000	5,213.00	20,852,000	
協和キリン	2,700	2,670.00	7,209,000	
アステラス製薬	18,100	2,070.50	37,476,050	
塩野義製薬	2,600	5,842.00	15,189,200	
エーザイ	2,500	9,085.00	22,712,500	
小野薬品工業	3,900	2,531.50	9,872,850	
第一三共	18,500	3,970.00	73,445,000	
ＥＮＥＯＳホールディングス	28,700	494.20	14,183,540	
ブリヂストン	5,700	5,771.00	32,894,700	
住友理工	400	814.00	325,600	
太平洋セメント	1,200	2,764.50	3,317,400	
ＴＯＴＯ	1,300	4,244.00	5,517,200	
日本特殊陶業	1,500	2,903.00	4,354,500	
日本製鉄	8,100	3,065.00	24,826,500	
神戸製鋼所	3,600	1,386.50	4,991,400	
ＪＦＥホールディングス	4,900	2,089.00	10,236,100	

日本軽金属ホールディングス	600	1,436.00	861,600	
三井金属鉱業	500	3,225.00	1,612,500	
三菱マテリアル	1,200	2,469.00	2,962,800	
住友金属鉱山	2,500	4,733.00	11,832,500	
ＤＯＷＡホールディングス	500	4,449.00	2,224,500	
ＵＡＣＪ	300	2,683.00	804,900	
ＬＩＸＩＬ	2,900	1,865.50	5,409,950	
三浦工業	900	3,499.00	3,149,100	
アマダ	3,400	1,377.00	4,681,800	
ナブテスコ	1,100	3,021.00	3,323,100	
小松製作所	9,200	3,835.00	35,282,000	
日立建機	1,100	4,051.00	4,456,100	
クボタ	10,100	2,028.50	20,487,850	
荏原製作所	900	6,817.00	6,135,300	
ダイキン工業	2,600	28,470.00	74,022,000	
栗田工業	1,000	5,532.00	5,532,000	
ダイフク	3,000	2,939.00	8,817,000	
グローリー	400	2,759.50	1,103,800	
セガサミーホールディングス	1,600	3,080.00	4,928,000	
ＮＴＮ	4,000	305.60	1,222,400	
日立造船	1,600	907.00	1,451,200	
三菱重工業	3,200	6,561.00	20,995,200	
イビデン	1,100	8,454.00	9,299,400	
コニカミノルタ	4,500	504.60	2,270,700	
ブラザー工業	2,300	2,207.00	5,076,100	
日立製作所	9,400	8,862.00	83,302,800	
富士電機	1,300	6,039.00	7,850,700	
安川電機	2,400	6,190.00	14,856,000	
オムロン	1,700	8,397.00	14,274,900	
日本電気	2,500	6,801.00	17,002,500	
富士通	1,800	18,100.00	32,580,000	
ルネサスエレクトロニクス	12,700	2,737.50	34,766,250	
セイコーエプソン	2,900	2,234.50	6,480,050	
アルバック	500	6,174.00	3,087,000	
パナソニック　ホールディングス	22,000	1,687.50	37,125,000	
シャープ	2,300	803.30	1,847,590	

アンリツ	1,400	1,227.50	1,718,500	
ソニーグループ	12,600	13,075.00	164,745,000	
ＴＤＫ	3,900	5,373.00	20,954,700	
アルプスアルパイン	1,900	1,236.00	2,348,400	
横河電機	2,300	2,631.00	6,051,300	
アズビル	1,100	4,468.00	4,914,800	
アドバンテスト	1,900	20,990.00	39,881,000	
シスメックス	1,700	9,363.00	15,917,100	
スタンレー電気	1,300	2,681.50	3,485,950	
ファナック	9,600	4,720.00	45,312,000	
太陽誘電	1,200	4,285.00	5,142,000	
村田製作所	5,700	8,231.00	46,916,700	
リコー	5,500	1,237.50	6,806,250	
東京エレクトロン	4,500	20,450.00	92,025,000	
川崎重工業	1,500	3,623.00	5,434,500	
トヨタ自動車	105,800	2,287.00	241,964,600	
ヤマハ発動機	3,000	4,080.00	12,240,000	
島津製作所	2,400	4,315.00	10,356,000	
ニコン	3,000	1,819.00	5,457,000	
ＨＯＹＡ	3,600	15,660.00	56,376,000	
前田工繊	200	3,105.00	621,000	
大日本印刷	2,200	3,974.00	8,742,800	
ＮＩＳＳＨＡ	400	1,673.00	669,200	
アシックス	1,600	4,198.00	6,716,800	
ヤマハ	1,400	5,273.00	7,382,200	
リンテック	400	2,297.50	919,000	
任天堂	10,400	6,426.00	66,830,400	
コクヨ	800	2,009.00	1,607,200	
美津濃	200	3,665.00	733,000	
東北電力	4,500	856.30	3,853,350	
九州電力	4,000	885.60	3,542,400	
電源開発	1,500	2,158.00	3,237,000	
レノバ	400	1,508.00	603,200	
東京瓦斯	3,900	3,154.00	12,300,600	
大阪瓦斯	3,700	2,148.50	7,949,450	
東邦瓦斯	700	2,418.00	1,692,600	

西部ガスホールディングス	200	1,996.00	399,200	
東武鉄道	1,900	3,605.00	6,849,500	
相鉄ホールディングス	800	2,469.00	1,975,200	
東急	5,300	1,701.00	9,015,300	
京王電鉄	1,000	4,380.00	4,380,000	
西日本旅客鉄道	2,200	5,775.00	12,705,000	
西武ホールディングス	2,300	1,480.50	3,405,150	
西日本鉄道	600	2,425.00	1,455,000	
阪急阪神ホールディングス	2,300	4,562.00	10,492,600	
南海電気鉄道	1,000	2,954.50	2,954,500	
京阪ホールディングス	1,000	3,721.00	3,721,000	
名古屋鉄道	1,900	2,210.00	4,199,000	
ヤマトホールディングス	2,800	2,603.50	7,289,800	
山九	500	4,738.00	2,369,000	
センコーグループホールディングス	1,100	1,018.00	1,119,800	
九州旅客鉄道	1,300	3,068.00	3,988,400	
ＳＧホールディングス	3,200	2,138.50	6,843,200	
ＮＩＰＰＯＮ　ＥＸＰＲＥＳＳホールディングス	700	8,165.00	5,715,500	
日本郵船	4,800	3,443.00	16,526,400	
ＡＮＡホールディングス	1,600	3,340.00	5,344,000	
トランコム	100	6,990.00	699,000	
ＴＩＳ	2,200	3,499.00	7,697,800	
ＳＨＩＦＴ	100	32,210.00	3,221,000	
ティーガイア	200	1,745.00	349,000	
オープンドア	100	1,252.00	125,200	
マネーフォワード	400	5,637.00	2,254,800	
ビジョナル	200	7,800.00	1,560,000	
野村総合研究所	3,800	3,934.00	14,949,200	
メルカリ	1,100	3,502.00	3,852,200	
Ｚホールディングス	26,700	390.30	10,421,010	
伊藤忠テクノソリューションズ	1,000	3,557.00	3,557,000	
ＢＩＰＲＯＧＹ	800	3,390.00	2,712,000	
ビジョン	400	1,744.00	697,600	
ＫＤＤＩ	14,900	4,261.00	63,488,900	
ソフトバンク	28,700	1,539.00	44,169,300	

ＮＴＴデータグループ	6,300	1,951.50	12,294,450	
カプコン	1,700	5,732.00	9,744,400	
ＳＣＳＫ	1,600	2,216.50	3,546,400	
ＴＯＫＡＩホールディングス	1,000	888.00	888,000	
アズワン	300	5,478.00	1,643,400	
伊藤忠商事	11,900	5,539.00	65,914,100	
丸紅	15,300	2,431.50	37,201,950	
三井物産	13,100	5,312.00	69,587,200	
キヤノンマーケティングジャパン	500	3,666.00	1,833,000	
モスフードサービス	200	3,220.00	644,000	
ローソン	500	6,875.00	3,437,500	
ゲオホールディングス	200	1,847.00	369,400	
アダストリア	200	2,849.00	569,800	
ジンズホールディングス	100	3,610.00	361,000	
ＤＣＭホールディングス	1,100	1,197.00	1,316,700	
Ｊ．フロント　リテイリング	2,400	1,355.00	3,252,000	
マツキヨココカラ＆カンパニー	1,100	8,103.00	8,913,300	
ＺＯＺＯ	1,200	2,779.00	3,334,800	
オイシックス・ラ・大地	300	2,263.00	678,900	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	500	1,112.00	556,000	
イオン北海道	400	852.00	340,800	
スギホールディングス	300	6,294.00	1,888,200	
日本瓦斯	1,000	1,910.00	1,910,000	
マックスバリュ東海	100	2,755.00	275,500	
丸井グループ	1,800	2,444.00	4,399,200	
イオン	6,500	2,864.00	18,616,000	
平和堂	300	2,329.00	698,700	
ヤオコー	200	7,492.00	1,498,400	
ヤマダホールディングス	5,800	427.70	2,480,660	
ファーストリテイリング	1,700	34,160.00	58,072,000	
サンドラッグ	700	4,113.00	2,879,100	
りそなホールディングス	21,300	709.80	15,118,740	
三井住友トラスト・ホールディングス	3,300	5,280.00	17,424,000	
三井住友フィナンシャルグループ	13,000	6,443.00	83,759,000	
みずほフィナンシャルグループ	24,100	2,245.50	54,116,550	

大和証券グループ本社	13,300	738.70	9,824,710	
野村ホールディングス	29,000	557.80	16,176,200	
ＳＯＭＰＯホールディングス	3,100	6,460.00	20,026,000	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	4,300	5,099.00	21,925,700	
東京海上ホールディングス	18,000	3,163.00	56,934,000	
Ｔ＆Ｄホールディングス	5,000	2,082.00	10,410,000	
東京センチュリー	400	5,247.00	2,098,800	
オリックス	11,700	2,594.00	30,349,800	
ヒューリック	3,800	1,216.50	4,622,700	
野村不動産ホールディングス	1,100	3,437.00	3,780,700	
三井不動産	9,000	2,832.50	25,492,500	
三菱地所	11,200	1,721.00	19,275,200	
平和不動産	300	3,840.00	1,152,000	
東京建物	1,900	1,874.00	3,560,600	
住友不動産	2,800	3,663.00	10,256,400	
ディップ	400	3,615.00	1,446,000	
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	500	2,763.50	1,381,750	
オリエンタルランド	10,900	5,407.00	58,936,300	
ダスキン	400	3,189.00	1,275,600	
リゾートトラスト	800	2,169.00	1,735,200	
サイバーエージェント	4,300	1,009.00	4,338,700	
楽天グループ	14,900	534.10	7,958,090	
テクノプロ・ホールディングス	1,100	3,431.00	3,774,100	
リクルートホールディングス	14,400	4,798.00	69,091,200	
エラン	300	879.00	263,700	
インソース	500	1,183.00	591,500	
カーブスホールディングス	500	744.00	372,000	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	200	2,238.00	447,600	
乃村工藝社	800	896.00	716,800	
セコム	2,100	9,214.00	19,349,400	
ベネッセホールディングス	700	1,824.50	1,277,150	
合　計	1,020,000		3,221,661,810	

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種　類	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	森ヒルズリート投資法人	15	2,211,000	
	日本プロロジスリート投資法人	22	6,454,800	
	ヒューリックリート投資法人	13	2,133,300	
	積水ハウス・リート投資法人	42	3,624,600	
	日本ビルファンド投資法人	15	9,195,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	13	7,436,000	
	日本プライムリアルティ投資法人	8	2,840,000	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	29	4,413,800	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	9	2,745,000	
	ジャパンエクセレント投資法人	12	1,603,200	
合計		178	42,656,700	

(注)券面総額欄の数値は口数を表しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

ＲＭ先進国株式ＥＳＧマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2023年 7月20日現在
資産の部	
流動資産	
預金	197,382,588
コール・ローン	32,831,751
株式	6,294,341,572
投資証券	140,578,266
派生商品評価勘定	6,578,945
未収配当金	4,092,995

	2023年 7月20日現在
差入委託証拠金	43,417,524
流動資産合計	6,719,223,641
資産合計	6,719,223,641
負債の部	
流動負債	
未払解約金	33,579,000
未払利息	89
流動負債合計	33,579,089
負債合計	33,579,089
純資産の部	
元本等	
元本	3,598,118,896
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	3,087,525,656
元本等合計	6,685,644,552
純資産合計	6,685,644,552
負債純資産合計	6,719,223,641

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

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

（注）※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

2023年 7月20日現在
１.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 ２.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、株価変動リスク、リートの価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。 ３.金融商品に係るリスク管理体制

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

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

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

2023年 7月20日現在
1 .貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 2 .時価の算定方法 株式、投資証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 デリバティブ取引 （その他の注記）の2　デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。 3 .金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

2023年 7月20日現在
該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1　有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2023年 7月20日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
株式	717,471,326

投資証券	630,509
合計	718,101,835

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

2　デリバティブ取引に関する注記

(株式関連)

（2023年 7月20日現在）　　（単位：円）

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

（注）時価の算定方法

先物取引

外国先物取引について

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

通 貨	銘　柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	BAKER HUGHES COMPANY	1,724	35.20	60,684.80	
	CHENIERE ENERGY INC	409	157.38	64,368.42	
	HALLIBURTON CO	1,481	37.01	54,811.81	
	HF SINCLAIR CORP	270	47.40	12,798.00	
	KINDER MORGAN INC	3,479	17.29	60,151.91	
	MARATHON PETROLEUM CORP	745	122.11	90,971.95	
	ONEOK INC	769	64.77	49,808.13	
	PHILLIPS 66	776	102.46	79,508.96	

SCHLUMBERGER LTD	2,354	57.36	135,025.44	
TARGA RESOURCES CORP	372	78.74	29,291.28	
VALERO ENERGY CORP	619	118.02	73,054.38	
WILLIAMS COS INC	2,007	33.32	66,873.24	
AMCOR PLC	2,580	9.98	25,748.40	
AVERY DENNISON CORP	133	177.42	23,596.86	
BALL CORP	544	57.00	31,008.00	
ECOLAB INC	423	187.28	79,219.44	
INTERNATIONAL PAPER CO	545	31.56	17,200.20	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	440	84.07	36,990.80	
LINDE PLC	817	374.71	306,138.07	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	434	91.25	39,602.50	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	107	454.26	48,605.82	
NEWMONT CORP	1,366	45.18	61,715.88	
NUCOR CORP	415	167.12	69,354.80	
PPG INDUSTRIES INC	387	150.26	58,150.62	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	407	268.01	109,080.07	
STEEL DYNAMICS INC	269	105.30	28,325.70	
WESTROCK CO	414	30.22	12,511.08	
3M CO	913	103.48	94,477.24	
AECOM	231	88.70	20,489.70	
ALLEGION PLC	139	125.80	17,486.20	
AXON ENTERPRISE INC	113	189.53	21,416.89	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	227	144.32	32,760.64	
CARRIER GLOBAL CORP	1,379	55.23	76,162.17	
CATERPILLAR INC	859	262.75	225,702.25	
CUMMINS INC	243	258.85	62,900.55	
DOVER CORP	243	150.13	36,481.59	
EATON CORP PLC	661	209.81	138,684.41	
EMERSON ELECTRIC CO	960	91.67	88,003.20	
FASTENAL CO	940	57.29	53,852.60	
FERGUSON PLC	343	157.92	54,166.56	
FORTIVE CORP	581	74.36	43,203.16	
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS I	207	73.30	15,173.10	
GENERAC HOLDINGS INC	101	146.93	14,839.93	

GRACO INC	273	87.42	23,865.66	
IDEX CORP	131	211.18	27,664.58	
ILLINOIS TOOL WORKS	515	254.96	131,304.40	
INGERSOLL-RAND INC	700	65.72	46,004.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	1,136	69.47	78,917.92	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	318	198.83	63,227.94	
LENNOX INTERNATIONAL INC	51	334.25	17,046.75	
MASCO CORP	343	60.57	20,775.51	
OTIS WORLDWIDE CORP	681	88.08	59,982.48	
OWENS CORNING	152	136.34	20,723.68	
PENTAIR PLC	260	66.33	17,245.80	
QUANTA SERVICES INC	247	199.95	49,387.65	
ROCKWELL AUTOMATION INC	189	344.00	65,016.00	
TORO CO	183	103.80	18,995.40	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	378	195.85	74,031.30	
UNITED RENTALS INC	120	460.49	55,258.80	
WW GRAINGER INC	75	766.05	57,453.75	
XYLEM INC	412	111.46	45,921.52	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	687	237.33	163,045.71	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	196	169.67	33,255.32	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	261	71.58	18,682.38	
CINTAS CORP	154	504.06	77,625.24	
CLARIVATE PLC	662	9.78	6,474.36	
PAYCHEX INC	546	123.31	67,327.26	
PAYLOCITY HOLDING CORP	74	224.96	16,647.04	
ROBERT HALF INC	174	84.56	14,713.44	
TRANSUNION	319	81.00	25,839.00	
WASTE MANAGEMENT INC	688	166.70	114,689.60	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	196	98.32	19,270.72	
CSX CORP	3,400	33.80	114,920.00	
DELTA AIR LINES INC	259	48.55	12,574.45	
EXPEDITORS INTL WASH INC	252	124.51	31,376.52	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	144	195.23	28,113.12	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	294	56.37	16,572.78	
NORFOLK SOUTHERN CORP	386	237.41	91,640.26	

OLD DOMINION FREIGHT LINE	162	395.20	64,022.40	
UNION PACIFIC CORP	1,016	214.25	217,678.00	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	1,204	186.02	223,968.08	
APTIV PLC	468	110.38	51,657.84	
BORGWARNER INC	369	45.93	16,948.17	
LEAR CORP	107	149.04	15,947.28	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	1,051	24.83	26,096.33	
TESLA INC	4,762	291.26	1,386,980.12	
DECKERS OUTDOOR CORP	44	543.72	23,923.68	
HASBRO INC	208	64.61	13,438.88	
LULULEMON ATHLETICA INC	192	390.51	74,977.92	
NIKE INC -CL B	2,054	109.88	225,693.52	
NVR INC	5	6,445.95	32,229.75	
PULTEGROUP INC	375	81.96	30,735.00	
VF CORP	592	20.46	12,112.32	
WHIRLPOOL CORP	98	156.10	15,297.80	
ARAMARK	420	43.01	18,064.20	
BOOKING HOLDINGS INC	63	2,927.88	184,456.44	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	436	148.92	64,929.12	
MCDONALD'S CORP	1,216	294.13	357,662.08	
VAIL RESORTS INC	63	241.29	15,201.27	
YUM! BRANDS INC	472	135.93	64,158.96	
ALPHABET INC-CL A	9,953	122.03	1,214,564.59	
ALPHABET INC-CL C	8,969	122.78	1,101,213.82	
COMCAST CORP-CLASS A	7,012	42.71	299,482.52	
ELECTRONIC ARTS INC	453	136.84	61,988.52	
FOX CORP - CLASS A	509	33.72	17,163.48	
FOX CORP- CLASS B	235	31.68	7,444.80	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	673	37.66	25,345.18	
OMNICOM GROUP	337	87.78	29,581.86	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	1,044	5.49	5,731.56	
SNAP INC - A	1,641	13.11	21,513.51	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	290	152.01	44,082.90	
WALT DISNEY CO/THE	3,045	87.04	265,036.80	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	427	28.85	12,318.95	

ADVANCE AUTO PARTS INC	96	72.44	6,954.24	
AUTOZONE INC	31	2,505.89	77,682.59	
BEST BUY CO INC	350	84.22	29,477.00	
BURLINGTON STORES INC	113	176.37	19,929.81	
CARMAX INC	255	85.14	21,710.70	
EBAY INC	935	49.03	45,843.05	
GENUINE PARTS CO	243	168.07	40,841.01	
HOME DEPOT INC	1,689	319.48	539,601.72	
LKQ CORP	439	58.29	25,589.31	
LOWE'S COS INC	993	230.89	229,273.77	
MERCADOLIBRE INC	75	1,225.75	91,931.25	
POOL CORP	68	365.97	24,885.96	
TJX COMPANIES INC	1,916	85.59	163,990.44	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	190	211.16	40,120.40	
ULTA BEAUTY INC	82	471.21	38,639.22	
KROGER CO	1,173	46.98	55,107.54	
TARGET CORP	761	132.70	100,984.70	
BUNGE LTD	264	103.93	27,437.52	
CAMPBELL SOUP CO	348	45.89	15,969.72	
COCA-COLA CO/THE	6,852	61.64	422,357.28	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	327	64.76	21,176.52	
CONAGRA BRANDS INC	839	32.57	27,326.23	
DARLING INGREDIENTS INC	292	66.74	19,488.08	
GENERAL MILLS INC	969	75.21	72,878.49	
HORMEL FOODS CORP	532	39.56	21,045.92	
JM SMUCKER CO/THE	180	149.69	26,944.20	
KELLOGG CO	463	67.18	31,104.34	
KEURIG DR PEPPER INC	1,548	31.89	49,365.72	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	246	112.37	27,643.02	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	406	86.06	34,940.36	
PEPSICO INC	2,296	186.26	427,652.96	
CHURCH & DWIGHT CO INC	407	98.27	39,995.89	
CLOROX COMPANY	212	154.74	32,804.88	
COLGATE-PALMOLIVE CO	1,313	76.42	100,339.46	
KIMBERLY-CLARK CORP	559	135.35	75,660.65	

