

## 【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25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6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】	つみたてバランスファンド
【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】

つみたてバランスファンド（以下「ファンド」といいます。）

### （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】

ありません。

### （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26日から2024年4月25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。

( 1 0 ) 【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。

( 1 1 ) 【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。

( 1 2 ) 【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】

ファンドの目的

信託財産の長期的な成長を目標として運用を行います。

ファンドの基本的性格

## 1) 商品分類

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単位型投信	国内	株式 債券	インデックス型
追加型投信	海外	不動産投信 その他資産 ( )	特殊型
	内外	資産複合	

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 2) 属性区分

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (含む日本)			
	年2回	日本			
	年4回	北米	ファミリーファンド	あり	日経225
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ( )	年6回 (隔月)	欧州			
	年12回 (毎月)	アジア			TOPIX
	日々	オセアニア			
不動産投信	その他 ( )	中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	なし	その他 (合成ベンチマー ク)
その他資産 (投資信託証券(資 産複合(株式、債 券、不動産投信) 資産配分固定 型))		アフリカ			
		中近東 (中東)			
		エマージング			
資産複合 ( ) 資産配分固定型 資産配分変更型					

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円で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（株式、債券、不動産投信）（資産配分固定型））））と収益の源泉となる資産を示す商品分類上の投資対象資産（資産複合）とが異なります。

#### <商品分類の定義>

##### 1. 単位型投信・追加型投信の区分

(1) 単位型投信：当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われないファンドをいう。

(2) 追加型投信：一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。

##### 2. 投資対象地域による区分

(1) 国内：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(2) 海外：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(3) 内外：目論見書又は投資信託約款において、国内及び海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

##### 3. 投資対象資産による区分

(1) 株式：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(2) 債券：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(3) 不動産投信（リート）：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券及び不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(4) その他資産：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に上記(1)から(3)に掲げる資産以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、その他資産と併記して具体的な収益の源泉となる資産の名称記載も可とする。

(5) 資産複合：目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(4)に掲げる資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

##### 4. 独立した区分

(1) MMF（マネー・マネージメント・ファンド）：「MMF等の運営に関する規則」に定めるMMFをいう。

(2) MRF（マネー・リザーブ・ファンド）：「MMF等の運営に関する規則」に定めるMRFをいう。

(3) ETF：投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号及び第2号に規定する証券投資信託並びに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいう。

#### <補足として使用する商品分類>

(1) インデックス型：目論見書又は投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいう。

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

#### <属性区分の定義>

##### 1. 投資対象資産による属性区分

###### (1) 株式

一般：次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

大型株：目論見書又は投資信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいう。

中小型株：目論見書又は投資信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいう。

## (2)債券

一般：次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

公債：目論見書又は投資信託約款において、日本国又は各国の政府の発行する国債(地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含む。以下同じ。)に主として投資する旨の記載があるものをいう。

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

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

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

## (3)不動産投信

これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

## (4)その他資産

組入れている資産を記載するものとする。

## (5)資産複合

以下の小分類に該当する場合には当該小分類を併記することができる。

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

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

## 2. 決算頻度による属性区分

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

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

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

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

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

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

その他：上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

## 3. 投資対象地域による属性区分(重複使用可能)

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

## 4. 投資形態による属性区分

ファミリーファンド：目論見書又は投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資され

るものを除く。)を投資対象として投資するものをいう。

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

#### 5. 為替ヘッジによる属性区分

為替ヘッジあり：目論見書又は投資信託約款において、為替のフルヘッジ又は一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいう。

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

#### 6. インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分

日経225

TOPIX

その他の指数：前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

#### 7. 特殊型

ブル・ベア型：目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。

条件付運用型：目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。

ロング・ショート型/絶対収益追求型：目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨若しくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。

その他型：目論見書又は投資信託約款において、上記 から に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

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

### ファンドの特色

**1** 国内、先進国および新興国の株式・債券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)を実質的な主要投資対象とし、以下の指数を「基本的資産配分」で組み合わせた合成ベンチマーク\*1に連動する投資成果を目指します。

- 合成ベンチマークへの連動性を高めるため、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)を活用することがあります。

実質的な投資対象	合成ベンチマークを構成する指数*2	基本的資産配分
国内株式	東証株価指数(TOPIX、配当込み)	30%
先進国株式	MSCI-KOKUSAI指数(配当込み、円換算ベース)	20%
新興国株式	MSCIエマージング・マーケット指数(配当込み、円換算ベース)	5%
国内債券	NOMURA-BPI総合	20%
先進国債券	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)	5%
新興国債券	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)	5%
国内リート	東証REIT指数(配当込み)	10%
先進国リート	S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)	5%

\*1 合成ベンチマークは、合成ベンチマークを構成する指数および基本的資産配分をもとに委託会社が計算したものです。

\*2 合成ベンチマークを構成する指数については、「合成ベンチマークを構成する指数の著作権等について」をご参照ください。

## 2 以下のマザーファンドを通じて、国内、先進国および新興国の株式・債券ならびに国内および先進国の不動産投資信託証券への投資を行います。

- 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
実質的な投資対象	株式	<b>RM国内株式マザーファンド</b> 【主要投資対象】 国内の株式 【対象指数】 東証株価指数(TOPIX、配当込み)	<b>RM先進国株式マザーファンド</b> 【主要投資対象】 先進国(日本を除く)の株式およびETF(上場投資信託証券) 【対象指数】 MSCI-KOKUSAI指数(配当込み、円換算ベース)	<b>RM新興国株式マザーファンド</b> 【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)
	債券	<b>RM国内債券マザーファンド</b> 【主要投資対象】 国内の債券 【対象指数】 NOMURA-BPI総合	<b>RM先進国債券マザーファンド</b> 【主要投資対象】 先進国(日本を除く)の債券 【対象指数】 FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)	<b>RM新興国債券マザーファンド</b> 【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)
	リート	<b>RM国内リートマザーファンド</b> 【主要投資対象】 不動産投資信託証券 【対象指数】 東証REIT指数(配当込み)	<b>RM先進国リートマザーファンド</b> 【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)	—

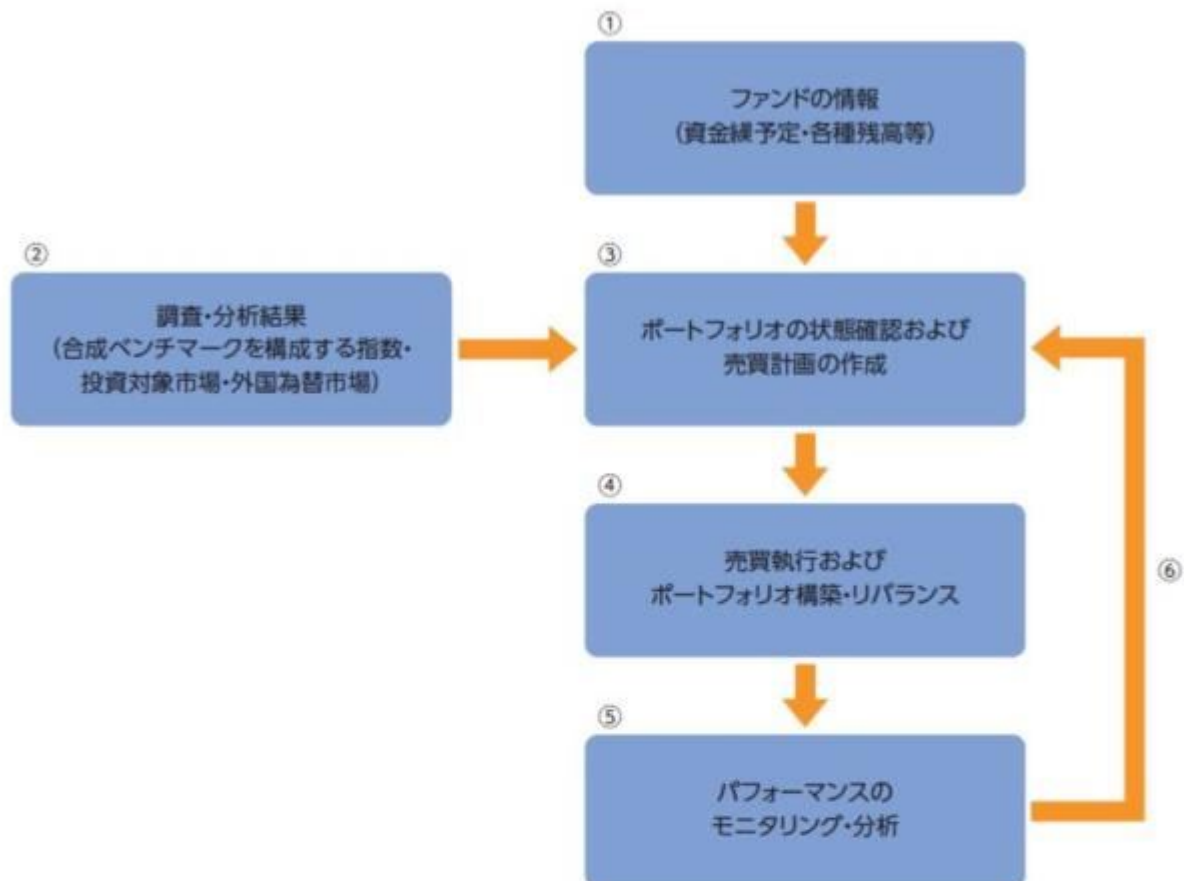
## 3 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

## 4 購入時手数料のないノーロード型のファンドです。

- 換金時手数料、信託財産留保額もかかりません。



## 運用プロセスのイメージ



- ①設定・解約による資金繰予定のほか、各マザーファンド・現金等の残高・取引履歴情報を確認します。
- ②合成ベンチマークを構成する指数、投資対象となる市場および外国為替市場に関する調査・分析を行います。
- ③各種情報を基にポートフォリオの状態を確認し、必要に応じてマザーファンドの売買計画を作成します。
- ④売買執行(マザーファンドの売買)により、ポートフォリオの構築・リバランスを行います。
- ⑤運用パフォーマンスや合成ベンチマークとの連動性について、モニタリング・分析を行います。
- ⑥上記⑤の分析結果を反映し、継続的な運用の改善につなげます。

※上記の運用プロセスおよびイメージ図は、今後変更になる場合があります。

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

## ■ 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株式、債券およびリートなどに実質的に投資を行う、ファミリーファンド方式で運用を行います。



## ■ 主な投資制限

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

## 分配方針

原則、毎年7月25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。

## 合成ベンチマークを構成する指数の著作権等について

- 「東証株価指数(TOPIX、配当込み)」は、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、配当を考慮したものです。なお、TOPIXに関する著作権、知的財産権その他の一切の権利は株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社に帰属します。
- 「MSCI-KOKUSAI指数(配当込み、円換算ベース)」は、MSCI-KOKUSAI指数(米ドルベース)をもとに委託会社が円換算して計算したものです。MSCI-KOKUSAI指数(米ドルベース)は、MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものであり、指数に関する著作権、知的財産権その他の権利はMSCI Inc.に帰属します。
- 「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。
- 「NOMURA-BPI総合」は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表する、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で一定の組入基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスをもとに計算されます。NOMURA-BPI総合の知的財産権とその他の一切の権利は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属しています。野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、NOMURA-BPI総合指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
- 「FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)」は、FTSE世界国債インデックス(除く日本、米ドルベース)をもとに委託会社が円換算して計算したものです。FTSE世界国債インデックス(除く日本、米ドルベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
- 「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。
- 「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。
- 「S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)」は、S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み)をもとに委託会社が円換算して計算したものです。S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み)は、S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCが有するS&Pグローバル株価指数の採用銘柄の中から、不動産投資信託(REIT)および同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出される指数であり、指数に関する著作権、知的財産権その他の権利はS&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCに帰属します。

### 信託金限度額

- ・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。

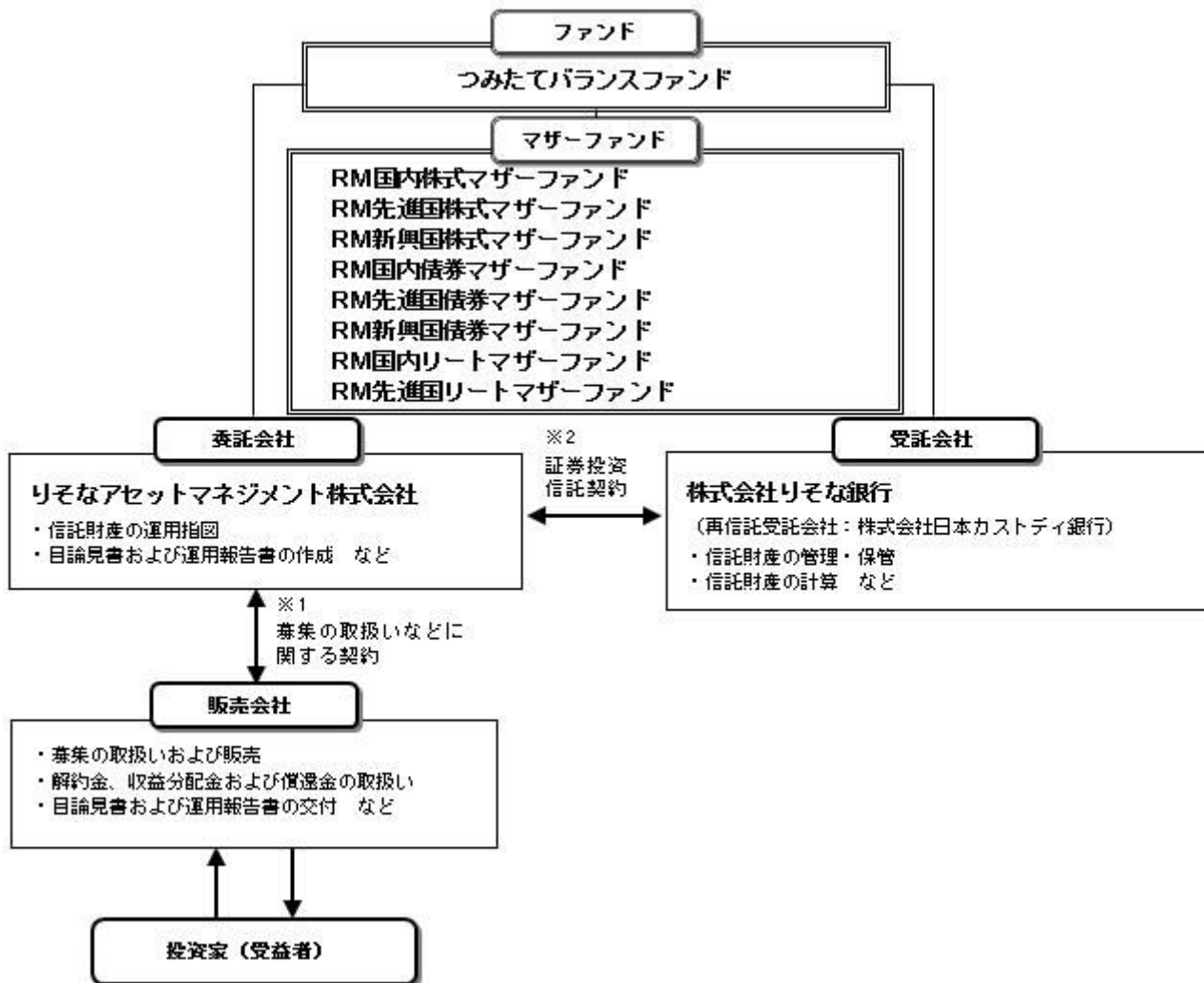
## (2)【ファンドの沿革】

2017年10月26日

- ・ファンドの信託契約締結、運用開始

## (3) 【ファンドの仕組み】

## ファンドの仕組み



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

## 委託会社の概況（2023年7月末現在）

- 資本金  
1,000百万円
- 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
- 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】

R M国内株式マザーファンド、R M先進国株式マザーファンド、R M新興国株式マザーファンド、R M国内債券マザーファンド、R M先進国債券マザーファンド、R M新興国債券マザーファンド、R M国内リートマザーファンドおよびR M先進国リートマザーファンド（以下、各々を「マザーファンド」といいます。）の各受益証券を主要投資対象とします。

主として各マザーファンド受益証券への投資を通じ、実質的に国内、先進国および新興国の株式・債券ならびに国内および先進国の不動産投資信託証券等への分散投資を行い、信託財産の長期的な成長を目標とした運用を行います。

以下の指数を「基本的資産配分」で組合わせたものを合成ベンチマークとし、当該合成ベンチマークに連動する投資成果を目指します。

実質的な投資対象	指数名称	基本的資産配分
国内株式	東証株価指数（TOPIX、配当込み）	30%
先進国株式	M S C I - K O K U S A I 指数（配当込み、円換算ベース）	20%
新興国株式	M S C I エマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）	5%
国内債券	N O M U R A - B P I 総合	20%
先進国債券	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）	5%
新興国債券	J P モルガン G B I - E M グローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）	5%
国内リート	東証 R E I T 指数（配当込み）	10%
先進国リート	S & P 先進国 R E I T 指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）	5%

合成ベンチマークへの連動性を高めるため、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、E T F（上場投資信託証券）を活用することがあります。

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

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

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

## （２）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

有価証券の指図範囲

委託者は、信託金を、主として、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。

#### 金融商品の指図範囲

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

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

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

#### その他の投資対象と指図範囲

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

## 《参考情報》

## 投資対象とするマザーファンドの概要

## &lt; R M国内株式マザーファンド &gt;

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

## &lt; R M先進国株式マザーファンド &gt;

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、MSCI - KOKUSA I 指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	次の有価証券を主要投資対象とします。 <ul style="list-style-type: none"> <li>・金融商品取引所に上場されているまたは店頭登録されている（上場予定および店頭登録予定を含みます。）先進国株式（*）（日本の株式を除きます。以下同じ。）</li> <li>（*）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。</li> <li>・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）</li> </ul>
投資方針	主として、先進国株式または先進国株式の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）に投資し、MSCI - KOKUSA I 指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。なお、MSCI - KOKUSA I 指数（配当込み、円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の金融商品取引市場に上場する株価指数先物取引を活用することがあります。 株式またはETF（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。 為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。 資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	株式への投資割合には、制限を設けません。 新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。



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

## &lt; R M新興国株式マザーファンド &gt;

<b>運用の基本方針</b>	
基本方針	この投資信託は、MSCIEマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	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	主として、新興国の株式または新興国株式の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）に投資し、MSCIEマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。なお、MSCIEマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の金融商品取引市場に上場する株価指数先物取引を活用することがあります。 株式またはETF（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。 為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。 資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	株式への投資割合には、制限を設けません。 新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
収益分配	収益分配は行いません。

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

## &lt; R M国内債券マザーファンド &gt;

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

申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
<b>その他</b>	
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

## &lt; R M先進国債券マザーファンド &gt;

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

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

## &lt; R M新興国債券マザーファンド &gt;

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、J Pモルガン G B I E Mグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	次の有価証券を主要投資対象とします。 ・ J Pモルガン G B I E Mグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）に採用されている新興国の債券 ・ 新興国債券の指数を対象指数とした E T F（上場投資信託証券）
投資方針	主として、J Pモルガン G B I E Mグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）に採用されている新興国の現地通貨建て債券または新興国債券の指数を対象指数とした E T F（上場投資信託証券）に投資し、J Pモルガン G B I E Mグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、J Pモルガン G B I E Mグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の債券先物取引を活用することがあります。 債券または E T F（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。 為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。 資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。

主な投資制限	<p>株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限り ます。</p> <p>株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財 産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損 益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変 動リスクを回避する目的以外には利用しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、 同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額 を超えないものとします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エク スポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポ ージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの 区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることと なった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比 率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
収益分配	収益分配は行いません。
<b>ファンドに係る費用</b>	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	<p>組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信 託財産に関する租税など。</p> <p>上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。</p>
<b>その他</b>	
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

## &lt; R M国内リートマザーファンド &gt;

<b>運用の基本方針</b>	
基本方針	この投資信託は、東証 R E I T 指数（配当込み）の動きに連動する投資成果をめ ざして運用を行います。
主な投資対象	<p>次の有価証券を主要投資対象とします。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・東証 R E I T 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。）</li> </ul>

投資方針	<p>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。</p> <p>不動産投資信託証券またはETF（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。</p> <p>資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>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。</p> <p>新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は、行いません。</p> <p>デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
収益分配	収益分配は行いません。
<b>ファンドに係る費用</b>	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	<p>組入る有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。</p> <p>上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。</p>
<b>その他</b>	
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

## &lt; R M先進国リートマザーファンド &gt;

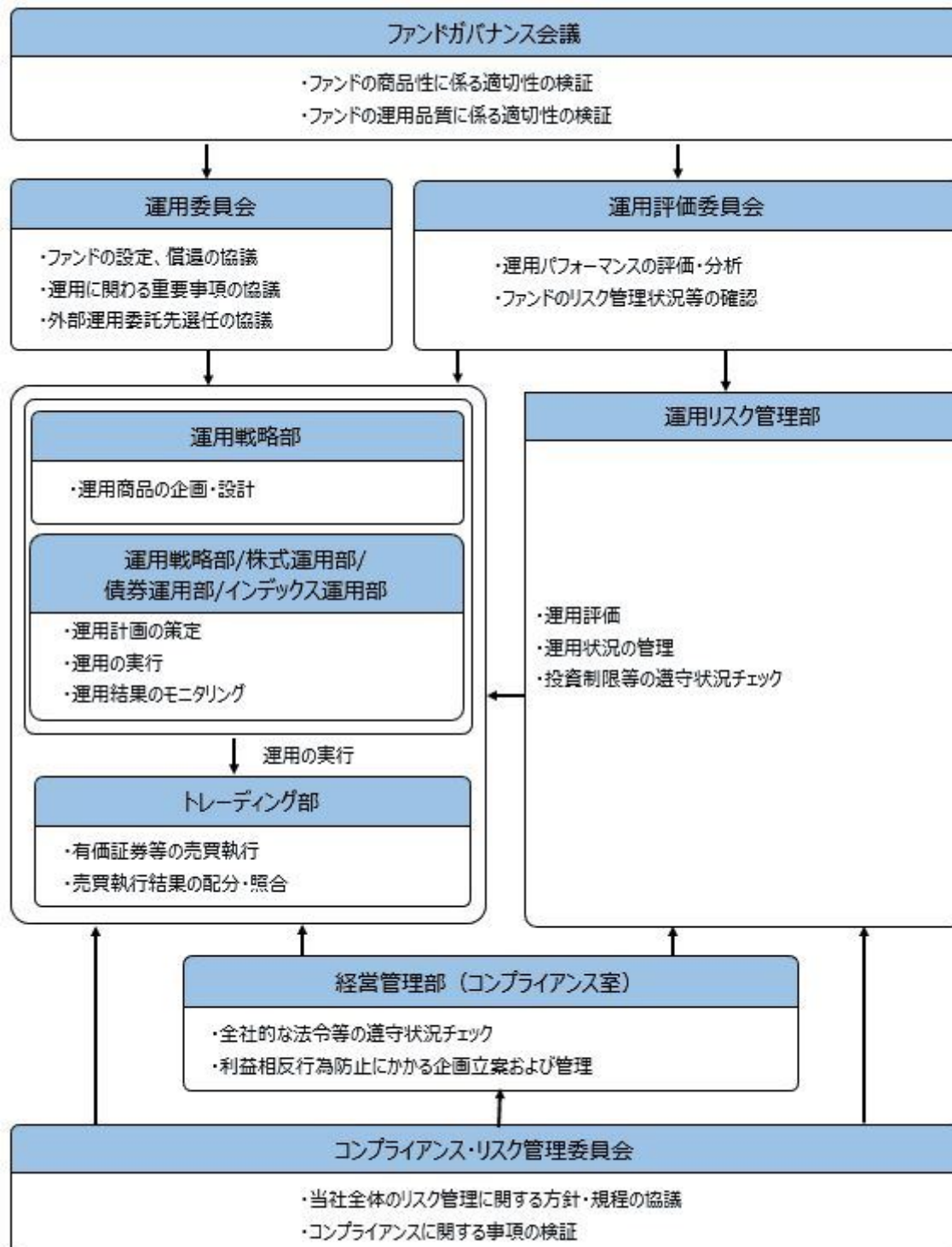
<b>運用の基本方針</b>	
基本方針	この投資信託は、S & P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