PROCTER & GAMBLE CO/THE	3,938	150.29	591,842.02	
ALIGN TECHNOLOGY INC	118	342.58	40,424.44	
AMERISOURCEBERGEN CORP	289	191.94	55,470.66	
CIGNA GROUP/THE	492	292.66	143,988.72	
COOPER COS INC/THE	82	394.84	32,376.88	
DAVITA INC	97	104.76	10,161.72	
DENTSPLY SIRONA INC	353	40.67	14,356.51	
DEXCOM INC	638	133.63	85,255.94	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	1,024	91.62	93,818.88	
ELEVANCE HEALTH INC	394	463.21	182,504.74	
HCA HEALTHCARE INC	352	286.71	100,921.92	
HOLOGIC INC	425	78.54	33,379.50	
HUMANA INC	212	447.26	94,819.12	
IDEXX LABORATORIES INC	136	547.75	74,494.00	
INSULET CORP	120	287.82	34,538.40	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	153	217.11	33,217.83	
MOLINA HEALTHCARE INC	96	312.45	29,995.20	
QUEST DIAGNOSTICS INC	197	143.10	28,190.70	
STERIS PLC	160	227.44	36,390.40	
TELEFLEX INC	84	251.30	21,109.20	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	352	140.79	49,558.08	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	506	123.08	62,278.48	
AMGEN INC	888	232.05	206,060.40	
AVANTOR INC	1,116	21.83	24,362.28	
BIO-TECHNE CORP	270	83.88	22,647.60	
BIOGEN INC	247	276.89	68,391.83	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	3,500	62.06	217,210.00	
DANAHER CORP	1,153	243.88	281,193.64	
ELI LILLY & CO	1,348	453.56	611,398.88	
GILEAD SCIENCES INC	2,074	78.96	163,763.04	
ILLUMINA INC	270	184.53	49,823.10	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	97	131.19	12,725.43	
JOHNSON & JOHNSON	4,336	158.74	688,296.64	
MERCK & CO. INC.	4,232	105.95	448,380.40	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	38	1,340.03	50,921.14	

REPLIGEN CORP	94	158.59	14,907.46	
WATERS CORP	102	280.08	28,568.16	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	127	385.62	48,973.74	
ZOETIS INC	767	170.89	131,072.63	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	844	30.97	26,138.68	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	2,472	11.88	29,367.36	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	659	132.37	87,231.83	
REGIONS FINANCIAL CORP	1,601	20.02	32,052.02	
TRUIST FINANCIAL CORP	2,187	35.59	77,835.33	
US BANCORP	2,588	38.91	100,699.08	
WEBSTER FINANCIAL CORP	281	44.33	12,456.73	
ALLY FINANCIAL INC	438	29.66	12,991.08	
AMERICAN EXPRESS CO	1,054	177.12	186,684.48	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	174	352.47	61,329.78	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	1,322	45.60	60,283.20	
BLACKROCK INC	250	747.30	186,825.00	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	184	140.19	25,794.96	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	437	121.85	53,248.45	
EQUITABLE HOLDINGS INC	593	28.47	16,882.71	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	66	425.18	28,061.88	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	999	60.83	60,769.17	
FISERV INC	1,056	127.63	134,777.28	
FRANKLIN RESOURCES INC	483	30.00	14,490.00	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	931	115.66	107,679.46	
INVESCO LTD	468	18.04	8,442.72	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	138	229.26	31,637.88	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	59	261.14	15,407.26	
MASTERCARD INC-CLASS A	1,421	398.27	565,941.67	
MOODY'S CORP	274	359.54	98,513.96	
MORGAN STANLEY	2,090	93.16	194,704.40	
NASDAQ INC	595	50.43	30,005.85	
NORTHERN TRUST CORP	343	81.28	27,879.04	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	335	109.59	36,712.65	
S&P GLOBAL INC	547	422.53	231,123.91	
SCHWAB (CHARLES) CORP	2,502	66.04	165,232.08	

STATE STREET CORP	566	69.38	39,269.08	
SYNCHRONY FINANCIAL	732	36.11	26,432.52	
T ROWE PRICE GROUP INC	386	121.27	46,810.22	
VISA INC-CLASS A SHARES	2,713	241.42	654,972.46	
AFLAC INC	956	71.32	68,181.92	
ALLSTATE CORP	430	105.79	45,489.70	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	634	80.25	50,878.50	
ASSURANT INC	86	128.01	11,008.86	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	507	72.43	36,722.01	
MARSH & MCLENNAN COS	821	187.36	153,822.56	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	420	82.51	34,654.20	
PROGRESSIVE CORP	970	118.22	114,673.40	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	631	94.30	59,503.30	
TRAVELERS COS INC/THE	387	170.56	66,006.72	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	173	226.72	39,222.56	
ACCENTURE PLC-CL A	1,053	318.80	335,696.40	
ADOBE INC	765	527.17	403,285.05	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	261	93.98	24,528.78	
ANSYS INC	150	348.81	52,321.50	
AUTODESK INC	355	219.07	77,769.85	
BLACK KNIGHT INC	282	70.08	19,762.56	
CADENCE DESIGN SYS INC	453	242.49	109,847.97	
DOCUSIGN INC	362	54.18	19,613.16	
FAIR ISAAC CORP	42	844.85	35,483.70	
GARTNER INC	133	367.68	48,901.44	
GEN DIGITAL INC	910	19.32	17,581.20	
HUBSPOT INC	79	568.62	44,920.98	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	1,510	135.48	204,574.80	
INTUIT INC	467	500.56	233,761.52	
MICROSOFT CORP	11,815	355.08	4,195,270.20	
PTC INC	187	146.64	27,421.68	
SALESFORCE INC	1,667	234.37	390,694.79	
SERVICENOW INC	339	603.25	204,501.75	
SPLUNK INC	256	108.67	27,819.52	
SYNOPSYS INC	258	457.33	117,991.14	

	TWILIO INC - A	319	67.61	21,567.59	
	VMWARE INC-CLASS A	397	166.69	66,175.93	
	WORKDAY INC-CLASS A	345	231.68	79,929.60	
	ZSCALER INC	144	161.04	23,189.76	
	HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	2,210	17.27	38,166.70	
	HP INC	1,494	32.93	49,197.42	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	290	172.58	50,048.20	
	NETAPP INC	357	79.31	28,313.67	
	SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	309	59.86	18,496.74	
	TRIMBLE INC	424	53.67	22,756.08	
	WESTERN DIGITAL CORP	499	38.93	19,426.07	
	LIBERTY GLOBAL PLC-A	277	18.87	5,226.99	
	LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	457	19.85	9,071.45	
	VERIZON COMMUNICATIONS INC	6,992	33.97	237,518.24	
	AMERICAN WATER WORKS CO INC	334	143.98	48,089.32	
	ATMOS ENERGY CORP	246	121.17	29,807.82	
	CMS ENERGY CORP	486	60.51	29,407.86	
	CONSOLIDATED EDISON INC	584	93.49	54,598.16	
	EDISON INTERNATIONAL	661	70.64	46,693.04	
	ESSENTIAL UTILITIES INC	399	41.50	16,558.50	
	EVERSOURCE ENERGY	603	72.15	43,506.45	
	EXELON CORP	1,641	41.51	68,117.91	
	SEMPRA ENERGY	520	146.53	76,195.60	
	UGI CORP	330	26.60	8,778.00	
	APPLIED MATERIALS INC	1,408	141.78	199,626.24	
	INTEL CORP	6,953	34.46	239,600.38	
	LAM RESEARCH CORP	225	640.11	144,024.75	
	MARVELL TECHNOLOGY INC	1,451	65.63	95,229.13	
	NVIDIA CORP	4,126	470.77	1,942,397.02	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	443	220.28	97,584.04	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	1,513	183.67	277,892.71	
	CBRE GROUP INC - A	513	88.91	45,610.83	
米ドル 小計		251,683		33,525,516.50 (4,683,514,655)	
カナダドル	CAMECO CORP	679	43.33	29,421.07	

ENBRIDGE INC	3,353	48.52	162,687.56	
KEYERA CORP	324	31.76	10,290.24	
PARKLAND CORP	182	35.39	6,440.98	
PEMBINA PIPELINE CORP	957	40.86	39,103.02	
AGNICO EAGLE MINES LTD	790	70.58	55,758.20	
IVANHOE MINES LTD-CL A	1,023	12.80	13,094.40	
KINROSS GOLD CORP	2,391	6.79	16,234.89	
LUNDIN MINING CORP	1,264	11.59	14,649.76	
NUTRIEN LTD	836	84.88	70,959.68	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	104	115.77	12,040.08	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	785	59.06	46,362.10	
CAE INC	528	29.10	15,364.80	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	137	109.04	14,938.48	
RB GLOBAL INC	282	81.86	23,084.52	
THOMSON REUTERS CORP	281	174.66	49,079.46	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	941	155.37	146,203.17	
MAGNA INTERNATIONAL INC	476	81.35	38,722.60	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	337	42.38	14,282.06	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	92	184.87	17,008.04	
DOLLARAMA INC	474	88.06	41,740.44	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	1,318	67.08	88,411.44	
METRO INC	388	72.91	28,289.08	
BANK OF MONTREAL	1,200	123.38	148,056.00	
BANK OF NOVA SCOTIA	1,967	67.02	131,828.34	
NATIONAL BANK OF CANADA	579	100.95	58,450.05	
TORONTO-DOMINION BANK	3,025	86.05	260,301.25	
BROOKFIELD CORP	2,335	47.11	110,001.85	
INTACT FINANCIAL CORP	302	196.43	59,321.86	
SUN LIFE FINANCIAL INC	975	68.46	66,748.50	
OPEN TEXT CORP	437	55.47	24,240.39	
SHOPIFY INC - CLASS A	1,986	89.91	178,561.26	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	618	59.31	36,653.58	
TELUS CORP	717	24.29	17,415.93	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	1,266	10.91	13,812.06	
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	204	42.43	8,655.72	

	FORTIS INC	838	56.70	47,514.60	
	HYDRO ONE LTD	509	37.90	19,291.10	
	FIRSTSERVICE CORP	67	209.72	14,051.24	
カナダドル 小計		34,967		2,149,069.80 (228,274,194)	
ユーロ	GALP ENERGIA SGPS SA	947	11.27	10,672.69	
	NESTE OYJ	739	36.70	27,121.30	
	OMV AG	239	40.82	9,755.98	
	REPSOL SA	2,213	12.95	28,669.41	
	TENARIS SA	798	14.42	11,507.16	
	TOTALENERGIES SE	3,937	52.32	205,983.84	
	AKZO NOBEL	280	74.22	20,781.60	
	COVESTRO AG	348	48.84	16,996.32	
	CRH PLC	1,246	51.78	64,517.88	
	DSM-FIRMENICH AG	304	103.30	31,403.20	
	EVONIK INDUSTRIES AG	352	18.31	6,445.12	
	HEIDELBERG MATERIALS AG	228	72.10	16,438.80	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	389	33.94	13,202.66	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	932	11.53	10,745.96	
	SYMRISE AG	210	97.00	20,370.00	
	UMICORE	377	27.76	10,465.52	
	UPM-KYMMENE OYJ	938	28.96	27,164.48	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	375	30.30	11,362.50	
	BOUYGUES SA	366	31.34	11,470.44	
	BRENNTAG SE	249	67.50	16,807.50	
	CNH INDUSTRIAL NV	1,795	13.86	24,887.67	
	EIFFAGE	135	94.50	12,757.50	
	GEA GROUP AG	292	37.80	11,037.60	
	KINGSPAN GROUP PLC	247	72.16	17,823.52	
	KNORR-BREMSE AG	129	62.66	8,083.14	
	METSO CORPORATION	1,125	11.29	12,701.25	
	PRYSMIAN SPA	411	36.69	15,079.59	
	SCHNEIDER ELECTRIC SE	902	157.86	142,389.72	
	WARTSILA OYJ ABP	698	10.49	7,325.51	
	TELEPERFORMANCE	104	156.85	16,312.40	

WOLTERS KLUWER	420	112.90	47,418.00	
ADP	49	130.40	6,389.60	
DEUTSCHE GROUP AG	1,711	45.78	78,338.13	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	1,009	8.79	8,875.16	
GETLINK	682	16.08	10,966.56	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	548	107.20	58,745.60	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	93	99.45	9,248.85	
MICHELIN(CGDE)	1,183	28.09	33,230.47	
VALEO SA	298	21.30	6,347.40	
ADIDAS AG	267	172.30	46,004.10	
HERMES INTERNATIONAL	53	1,882.20	99,756.60	
KERING	123	530.40	65,239.20	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	461	850.40	392,034.40	
MONCLER SPA	342	62.00	21,204.00	
PUMA SE	201	58.80	11,818.80	
AMADEUS IT GROUP SA	760	66.98	50,904.80	
JUST EAT TAKEAWAY	406	16.15	6,557.71	
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	1,368	21.70	29,685.60	
PROSUS NV	1,325	67.87	89,927.75	
ZALANDO SE	359	29.75	10,680.25	
CARREFOUR SA	1,051	17.45	18,339.95	
HELLOFRESH SE	235	24.00	5,640.00	
JERONIMO MARTINS	453	26.38	11,950.14	
KESKO OYJ-B SHS	438	17.43	7,636.53	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N.V.	1,633	30.82	50,337.22	
DANONE	1,057	55.55	58,716.35	
JDE PEET'S BV	101	26.98	2,724.98	
KERRY GROUP PLC-A	284	90.52	25,707.68	
BEIERSDORF AG	178	114.75	20,425.50	
HENKEL AG & CO KGAA	164	63.54	10,420.56	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	286	71.04	20,317.44	
L'OREAL	401	406.30	162,926.30	
MERCK KGAA	225	149.05	33,536.25	
BNP PARIBAS	1,840	57.96	106,646.40	
COMMERZBANK AG	1,725	11.09	19,138.87	

	CREDIT AGRICOLE SA	2,015	11.11	22,398.74	
	FINECOBANK SPA	1,099	13.74	15,105.75	
	ING GROEP NV-CVA	6,116	13.08	79,997.28	
	KBC GROEP NV	424	65.36	27,712.64	
	MEDIOBANCA SPA	1,012	11.44	11,577.28	
	SOCIETE GENERALE SA	1,215	23.90	29,038.50	
	DEUTSCHE BOERSE AG	314	165.25	51,888.50	
	NEXI SPA	1,129	7.68	8,675.23	
	WORLDLINE SA	381	34.46	13,129.26	
	ASSICURAZIONI GENERALI	1,662	18.76	31,187.43	
	AXA SA	3,085	26.63	82,168.97	
	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	236	332.50	78,470.00	
	NN GROUP NV	453	33.29	15,080.37	
	POSTE ITALIANE SPA	774	9.96	7,715.23	
	DASSAULT SYSTEMES SE	1,125	41.36	46,535.62	
	NOKIA OYJ	8,850	3.52	31,209.52	
	ELISA OYJ	226	48.80	11,028.80	
	KONINKLIJKE KPN NV	5,834	3.24	18,913.82	
	ORANGE	3,109	10.57	32,874.56	
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	1,281	2.43	3,115.39	
	ENEL SPA	13,391	6.27	84,028.52	
	IBERDROLA SA	9,999	11.17	111,688.83	
	NATURGY ENERGY GROUP SA	198	26.86	5,318.28	
	REDEIA CORP SA	644	15.23	9,811.34	
	TERNA SPA	2,313	7.65	17,703.70	
	VERBUND AG	119	74.25	8,835.75	
	ASML HOLDING NV	673	651.90	438,728.70	
	STMICROELECTRONICS NV	1,151	46.93	54,022.18	
	LEG IMMOBILIEN SE	106	63.72	6,754.32	
	VONOVIA SE	1,200	21.12	25,344.00	
ユーロ 小計		113,168		3,858,175.92 (604,691,911)	
英ポンド	ANGLO AMERICAN PLC	2,126	23.03	48,961.78	
	ANTOFAGASTA PLC	654	14.86	9,721.71	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	227	58.18	13,206.86	

ENDEAVOUR MINING PLC	307	19.67	6,038.69	
JOHNSON MATTHEY PLC	257	18.38	4,724.94	
MONDI PLC	802	13.22	10,606.45	
ASHTEAD GROUP PLC	722	54.72	39,507.84	
DCC PLC	185	45.73	8,460.05	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	118	110.10	12,991.80	
INTERTEK GROUP PLC	263	41.94	11,030.22	
RELX PLC	3,208	25.72	82,509.76	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	1,858	4.54	8,435.32	
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	180	43.00	7,740.00	
BURBERRY GROUP PLC	628	21.94	13,778.32	
TAYLOR WIMPEY PLC	5,889	1.16	6,848.90	
AUTO TRADER GROUP PLC	1,644	6.60	10,860.26	
INFORMA PLC	2,317	7.43	17,215.31	
WPP PLC	1,731	8.60	14,886.60	
KINGFISHER PLC	3,200	2.48	7,945.60	
OCADO GROUP PLC	775	6.83	5,299.45	
SAINSBURY (J) PLC	3,312	2.83	9,376.27	
TESCO PLC	11,922	2.57	30,651.46	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	564	21.03	11,860.92	
COCA-COLA HBC AG-DI	348	23.49	8,174.52	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	1,190	58.60	69,734.00	
UNILEVER PLC	4,211	40.85	172,019.35	
NMC HEALTH PLC	5	0.00	0.00	
ASTRAZENECA PLC	2,583	105.02	271,266.66	
HSBC HOLDINGS PLC	33,272	6.28	209,214.33	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	109,110	0.46	50,948.91	
3I GROUP PLC	1,625	19.53	31,736.25	
ABRDN PLC	3,791	2.31	8,761.00	
SCHRODERS PLC	1,456	4.61	6,719.44	
ST JAMES'S PLACE PLC	1,011	11.61	11,737.71	
ADMIRAL GROUP PLC	365	21.78	7,949.70	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	10,341	2.36	24,487.48	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	1,289	5.52	7,115.28	
PRUDENTIAL PLC	4,530	10.64	48,199.20	

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

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

	AP MOELLER-MAERSK A/S-B	8	14,040.00	112,320.00	
	DSV A/S	314	1,477.00	463,778.00	
	PANDORA A/S	147	656.60	96,520.20	
	COLOPLAST-B	188	805.00	151,340.00	
	GENMAB A/S	114	2,717.00	309,738.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	2,760	1,064.40	2,937,744.00	
	ORSTED A/S	307	625.00	191,875.00	
デンマーククローネ 小計		6,054		4,884,097.84 (102,712,577)	
オーストラリアドル	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	3,134	36.05	112,980.70	
	BLUESCOPE STEEL LTD	782	20.25	15,835.50	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	2,765	22.29	61,631.85	
	IGO LTD	1,162	14.77	17,162.74	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	716	40.51	29,005.16	
	MINERAL RESOURCES LTD	272	72.06	19,600.32	
	NEWCREST MINING LTD	1,569	27.75	43,539.75	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	1,919	12.59	24,160.21	
	ORICA LTD	891	15.15	13,498.65	
	PILBARA MINERALS LTD	4,599	5.13	23,592.87	
	BRAMBLES LTD	2,449	13.96	34,188.04	
	COMPUTERSHARE LTD	874	24.35	21,281.90	
	AURIZON HOLDINGS LTD	2,643	3.71	9,805.53	
	TRANSURBAN GROUP	5,068	13.92	70,546.56	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	1,039	38.34	39,835.26	
	IDP EDUCATION LTD	356	23.16	8,244.96	
	REA GROUP LTD	103	149.57	15,405.71	
	SEEK LTD	653	24.47	15,978.91	
	COLES GROUP LTD	2,355	18.09	42,601.95	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	2,324	5.89	13,688.36	
	COCHLEAR LTD	105	235.13	24,688.65	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	306	56.85	17,396.10	
	SONIC HEALTHCARE LTD	726	35.31	25,635.06	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	4,959	25.46	126,256.14	
	ASX LTD	312	61.76	19,269.12	
	MACQUARIE GROUP LTD	610	183.90	112,179.00	

	QBE INSURANCE GROUP LTD	2,584	15.24	39,380.16	
	SUNCORP GROUP LTD	1,985	13.83	27,452.55	
	XERO LTD	222	126.80	28,149.60	
	TELSTRA GROUP LTD	6,669	4.21	28,076.49	
	APA GROUP	1,923	9.84	18,922.32	
	LENDLEASE GROUP	954	7.94	7,574.76	
オーストラリアドル 小計		57,028		1,107,564.88 (105,008,226)	
ニュージーランドドル	EBOS GROUP LTD	262	37.90	9,929.80	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	2,779	5.07	14,089.53	
	MERCURY NZ LTD	826	6.40	5,286.40	
	MERIDIAN ENERGY LTD	2,181	5.38	11,733.78	
ニュージーランドドル 小計		6,048		41,039.51 (3,594,240)	
香港ドル	MTR CORP	2,523	34.95	88,178.85	
	WH GROUP LTD	17,000	4.03	68,510.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	5,742	22.65	130,056.30	
	HANG SENG BANK LTD	1,261	109.20	137,701.20	
	AIA GROUP LTD	19,400	78.50	1,522,900.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	7,289	9.25	67,423.25	
	HONG KONG & CHINA GAS	20,079	6.43	129,107.97	
	SINO LAND CO	6,000	9.39	56,340.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	672	62.20	41,798.40	
	SWIRE PROPERTIES LTD	1,804	18.68	33,698.72	
香港ドル 小計		81,770		2,275,714.69 (40,712,535)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	2,509	6.86	17,211.74	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	2,100	28.64	60,144.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	1,380	9.44	13,027.20	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	4,405	3.36	14,800.80	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	968	6.92	6,698.56	
シンガポールドル 小計		11,362		111,882.30 (11,804,701)	
イスラエルシュケル	BANK LEUMI LE-ISRAEL	2,644	30.89	81,673.16	
		2,644		81,673.16	

イスラエルシュケル 小計			(3,180,557)	
合　計	895,422		6,294,341,572 (6,294,341,572)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。

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

(2)株式以外の有価証券

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

		GOODMAN GROUP	2,959	60,718.68	
		GPT GROUP	3,278	13,931.50	
		MIRVAC GROUP	6,751	15,864.85	
		SCENTRE GROUP	8,253	22,695.75	
		STOCKLAND	4,073	16,943.68	
		VICINITY CENTRES	7,638	14,779.53	
	オーストラリアドル 小計		35,055	162,073.44 (15,366,182)	
	シンガポールドル	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	8,592	17,098.08	
	シンガポールドル 小計		8,592	17,098.08 (1,804,018)	
合計				140,578,266 (140,578,266)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数		組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式	285銘柄	97.6%	—	72.9%
	投資証券	12銘柄	—	2.4%	1.8%
カナダドル	株式	39銘柄	99.4%	—	3.5%
	投資証券	2銘柄	—	0.6%	0.0%
ユーロ	株式	95銘柄	99.6%	—	9.5%
	投資証券	2銘柄	—	0.4%	0.0%
英ポンド	株式	42銘柄	98.8%	—	4.2%
	投資証券	1銘柄	—	1.2%	0.0%
スイスフラン	株式	22銘柄	100.0%	—	2.5%
スウェーデンクローナ	株式	22銘柄	100.0%	—	1.0%
ノルウェークローネ	株式	9銘柄	100.0%	—	0.3%
デンマーククローネ	株式	12銘柄	100.0%	—	1.6%
オーストラリアドル	株式	32銘柄	87.2%	—	1.6%
	投資証券	7銘柄	—	12.8%	0.2%
ニュージーランドドル	株式	4銘柄	100.0%	—	0.1%

香港ドル	株式	10銘柄	100.0%	―	0.6%
シンガポールドル	株式	5銘柄	86.7%	―	0.2%
	投資証券	1銘柄	―	13.3%	0.0%
イスラエルシュケル	株式	1銘柄	100.0%	―	0.0%

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

ＲＭ新興国株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2023年 7月20日現在
資産の部	
流動資産	
預金	823,104,460
コール・ローン	32,476,441
株式	25,479,697,457
投資証券	28,361,520
派生商品評価勘定	12,852,494
未収入金	3,873,846
未収配当金	161,135,154
差入委託証拠金	487,651,454
流動資産合計	27,029,152,826
資産合計	27,029,152,826
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,403,244
未払解約金	14,172,700
未払利息	88
流動負債合計	15,576,032
負債合計	15,576,032
純資産の部	
元本等	
元本	15,608,210,450
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	11,405,366,344

	2023年 7月20日現在
元本等合計	27,013,576,794
純資産合計	27,013,576,794
負債純資産合計	27,029,152,826

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

2023年 7月20日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月21日
期首元本額	11,648,718,312円
期中追加設定元本額	7,603,707,517円
期中一部解約元本額	3,644,215,379円

期末元本額	15,608,210,450円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド（安定型）	593,839,711円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	2,305,137,861円
りそなラップ型ファンド（成長型）	2,152,574,198円
ＤＣりそな　グローバルバランス	15,894,621円
つみたてバランスファンド	1,030,406,494円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	459,372,542円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	331,507,170円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	225,980,305円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	116,436,536円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	79,131,353円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	43,607,375円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	89,738,797円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスＥＳＧ	156,780,672円
九州ＳＤＧｓ・グローバルバランス	83,565,205円
ラップ型ファンド・プラスＥＳＧ（安定型）	2,479,103円
ラップ型ファンド・プラスＥＳＧ（安定成長型）	48,805,029円
ラップ型ファンド・プラスＥＳＧ（成長型）	102,765,629円
りそな　つみたてラップ型ファンド（安定型）	5,104,864円
りそな　つみたてラップ型ファンド（安定成長型）	13,561,458円
りそな　つみたてラップ型ファンド（成長型）	16,429,974円
りそな　つみたてリスクコントロールファンド	646,529円
ターゲットリターンバランスファンド（目標２％）	11,784円
ターゲットリターンバランスファンド（目標３％）	22,135円
ターゲットリターンバランスファンド（目標４％）	34,960円
ターゲットリターンバランスファンド（目標５％）	47,850円
ターゲットリターンバランスファンド（目標６％）	57,514円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６５	56,688円
ＦＷりそな先進国＋新興国株式アクティブファンド	124,473,775円
ＦＷりそな新興国株式インデックスファンド	3,895,558,216円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　新興国株式インデックス	2,543,597,002円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	115,443,902円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	375,120,422円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	483,935,665円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　Ｓｅｌｅｃｔ　全世界株式インデックス	44,838,020円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　Ｓｅｌｅｃｔ　全世界株式インデックス（除く日本）	28,953,346円
りそなＶＩグローバル・バランスファンド（安定型）（適格機関投資家専用）	7,055,860円
りそなＶＩグローバル・バランスファンド（安定成長型）（適格機関投資家専用）	10,006,362円
りそなＶＩグローバル・バランスファンド（成長型）（適格機関投資家専用）	60,362,538円
りそなＦＴ　マルチアセットファンド（適格機関投資家専用）	28,864,277円
りそなＤＡＡマルチアセットファンド（適格機関投資家専用）	16,004,708円

２．計算日における受益権の総数

15,608,210,450口

3．　計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.7307円
(10,000口当たり純資産額)	(17,307円)

（注）※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

2023年 7月20日現在

1．金融商品に対する取組方針

当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

2．金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。

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

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

3．金融商品に係るリスク管理体制

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

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

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

2023年 7月20日現在

1．貸借対照表計上額、時価及び差額

貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2．時価の算定方法

株式、投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

デリバティブ取引

（その他の注記）の2　デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3．金融商品の時価等に関する事項の補足説明

金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

2023年 7月20日現在
該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1　有価証券に関する注記

売買目的有価証券

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

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

2　デリバティブ取引に関する注記

(株式関連)

（2023年 7月20日現在）　（単位：円）

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

（注）時価の算定方法

先物取引

外国先物取引について

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

(通貨関連)

（2023年 7月20日現在） **（単位：円）**

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

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

①計算日において為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

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

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

通 貨	銘　柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	29,100	1.39	40,681.80	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	1,600	0.00	0.00	
	SURGUTNEFTEGAS-SP ADR	13,769	0.00	0.00	
	TATNEFT PAO-SPONSORED ADR	4,090	0.00	0.00	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	5,573	7.69	42,856.37	

	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	11,117	0.00	0.00	
	NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR	2,773	0.00	0.00	
	PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	2,330	0.00	0.00	
	PHOSAGRO PJSC(BLOCKED)-GDR	15	0.00	0.00	
	POLYUS PJSC-REG S-GDR	1,288	0.00	0.00	
	SEVERSTAL - GDR REG S	3,862	0.00	0.00	
	SOUTHERN COPPER CORP	2,307	76.76	177,085.32	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	11,187	26.43	295,672.41	
	NIO INC - ADR	36,208	10.64	385,253.12	
	H WORLD GROUP LTD	5,136	40.93	210,216.48	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	11,675	6.10	71,217.50	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	11,085	58.85	652,352.25	
	AUTOHOME INC-ADR	2,118	29.26	61,972.68	
	IQIYI INC-ADR	11,203	5.26	58,927.78	
	JOYY INC	1,098	33.22	36,475.56	
	KANZHUN LTD	4,502	15.98	71,941.96	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	19,111	7.02	134,159.22	
	VK CO LTD	2,211	0.00	0.00	
	WEIBO CORP-SPON ADR	1,731	13.79	23,870.49	
	MINISO GROUP HOLDING LTD-ADR	2,291	17.89	40,985.99	
	PDD HOLDINGS INC	13,382	75.23	1,006,727.86	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	9,598	16.52	158,558.96	
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	1	0.00	0.00	
	X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	2,296	0.00	0.00	
	LEGEND BIOTECH CORP-ADR	1,616	70.42	113,798.72	
	COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	105,788	1.18	124,829.84	
	CREDICORP LTD	1,808	156.29	282,572.32	
	TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	2,188	0.00	0.00	
	LUFAX HOLDING LTD-ADR	16,257	1.59	25,848.63	
	QIFU TECHNOLOGY INC	3,164	18.18	57,521.52	
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	14,388	2.63	37,969.93	
	DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	1,554	38.39	59,658.06	
	KE HOLDINGS INC	17,711	14.89	263,716.79	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	31,080	0.63	19,611.48	
		418,211		4,454,483.04	

米ドル 小計				(622,291,280)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-CPO	385,000	12.48	4,804,800.00	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	83,000	84.21	6,989,430.00	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	5,350	238.19	1,274,316.50	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	27,700	37.92	1,050,384.00	
	ALFA S.A.B.-A	87,800	10.15	891,170.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	14,500	129.15	1,872,675.00	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	10,200	313.62	3,198,924.00	
	GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	5,295	477.60	2,528,892.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	5,980	170.82	1,021,503.60	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	59,200	16.65	985,680.00	
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	139,200	68.44	9,526,848.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	13,400	174.36	2,336,424.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	14,350	139.82	2,006,417.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	51,800	180.96	9,373,728.00	
	GRUMA S.A.B.-B	5,455	285.07	1,555,056.85	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	33,400	87.79	2,932,186.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	40,200	38.82	1,560,564.00	
	BANCO DEL BAJIO SA	22,200	56.14	1,246,308.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	69,000	150.07	10,354,830.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	54,000	42.15	2,276,100.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	830,200	17.59	14,603,218.00	
メキシコペソ 小計		1,957,230		82,389,454.95 (688,817,038)	
ブラジルレアル	COSAN SA	34,500	19.32	666,540.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	99,000	32.46	3,213,540.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	126,500	29.10	3,681,150.00	
	PRIO SA	19,700	44.14	869,558.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	20,900	18.88	394,592.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	17,000	12.70	215,900.00	
	GERDAU SA-PREF	31,695	27.43	869,393.85	
	KLABIN SA - UNIT	18,200	20.95	381,290.00	
	SUZANO SA	21,307	43.47	926,215.29	
	VALE SA	89,704	67.24	6,031,696.96	
	WEG SA	45,000	37.91	1,705,950.00	

CCR SA	26,700	13.53	361,251.00	
LOCALIZA RENT A CAR	23,710	69.46	1,646,896.60	
RUMO SA	36,000	22.80	820,800.00	
LOJAS RENNER S.A.	23,620	17.78	419,963.60	
MAGAZINE LUIZA SA	86,300	2.94	253,722.00	
VIBRA ENERGIA SA	28,100	16.86	473,766.00	
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	19,100	10.70	204,370.00	
RAIA DROGASIL SA	33,876	27.99	948,189.24	
SENDAS DISTRIBUIDORA SA	34,700	12.14	421,258.00	
AMBEV SA	126,400	14.63	1,849,232.00	
JBS SA	21,300	18.21	387,873.00	
NATURA &CO HOLDING SA	22,400	15.93	356,832.00	
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	150,892	4.13	623,183.96	
REDE D'OR SAO LUIZ SA	14,200	32.95	467,890.00	
HYPERA SA	9,800	44.02	431,396.00	
BANCO BRADESCO S.A.	42,615	14.59	621,752.85	
BANCO BRADESCO SA-PREF	142,636	16.51	2,354,920.36	
BANCO DO BRASIL S.A.	22,000	47.43	1,043,460.00	
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	8,100	29.50	238,950.00	
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	129,000	27.97	3,608,130.00	
ITAUSA SA	129,170	9.66	1,247,782.20	
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	153,300	14.60	2,238,180.00	
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	32,400	32.89	1,065,636.00	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	18,600	30.18	561,348.00	
TOTVS SA	12,700	29.01	368,427.00	
TELEFONICA BRASIL S.A.	11,000	40.29	443,190.00	
TIM SA	24,000	13.78	330,720.00	
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	7,100	42.49	301,679.00	
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	30,800	37.81	1,164,548.00	
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	34,434	12.40	426,981.60	
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	8,100	54.17	438,777.00	
CPFL ENERGIA SA	7,200	35.16	253,152.00	
ENERGISA SA-UNITS	6,100	49.40	301,340.00	
ENEVA SA	22,700	12.52	284,204.00	
ENGIE BRASIL ENERGIA SA	6,275	44.55	279,551.25	

	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	28,200	33.36	940,752.00	
ブラジルレアル 小計		2,057,034		47,135,930.76 (1,373,107,371)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	9,594	6,368.00	61,094,592.00	
	EMPRESAS CMPC SA	33,869	1,628.90	55,169,214.10	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	3,822	64,550.00	246,710,100.00	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES	466,759	59.60	27,818,836.40	
	FALABELLA SA	21,259	2,279.80	48,466,268.20	
	CENCOSUD SA	35,890	1,816.80	65,204,952.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	3,292	6,898.00	22,708,216.00	
	BANCO DE CHILE	1,244,596	88.88	110,619,692.48	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	1,739	23,781.00	41,355,159.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	1,641,012	42.22	69,283,526.64	
	ENEL AMERICAS SA	517,290	109.79	56,793,269.10	
	ENEL CHILE SA	827,632	60.00	49,657,920.00	
チリペソ 小計		4,806,754		854,881,745.92 (147,776,568)	
コロンビアペソ	BANCOLOMBIA SA	6,380	33,600.00	214,368,000.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	10,944	29,780.00	325,912,320.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	12,989	17,300.00	224,709,700.00	
コロンビアペソ 小計		30,313		764,990,020.00 (26,845,794)	
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	1,474	22.82	33,636.68	
	MYTILINEOS S.A.	2,599	35.68	92,732.32	
	OPAP SA	4,870	16.28	79,283.60	
	JUMBO SA	2,974	27.90	82,974.60	
	ALPHA SERVICES AND HOLDINGS	65,690	1.62	106,647.71	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	74,565	1.63	121,540.95	
	NATIONAL BANK OF GREECE	14,028	6.22	87,254.16	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	4,849	14.60	70,795.40	
	PUBLIC POWER CORP	5,654	10.75	60,780.50	
	TERNA ENERGY SA	1,400	18.11	25,354.00	
ユーロ 小計		178,103		760,999.92 (119,271,517)	
英ポンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	5,948	0.00	0.00	

英ポンド 小計		5,948		0.00 (0)	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	27,711	89.45	2,478,748.95	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	34,746	37.68	1,309,229.28	
	HEKTAS TICARET T.A.S	35,672	31.36	1,118,673.92	
	KOZA ALTIN ISLETMELERI AS	25,931	27.30	707,916.30	
	SASA POLYESTER SANAYI	27,188	62.25	1,692,453.00	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	15,288	71.60	1,094,620.80	
	KOC HOLDING AS	18,208	114.50	2,084,816.00	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	37,427	49.94	1,869,104.38	
	PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS	1,253	731.70	916,820.10	
	TURK HAVA YOLLARI AO	14,261	223.60	3,188,759.60	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	1,780	835.00	1,486,300.00	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	3,208	253.70	813,869.60	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	11,198	199.90	2,238,480.20	
	AKBANK T.A.S.	83,796	25.02	2,096,575.92	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	30,648	52.35	1,604,422.80	
	TURKIYE IS BANKASI-C	90,125	14.27	1,286,083.75	
	YAPI VE KREDI BANKASI	92,810	13.22	1,226,948.20	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	31,132	47.12	1,466,939.84	
トルコリラ 小計		582,382		28,680,762.64 (149,117,021)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	2,117	715.00	1,513,655.00	
	MONETA MONEY BANK AS	7,045	83.20	586,144.00	
	CEZ AS	4,323	897.00	3,877,731.00	
チェココルナ 小計		13,485		5,977,530.00 (39,171,949)	
ハンガリーフォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	11,609	3,190.00	37,032,710.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	3,960	8,800.00	34,848,000.00	
	OTP BANK PLC	6,308	12,500.00	78,850,000.00	
ハンガリーフォリント 小計		21,877		150,730,710.00 (62,476,221)	
ポーランドズロチ	ORLEN SA	14,813	70.44	1,043,427.72	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	3,988	116.60	465,000.80	
	LPP SA	26	14,420.00	374,920.00	

	CD PROJEKT SA	1,602	160.00	256,320.00	
	CYFROWY POLSAT SA	8,679	16.66	144,635.53	
	ALLEGRO.EU SA	11,388	32.50	370,110.00	
	PEPCO GROUP NV	5,086	35.48	180,451.28	
	DINO POLSKA SA	1,364	474.00	646,536.00	
	BANK PEKAO SA	5,176	114.95	594,981.20	
	MBANK SA	290	465.80	135,082.00	
	PKO BANK POLSKI SA	22,290	39.89	889,148.10	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	977	406.00	396,662.00	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	15,971	38.79	619,515.09	
	PGE SA	29,021	8.44	245,111.36	
ポーランドズロチ 小計		120,671		6,361,901.08 (223,952,278)	
ロシアルーブル	GAZPROM PJSC	209,472	0.00	0.00	
	LUKOIL PJSC	7,345	0.00	0.00	
	ROSNEFT OIL CO PJSC	20,180	0.00	0.00	
	SURGUTNEFTEGAS-PREFERENCE	131,600	0.00	0.00	
	ALROSA PJSC	46,260	0.00	0.00	
	UNITED CO RUSAL INTERNATIONA	55,000	0.00	0.00	
	YANDEX NV-A	5,354	0.00	0.00	
	OZON HOLDINGS PLC - ADR	920	0.00	0.00	
	MAGNIT PJSC	1,334	0.00	0.00	
	SBERBANK OF RUSSIA PJSC	190,680	0.00	0.00	
	VTB BANK PJSC	65,736,000	0.00	0.00	
	MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ	22,980	0.00	0.00	
	MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JO	16,768	0.00	0.00	
	INTER RAO UES PJSC	725,000	0.00	0.00	
ロシアルーブル 小計		67,168,893		0.00 (0)	
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO-H	58,000	5.79	335,820.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	50,000	9.01	450,500.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	650,000	4.58	2,977,000.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	89,500	23.15	2,071,925.00	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	38,000	8.50	323,000.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	560,000	5.87	3,287,200.00	

YANKUANG ENERGY GROUP CO-H	57,000	11.72	668,040.00	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	110,000	3.48	382,800.00	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	30,500	19.74	602,070.00	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	64,500	6.63	427,635.00	
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	100,000	4.44	444,000.00	
CHINA RESOURCES CEMENT	68,000	3.00	204,000.00	
CMOC GROUP LTD-H	87,000	4.73	411,510.00	
DONGYUE GROUP	44,000	7.60	334,400.00	
GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD-H	9,640	51.25	494,050.00	
JIANGXI COPPER CO LTD-H	31,000	12.48	386,880.00	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	42,000	4.85	203,700.00	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	20,500	16.14	330,870.00	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	31,500	11.72	369,180.00	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	152,000	12.64	1,921,280.00	
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	61,000	3.88	236,680.00	
BOC AVIATION LTD	6,100	65.45	399,245.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	68,000	3.62	246,160.00	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	43,000	9.06	389,580.00	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	26,000	4.71	122,460.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	113,000	4.94	558,220.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	58,000	9.39	544,620.00	
CITIC LTD	155,000	8.48	1,314,400.00	
CRRC CORP LTD - H	118,000	4.30	507,400.00	
FOSUN INTERNATIONAL LTD	72,500	5.32	385,700.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	17,000	18.38	312,460.00	
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	27,000	11.06	298,620.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	49,000	11.36	556,640.00	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	13,800	31.30	431,940.00	
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL LIMITED	92,000	3.05	280,600.00	
AIR CHINA LTD-H	42,000	5.95	249,900.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	46,000	4.99	229,540.00	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	40,000	10.42	416,800.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	46,000	4.63	212,980.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	83,700	8.13	680,481.00	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	46,000	4.62	212,520.00	

JD LOGISTICS INC	52,200	12.12	632,664.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	30,000	6.93	207,900.00	
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	3,500	121.00	423,500.00	
SHENZHEN INTL HOLDINGS	32,500	7.12	231,400.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	32,000	6.05	193,600.00	
BYD CO LTD-H	26,500	265.20	7,027,800.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	70,000	3.52	246,400.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	16,400	33.05	542,020.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	161,000	9.69	1,560,090.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	64,000	9.48	606,720.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	70,000	4.64	324,800.00	
LI AUTO INC-CLASS A	29,688	145.80	4,328,510.40	
MINTH GROUP LTD	22,000	22.90	503,800.00	
XPENG INC-CLASS A SHARES	27,664	57.20	1,582,380.80	
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	32,000	17.10	547,200.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	32,400	82.95	2,687,580.00	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	110,000	3.43	377,300.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	61,000	23.90	1,457,900.00	
LI NING CO LTD	62,500	40.50	2,531,250.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	21,900	78.25	1,713,675.00	
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	41,500	7.91	328,265.00	
EAST BUY HOLDING LTD	10,500	29.90	313,950.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	44,000	18.16	799,040.00	
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	27,000	13.16	355,320.00	
MEITUAN	133,810	127.70	17,087,537.00	
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	41,510	35.00	1,452,850.00	
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LT	34,800	17.70	615,960.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	25,000	13.42	335,500.00	
TRIP.COM GROUP LTD	14,460	286.00	4,135,560.00	
BAIDU INC-CLASS A	59,530	142.10	8,459,213.00	
BILIBILI INC-CLASS Z	5,117	124.20	635,531.40	
CHINA LITERATURE LTD	9,800	32.65	319,970.00	
CHINA RUYI HOLDINGS LIMITED	136,000	2.59	352,240.00	
KINGSOFT CORP LTD	24,200	34.15	826,430.00	
KUAISHOU TECHNOLOGY	61,100	57.90	3,537,690.00	

NETEASE INC	52,100	163.10	8,497,510.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	164,400	333.00	54,745,200.00	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	437,740	90.35	39,549,809.00	
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	20,000	8.74	174,800.00	
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-H	1,900	108.20	205,580.00	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	49,600	13.04	646,784.00	
JD.COM INC - CL A	62,210	142.80	8,883,588.00	
POP MART INTERNATIONAL GROUP	15,000	18.90	283,500.00	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	50,000	6.76	338,000.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	19,500	26.90	524,550.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	118,000	4.96	585,280.00	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	29,550	51.85	1,532,167.50	
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	15,000	18.68	280,200.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	2,600	138.58	360,308.00	
CHINA FEIHE LTD	95,000	4.40	418,000.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	84,000	27.75	2,331,000.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	42,000	48.95	2,055,900.00	
DALI FOODS GROUP CO LTD	66,500	3.55	236,075.00	
NONGFU SPRING CO LTD-H	46,800	43.20	2,021,760.00	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	48,000	7.88	378,240.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	50,000	11.80	590,000.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	16,000	67.60	1,081,600.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	31,000	6.30	195,300.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	123,000	5.27	648,210.00	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	14,000	16.64	232,960.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	17,500	30.65	536,375.00	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	9,000	18.24	164,160.00	
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	9,000	45.00	405,000.00	
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	24,200	14.30	346,060.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	64,000	10.30	659,200.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	21,500	14.18	304,870.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	33,600	23.90	803,040.00	
3SBIO INC	52,500	7.19	377,475.00	
AKESO INC	13,000	35.90	466,700.00	
BEIGENE LTD	18,296	117.30	2,146,120.80	

CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	33,000	12.06	397,980.00	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	43,500	6.06	263,610.00	
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	90,000	3.36	302,400.00	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	240,000	6.22	1,492,800.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	30,000	16.38	491,400.00	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	2,700	44.55	120,285.00	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	32,000	12.38	396,160.00	
INNOVENT BIOLOGICS INC	29,500	30.75	907,125.00	
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	9,600	16.66	159,936.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	14,000	20.40	285,600.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	279,250	3.41	952,242.50	
WUXI APPTEC CO LTD-H	10,168	69.55	707,184.40	
WUXI BIOLOGICS (CAYMAN) INC.	101,500	40.05	4,065,075.00	
ZAI LAB LTD	23,030	23.05	530,841.50	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	772,000	2.61	2,014,920.00	
BANK OF CHINA LTD-H	2,100,000	2.74	5,754,000.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	232,000	4.46	1,034,720.00	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	245,000	3.62	886,900.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	2,546,000	4.29	10,922,340.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	69,000	2.20	151,800.00	
CHINA MERCHANTS BANK-H	103,000	33.25	3,424,750.00	
CHINA MINSHENG BANKING-H	171,600	2.88	494,208.00	
IND & COMM BK OF CHINA-H	1,497,000	3.59	5,374,230.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	214,000	4.44	950,160.00	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	250,000	0.78	195,000.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	82,000	3.99	327,180.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	38,800	14.08	546,304.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	53,000	14.14	749,420.00	
FAR EAST HORIZON LTD	38,000	5.70	216,600.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	26,800	10.60	284,080.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	65,200	4.93	321,436.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	35,800	9.79	350,482.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	199,000	11.64	2,316,360.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	71,200	19.18	1,365,616.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	33,400	7.50	250,500.00	