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

委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

### （３）【運用体制】

ファンドの運用体制は以下のとおりです。



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

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



#### ファンドの関係法人に対する管理体制

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

上記の運用体制は、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】

##### 収益分配方針

原則として毎決算時に以下の収益分配方針に基づいて分配を行います。

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

##### 収益分配金の支払い

###### < 分配金再投資コース（自動けいぞく投資コース）>

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

###### < 分配金受取りコース（一般コース）>

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

#### （５）【投資制限】

##### 約款に定める投資制限

- 1) 株式への実質投資割合には、制限を設けません。
- 2) 新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の 20% 以下とします。
- 3) 投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 5% 以下とします。
- 4) 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- 5) デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。
- 6) 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 7) 一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に 10%、合計で 20% を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- 8) 投資する株式等の範囲
  1. 委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
  2. 前記 1. の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとします。
- 9) 信用取引の指図範囲
  1. 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができます。

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

イ) 信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券

ロ) 株式分割により取得する株券

ハ) 有償増資により取得する株券

ニ) 売出しにより取得する株券

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

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

#### 10) 先物取引等の運用指図および範囲

1. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとします(以下同じ。)

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

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

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

2. 委託者は、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。

イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合わせてヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額の範囲内とします。

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

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

3. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれ

らの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。

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

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

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

#### 11) スワップ取引の運用指図および範囲

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

#### 12) 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図および範囲

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

場合には、委託者は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

4. 為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下4.において「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「保有外貨建資産の時価総額の合計額」といいます。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額の合計額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額が保有外貨建資産の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
5. 前記3.および4.においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品および保有外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品および保有外貨建資産の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
6. 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。
7. 委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

### 13) 直物為替先渡取引の運用指図

1. 委託者は、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、直物為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
2. 直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として、信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
3. 直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる直物為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる直物為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下3.において「直物為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、保有外貨建資産の時価総額の合計額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額の合計額が減少して、直物為替先渡取引の想定元本の合計額が保有外貨建資産の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかにその超える額に相当する直物為替先渡取引の一部の解約（反対の売買による解消を含む。）を指図するものとします。
4. 前記3.においてマザーファンドの信託財産にかかる直物為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる直物為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
5. 直物為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。
6. 委託者は、直物為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

### 14) 有価証券の貸付けの指図および範囲

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

2. 前記1. に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかにその超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
3. 委託者は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

#### 15) 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

#### 16) 外国為替予約取引の指図および範囲

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

#### 17) 資金の借入れ

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

#### 法令による投資制限

同一法人の発行する株式(投資信託及び投資法人に関する法律)

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

### 3【投資リスク】

#### (1) ファンドのリスク

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

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

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

#### 市場リスク

##### ・株価変動リスク

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

##### ・金利(債券価格)変動リスク

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

##### ・リートの価格変動リスク

リートの価格は、不動産市況(不動産価格、賃貸料等)、金利・景気動向、社会情勢の変化、関係法令・各種規制等の変更、災害等の要因により変動します。リートの価格および分配金は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。

## 資産配分リスク

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

## 信用リスク

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

## 流動性リスク

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

## カントリーリスク

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

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

## （その他の留意点）

当ファンドは合成ベンチマークに連動する投資成果を目指して運用しますが、主として以下の理由から、当ファンドの投資成果は合成ベンチマークの動きから乖離する場合があります。

- ・組入資産の時価変動等の理由により、基本的資産配分から実際の資産配分比率が乖離する場合があります。
- ・合成ベンチマークを構成する指数の全ての銘柄を指数の算出方法どおりに組み入れない場合や、構成銘柄以外の銘柄や先物を組み入れる場合があります。
- ・有価証券等の売買価格や基準価額算出に使用される有価証券等の時価が、合成ベンチマークを構成する指数の算出に使用される有価証券等の時価と一致しない場合があります。
- ・外貨取引時の為替レートや基準価額算出に使用される為替レートが、合成ベンチマークを構成する指数の算出に使用される為替レートと一致しない場合があります。
- ・運用管理費用（信託報酬）、監査費用および有価証券等の売買にかかる売買委託手数料等の費用負担が発生すること。

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

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

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

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

小さかった場合も同様です。

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

## （２）リスク管理体制

### 委託会社における投資リスクに対する管理体制

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

運用評価委員会は、運用実績、流動性リスクを含む運用リスクの状況、主な投資制限等の遵守状況および運用事務状況等を確認することを通じ、信託財産の適切な運用に寄与することを目的に運用部門に対する管理・指導、改善提案等を行います。なお、流動性リスクについては、緊急時対応策の有効性検証結果や流動性リスク管理プロセスの見直し結果についても確認を行います。

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

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



- \* 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。2018年8月末を10,000として指数化しております。
- \* 年間騰落率は、2018年8月から2023年7月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。なお、2018年9月までは、対象インデックスの騰落率を表示しております。

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

## 各資産クラスの指数

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

## ○代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

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

## 東証株価指数 (TOPIX, 配当込み)

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

## MSCI-KOKUSAIインデックス (配当込み, 円ベース)

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

## MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み, 円ベース)

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

## NOMURA-BPI国債

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

## FTSE世界国債インデックス (除く日本, 円ベース)

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

## JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド (円ベース)

JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド (円ベース)は、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。

## ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	31.3	42.1	59.8	62.7	5.4	7.9	21.5
最小値	△8.2	△16.0	△12.4	△19.4	△5.5	△6.1	△9.4
平均値	6.2	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年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。なお、当ファンドの設定日以前の年間騰落率につきましては、当ファンドの対象インデックスを用いて算出しております。
- \* 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。

## 4 【手数料等及び税金】

## (1) 【申込手数料】

ありません。

## (2) 【換金（解約）手数料】



換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

### （３）【信託報酬等】

信託報酬

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年0.2145%（税抜0.195%）の率を乗じて得た額とします。

ただし、R M新興国債券マザーファンドがETF（上場投資信託証券）を保有した場合に受益者が負担する実質的な信託報酬率の合計値は年率0.237%程度（税込）

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
0.075%	0.100%	0.020%

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

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

支払時期

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

### （４）【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

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

上場投資信託証券、上場不動産投資信託証券は市場の需給により価格形成されるため、これら費用を表示することができません。

上記の手数料等の合計額については、購入金額や保有期間等に応じて異なりますので、上限額等を事前に示すことができません。

## （５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度（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。

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）<sup>\*</sup>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。

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

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

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

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）」、未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA」および非課税累積投資契約に係る少額投資非課税制度「愛称：つみたて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。
- ・つみたてNISAをご利用の場合、毎年、年間40万円の範囲で販売会社との契約に基づいて定期的かつ継続的な方法で購入することにより生じる配当所得および譲渡所得が20年間非課税となります。なお、「NISA」と「つみたてNISA」の投資枠は、年ごとに選択制であり、同一年において両方の適用を受けることはできません。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。

法人受益者の場合

### １）収益分配金、解約金、償還金に対する課税

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

### ２）益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

個別元本

### １）各受益者の買付時の基準価額（申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額は含まれませ

ん。)が個別元本になります。

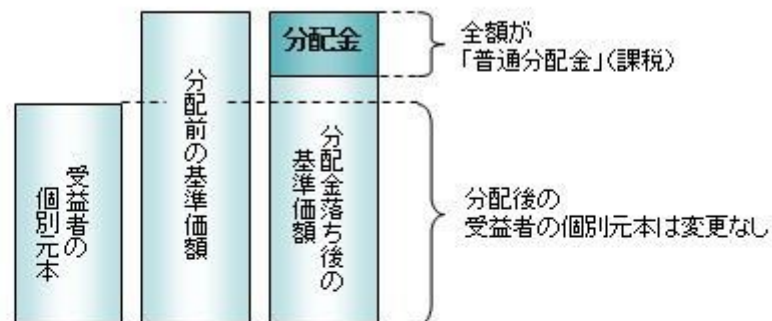
- 2) 受益者が同一ファンドを複数回お申込みの場合、1口当たりの個別元本は、申込口数で加重平均した値となります。ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。

#### 普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

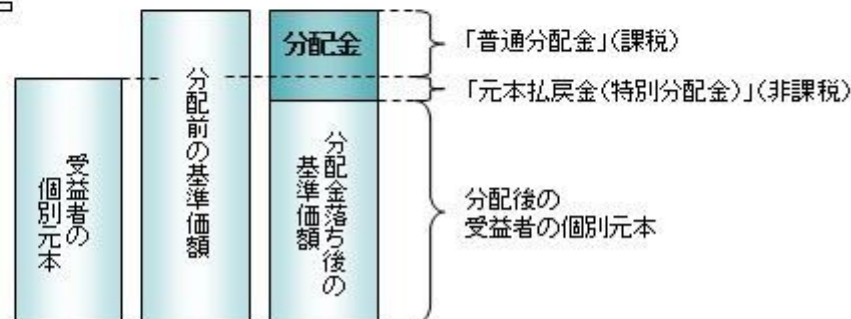
- 1) 収益分配金には課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」(元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。
- 2) 受益者が収益分配金を受け取る際
- イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。
- ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。
- ハ)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

#### <分配金に関するイメージ図>

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



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

上記は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】

### 【つみたてバランスファンド】

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。

### (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	36,411,380,428	99.70
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		108,484,926	0.30
合計（純資産総額）		36,519,865,354	100.00

## （２）【投資資産】

### 【投資有価証券の主要銘柄】

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	R M国内株式マザーファンド	6,261,183,233	1.7412	10,901,972,246	1.7697	11,080,415,967	30.34
日本	親投資信託受益証券	R M先進国株式マザーファンド	2,902,870,484	2.5213	7,319,007,351	2.5268	7,334,973,138	20.08
日本	親投資信託受益証券	R M国内債券マザーファンド	7,107,817,779	1.0185	7,239,312,407	1.0069	7,156,861,721	19.60
日本	親投資信託受益証券	R M国内リートマザーファンド	2,479,261,030	1.4568	3,611,787,468	1.4555	3,608,564,429	9.88
日本	親投資信託受益証券	R M新興国株式マザーファンド	1,036,134,667	1.7413	1,804,221,295	1.7850	1,849,500,380	5.06
日本	親投資信託受益証券	R M新興国債券マザーファンド	1,384,380,885	1.3111	1,815,061,778	1.3053	1,807,032,369	4.95
日本	親投資信託受益証券	R M先進国リートマザーファンド	1,182,527,079	1.5525	1,835,873,290	1.5135	1,789,754,734	4.90
日本	親投資信託受益証券	R M先進国債券マザーファンド	1,548,717,725	1.1630	1,801,158,714	1.1521	1,784,277,690	4.89

#### ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.70
合計	99.70

### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## （３）【運用実績】

### 【純資産の推移】

純資産総額（百万円）	1口当たり純資産額（円）
------------	--------------

期別	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第1計算期間末 (2018年 7月25日)	556	556	1.0211	1.0211
第2計算期間末 (2019年 7月25日)	3,291	3,291	1.0322	1.0322
第3計算期間末 (2020年 7月27日)	7,744	7,744	1.0317	1.0317
第4計算期間末 (2021年 7月26日)	15,835	15,835	1.2671	1.2671
第5計算期間末 (2022年 7月25日)	24,171	24,171	1.2987	1.2987
第6計算期間末 (2023年 7月25日)	36,477	36,477	1.4465	1.4465
2022年 7月末日	24,251		1.3044	
8月末日	25,136		1.3143	
9月末日	24,721		1.2568	
10月末日	26,508		1.3101	
11月末日	27,262		1.3118	
12月末日	26,896		1.2583	
2023年 1月末日	28,335		1.2903	
2月末日	29,470		1.3080	
3月末日	30,244		1.3104	
4月末日	31,604		1.3375	
5月末日	33,138		1.3727	
6月末日	35,501		1.4407	
7月末日	36,519		1.4497	

## 【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2017年10月26日～2018年 7月25日	0.0000
第2期	2018年 7月26日～2019年 7月25日	0.0000
第3期	2019年 7月26日～2020年 7月27日	0.0000
第4期	2020年 7月28日～2021年 7月26日	0.0000
第5期	2021年 7月27日～2022年 7月25日	0.0000
第6期	2022年 7月26日～2023年 7月25日	0.0000

## 【収益率の推移】

期	期間	収益率（%）
第1期	2017年10月26日～2018年 7月25日	2.11
第2期	2018年 7月26日～2019年 7月25日	1.09
第3期	2019年 7月26日～2020年 7月27日	0.05
第4期	2020年 7月28日～2021年 7月26日	22.82
第5期	2021年 7月27日～2022年 7月25日	2.49
第6期	2022年 7月26日～2023年 7月25日	11.38

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

#### （４）【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	2017年10月26日～2018年7月25日	548,362,039	3,063,179
第2期	2018年7月26日～2019年7月25日	2,744,605,538	101,031,481
第3期	2019年7月26日～2020年7月27日	4,603,201,837	284,995,956
第4期	2020年7月28日～2021年7月26日	5,615,036,613	624,482,362
第5期	2021年7月27日～2022年7月25日	6,848,125,159	734,419,987
第6期	2022年7月26日～2023年7月25日	7,786,544,191	1,179,699,953

(注)第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

（参考）

#### R M国内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	日本	118,193,973,760	99.18
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		982,341,473	0.82
合計（純資産総額）		119,176,315,233	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	884,260,000	0.74

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

#### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	1,965,000	1,950.03	3,831,822,145	2,386.00	4,688,490,000	3.93

日本	株式	ソニーグループ	電気機器	253,100	11,941.04	3,022,278,103	13,315.00	3,370,026,500	2.83
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	2,207,300	944.61	2,085,046,390	1,146.00	2,529,565,800	2.12
日本	株式	キーエンス	電気機器	35,800	61,196.69	2,190,841,704	63,760.00	2,282,608,000	1.92
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	11,497,100	158.89	1,826,783,552	162.90	1,872,877,590	1.57
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	250,500	5,689.45	1,425,207,225	6,694.00	1,676,847,000	1.41
日本	株式	三菱商事	卸売業	230,800	5,093.61	1,175,606,931	7,265.00	1,676,762,000	1.41
日本	株式	日立製作所	電気機器	175,800	7,445.18	1,308,862,845	9,298.00	1,634,588,400	1.37
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	75,700	16,451.39	1,245,370,367	21,245.00	1,608,246,500	1.35
日本	株式	三井物産	卸売業	268,700	4,216.81	1,133,058,082	5,541.00	1,488,866,700	1.25
日本	株式	任天堂	その他製品	225,900	5,646.60	1,275,567,814	6,450.00	1,457,055,000	1.22
日本	株式	信越化学工業	化学	298,000	3,925.70	1,169,858,985	4,679.00	1,394,342,000	1.17
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	317,600	4,336.18	1,377,173,043	4,341.00	1,378,701,600	1.16
日本	株式	第一三共	医薬品	312,700	4,404.50	1,377,288,845	4,347.00	1,359,306,900	1.14
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	272,300	4,073.87	1,109,317,364	4,933.00	1,343,255,900	1.13
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	233,300	4,458.70	1,040,215,362	5,750.00	1,341,475,000	1.13
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	290,900	3,531.32	1,027,261,325	4,513.00	1,312,831,700	1.10
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	177,000	5,885.67	1,041,765,335	7,242.00	1,281,834,000	1.08
日本	株式	HOYA	精密機器	75,800	14,597.98	1,106,526,952	16,530.00	1,252,974,000	1.05
日本	株式	ダイキン工業	機械	43,100	24,011.78	1,034,907,897	28,690.00	1,236,539,000	1.04
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	509,700	2,039.63	1,039,601,014	2,404.00	1,225,318,800	1.03
日本	株式	KDDI	情報・通信業	277,300	4,112.03	1,140,268,209	4,187.00	1,161,055,100	0.97
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	348,400	2,825.63	984,449,793	3,259.00	1,135,435,600	0.95
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	194,700	4,675.31	910,284,344	5,450.00	1,061,115,000	0.89
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	576,800	1,507.80	869,700,006	1,578.00	910,190,400	0.76
日本	株式	村田製作所	電気機器	108,500	7,739.17	839,700,109	8,325.00	903,262,500	0.76
日本	株式	S M C	機械	11,700	68,766.98	804,573,745	74,150.00	867,555,000	0.73
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	130,500	5,965.16	778,454,066	5,893.00	769,036,500	0.65
日本	株式	三菱電機	電気機器	373,500	1,586.91	592,711,335	2,051.00	766,048,500	0.64
日本	株式	ファナック	電気機器	174,500	4,535.05	791,366,571	4,348.00	758,726,000	0.64

## ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.08
		鉱業	0.33
		建設業	2.03
		食料品	3.23
		繊維製品	0.43
		パルプ・紙	0.17
		化学	5.93

医薬品	4.91
石油・石炭製品	0.43
ゴム製品	0.70
ガラス・土石製品	0.67
鉄鋼	0.94
非鉄金属	0.68
金属製品	0.51
機械	5.47
電気機器	17.86
輸送用機器	8.03
精密機器	2.50
その他製品	2.28
電気・ガス業	1.30
陸運業	2.88
海運業	0.59
空運業	0.50
倉庫・運輸関連業	0.14
情報・通信業	8.03
卸売業	6.89
小売業	4.32
銀行業	6.51
証券、商品先物取引業	0.73
保険業	2.28
その他金融業	1.15
不動産業	1.80
サービス業	4.87
合 計	99.18

## 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	38	日本円	842,670,900	884,260,000	0.74

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

## R M先進国株式マザーファンド

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	133,583,696,440	65.70
	カナダ	6,596,341,393	3.24
	パナマ	65,851,508	0.03
	ドイツ	4,791,555,013	2.36
	イタリア	1,054,201,681	0.52
	フランス	6,255,127,434	3.08
	オランダ	3,815,436,311	1.88
	スペイン	1,411,052,695	0.69
	ベルギー	430,587,658	0.21
	オーストリア	100,472,348	0.05
	ルクセンブルク	109,768,504	0.05
	フィンランド	604,505,808	0.30
	アイルランド	3,518,846,049	1.73
	ポルトガル	94,826,537	0.05
	イギリス	7,859,569,052	3.87
	スイス	6,248,369,538	3.07
	スウェーデン	1,660,662,338	0.82
	ノルウェー	365,845,563	0.18
	デンマーク	1,637,948,172	0.81
	ケイマン	361,869,800	0.18
	リベリア	87,866,653	0.04
	オーストラリア	3,793,721,780	1.87
	バミューダ	279,456,574	0.14
	ニュージーランド	152,051,082	0.07
	香港	1,052,440,810	0.52
	シンガポール	633,847,781	0.31
	イスラエル	357,496,129	0.18
	キュラソー	282,321,669	0.14
	ジャージー	691,673,230	0.34
	マン島	42,002,885	0.02
小計		187,939,412,435	92.43
投資証券	アメリカ	3,371,683,506	1.66
	カナダ	16,241,232	0.01
	フランス	66,941,240	0.03
	ベルギー	17,421,676	0.01
	イギリス	68,116,754	0.03
	オーストラリア	220,965,275	0.11
	香港	53,420,976	0.03

	シンガポール	75,727,517	0.04
	小計	3,890,518,176	1.91
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		11,500,471,617	5.66
合計(純資産総額)		203,330,402,228	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	9,318,578,668	4.58
	買建	ドイツ	2,201,620,200	1.08

(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		315,898,562	0.16

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	391,985	20,474.48	8,025,690,140	27,606.15	10,821,198,707	5.32
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	175,194	35,057.82	6,141,921,346	47,700.01	8,356,757,111	4.11
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	228,670	13,844.66	3,165,859,248	18,637.64	4,261,869,985	2.10
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	61,185	29,252.68	1,789,825,513	65,903.47	4,032,304,118	1.98
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	147,533	13,988.45	2,063,758,451	18,689.80	2,757,362,647	1.36
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	70,617	21,817.92	1,540,716,544	37,560.04	2,652,377,825	1.30
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	54,860	21,345.67	1,171,023,862	45,882.91	2,517,136,750	1.24
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	133,044	14,132.24	1,880,210,072	18,750.41	2,494,630,839	1.23
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	23,097	69,054.15	1,594,943,807	70,895.22	1,637,466,959	0.81
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	72,555	19,442.58	1,410,656,566	22,119.60	1,604,887,774	0.79
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	32,147	43,893.82	1,411,054,918	49,312.71	1,585,255,872	0.78

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	64,334	23,539.17	1,514,369,001	24,596.44	1,582,387,731	0.78
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	100,509	15,956.39	1,603,761,235	14,683.43	1,475,817,389	0.73
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	40,235	31,588.55	1,270,965,615	33,233.67	1,337,157,014	0.66
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	10,324	84,493.18	872,307,682	126,843.39	1,309,531,223	0.64
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	19,997	49,349.36	986,839,310	64,631.92	1,292,444,616	0.64
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	58,429	20,021.96	1,169,863,632	22,049.11	1,288,307,898	0.63
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	68,056	18,165.05	1,236,241,323	17,392.32	1,183,651,730	0.58
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	一般消費財・サービス流通・小売り	25,060	44,313.91	1,110,506,822	46,713.22	1,170,633,516	0.58
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	金融サービス	21,073	53,295.11	1,123,088,026	55,395.57	1,167,350,872	0.57
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	9,974	96,062.22	958,124,642	101,443.55	1,011,797,968	0.50
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	44,550	25,196.97	1,122,525,361	22,395.90	997,737,519	0.49
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	62,811	15,262.82	958,673,107	14,990.74	941,583,986	0.46
アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	43,655	20,812.81	908,583,255	21,265.32	928,337,741	0.46
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	34,073	24,211.59	824,961,762	26,828.00	914,110,468	0.45
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	41,004	20,252.85	830,448,107	22,034.27	903,493,617	0.44
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	101,672	8,537.14	867,988,423	8,807.80	895,507,211	0.44
フランス	株式	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	耐久消費財・アパレル	6,835	123,945.99	847,170,893	130,680.42	893,200,671	0.44
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	10,971	69,589.84	763,470,140	79,411.22	871,220,499	0.43
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	11,354	51,442.77	584,081,237	74,554.80	846,495,243	0.42

## ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国外	エネルギー	4.59
		素材	3.91
		資本財	6.30

	商業・専門サービス	1.46
	運輸	1.80
	自動車・自動車部品	2.17
	耐久消費財・アパレル	1.58
	消費者サービス	2.03
	メディア・娯楽	5.70
	一般消費財・サービス流通・小売り	4.15
	生活必需品流通・小売り	1.64
	食品・飲料・タバコ	3.74
	家庭用品・パーソナル用品	1.60
	ヘルスケア機器・サービス	4.29
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.81
	銀行	5.18
	金融サービス	6.17
	保険	2.85
	ソフトウェア・サービス	8.83
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.61
	電気通信サービス	1.10
	公益事業	2.68
	半導体・半導体製造装置	5.89
	不動産管理・開発	0.34
投資証券		1.91
合計		94.34

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	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	287	米ドル	64,093,262.5	9,035,227,216	66,103,275	9,318,578,668	4.58
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	STX E6002309	買建	600	ユーロ	13,742,798	2,134,943,675	14,172,000	2,201,620,200	1.08

(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	1,690,000.00	236,371,543	238,185,349	0.12
	ユーロ	買建	260,000.00	40,395,341	40,382,947	0.02

英ポンド	買建	158,000.00	28,631,097	28,619,341	0.01
スウェーデンクローナ	買建	300,000.00	4,049,340	4,013,520	0.00
オーストラリアドル	買建	50,000.00	4,745,840	4,697,405	0.00

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

#### R M新興国株式マザーファンド

以下の運用状況は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。



## R M国内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（％）
国債証券	日本	134,556,102,410	85.26
地方債証券	日本	7,342,793,195	4.65
特殊債券	日本	8,592,675,194	5.44
社債券	日本	5,692,230,000	3.61
	フランス	499,695,000	0.32
	韓国	100,106,000	0.06
	小計	6,292,031,000	3.99
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		1,040,814,085	0.66
合計（純資産総額）		157,824,415,884	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444回利付国債（2年）	5,350,000,000	100.13	5,357,063,900	100.08	5,354,547,500	0.005	2025/1/1	3.39
日本	国債証券	第147回利付国債（5年）	2,110,000,000	100.06	2,111,327,900	100.01	2,110,274,300	0.005	2026/3/20	1.34
日本	国債証券	第158回利付国債（5年）	1,930,000,000	100.00	1,930,106,400	99.79	1,925,985,600	0.100	2028/3/20	1.22
日本	国債証券	第146回利付国債（5年）	1,860,000,000	100.36	1,866,733,200	100.26	1,864,873,200	0.100	2025/12/20	1.18
日本	国債証券	第366回日本国債（10年）	1,860,000,000	98.34	1,829,302,400	97.47	1,813,053,600	0.200	2032/3/20	1.15
日本	国債証券	第356回利付国債（10年）	1,810,000,000	98.89	1,789,945,500	98.85	1,789,257,400	0.100	2029/9/20	1.13
日本	国債証券	第145回利付国債（5年）	1,770,000,000	100.31	1,775,556,500	100.24	1,774,336,500	0.100	2025/9/20	1.12
日本	国債証券	第150回利付国債（5年）	1,740,000,000	99.96	1,739,445,000	99.91	1,738,521,000	0.005	2026/12/20	1.10
日本	国債証券	第142回利付国債（5年）	1,720,000,000	100.21	1,723,612,000	100.22	1,723,801,200	0.100	2024/12/20	1.09
日本	国債証券	第359回利付国債（10年）	1,740,000,000	98.71	1,717,713,700	98.28	1,710,176,400	0.100	2030/6/20	1.08
日本	国債証券	第362回利付国債（10年）	1,750,000,000	97.86	1,712,606,400	97.52	1,706,687,500	0.100	2031/3/20	1.08
日本	国債証券	第148回利付国債（5年）	1,700,000,000	100.07	1,701,355,800	99.98	1,699,745,000	0.005	2026/6/20	1.08

日本	国債証券	第348回利付国債(10年)	1,690,000,000	99.79	1,686,451,000	100.08	1,691,385,800	0.100	2027/9/20	1.07
日本	国債証券	第149回利付国債(5年)	1,540,000,000	100.02	1,540,344,600	99.95	1,539,260,800	0.005	2026/9/20	0.98
日本	国債証券	第153回利付国債(5年)	1,540,000,000	99.90	1,538,587,400	99.78	1,536,704,400	0.005	2027/6/20	0.97
日本	国債証券	第353回利付国債(10年)	1,540,000,000	99.37	1,530,351,400	99.36	1,530,159,400	0.100	2028/12/20	0.97
日本	国債証券	第357回利付国債(10年)	1,510,000,000	98.74	1,491,009,700	98.68	1,490,128,400	0.100	2029/12/20	0.94
日本	国債証券	第367回日本国債(10年)	1,520,000,000	99.04	1,505,474,300	97.24	1,478,063,200	0.200	2032/6/20	0.94
日本	国債証券	第364回利付国債(10年)	1,510,000,000	97.52	1,472,641,200	97.06	1,465,636,200	0.100	2031/9/20	0.93
日本	国債証券	第351回利付国債(10年)	1,360,000,000	99.70	1,356,037,500	99.66	1,355,376,000	0.100	2028/6/20	0.86
日本	国債証券	第363回利付国債(10年)	1,380,000,000	97.66	1,347,836,300	97.29	1,342,698,600	0.100	2031/6/20	0.85
日本	国債証券	第349回利付国債(10年)	1,340,000,000	99.63	1,335,109,000	99.95	1,339,410,400	0.100	2027/12/20	0.85
日本	国債証券	第152回利付国債(5年)	1,310,000,000	100.31	1,314,158,100	100.19	1,312,606,900	0.100	2027/3/20	0.83
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	1,310,000,000	100.00	1,310,000,000	100.19	1,312,606,900	0.100	2027/3/20	0.83
日本	国債証券	第361回利付国債(10年)	1,320,000,000	98.16	1,295,764,900	97.77	1,290,656,400	0.100	2030/12/20	0.82
日本	国債証券	第358回利付国債(10年)	1,310,000,000	99.03	1,297,342,700	98.50	1,290,441,700	0.100	2030/3/20	0.82
日本	国債証券	第368回日本国債(10年)	1,280,000,000	99.45	1,272,993,100	96.99	1,241,561,600	0.200	2032/9/20	0.79
日本	国債証券	第449回利付国債(2年)	1,230,000,000	100.09	1,231,177,500	100.02	1,230,332,100	0.005	2025/6/1	0.78
日本	国債証券	第369回日本国債(10年)	1,230,000,000	100.76	1,239,398,100	99.50	1,223,960,700	0.500	2032/12/20	0.78
日本	国債証券	第360回利付国債(10年)	1,230,000,000	98.26	1,208,684,200	97.98	1,205,227,800	0.100	2030/9/20	0.76

## ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	85.26
地方債証券	4.65
特殊債券	5.44
社債券	3.99
合計	99.34

### 投資不動産物件

該当事項はありません。

### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

### R M先進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（％）
国債証券	アメリカ	26,698,245,306	47.89
	カナダ	1,114,105,430	2.00
	メキシコ	554,582,624	0.99
	ドイツ	3,663,172,652	6.57
	イタリア	4,272,625,085	7.66
	フランス	4,604,868,890	8.26
	オランダ	870,757,122	1.56
	スペイン	2,797,114,513	5.02
	ベルギー	1,016,317,607	1.82
	オーストリア	697,467,914	1.25
	フィンランド	285,631,021	0.51
	アイルランド	322,322,066	0.58
	イギリス	2,732,515,210	4.90
	スウェーデン	109,828,655	0.20
	ノルウェー	89,776,837	0.16
	デンマーク	169,760,038	0.30
	ポーランド	277,348,376	0.50
	オーストラリア	837,709,470	1.50
	ニュージーランド	114,179,941	0.20
	シンガポール	243,381,292	0.44
マレーシア	288,126,637	0.52	
中国	3,174,635,289	5.69	
イスラエル	160,883,090	0.29	
	小計	55,095,355,065	98.82
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		655,450,848	1.18
合計（純資産総額）		55,750,805,913	100.00

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,680,000	12,309.50	329,894,610	11,893.79	318,753,654	1.625	2031/5/15	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,470,000	12,842.95	317,221,008	12,714.28	314,042,777	0.750	2026/4/30	0.56

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,120,000	14,054.70	297,959,831	13,826.34	293,118,590	3.875	2025/3/31	0.53
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,060,000	13,931.56	286,990,329	13,574.97	279,644,392	3.500	2033/2/15	0.50
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,320,000	11,918.72	276,514,489	11,523.19	267,338,152	1.125	2031/2/15	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,990,000	13,430.75	267,272,098	12,942.80	257,561,882	2.875	2032/5/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,110,000	11,869.01	250,436,177	11,475.28	242,128,585	1.250	2031/8/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,880,000	12,869.19	241,940,801	12,718.13	239,100,979	0.875	2026/6/30	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,920,000	12,402.05	238,119,474	11,964.82	229,724,712	1.875	2032/2/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,590,000	14,770.30	234,847,778	14,248.98	226,558,834	4.125	2032/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,820,000	12,574.52	228,856,336	12,306.79	223,983,597	1.250	2028/4/30	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,930,000	11,937.33	230,390,654	11,527.05	222,472,079	1.375	2031/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,650,000	13,301.84	219,480,377	12,789.72	211,030,436	2.750	2032/8/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,580,000	13,238.51	209,168,532	13,308.17	210,269,145	0.750	2024/11/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,800,000	11,687.82	210,380,809	11,349.18	204,285,352	0.875	2030/11/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,510,000	13,718.57	207,150,480	13,437.30	202,903,294	3.375	2033/5/15	0.36
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	1,390,000	14,205.85	197,461,389	14,068.55	195,552,958	0.750	2028/5/25	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,360,000	14,413.08	196,017,904	14,001.73	190,423,597	4.125	2027/10/31	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,450,000	12,958.22	187,894,286	12,780.36	185,315,251	1.500	2027/1/31	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,370,000	14,041.14	192,363,715	13,125.62	179,821,111	3.625	2053/2/15	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,300,000	14,099.11	183,288,489	13,827.44	179,756,849	3.875	2026/1/15	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,270,000	15,064.25	191,316,044	14,060.65	178,570,333	4.000	2052/11/15	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,340,000	13,608.01	182,347,338	13,280.08	177,953,203	2.875	2028/5/15	0.32
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	1,190,000	14,697.78	174,903,686	14,733.55	175,329,292	0.000	2025/3/25	0.31
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,300,000	13,482.45	175,271,965	13,331.30	173,306,919	2.250	2025/11/15	0.31
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,360,000	12,734.65	173,191,337	12,688.40	172,562,257	0.500	2026/2/28	0.31
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,230,000	13,798.26	169,718,655	13,770.57	169,378,022	3.000	2024/7/31	0.30
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,320,000	12,712.63	167,806,724	12,683.99	167,428,745	0.375	2026/1/31	0.30
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,310,000	12,724.19	166,686,947	12,631.13	165,467,831	0.875	2026/9/30	0.30
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,270,000	12,840.95	163,080,158	12,750.62	161,932,955	0.250	2025/10/31	0.29

## ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	98.82
合計	98.82

### 投資不動産物件

該当事項はありません。

### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

### R M新興国債券マザーファンド

以下の運用状況は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	G L P 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	アクティブ・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。

## R M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	MP 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)

2019年7月25日	0円
2020年7月27日	0円
2021年7月26日	0円
2022年7月25日	0円
2023年7月25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国内株式マザーファンド	30.3
RM先進国株式マザーファンド	20.1
RM新興国株式マザーファンド	5.1
RM国内債券マザーファンド	19.6
RM先進国債券マザーファンド	4.9
RM新興国債券マザーファンド	4.9
RM国内リートマザーファンド	9.9
RM先進国リートマザーファンド	4.9
現金等	0.3
合計	100.0

※比率はファンドの純資産総額に対する組入比率であり、四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。  
※現金等には未収・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	60.3
米ドル	21.6
ユーロ	3.9
香港ドル	1.3
英ポンド	1.3
その他	11.6
合計	100.0

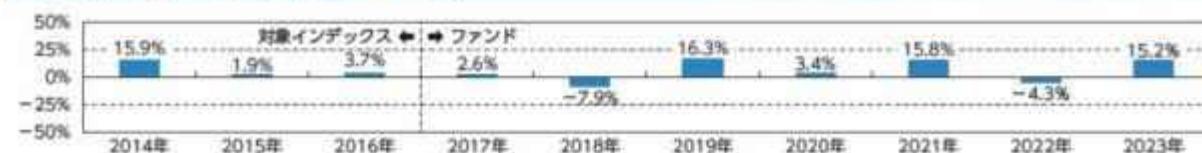
※比率はファンドの純資産総額に対する組入比率であり、四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。  
※上記通貨別組入比率は、各マザーファンドが実質的に保有している株式・債券等の通貨を基準に算出しています。

## ■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(%)	
国内株式	日本	トヨタ自動車	—	3.93	
	日本	ソニーグループ	—	2.83	
	日本	三菱UFJフィナンシャルグループ	—	2.12	
先進国株式	アメリカ	APPLE INC	—	5.32	
	アメリカ	MICROSOFT CORP	—	4.11	
	アメリカ	AMAZON.COM INC	—	2.10	
新興国株式	台湾	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	—	5.90	
	ケイマン	TENICENT HOLDINGS LTD	—	3.70	
国内債券	日本	第444回利付国債(2年)	2025/1/1	3.39	
	日本	第147回利付国債(5年)	2026/3/20	1.34	
	日本	第158回利付国債(5年)	2028/3/20	1.22	
	アメリカ	US TREASURY N/B	2031/5/15	0.57	
	アメリカ	US TREASURY N/B	2026/4/30	0.56	
	アメリカ	US TREASURY N/B	2025/3/31	0.53	
	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	
	国内リート	日本	日本ビルファンド投資法人	—	6.47
		日本	ジャパ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)



・2014年から2016年までは、対象インデックス(合成ベンチマーク)の年間騰落率です。  
・対象インデックスはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。  
・2017年は10月26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です。

(7) 申込単位

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

(8) 申込代金の支払い

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

(9) 受付の中止および取消

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

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

## 2【換金（解約）手続等】

(1) 解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(2) 取扱時間

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

(3) 解約請求不可日

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

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

(4) 解約制限

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

(5) 解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

委託会社の照会先

りそなアセットマネジメント株式会社

電話番号：0120-223351

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時）

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

（6）手取額

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

（7）解約単位

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

（8）解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

（9）受付の中止および取消

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

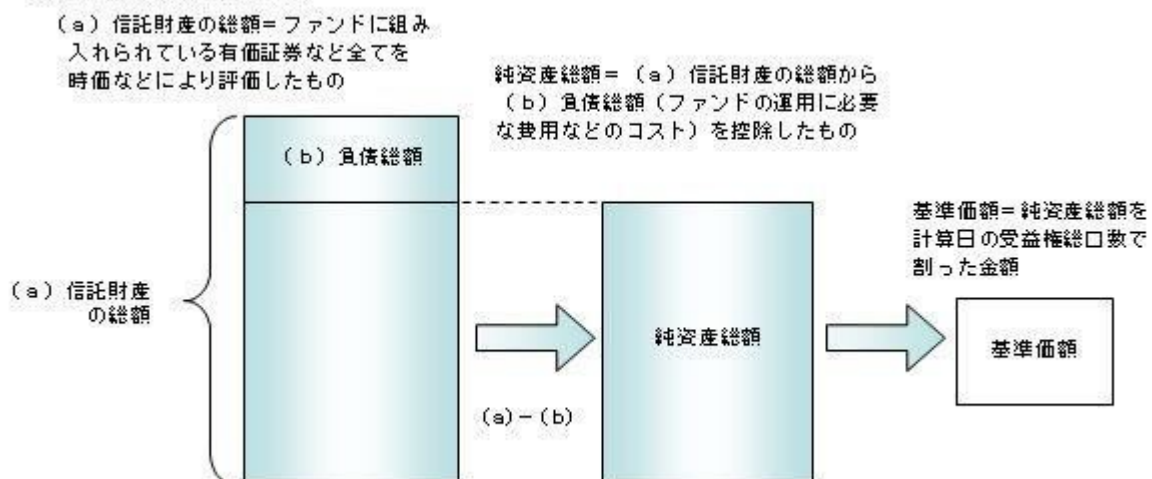
3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

基準価額の算出

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

<基準価額算出の流れ>



有価証券などの評価基準

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

## &lt; 主な資産の評価方法 &gt;

## 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<sup>\*</sup>における以下のいずれかの価額で評価します。

- ・ 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）
- ・ 金融商品取引業者（第一種金融商品取引業者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。）、銀行などの提示する価額（売気配相場を除きます。）
- ・ 価格情報会社の提供する価額

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

\* 外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

## 国内上場不動産投信

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

## 海外上場不動産投信

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

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

## 基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

## 委託会社の照会先

りそなアセットマネジメント株式会社

電話番号：0120-223351

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時）

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

## (2) 【保管】

該当事項はありません。

## (3) 【信託期間】

無期限とします（2017年10月26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26日から翌年7月25日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

## (5) 【その他】

信託の終了（繰上償還）

- 1) 委託会社は、次のいずれかの場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し繰上償還させることができます。
  - イ) 信託財産の純資産総額が20億円を下回ることとなったとき
  - ロ) 繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき
  - ハ) やむを得ない事情が発生したとき

- 2) この場合、委託会社は書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行ないます。(後述の「書面決議」をご覧ください。)
  - 3) 委託会社は、次のいずれかの場合には、後述の「書面決議」の規定は適用せず、信託契約を解約し繰上償還させます。
    - イ) 信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合で、書面決議が困難な場合
    - ロ) 監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき
    - ハ) 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したとき(監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引き継ぐことを命じたときは、書面決議で可決された場合、存続します。)
  - 二) 受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合またはその任務に違反するなどして解任された場合に、委託会社が新受託会社を選任できないとき
- 4) 繰上償還を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

#### 償還金について

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

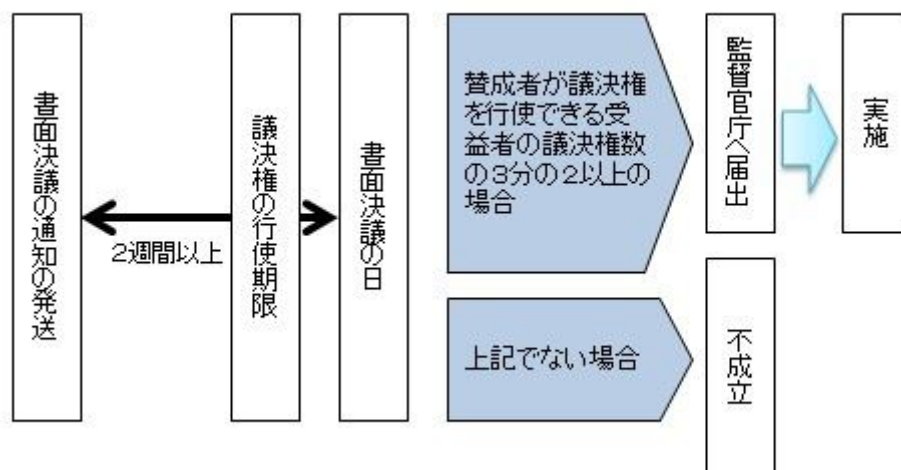
#### 信託約款の変更など

- 1) 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、この信託約款を変更すること、または当ファンドと他のファンドとの併合(以下「併合」といいます。)を行なうことができます。信託約款の変更または併合を行なう際には、委託会社は、その旨および内容をあらかじめ監督官庁に届け出ます。
- 2) この変更事項のうち、その内容が重大なものまたは併合(受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものを除きます。)については、書面決議を行ないます。(後述の「書面決議」をご覧ください。)
- 3) 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、後述の「書面決議」の規定を適用します。

#### 書面決議

- 1) 繰上償還、信託約款の重大な変更または併合に対して、委託会社は書面決議を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびにその内容および理由などの事項を定め、決議の日の2週間前までに知っている受益者に対し書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。
- 2) 受益者は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、書面決議について賛成するものとみなします。
- 3) 書面決議は、議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
- 4) 繰上償還、信託約款の重大な変更または併合に関する委託会社の提案に対して、すべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときは、書面決議を行ないません。
- 5) 当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合であっても、併合にかかる他のファンドにおいて併合の書面決議が否決された場合は、当該他のファンドとの併合を行なうことはできません。
- 6) 当ファンドは、受益者からの換金請求に対して、投資信託契約の一部を解約することにより応じることができるため、受益者の保護に欠けるおそれがないものとして、書面決議において反対した受益者からの買取請求は受け付けません。

## ＜書面決議の主な流れ＞



## 公告

公告は電子公告により行ない、委託会社のホームページに掲載します。

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

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

## 運用報告書の作成

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

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

## 関係法人との契約について

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

## 他の受益者の氏名などの開示の請求の制限

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

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

## 4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

## (1) 収益分配金・償還金受領権

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

## (2) 解約請求権

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

## (3) 帳簿閲覧権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第6期計算期間(2022年7月26日から2023年7月25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】



## 【つみたてバランスファンド】

## ( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位：円 )

	第5期 2022年 7月25日現在	第6期 2023年 7月25日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	88,775,527	142,920,018
親投資信託受益証券	24,113,274,295	36,389,151,484
流動資産合計	24,202,049,822	36,532,071,502
資産合計	24,202,049,822	36,532,071,502
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	7,142,517	19,994,226
未払受託者報酬	2,344,098	3,473,244
未払委託者報酬	20,510,773	30,390,854
未払利息	240	387
その他未払費用	914,113	1,059,242
流動負債合計	30,911,741	54,917,953
負債合計	30,911,741	54,917,953
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	18,611,338,221	25,218,182,459
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ( )	5,559,799,860	11,258,971,090
( 分配準備積立金 )	2,735,531,591	6,131,858,883
元本等合計	24,171,138,081	36,477,153,549
純資産合計	24,171,138,081	36,477,153,549
負債純資産合計	24,202,049,822	36,532,071,502

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第5期		第6期	
	自	2021年 7月27日	自	2022年 7月26日
	至	2022年 7月25日	至	2023年 7月25日
営業収益				
有価証券売買等損益		546,824,489		3,637,477,189
その他収益		-		851
営業収益合計		546,824,489		3,637,478,040
営業費用				
支払利息		105,629		101,512
受託者報酬		4,336,855		6,370,959
委託者報酬		37,947,313		55,745,761
その他費用		1,695,845		1,946,661
営業費用合計		44,085,642		64,164,893
営業利益又は営業損失（ ）		502,738,847		3,573,313,147
経常利益又は経常損失（ ）		502,738,847		3,573,313,147
当期純利益又は当期純損失（ ）		502,738,847		3,573,313,147
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（ ）		9,728,744		33,949,858
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		3,337,627,581		5,559,799,860
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,927,610,041		2,512,842,262
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,927,610,041		2,512,842,262
剰余金減少額又は欠損金増加額		198,447,865		353,034,321
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		198,447,865		353,034,321
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		5,559,799,860		11,258,971,090