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

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

	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	172,800	5.22	902,016.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	16,200	18.92	306,504.00	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	5,300	17.60	93,280.00	
	MALAYAN BANKING BHD	142,900	8.82	1,260,378.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	389,100	3.96	1,540,836.00	
	RHB BANK BHD	39,200	5.50	215,600.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	72,600	2.51	182,226.00	
	CELCOMDIGI BHD	90,500	4.26	385,530.00	
	MAXIS BHD	64,700	4.07	263,329.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	36,600	4.84	177,144.00	
	PETRONAS GAS BHD	22,900	16.94	387,926.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	71,400	9.10	649,740.00	
	INARI AMERTRON BHD	74,800	3.10	231,880.00	
マレーシアリンギット 小計		2,309,920		11,264,351.80 (345,158,888)	
タイバーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	201,000	9.45	1,899,450.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	37,900	157.50	5,969,250.00	
	PTT PCL-NVDR	270,400	34.50	9,328,800.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	31,600	47.25	1,493,100.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	53,800	33.75	1,815,750.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	54,100	39.00	2,109,900.00	
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	32,200	39.50	1,271,900.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	19,700	324.00	6,382,800.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	115,700	71.75	8,301,475.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	234,600	8.80	2,064,480.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	207,000	7.70	1,593,900.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	190,600	4.50	857,700.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	75,900	32.25	2,447,775.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	45,225	40.75	1,842,918.75	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	145,900	14.00	2,042,600.00	
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	85,300	21.50	1,833,950.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	36,100	34.75	1,254,475.00	
	CP ALL PCL-NVDR	157,200	62.75	9,864,300.00	
	CP AXTRA PCL-NVDR	59,000	35.00	2,065,000.00	
	CARABAO GROUP PCL-NVDR	4,900	70.50	345,450.00	

	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	94,100	19.70	1,853,770.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	31,400	29.50	926,300.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	280,500	28.75	8,064,375.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	16,900	222.00	3,751,800.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	13,200	134.50	1,775,400.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	84,100	20.10	1,690,410.00	
	SCB X PCL-NVDR	21,200	111.00	2,353,200.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	23,600	46.50	1,097,400.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	16,300	37.75	615,325.00	
	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	16,200	49.00	793,800.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	84,500	105.50	8,914,750.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	30,000	221.00	6,630,000.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	28,600	76.75	2,195,050.00	
	TRUE CORP PCL/NEW-NVDR	327,315	7.05	2,307,570.75	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	25,200	36.50	919,800.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	6,300	138.50	872,550.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	48,000	56.75	2,724,000.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	21,300	55.25	1,176,825.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	81,400	49.00	3,988,600.00	
	RATCH GROUP PCL-NVDR	21,900	36.75	804,825.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	57,400	65.75	3,774,050.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	207,600	8.50	1,764,600.00	
タイバーツ 小計		3,595,140		123,779,374.50 (509,971,022)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	51,250	53.30	2,731,625.00	
	AYALA CORPORATION	7,910	620.00	4,904,200.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	72,731	44.70	3,251,075.70	
	SM INVESTMENTS CORP	6,870	921.00	6,327,270.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	24,500	207.60	5,086,200.00	
	JOLLIBEE FOODS CORP	11,290	255.00	2,878,950.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	24,530	131.00	3,213,430.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	54,578	113.40	6,189,145.20	
	BDO UNIBANK INC	65,396	141.70	9,266,613.20	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	45,472	56.00	2,546,432.00	
	PLDT INC	1,865	1,306.00	2,435,690.00	

	ACEN CORP	14,250	5.37	76,522.50	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	7,490	349.80	2,620,002.00	
	AYALA LAND INC	181,100	26.05	4,717,655.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	252,700	33.00	8,339,100.00	
フィリピンペソ 小計		821,932		64,583,910.60 (165,457,520)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY TBK PT	355,100	2,330.00	827,383,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	45,500	24,250.00	1,103,375,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK	175,600	1,990.00	349,444,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	909,184	775.00	704,617,600.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	89,700	8,725.00	782,632,500.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	292,209	3,160.00	923,380,440.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	101,289	6,775.00	686,232,975.00	
	VALE INDONESIA TBK	49,100	6,425.00	315,467,500.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	507,600	6,575.00	3,337,470,000.00	
	GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT	22,100,000	115.00	2,541,500,000.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	409,300	2,750.00	1,125,575,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESI PT	181,300	5,325.00	965,422,500.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	75,400	11,750.00	885,950,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	117,600	7,350.00	864,360,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	202,200	4,270.00	863,394,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	526,300	2,000.00	1,052,600,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	1,473,900	9,150.00	13,486,185,000.00	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	999,900	5,350.00	5,349,465,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	207,300	8,900.00	1,844,970,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	1,816,545	5,625.00	10,218,065,625.00	
	SARANA MENARA NUSANTARA PT	412,300	1,050.00	432,915,000.00	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	1,327,300	3,850.00	5,110,105,000.00	
インドネシアルピア 小計		32,374,627		53,770,510,140.00 (505,442,795)	
韓国ウォン	HD HYUNDAI	1,185	59,400.00	70,389,000.00	
	S-OIL CORP	1,083	69,800.00	75,593,400.00	
	SK INNOVATION CO LTD	1,402	169,500.00	237,639,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORP	2,898	44,450.00	128,816,100.00	
	HYUNDAI STEEL CO	2,249	33,450.00	75,229,050.00	

KOREA ZINC CO LTD	231	462,500.00	106,837,500.00	
KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	458	125,500.00	57,479,000.00	
LG CHEM LTD	1,320	687,000.00	906,840,000.00	
LG CHEM LTD-PREFERENCE	197	388,000.00	76,436,000.00	
LOTTE CHEMICAL CORP	484	146,200.00	70,760,800.00	
POSCO FUTURE M CO LTD	803	480,000.00	385,440,000.00	
POSCO HOLDINGS INC	1,912	499,500.00	955,044,000.00	
SK IE TECHNOLOGY CO LTD	775	91,300.00	70,757,500.00	
SKC CO LTD	602	96,300.00	57,972,600.00	
CJ CORP	425	61,900.00	26,307,500.00	
DOOSAN BOBCAT INC	1,487	59,400.00	88,327,800.00	
DOOSAN ENERBILITY	11,421	17,670.00	201,809,070.00	
ECOPRO BM CO LTD	1,314	361,000.00	474,354,000.00	
GS HOLDINGS	1,411	38,050.00	53,688,550.00	
HANWHA AEROSPACE CO LTD	957	127,900.00	122,400,300.00	
HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	607	144,800.00	87,893,600.00	
HD KOREA SHIPBUILDING & OFFS	1,038	126,500.00	131,307,000.00	
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	2,000	37,450.00	74,900,000.00	
HYUNDAI MIPO DOCKYARD	517	91,500.00	47,305,500.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	1,854	52,300.00	96,964,200.00	
LG CORP	2,401	86,400.00	207,446,400.00	
LG ENERGY SOLUTION	938	560,000.00	525,280,000.00	
POSCO INTERNATIONAL CORP	1,476	46,950.00	69,298,200.00	
SAMSUNG C&T CORP	2,130	103,300.00	220,029,000.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	3,781	32,450.00	122,693,450.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	15,535	8,560.00	132,979,600.00	
SK	1,030	147,000.00	151,410,000.00	
SK SQUARE CO LTD	2,400	46,450.00	111,480,000.00	
HMM CO LTD	6,429	19,020.00	122,279,580.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	524	188,000.00	98,512,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	4,956	25,450.00	126,130,200.00	
PAN OCEAN CO LTD	5,356	4,960.00	26,565,760.00	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	1,948	37,000.00	72,076,000.00	
HANON SYSTEMS	3,541	9,200.00	32,577,200.00	
HYUNDAI MOBIS CO LTD	1,635	244,000.00	398,940,000.00	

HYUNDAI MOTOR CO	3,690	202,000.00	745,380,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	870	106,700.00	92,829,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	533	106,400.00	56,711,200.00	
KIA CORP	7,008	86,000.00	602,688,000.00	
COWAY CO LTD	1,442	44,100.00	63,592,200.00	
F&F CO LTD / NEW	518	105,300.00	54,545,400.00	
LG ELECTRONICS INC	2,914	123,500.00	359,879,000.00	
KANGWON LAND INC	3,072	16,410.00	50,411,520.00	
HYBE CO LTD	525	263,500.00	138,337,500.00	
KAKAO CORP	8,310	50,400.00	418,824,000.00	
KAKAO GAMES CORP	1,051	32,850.00	34,525,350.00	
KRAFTON INC	724	183,300.00	132,709,200.00	
NAVER CORP	3,490	204,500.00	713,705,000.00	
NCSOFT CORP	383	287,500.00	110,112,500.00	
NETMARBLE CORPORATION	392	48,700.00	19,090,400.00	
PEARL ABYSS CORP	960	56,600.00	54,336,000.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	885	72,800.00	64,428,000.00	
BGF RETAIL CO LTD/NEW	138	164,100.00	22,645,800.00	
E-MART INC	557	78,400.00	43,668,800.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	221	278,000.00	61,438,000.00	
KT&G CORP	2,766	82,000.00	226,812,000.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	591	117,100.00	69,206,100.00	
AMOREPACIFIC CORP	788	105,800.00	83,370,400.00	
LG H&H	260	454,000.00	118,040,000.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	2,829	63,900.00	180,773,100.00	
HLB INC	2,982	31,000.00	92,442,000.00	
CELLTRION INC	2,900	149,900.00	434,710,000.00	
CELLTRION PHARM INC	355	82,200.00	29,181,000.00	
HANMI PHARM CO LTD	214	275,000.00	58,850,000.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	477	741,000.00	353,457,000.00	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	783	81,600.00	63,892,800.00	
SK BIOSCIENCE CO LTD	710	76,000.00	53,960,000.00	
YUHAN CORP	1,526	60,000.00	91,560,000.00	
HANA FINANCIAL GROUP	7,972	38,750.00	308,915,000.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	6,372	10,180.00	64,866,960.00	

	KAKAOBANK CORP	4,052	25,500.00	103,326,000.00	
	KB FINANCIAL GROUP INC	10,410	48,150.00	501,241,500.00	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	11,243	33,550.00	377,202,650.00	
	WOORI FINANCIAL GROUP INC	15,149	11,660.00	176,637,340.00	
	KAKAOPAY CORP	730	49,950.00	36,463,500.00	
	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	1,162	50,600.00	58,797,200.00	
	MERITZ FINANCIAL GROUP INC	2,513	45,200.00	113,587,600.00	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	5,653	6,990.00	39,514,470.00	
	NH INVESTMENT & SECURITIES C	2,964	9,680.00	28,691,520.00	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	1,943	36,200.00	70,336,600.00	
	DB INSURANCE CO LTD	1,260	72,100.00	90,846,000.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	856	237,500.00	203,300,000.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	2,205	69,100.00	152,365,500.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	1,032	129,600.00	133,747,200.00	
	COSMOAM&T CO LTD	620	202,500.00	125,550,000.00	
	L&F CO LTD	644	279,000.00	179,676,000.00	
	LG DISPLAY CO LTD	5,817	14,930.00	86,847,810.00	
	LG INNOTEK CO LTD	384	288,000.00	110,592,000.00	
	LOTTE ENERGY MATERIALS CORP	440	53,800.00	23,672,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	1,437	153,200.00	220,148,400.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	126,333	71,700.00	9,058,076,100.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	21,845	59,800.00	1,306,331,000.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	1,461	695,000.00	1,015,395,000.00	
	KT CORP	1,598	29,400.00	46,981,200.00	
	LG UPLUS CORP	6,485	10,330.00	66,990,050.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	7,197	20,200.00	145,379,400.00	
	SK HYNIX INC	14,474	117,500.00	1,700,695,000.00	
韓国ウォン 小計		411,825		29,340,473,130.00 (3,242,122,280)	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	31,000	79.30	2,458,300.00	
	ASIA CEMENT CORP	54,000	44.80	2,419,200.00	
	CHINA STEEL CORP	315,000	29.30	9,229,500.00	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	88,000	64.30	5,658,400.00	
	FORMOSA PLASTICS CORP	102,000	82.80	8,445,600.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	127,000	70.30	8,928,100.00	

TAIWAN CEMENT	152,917	36.60	5,596,762.20	
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	3,600	961.00	3,459,600.00	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	92,000	29.75	2,737,000.00	
VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	1,500	1,810.00	2,715,000.00	
WALSIN LIHWA CORP	74,000	40.40	2,989,600.00	
CHINA AIRLINES LTD	75,000	24.50	1,837,500.00	
EVA AIRWAYS CORP	66,000	36.10	2,382,600.00	
EVERGREEN MARINE CORP LTD	27,420	98.10	2,689,902.00	
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	55,000	30.25	1,663,750.00	
WAN HAI LINES LTD	18,650	50.90	949,285.00	
YANG MING MARINE TRANSPORT	41,000	46.80	1,918,800.00	
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	53,000	38.40	2,035,200.00	
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	5,420	507.00	2,747,940.00	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	10,080	202.50	2,041,200.00	
GIANT MANUFACTURING	9,000	228.50	2,056,500.00	
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	5,000	319.00	1,595,000.00	
POU CHEN	61,000	30.60	1,866,600.00	
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	8,000	767.00	6,136,000.00	
MOMO.COM INC	2,000	637.00	1,274,000.00	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	16,000	284.00	4,544,000.00	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	130,000	76.40	9,932,000.00	
PHARMAESSENTIA CORP	7,000	376.00	2,632,000.00	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	151,265	18.70	2,828,655.50	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	470,000	26.05	12,243,500.00	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	359,578	26.45	9,510,838.10	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	285,168	28.15	8,027,479.20	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	222,430	22.10	4,915,703.00	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	297,125	38.85	11,543,306.25	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	276,814	18.00	4,982,652.00	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	276,445	19.25	5,321,566.25	
TAIWAN BUSINESS BANK	172,000	14.25	2,451,000.00	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	244,741	28.35	6,938,407.35	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	106,000	44.30	4,695,800.00	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	38,245	212.00	8,107,940.00	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	251,437	24.10	6,059,631.70	

CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	252,000	44.50	11,214,000.00	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	414,000	12.30	5,092,200.00	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	198,825	64.80	12,883,860.00	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	366,835	9.10	3,338,198.50	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	14,000	385.50	5,397,000.00	
ACER INC	78,000	36.30	2,831,400.00	
ADVANTECH CO LTD	12,427	400.00	4,970,800.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	18,000	298.00	5,364,000.00	
AUO CORP	176,200	18.85	3,321,370.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	16,000	177.50	2,840,000.00	
COMPAL ELECTRONICS	100,000	31.10	3,110,000.00	
DELTA ELECTRONICS INC	52,000	357.00	18,564,000.00	
E INK HOLDINGS INC	24,000	219.00	5,256,000.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	330,800	108.50	35,891,800.00	
INNOLUX CORP	254,475	15.75	4,007,981.25	
INVENTEC CORP	73,000	63.60	4,642,800.00	
LARGAN PRECISION CO LTD	2,500	2,270.00	5,675,000.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	56,000	136.50	7,644,000.00	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	17,000	187.00	3,179,000.00	
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	6,000	266.50	1,599,000.00	
PEGATRON CORP	56,000	76.80	4,300,800.00	
QUANTA COMPUTER INC	72,000	198.00	14,256,000.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	34,000	59.30	2,016,200.00	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	35,000	203.00	7,105,000.00	
WISTRON CORP	73,000	128.00	9,344,000.00	
WIWYNN CORP	2,000	1,800.00	3,600,000.00	
WPG HOLDINGS LTD	35,960	57.80	2,078,488.00	
YAGEO CORPORATION	8,524	486.00	4,142,664.00	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	18,000	105.00	1,890,000.00	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	101,000	115.00	11,615,000.00	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	44,000	70.90	3,119,600.00	
TAIWAN MOBILE CO LTD	47,000	94.20	4,427,400.00	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	82,000	112.50	9,225,000.00	
EMEMORY TECHNOLOGY INC	1,800	2,050.00	3,690,000.00	
GLOBAL UNICHIP CORP	2,300	1,850.00	4,255,000.00	

	GLOBALWAFERS CO LTD	6,000	517.00	3,102,000.00	
	MEDIATEK INC	39,800	696.00	27,700,800.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	30,000	70.40	2,112,000.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS COR	16,000	404.50	6,472,000.00	
	PARADE TECHNOLOGIES LTD	2,000	919.00	1,838,000.00	
	POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU	70,000	30.10	2,107,000.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	13,000	415.00	5,395,000.00	
	SILERGY CORP	8,640	340.50	2,941,920.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	652,000	581.00	378,812,000.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	298,000	47.50	14,155,000.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	21,000	80.00	1,680,000.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	9,000	171.50	1,543,500.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	77,000	27.95	2,152,150.00	
	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	49,608	35.10	1,741,240.80	
新台湾ドル 小計		9,148,529		874,205,991.10 (3,926,408,788)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	19,660	384.55	7,560,253.00	
	COAL INDIA LTD	42,402	228.60	9,693,097.20	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	14,851	297.90	4,424,112.90	
	INDIAN OIL CORP LTD	70,217	98.25	6,898,820.25	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	81,360	166.75	13,566,780.00	
	PETRONET LNG LTD	18,996	224.85	4,271,250.60	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	80,649	2,841.85	229,192,360.65	
	ACC LTD	1,469	1,800.05	2,644,273.45	
	AMBUJA CEMENTS LTD	13,736	419.30	5,759,504.80	
	ASIAN PAINTS LTD	10,272	3,514.65	36,102,484.80	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	6,576	683.55	4,495,024.80	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	7,281	1,784.20	12,990,760.20	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	31,670	439.20	13,909,464.00	
	JINDAL STEEL & POWER LTD	10,594	640.05	6,780,689.70	
	JSW STEEL LTD	15,763	791.90	12,482,719.70	
	PI INDUSTRIES LTD	2,083	3,645.95	7,594,513.85	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	4,189	2,685.95	11,251,444.55	
	SHREE CEMENT LTD	251	24,028.30	6,031,103.30	
	SRF LTD	4,133	2,241.25	9,263,086.25	

TATA STEEL LTD	197,316	116.70	23,026,777.20	
ULTRATECH CEMENT LTD	3,033	8,329.20	25,262,463.60	
UPL LTD	13,811	639.15	8,827,300.65	
VEDANTA LTD	18,821	283.65	5,338,576.65	
ABB INDIA LTD	1,585	4,493.50	7,122,197.50	
ADANI ENTERPRISES LTD	4,197	2,423.75	10,172,478.75	
BHARAT ELECTRONICS LTD	102,464	126.90	13,002,681.60	
CG POWER AND INDUSTRIAL SOLU	15,444	417.40	6,446,325.60	
HAVELLS INDIA LTD	7,120	1,364.00	9,711,680.00	
HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	2,237	3,860.90	8,636,833.30	
LARSEN & TOUBRO LTD	18,402	2,494.15	45,897,348.30	
SIEMENS LTD	2,310	3,710.35	8,570,908.50	
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	6,472	625.50	4,048,236.00	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	14,130	731.40	10,334,682.00	
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	7,859	685.90	5,390,488.10	
INTERGLOBE AVIATION LTD	3,501	2,700.50	9,454,450.50	
BAJAJ AUTO LTD	1,903	4,823.65	9,179,405.95	
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	2,334	2,430.20	5,672,086.80	
BHARAT FORGE LTD	6,216	855.55	5,318,098.80	
EICHER MOTORS LTD	3,761	3,330.15	12,524,694.15	
HERO MOTOCORP LTD	2,952	3,096.65	9,141,310.80	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	24,535	1,544.45	37,893,080.75	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	3,577	9,607.55	34,366,206.35	
MRF LTD	54	102,718.15	5,546,780.10	
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN	53,088	96.20	5,107,065.60	
SONA BLW PRECISION FORGINGS	10,800	553.95	5,982,660.00	
TATA MOTORS LTD	44,047	620.60	27,335,568.20	
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LT	2,841	3,194.20	9,074,722.20	
TVS MOTOR CO LTD	6,191	1,334.10	8,259,413.10	
PAGE INDUSTRIES LTD	149	36,460.45	5,432,607.05	
TITAN CO LTD	9,515	2,995.65	28,503,609.75	
INDIAN HOTELS CO LTD	22,920	400.25	9,173,730.00	
JUBILANT FOODWORKS LTD	10,195	476.00	4,852,820.00	
ZOMATO LTD	116,147	77.65	9,018,814.55	
INFO EDGE INDIA LTD	1,911	4,679.50	8,942,524.50	

TRENT LTD	4,453	1,716.45	7,643,351.85	
AVENUE SUPERMARTS LTD	4,103	3,705.85	15,205,102.55	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	3,003	5,065.90	15,212,897.70	
ITC LTD	79,816	478.85	38,219,891.60	
MARICO LTD	12,369	531.85	6,578,452.65	
NESTLE INDIA LTD	851	22,940.95	19,522,748.45	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	15,548	860.45	13,378,276.60	
UNITED SPIRITS LTD	7,422	970.95	7,206,390.90	
VARUN BEVERAGES LTD	11,762	819.85	9,643,075.70	
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	3,413	1,828.85	6,241,865.05	
DABUR INDIA LTD	17,113	574.55	9,832,274.15	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	11,134	1,043.90	11,622,782.60	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	21,860	2,671.60	58,401,176.00	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	2,793	5,175.60	14,455,450.80	
MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	20,500	611.55	12,536,775.00	
AUROBINDO PHARMA LTD	7,383	751.10	5,545,371.30	
CIPLA LTD	13,421	1,035.80	13,901,471.80	
DIVI'S LABORATORIES LTD	3,145	3,638.05	11,441,667.25	
DR. REDDY'S LABORATORIES	2,966	5,221.35	15,486,524.10	
LUPIN LTD	4,421	932.75	4,123,687.75	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	25,785	1,081.85	27,895,502.25	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	2,579	1,924.55	4,963,414.45	
AU SMALL FINANCE BANK LTD	5,313	769.35	4,087,556.55	
AXIS BANK LTD	60,500	964.30	58,340,150.00	
BANDHAN BANK LTD	19,777	214.55	4,243,155.35	
BANK OF BARODA	27,026	200.00	5,405,200.00	
HDFC BANK LIMITED	73,394	1,685.10	123,676,229.40	
ICICI BANK LTD	136,870	973.45	133,236,101.50	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	28,784	1,906.60	54,879,574.40	
STATE BANK OF INDIA	47,984	601.45	28,859,976.80	
YES BANK LTD	275,079	17.45	4,800,128.55	
BAJAJ FINANCE LTD	7,278	7,584.70	55,201,446.60	
BAJAJ FINSERV LTD	9,746	1,644.10	16,023,398.60	
BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMEN	806	7,456.65	6,010,059.90	
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	11,638	1,170.30	13,619,951.40	

	MUTHOOT FINANCE LTD	2,371	1,292.75	3,065,110.25	
	SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	7,713	865.75	6,677,529.75	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	6,408	1,785.75	11,443,086.00	
	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	24,553	659.05	16,181,654.65	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	5,683	1,366.45	7,765,535.35	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	8,896	559.45	4,976,867.20	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	11,421	1,310.45	14,966,649.45	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	25,519	1,169.05	29,832,986.95	
	INFOSYS LTD	87,548	1,474.95	129,128,922.60	
	LTIMINDTREE LTD	2,255	4,990.50	11,253,577.50	
	MPHASIS LTD	1,924	2,169.80	4,174,695.20	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	24,319	3,470.05	84,388,145.95	
	TATA ELXSI LTD	853	7,558.90	6,447,741.70	
	TECH MAHINDRA LTD	14,666	1,244.70	18,254,770.20	
	WIPRO LTD	37,402	417.95	15,632,165.90	
	BHARTI AIRTEL LTD	59,315	870.75	51,648,536.25	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	7,170	979.65	7,024,090.50	
	ADANI POWER LTD	20,741	245.70	5,096,063.70	
	GAIL INDIA LTD	58,140	109.50	6,366,330.00	
	INDRAPRASTHA GAS LTD	7,746	497.05	3,850,149.30	
	NTPC LTD	113,658	192.55	21,884,847.90	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	90,939	243.25	22,120,911.75	
	TATA POWER CO LTD	39,023	219.50	8,565,548.50	
	DLF LTD	15,745	501.00	7,888,245.00	
	GODREJ PROPERTIES LTD	3,754	1,607.50	6,034,555.00	
インドルピー 小計		2,835,787		2,189,590,167.00 (3,744,199,185)	
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	16,008	16.55	264,932.40	
	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	68,061	4.19	285,175.59	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	107,154	1.91	204,664.14	
	INDUSTRIES QATAR	41,380	12.15	502,767.00	
	COMMERCIAL BANK PQSC	89,506	5.85	523,610.10	
	DUKHAN BANK	47,311	4.12	195,347.11	
	MASRAF AL RAYAN	156,266	2.47	386,602.08	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	26,217	10.00	262,170.00	

	QATAR ISLAMIC BANK	41,163	18.65	767,689.95	
	QATAR NATIONAL BANK	122,744	15.97	1,960,221.68	
	OOREDOO QPSC	18,307	11.41	208,882.87	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	11,535	18.10	208,783.50	
	BARWA REAL ESTATE CO	60,279	2.60	157,147.35	
カタールリアル 小計		805,931		5,927,993.77 (227,575,680)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	5,798	163.10	945,653.80	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	2,290	201.14	460,610.60	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	1,807	900.00	1,626,300.00	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	11,272	414.63	4,673,709.36	
	GOLD FIELDS LTD	23,923	285.23	6,823,557.29	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	15,256	83.01	1,266,400.56	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	23,265	136.28	3,170,554.20	
	KUMBA IRON ORE LTD	1,694	445.94	755,422.36	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	9,656	142.56	1,376,559.36	
	SASOL LTD	14,307	236.71	3,386,609.97	
	SIBANYE STILLWATER LTD	72,813	33.01	2,403,557.13	
	BIDVEST GROUP LTD	8,221	266.68	2,192,376.28	
	MULTICHOICE GROUP LTD	9,584	83.13	796,717.92	
	MR PRICE GROUP LTD	6,240	143.81	897,374.40	
	NASPERS LTD-N SHS	5,199	3,374.28	17,542,881.72	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	52,043	16.25	845,698.75	
	THE FOSCHINI GROUP LTD	10,240	94.35	966,144.00	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	22,905	76.61	1,754,752.05	
	BID CORP LTD	8,546	421.06	3,598,378.76	
	CLICKS GROUP LTD	6,931	257.99	1,788,128.69	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	12,899	237.53	3,063,899.47	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	9,547	186.62	1,781,661.14	
	ABSA GROUP LTD	22,911	180.45	4,134,289.95	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	2,173	1,637.74	3,558,809.02	
	NEDBANK GROUP LTD	12,732	225.51	2,871,193.32	
	STANDARD BANK GROUP LTD	35,808	185.35	6,637,012.80	
	FIRSTRAND LTD	134,868	70.60	9,521,680.80	
	REINET INVESTMENTS SCA	3,701	443.42	1,641,097.42	

	REMGRO LTD	14,915	157.27	2,345,682.05	
	DISCOVERY LTD	13,990	152.15	2,128,578.50	
	OLD MUTUAL LTD	121,527	12.62	1,533,670.74	
	OUTSURANCE GROUP LTD	22,382	37.95	849,396.90	
	SANLAM LTD	49,120	63.78	3,132,873.60	
	MTN GROUP LTD	45,604	134.59	6,137,842.36	
	VODACOM GROUP LTD	15,613	114.03	1,780,350.39	
	NEPI ROCKCASTLE N.V.	10,844	111.00	1,203,684.00	
南アフリカランド 小計		840,624		109,593,109.66 (857,018,117)	
アラブディルハム	MULTIPLY GROUP	88,559	3.26	288,702.34	
	AMERICANA RESTAURANTS INTERN	70,134	3.88	272,119.92	
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	88,102	3.97	349,764.94	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	73,466	8.30	609,767.80	
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	35,275	11.04	389,436.00	
	DUBAI ISLAMIC BANK	80,564	5.64	454,380.96	
	EMIRATES NBD PJSC	47,764	16.35	780,941.40	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	117,934	13.72	1,618,054.48	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	92,661	22.30	2,066,340.30	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	106,834	5.29	565,151.86	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	179,649	6.66	1,196,462.34	
アラブディルハム 小計		980,942		8,591,122.34 (326,376,737)	
クウェートディナール	AGILITY	35,573	0.65	23,335.88	
	BOUBYAN BANK K.S.C	38,661	0.65	25,168.31	
	GULF BANK	32,739	0.27	9,035.96	
	KUWAIT FINANCE HOUSE	216,159	0.78	169,252.49	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	200,495	0.98	196,886.09	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	52,466	0.53	27,911.91	
	MABANEE CO KPSC	20,333	0.87	17,750.70	
クウェートディナール 小計		596,426		469,341.34 (214,273,095)	
オフショア人民元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	18,900	6.50	122,850.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	47,900	6.53	312,787.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	11,500	27.96	321,540.00	

COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-A	8,100	14.50	117,450.00	
GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	9,700	6.83	66,251.00	
INNER MONGOLIA DIAN TOU EN-A	2,700	13.69	36,963.00	
JIZHONG ENERGY RESOURCES-A	4,900	6.52	31,948.00	
OFFSHORE OIL ENGINEERING-A	10,500	6.58	69,090.00	
PETROCHINA CO LTD-A	33,500	8.14	272,690.00	
PINGDINGSHAN TIANAN COAL -A	3,200	7.74	24,768.00	
SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	15,700	16.28	255,596.00	
SHAN XI HUA YANG GROUP NEW-A	5,100	8.05	41,055.00	
SHANXI COKING COAL ENERGY-A	12,420	8.85	109,917.00	
SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	6,500	16.88	109,720.00	
YANKUANG ENERGY GROUP CO-A	6,736	18.30	123,268.80	
YANTAI JEREH OILFIELD-A	900	26.81	24,129.00	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	23,100	5.80	133,980.00	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	6,200	23.57	146,134.00	
ANHUI HONGLU STEEL CONSTRU-A	650	30.00	19,500.00	
ASIA-POTASH INTERNATIONAL-A	1,500	26.04	39,060.00	
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	33,700	5.74	193,438.00	
BBMG CORPORATION-A	900	2.20	1,980.00	
CANMAX TECHNOLOGIES CO LTD-A	1,040	33.53	34,871.20	
CHENGXIN LITHIUM GROUP CO-A	1,400	28.12	39,368.00	
CHINA JUSHI CO LTD -A	7,414	13.77	102,090.78	
CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	5,700	23.99	136,743.00	
CHINA RARE EARTH RESOURCES-A	1,900	30.49	57,931.00	
CMOC GROUP LTD-A	28,400	5.85	166,140.00	
CNGR ADVANCED MATERIAL CO -A	600	58.83	35,298.00	
CNNC HUA YUAN TITANIUM -A	4,785	5.79	27,705.15	
DO-FLUORIDE NEW MATERIALS -A	2,100	19.09	40,089.00	
GANFENG LITHIUM GROUP CO L-A	2,740	59.77	163,769.80	
GEM CO LTD-A	10,800	6.97	75,276.00	
GUANGDONG HEC TECHNOLOGY H-A	6,300	6.93	43,659.00	
GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	4,180	35.09	146,676.20	
HANGZHOU OXYGEN PLANT GROU-A	2,000	32.89	65,780.00	
HENAN SHENHUO COAL & POWER-A	3,500	14.30	50,050.00	
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	9,320	14.90	138,868.00	

HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	1,950	7.04	13,728.00	
HESTEEL CO LTD-A	1,500	2.25	3,375.00	
HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A	1,400	71.23	99,722.00	
HUAFON CHEMICAL CO LTD -A	4,600	7.42	34,132.00	
HUAIBEI MINING HOLDINGS CO-A	3,700	12.36	45,732.00	
HUAXIN CEMENT CO LTD-A	1,100	12.45	13,695.00	
HUBEI FEILIHUA QUARTZ GLAS-A	1,000	43.90	43,900.00	
HUBEI XINGFA CHEMICALS GRP-A	1,900	24.85	47,215.00	
HUNAN CHANGYUAN LICO CO LT-A	3,324	10.91	36,264.84	
HUNAN VALIN STEEL CO LTD -A	14,600	5.28	77,088.00	
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	73,300	1.81	132,673.00	
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	15,700	4.25	66,725.00	
INNER MONGOLIA YUAN XING-A	5,900	7.29	43,011.00	
JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	7,600	11.90	90,440.00	
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	390	69.65	27,163.50	
JIANGSU YOKE TECHNOLOGY-A	500	76.19	38,095.00	
JIANGXI COPPER CO LTD-A	2,000	19.67	39,340.00	
JINDUICHENG MOLYBDENUM CO -A	6,700	11.35	76,045.00	
LB GROUP CO LTD-A	4,500	17.09	76,905.00	
LUXI CHEMICAL GROUP CO LT-A	1,900	11.27	21,413.00	
LUXIANG COMPANY,LTD.	400	61.58	24,632.00	
NINGBO SHANSHAN CO LTD-A	2,300	14.97	34,431.00	
NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	11,900	13.54	161,126.00	
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	18,100	3.96	71,676.00	
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY-A	8,400	19.37	162,708.00	
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	15,750	12.21	192,307.50	
SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A	8,090	15.75	127,417.50	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	6,368	25.90	164,931.20	
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	3,520	32.81	115,491.20	
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	10,000	3.10	31,000.00	
SHANDONG SUN PAPER INDUSTR-A	2,200	11.15	24,530.00	
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	4,408	38.33	168,958.64	
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	3,700	7.73	28,601.00	
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	4,800	3.98	19,104.00	
SHENGHE RESOURCES HOLDINGS-A	1,700	12.38	21,046.00	

SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	1,080	49.52	53,481.60	
SHENZHEN DYNANONIC CO LTD-A	320	116.28	37,209.60	
SHENZHEN SENIOR TECHNOLOGY-A	1,798	16.42	29,523.16	
SHENZHEN YUTO PACKAGING TE-A	1,700	25.66	43,622.00	
SICHUAN HEBANG BIOTECHNOL- A	14,200	2.52	35,784.00	
SICHUAN YAHUA INDUSTRIAL-A	1,900	17.49	33,231.00	
SINOMA SCIENCE&TECHNOLOGY -A	2,200	20.22	44,484.00	
SINOMINE RESOURCE GROUP CO-A	980	47.31	46,363.80	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A	600	3.13	1,878.00	
SKSHU PAINT CO LTD-A	784	69.05	54,135.20	
SUNRESIN NEW MATERIALS CO -A	1,200	59.50	71,400.00	
TANGSHAN JIDONG CEMENT INV-A	3,700	7.47	27,639.00	
TIANQI LITHIUM CORP-A	2,300	67.84	156,032.00	
TIANSHAN ALUMINUM GROUP CO-A	7,500	6.40	48,000.00	
TIBET SUMMIT RESOURCES CO-A	1,500	17.78	26,670.00	
TONGKUN GROUP CO LTD-A	1,500	14.68	22,020.00	
TONGLING NONFERROUS METALS-A	10,400	3.10	32,240.00	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	5,500	91.15	501,325.00	
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	640	29.56	18,918.40	
WESTERN MINING CO -A	3,300	11.66	38,478.00	
WESTERN SUPERCONDUCTING TE-A	560	52.03	29,136.80	
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD-A	1,200	18.50	22,200.00	
XINJIANG ZHONGTAI CHEMICAL-A	4,100	6.79	27,839.00	
YINTAI GOLD CO LTD-A	2,380	13.60	32,368.00	
YONGXING SPECIAL MATERIALS-A	910	55.03	50,077.30	
YUNNAN ALUMINIUM CO LTD-A	7,300	13.18	96,214.00	
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	1,400	91.89	128,646.00	
YUNNAN TIN CO LTD-A	3,500	16.40	57,400.00	
YUNNAN YUNTIANHUA CO-A	1,500	18.27	27,405.00	
ZANGGE MINING CO LTD-A	3,300	23.39	77,187.00	
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	2,708	47.82	129,496.56	
ZHEJIANG JUHUA CO-A	5,700	14.97	85,329.00	
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	6,700	9.39	62,913.00	
ZHONGJIN GOLD CORP-A	10,000	11.24	112,400.00	
ZIBO QIXIANG TENGDA CHEMIC-A	4,500	6.50	29,250.00	

ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	36,000	12.59	453,240.00	
AECC AERO-ENGINE CONTROL-A	1,000	23.25	23,250.00	
AECC AVIATION POWER CO-A	4,600	41.48	190,808.00	
AVICOPTER PLC-A	500	41.71	20,855.00	
BEIJING EASPRING MATERIAL-A	700	48.23	33,761.00	
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	3,700	25.32	93,684.00	
BEIJING UNITED INFORMATION-A	841	34.29	28,837.89	
CHINA BAOAN GROUP-A	4,500	11.47	51,615.00	
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	6,900	31.85	219,765.00	
CHINA ENERGY ENGINEERING COR	52,300	2.37	123,951.00	
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	9,700	8.33	80,801.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	31,200	7.69	239,928.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	73,200	5.65	413,580.00	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	6,960	219.50	1,527,720.00	
COSCO SHIPPING DEVELOPMENT CO	18,400	2.52	46,368.00	
CRRC CORP LTD-A	36,500	6.58	240,170.00	
DAJIN HEAVY INDUSTRY CO LT-A	1,200	30.73	36,876.00	
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	4,400	19.31	84,964.00	
EVE ENERGY CO LTD-A	3,020	56.05	169,271.00	
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	417	5.97	2,489.49	
FAW JIEFANG GROUP CO LTD-A	3,200	9.18	29,376.00	
GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A	600	101.39	60,834.00	
GOLDWIND SCIENCE &TECHNOL-A	3,400	10.91	37,094.00	
GOODWE TECHNOLOGIES CO LTD-A	280	171.17	47,927.60	
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	3,900	26.49	103,311.00	
GUANGDONG KINLONG HARDWARE-A	400	54.81	21,924.00	
GUANGZHOU GREAT POWER ENER-A	1,000	49.48	49,480.00	
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	1,680	33.78	56,750.40	
HOYMILES POWER ELECTRONICS-A	298	347.25	103,480.50	
HOYUAN GREEN ENERGY CO LTD	978	49.95	48,851.10	
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	2,436	68.68	167,304.48	
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	5,300	15.56	82,468.00	
JIANGXI SPECIAL ELECTRIC -A	2,500	11.95	29,875.00	
KEDA INDUSTRIAL GROUP CO LTD	2,800	11.19	31,332.00	
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A	2,200	14.89	32,758.00	

METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	39,700	4.04	160,388.00	
MING YANG SMART ENERGY GRO-A	4,300	17.00	73,100.00	
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	11,682	24.60	287,377.20	
NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO -A	540	132.90	71,766.00	
NINGBO ORIENT WIRES & CABL-A	1,000	45.22	45,220.00	
NINGBO RONBAY NEW ENERGY T-A	450	50.19	22,585.50	
NORTH INDUSTRIES GROUP RED-A	2,400	17.25	41,400.00	
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	26,400	5.73	151,272.00	
PYLON TECHNOLOGIES CO LTD-A	200	188.32	37,664.00	
RIYUE HEAVY INDUSTRY CO LT-A	2,000	18.45	36,900.00	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	12,600	17.37	218,862.00	
SHANGHAI CONSTRUCTION GROU-A	5,600	2.75	15,400.00	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	24,000	4.74	113,760.00	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	2,400	67.01	160,824.00	
SHENZHEN KSTAR SCIENCE AND-A	1,200	37.73	45,276.00	
SICHUAN NEW ENERGY POWER CO	2,400	14.63	35,112.00	
SICHUAN ROAD&BRIDGE GROUP-A	13,860	9.91	137,352.60	
SIEYUAN ELECTRIC CO LTD-A	1,500	51.64	77,460.00	
SINOMA INTERNATIONAL ENGIN-A	5,500	12.80	70,400.00	
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	2,200	110.70	243,540.00	
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	1,300	15.90	20,670.00	
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	409	191.73	78,417.57	
TBEA CO LTD-A	10,920	16.41	179,197.20	
TITAN WIND ENERGY SUZHOU-A	2,800	13.98	39,144.00	
WEICHAI POWER CO LTD-A	9,500	12.75	121,125.00	
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	20,700	6.99	144,693.00	
XIAMEN C & D INC-A	4,400	9.12	40,128.00	
ZHEFU HOLDING GROUP CO LTD-A	5,300	4.30	22,790.00	
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	4,100	27.32	112,012.00	
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	420	59.64	25,048.80	
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	3,800	28.07	106,666.00	
ZHEJIANG WEIXING NEW BUILD-A	1,300	20.02	26,026.00	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-A	800	43.08	34,464.00	
ZHUZHOU KIBING GROUP CO LT-A	4,000	8.55	34,200.00	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	15,500	7.07	109,585.00	

SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	1,800	42.57	76,626.00	
ZHEJIANG WEIMING ENVIRONME-A	2,340	17.51	40,973.40	
AIR CHINA LTD-A	11,400	8.70	99,180.00	
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	56,400	5.57	314,148.00	
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	24,800	4.71	116,808.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	17,600	6.52	114,752.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	20,770	9.96	206,869.20	
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	24,100	7.21	173,761.00	
HAINAN AIRLINES HOLDING CO-A	81,700	1.60	130,720.00	
JUNEYAO AIRLINES CO LTD-A	3,500	16.91	59,185.00	
LIAONING PORT CO LTD-A	21,900	1.56	34,164.00	
S F HOLDING CO LTD-A	8,600	47.10	405,060.00	
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	2,100	44.99	94,479.00	
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	8,900	5.30	47,170.00	
SPRING AIRLINES CO LTD-A	1,900	60.52	114,988.00	
YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	7,400	15.74	116,476.00	
YUNDA HOLDING CO LTD-A	4,870	9.78	47,628.60	
BETHEL AUTOMOTIVE SAFETY S-A	900	86.22	77,598.00	
BYD CO LTD -A	2,800	264.83	741,524.00	
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	200	131.61	26,322.00	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	10,226	13.76	140,709.76	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	3,400	36.28	123,352.00	
GREAT WALL MOTOR CO LTD-A	3,300	25.33	83,589.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A	6,900	10.92	75,348.00	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	7,100	18.25	129,575.00	
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	1,000	157.89	157,890.00	
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	1,200	19.84	23,808.00	
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	1,900	75.90	144,210.00	
SAIC MOTOR CORP LTD-A	12,410	14.28	177,214.80	
SAILUN GROUP CO LTD-A	3,100	11.58	35,898.00	
SERES GROUP CO L-A	3,100	42.91	133,021.00	
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	1,300	23.40	30,420.00	
SHENZHEN KEDALI INDUSTRY C-A	400	120.65	48,260.00	
BEIJING ROBOROCK TECHNOLOG-A	200	363.75	72,750.00	
ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A	600	75.05	45,030.00	

GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	4,600	37.51	172,546.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-A	9,400	23.06	216,764.00	
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	1,000	25.13	25,130.00	
JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	1,040	40.31	41,922.40	
OPPEIN HOME GROUP INC-A	1,040	94.00	97,760.00	
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	31,790	4.40	139,876.00	
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	300	51.78	15,534.00	
BTG HOTELS GROUP CO LTD-A	1,600	20.04	32,064.00	
OFFCN EDUCATION TECHNOLOGY-A	10,200	4.63	47,226.00	
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	1,700	44.48	75,616.00	
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	8,300	4.46	37,018.00	
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	5,080	12.70	64,516.00	
37 INTERACTIVE ENTERTAINME-A	3,900	28.60	111,540.00	
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	1,300	8.24	10,712.00	
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	23,800	7.31	173,978.00	
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY XI	100	422.00	42,200.00	
GIANT NETWORK GROUP CO LTD-A	4,100	15.14	62,074.00	
KUNLUN TECH CO LTD-A	2,500	38.53	96,325.00	
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	3,110	34.17	106,268.70	
PERFECT WORLD CO LTD-A	4,450	15.21	67,684.50	
WANDA FILM HOLDING CO LTD-A	4,500	14.47	65,115.00	
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	17,100	6.32	108,072.00	
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	3,400	114.23	388,382.00	
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	5,000	7.00	35,000.00	
WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A	6,000	4.88	29,280.00	
DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	1,036	26.77	27,733.72	
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	2,164	36.00	77,904.00	
ANGEL YEAST CO LTD-A	700	35.19	24,633.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	600	244.32	146,592.00	
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	500	53.02	26,510.00	
ANHUI YINGJIA DISTILLERY C-A	600	64.21	38,526.00	
ANJOY FOODS GROUP CO LTD	400	146.70	58,680.00	
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	6,600	7.03	46,398.00	
BEIJING YANJING BREWERY CO-A	3,900	11.25	43,875.00	
CHONGQING BREWERY CO-A	800	86.38	69,104.00	