## (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5期 2022年 7月25日現在	第6期 2023年 7月25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 12,497,633,049円	期首元本額 18,611,338,221円
期中追加設定元本額 6,848,125,159円	期中追加設定元本額 7,786,544,191円
期中一部解約元本額 734,419,987円	期中一部解約元本額 1,179,699,953円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 18,611,338,221口	2. 計算期間の末日における受益権の総数 25,218,182,459口
3. 計算期間の末日における1単位の純資産の額 1.2987円	3. 計算期間の末日における1単位の純資産の額 1.4465円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (12,987円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (14,465円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第5期 自 2021年 7月27日 至 2022年 7月25日	第6期 自 2022年 7月26日 至 2023年 7月25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 389,872,573円	A 費用控除後の配当等収益額 688,712,448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 103,137,530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 2,850,650,841円
C 収益調整金額 2,824,268,269円	C 収益調整金額 5,127,112,207円
D 分配準備積立金額 2,242,521,488円	D 分配準備積立金額 2,592,495,594円
E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D) 5,559,799,860円	E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D) 11,258,971,090円
F 当ファンドの期末残存口数 18,611,338,221口	F 当ファンドの期末残存口数 25,218,182,459口
G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000) 2,987円	G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000) 4,464円
H 10,000口当たり分配金額 0円	H 10,000口当たり分配金額 0円
I 収益分配金金額 (I=F×H/10,000) 0円	I 収益分配金金額 (I=F×H/10,000) 0円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

第5期 自 2021年 7月27日 至 2022年 7月25日	第6期 自 2022年 7月26日 至 2023年 7月25日
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、株価変動リスク、金利変動リスク、リートの価格変動リスク、投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。</p> <p>また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。</p>	<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>同左</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>同左</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

第5期 2022年 7月25日現在	第6期 2023年 7月25日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>親投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> <p>3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>親投資信託受益証券 同左</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左</p> <p>3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>同左</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

第5期 自 2021年 7月27日 至 2022年 7月25日	第6期 自 2022年 7月26日 至 2023年 7月25日
該当事項はありません。	同左

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 1 有価証券に関する注記

## 売買目的有価証券

種類	第5期 自 2021年 7月27日 至 2022年 7月25日	第6期 自 2022年 7月26日 至 2023年 7月25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	546,824,489	3,621,792,643
合計	546,824,489	3,621,792,643

## 2 デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

## （4）【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	R M国内株式マザーファンド	6,296,076,948	10,962,729,181	
	R M国内リートマザーファンド	2,479,261,030	3,611,787,468	
	R M先進国株式マザーファンド	2,902,870,484	7,319,007,351	
	R M新興国株式マザーファンド	1,036,134,667	1,804,221,295	
	R M先進国リートマザーファンド	1,182,527,079	1,835,873,290	
	R M国内債券マザーファンド	7,107,817,779	7,239,312,407	
	R M先進国債券マザーファンド	1,548,717,725	1,801,158,714	
	R M新興国債券マザーファンド	1,384,380,885	1,815,061,778	
合計		23,937,786,597	36,389,151,484	

(注) 券面総額欄の数値は口数を表しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

### (参考)

当ファンドは「R M国内株式マザーファンド」、「R M先進国株式マザーファンド」、「R M新興国株式マザーファンド」、「R M国内債券マザーファンド」、「R M先進国債券マザーファンド」、「R M新興国債券マザーファンド」、「R M国内リートマザーファンド」および「R M先進国リートマザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同親投資信託の受益証券です。

なお、以下に記載した状況は監査意見の対象外となっております。

### R M国内株式マザーファンド

#### 貸借対照表

(単位：円)

2023年 7月25日現在

#### 資産の部

##### 流動資産

2023年 7月25日現在

コール・ローン	944,085,580
株式	116,137,223,070
派生商品評価勘定	27,242,450
未収入金	890,412,400
未収配当金	125,758,065
差入委託証拠金	36,900,000
流動資産合計	118,161,621,565
資産合計	118,161,621,565
負債の部	
流動負債	
前受金	24,600,000
未払金	1,017,745,629
未払解約金	5,929,000
未払利息	2,560
流動負債合計	1,048,277,189
負債合計	1,048,277,189
純資産の部	
元本等	
元本	67,260,687,267
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	49,852,657,109
元本等合計	117,113,344,376
純資産合計	117,113,344,376
負債純資産合計	118,161,621,565

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2023年 7月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月26日
期首元本額	39,273,926,119円
期中追加設定元本額	74,024,630,887円

期中一部解約元本額	46,037,869,739円
期末元本額	67,260,687,267円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	2,474,654,842円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	3,306,096,784円
りそなラップ型ファンド(成長型)	4,044,771,051円
DCりそな グローバルバランス	68,733,479円
つみたてバランスファンド	6,296,076,948円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	465,401,205円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	329,126,633円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	224,344,678円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	115,618,986円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	78,569,012円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	43,297,249円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	91,481,415円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定型)	23,511,557円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定成長型)	39,650,078円
りそな つみたてラップ型ファンド(成長型)	43,215,771円
りそな つみたてリスクコントロールファンド	20,787,253円
ターゲットリターンバランスファンド(目標2%)	35,634円
ターゲットリターンバランスファンド(目標3%)	43,748円
ターゲットリターンバランスファンド(目標4%)	57,796円
ターゲットリターンバランスファンド(目標5%)	78,769円
ターゲットリターンバランスファンド(目標6%)	124,956円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2065	56,343円
FWりそな国内株式アクティブファンド	467,561,757円
FWりそな国内株式インデックスファンド	39,816,786,682円
Smart-i TOPIXインデックス	3,325,220,987円
Smart-i 8資産バランス 安定型	119,020,233円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	374,001,968円
Smart-i 8資産バランス 成長型	480,377,117円
TOPIXインデックスファンド(適格機関投資家専用)	502,563,301円
りそなFT TOPIXインデックス(適格機関投資家専用)	942,771,143円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	154,590,767円
りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	2,031,776,086円
りそなVIグローバル・バランスファンド(安定型)(適格機関投資家専用)	31,488,146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)	30,130,549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)	41,127,800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)	54,195,207円
りそなDAAマルチアセットファンド(適格機関投資家専用)	20,479,134円
りそなFT パッシブバランス(適格機関投資家専用)	71,650,208円
りそなマルチアセットファンド(適格機関投資家専用)	51,445,968円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	25,204円
りそなDAAファンド202205(適格機関投資家専用)	325,957,353円



りそなFT パッシブバランス202307（適格機関投資家専用）	753,783,470円
2. 計算日における受益権の総数	67,260,687,267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	1.7412円
(10,000口当たり純資産額)	(17,412円)

（注） は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

2023年 7月25日現在

1. 金融商品に対する取組方針

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

2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

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

金融商品の時価等に関する事項

2023年 7月25日現在

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

2. 時価の算定方法

株式

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

デリバティブ取引

（その他の注記）の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

## （関連当事者との取引に関する注記）

2023年 7月25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25日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式		12,588,207,586
合計		12,588,207,586

(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25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	909,197,550	-	936,440,000	27,242,450
	合計	909,197,550	-	936,440,000	27,242,450

（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	
極洋	1,900	3,660.00	6,954,000	
ニッスイ	49,900	674.70	33,667,530	
マルハニチロ	7,400	2,475.50	18,318,700	
雪国まいたけ	4,200	935.00	3,927,000	
カネコ種苗	1,500	1,465.00	2,197,500	
サカタのタネ	5,700	3,895.00	22,201,500	
ホクト	4,400	1,840.00	8,096,000	
ホクリヨウ	600	897.00	538,200	
住石ホールディングス	6,000	358.00	2,148,000	
日鉄鉱業	2,000	4,945.00	9,890,000	
三井松島ホールディングス	2,300	2,613.00	6,009,900	
I N P E X	184,400	1,840.00	339,296,000	
石油資源開発	5,800	4,865.00	28,217,000	
K & O エナジーグループ	2,300	2,275.00	5,232,500	
ショーボンドホールディングス	6,800	5,702.00	38,773,600	
ミライト・ワン	16,500	1,824.00	30,096,000	
タマホーム	3,100	3,505.00	10,865,500	
サンヨーホームズ	500	721.00	360,500	
日本アクア	1,600	887.00	1,419,200	
ファーストコーポレーション	1,000	737.00	737,000	
ベステラ	800	1,086.00	868,800	
Robot Home	8,400	196.00	1,646,400	
キャンディル	700	604.00	422,800	
ダイセキ環境ソリューション	800	1,338.00	1,070,400	
第一カッター興業	1,300	1,441.00	1,873,300	
安藤・間	28,900	1,120.00	32,368,000	
東急建設	14,200	760.00	10,792,000	

コムシスホールディングス	15,900	2,811.00	44,694,900	
ピーアールホールディングス	7,900	399.00	3,152,100	
高松コンストラクショングループ	3,200	2,672.00	8,550,400	
東建コーポレーション	1,400	7,420.00	10,388,000	
ソネック	400	973.00	389,200	
ヤマウラ	2,500	1,155.00	2,887,500	
オリエンタル白石	17,900	306.00	5,477,400	
大成建設	32,600	5,408.00	176,300,800	
大林組	124,800	1,311.00	163,612,800	
清水建設	98,900	957.90	94,736,310	
飛島建設	3,900	1,370.00	5,343,000	
長谷工コーポレーション	36,000	1,833.00	65,988,000	
松井建設	3,300	769.00	2,537,700	
銭高組	300	3,165.00	949,500	
鹿島建設	77,300	2,229.00	172,301,700	
不動テトラ	2,400	1,874.00	4,497,600	
大末建設	1,000	1,376.00	1,376,000	
鉄建建設	2,500	2,046.00	5,115,000	
西松建設	5,900	3,709.00	21,883,100	
三井住友建設	28,100	373.00	10,481,300	
大豊建設	1,400	3,945.00	5,523,000	
佐田建設	1,700	480.00	816,000	
ナカノフドー建設	1,900	398.00	756,200	
奥村組	5,700	4,200.00	23,940,000	
東鉄工業	4,800	2,727.00	13,089,600	
イチケン	600	2,048.00	1,228,800	
富士ピー・エス	1,200	447.00	536,400	
浅沼組	2,800	3,470.00	9,716,000	
戸田建設	42,900	779.80	33,453,420	
熊谷組	5,800	3,180.00	18,444,000	
北野建設	500	3,105.00	1,552,500	
植木組	800	1,420.00	1,136,000	
矢作建設工業	4,700	1,334.00	6,269,800	
ピーエス三菱	4,400	780.00	3,432,000	
日本ハウスホールディングス	6,900	374.00	2,580,600	
新日本建設	4,900	1,261.00	6,178,900	

東亜道路工業	1,400	4,880.00	6,832,000	
日本道路	700	9,340.00	6,538,000	
東亜建設工業	3,000	3,145.00	9,435,000	
日本国土開発	9,900	611.00	6,048,900	
若築建設	1,600	3,205.00	5,128,000	
東洋建設	11,300	1,081.00	12,215,300	
五洋建設	49,500	762.70	37,753,650	
世紀東急工業	4,500	1,447.00	6,511,500	
福田組	1,300	4,840.00	6,292,000	
住友林業	26,900	3,424.00	92,105,600	
日本基礎技術	1,600	502.00	803,200	
巴コーポレーション	3,000	517.00	1,551,000	
大和ハウス工業	96,500	3,843.00	370,849,500	
ライト工業	6,500	2,038.00	13,247,000	
積水ハウス	105,800	2,930.00	309,994,000	
日特建設	3,300	1,108.00	3,656,400	
北陸電気工事	2,400	987.00	2,368,800	
ユアテック	7,700	889.00	6,845,300	
日本リーテック	3,100	1,460.00	4,526,000	
四電工	1,500	2,313.00	3,469,500	
中電工	5,400	2,386.00	12,884,400	
関電工	19,100	1,236.00	23,607,600	
きんでん	24,600	1,996.00	49,101,600	
東京エネシス	3,500	985.00	3,447,500	
トーエネック	1,200	3,725.00	4,470,000	
住友電設	3,300	3,205.00	10,576,500	
日本電設工業	5,700	2,131.00	12,146,700	
エクシオグループ	16,100	2,909.00	46,834,900	
新日本空調	1,900	2,363.00	4,489,700	
九電工	8,500	4,115.00	34,977,500	
三機工業	7,700	1,537.00	11,834,900	
日揮ホールディングス	34,500	1,972.50	68,051,250	
中外炉工業	1,100	2,081.00	2,289,100	
ヤマト	2,300	905.00	2,081,500	
太平電業	2,200	4,410.00	9,702,000	
高砂熱学工業	8,400	2,549.00	21,411,600	

三晃金属工業	300	4,525.00	1,357,500	
朝日工業社	1,400	2,450.00	3,430,000	
明星工業	6,000	988.00	5,928,000	
大気社	4,000	4,230.00	16,920,000	
ダイダン	2,300	2,980.00	6,854,000	
日比谷総合設備	3,000	2,235.00	6,705,000	
フィル・カンパニー	600	765.00	459,000	
テスホールディングス	7,500	608.00	4,560,000	
インフロニア・ホールディングス	36,600	1,371.50	50,196,900	
東洋エンジニアリング	4,600	666.00	3,063,600	
レイズネクスト	5,000	1,446.00	7,230,000	
ニッポン	9,400	1,847.00	17,361,800	
日清製粉グループ本社	32,400	1,720.50	55,744,200	
日東富士製粉	600	4,825.00	2,895,000	
昭和産業	3,100	2,701.00	8,373,100	
鳥越製粉	2,200	623.00	1,370,600	
中部飼料	4,800	1,086.00	5,212,800	
フィード・ワン	5,100	753.00	3,840,300	
東洋精糖	500	1,762.00	881,000	
日本甜菜製糖	2,000	1,921.00	3,842,000	
D M三井製糖ホールディングス	3,500	2,834.00	9,919,000	
塩水港精糖	3,200	217.00	694,400	
ウェルネオシュガー	1,800	2,075.00	3,735,000	
森永製菓	6,400	4,535.00	29,024,000	
中村屋	900	3,075.00	2,767,500	
江崎グリコ	10,000	3,772.00	37,720,000	
名糖産業	1,400	1,641.00	2,297,400	
井村屋グループ	1,900	2,245.00	4,265,500	
不二家	2,400	2,441.00	5,858,400	
山崎製パン	23,400	2,154.50	50,415,300	
第一屋製パン	500	389.00	194,500	
モロゾフ	1,100	3,785.00	4,163,500	
亀田製菓	2,200	4,345.00	9,559,000	
寿スピリッツ	3,700	11,030.00	40,811,000	
カルビー	16,000	2,735.00	43,760,000	
森永乳業	6,400	4,697.00	30,060,800	

六甲バター	2,600	1,322.00	3,437,200	
ヤクルト本社	25,000	8,811.00	220,275,000	
明治ホールディングス	42,900	3,333.00	142,985,700	
雪印メグミルク	8,500	1,980.00	16,830,000	
プリマハム	4,700	2,220.00	10,434,000	
日本ハム	13,700	4,082.00	55,923,400	
林兼産業	800	491.00	392,800	
丸大食品	3,500	1,518.00	5,313,000	
S Foods	3,900	3,345.00	13,045,500	
柿安本店	1,400	2,343.00	3,280,200	
伊藤ハム米久ホールディングス	26,800	722.00	19,349,600	
サッポロホールディングス	11,500	3,664.00	42,136,000	
アサヒグループホールディングス	80,900	5,662.00	458,055,800	
キリンホールディングス	158,000	2,091.00	330,378,000	
宝ホールディングス	23,900	1,222.00	29,205,800	
オエノンホールディングス	10,500	367.00	3,853,500	
養命酒製造	1,200	1,867.00	2,240,400	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	27,400	1,616.50	44,292,100	
サントリー食品インターナショナル	24,700	5,108.00	126,167,600	
ダイドーグループホールディングス	2,000	5,100.00	10,200,000	
伊藤園	11,900	4,075.00	48,492,500	
キーコーヒー	3,900	2,069.00	8,069,100	
ユニカフェ	900	915.00	823,500	
ジャパンフーズ	400	1,098.00	439,200	
日清オイリオグループ	4,900	3,740.00	18,326,000	
不二製油グループ本社	8,200	1,993.50	16,346,700	
かどや製油	300	3,455.00	1,036,500	
J - オイルミルズ	3,600	1,678.00	6,040,800	
キッコーマン	23,200	8,074.00	187,316,800	
味の素	84,600	5,591.00	472,998,600	
ブルドックソース	1,900	1,933.00	3,672,700	
キューピー	18,800	2,332.50	43,851,000	
ハウス食品グループ本社	10,700	3,357.00	35,919,900	
カゴメ	16,300	3,145.00	51,263,500	
焼津水産化学工業	1,100	819.00	900,900	

アリアケジャパン	3,100	5,087.00	15,769,700	
ピエトロ	400	1,819.00	727,600	
エバラ食品工業	900	2,929.00	2,636,100	
やまみ	300	1,344.00	403,200	
ニチレイ	16,000	3,185.00	50,960,000	
東洋水産	17,700	6,125.00	108,412,500	
イトアンドホールディングス	1,500	2,102.00	3,153,000	
大冷	300	1,978.00	593,400	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	2,200	1,081.00	2,378,200	
日清食品ホールディングス	12,300	11,705.00	143,971,500	
永谷園ホールディングス	1,700	2,151.00	3,656,700	
一正蒲鉾	1,200	734.00	880,800	
フジッコ	3,600	1,857.00	6,685,200	
ロック・フィールド	3,900	1,477.00	5,760,300	
日本たばこ産業	230,600	3,108.00	716,704,800	
ケンコーマヨネーズ	2,400	1,309.00	3,141,600	
わらべや日洋ホールディングス	2,600	2,747.00	7,142,200	
なとり	2,200	1,951.00	4,292,200	
イフジ産業	500	1,199.00	599,500	
ファーマフーズ	5,000	1,622.00	8,110,000	
ユーグレナ	22,600	891.00	20,136,600	
紀文食品	2,700	1,070.00	2,889,000	
ピクルスホールディングス	2,100	1,218.00	2,557,800	
ミヨシ油脂	1,000	1,033.00	1,033,000	
理研ビタミン	3,000	2,045.00	6,135,000	
片倉工業	3,300	1,634.00	5,392,200	
ゲンゼ	2,500	4,420.00	11,050,000	
東洋紡	15,400	1,061.50	16,347,100	
ユニチカ	10,700	232.00	2,482,400	
富士紡ホールディングス	1,400	3,395.00	4,753,000	
倉敷紡績	2,700	2,368.00	6,393,600	
シキボウ	1,500	1,034.00	1,551,000	
日本毛織	9,400	1,166.00	10,960,400	
ダイトウボウ	4,500	97.00	436,500	
トーア紡コーポレーション	1,100	479.00	526,900	
ダイドーリミテッド	4,000	270.00	1,080,000	



帝国繊維	4,000	1,699.00	6,796,000	
帝人	34,200	1,496.50	51,180,300	
東レ	238,700	794.80	189,718,760	
住江織物	600	2,325.00	1,395,000	
日本フェルト	1,500	420.00	630,000	
イチカワ	300	1,382.00	414,600	
日東製網	300	1,414.00	424,200	
アツギ	1,600	448.00	716,800	
ダイニック	700	781.00	546,700	
セーレン	6,900	2,430.00	16,767,000	
ソトー	900	762.00	685,800	
東海染工	300	1,090.00	327,000	
小松マテーレ	5,200	737.00	3,832,400	
ワコールホールディングス	6,500	3,024.00	19,656,000	
ホギメディカル	4,800	3,120.00	14,976,000	
クラウディアホールディングス	600	880.00	528,000	
T S Iホールディングス	12,000	726.00	8,712,000	
マツオカコーポレーション	800	1,278.00	1,022,400	
ワールド	4,600	1,762.00	8,105,200	
三陽商会	1,100	2,053.00	2,258,300	
ナイガイ	900	288.00	259,200	
オンワードホールディングス	23,100	563.00	13,005,300	
ルックホールディングス	800	2,699.00	2,159,200	
キムラタン	15,700	21.00	329,700	
ゴールドウイン	6,300	11,520.00	72,576,000	
デサント	6,100	4,075.00	24,857,500	
キング	1,200	640.00	768,000	
ヤマトインターナショナル	2,200	310.00	682,000	
特種東海製紙	1,600	3,275.00	5,240,000	
王子ホールディングス	148,400	551.60	81,857,440	
日本製紙	18,600	1,265.00	23,529,000	
三菱製紙	3,300	581.00	1,917,300	
北越コーポレーション	22,500	863.00	19,417,500	
中越パルプ工業	1,100	1,347.00	1,481,700	
巴川製紙所	900	710.00	639,000	
大王製紙	15,700	1,151.00	18,070,700	

阿波製紙	700	552.00	386,400
レンゴー	32,400	879.60	28,499,040
トモク	2,100	2,160.00	4,536,000
ザ・パック	2,600	3,235.00	8,411,000
北の達人コーポレーション	15,000	259.00	3,885,000
クラレ	56,600	1,406.50	79,607,900
旭化成	222,500	961.10	213,844,750
共和レザー	1,600	612.00	979,200
レゾナック・ホールディングス	34,400	2,333.50	80,272,400
住友化学	264,300	444.60	117,507,780
住友精化	1,500	4,640.00	6,960,000
日産化学	16,800	6,254.00	105,067,200
ラサ工業	1,400	2,136.00	2,990,400
クレハ	3,000	8,400.00	25,200,000
多木化学	1,400	4,165.00	5,831,000
テイカ	2,400	1,453.00	3,487,200
石原産業	6,400	1,364.00	8,729,600
片倉コープアグリ	600	1,265.00	759,000
日本曹達	3,800	5,170.00	19,646,000
東ソー	47,600	1,819.00	86,584,400
トクヤマ	11,500	2,369.50	27,249,250
セントラル硝子	5,700	3,065.00	17,470,500
東亜合成	17,900	1,296.00	23,198,400
大阪ソーダ	2,100	5,480.00	11,508,000
関東電化工業	6,900	930.00	6,417,000
デンカ	13,000	2,747.50	35,717,500
信越化学工業	296,200	4,563.00	1,351,560,600
日本カーバイド工業	1,100	1,501.00	1,651,100
堺化学工業	2,700	1,977.00	5,337,900
第一稀元素化学工業	3,200	979.00	3,132,800
エア・ウォーター	33,600	1,968.00	66,124,800
日本酸素ホールディングス	34,600	3,165.00	109,509,000
日本化学工業	1,200	1,937.00	2,324,400
東邦アセチレン	600	1,470.00	882,000
日本パーカライズニング	17,600	1,095.00	19,272,000
高圧ガス工業	5,200	765.00	3,978,000