CHONGQING FULING ZHACAI-A	910	17.94	16,325.40	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	8,170	44.20	361,114.00	
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	900	20.59	18,531.00	
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	2,800	48.72	136,416.00	
HEBEI YANGYUAN ZHIHUI BEVERA	2,600	25.19	65,494.00	
HEILONGJIANG AGRICULTURE-A	2,500	14.13	35,325.00	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	7,400	24.33	180,042.00	
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	11,500	27.24	313,260.00	
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	2,000	55.39	110,780.00	
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	2,700	131.61	355,347.00	
JIUGUI LIQUOR CO LTD-A	400	91.15	36,460.00	
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	300	34.28	10,284.00	
JUEWEI FOOD CO LTD-A	300	36.79	11,037.00	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	2,000	1,723.00	3,446,000.00	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	2,500	221.15	552,875.00	
MEIHUA HOLDINGS GROUP CO -A	5,400	8.97	48,438.00	
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	9,416	42.45	399,709.20	
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	7,600	11.89	90,364.00	
SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT-A	1,372	35.01	48,033.72	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	2,120	212.95	451,454.00	
SHEDE SPIRITS CO LTD-A	700	129.92	90,944.00	
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	400	63.00	25,200.00	
TOLY BREAD CO LTD-A	1,176	9.64	11,336.64	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-A	1,500	94.42	141,630.00	
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	10,060	18.77	188,826.20	
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	6,400	168.32	1,077,248.00	
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	2,200	40.13	88,286.00	
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	1,100	16.15	17,765.00	
BY-HEALTH CO LTD-A	1,300	20.58	26,754.00	
YUNNAN BOTANEE BIO-TECHNOL-A	400	89.58	35,832.00	
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	13,168	19.14	252,035.52	
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD-A	1,000	53.57	53,570.00	
CHINA MEHECO CO LTD -A	2,240	12.88	28,851.20	
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	3,300	31.20	102,960.00	
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	700	69.91	48,937.00	

HUADONG MEDICINE CO LTD-A	2,940	43.74	128,595.60	
IRAY TECHNOLOGY CO LTD-A	280	266.25	74,550.00	
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	1,180	21.62	25,511.60	
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A	500	35.31	17,655.00	
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	5,960	9.93	59,182.80	
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	1,900	21.11	40,109.00	
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	8,380	6.91	57,905.80	
OVCTEK CHINA INC-A	920	31.13	28,639.60	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	4,400	20.84	91,696.00	
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	1,900	297.52	565,288.00	
SHENZHEN NEW INDUSTRIES BI-A	1,000	59.00	59,000.00	
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	300	103.16	30,948.00	
APELOA PHARMACEUTICAL CO-A	900	16.66	14,994.00	
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	680	118.07	80,287.60	
BEIJING TIANTAN BIOLOGICAL-A	3,300	24.81	81,873.00	
BEIJING TONGRENTANG CO-A	2,300	52.01	119,623.00	
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	1,015	64.02	64,980.30	
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	300	49.84	14,952.00	
BGI GENOMICS CO LTD-A	300	57.57	17,271.00	
BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY COR-A	800	89.64	71,712.00	
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	700	143.84	100,688.00	
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	1,500	54.68	82,020.00	
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	4,050	45.88	185,814.00	
DAAN GENE CO LTD-A	960	9.77	9,379.20	
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	1,200	52.12	62,544.00	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	300	62.81	18,843.00	
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	4,680	21.67	101,415.60	
HUBEI JUMPCAN PHARMACEUT-A	1,300	27.31	35,503.00	
HUMANWELL HEALTHCARE GROUP-A	3,800	24.38	92,644.00	
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	300	440.01	132,003.00	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	11,016	46.69	514,337.04	
JOINCARE PHARMACEUTICAL GR-A	1,600	12.29	19,664.00	
JOINN LABORATORIES CHINA C-A	784	37.75	29,596.00	
LIVZON PHARMACEUTICAL GROU-A	500	36.88	18,440.00	
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	1,098	13.20	14,493.60	

PHARMARON BEIJING CO LTD-A	2,450	37.83	92,683.50	
PORTON PHARMA SOLUTIONS L-A	800	27.17	21,736.00	
SHANDONG BUCHANG PHARMACEU-A	260	19.98	5,194.80	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	3,600	30.56	110,016.00	
SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCE-A	835	38.52	32,164.20	
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	10,500	7.57	79,485.00	
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	960	25.60	24,576.00	
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	1,700	31.79	54,043.00	
SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A	2,600	24.25	63,050.00	
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	2,400	27.70	66,480.00	
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	3,000	26.25	78,750.00	
WUXI APPTEC CO LTD-A	3,728	67.87	253,019.36	
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	2,960	53.99	159,810.40	
ZHANGZHOU PIENTZEHUANG PHA-A	900	282.90	254,610.00	
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	1,210	18.15	21,961.50	
ZHEJIANG JIUZHOU PHARMACEU-A	1,300	24.82	32,266.00	
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	5,463	16.19	88,445.97	
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A	400	34.09	13,636.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	125,400	3.40	426,360.00	
BANK OF BEIJING CO LTD -A	32,600	4.63	150,938.00	
BANK OF CHANGSHA CO LTD-A	7,500	7.95	59,625.00	
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	5,400	12.87	69,498.00	
BANK OF CHINA LTD-A	52,600	3.72	195,672.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	62,200	5.52	343,344.00	
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	13,000	11.32	147,160.00	
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	23,800	7.03	167,314.00	
BANK OF NANJING CO LTD -A	15,500	8.12	125,860.00	
BANK OF NINGBO CO LTD -A	9,900	24.30	240,570.00	
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	24,610	5.95	146,429.50	
BANK OF SUZHOU CO LTD-A	5,100	6.72	34,272.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	9,200	5.89	54,188.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	78,400	2.94	230,496.00	
CHINA MERCHANTS BANK-A	34,000	31.58	1,073,720.00	
CHINA MINSHENG BANKING-A	46,000	3.92	180,320.00	
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	21,970	2.58	56,682.60	

CHONGQING RURAL COMMERCIAL-A	8,500	3.69	31,365.00	
HUAXIA BANK CO LTD-A	24,300	5.52	134,136.00	
IND & COMM BK OF CHINA-A	94,400	4.56	430,464.00	
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	35,300	15.72	554,916.00	
PING AN BANK CO LTD-A	34,400	11.31	389,064.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	42,400	4.78	202,672.00	
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	44,600	7.41	330,486.00	
SHANGHAI RURAL COMMERCIAL -A	13,500	5.58	75,330.00	
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A	13,900	3.82	53,098.00	
BOC INTERNATIONAL CHINA CO-A	3,000	10.61	31,830.00	
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	8,800	7.51	66,088.00	
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	6,800	6.10	41,480.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-A	8,000	11.92	95,360.00	
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	3,000	8.27	24,810.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPTAL-A	3,500	36.63	128,205.00	
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	11,900	14.01	166,719.00	
CITIC SECURITIES CO-A	21,500	20.41	438,815.00	
CSC FINANCIAL CO LTD-A	7,500	24.67	185,025.00	
DONGXING SECURITIES CO LT-A	6,200	8.24	51,088.00	
EAST MONEY INFORMATION CO-A	27,812	14.37	399,658.44	
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	6,600	16.66	109,956.00	
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	500	5.76	2,880.00	
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	17,000	6.75	114,750.00	
GF SECURITIES CO LTD-A	9,500	14.90	141,550.00	
GUANGZHOU YUEXIU CAPITAL H-A	4,374	6.50	28,431.00	
GUOLIAN SECURITIES CO LTD-A	2,200	9.25	20,350.00	
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	11,300	9.08	102,604.00	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	12,000	14.61	175,320.00	
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	9,500	6.73	63,935.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	18,700	9.64	180,268.00	
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	1,000	165.10	165,100.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	13,100	14.68	192,308.00	
HUAXI SECURITIES CO LTD-A	300	8.43	2,529.00	
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	16,300	6.35	103,505.00	
NANJING SECURITIES CO LTD	7,600	8.28	62,928.00	

ORIENT SECURITIES CO LTD-A	10,800	9.91	107,028.00	
SDIC CAPITAL CO LTD-A	11,000	7.44	81,840.00	
SHANXI SECURITIES CO LTD-A	400	5.77	2,308.00	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	45,600	4.68	213,408.00	
SINOLINK SECURITIES CO LTD-A	7,700	8.91	68,607.00	
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	9,700	7.59	73,623.00	
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	3,800	3.74	14,212.00	
WESTERN SECURITIES CO LTD-A	10,000	6.58	65,800.00	
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	6,000	10.07	60,420.00	
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD-A	10,500	7.02	73,710.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	4,500	32.59	146,655.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	11,100	27.55	305,805.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	3,800	39.97	151,886.00	
PICC HOLDING CO-A	15,500	6.03	93,465.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	16,500	47.77	788,205.00	
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	11,700	12.00	140,400.00	
BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	800	451.00	360,800.00	
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	4,674	13.15	61,463.10	
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	1,170	49.29	57,669.30	
DHC SOFTWARE CO LTD -A	400	6.85	2,740.00	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	3,073	37.74	115,975.02	
IFLYTEK CO LTD - A	3,600	67.76	243,936.00	
NAVINFO CO LTD-A	4,800	11.29	54,192.00	
QI AN XIN TECHNOLOGY GROUP-A	1,252	48.98	61,322.96	
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	900	111.09	99,981.00	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	2,995	52.71	157,866.45	
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	900	98.12	88,308.00	
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	5,908	18.83	111,247.64	
AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A	2,300	24.61	56,603.00	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	57,300	4.30	246,390.00	
CETC CYBERSPACE SECURITY T-A	1,300	27.06	35,178.00	
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	4,500	31.74	142,830.00	
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	6,700	12.59	84,353.00	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-A	11,000	6.04	66,440.00	
CHINA ZHENHUA GROUP SCIENC-A	1,200	93.05	111,660.00	

FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	17,600	25.09	441,584.00	
GOERTEK INC -A	6,100	18.03	109,983.00	
GRG BANKING EQUIPMENT CO -A	2,200	11.55	25,410.00	
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	6,900	6.89	47,541.00	
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICAT-A	300	10.18	3,054.00	
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	1,500	62.50	93,750.00	
HENGDIAN GROUP DMEGC -A	2,700	17.50	47,250.00	
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO-A	3,700	15.36	56,832.00	
HUAGONG TECH CO LTD-A	2,700	44.16	119,232.00	
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	2,400	45.11	108,264.00	
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	9,600	12.29	117,984.00	
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	10,433	33.56	350,131.48	
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	576	121.97	70,254.72	
NINESTAR CORP-A	1,800	32.88	59,184.00	
RAYTRON TECHNOLOGY CO LTD-A	700	47.60	33,320.00	
SHANGHAI FRIENDESS ELECTRO-A	280	211.11	59,110.80	
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	2,300	15.94	36,662.00	
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	780	79.70	62,166.00	
SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY-A	3,500	21.16	74,060.00	
SHENZHEN SUNLORD ELECTRONI-A	800	25.36	20,288.00	
SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	1,794	133.36	239,247.84	
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	3,300	23.60	77,880.00	
TIANJIN712 COMMUNICATION &-A	700	28.62	20,034.00	
TIANMA MICROELECTRONICS-A	2,400	9.19	22,056.00	
UNISPLENDOUR CORP LTD-A	4,876	28.69	139,892.44	
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	2,700	47.01	126,927.00	
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	3,464	8.11	28,093.04	
WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHA-A	1,760	24.42	42,979.20	
XIAMEN FARATRONIC CO LTD-A	400	133.20	53,280.00	
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	2,240	39.86	89,286.40	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	6,300	22.02	138,726.00	
ZHEJIANG SUPCON TECHNOLOGY-A	870	55.22	48,041.40	
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	1,700	149.00	253,300.00	
ZTE CORP-A	6,400	42.19	270,016.00	
CHINA UNITED NETWORK-A	46,500	5.23	243,195.00	

CECEP SOLAR ENERGY CO LT-A	6,500	6.59	42,835.00	
CECEP WIND POWER CORP-A	7,900	3.63	28,677.00	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	32,500	7.18	233,350.00	
CHINA THREE GORGES RENEWAB-A	42,200	5.32	224,504.00	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	35,300	22.50	794,250.00	
DATANG INTL POWER GEN CO-A	20,000	3.15	63,000.00	
ENN NATURAL GAS CO LTD-A	4,800	18.99	91,152.00	
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	31,000	3.67	113,770.00	
HUADIAN POWER INTL CORP-A	12,500	6.06	75,750.00	
HUANENG POWER INTL INC-A	18,200	9.26	168,532.00	
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	13,800	12.58	173,604.00	
SHANGHAI ELECTRIC POWER CO-A	7,100	10.27	72,917.00	
SHENZHEN ENERGY GROUP CO L-A	11,600	6.81	78,996.00	
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A	5,200	14.63	76,076.00	
ZHEJIANG ZHENENG ELECTRIC-A	21,300	4.91	104,583.00	
3PEAK INC-A	200	226.12	45,224.00	
ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	943	137.00	129,191.00	
AMLOGIC SHANGHAI INC-A	600	94.73	56,838.00	
CAMBRICON TECHNOLOGIES-A	800	182.37	145,896.00	
CHINA RESOURCES MICROELECT-A	2,200	53.84	118,448.00	
FLAT GLASS GROUP CO LTD-A	2,300	34.52	79,396.00	
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR I-A	1,356	114.60	155,397.60	
HANGZHOU CHANG CHUAN TECHN-A	1,300	43.79	56,927.00	
HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	2,352	33.90	79,732.80	
HANGZHOU LION ELECTRONICS -A	1,000	37.03	37,030.00	
HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	2,000	30.69	61,380.00	
INGENIC SEMICONDUCTOR CO -A	1,200	92.29	110,748.00	
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	4,312	32.76	141,261.12	
JCET GROUP CO LTD-A	3,800	35.16	133,608.00	
JIANGSU PACIFIC QUARTZ CO -A	700	104.68	73,276.00	
JINKO SOLAR CO LTD-A	13,400	12.20	163,480.00	
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	12,936	29.24	378,248.64	
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A	1,514	59.19	89,613.66	
NATIONAL SILICON INDUSTRY -A	5,600	20.30	113,680.00	
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	900	276.63	248,967.00	

	RISEN ENERGY CO LTD-A	2,400	23.88	57,312.00	
	SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	9,900	16.89	167,211.00	
	SG MICRO CORP-A	1,007	85.30	85,897.10	
	SHANGHAI AIKO SOLAR ENERGY-A	3,220	27.72	89,258.40	
	SHANGHAI FUDAN MICROELE-DO-A	800	58.43	46,744.00	
	SHENZHEN SC NEW ENERGY TEC-A	300	101.36	30,408.00	
	STARPOWER SEMICONDUCTOR LT-A	200	222.64	44,528.00	
	TCL ZHONGHUAN RENEWABLE EN-A	5,375	29.60	159,100.00	
	TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	1,900	9.97	18,943.00	
	TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	3,200	24.24	77,568.00	
	TONGWEI CO LTD-A	6,600	33.80	223,080.00	
	TRINA SOLAR CO LTD-A	3,200	36.19	115,808.00	
	UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	1,819	90.81	165,183.39	
	VERISILICON MICROELECTRONI-A	1,000	68.59	68,590.00	
	WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	2,185	103.87	226,955.95	
	WUXI AUTOWELL TECHNOLOGY C-A	400	184.10	73,640.00	
	XINJIANG DAQO NEW ENERGY C-A	3,600	40.52	145,872.00	
	YANGZHOU YANGJIE ELECTRONI-A	700	43.08	30,156.00	
	ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	1,800	64.11	115,398.00	
	CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	12,100	12.46	150,766.00	
	CHINA VANKE CO LTD -A	16,400	13.90	227,960.00	
	GEMDALE CORP-A	7,200	6.88	49,536.00	
	HAINAN AIRPORT INFRASTRUCT-A	21,800	4.09	89,162.00	
	HANGZHOU BINJIANG REAL EST-A	5,600	8.57	47,992.00	
	POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	17,400	12.75	221,850.00	
	SHANGHAI LINGANG HOLDINGS-A	1,680	12.22	20,529.60	
	YOUNGOR GROUP CO-A	3,100	6.56	20,336.00	
	ZHEJIANG CHINA COMMODITIES-A	13,000	8.57	111,410.00	
オフショア人民元 小計		4,121,413		62,277,842.08 (1,204,802,221)	
サウジアラビアリアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	7,849	10.66	83,670.34	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	70,868	32.30	2,289,036.40	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	3,568	46.20	164,841.60	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	8,294	14.60	121,092.40	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	6,122	129.40	792,186.80	

SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	10,211	36.10	368,617.10	
SAUDI ARABIAN MINING CO	34,492	43.80	1,510,749.60	
SAUDI ARAMCO BASE OIL CO	1,374	146.00	200,604.00	
SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	23,960	85.50	2,048,580.00	
SAUDI IND INVESTMENT GROUP	9,618	24.58	236,410.44	
SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	18,931	12.50	236,637.50	
YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	7,669	45.90	352,007.10	
SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	1,076	180.60	194,325.60	
JARIR MARKETING CO	14,720	16.18	238,169.60	
NAHDI MEDICAL CO	871	179.20	156,083.20	
ALMARAI CO	6,924	65.70	454,906.80	
SAVOLA	6,673	41.10	274,260.30	
DALLAH HEALTHCARE CO	835	172.80	144,288.00	
DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	2,355	302.80	713,094.00	
MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	1,322	262.80	347,421.60	
AL RAJHI BANK	51,979	70.80	3,680,113.20	
ALINMA BANK	24,489	36.45	892,624.05	
ARAB NATIONAL BANK	16,584	27.70	459,376.80	
BANK AL-JAZIRA	11,133	18.30	203,733.90	
BANK ALBILAD	13,423	43.35	581,887.05	
BANQUE SAUDI FRANSI	16,111	44.15	711,300.65	
RIYAD BANK	38,641	34.60	1,336,978.60	
SAUDI AWWAL BANK	26,419	41.50	1,096,388.50	
SAUDI INVESTMENT BANK/THE	13,432	17.66	237,209.12	
THE SAUDI NATIONAL BANK	78,054	40.60	3,168,992.40	
SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING	1,363	197.20	268,783.60	
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	1,990	183.00	364,170.00	
ARABIAN INTERNET & COMMUNICA	542	365.00	197,830.00	
ELM CO	642	656.40	421,408.80	
ETIHAD ETISALAT CO	10,475	47.55	498,086.25	
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	13,459	13.86	186,541.74	
SAUDI TELECOM CO	52,586	45.30	2,382,145.80	
ACWA POWER CO	2,007	191.20	383,738.40	
SAUDI ELECTRICITY CO	21,376	22.66	484,380.16	
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	14,772	16.04	236,942.88	

	EMAAR ECONOMIC CITY	8,295	8.98	74,489.10	
サウジアラビアリアル 小計		655,504		28,794,103.38 (1,075,459,761)	
合　計		159,080,888		25,479,697,457 (25,479,697,457)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。

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

(2)株式以外の有価証券

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

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

外貨建有価証券の内訳

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

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

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

ＲＭ国内リートマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2023年 7月20日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	246,194,688
投資証券	44,994,987,700
派生商品評価勘定	4,945,670
未収配当金	262,035,677
差入委託証拠金	25,087,500
流動資産合計	45,533,251,235
資産合計	45,533,251,235
負債の部	
流動負債	
前受金	4,524,200
未払解約金	42,990,800
未払利息	667
流動負債合計	47,515,667
負債合計	47,515,667
純資産の部	
元本等	
元本	31,278,827,263
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	14,206,908,305
元本等合計	45,485,735,568
純資産合計	45,485,735,568
負債純資産合計	45,533,251,235

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

2023年 7月20日現在
1． 投資信託財産に係る元本の状況

期首	2022年 7月21日
期首元本額	18,033,890,177円
期中追加設定元本額	28,033,752,454円
期中一部解約元本額	14,788,815,368円
期末元本額	31,278,827,263円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド（安定型）	1,025,657,749円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	1,356,881,495円
りそなラップ型ファンド（成長型）	1,638,562,987円
ＤＣりそな　グローバルバランス	28,693,532円
つみたてバランスファンド	2,479,261,030円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	264,718,090円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	193,718,894円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	132,472,943円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	68,139,964円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	46,388,700円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	25,560,249円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	53,503,127円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスＥＳＧ	141,866,936円
九州ＳＤＧｓ・グローバルバランス	62,415,293円
りそな国内リートインデックス（ラップ専用）	1,332,776,499円
ラップ型ファンド・プラスＥＳＧ（安定型）	4,135,127円
ラップ型ファンド・プラスＥＳＧ（安定成長型）	42,809,280円
ラップ型ファンド・プラスＥＳＧ（成長型）	46,007,425円
りそな　つみたてラップ型ファンド（安定型）	8,721,958円
りそな　つみたてラップ型ファンド（安定成長型）	14,455,951円
りそな　つみたてラップ型ファンド（成長型）	16,760,508円
りそな　つみたてリスクコントロールファンド	2,116,442円
ターゲットリターンバランスファンド（目標２％）	14,228円
ターゲットリターンバランスファンド（目標３％）	14,435円
ターゲットリターンバランスファンド（目標４％）	22,690円
ターゲットリターンバランスファンド（目標５％）	31,197円
ターゲットリターンバランスファンド（目標６％）	45,421円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６５	33,508円
ＦＷりそな国内リートインデックスオープン	7,396,252,073円
ＦＷりそな国内リートインデックスファンド	6,375,177,493円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　Ｊリートインデックス	3,174,521,535円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	64,448,907円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	219,992,220円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	287,348,487円
Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド（適格機関投資家専用）	4,144,144,077円
りそなＤＡＡファンド（適格機関投資家専用）	134,466,226円
りそなＶＩグローバル・バランスファンド（安定型）（適格機関投資家専用）	12,051,598円
りそなＶＩグローバル・バランスファンド（安定成長型）（適格機関投資家専用）	12,028,214円
りそなＶＩグローバル・バランスファンド（成長型）（適格機関投資家専用）	16,808,510円

りそなＦＴ　マルチアセットファンド（適格機関投資家専用）	16,961,960円
りそなＤＡＡマルチアセットファンド（適格機関投資家専用）	4,584,406円
りそなマルチアセットファンド（適格機関投資家専用）	14,177,252円
りそなＤＡＡファンドⅡ（適格機関投資家専用）	12,093円
Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド２０２１０２（適格機関投資家専用）	136,541,799円
りそなＤＡＡファンド２０２２０５（適格機関投資家専用）	283,524,755円
２．　計算日における受益権の総数	
	31,278,827,263口
３．　計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.4542円
(10,000口当たり純資産額)	(14,542円)

（注）※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

2023年 7月20日現在
１.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 ２.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、リートの価格変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。 ３.金融商品に係るリスク管理体制 運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

2023年 7月20日現在
１.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 ２.時価の算定方法 投資証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 デリバティブ取引 （その他の注記）の2　デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

3 .金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

2023年 7月20日現在
該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1　有価証券に関する注記

売買目的有価証券

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

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

2　デリバティブ取引に関する注記

(投資証券関連)

（2023年 7月20日現在）　（単位：円）

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

（注）時価の算定方法

先物取引

国内先物取引について

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種　類	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	860	103,458,000	
	サンケイリアルエステート投資法人	1,355	127,641,000	
	ＳＯＳｉＬＡ物流リート投資法人	2,104	271,416,000	
	東海道リート投資法人	704	88,140,800	
	日本アコモデーションファンド投資法人	1,461	968,643,000	
	森ヒルズリート投資法人	4,974	733,167,600	
	産業ファンド投資法人	6,455	978,578,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	4,230	1,478,385,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	3,102	692,986,800	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	2,219	926,432,500	
	ＧＬＰ投資法人	14,262	1,996,680,000	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	2,023	712,096,000	
	日本プロロジスリート投資法人	7,355	2,157,957,000	
	星野リゾート・リート投資法人	740	479,520,000	
	Ｏｎｅリート投資法人	738	190,182,600	
	イオンリート投資法人	4,856	739,083,200	
	ヒューリックリート投資法人	3,958	649,507,800	
	日本リート投資法人	1,374	471,282,000	
	積水ハウス・リート投資法人	12,712	1,097,045,600	

トーセイ・リート投資法人	938	127,099,000	
ケネディクス商業リート投資法人	1,839	516,023,400	
ヘルスケア＆メディカル投資法人	1,043	164,376,800	
サムティ・レジデンシャル投資法人	1,100	132,550,000	
野村不動産マスターファンド投資法人	13,680	2,233,944,000	
いちごホテルリート投資法人	701	72,553,500	
ラサールロジポート投資法人	5,407	829,433,800	
スターアジア不動産投資法人	5,282	307,940,600	
マリモ地方創生リート投資法人	646	83,269,400	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	1,671	848,868,000	
大江戸温泉リート投資法人	683	44,121,800	
投資法人みらい	5,139	238,963,500	
三菱地所物流リート投資法人	1,453	587,738,500	
ＣＲＥロジスティクスファンド投資法人	1,812	326,522,400	
ザイマックス・リート投資法人	686	79,301,600	
タカラレーベン不動産投資法人	1,994	193,218,600	
アドバンス・ロジスティクス投資法人	1,844	245,252,000	
日本ビルファンド投資法人	4,935	3,025,155,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	4,338	2,481,336,000	
日本都市ファンド投資法人	21,344	2,055,427,200	
オリックス不動産投資法人	8,429	1,514,691,300	
日本プライムリアルティ投資法人	2,893	1,027,015,000	
ＮＴＴ都市開発リート投資法人	4,066	552,976,000	
東急リアル・エステート投資法人	2,836	540,258,000	
グローバル・ワン不動産投資法人	3,113	363,287,100	
ユナイテッド・アーバン投資法人	9,463	1,440,268,600	
森トラストリート投資法人	7,873	561,344,900	
インヴィンシブル投資法人	18,619	1,031,492,600	
フロンティア不動産投資法人	1,570	745,750,000	
平和不動産リート投資法人	2,980	430,312,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	2,852	869,860,000	
福岡リート投資法人	2,188	362,551,600	
ケネディクス・オフィス投資法人	2,461	831,818,000	
いちごオフィスリート投資法人	3,466	308,820,600	
大和証券オフィス投資法人	876	561,516,000	
阪急阪神リート投資法人	1,911	277,095,000	

	スターツプロシード投資法人	733	163,752,200	
	大和ハウスリート投資法人	6,377	1,780,458,400	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	13,642	980,859,800	
	大和証券リビング投資法人	5,862	677,061,000	
	ジャパンエクセレント投資法人	3,881	518,501,600	
合計		258,108	44,994,987,700	

(注)券面総額欄の数値は口数を表しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

ＲＭ先進国リートマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2023年 7月20日現在
資産の部	
流動資産	
預金	387,774,462
コール・ローン	55,338,439
株式	577,936,943
投資証券	58,740,032,146
派生商品評価勘定	220,684
未収入金	104,307
未収配当金	106,126,046
流動資産合計	59,867,533,027
資産合計	59,867,533,027
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	477
未払解約金	7,138,300
未払利息	150
流動負債合計	7,138,927
負債合計	7,138,927
純資産の部	
元本等	
元本	39,434,592,049

	2023年 7月20日現在
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	20,425,802,051
元本等合計	59,860,394,100
純資産合計	59,860,394,100
負債純資産合計	59,867,533,027

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

2023年 7月20日現在	
1． 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月21日
期首元本額	21,136,405,855円
期中追加設定元本額	34,712,952,354円
期中一部解約元本額	16,414,766,160円
期末元本額	39,434,592,049円

期末元本の内訳※

りそなラップ型ファンド（安定型）	1,095,912,905円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	1,710,967,750円
りそなラップ型ファンド（成長型）	2,501,228,021円
ＤＣりそな　グローバルバランス	28,193,527円
つみたてバランスファンド	1,182,527,079円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	542,559,769円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	385,879,347円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	264,423,561円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	132,746,082円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	90,222,214円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	50,155,959円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	102,954,944円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスＥＳＧ	270,795,035円
九州ＳＤＧｓ・グローバルバランス	120,203,068円
ラップ型ファンド・プラスＥＳＧ（安定型）	4,507,339円
ラップ型ファンド・プラスＥＳＧ（安定成長型）	58,384,313円
ラップ型ファンド・プラスＥＳＧ（成長型）	58,176,263円
りそな　つみたてラップ型ファンド（安定型）	9,438,188円
りそな　つみたてラップ型ファンド（安定成長型）	20,178,143円
りそな　つみたてラップ型ファンド（成長型）	26,912,629円
りそな　つみたてリスクコントロールファンド	746,784円
ターゲットリターンバランスファンド（目標２％）	27,409円
ターゲットリターンバランスファンド（目標３％）	28,514円
ターゲットリターンバランスファンド（目標４％）	44,643円
ターゲットリターンバランスファンド（目標５％）	59,948円
ターゲットリターンバランスファンド（目標６％）	90,869円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６５	64,666円
ＦＷりそな先進国リートインデックスオープン	14,127,528,562円
ＦＷりそな先進国リートインデックスファンド	12,202,495,406円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　先進国リートインデックス	2,742,263,743円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	137,246,955円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	443,871,291円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	572,472,688円
りそなＤＡＡファンド（適格機関投資家専用）	121,316,490円
りそな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）	13,046,089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）	8,250,061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）	85,527,533円
りそなＦＴ　マルチアセットファンド（適格機関投資家専用）	34,759,359円
りそなＤＡＡマルチアセットファンド（適格機関投資家専用）	18,816,657円
りそなマルチアセットファンド（適格機関投資家専用）	13,745,742円
りそなＤＡＡファンドⅡ（適格機関投資家専用）	23,823円
りそなＤＡＡファンド２０２２０５（適格機関投資家専用）	255,798,681円

２．　計算日における受益権の総数

39,434,592,049口

3．　計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.5180円
(10,000口当たり純資産額)	(15,180円)

（注）※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

2023年 7月20日現在

1．金融商品に対する取組方針

当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

2．金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。

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

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

3．金融商品に係るリスク管理体制

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

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

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

2023年 7月20日現在

1．貸借対照表計上額、時価及び差額

貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2．時価の算定方法

株式、投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

デリバティブ取引

（その他の注記）の2　デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3．金融商品の時価等に関する事項の補足説明

金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

2023年 7月20日現在
該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1　有価証券に関する注記

売買目的有価証券

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

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

2　デリバティブ取引に関する注記

(通貨関連)

（2023年 7月20日現在）　（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	45,939,179	－	46,159,863	220,684
	米ドル	33,345,624	－	33,507,312	161,688
	カナダドル	4,219,172	－	4,246,400	27,228
	ユーロ	3,120,778	－	3,133,276	12,498
	シンガポールドル	5,253,605	－	5,272,875	19,270
	売建	16,225,610	－	16,226,087	△477
	米ドル	14,659,050	－	14,659,449	△399
	ユーロ	1,566,560	－	1,566,638	△78
合計		62,164,789	－	62,385,950	220,207

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

①計算日において為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

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

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

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

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。

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

(2)株式以外の有価証券

種　類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	ACADIA REALTY TRUST	31,077	485,111.97	
		AGREE REALTY CORP	29,682	1,963,167.48	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	22,884	443,034.24	
		ALEXANDER'S INC	738	137,747.70	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	50,525	6,033,695.50	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	3,468	57,395.40	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	16,990	377,687.70	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	100,780	3,657,306.20	
		APARTMENT INCOME REIT CO	47,496	1,711,755.84	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	48,768	427,207.68	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	67,649	1,047,206.52	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	21,671	270,454.08	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	12,741	47,396.52	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	45,534	8,853,175.62	
		BLUEROCK HOMES TRUST INC	607	9,875.89	
		BOSTON PROPERTIES INC	45,852	2,953,785.84	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	21,236	82,395.68	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	55,191	271,539.72	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	95,732	2,202,793.32	
		BRT APARTMENTS CORP	3,225	65,596.50	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	34,244	3,814,439.16	
		CARETRUST REIT INC	31,518	651,477.06	
		CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	8,439	190,383.84	
		CENTERSPACE	4,898	309,308.70	
		CHATHAM LODGING TRUST	17,055	164,580.75	
		CITY OFFICE REIT INC	14,501	83,090.73	
		CLIPPER REALTY INC	2,188	13,521.84	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	8,122	290,848.82	
		CORPORATE OFFICE PROPERTIES	35,648	931,125.76	
		COUSINS PROPERTIES INC	48,167	1,181,054.84	
		CTO REALTY GROWTH INC	6,920	122,553.20	
		CUBESMART	72,107	3,304,663.81	
		DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	66,372	546,241.56	
		DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	92,300	46,150.00	

DIGITAL REALTY TRUST INC	93,472	11,326,002.24	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	82,808	226,893.92	
DOUGLAS EMMETT INC	53,708	758,356.96	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	82,000	—	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	29,974	439,418.84	
EASTGROUP PROPERTIES INC	14,278	2,605,449.44	
ELME COMMUNITIES	28,983	476,480.52	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	42,453	346,841.01	
EPR PROPERTIES	23,947	1,084,080.69	
EQUINIX INC	29,993	24,376,210.89	
EQUITY COMMONWEALTH	34,709	712,228.68	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	56,143	3,760,458.14	
EQUITY RESIDENTIAL	109,356	7,442,769.36	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	47,347	1,200,246.45	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	20,584	5,002,941.20	
EXTRA SPACE STORAGE INC	43,320	6,452,947.20	
FARMLAND PARTNERS INC	15,087	196,281.87	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	23,585	2,416,754.95	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	42,158	2,219,197.12	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	27,857	740,439.06	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	33,544	56,018.48	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	84,277	4,121,145.30	
GETTY REALTY CORP	14,649	484,735.41	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	13,837	190,120.38	
GLADSTONE LAND CORP	11,212	191,052.48	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	21,276	211,908.96	
GLOBAL NET LEASE INC	33,604	376,028.76	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	122,343	2,374,677.63	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	175,602	3,761,394.84	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	8,823	56,202.51	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	33,399	877,057.74	
HOST HOTELS & RESORTS INC	228,459	4,036,870.53	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	39,736	229,276.72	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	71,361	1,253,099.16	

INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	17,584	72,270.24	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	8,924	722,397.80	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	21,401	517,048.16	
INVITATION HOMES INC	186,423	6,580,731.90	
IRON MOUNTAIN INC	93,554	5,821,865.42	
JBG SMITH PROPERTIES	30,544	505,503.20	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	274,900	85,219.00	
KILROY REALTY CORP	33,433	1,157,784.79	
KIMCO REALTY CORP	199,050	4,152,183.00	
KITE REALTY GROUP TRUST	69,825	1,635,999.75	
LIFE STORAGE INC	27,305	3,634,295.50	
LTC PROPERTIES INC	13,323	464,306.55	
LXP INDUSTRIAL TRUST	92,811	964,306.29	
MACERICH CO/THE	68,338	875,409.78	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	635,700	73,741.20	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	190,397	1,985,840.71	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	37,413	5,721,195.96	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	26,147	922,466.16	
NATL HEALTH INVESTORS INC	13,760	754,873.60	
NECESSITY RETAIL REIT INC/TH	42,346	315,477.70	
NETSTREIT CORP	18,899	334,323.31	
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES	11,428	144,107.08	
NEXPOINT RESIDENTIAL	7,337	346,159.66	
NNN REIT INC	58,523	2,548,676.65	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	17,029	146,619.69	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	74,619	2,438,548.92	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	5,669	118,028.58	
ORION OFFICE REIT INC	19,499	133,568.15	
PARAMOUNT GROUP INC	52,275	263,466.00	
PARK HOTELS & RESORTS INC	68,442	921,913.74	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	40,092	570,910.08	
PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	37,327	1,300,845.95	
PHYSICIANS REALTY TRUST	75,745	1,121,783.45	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	39,816	317,731.68	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	12,349	283,656.53	

POSTAL REALTY TRUST INC- A	6,456	98,324.88	
PRIME US REIT	183,100	34,789.00	
PROLOGIS INC	296,121	36,357,736.38	
PUBLIC STORAGE	50,741	14,865,083.36	
REALTY INCOME CORP	215,940	13,329,976.20	
REGENCY CENTERS CORP	49,435	3,200,916.25	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	41,175	589,626.00	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	64,555	3,485,324.45	
RLJ LODGING TRUST	50,339	507,920.51	
RPT REALTY	27,355	303,366.95	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	19,028	1,782,733.32	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	73,389	943,048.65	
SAFEHOLD INC	12,956	319,235.84	
SAUL CENTERS INC	4,442	169,817.66	
SERVICE PROPERTIES TRUST	52,270	478,270.50	
SIMON PROPERTY GROUP INC	104,887	12,944,104.67	
SITE CENTERS CORP	57,839	834,616.77	
SL GREEN REALTY CORP	20,343	731,127.42	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	44,994	1,866,351.12	
STAG INDUSTRIAL INC	57,181	2,141,428.45	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	33,606	219,447.18	
SUN COMMUNITIES INC	39,899	5,381,178.13	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	65,630	662,206.70	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	33,411	794,513.58	
TERRENO REALTY CORP	23,614	1,395,115.12	
UDR INC	99,241	4,243,545.16	
UMH PROPERTIES INC	18,720	302,889.60	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	4,387	212,418.54	
URBAN EDGE PROPERTIES	37,301	625,910.78	
URSTADT BIDDLE - CLASS A	9,974	223,417.60	
VENTAS INC	128,357	6,188,090.97	
VERIS RESIDENTIAL INC	26,189	439,189.53	
VICI PROPERTIES INC	322,067	10,354,454.05	
VORNADO REALTY TRUST	51,097	1,049,021.41	
WELLTOWER INC	159,408	12,819,591.36	

	WHITESTONE REIT	15,983	161,588.13	
	WP CAREY INC	68,655	4,852,535.40	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	35,531	452,309.63	
米ドル 小計		8,186,052	326,065,834.34 (45,551,397,057)	
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	20,562	463,878.72	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	20,272	145,755.68	
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	5,322	62,586.72	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	7,377	493,668.84	
	BSR REAL ESTATE INVESTMENT T	6,564	116,839.20	
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	14,969	50,295.84	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	25,958	1,366,169.54	
	CHOICE PROPERTIES REIT	50,425	681,241.75	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	15,851	219,853.37	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	16,684	259,102.52	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	39,654	566,259.12	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	5,350	75,970.00	
	EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	15,851	45,492.37	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	32,437	476,499.53	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	9,850	765,837.50	
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	42,850	451,639.00	
	INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	2,543	9,256.52	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	22,620	290,667.00	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	18,755	334,401.65	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	5,378	82,552.30	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	6,979	116,968.04	
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	12,242	103,812.16	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	37,128	263,237.52	
	PRIMARIS REIT	14,963	200,504.20	
	PRO REAL ESTATE INVESTMENT T	8,626	46,925.44	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	47,761	955,220.00	
	SLATE GROCERY REIT	10,423	142,273.95	
	SLATE OFFICE REIT	6,335	12,289.90	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	22,146	553,650.00	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	16,181	44,335.94	

	カナダドル 小計	562,056	9,397,184.32 (998,168,918)	
ユーロ	AEDIFICA	14,913	953,686.35	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	2,209	11,243.81	
	ALTAREA	1,602	165,967.20	
	CARE PROPERTY INVEST	11,306	146,978.00	
	CARMILA	18,272	287,966.72	
	COFINIMMO	9,647	706,642.75	
	COVIVIO	14,674	677,645.32	
	CROMWELL REIT EUR	114,140	180,341.20	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	13,695	301,837.80	
	GECINA SA	17,501	1,758,850.50	
	HAMBORNER REIT AG	22,165	144,737.45	
	ICADE	10,070	390,917.40	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	14,471	37,335.18	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	93,814	540,368.64	
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	9,152	128,311.04	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	132,455	129,673.44	
	KLEPIERRE	62,063	1,482,064.44	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	19,976	119,656.24	
	MERCIALYS	26,360	215,097.60	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	105,872	887,736.72	
	MONTEA NV	4,410	326,340.00	
	NSI NV	5,397	105,673.26	
	RETAIL ESTATES	3,532	204,856.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	34,458	1,822,828.20	
	VASTNED RETAIL NV	6,207	125,071.05	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	50,026	1,395,725.40	
	WERELDHAVE NV	13,508	206,807.48	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	8,062	227,751.50	
	ユーロ 小計	839,957	13,682,110.69 (2,144,397,208)	
英ポンド	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	141,815	74,452.87	
	AEW UK REIT PLC	42,887	42,286.58	
	ASSURA PLC	936,180	456,668.60	
	BALANCED COMM PROPERTY TRUST	252,276	184,161.48	

		BIG YELLOW GROUP PLC	55,646	610,993.08	
		BRITISH LAND CO PLC	302,823	1,072,901.88	
		CLS HOLDINGS PLC	64,468	92,576.04	
		CUSTODIAN PROPERTY INCOME REIT PLC	153,661	136,758.29	
		DERWENT LONDON PLC	36,322	816,518.56	
		EDISTON PROPERTY INVESTMENT	57,084	35,506.24	
		EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	188,158	168,777.72	
		GREAT PORTLAND ESTATES PLC	83,526	363,672.20	
		HAMMERSON PLC	1,312,197	336,709.75	
		HELICAL PLC	33,175	88,245.50	
		HOME REIT PLC	147,401	56,086.08	
		IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	142,814	133,673.90	
		INTU PROPERTIES PLC	117,549	—	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	242,000	1,600,588.00	
		LONDONMETRIC PROPERTY PLC	310,639	570,643.84	
		LXI REIT PLC	541,292	522,617.42	
		NEWRIVER REIT PLC	107,134	93,206.58	
		PICTON PROPERTY INCOME LTD	190,871	141,244.54	
		PRIMARY HEALTH PROPERTIES	421,955	418,790.33	
		PRS REIT PLC/THE	171,235	143,666.16	
		REGIONAL REIT LTD	151,551	72,441.37	
		SAFESTORE HOLDINGS PLC	69,285	628,761.37	
		SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	197,166	88,527.53	
		SEGRO PLC	393,422	3,130,065.43	
		SHAFTESBURY CAPITAL PLC	618,851	767,375.24	
		SUPERMARKET INCOME REIT PLC	398,928	312,759.55	
		TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	106,966	64,179.60	
		TRITAX BIG BOX REIT PLC	594,580	848,465.66	
		UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	267,793	145,679.39	
		UNITE GROUP PLC	127,291	1,229,631.06	
		URBAN LOGISTICS REIT PLC	147,659	182,211.20	
		WAREHOUSE REIT PLC	145,941	130,179.37	
		WORKSPACE GROUP PLC	43,511	231,260.96	
		英ポンド 小計	9,316,052	15,992,283.37 (2,892,524,293)	

オーストラリアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	126,889	343,869.19	
	ARENA REIT	111,944	411,953.92	
	BWP TRUST	155,714	573,027.52	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	176,579	550,926.48	
	CENTURIA OFFICE REIT	150,261	214,873.23	
	CHARTER HALL GROUP	149,818	1,707,925.20	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	204,710	845,452.30	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	169,064	637,371.28	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	102,691	304,992.27	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	432,684	244,466.46	
	DEXUS INDUSTRIA REIT	71,835	197,546.25	
	DEXUS/AU	345,560	2,816,314.00	
	GDI PROPERTY GROUP	181,458	118,854.99	
	GOODMAN GROUP	549,007	11,265,623.64	
	GPT GROUP	608,304	2,585,292.00	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	88,398	251,050.32	
	HEALTHCO REIT	136,880	186,156.80	
	HMC CAPITAL LTD	77,093	396,258.02	
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	507,628	604,077.32	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	67,652	208,368.16	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	119,014	468,915.16	
	MIRVAC GROUP	1,267,475	2,978,566.25	
	NATIONAL STORAGE REIT	397,707	898,817.82	
	RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE	96,236	67,365.20	
	REGION RE LTD	362,765	870,636.00	
	RURAL FUNDS GROUP	133,000	266,000.00	
	SCENTRE GROUP	1,666,601	4,583,152.75	
	STOCKLAND	766,711	3,189,517.76	
	VICINITY CENTRES	1,229,748	2,379,562.38	
	WAYPOINT REIT	219,293	563,583.01	
	オーストラリアドル 小計	10,672,719	40,730,515.68 (3,861,660,191)	
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	256,643	297,705.88	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	342,168	752,769.60	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	498,622	456,239.13	