チタン工業	300	1,393.00	417,900
四国化成ホールディングス	4,200	1,469.00	6,169,800
戸田工業	800	2,220.00	1,776,000
ステラ ケミファ	2,100	3,105.00	6,520,500
保土谷化学工業	1,000	3,395.00	3,395,000
日本触媒	5,400	5,423.00	29,284,200
大日精化工業	2,500	2,211.00	5,527,500
カネカ	8,100	4,155.00	33,655,500
三菱瓦斯化学	26,600	2,123.00	56,471,800
三井化学	29,400	4,044.00	118,893,600
J S R	33,300	4,055.00	135,031,500
東京応化工業	6,200	8,424.00	52,228,800
大阪有機化学工業	2,700	2,678.00	7,230,600
三菱ケミカルグループ	240,400	833.00	200,253,200
K Hネオケム	5,900	2,296.00	13,546,400
ダイセル	49,600	1,290.00	63,984,000
住友ベークライト	5,300	6,069.00	32,165,700
積水化学工業	72,200	2,060.50	148,768,100
日本ゼオン	21,400	1,338.50	28,643,900
アイカ工業	9,000	3,157.00	28,413,000
U B E	18,400	2,535.00	46,644,000
積水樹脂	4,900	2,205.00	10,804,500
タキロンシーアイ	7,800	576.00	4,492,800
旭有機材	2,400	4,295.00	10,308,000
ニチバン	2,200	2,030.00	4,466,000
リケンテクノス	7,700	673.00	5,182,100
大倉工業	1,700	2,272.00	3,862,400
積水化成成品工業	5,000	457.00	2,285,000
群栄化学工業	800	2,864.00	2,291,200
タイガースポリマー	1,300	690.00	897,000
ミライアル	800	1,557.00	1,245,600
ダイキアクシス	1,000	715.00	715,000
ダイキョーニシカワ	7,900	780.00	6,162,000
竹本容器	900	812.00	730,800
森六ホールディングス	1,800	2,101.00	3,781,800
恵和	2,300	1,123.00	2,582,900

日本化薬	27,200	1,256.50	34,176,800
カーリットホールディングス	3,200	812.00	2,598,400
日本精化	2,000	2,895.00	5,790,000
扶桑化学工業	3,300	4,495.00	14,833,500
トリケミカル研究所	4,800	2,556.00	12,268,800
A D E K A	12,400	2,794.50	34,651,800
日油	11,000	5,982.00	65,802,000
新日本理化	3,800	239.00	908,200
ハリマ化成グループ	1,900	890.00	1,691,000
花王	86,800	5,210.00	452,228,000
第一工業製薬	1,300	1,800.00	2,340,000
石原ケミカル	1,600	1,600.00	2,560,000
日華化学	1,100	840.00	924,000
ニイタカ	500	1,997.00	998,500
三洋化成工業	2,200	4,275.00	9,405,000
有機合成薬品工業	2,000	303.00	606,000
大日本塗料	4,300	939.00	4,037,700
日本ペイントホールディングス	157,700	1,222.00	192,709,400
関西ペイント	32,600	2,323.50	75,746,100
神東塗料	2,200	126.00	277,200
中国塗料	5,900	1,183.00	6,979,700
日本特殊塗料	1,800	1,130.00	2,034,000
藤倉化成	4,800	453.00	2,174,400
太陽ホールディングス	5,400	2,614.00	14,115,600
D I C	13,900	2,657.50	36,939,250
サカタインクス	7,900	1,225.00	9,677,500
東洋インキ S C ホールディングス	7,000	2,136.00	14,952,000
T & K T O K A	3,200	1,175.00	3,760,000
富士フイルムホールディングス	68,500	8,134.00	557,179,000
資生堂	74,500	6,172.00	459,814,000
ライオン	42,800	1,338.00	57,266,400
高砂香料工業	2,400	2,766.00	6,638,400
マンダム	7,700	1,382.00	10,641,400
ミルボン	5,300	4,939.00	26,176,700
ファンケル	15,600	2,451.00	38,235,600
コーセー	7,300	13,515.00	98,659,500

コタ	3,300	1,616.00	5,332,800	
シーボン	400	1,553.00	621,200	
ポーラ・オルビスホールディングス	18,300	2,021.00	36,984,300	
ノエビアホールディングス	3,200	5,410.00	17,312,000	
アジュバンホールディングス	700	930.00	651,000	
新日本製薬	2,000	1,424.00	2,848,000	
アクシージア	1,800	1,296.00	2,332,800	
エステー	2,800	1,510.00	4,228,000	
アグロ カネショウ	1,400	1,624.00	2,273,600	
コニシ	6,000	2,201.00	13,206,000	
長谷川香料	6,800	3,435.00	23,358,000	
星光PMC	1,400	571.00	799,400	
小林製薬	10,400	7,634.00	79,393,600	
荒川化学工業	3,000	1,014.00	3,042,000	
メック	2,900	3,415.00	9,903,500	
日本高純度化学	900	2,492.00	2,242,800	
タカラバイオ	9,600	1,772.00	17,011,200	
JCU	4,000	3,350.00	13,400,000	
新田ゼラチン	1,700	749.00	1,273,300	
OATアグリオ	1,100	2,047.00	2,251,700	
デクセリアルズ	9,700	3,250.00	31,525,000	
アース製薬	3,200	5,040.00	16,128,000	
北興化学工業	3,600	880.00	3,168,000	
大成ラミック	1,100	3,005.00	3,305,500	
クミアイ化学工業	14,200	1,082.00	15,364,400	
日本農薬	6,500	729.00	4,738,500	
アキレス	2,200	1,498.00	3,295,600	
有沢製作所	5,800	1,082.00	6,275,600	
日東電工	25,900	10,360.00	268,324,000	
レック	5,100	847.00	4,319,700	
三光合成	4,500	645.00	2,902,500	
きもと	4,000	194.00	776,000	
藤森工業	2,800	3,495.00	9,786,000	
前澤化成工業	2,300	1,534.00	3,528,200	
未来工業	1,300	2,775.00	3,607,500	
ウェーブロックホールディングス	800	605.00	484,000	

J S P	2,500	1,842.00	4,605,000
エフピコ	6,700	2,881.50	19,306,050
天馬	2,900	2,594.00	7,522,600
信越ポリマー	6,600	1,436.00	9,477,600
東リ	6,200	366.00	2,269,200
ニフコ	12,900	4,049.00	52,232,100
バルカー	3,000	3,795.00	11,385,000
ユニ・チャーム	74,300	5,217.00	387,623,100
ショーエイコーポレーション	800	599.00	479,200
協和キリン	43,100	2,708.50	116,736,350
武田薬品工業	315,700	4,373.00	1,380,556,100
アステラス製薬	337,000	2,080.00	700,960,000
住友ファーマ	26,500	662.20	17,548,300
塩野義製薬	45,000	5,880.00	264,600,000
わかもと製薬	2,600	235.00	611,000
日本新薬	8,400	5,680.00	47,712,000
中外製薬	111,700	3,992.00	445,906,400
科研製薬	6,100	3,502.00	21,362,200
エーザイ	43,400	8,994.00	390,339,600
ロート製薬	34,600	3,045.00	105,357,000
小野薬品工業	68,800	2,640.50	181,666,400
久光製薬	7,900	4,335.00	34,246,500
持田製薬	4,100	3,240.00	13,284,000
参天製薬	65,000	1,205.00	78,325,000
扶桑薬品工業	1,100	2,050.00	2,255,000
日本ケミファ	300	1,912.00	573,600
ツムラ	11,200	2,646.00	29,635,200
キッセイ薬品工業	5,500	2,994.00	16,467,000
生化学工業	6,800	755.00	5,134,000
栄研化学	5,800	1,583.00	9,181,400
鳥居薬品	1,900	3,550.00	6,745,000
J C R ファーマ	12,100	1,229.00	14,870,900
東和薬品	5,500	1,794.00	9,867,000
富士製薬工業	2,600	1,166.00	3,031,600
ゼリア新薬工業	4,900	2,340.00	11,466,000
そーせいグループ	12,300	1,794.00	22,066,200

第一三共	310,800	4,122.00	1,281,117,600	
杏林製薬	7,700	1,764.00	13,582,800	
大幸薬品	6,900	346.00	2,387,400	
ダイト	2,500	2,268.00	5,670,000	
大塚ホールディングス	81,600	5,245.00	427,992,000	
大正製薬ホールディングス	7,900	5,406.00	42,707,400	
ペプチドリーム	17,300	1,837.50	31,788,750	
あすか製薬ホールディングス	3,700	1,516.00	5,609,200	
サワイグループホールディングス	8,200	3,544.00	29,060,800	
日本コークス工業	32,200	113.00	3,638,600	
ニチレキ	4,200	2,081.00	8,740,200	
ユシロ化学工業	1,800	1,121.00	2,017,800	
ビーピー・カストロール	1,100	867.00	953,700	
富士石油	7,300	295.00	2,153,500	
MORESCO	900	1,192.00	1,072,800	
出光興産	39,600	3,018.00	119,512,800	
E N E O Sホールディングス	605,100	512.50	310,113,750	
コスモエネルギーホールディングス	14,100	4,314.00	60,827,400	
横浜ゴム	20,300	3,149.00	63,924,700	
TOYO TIRE	20,500	1,963.00	40,241,500	
ブリヂストン	113,900	5,836.00	664,720,400	
住友ゴム工業	35,000	1,460.00	51,100,000	
藤倉コンポジット	2,000	984.00	1,968,000	
オカモト	1,900	3,880.00	7,372,000	
フコク	1,900	1,610.00	3,059,000	
ニッタ	3,600	3,225.00	11,610,000	
住友理工	6,900	828.00	5,713,200	
三ツ星ベルト	5,200	4,440.00	23,088,000	
バンドー化学	5,700	1,441.00	8,213,700	
日東紡績	4,000	2,602.00	10,408,000	
A G C	36,300	5,080.00	184,404,000	
日本板硝子	18,200	647.00	11,775,400	
石塚硝子	400	1,625.00	650,000	
日本山村硝子	1,000	1,115.00	1,115,000	
日本電気硝子	14,600	2,572.50	37,558,500	
オハラ	1,700	1,391.00	2,364,700	

住友大阪セメント	5,000	3,896.00	19,480,000
太平洋セメント	22,700	2,875.00	65,262,500
日本ヒューム	3,100	757.00	2,346,700
日本コンクリート工業	6,900	336.00	2,318,400
三谷セキサン	1,500	4,600.00	6,900,000
アジアパイルホールディングス	5,600	620.00	3,472,000
東海カーボン	29,900	1,233.50	36,881,650
日本カーボン	2,000	4,275.00	8,550,000
東洋炭素	2,200	5,310.00	11,682,000
ノリタケカンパニーリミテド	1,800	5,410.00	9,738,000
T O T O	23,500	4,350.00	102,225,000
日本碍子	41,500	1,721.00	71,421,500
日本特殊陶業	27,200	2,991.00	81,355,200
ダントーホールディングス	2,000	737.00	1,474,000
M A R U W A	1,300	22,240.00	28,912,000
品川リフラクトリーズ	1,000	6,020.00	6,020,000
黒崎播磨	700	9,680.00	6,776,000
ヨータイ	1,900	1,513.00	2,874,700
東京窯業	2,500	348.00	870,000
ニッカトー	1,200	672.00	806,400
フジミインコーポレーテッド	8,500	3,460.00	29,410,000
クニミネ工業	800	1,048.00	838,400
エーアンドエーマテリアル	500	1,143.00	571,500
ニチアス	9,000	2,909.00	26,181,000
ニチハ	4,500	3,270.00	14,715,000
日本製鉄	164,300	3,180.00	522,474,000
神戸製鋼所	73,800	1,463.50	108,006,300
中山製鋼所	7,600	903.00	6,862,800
合同製鐵	1,800	3,935.00	7,083,000
J F Eホールディングス	98,100	2,204.00	216,212,400
東京製鐵	10,300	1,687.00	17,376,100
共英製鋼	4,200	2,184.00	9,172,800
大和工業	6,100	6,381.00	38,924,100
東京鐵鋼	1,700	3,360.00	5,712,000
大阪製鐵	1,700	1,501.00	2,551,700
淀川製鋼所	4,200	3,345.00	14,049,000



中部鋼鈹	3,000	2,042.00	6,126,000
丸一鋼管	11,200	3,329.00	37,284,800
モリ工業	700	3,495.00	2,446,500
大同特殊鋼	4,600	6,231.00	28,662,600
日本高周波鋼業	1,000	361.00	361,000
日本冶金工業	2,700	4,255.00	11,488,500
山陽特殊製鋼	3,600	2,717.00	9,781,200
愛知製鋼	2,100	3,500.00	7,350,000
日本金属	600	961.00	576,600
大平洋金属	2,600	1,587.00	4,126,200
新日本電工	21,900	286.00	6,263,400
栗本鐵工所	1,700	2,476.00	4,209,200
虹技	300	1,298.00	389,400
日本鑄鉄管	300	1,170.00	351,000
三菱製鋼	2,300	1,656.00	3,808,800
日垂鋼業	2,900	328.00	951,200
日本精線	500	4,925.00	2,462,500
エンピプロ・ホールディングス	2,000	568.00	1,136,000
シンニッタン	3,000	253.00	759,000
新家工業	600	2,511.00	1,506,600
大紀アルミニウム工業所	5,200	1,557.00	8,096,400
日本軽金属ホールディングス	9,900	1,472.00	14,572,800
三井金属鉱業	10,700	3,298.00	35,288,600
東邦亜鉛	2,200	1,743.00	3,834,600
三菱マテリアル	24,500	2,547.50	62,413,750
住友金属鉱山	42,500	4,917.00	208,972,500
D O W Aホールディングス	8,200	4,527.00	37,121,400
古河機械金属	5,400	1,648.00	8,899,200
エス・サイエンス	17,100	24.00	410,400
大阪チタニウムテクノロジーズ	5,400	3,295.00	17,793,000
東邦チタニウム	6,600	1,879.00	12,401,400
U A C J	5,100	2,751.00	14,030,100
C Kサンエツ	900	4,205.00	3,784,500
古河電気工業	12,200	2,752.00	33,574,400
住友電気工業	126,700	1,817.50	230,277,250
フジクラ	39,400	1,187.50	46,787,500

SWCC	4,100	1,954.00	8,011,400
タツタ電線	5,400	714.00	3,855,600
カナレ電気	400	1,488.00	595,200
平河ヒューテック	2,100	1,693.00	3,555,300
リョービ	3,900	2,885.00	11,251,500
アーレスティ	3,200	748.00	2,393,600
AREホールディングス	14,800	1,928.00	28,534,400
稲葉製作所	1,900	1,594.00	3,028,600
宮地エンジニアリンググループ	1,000	4,330.00	4,330,000
トーカロ	9,800	1,433.00	14,043,400
アルファC o	1,000	1,256.00	1,256,000
SUMCO	69,900	2,049.50	143,260,050
川田テクノロジーズ	900	5,770.00	5,193,000
RS Technologies	2,400	2,979.00	7,149,600
ジェイテックコーポレーション	400	2,396.00	958,400
信和	1,600	785.00	1,256,000
東洋製罐グループホールディングス	21,900	2,246.50	49,198,350
ホッカンホールディングス	2,000	1,390.00	2,780,000
コロナ	2,000	915.00	1,830,000
横河ブリッジホールディングス	4,600	2,579.00	11,863,400
駒井ハルテック	500	1,976.00	988,000
高田機工	200	2,823.00	564,600
三和ホールディングス	33,800	1,900.00	64,220,000
文化シャッター	10,600	1,076.00	11,405,600
三協立山	4,200	920.00	3,864,000
アルインコ	2,800	1,095.00	3,066,000
東洋シャッター	700	657.00	459,900
LIXIL	53,500	1,905.00	101,917,500
日本ファイルコン	1,900	471.00	894,900
ノーリツ	5,400	1,718.00	9,277,200
長府製作所	3,700	2,550.00	9,435,000
リンナイ	20,000	3,112.00	62,240,000
ダイニチ工業	1,400	745.00	1,043,000
日東精工	5,300	611.00	3,238,300
三洋工業	300	1,972.00	591,600
岡部	5,900	748.00	4,413,200

ジーテクト	4,100	1,854.00	7,601,400
東プレ	6,500	1,639.00	10,653,500
高周波熱錬	5,700	1,035.00	5,899,500
東京製綱	2,200	1,290.00	2,838,000
サンコール	2,500	535.00	1,337,500
モリテック スチール	2,100	321.00	674,100
パイオラックス	5,100	2,232.00	11,383,200
エイチワン	3,800	828.00	3,146,400
日本発條	32,500	1,118.50	36,351,250
中央発條	2,700	703.00	1,898,100
アドバネクス	300	985.00	295,500
立川ブラインド工業	1,700	1,248.00	2,121,600
三益半導体工業	2,800	2,915.00	8,162,000
日本ドライケミカル	700	1,702.00	1,191,400
日本製鋼所	9,900	2,982.50	29,526,750
三浦工業	15,000	3,609.00	54,135,000
タクマ	11,000	1,539.00	16,929,000
ツガミ	8,000	1,277.00	10,216,000
オークマ	3,600	7,428.00	26,740,800
芝浦機械	3,600	4,610.00	16,596,000
アマダ	57,300	1,401.50	80,305,950
アイダエンジニアリング	7,400	997.00	7,377,800
TAKISAWA	700	2,531.00	1,771,700
FUJI	15,600	2,647.50	41,301,000
牧野フライス製作所	4,000	5,790.00	23,160,000
オーエスジー	17,100	1,885.00	32,233,500
ダイジェット工業	300	932.00	279,600
旭ダイヤモンド工業	10,000	910.00	9,100,000
D M G 森精機	21,800	2,456.00	53,540,800
ソディック	9,500	747.00	7,096,500
ディスコ	17,300	24,660.00	426,618,000
日東工器	1,700	1,904.00	3,236,800
日進工具	3,000	1,136.00	3,408,000
パンチ工業	2,500	476.00	1,190,000
富士ダイス	1,300	674.00	876,200
豊和工業	1,500	818.00	1,227,000

石川製作所	700	1,369.00	958,300
東洋機械金属	1,900	690.00	1,311,000
津田駒工業	500	413.00	206,500
エンシュウ	600	838.00	502,800
島精機製作所	5,700	1,892.00	10,784,400
オプトラン	5,300	2,322.00	12,306,600
NCホールディングス	600	2,179.00	1,307,400
イワキポンプ	2,400	1,440.00	3,456,000
フリュー	3,800	1,446.00	5,494,800
ヤマシンフィルタ	8,600	301.00	2,588,600
日阪製作所	3,500	932.00	3,262,000
やまびこ	5,900	1,552.00	9,156,800
野村マイクロ・サイエンス	1,200	6,280.00	7,536,000
平田機工	1,700	8,000.00	13,600,000
PEGASUS	4,000	577.00	2,308,000
マルマエ	1,600	1,754.00	2,806,400
タツモ	2,000	2,293.00	4,586,000
ナブテスコ	22,500	3,091.00	69,547,500
三井海洋開発	4,500	1,524.00	6,858,000
レオン自動機	3,800	1,455.00	5,529,000
SMC	11,600	74,610.00	865,476,000
ホソカワミクロン	2,300	3,490.00	8,027,000
ユニオンツール	1,600	3,315.00	5,304,000
瑞光	2,600	1,209.00	3,143,400
オイレス工業	5,000	1,932.00	9,660,000
日精エー・エス・ビー機械	1,400	4,040.00	5,656,000
サトーホールディングス	5,100	1,973.00	10,062,300
技研製作所	3,400	2,089.00	7,102,600
日本エアテック	1,800	1,265.00	2,277,000
カワタ	800	1,209.00	967,200
日精樹脂工業	2,700	1,004.00	2,710,800
オカダアイヨン	900	2,215.00	1,993,500
ワイエイシイホールディングス	1,200	2,770.00	3,324,000
小松製作所	168,300	3,956.00	665,794,800
住友重機械工業	21,300	3,485.00	74,230,500
日立建機	14,300	4,284.00	61,261,200

日工	5,300	671.00	3,556,300
巴工業	1,500	2,868.00	4,302,000
井関農機	3,400	1,275.00	4,335,000
TOWA	3,700	2,378.00	8,798,600
丸山製作所	500	2,006.00	1,003,000
北川鉄工所	1,400	1,203.00	1,684,200
ローツェ	1,900	10,000.00	19,000,000
タカキタ	800	490.00	392,000
クボタ	190,100	2,115.50	402,156,550
荏原実業	1,700	2,976.00	5,059,200
三菱化工機	1,200	2,724.00	3,268,800
月島ホールディングス	4,900	1,271.00	6,227,900
帝国電機製作所	2,500	2,664.00	6,660,000
東京機械製作所	700	461.00	322,700
新東工業	7,300	1,082.00	7,898,600
澁谷工業	3,400	2,600.00	8,840,000
アイチ コーポレーション	5,000	891.00	4,455,000
小森コーポレーション	8,300	1,114.00	9,246,200
鶴見製作所	2,700	2,579.00	6,963,300
日本ギア工業	900	354.00	318,600
酒井重工業	400	5,210.00	2,084,000
荏原製作所	14,700	6,852.00	100,724,400
石井鐵工所	300	2,677.00	803,100
西島製作所	3,100	1,904.00	5,902,400
北越工業	3,600	1,531.00	5,511,600
ダイキン工業	42,900	28,910.00	1,240,239,000
オルガノ	4,900	4,100.00	20,090,000
トーヨーカネツ	1,400	3,675.00	5,145,000
栗田工業	20,100	5,569.00	111,936,900
椿本チエイン	5,100	3,845.00	19,609,500
大同工業	1,100	755.00	830,500
木村化工機	2,700	725.00	1,957,500
アネスト岩田	6,100	1,163.00	7,094,300
ダイフク	55,600	3,033.00	168,634,800
サムコ	1,000	5,200.00	5,200,000
加藤製作所	1,300	1,209.00	1,571,700

油研工業	400	2,085.00	834,000
タダノ	18,900	1,128.50	21,328,650
フジテック	12,600	3,625.00	45,675,000
C K D	9,900	2,164.00	21,423,600
平和	11,900	2,408.00	28,655,200
理想科学工業	2,900	2,348.00	6,809,200
S A N K Y O	7,100	5,819.00	41,314,900
日本金銭機械	3,900	1,130.00	4,407,000
マースグループホールディングス	2,100	2,857.00	5,999,700
フクシマガリレイ	2,600	4,895.00	12,727,000
オーイズミ	1,000	512.00	512,000
ダイコク電機	2,000	3,935.00	7,870,000
竹内製作所	6,500	4,645.00	30,192,500
アマノ	10,200	2,965.00	30,243,000
J U K I	5,600	582.00	3,259,200
サンデン	4,100	194.00	795,400
ジャノメ	3,600	653.00	2,350,800
マックス	4,400	2,608.00	11,475,200
グローリー	8,600	2,844.00	24,458,400
新晃工業	3,600	1,923.00	6,922,800
大和冷機工業	5,500	1,439.00	7,914,500
セガサミーホールディングス	28,900	3,028.00	87,509,200
日本ピストンリング	900	1,696.00	1,526,400
リケン	1,400	3,310.00	4,634,000
T P R	4,100	1,788.00	7,330,800
ツバキ・ナカシマ	8,900	816.00	7,262,400
ホシザキ	23,100	5,203.00	120,189,300
大豊工業	3,100	957.00	2,966,700
日本精工	66,000	916.50	60,489,000
N T N	70,800	317.00	22,443,600
ジェイテクト	32,000	1,358.00	43,456,000
不二越	2,700	3,855.00	10,408,500
日本トムソン	8,800	589.00	5,183,200
T H K	20,700	2,911.50	60,268,050
ユーシン精機	2,800	709.00	1,985,200
前澤給装工業	2,500	1,157.00	2,892,500