		PRECINCT PROPERTIES GROUP	432,348	557,728.92
		STRIDE STAPLED GROUP	186,933	265,444.86
		VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	159,328	374,420.80
		ニュージーランドドル 小計	1,876,042	2,704,309.19 (236,843,398)
	香港ドル	CHAMPION REIT	601,000	1,658,760.00
		FORTUNE REIT	470,000	2,660,200.00
		LINK REIT	817,400	35,270,810.00
		PROSPERITY REIT	431,000	728,390.00
		SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	345,000	997,050.00
		YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	795,000	1,311,750.00
		香港ドル 小計	3,459,400	42,626,960.00 (762,596,314)
	シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LT	184,100	228,284.00
		CAPITALAND ASCENDAS REIT	1,081,400	2,995,478.00
		CAPITALAND ASCOTT TRUST	695,096	757,654.64
		CAPITALAND CHINA TRUST	376,400	391,456.00
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	1,620,532	3,224,858.68
		CDL HOSPITALITY TRUSTS	266,200	314,116.00
		DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	209,200	127,612.00
		EC WORLD REIT	50,000	15,000.00
		ESR-LOGOS REIT	2,101,050	714,357.00
		FAR EAST HOSPITALITY TRUST	321,400	205,696.00
		FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	461,400	119,964.00
		FRASERS CENTREPOINT TRUST	338,500	744,700.00
		FRASERS LOGISTICS & COMMERCI	918,579	1,175,781.12
		KEPPEL DC REIT	419,500	935,485.00
		KEPPEL REIT	649,200	594,018.00
		LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	611,800	416,024.00
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	635,700	1,436,682.00
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,069,600	1,807,624.00
		MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA	729,700	1,218,599.00
		OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	779,700	241,707.00
		PARKWAYLIFE REAL ESTATE	126,100	462,787.00
		SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	188,100	136,372.50
		SPH REIT	333,900	315,535.50

		STARHILL GLOBAL REIT	435,300	226,356.00	
		SUNTEC REIT	709,600	922,480.00	
	シンガポールドル 小計		15,312,057	19,728,627.44 (2,081,567,481)	
	韓国ウォン	D&D PLATFORM REIT CO LTD	15,215	48,383,700.00	
		E KOCREF CR-REIT CO LTD	3,951	20,387,160.00	
		ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	43,823	173,319,965.00	
		IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	7,910	35,199,500.00	
		JR REIT XXVII	47,106	195,489,900.00	
		KORAMCO ENERGY PLUS REIT	14,612	81,534,960.00	
		LOTTE REIT CO LTD	44,180	160,594,300.00	
		MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	34,232	142,747,440.00	
		NH ALL-ONE REIT CO LTD	11,869	39,642,460.00	
		SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	26,417	161,407,870.00	
		SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LT	4,632	15,054,000.00	
		SK REITS CO LTD	27,542	136,057,480.00	
	韓国ウォン 小計		281,489	1,209,818,735.00 (133,684,970)	
	イスラエルシュケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	237,765	413,948.86	
		REIT 1 LTD	62,662	1,053,348.22	
		SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	64,116	514,915.59	
	イスラエルシュケル 小計		364,543	1,982,212.67 (77,192,316)	
合計				58,740,032,146 (58,740,032,146)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数		組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式	3銘柄	1.2%	—	0.9%
	投資証券	141銘柄	—	98.8%	76.8%

カナダドル	投資証券	30銘柄	―	100.0%	1.7%
ユーロ	投資証券	28銘柄	―	100.0%	3.6%
英ポンド	投資証券	37銘柄	―	100.0%	4.9%
オーストラリアドル	株式	1銘柄	0.9%	―	0.1%
	投資証券	30銘柄	―	99.1%	6.5%
ニュージーランドドル	投資証券	6銘柄	―	100.0%	0.4%
香港ドル	投資証券	6銘柄	―	100.0%	1.3%
シンガポールドル	投資証券	25銘柄	―	100.0%	3.5%
韓国ウォン	投資証券	12銘柄	―	100.0%	0.2%
イスラエルシュケル	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2023年 7月31日現在です。

【九州ＳＤＧｓ・グローバルバランス】

【純資産額計算書】

Ⅰ　資産総額	2,346,297,788円
Ⅱ　負債総額	9,237,703円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	2,337,060,085円
Ⅳ　発行済口数	2,231,002,246口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0475円

（参考）

ＲＭ国内債券マザーファンド（九州重視型）

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	1,218,118,683円
Ⅱ　負債総額	31円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	1,218,118,652円
Ⅳ　発行済口数	1,244,558,975口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.9788円

ＲＭ米ドル建ＳＤＧｓ債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	2,353,765,369円
Ⅱ　負債総額	112,021,142円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	2,241,744,227円
Ⅳ　発行済口数	2,574,434,758口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.8708円

ＲＭユーロ建ＳＤＧｓ債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	1,712,958,954円
Ⅱ　負債総額	98,082,123円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	1,614,876,831円
Ⅳ　発行済口数	1,854,022,269口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.8710円

ＲＭ新興国債券マザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	10,535,756,057円
Ⅱ　負債総額	45,728,951円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	10,490,027,106円
Ⅳ　発行済口数	8,036,763,258口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3053円

ＲＭ国内株式ＥＳＧマザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	3,660,725,904円
Ⅱ　負債総額	12,981,377円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	3,647,744,527円
Ⅳ　発行済口数	2,375,998,820口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.5352円

ＲＭ先進国株式ＥＳＧマザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	6,831,483,513円
Ⅱ　負債総額	18,700,697円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	6,812,782,816円
Ⅳ　発行済口数	3,628,285,542口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.8777円

ＲＭ新興国株式マザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	28,131,067,564円
Ⅱ　負債総額	6,973,740円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	28,124,093,824円
Ⅳ　発行済口数	15,755,431,837口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.7850円

ＲＭ国内リートマザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	46,934,599,459円
Ⅱ　負債総額	393,220,363円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	46,541,379,096円
Ⅳ　発行済口数	31,977,289,943口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.4555円

ＲＭ先進国リートマザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	60,172,150,860円
Ⅱ　負債総額	73,778,557円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	60,098,372,303円
Ⅳ　発行済口数	39,708,182,480口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.5135円

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

（１）名義書換

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

（２）受益者に対する特典

該当事項はありません。

（３）譲渡制限の内容

①　譲渡制限はありません。

②　受益権の譲渡

・受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

・前述の申請のある場合には、振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社債、株式等の振替に関する法律の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知

するものとします。

・前述の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合などにおいて、委託会社が必要と認めたときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

③　受益権の譲渡の対抗要件

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

（４）受益証券の再発行

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

（５）受益権の再分割

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

（６）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

（１）資本金の額

2023年7月末現在	資本金の額	1,000,000,000円
	発行可能株式総数	3,960,000株
	発行済株式総数	3,960,000株

●過去５年間における主な資本金の増減
該当事項はありません。

（２）委託会社の機構（2023年7月末現在）

①　会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は取締役会の決議をもって決定します。
取締役会は、その決議によって代表取締役を選定します。取締役会は、業務執行を分担して行う責任者を執行役員として選任することができます。また、取締役会は、取締役および執行役員の職務執行を監督します。
取締役会は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役社長がこれを招集し、議長となります。取締役社長に事故または欠員があるときは、取締役会においてあらかじめ定めた順序に従い、他の取締役が取締役会を招集し、議長となります。
取締役会の決議は、議決に加わることができる取締役の過半数が出席し、出席した取締役の過半数をもって行います。
取締役は株主総会において選任されます。取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までです。
監査等委員である取締役の任期は、選任後2年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までです。
経営会議は、経営に関する全般的重要事項および重要な業務執行案件を協議します。
監査等委員会は、代表取締役その他の業務執行取締役の職務の執行を監査する独立の機関であるとともに、監査等委員である取締役以外の業務執行取締役の選任・解任・辞任および報酬等について監査等委員会としての意見を決定します。

②　投資運用の意思決定機構

委託会社では、以下P.D.C.Aサイクルにて投資運用の意思決定を行っています。
○PLAN：計画
・運用戦略部は、運用基本方針や主な投資制限などを策定し、運用委員会にて協議します。
○DO：実行
・運用部門のファンドマネージャーは、決定された運用基本方針等に基づいて運用計画を策定し、ファンドマネージャーが所属する部の部長が承認します。
・ファンドマネージャーは、決定された運用計画に沿って運用指図を行いポートフォリオを構築し、ファンドの運用状況を管理します。
・運用部門の各部長は、ファンドの運用が運用計画に沿って行われていることを確認します。
・売買発注の執行は、運用計画の策定等から組織的に分離されたトレーディング部が、発注先証券会社等の選定ルール等に基づく最良執行を行うよう努めます。
○CHECK：検証→ACTION：改善
・法令等や主な投資制限の遵守状況等については、運用部門から独立した運用リスク管理部がモニタリングを行います。その結果は、運用評価委員会に報告するとともにすみやかに運用部門にフィードバックされ、ファンドの運用に反映されます。
・運用実績等については運用評価委員会が統括し、運用部門に対する管理・指導を行います。

2【事業の内容及び営業の概況】

当社は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社として、証券投資信託の設定を行うとともに、「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者として、その運用（投資運用業）を行っています。また、「金融商品取引法」に定める投資助言・代理業および第二種金融商品取引業を行っています。
2023年7月末現在、委託会社が運用する証券投資信託は以下のとおりです（ただし、親投資信託を除きます。）。

ファンドの種類	本数	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	152	1,579,856
単位型株式投資信託	5	22,206
単位型公社債投資信託	8	15,705
合計	165	1,617,769

3【委託会社等の経理状況】

（１）委託会社であるりそなアセットマネジメント株式会社（以下、「当社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第２条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。
（２）財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。
（３）当社は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づき、第８期事業年度（自 2022年４月１日 至 2023年３月31日）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツにより監査を受けております。

（１）【貸借対照表】

（単位：千円）

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

固定資産計	187,054	218,474
資産合計	12,427,176	14,466,729

（単位：千円）

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

（２）【損益計算書】

（単位：千円）

	前事業年度 （自　2021年４月１日 至　2022年３月31日）	当事業年度 （自　2022年４月１日 至　2023年３月31日）
営業収益		
委託者報酬	4,788,765	4,696,038
運用受託報酬	5,438,177	5,142,361
投資助言報酬	982,472	952,145
営業収益計	11,209,415	10,790,545
営業費用		
支払手数料	1,460,131	1,210,415
広告宣伝費	49,322	68,988
調査費		
調査費	1,502,951	1,772,867

委託調査費		137,291	148,470
委託計算費		269,116	300,448
事務委託費		23,751	26,903
営業雑経費			
印刷費		95,519	114,901
協会費		12,887	13,978
販売促進費		2,277	836
その他		64,110	70,972
営業費用計		3,617,359	3,728,783
一般管理費			
給料			
役員報酬		127,995	124,995
給料・手当		1,260,284	1,361,136
賞与		169,303	192,845
賞与引当金繰入額		253,537	265,505
旅費交通費		6,944	20,681
租税公課		92,204	85,343
不動産賃借料		99,813	113,302
固定資産減価償却費		15,365	13,938
諸経費		270,995	267,977
一般管理費計		2,296,443	2,445,724
営業利益		5,295,612	4,616,037
営業外収益			
受取利息		―	5,137
受取配当金		506	64
投資有価証券売却益		866	564
雑収入		3,244	2,431
営業外収益計		4,617	8,198
営業外費用			
投資有価証券売却損		―	290
為替差損		170	64,517
雑損失		1,455	22
営業外費用計		1,625	64,829
経常利益		5,298,604	4,559,406
特別損失			
固定資産除去損		―	2,368
特別損失計		―	2,368
税引前当期純利益		5,298,604	4,557,038
法人税、住民税及び事業税	※1	1,632,846	1,384,185
法人税等調整額		10,297	1,450
法人税等計		1,643,143	1,385,636
当期純利益		3,655,460	3,171,401

（３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自　2021年４月１日　　至　2022年３月31日）

（単位：千円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計	その他利益剰余金	利益剰余金合計	
				繰越利益剰余金		

当期首残高	1,000,000	490,000	490,000	4,548,350	4,548,350	6,038,350
当期変動額						
当期純利益	－	－	－	3,655,460	3,655,460	3,655,460
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	－	－	－	－	－	－
当期変動額合計	－	－	－	3,655,460	3,655,460	3,655,460
当期末残高	1,000,000	490,000	490,000	8,203,810	8,203,810	9,693,810

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

当事業年度（自　2022年４月１日　　至　2023年３月31日）

（単位：千円）

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

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

（重要な会計方針）

１．有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）を採用しております。

２．固定資産の減価償却の方法

（１）有形固定資産

2016年４月１日以降に取得した建物附属設備につきましては、定額法を採用しております。
その他の有形固定資産につきましては、定率法を採用しております。
なお、主な耐用年数は次のとおりであります。
建物　　５～15年
器具備品　３～20年

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

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

４．収益および費用の計上基準
当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行義務の内容及び当該履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。
①投資運用業（投資信託委託業）
投資信託約款に基づき、信託財産の運用指図等を行っております。
当該業務より発生する委託者報酬は、信託期間にわたり収益として認識しております。

②投資運用業（投資一任業）
投資一任契約に基づき、顧客資産を一任して運用指図等を行っております。
当該業務より発生する運用受託報酬は、契約期間にわたり収益として認識しております。

③投資助言・代理業
投資助言契約に基づき、運用に関する投資判断の助言等を行っております。
当該業務より発生する投資助言報酬は、契約期間にわたり収益として認識しております。

５．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項
（１）グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い
当社は、当事業年度から、連結納税制度からグループ通算制度へ移行しております。これに伴い、法人税及び地方法人税並びに税効果会計の会計処理及び開示については、「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第42号 2021年８月12日。以下「実務対応報告第42号」という。）に従っております。また、実務対応報告第42号第32項(1)に基づき、実務対応報告第42号の適用に伴う会計方針の変更による影響はないものとみなしております。

（会計方針の変更）
（時価の算定に関する会計基準等の適用）
「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年６月17日。以下「時価算定会計基準適用指針」という。）を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準適用指針が定める新たな会計方針を将来にわたって適用することといたしました。これによる当財務諸表に与える影響はありません。また、「金融商品関係」注記において、金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項等の注記を行うことといたしました。

注記事項
（貸借対照表関係）
※１　有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 （2022年３月31日）	当事業年度 （2023年３月31日）
建物	2,073千円	2,865千円

器具備品	32,416千円	40,455千円

※２　関係会社に対する資産及び負債

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

（注）当該金額は、連結納税親会社と受払いする金額であります。

（損益計算書関係）

※１　関係会社に対する主な取引

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

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自　2021年４月１日　至　2022年３月31日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

２．配当に関する事項

該当事項はありません。

当事業年度（自　2022年４月１日　至　2023年３月31日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

２．配当に関する事項

該当事項はありません。

（金融商品関係）

１．金融商品の状況に関する事項

（１）金融商品に対する取組方針

資金運用については、短期的な預金等に限定しております。

（２）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

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

２．金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（自　2021年４月１日　至　2022年３月31日）

（単位：千円）

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

（注）金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

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

当事業年度（自　2022年４月１日　至　2023年３月31日）

（単位：千円）

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

（注）金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

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

３．金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

金融商品の時価を、時価の算定に用いたインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の３つのレベルに分類しております。

レベル１の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産または負債に関する相場価格により算定した時価

レベル２の時価：観察可能な時価に係るインプットのうち、レベル１のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価

レベル３の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

前事業年度（自　2021年４月１日　至　2022年３月31日）

（単位：千円）

区分	時価			
	レベル１	レベル２	レベル３	合計
投資有価証券				

投資信託	―	37,596	―	37,596
資産計	―	37,596	―	37,596

当事業年度（自　2022年４月１日　至　2023年３月31日）

（単位：千円）

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

（有価証券関係）

１．その他有価証券

前事業年度（自　2021年４月１日　至　2022年３月31日）

（単位：千円）

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

当事業年度（自　2022年４月１日　至　2023年３月31日）

（単位：千円）

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

２．事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（自　2021年４月１日　至　2022年３月31日）

（単位：千円）

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

当事業年度（自　2022年４月１日　至　2023年３月31日）

（単位：千円）

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

（税効果会計関係）

１．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

２．法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主要な項目別の内訳

前事業年度（自　2021年４月１日　至　2022年３月31日）

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

当事業年度（自　2022年４月１日　至　2023年３月31日）

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

（収益認識関係）

１．顧客との契約から生じる収益を分解した情報

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

２．収益を理解するための基礎となる情報

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

３．当事業年度及び翌事業年度以降の収益の金額を理解するための情報

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（セグメント情報等）

前事業年度（自　2021年４月１日　至　2022年３月31日）

１．セグメント情報
当社は、「資産運用業」の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

２．関連情報
（１）製品及びサービスごとの情報
単一の商品・サービスの区分の外部顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。
（２）地域ごとの情報
①営業収益
本邦の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。
なお、営業収益の地域区分は、契約相手方の所在地（ファンドの場合は組成地）を基礎として分類しております。
②有形固定資産
本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。
（３）主要な顧客ごとの情報

（単位：千円）

顧客の名称又は氏名	営業収益額
株式会社りそな銀行	5,964,710

３．報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報
該当事項はありません。

４．報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報
該当事項はありません。

５．報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報
該当事項はありません。

当事業年度（自　2022年４月１日　至　2023年３月31日）
１．セグメント情報
当社は、「資産運用業」の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

２．関連情報
（１）製品及びサービスごとの情報
単一の商品・サービスの区分の外部顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。
（２）地域ごとの情報
①営業収益
本邦の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。
なお、営業収益の地域区分は、契約相手方の所在地（ファンドの場合は組成地）を基礎として分類しております。
②有形固定資産
本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。
（３）主要な顧客ごとの情報

（単位：千円）

顧客の名称又は氏名	営業収益額
株式会社りそな銀行	5,545,681

３．報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報
該当事項はありません。

４．報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報
該当事項はありません。

５．報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報
該当事項はありません。

（関連当事者情報）
前事業年度（自　2021年４月１日　至　2022年３月31日）
１．関連当事者との取引
（１）親会社及び主要株主（会社等に限る）等

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の所有（被所有）割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
親会社	株式会社りそなホールディングス	東京都江東区	50,552	持株会社としての経営管理	(直接)100%	連結納税	連結納税に係る個別帰属額（注１）	1,311,417	その他未払金	1,311,908

取引条件及び取引条件の決定方針等
（注1）連結納税制度に基づく連結法人税の支払予定額であります。

（２）兄弟会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の所有（被所有）割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）（注４）
親会社の子会社	株式会社りそな銀行	大阪市中央区	279,928	銀行業務及び信託業務	―	投資信託の販売委託 投資助言 投資一任	運用受託報酬（注１）	5,202,291	未収運用受託報酬	2,880,437
							投資助言報酬（注２）	762,418	未収投資助言報酬	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）

当事業年度（自　2022年４月１日　至　2023年３月31日）
１．関連当事者との取引
（１）兄弟会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の所有（被所有）割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）（注４）
親会社の子会社	株式会社りそな銀行	大阪市中央区	279,928	銀行業務及び信託業務	―	投資信託の販売委託 投資助言 投資一任	運用受託報酬（注１）	4,790,900	未収運用受託報酬	2,557,553
							投資助言報酬（注２）	754,781	未収投資助言報酬	410,936
							支払手数料（注３）	801,950	未払手数料	161,752

取引条件及び取引条件の決定方針等
（注１）投資一任の収益については、一般取引条件を勘案した個別契約に基づき決定しております。
（注２）投資助言の収益については、一般取引条件を勘案した個別契約に基づき決定しております。
（注３）投資信託の販売委託については、一般取引条件を基に、協議のうえ決定しております。
（注４）上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には消費税等が含まれております。

２．親会社に関する注記
親会社情報
株式会社りそなホールディングス（東京証券取引所に上場）

（１株当たり情報）

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

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

（注）１株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は以下のとおりであります。

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

（重要な後発事象）
前事業年度（自　2021年４月１日　至　2022年３月31日）
該当事項はありません。

当事業年度（自　2022年４月１日　至　2023年３月31日）
該当事項はありません。

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 （2023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（2023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 （2023年3月末現在）	事業の内容
九州ＦＧ証券株式会社	3,000百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
野村證券株式会社（注）	10,000百万円	
株式会社鹿児島銀行	18,130百万円	銀行法に基づき銀行業を営
株式会社肥後銀行	18,128百万円	

株式会社宮崎銀行	14,697百万円	んでいます。

（注）募集の取扱いを行ないません。

2【関係業務の概要】

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

3【資本関係】

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

第3【その他】

（1）目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」という名称を用いることがあります。
（2）目論見書の表紙等に委託会社または受託会社のロゴ・マーク、ファンドの総称、図案等を記載することがあります。
（3）目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。
（4）目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。
① ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。
② 本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。
③ 委託会社等の情報、受託会社に関する情報を記載することがあります。
④ 交付目論見書にはファンドの約款の主な内容が含まれておりますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されております。
⑤ ファンドに関する請求目論見書は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできます。
⑥ ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。
（5）有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。
（6）目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。

独立監査人の監査報告書

2023年5月22日

りそなアセットマネジメント株式会社
取　締　役　会　　御　中

有限責任監査法人ト　ー　マ　ツ
東　京　事　務　所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	松　崎　　雅　則
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	石　坂　　武　嗣

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているりそなアセットマネジメント株式会社の2022年4月1日から2023年3月31日までの第8期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、りそなアセットマネジメント株式会社の2023年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

監査等委員会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

- 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査等委員会に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

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

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

(注)1.上記は、当社が、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2.ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

2023年10月3日

りそなアセットマネジメント株式会社
取　締　役　会　　御　中

有限責任監査法人ト　ー　マ　ツ
東　京　事　務　所

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　松　崎　　雅　則

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている九州ＳＤＧｓ・グローバルバランスの2022年7月21日から2023年7月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、九州ＳＤＧｓ・グローバルバランスの2023年7月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、りそなアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

・　不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
・　財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
・　経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
・　経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
・　財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

りそなアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

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