イーグル工業	4,000	1,783.00	7,132,000
前澤工業	1,600	906.00	1,449,600
日本ピラー工業	3,300	4,450.00	14,685,000
キット	13,200	1,041.00	13,741,200
マキタ	44,700	4,033.00	180,275,100
三井E & S	17,000	497.00	8,449,000
日立造船	29,400	919.00	27,018,600
三菱重工業	62,800	6,669.00	418,813,200
I H I	22,600	3,730.00	84,298,000
サノヤスホールディングス	3,700	142.00	525,400
スター精密	6,800	1,764.00	11,995,200
日清紡ホールディングス	29,200	1,213.50	35,434,200
イビデン	20,600	8,611.00	177,386,600
コニカミノルタ	80,200	512.80	41,126,560
ブラザー工業	48,000	2,223.50	106,728,000
ミネベアミツミ	62,500	2,693.00	168,312,500
日立製作所	174,700	8,886.00	1,552,384,200
東芝	69,100	4,540.00	313,714,000
三菱電機	371,300	2,101.00	780,101,300
富士電機	21,800	6,067.00	132,260,600
東洋電機製造	900	971.00	873,900
安川電機	42,600	6,355.00	270,723,000
シンフォニアテクノロジー	4,000	1,777.00	7,108,000
明電舎	5,500	2,037.00	11,203,500
オリジン	600	1,310.00	786,000
山洋電気	1,600	7,480.00	11,968,000
デンヨー	2,700	2,123.00	5,732,100
P H Cホールディングス	5,000	1,491.00	7,455,000
ソシオネクスト	5,000	15,520.00	77,600,000
東芝テック	5,400	3,975.00	21,465,000
芝浦メカトロニクス	600	23,990.00	14,394,000
マブチモーター	8,900	3,971.00	35,341,900
ニデック	87,400	8,362.00	730,838,800
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	2,600	525.00	1,365,000
トレックス・セミコンダクター	1,700	2,376.00	4,039,200
東光高岳	2,200	2,125.00	4,675,000

ダブル・スコープ	11,800	1,460.00	17,228,000	
ダイヘン	3,200	5,470.00	17,504,000	
ヤーマン	6,200	1,011.00	6,268,200	
JVCケンウッド	32,700	488.00	15,957,600	
ミマキエンジニアリング	3,400	960.00	3,264,000	
I - P E X	2,000	1,315.00	2,630,000	
大崎電気工業	8,500	553.00	4,700,500	
オムロン	32,900	8,496.00	279,518,400	
日東工業	4,800	3,635.00	17,448,000	
I D E C	5,300	3,045.00	16,138,500	
正興電機製作所	1,100	1,032.00	1,135,200	
不二電機工業	600	1,185.00	711,000	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	11,800	2,850.00	33,630,000	
サクサホールディングス	600	2,152.00	1,291,200	
メルコホールディングス	900	3,185.00	2,866,500	
テクノメディカ	900	2,097.00	1,887,300	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	1,200	887.00	1,064,400	
日本電気	50,800	6,869.00	348,945,200	
富士通	35,800	18,435.00	659,973,000	
沖電気工業	16,200	881.00	14,272,200	
岩崎通信機	1,200	794.00	952,800	
電気興業	1,400	2,392.00	3,348,800	
サンケン電気	3,300	13,530.00	44,649,000	
ナカヨ	400	1,179.00	471,600	
アイホン	2,200	2,477.00	5,449,400	
ルネサスエレクトロニクス	234,400	2,696.50	632,059,600	
セイコーエプソン	46,100	2,280.50	105,131,050	
ワコム	27,300	619.00	16,898,700	
アルバック	8,500	6,039.00	51,331,500	
アクセル	1,000	1,579.00	1,579,000	
E I Z O	2,600	4,785.00	12,441,000	
ジャパンディスプレイ	137,900	38.00	5,240,200	
日本信号	8,200	1,031.00	8,454,200	
京三製作所	7,500	512.00	3,840,000	
能美防災	4,900	1,703.00	8,344,700	



ホーチキ	2,700	1,791.00	4,835,700	
星和電機	1,100	526.00	578,600	
エレコム	8,600	1,505.00	12,943,000	
パナソニック ホールディングス	424,300	1,756.50	745,282,950	
シャープ	43,300	804.40	34,830,520	
アンリツ	25,300	1,238.50	31,334,050	
富士通ゼネラル	10,200	3,305.00	33,711,000	
ソニーグループ	251,600	13,155.00	3,309,798,000	
T D K	56,900	5,418.00	308,284,200	
帝国通信工業	1,600	1,650.00	2,640,000	
タムラ製作所	15,400	622.00	9,578,800	
アルプスアルパイン	32,100	1,247.50	40,044,750	
池上通信機	900	721.00	648,900	
日本電波工業	4,300	1,205.00	5,181,500	
鈴木	1,900	930.00	1,767,000	
メイコー	3,900	2,727.00	10,635,300	
日本トリム	800	3,220.00	2,576,000	
ローランド ディー . ジー .	2,000	3,540.00	7,080,000	
フォスター電機	3,300	924.00	3,049,200	
S M K	900	2,516.00	2,264,400	
ヨコオ	2,900	1,859.00	5,391,100	
ティアック	4,300	119.00	511,700	
ホシデン	8,400	1,806.00	15,170,400	
ヒロセ電機	5,800	18,300.00	106,140,000	
日本航空電子工業	7,400	2,932.00	21,696,800	
T O A	4,100	977.00	4,005,700	
マクセル	7,300	1,562.00	11,402,600	
古野電気	4,700	1,238.00	5,818,600	
スミダコーポレーション	3,800	1,465.00	5,567,000	
アイコム	1,400	2,863.00	4,008,200	
リオン	1,500	1,979.00	2,968,500	
横河電機	39,300	2,664.50	104,714,850	
新電元工業	1,400	3,280.00	4,592,000	
アズビル	24,800	4,502.00	111,649,600	
東亜ディーケーケー	1,300	846.00	1,099,800	
日本光電工業	16,400	3,719.00	60,991,600	

チノー	1,500	2,262.00	3,393,000	
共和電業	2,600	358.00	930,800	
日本電子材料	2,400	1,754.00	4,209,600	
堀場製作所	7,900	8,078.00	63,816,200	
アドバンテスト	28,000	20,505.00	574,140,000	
小野測器	1,000	449.00	449,000	
エスベック	2,800	2,331.00	6,526,800	
キーエンス	35,600	66,230.00	2,357,788,000	
日置電機	1,900	8,110.00	15,409,000	
シスメックス	30,700	9,566.00	293,676,200	
日本マイクロニクス	5,900	2,119.00	12,502,100	
メガチップス	2,900	4,105.00	11,904,500	
OBARA GROUP	1,900	4,110.00	7,809,000	
澤藤電機	300	1,219.00	365,700	
原田工業	1,200	822.00	986,400	
コーセル	4,300	1,250.00	5,375,000	
イリソ電子工業	3,300	3,915.00	12,919,500	
オブテックスグループ	6,500	1,863.00	12,109,500	
千代田インテグレ	1,200	2,457.00	2,948,400	
レーザーテック	16,300	20,655.00	336,676,500	
スタンレー電気	25,300	2,744.50	69,435,850	
ウシオ電機	18,100	1,962.00	35,512,200	
岡谷電機産業	2,100	280.00	588,000	
ヘリオス テクノ ホールディング	2,500	490.00	1,225,000	
エノモト	700	1,783.00	1,248,100	
日本セラミック	3,600	2,537.00	9,133,200	
遠藤照明	1,200	1,315.00	1,578,000	
古河電池	2,600	1,017.00	2,644,200	
双信電機	1,100	357.00	392,700	
山一電機	2,900	2,283.00	6,620,700	
図研	3,100	3,940.00	12,214,000	
日本電子	8,900	4,844.00	43,111,600	
カシオ計算機	26,500	1,197.00	31,720,500	
ファナック	173,400	4,768.00	826,771,200	
日本シイエムケイ	7,600	515.00	3,914,000	
エンプラス	1,000	5,310.00	5,310,000	

大真空	4,300	641.00	2,756,300	
ローム	16,400	13,170.00	215,988,000	
浜松ホトニクス	28,500	6,815.00	194,227,500	
三井ハイテック	3,700	9,380.00	34,706,000	
新光電気工業	12,600	5,724.00	72,122,400	
京セラ	55,200	7,606.00	419,851,200	
太陽誘電	17,300	4,355.00	75,341,500	
村田製作所	107,900	8,259.00	891,146,100	
双葉電子工業	6,800	495.00	3,366,000	
北陸電気工業	1,000	1,270.00	1,270,000	
ニチコン	7,300	1,465.00	10,694,500	
日本ケミコン	3,500	1,399.00	4,896,500	
K O A	5,400	1,865.00	10,071,000	
市光工業	5,100	537.00	2,738,700	
小糸製作所	42,800	2,656.50	113,698,200	
ミツバ	6,700	843.00	5,648,100	
S C R E E Nホールディングス	6,100	15,265.00	93,116,500	
キャノン電子	3,900	1,891.00	7,374,900	
キャノン	195,100	3,760.00	733,576,000	
リコー	89,200	1,255.00	111,946,000	
象印マホービン	10,600	1,975.00	20,935,000	
M U T O Hホールディングス	400	1,790.00	716,000	
東京エレクトロン	75,300	19,665.00	1,480,774,500	
イノテック	2,400	1,667.00	4,000,800	
トヨタ紡織	15,000	2,618.50	39,277,500	
芦森工業	500	2,075.00	1,037,500	
ユニプレス	6,400	1,142.00	7,308,800	
豊田自動織機	26,000	10,445.00	271,570,000	
モリタホールディングス	6,200	1,554.00	9,634,800	
三櫻工業	5,400	873.00	4,714,200	
デンソー	73,400	9,734.00	714,475,600	
東海理化電機製作所	10,000	2,181.00	21,810,000	
川崎重工業	26,800	3,653.00	97,900,400	
名村造船所	7,100	586.00	4,160,600	
日本車輛製造	1,400	2,048.00	2,867,200	
三菱ロジスネクスト	5,700	1,309.00	7,461,300	

近畿車輛	400	1,640.00	656,000	
日産自動車	505,300	665.00	336,024,500	
いすゞ自動車	103,400	1,861.00	192,427,400	
トヨタ自動車	1,953,100	2,344.50	4,579,042,950	
日野自動車	45,900	631.40	28,981,260	
三菱自動車工業	138,800	584.20	81,086,960	
エフテック	1,900	947.00	1,799,300	
レシップホールディングス	1,100	544.00	598,400	
G M B	500	1,398.00	699,000	
ファルテック	400	609.00	243,600	
武蔵精密工業	8,700	1,789.00	15,564,300	
日産車体	6,300	982.00	6,186,600	
新明和工業	11,200	1,411.00	15,803,200	
極東開発工業	5,900	1,829.00	10,791,100	
トピー工業	2,900	2,453.00	7,113,700	
ティラド	900	1,877.00	1,689,300	
曙ブレーキ工業	21,700	143.00	3,103,100	
タチエス	5,600	1,564.00	8,758,400	
N O K	13,800	2,131.00	29,407,800	
フタバ産業	9,500	597.00	5,671,500	
K Y B	3,400	5,050.00	17,170,000	
大同メタル工業	7,000	538.00	3,766,000	
プレス工業	15,900	639.00	10,160,100	
ミクニ	3,200	528.00	1,689,600	
太平洋工業	8,200	1,373.00	11,258,600	
河西工業	3,600	171.00	615,600	
アイシン	27,400	4,708.00	128,999,200	
マツダ	117,700	1,450.50	170,723,850	
今仙電機製作所	1,700	611.00	1,038,700	
本田技研工業	289,100	4,481.00	1,295,457,100	
スズキ	65,300	5,578.00	364,243,400	
S U B A R U	112,500	2,721.00	306,112,500	
安永	1,200	945.00	1,134,000	
ヤマハ発動機	55,900	4,163.00	232,711,700	
T B K	2,700	424.00	1,144,800	
エクセディ	5,800	2,485.00	14,413,000	

豊田合成	10,400	2,855.00	29,692,000
愛三工業	5,900	1,164.00	6,867,600
盟和産業	400	1,015.00	406,000
日本プラスト	2,200	462.00	1,016,400
ヨロズ	3,300	950.00	3,135,000
エフ・シー・シー	6,300	1,860.00	11,718,000
シマノ	14,400	23,630.00	340,272,000
テイ・エス テック	16,300	1,840.00	29,992,000
ジャムコ	1,500	1,573.00	2,359,500
テルモ	109,400	4,448.00	486,611,200
クリエートメディック	900	886.00	797,400
日機装	8,300	913.00	7,577,900
日本エム・ディ・エム	2,100	971.00	2,039,100
島津製作所	43,300	4,343.00	188,051,900
JMS	3,300	582.00	1,920,600
クボテック	600	300.00	180,000
長野計器	2,600	2,080.00	5,408,000
ブイ・テクノロジー	1,700	2,438.00	4,144,600
東京計器	2,700	1,311.00	3,539,700
愛知時計電機	1,400	1,548.00	2,167,200
インターアクション	1,700	1,139.00	1,936,300
オーバル	2,400	394.00	945,600
東京精密	7,800	7,470.00	58,266,000
マニー	14,200	1,866.50	26,504,300
ニコン	51,400	1,828.50	93,984,900
トプコン	18,700	2,053.50	38,400,450
オリンパス	218,900	2,287.00	500,624,300
理研計器	2,200	5,350.00	11,770,000
タムロン	2,700	4,370.00	11,799,000
HOYA	75,400	15,845.00	1,194,713,000
シード	1,400	598.00	837,200
ノーリツ鋼機	3,400	2,461.00	8,367,400
A & D ホロンホールディングス	5,200	1,838.00	9,557,600
朝日インテック	39,700	2,845.50	112,966,350
シチズン時計	39,100	904.00	35,346,400
リズム	900	1,558.00	1,402,200

大研医器	2,100	513.00	1,077,300	
メニコン	12,200	2,491.00	30,390,200	
シンシア	300	583.00	174,900	
松風	1,600	2,349.00	3,758,400	
セイコーグループ	5,500	2,617.00	14,393,500	
ニプロ	29,600	1,031.50	30,532,400	
K Y O R I T S U	4,100	181.00	742,100	
中本パックス	800	1,627.00	1,301,600	
スノーピーク	6,100	1,737.00	10,595,700	
パラマウントベッドホールディングス	8,200	2,306.00	18,909,200	
トランザクション	2,300	1,801.00	4,142,300	
粧美堂	700	416.00	291,200	
ニホンフラッシュ	3,300	968.00	3,194,400	
前田工織	3,000	3,110.00	9,330,000	
永大産業	2,900	218.00	632,200	
アートネイチャー	3,700	793.00	2,934,100	
バンダイナムコホールディングス	97,400	3,120.00	303,888,000	
アイフィスジャパン	800	612.00	489,600	
S H O E I	8,000	2,540.00	20,320,000	
フランスベッドホールディングス	4,100	1,185.00	4,858,500	
パイロットコーポレーション	5,600	4,532.00	25,379,200	
萩原工業	2,400	1,543.00	3,703,200	
フジシールインターナショナル	7,200	1,542.00	11,102,400	
タカラトミー	16,400	1,874.00	30,733,600	
広済堂ホールディングス	1,900	2,290.00	4,351,000	
エステールホールディングス	600	621.00	372,600	
タカノ	1,000	832.00	832,000	
プロネクサス	2,900	1,047.00	3,036,300	
ホクシン	2,000	136.00	272,000	
ウッドワン	900	1,190.00	1,071,000	
大建工業	2,200	2,325.00	5,115,000	
凸版印刷	43,700	3,241.00	141,631,700	
大日本印刷	38,900	4,024.00	156,533,600	
共同印刷	1,000	3,205.00	3,205,000	
N I S S H A	6,800	1,693.00	11,512,400	
光村印刷	200	1,239.00	247,800	

TAKARA & COMPANY	2,300	2,316.00	5,326,800	
アシックス	32,800	4,282.00	140,449,600	
ツツミ	600	2,204.00	1,322,400	
ローランド	2,600	4,100.00	10,660,000	
小松ウオール工業	1,300	2,745.00	3,568,500	
ヤマハ	22,400	5,351.00	119,862,400	
河合楽器製作所	1,000	3,510.00	3,510,000	
クリナップ	4,000	727.00	2,908,000	
ピジョン	22,700	1,910.50	43,368,350	
キングジム	3,100	880.00	2,728,000	
リンテック	7,100	2,313.50	16,425,850	
イトーキ	7,300	1,083.00	7,905,900	
任天堂	224,600	6,443.00	1,447,097,800	
三菱鉛筆	5,100	1,638.00	8,353,800	
タカラスタANDARD	6,600	1,862.00	12,289,200	
コクヨ	17,100	2,033.00	34,764,300	
ナカバヤシ	3,800	510.00	1,938,000	
グローブライド	2,900	2,233.00	6,475,700	
オカムラ	10,700	1,965.00	21,025,500	
美津濃	3,500	3,705.00	12,967,500	
東京電力ホールディングス	320,600	523.80	167,930,280	
中部電力	131,100	1,729.00	226,671,900	
関西電力	137,300	1,801.00	247,277,300	
中国電力	56,600	991.80	56,135,880	
北陸電力	33,600	830.60	27,908,160	
東北電力	87,000	899.80	78,282,600	
四国電力	30,400	1,006.50	30,597,600	
九州電力	82,000	923.10	75,694,200	
北海道電力	34,400	573.70	19,735,280	
沖縄電力	8,300	1,179.00	9,785,700	
電源開発	26,800	2,208.00	59,174,400	
エフオン	2,300	557.00	1,281,100	
イーレックス	6,300	1,128.00	7,106,400	
レノバ	9,500	1,517.00	14,411,500	
東京瓦斯	75,200	3,187.00	239,662,400	
大阪瓦斯	72,000	2,184.50	157,284,000	

東邦瓦斯	14,000	2,470.00	34,580,000
北海道瓦斯	2,100	2,360.00	4,956,000
広島ガス	7,500	377.00	2,827,500
西部ガスホールディングス	3,300	2,048.00	6,758,400
静岡ガス	8,100	1,067.00	8,642,700
メタウォーター	4,300	1,798.00	7,731,400
SBSホールディングス	3,200	3,340.00	10,688,000
東武鉄道	39,100	3,650.00	142,715,000
相鉄ホールディングス	11,700	2,487.50	29,103,750
東急	99,700	1,719.50	171,434,150
京浜急行電鉄	40,300	1,319.50	53,175,850
小田急電鉄	53,900	1,914.50	103,191,550
京王電鉄	18,800	4,453.00	83,716,400
京成電鉄	22,900	5,807.00	132,980,300
富士急行	4,400	5,450.00	23,980,000
東日本旅客鉄道	60,300	7,882.00	475,284,600
西日本旅客鉄道	45,400	5,728.00	260,051,200
東海旅客鉄道	27,400	17,750.00	486,350,000
西武ホールディングス	43,000	1,504.50	64,693,500
鴻池運輸	6,100	1,793.00	10,937,300
西日本鉄道	9,500	2,474.50	23,507,750
ハマキョウレックス	2,800	3,855.00	10,794,000
サカイ引越センター	1,700	5,120.00	8,704,000
近鉄グループホールディングス	35,500	4,639.00	164,684,500
阪急阪神ホールディングス	47,400	4,617.00	218,845,800
南海電気鉄道	17,000	2,985.50	50,753,500
京阪ホールディングス	19,600	3,791.00	74,303,600
神戸電鉄	1,000	3,015.00	3,015,000
名古屋鉄道	39,200	2,215.00	86,828,000
山陽電気鉄道	2,700	2,185.00	5,899,500
アルプス物流	2,800	1,575.00	4,410,000
ヤマトホールディングス	45,500	2,668.50	121,416,750
山九	9,000	4,846.00	43,614,000
丸運	1,300	241.00	313,300
丸全昭和運輸	2,200	4,130.00	9,086,000
センコーグループホールディングス	18,800	1,032.00	19,401,600



トナミホールディングス	800	5,040.00	4,032,000	
ニッコンホールディングス	11,400	2,937.00	33,481,800	
日本石油輸送	300	2,847.00	854,100	
福山通運	2,700	4,080.00	11,016,000	
セイノーホールディングス	22,100	2,167.00	47,890,700	
エスライングループ本社	800	857.00	685,600	
神奈川中央交通	1,000	3,180.00	3,180,000	
A Z - C O M丸和ホールディングス	8,600	1,965.00	16,899,000	
C & F ロジホールディングス	3,400	1,319.00	4,484,600	
九州旅客鉄道	25,100	3,062.00	76,856,200	
S Gホールディングス	68,100	2,163.00	147,300,300	
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	13,300	8,272.00	110,017,600	
日本郵船	95,000	3,451.00	327,845,000	
商船三井	62,600	3,730.00	233,498,000	
川崎汽船	26,700	4,264.00	113,848,800	
N Sユナイテッド海運	1,900	3,640.00	6,916,000	
明治海運	2,700	598.00	1,614,600	
飯野海運	13,000	893.00	11,609,000	
共栄タンカー	500	870.00	435,000	
乾汽船	4,500	1,288.00	5,796,000	
日本航空	87,200	3,074.00	268,052,800	
A N Aホールディングス	96,600	3,400.00	328,440,000	
パスコ	500	1,845.00	922,500	
トランコム	1,000	6,930.00	6,930,000	
日新	2,700	2,585.00	6,979,500	
三菱倉庫	7,600	3,517.00	26,729,200	
三井倉庫ホールディングス	3,300	3,580.00	11,814,000	
住友倉庫	9,600	2,436.00	23,385,600	
澁澤倉庫	1,400	2,950.00	4,130,000	
東陽倉庫	3,600	274.00	986,400	
日本トランスシティ	7,100	638.00	4,529,800	
ケイヒン	500	1,810.00	905,000	
中央倉庫	1,700	1,103.00	1,875,100	
川西倉庫	500	1,039.00	519,500	
安田倉庫	2,400	1,012.00	2,428,800	

ファイブホールディングス	500	1,197.00	598,500	
東洋埠頭	800	1,404.00	1,123,200	
上組	17,000	3,241.00	55,097,000	
サンリツ	600	740.00	444,000	
キムラユニティー	1,300	1,312.00	1,705,600	
キューソー流通システム	1,700	932.00	1,584,400	
東海運	1,600	291.00	465,600	
エーアイティー	2,200	1,851.00	4,072,200	
内外トランスライン	1,300	2,687.00	3,493,100	
日本コンセプト	1,100	2,013.00	2,214,300	
N E C ネットズエスアイ	11,900	1,922.00	22,871,800	
クロスキャット	2,000	1,122.00	2,244,000	
システナ	60,000	287.00	17,220,000	
デジタルアーツ	2,300	5,360.00	12,328,000	
日鉄ソリューションズ	6,100	3,940.00	24,034,000	
キューブシステム	2,100	1,196.00	2,511,600	
コア	1,600	1,750.00	2,800,000	
手間いらず	600	3,750.00	2,250,000	
ラクーンホールディングス	3,000	697.00	2,091,000	
ソリトンシステムズ	1,800	1,226.00	2,206,800	
ソフトクリエイイトホールディングス	2,900	1,670.00	4,843,000	
T I S	39,000	3,479.00	135,681,000	
J N S ホールディングス	1,300	439.00	570,700	
グリー	9,600	626.00	6,009,600	
G M O ペパボ	500	1,717.00	858,500	
コーエーテクモホールディングス	22,400	2,363.00	52,931,200	
三菱総合研究所	1,700	5,290.00	8,993,000	
ボルテージ	800	310.00	248,000	
電算	300	1,593.00	477,900	
A G S	1,200	766.00	919,200	
ファインデックス	2,800	609.00	1,705,200	
ブレインパッド	2,700	933.00	2,519,100	
K L a b	7,100	308.00	2,186,800	
ポルトウウィンホールディングス	6,100	698.00	4,257,800	
ネクソン	90,900	2,657.00	241,521,300	
アイスタイル	10,400	492.00	5,116,800	

エムアップホールディングス	4,400	1,150.00	5,060,000	
エイチーム	2,100	708.00	1,486,800	
エニグモ	4,500	375.00	1,687,500	
テクノスジャパン	2,300	630.00	1,449,000	
e n i s h	2,100	319.00	669,900	
コロプラ	13,800	660.00	9,108,000	
オルトプラス	2,300	234.00	538,200	
ブロードリーフ	20,800	440.00	9,152,000	
クロス・マーケティンググループ	1,700	825.00	1,402,500	
デジタルハーツホールディングス	2,200	1,450.00	3,190,000	
システム情報	2,800	735.00	2,058,000	
メディアドゥ	1,400	1,320.00	1,848,000	
じげん	10,400	752.00	7,820,800	
ブイキューブ	4,300	449.00	1,930,700	
エンカレッジ・テクノロジー	600	513.00	307,800	
サイバーリンクス	900	708.00	637,200	
ディー・エル・イー	2,000	255.00	510,000	
フィックスターズ	4,000	1,424.00	5,696,000	
C A R T A H O L D I N G S	1,700	1,231.00	2,092,700	
オブティム	2,900	956.00	2,772,400	
セレス	1,400	1,026.00	1,436,400	
S H I F T	2,400	31,990.00	76,776,000	
ティーガイア	3,700	1,779.00	6,582,300	
セック	400	2,975.00	1,190,000	
テクマトリックス	6,500	1,748.00	11,362,000	
プロシップ	1,600	1,360.00	2,176,000	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	10,400	2,739.50	28,490,800	
G M O ペイメントゲートウェイ	7,100	10,685.00	75,863,500	
ザッパラス	800	373.00	298,400	
システムリサーチ	1,100	2,566.00	2,822,600	
インターネットイニシアティブ	19,500	2,582.00	50,349,000	
さくらインターネット	4,000	1,059.00	4,236,000	
ヴィンクス	800	1,286.00	1,028,800	
G M O グローバルサイン・ホールディングス	1,100	2,954.00	3,249,400	
S R A ホールディングス	1,800	3,170.00	5,706,000	
システムインテグレータ	800	426.00	340,800	

朝日ネット	3,800	653.00	2,481,400	
e B A S E	5,000	716.00	3,580,000	
アバントグループ	4,500	1,444.00	6,498,000	
アドソル日進	1,500	1,635.00	2,452,500	
ODKソリューションズ	600	571.00	342,600	
フリービット	1,900	1,234.00	2,344,600	
コムチュア	4,700	2,020.00	9,494,000	
サイバーコム	400	1,443.00	577,200	
アステリア	2,800	845.00	2,366,000	
アイル	1,700	2,647.00	4,499,900	
マークライنز	1,900	2,715.00	5,158,500	
メディカル・データ・ビジョン	5,300	678.00	3,593,400	
g u m i	5,300	701.00	3,715,300	
ショーケース	600	374.00	224,400	
モバイルファクトリー	600	847.00	508,200	
テラスカイ	1,500	2,051.00	3,076,500	
デジタル・インフォメーション・テクノロ ジー	2,100	1,776.00	3,729,600	
P C Iホールディングス	1,100	1,128.00	1,240,800	
アイピーシー	400	583.00	233,200	
ネオジャパン	1,200	1,036.00	1,243,200	
P R T I M E S	900	1,565.00	1,408,500	
ラクス	16,900	2,431.50	41,092,350	
ランドコンピュータ	700	1,243.00	870,100	
ダブルスタンダード	1,400	2,376.00	3,326,400	
オープンドア	2,500	1,209.00	3,022,500	
マイネット	900	338.00	304,200	
アカツキ	1,700	2,096.00	3,563,200	
ベネフィットジャパン	200	1,254.00	250,800	
U b i c o mホールディングス	1,100	1,393.00	1,532,300	
カナミックネットワーク	3,800	459.00	1,744,200	
ノムラシステムコーポレーション	2,500	117.00	292,500	
チェンジホールディングス	8,700	1,849.00	16,086,300	
シンクロ・フード	1,800	700.00	1,260,000	
オークネット	1,800	1,726.00	3,106,800	
キャピタル・アセット・プランニング	500	799.00	399,500	

セグエグループ	800	1,109.00	887,200	
エイトレッド	400	1,407.00	562,800	
マクロミル	7,000	789.00	5,523,000	
ビーグリー	500	1,117.00	558,500	
オロ	1,100	1,900.00	2,090,000	
ユーザーローカル	1,300	2,264.00	2,943,200	
テモナ	600	285.00	171,000	
ニーズウェル	1,500	751.00	1,126,500	
マネーフォワード	8,600	5,548.00	47,712,800	
サインポスト	1,100	463.00	509,300	
Sun Asterisk	2,500	1,106.00	2,765,000	
電算システムホールディングス	1,700	3,165.00	5,380,500	
Appier Group	13,500	1,639.00	22,126,500	
ソルクシーズ	2,200	425.00	935,000	
フェイス	800	508.00	406,400	
プロトコーポレーション	4,500	1,224.00	5,508,000	
ハイマックス	1,100	1,412.00	1,553,200	
野村総合研究所	71,100	3,866.00	274,872,600	
サイバネットシステム	3,000	804.00	2,412,000	
CEホールディングス	1,400	619.00	866,600	
日本システム技術	1,200	2,390.00	2,868,000	
インテージホールディングス	4,000	1,650.00	6,600,000	
東邦システムサイエンス	800	1,226.00	980,800	
ソースネクスト	18,100	192.00	3,475,200	
インフォコム	4,600	2,261.00	10,400,600	
シンプレクス・ホールディングス	6,100	2,541.00	15,500,100	
HEROZ	1,200	1,843.00	2,211,600	
ラクスル	8,600	1,447.00	12,444,200	
メルカリ	21,500	3,580.00	76,970,000	
I P S	1,200	2,303.00	2,763,600	
F I G	3,200	282.00	902,400	
システムサポート	1,400	1,965.00	2,751,000	
イーソル	2,300	838.00	1,927,400	
アルテリア・ネットワークス	2,700	1,979.00	5,343,300	
東海ソフト	400	1,093.00	437,200	
ウイングアーク1st	3,700	2,618.00	9,686,600	

ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	1,000	1,516.00	1,516,000	
サーバーワークス	700	3,110.00	2,177,000	
東名	200	2,762.00	552,400	
ヴィッツ	300	1,176.00	352,800	
トピラシステムズ	700	918.00	642,600	
Sansan	11,700	1,513.00	17,702,100	
Link-U	700	911.00	637,700	
ギフトィ	3,900	1,641.00	6,399,900	
メドレー	4,800	4,840.00	23,232,000	
ベース	1,200	5,310.00	6,372,000	
JMDC	5,900	5,392.00	31,812,800	
フォーカスシステムズ	2,600	1,028.00	2,672,800	
クレスコ	2,800	2,037.00	5,703,600	
フジ・メディア・ホールディングス	34,300	1,567.00	53,748,100	
オービック	11,900	22,985.00	273,521,500	
ジャストシステム	5,100	4,195.00	21,394,500	
TDCソフト	3,000	1,891.00	5,673,000	
Zホールディングス	507,700	391.60	198,815,320	
トレンドマイクロ	20,600	6,514.00	134,188,400	
IDホールディングス	2,400	1,284.00	3,081,600	
日本オラクル	6,800	10,250.00	69,700,000	
アルファシステムズ	1,100	3,335.00	3,668,500	
フューチャー	8,900	1,786.00	15,895,400	
CAC Holdings	2,200	1,696.00	3,731,200	
SBテクノロジー	1,500	2,640.00	3,960,000	
トーセ	800	752.00	601,600	
オービックビジネスコンサルタント	7,000	5,360.00	37,520,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	19,200	3,503.00	67,257,600	
アイティフォー	4,700	1,096.00	5,151,200	
東計電算	500	6,190.00	3,095,000	
エクスネット	400	1,021.00	408,400	
大塚商会	20,200	5,542.00	111,948,400	
サイボウズ	4,900	2,296.00	11,250,400	
電通国際情報サービス	4,300	5,040.00	21,672,000	
ACCESS	4,200	904.00	3,796,800	

デジタルガレージ	6,300	4,025.00	25,357,500	
EMシステムズ	5,900	860.00	5,074,000	
ウェザーニューズ	1,100	6,320.00	6,952,000	
C I J	5,900	536.00	3,162,400	
ビジネスエンジニアリング	600	2,997.00	1,798,200	
日本エンタープライズ	2,900	140.00	406,000	
WOWOW	2,700	1,152.00	3,110,400	
スカラ	3,300	751.00	2,478,300	
インテリジェント ウェイブ	1,500	802.00	1,203,000	
I M A G I C A G R O U P	3,000	664.00	1,992,000	
ネットワンシステムズ	13,300	3,013.00	40,072,900	
システムソフト	12,200	82.00	1,000,400	
アルゴグラフィックス	3,300	3,560.00	11,748,000	
マーベラス	5,800	682.00	3,955,600	
エイベックス	6,100	1,504.00	9,174,400	
B I P R O G Y	13,100	3,377.00	44,238,700	
都築電気	1,900	1,969.00	3,741,100	
T B S ホールディングス	18,300	2,625.00	48,037,500	
日本テレビホールディングス	31,600	1,350.00	42,660,000	
朝日放送グループホールディングス	3,300	682.00	2,250,600	
テレビ朝日ホールディングス	8,700	1,772.00	15,416,400	
スカパー J S A T ホールディングス	31,600	589.00	18,612,400	
テレビ東京ホールディングス	2,600	3,445.00	8,957,000	
日本BS放送	1,000	940.00	940,000	
ビジョン	4,700	1,669.00	7,844,300	
スマートバリュー	700	383.00	268,100	
U S E N - N E X T H O L D I N G S	4,000	3,390.00	13,560,000	
ワイヤレスゲート	1,200	225.00	270,000	
日本通信	32,900	233.00	7,665,700	
クロップス	400	990.00	396,000	
日本電信電話	11,427,400	163.00	1,862,666,200	
K D D I	275,700	4,299.00	1,185,234,300	
ソフトバンク	573,300	1,542.00	884,028,600	
光通信	4,200	20,720.00	87,024,000	
エムティーアイ	2,400	560.00	1,344,000	
G M O インターネットグループ	13,200	2,746.50	36,253,800	

ファイバーゲート	1,900	1,391.00	2,642,900	
アйдママーケティングコミュニケーション	600	275.00	165,000	
KADOKAWA	18,900	3,438.00	64,978,200	
学研ホールディングス	5,900	886.00	5,227,400	
ゼンリン	6,100	943.00	5,752,300	
昭文社ホールディングス	1,200	314.00	376,800	
インプレスホールディングス	2,400	215.00	516,000	
アイネット	2,200	1,624.00	3,572,800	
松竹	2,000	10,845.00	21,690,000	
東宝	22,300	5,488.00	122,382,400	
東映	1,000	17,330.00	17,330,000	
NTTデータグループ	111,900	1,965.50	219,939,450	
ピー・シー・エー	2,000	1,510.00	3,020,000	
ビジネスブレイン太田昭和	1,500	2,197.00	3,295,500	
DTS	7,600	3,340.00	25,384,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	17,900	6,328.00	113,271,200	
シーイーシー	5,000	1,722.00	8,610,000	
カブコン	35,400	5,683.00	201,178,200	
アイ・エス・ビー	1,800	1,552.00	2,793,600	
ジャステック	2,200	1,353.00	2,976,600	
SCSK	29,100	2,184.00	63,554,400	
NSW	1,400	2,438.00	3,413,200	
アイネス	2,500	1,493.00	3,732,500	
TKC	5,700	3,715.00	21,175,500	
富士ソフト	8,100	4,595.00	37,219,500	
NSD	12,700	2,734.00	34,721,800	
コナミグループ	15,300	7,588.00	116,096,400	
福井コンピュータホールディングス	2,500	2,632.00	6,580,000	
JBCホールディングス	2,600	2,515.00	6,539,000	
ミロク情報サービス	3,200	1,646.00	5,267,200	
ソフトバンクグループ	176,000	6,966.00	1,226,016,000	
高千穂交易	1,000	3,115.00	3,115,000	
オルバヘルスケアホールディングス	400	1,764.00	705,600	
伊藤忠食品	800	5,140.00	4,112,000	
エレマテック	3,400	1,819.00	6,184,600	
あらた	2,900	4,850.00	14,065,000	



トーメンデバイス	500	4,960.00	2,480,000	
東京エレクトロン デバイス	1,400	10,080.00	14,112,000	
円谷フィールズホールディングス	6,500	2,970.00	19,305,000	
双日	37,500	3,307.00	124,012,500	
アルフレッサ ホールディングス	37,800	2,179.00	82,366,200	
横浜冷凍	10,200	1,202.00	12,260,400	
神栄	400	1,072.00	428,800	
ラサ商事	1,300	1,476.00	1,918,800	
アルコニックス	4,900	1,426.00	6,987,400	
神戸物産	29,100	3,684.00	107,204,400	
ハイパー	600	453.00	271,800	
あい ホールディングス	6,000	2,256.00	13,536,000	
ディーブイエックス	800	863.00	690,400	
ダイワボウホールディングス	15,400	2,695.00	41,503,000	
マクニカホールディングス	8,900	5,880.00	52,332,000	
ラクト・ジャパン	1,500	1,963.00	2,944,500	
グリムス	1,600	2,672.00	4,275,200	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	5,500	967.00	5,318,500	
八洲電機	3,000	1,360.00	4,080,000	
メディアスホールディングス	2,400	803.00	1,927,200	
レスターホールディングス	3,600	2,351.00	8,463,600	
ジュテックホールディングス	700	1,210.00	847,000	
大光	1,200	583.00	699,600	
OCHIホールディングス	700	1,342.00	939,400	
TOKAIホールディングス	18,600	893.00	16,609,800	
黒谷	800	618.00	494,400	
Cominix	600	875.00	525,000	
三洋貿易	4,200	1,350.00	5,670,000	
ビューティガレージ	600	4,590.00	2,754,000	
ウイン・パートナーズ	2,700	1,078.00	2,910,600	
ミタチ産業	700	1,091.00	763,700	
シップヘルスケアホールディングス	13,500	2,277.00	30,739,500	
明治電機工業	1,400	1,523.00	2,132,200	
デリカフーズホールディングス	1,100	600.00	660,000	
スターティアホールディングス	600	1,231.00	738,600	
コメダホールディングス	9,200	2,730.00	25,116,000	

ピーバンドットコム	400	460.00	184,000
アセンテック	1,300	663.00	861,900
富士興産	700	1,686.00	1,180,200
協栄産業	300	2,022.00	606,600
フルサト・マルカホールディングス	3,700	2,559.00	9,468,300
ヤマエグループホールディングス	2,100	3,230.00	6,783,000
小野建	3,700	1,695.00	6,271,500
南陽	600	2,159.00	1,295,400
佐島電機	1,800	1,492.00	2,685,600
エコートレーディング	600	1,178.00	706,800
伯東	2,200	5,570.00	12,254,000
コンドーテック	2,900	1,224.00	3,549,600
中山福	1,500	347.00	520,500
ナガイレーベン	4,800	2,274.00	10,915,200
三菱食品	3,500	3,720.00	13,020,000
松田産業	2,900	2,303.00	6,678,700
第一興商	14,600	2,831.50	41,339,900
メディバルホールディングス	36,000	2,410.00	86,760,000
S P K	1,700	1,805.00	3,068,500
萩原電気ホールディングス	1,500	3,220.00	4,830,000
アズワン	5,400	5,488.00	29,635,200
スズデン	1,300	2,198.00	2,857,400
尾家産業	700	1,329.00	930,300
シモジマ	2,600	1,069.00	2,779,400
ドウシシャ	4,000	2,267.00	9,068,000
小津産業	600	1,587.00	952,200
高速	2,000	2,049.00	4,098,000
たけびし	1,400	1,738.00	2,433,200
リックス	600	3,140.00	1,884,000
丸文	3,400	1,217.00	4,137,800
ハピネット	3,200	2,172.00	6,950,400
橋本総業ホールディングス	1,500	1,230.00	1,845,000
日本ライフライン	11,000	988.00	10,868,000
タカショー	3,300	669.00	2,207,700
I D O M	11,400	815.00	9,291,000
進和	2,300	2,216.00	5,096,800

エスケイジャパン	700	672.00	470,400
ダイترون	1,500	3,070.00	4,605,000
シークス	5,400	1,514.00	8,175,600
田中商事	800	653.00	522,400
オーハシテクニカ	1,800	1,582.00	2,847,600
白銅	1,400	2,370.00	3,318,000
ダイコー通産	300	1,130.00	339,000
伊藤忠商事	231,900	5,622.00	1,303,741,800
丸紅	293,700	2,454.00	720,739,800
高島	500	3,585.00	1,792,500
長瀬産業	17,300	2,412.00	41,727,600
蝶理	2,000	3,020.00	6,040,000
豊田通商	33,000	7,589.00	250,437,000
三共生興	5,400	637.00	3,439,800
兼松	14,600	2,073.00	30,265,800
ツカモトコーポレーション	400	1,301.00	520,400
三井物産	267,100	5,412.00	1,445,545,200
日本紙パルプ商事	2,000	4,550.00	9,100,000
カメイ	4,000	1,492.00	5,968,000
東都水産	100	6,500.00	650,000
OUGホールディングス	400	2,459.00	983,600
スターゼン	2,900	2,346.00	6,803,400
山善	10,100	1,174.00	11,857,400
椿本興業	600	4,585.00	2,751,000
住友商事	233,100	3,015.00	702,796,500
内田洋行	1,500	5,250.00	7,875,000
三菱商事	229,400	7,153.00	1,640,898,200
第一実業	1,300	5,390.00	7,007,000
キャノンマーケティングジャパン	8,700	3,695.00	32,146,500
西華産業	1,500	1,997.00	2,995,500
佐藤商事	2,600	1,501.00	3,902,600
菱洋エレクトロ	3,200	3,615.00	11,568,000
東京産業	3,400	869.00	2,954,600
ユアサ商事	3,200	4,570.00	14,624,000
神鋼商事	900	5,900.00	5,310,000
トルク	1,500	248.00	372,000

阪和興業	6,800	4,850.00	32,980,000	
正栄食品工業	2,500	4,255.00	10,637,500	
カナデン	2,500	1,349.00	3,372,500	
R Y O D E N	3,000	2,151.00	6,453,000	
岩谷産業	8,600	7,384.00	63,502,400	
ナイス	800	1,523.00	1,218,400	
ニチモウ	400	4,030.00	1,612,000	
極東貿易	2,200	1,778.00	3,911,600	
アステナホールディングス	6,500	445.00	2,892,500	
三愛オブリ	9,900	1,588.00	15,721,200	
稲畑産業	7,600	3,305.00	25,118,000	
G S I クレオス	2,200	2,027.00	4,459,400	
明和産業	5,000	685.00	3,425,000	
クワザワホールディングス	900	550.00	495,000	
ワキタ	6,900	1,277.00	8,811,300	
東邦ホールディングス	9,400	2,766.50	26,005,100	
サンゲツ	9,400	2,583.00	24,280,200	
ミツウロコグループホールディングス	4,800	1,356.00	6,508,800	
シナネンホールディングス	1,200	3,840.00	4,608,000	
伊藤忠エネクス	9,300	1,366.00	12,703,800	
サンリオ	10,700	6,089.00	65,152,300	
サンワテクノス	1,900	2,350.00	4,465,000	
リョーサン	4,000	4,420.00	17,680,000	
新光商事	5,100	1,137.00	5,798,700	
トーホー	1,600	2,612.00	4,179,200	
三信電気	1,500	2,145.00	3,217,500	
東陽テクニカ	3,800	1,391.00	5,285,800	
モスフードサービス	5,500	3,235.00	17,792,500	
加賀電子	3,100	6,310.00	19,561,000	
ソーダニッカ	2,100	841.00	1,766,100	
立花エレテック	2,700	2,725.00	7,357,500	
フォーバル	1,500	1,213.00	1,819,500	
P A L T A C	5,900	4,765.00	28,113,500	
三谷産業	6,600	324.00	2,138,400	
太平洋興発	1,000	774.00	774,000	
西本W i s m e t t a cホールディングス	1,000	4,575.00	4,575,000	

ヤマシタヘルスケアホールディングス	200	2,034.00	406,800	
コア商事ホールディングス	2,100	692.00	1,453,200	
K P Pグループホールディングス	8,800	615.00	5,412,000	
ヤマタネ	1,700	1,819.00	3,092,300	
丸紅建材リース	300	2,451.00	735,300	
泉州電業	1,900	3,850.00	7,315,000	
トラスコ中山	7,900	2,164.00	17,095,600	
オートバックスセブン	13,100	1,556.50	20,390,150	
モリト	2,700	1,152.00	3,110,400	
加藤産業	4,700	3,825.00	17,977,500	
北恵	700	795.00	556,500	
イエローハット	6,600	1,845.00	12,177,000	
J Kホールディングス	2,900	1,010.00	2,929,000	
日伝	2,200	2,422.00	5,328,400	
北沢産業	1,500	342.00	513,000	
杉本商事	1,700	2,120.00	3,604,000	
因幡電機産業	9,800	3,150.00	30,870,000	
東テク	1,300	5,280.00	6,864,000	
ミスミグループ本社	56,800	2,724.50	154,751,600	
アルテック	1,600	259.00	414,400	
タキヒヨー	700	1,209.00	846,300	
蔵王産業	500	2,458.00	1,229,000	
スズケン	11,000	4,102.00	45,122,000	
ジェコス	2,200	888.00	1,953,600	
グローセル	3,500	421.00	1,473,500	
ローソン	9,300	6,927.00	64,421,100	
サンエー	2,900	4,690.00	13,601,000	
カワチ薬品	2,900	2,176.00	6,310,400	
エービーシー・マート	5,500	7,734.00	42,537,000	
ハードオフコーポレーション	1,200	1,523.00	1,827,600	
アスクル	7,800	1,982.00	15,459,600	
ゲオホールディングス	3,700	1,922.00	7,111,400	
アダストリア	4,500	2,836.00	12,762,000	
ジーフット	2,000	285.00	570,000	
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	400	820.00	328,000	
くら寿司	4,400	3,065.00	13,486,000	

キャンドウ	1,300	2,654.00	3,450,200	
I Kホールディングス	900	372.00	334,800	
パルグループホールディングス	3,700	4,000.00	14,800,000	
エディオン	14,900	1,460.00	21,754,000	
サーラコーポレーション	7,900	734.00	5,798,600	
ワッツ	1,400	640.00	896,000	
ハローズ	1,700	3,655.00	6,213,500	
フジオフードグループ本社	4,200	1,409.00	5,917,800	
あみやき亭	900	3,410.00	3,069,000	
ひらまつ	6,200	249.00	1,543,800	
大黒天物産	1,200	6,070.00	7,284,000	
ハニーズホールディングス	3,000	1,614.00	4,842,000	
ファーマライズホールディングス	600	620.00	372,000	
アルペン	3,100	1,948.00	6,038,800	
ハブ	1,000	882.00	882,000	
クオールホールディングス	5,200	1,676.00	8,715,200	
ジinzホールディングス	2,200	3,560.00	7,832,000	
ビックカメラ	20,000	1,071.00	21,420,000	
D C Mホールディングス	21,900	1,205.00	26,389,500	
ペッパーフードサービス	9,300	118.00	1,097,400	
Monotaro	53,300	1,779.00	94,820,700	
東京一番フーズ	700	510.00	357,000	
DDグループ	1,900	1,558.00	2,960,200	
きちりホールディングス	700	856.00	599,200	
アークランドサービスホールディングス	3,100	3,050.00	9,455,000	
J . フロント リテイリング	46,800	1,364.50	63,858,600	
ドトール・日レスホールディングス	6,700	2,227.00	14,920,900	
マツキヨココカラ & カンパニー	22,800	8,061.00	183,790,800	
ブロンコビリー	2,000	2,938.00	5,876,000	
Z O Z O	24,900	2,771.50	69,010,350	
トレジャー・ファクトリー	1,800	1,403.00	2,525,400	
物語コーポレーション	6,300	3,535.00	22,270,500	
三越伊勢丹ホールディングス	63,400	1,479.50	93,800,300	
H a m e e	1,300	1,053.00	1,368,900	
マーケットエンタープライズ	300	1,517.00	455,100	
ウエルシアホールディングス	19,500	2,693.50	52,523,250	

クリエイトSDホールディングス	6,200	3,455.00	21,421,000	
丸善CHIホールディングス	3,400	356.00	1,210,400	
ミサワ	500	615.00	307,500	
ティーライフ	400	1,577.00	630,800	
エー・ピーホールディングス	600	877.00	526,200	
チムニー	900	1,343.00	1,208,700	
シュッピン	2,800	1,052.00	2,945,600	
オイシックス・ラ・大地	5,100	2,298.00	11,719,800	
ネクステージ	8,600	3,645.00	31,347,000	
ジョイフル本田	10,900	1,635.00	17,821,500	
鳥貴族ホールディングス	1,400	2,576.00	3,606,400	
ホットランド	2,900	1,699.00	4,927,100	
すかいらーくホールディングス	51,400	1,807.00	92,879,800	
SFPホールディングス	2,100	2,228.00	4,678,800	
綿半ホールディングス	2,900	1,370.00	3,973,000	
ヨシックスホールディングス	600	2,611.00	1,566,600	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	12,300	1,111.00	13,665,300	
ゴルフダイジェスト・オンライン	1,700	788.00	1,339,600	
B E E N O S	1,600	1,946.00	3,113,600	
あさひ	3,100	1,250.00	3,875,000	
日本調剤	2,600	1,200.00	3,120,000	
コスモス薬品	3,700	15,805.00	58,478,500	
トーエル	1,300	754.00	980,200	
セブン&アイ・ホールディングス	129,700	5,884.00	763,154,800	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	28,300	1,091.00	30,875,300	
ツルハホールディングス	7,900	10,490.00	82,871,000	
サンマルクホールディングス	3,000	1,921.00	5,763,000	
フェリシモ	700	1,006.00	704,200	
トリドールホールディングス	9,400	3,345.00	31,443,000	
T O K Y O B A S E	3,900	343.00	1,337,700	
ウイルプラスホールディングス	500	1,162.00	581,000	
J Mホールディングス	2,800	1,946.00	5,448,800	
サツドラホールディングス	1,300	759.00	986,700	
アレンザホールディングス	2,800	1,008.00	2,822,400	
串カツ田中ホールディングス	1,000	1,520.00	1,520,000	

パロックジャパンリミテッド	2,400	903.00	2,167,200	
クスリのアオキホールディングス	3,400	7,869.00	26,754,600	
力の源ホールディングス	1,700	2,105.00	3,578,500	
FOOD & LIFE COMPANIES	20,100	2,629.00	52,842,900	
メディカルシステムネットワーク	3,300	374.00	1,234,200	
一家ホールディングス	700	704.00	492,800	
ジャパンクラフトホールディングス	1,700	244.00	414,800	
はるやまホールディングス	1,200	510.00	612,000	
ノジマ	12,300	1,391.00	17,109,300	
カップ・クリエイト	5,900	1,525.00	8,997,500	
ライトオン	2,200	592.00	1,302,400	
良品計画	41,100	1,796.00	73,815,600	
パリミキホールディングス	3,600	326.00	1,173,600	
アドヴァングループ	3,600	995.00	3,582,000	
アルビス	1,200	2,441.00	2,929,200	
コナカ	3,200	399.00	1,276,800	
ハウス オブ ローゼ	400	1,606.00	642,400	
G - 7ホールディングス	4,700	1,246.00	5,856,200	
イオン北海道	5,600	861.00	4,821,600	
コジマ	6,200	643.00	3,986,600	
ヒマラヤ	900	958.00	862,200	
コーナン商事	5,100	3,455.00	17,620,500	
エコス	1,400	2,030.00	2,842,000	
ワタミ	4,500	893.00	4,018,500	
マルシェ	900	256.00	230,400	
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	76,000	2,718.00	206,568,000	
西松屋チェーン	8,300	1,708.00	14,176,400	
ゼンショーホールディングス	20,600	7,156.00	147,413,600	
幸楽苑ホールディングス	2,500	1,017.00	2,542,500	
ハークスレイ	1,000	658.00	658,000	
サイゼリヤ	5,600	4,360.00	24,416,000	
V Tホールディングス	14,300	530.00	7,579,000	
魚力	1,200	2,154.00	2,584,800	
ポブラ	700	233.00	163,100	
フジ・コーポレーション	2,100	1,767.00	3,710,700	



ユナイテッドアローズ	4,000	2,406.00	9,624,000	
ハイデイ日高	5,600	2,522.00	14,123,200	
YU-WA Creation Holdings	1,700	184.00	312,800	
コロワイド	17,300	2,063.00	35,689,900	
ピーシーデポコーポレーション	3,400	480.00	1,632,000	
壱番屋	3,000	5,480.00	16,440,000	
トップカルチャー	900	194.00	174,600	
PLANT	700	760.00	532,000	
スギホールディングス	7,600	6,176.00	46,937,600	
薬王堂ホールディングス	2,100	2,552.00	5,359,200	
ヴィア・ホールディングス	4,600	87.00	400,200	
スクロール	5,600	941.00	5,269,600	
ヨンドシーホールディングス	3,200	1,900.00	6,080,000	
木曽路	5,700	2,453.00	13,982,100	
SRSホールディングス	6,200	998.00	6,187,600	
千趣会	6,900	395.00	2,725,500	
タカキュー	1,900	85.00	161,500	
リテールパートナーズ	5,600	1,537.00	8,607,200	
ケーヨー	6,100	862.00	5,258,200	
上新電機	3,400	2,006.00	6,820,400	
日本瓦斯	19,900	1,950.00	38,805,000	
ロイヤルホールディングス	7,300	2,633.00	19,220,900	
東天紅	200	839.00	167,800	
いなげや	3,700	1,473.00	5,450,100	
チヨダ	3,600	1,036.00	3,729,600	
ライフコーポレーション	3,300	3,490.00	11,517,000	
リンガーハット	4,900	2,451.00	12,009,900	
MrMaxHD	5,300	598.00	3,169,400	
テンアライド	3,300	297.00	980,100	
AOKIホールディングス	6,900	920.00	6,348,000	
オークワ	6,000	856.00	5,136,000	
コメリ	5,800	2,972.00	17,237,600	
青山商事	8,000	1,289.00	10,312,000	
しまむら	4,400	13,785.00	60,654,000	
はせがわ	1,400	369.00	516,600	

高島屋	28,400	1,982.50	56,303,000
松屋	6,400	1,017.00	6,508,800
エイチ・ツー・オー リテイリング	18,300	1,515.00	27,724,500
近鉄百貨店	1,600	2,440.00	3,904,000
丸井グループ	27,800	2,455.50	68,262,900
アクシアル リテイリング	2,600	3,680.00	9,568,000
井筒屋	1,400	361.00	505,400
イオン	127,600	2,951.00	376,547,600
イズミ	5,700	3,520.00	20,064,000
平和堂	6,300	2,374.00	14,956,200
フジ	5,800	1,804.00	10,463,200
ヤオコー	4,300	7,513.00	32,305,900
ゼビオホールディングス	5,100	1,109.00	5,655,900
ケーズホールディングス	26,600	1,288.00	34,260,800
Olympicグループ	1,100	528.00	580,800
日産東京販売ホールディングス	3,700	398.00	1,472,600
シルバーライフ	700	1,363.00	954,100
Genky DrugStores	1,600	4,975.00	7,960,000
ナルミヤ・インターナショナル	500	1,063.00	531,500
ブックオフグループホールディングス	1,900	1,174.00	2,230,600
ギフトホールディングス	800	4,625.00	3,700,000
アインホールディングス	5,200	5,032.00	26,166,400
元気寿司	1,100	3,890.00	4,279,000
ヤマダホールディングス	154,300	431.00	66,503,300
アーケランズ	5,500	1,643.00	9,036,500
ニトリホールディングス	15,200	16,990.00	258,248,000
グルメ杵屋	3,000	1,049.00	3,147,000
愛眼	2,100	185.00	388,500
ケーユーホールディングス	2,200	1,216.00	2,675,200
吉野家ホールディングス	14,700	2,730.00	40,131,000
松屋フーズホールディングス	1,800	4,155.00	7,479,000
サガミホールディングス	6,000	1,304.00	7,824,000
関西フードマーケット	3,400	1,425.00	4,845,000
王将フードサービス	2,500	6,710.00	16,775,000
ミニストップ	2,700	1,466.00	3,958,200
アークス	6,900	2,437.00	16,815,300

パローホールディングス	7,200	2,061.00	14,839,200	
ベルク	1,900	6,580.00	12,502,000	
大庄	1,600	1,141.00	1,825,600	
ファーストリテイリング	16,900	34,190.00	577,811,000	
サンドラッグ	14,300	4,136.00	59,144,800	
サクスパー ホールディングス	3,600	1,031.00	3,711,600	
ヤマザワ	500	1,261.00	630,500	
やまや	600	2,685.00	1,611,000	
ペルーナ	9,100	705.00	6,415,500	
いよぎんホールディングス	41,700	882.60	36,804,420	
しずおかフィナンシャルグループ	77,800	1,091.50	84,918,700	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	29,500	895.80	26,426,100	
楽天銀行	12,200	1,989.00	24,265,800	
島根銀行	900	506.00	455,400	
じもとホールディングス	2,400	407.00	976,800	
めぶきフィナンシャルグループ	173,800	348.00	60,482,400	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	4,500	3,335.00	15,007,500	
九州フィナンシャルグループ	61,600	643.40	39,633,440	
ゆうちょ銀行	96,200	1,137.00	109,379,400	
富山第一銀行	11,100	757.00	8,402,700	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	188,000	590.30	110,976,400	
西日本フィナンシャルホールディングス	21,700	1,408.00	30,553,600	
三十三フィナンシャルグループ	3,100	1,647.00	5,105,700	
第四北越フィナンシャルグループ	5,500	3,265.00	17,957,500	
ひろぎんホールディングス	45,700	833.50	38,090,950	
おきなわフィナンシャルグループ	3,200	2,125.00	6,800,000	
十六フィナンシャルグループ	4,500	3,305.00	14,872,500	
北國フィナンシャルホールディングス	3,700	4,560.00	16,872,000	
プロクレアホールディングス	4,300	2,059.00	8,853,700	
あいちフィナンシャルグループ	4,900	2,341.00	11,470,900	
SBI新生銀行	7,700	2,819.00	21,706,300	
あおぞら銀行	22,000	2,815.00	61,930,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	2,193,900	1,071.00	2,349,666,900	
りそなホールディングス	442,800	704.00	311,731,200	
三井住友トラスト・ホールディングス	63,700	5,281.00	336,399,700	
三井住友フィナンシャルグループ	256,000	6,344.00	1,624,064,000	

千葉銀行	97,600	919.80	89,772,480	
群馬銀行	68,000	552.10	37,542,800	
武蔵野銀行	4,500	2,364.00	10,638,000	
千葉興業銀行	6,400	631.00	4,038,400	
筑波銀行	15,400	209.00	3,218,600	
七十七銀行	11,200	2,711.00	30,363,200	
秋田銀行	2,300	1,755.00	4,036,500	
山形銀行	3,900	1,085.00	4,231,500	
岩手銀行	2,400	2,135.00	5,124,000	
東邦銀行	27,700	234.00	6,481,800	
東北銀行	1,300	1,039.00	1,350,700	
ふくおかフィナンシャルグループ	28,000	3,097.00	86,716,000	
スルガ銀行	30,900	576.00	17,798,400	
八十二銀行	74,000	671.40	49,683,600	
山梨中央銀行	3,600	1,300.00	4,680,000	
大垣共立銀行	6,700	1,854.00	12,421,800	
福井銀行	3,100	1,509.00	4,677,900	
清水銀行	1,400	1,473.00	2,062,200	
富山銀行	400	1,683.00	673,200	
滋賀銀行	5,800	2,832.00	16,425,600	
南都銀行	5,300	2,441.00	12,937,300	
百五銀行	33,000	445.00	14,685,000	
京都銀行	11,100	7,673.00	85,170,300	
紀陽銀行	12,500	1,450.00	18,125,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	22,300	1,180.50	26,325,150	
山陰合同銀行	21,900	859.00	18,812,100	
鳥取銀行	900	1,182.00	1,063,800	
百十四銀行	3,200	2,012.00	6,438,400	
四国銀行	5,600	892.00	4,995,200	
阿波銀行	4,900	2,043.00	10,010,700	
大分銀行	2,100	2,275.00	4,777,500	
宮崎銀行	2,300	2,468.00	5,676,400	
佐賀銀行	2,100	1,729.00	3,630,900	
琉球銀行	8,000	955.00	7,640,000	
セブン銀行	125,500	292.10	36,658,550	
みずほフィナンシャルグループ	506,600	2,240.50	1,135,037,300	

高知銀行	900	848.00	763,200
山口フィナンシャルグループ	38,700	1,040.00	40,248,000
名古屋銀行	2,300	3,610.00	8,303,000
北洋銀行	53,100	286.00	15,186,600
大光銀行	800	1,146.00	916,800
愛媛銀行	4,700	843.00	3,962,100
トマト銀行	900	1,069.00	962,100
京葉銀行	16,000	562.00	8,992,000
栃木銀行	16,000	262.00	4,192,000
北日本銀行	1,200	2,030.00	2,436,000
東和銀行	6,400	564.00	3,609,600
福島銀行	2,800	217.00	607,600
大東銀行	1,100	657.00	722,700
トモニホールディングス	28,300	380.00	10,754,000
フィデアホールディングス	3,600	1,437.00	5,173,200
池田泉州ホールディングス	44,900	244.00	10,955,600
F P G	11,800	1,329.00	15,682,200
ジャパンインベストメントアドバイザー	2,900	1,282.00	3,717,800
マーキュリアホールディングス	1,600	763.00	1,220,800
S B Iホールディングス	50,700	2,921.50	148,120,050
日本アジア投資	2,100	231.00	485,100
ジャフコ グループ	11,700	1,816.00	21,247,200
大和証券グループ本社	250,500	759.70	190,304,850
野村ホールディングス	645,100	577.80	372,738,780
岡三証券グループ	30,800	522.00	16,077,600
丸三証券	11,700	501.00	5,861,700
東洋証券	11,600	343.00	3,978,800
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	38,100	414.00	15,773,400
光世証券	600	641.00	384,600
水戸証券	9,400	388.00	3,647,200
いちよし証券	6,500	645.00	4,192,500
松井証券	20,700	798.00	16,518,600
マネックスグループ	37,700	549.00	20,697,300
極東証券	4,400	723.00	3,181,200
岩井コスモホールディングス	4,000	1,616.00	6,464,000
アイザワ証券グループ	5,100	824.00	4,202,400

マネーパートナーズグループ	2,800	268.00	750,400
スパークス・グループ	3,900	1,485.00	5,791,500
小林洋行	1,100	230.00	253,000
かんぽ生命保険	40,800	2,234.00	91,147,200
S O M P Oホールディングス	60,100	6,224.00	374,062,400
アニコム ホールディングス	11,900	614.00	7,306,600
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	71,300	5,118.00	364,913,400
第一生命ホールディングス	171,100	2,662.50	455,553,750
東京海上ホールディングス	346,300	3,180.00	1,101,234,000
T & Dホールディングス	94,000	2,121.50	199,421,000
アドバンスクリエイト	2,000	1,215.00	2,430,000
全国保証	9,200	4,982.00	45,834,400
あんしん保証	1,300	314.00	408,200
ジェイリース	900	2,329.00	2,096,100
イントラスト	1,000	970.00	970,000
日本モーゲージサービス	1,500	566.00	849,000
C a s a	1,100	940.00	1,034,000
アルヒ	4,300	990.00	4,257,000
プレミアグループ	5,900	1,726.00	10,183,400
ネットプロテクションズホールディングス	11,600	322.00	3,735,200
クレディセゾン	22,200	2,257.00	50,105,400
芙蓉総合リース	3,200	11,460.00	36,672,000
みずほリース	5,200	4,715.00	24,518,000
東京センチュリー	6,500	5,367.00	34,885,500
日本証券金融	12,900	1,150.00	14,835,000
アイフル	58,000	340.00	19,720,000
リコーリース	3,300	4,300.00	14,190,000
イオンフィナンシャルサービス	20,100	1,245.00	25,024,500
アコム	62,500	359.60	22,475,000
ジャックス	3,700	5,160.00	19,092,000
オリエントコーポレーション	9,100	1,139.00	10,364,900
オリックス	229,900	2,655.50	610,499,450
三菱H C キャピタル	136,600	902.90	123,336,140
九州リースサービス	1,300	876.00	1,138,800
日本取引所グループ	98,400	2,387.50	234,930,000

イー・ギャランティ	5,700	2,081.00	11,861,700
アサックス	1,200	648.00	777,600
NECキャピタルソリューション	1,700	3,175.00	5,397,500
大東建託	12,800	14,550.00	186,240,000
いちご	40,300	272.00	10,961,600
日本駐車場開発	37,100	217.00	8,050,700
スター・マイカ・ホールディングス	3,200	624.00	1,996,800
SREホールディングス	1,700	3,615.00	6,145,500
ADワークスグループ	6,900	197.00	1,359,300
ヒューリック	81,700	1,238.00	101,144,600
三栄建築設計	1,700	1,481.00	2,517,700
野村不動産ホールディングス	21,900	3,461.00	75,795,900
三重交通グループホールディングス	7,500	559.00	4,192,500
サムティ	5,600	2,259.00	12,650,400
ディア・ライフ	6,000	844.00	5,064,000
コーセーアールイー	900	800.00	720,000
地主	2,700	1,893.00	5,111,100
プレサンスコーポレーション	5,500	2,016.00	11,088,000
THEグローバル社	1,600	278.00	444,800
ハウスコム	400	918.00	367,200
JPMC	1,800	1,092.00	1,965,600
サンセイランディック	800	1,003.00	802,400
エストラスト	300	642.00	192,600
フージャースホールディングス	5,400	1,039.00	5,610,600
オープンハウスグループ	12,800	5,373.00	68,774,400
東急不動産ホールディングス	105,300	828.90	87,283,170
飯田グループホールディングス	30,700	2,488.50	76,396,950
イーランド	400	1,538.00	615,200
ムゲンエステート	1,800	895.00	1,611,000
ビーロッド	1,900	738.00	1,402,200
ファーストブラザーズ	500	1,078.00	539,000
And Doホールディングス	2,100	1,070.00	2,247,000
シーアールイー	1,900	1,382.00	2,625,800
プロパティエージェント	300	1,170.00	351,000
ケイアイスター不動産	1,700	5,060.00	8,602,000
アグレ都市デザイン	500	1,573.00	786,500

グッドコムアセット	3,200	842.00	2,694,400	
ジェイ・エス・ビー	900	5,240.00	4,716,000	
ロードスターキャピタル	2,000	1,706.00	3,412,000	
テンポイノベーション	800	1,140.00	912,000	
グローバル・リンク・マネジメント	500	1,500.00	750,000	
フェイスネットワーク	700	1,462.00	1,023,400	
パーク24	27,300	1,836.50	50,136,450	
パラカ	1,200	1,957.00	2,348,400	
宮越ホールディングス	1,600	1,016.00	1,625,600	
三井不動産	149,500	2,856.50	427,046,750	
三菱地所	211,400	1,738.00	367,413,200	
平和不動産	5,700	3,880.00	22,116,000	
東京建物	33,400	1,904.00	63,593,600	
京阪神ビルディング	5,900	1,207.00	7,121,300	
住友不動産	63,300	3,713.00	235,032,900	
テオーシー	6,300	602.00	3,792,600	
東京楽天地	600	4,200.00	2,520,000	
レオパレス21	39,400	307.00	12,095,800	
スターツコーポレーション	5,000	2,903.00	14,515,000	
フジ住宅	4,900	697.00	3,415,300	
空港施設	4,200	558.00	2,343,600	
明和地所	1,300	1,137.00	1,478,100	
ゴールドクレスト	3,300	1,882.00	6,210,600	
エスリード	1,600	2,900.00	4,640,000	
日神グループホールディングス	5,600	515.00	2,884,000	
日本エスコン	7,900	855.00	6,754,500	
MIRARTHホールディングス	17,700	477.00	8,442,900	
AVANTIA	1,500	886.00	1,329,000	
イオンモール	18,200	1,759.00	32,013,800	
毎日コムネット	1,000	733.00	733,000	
ファースト住建	1,100	1,113.00	1,224,300	
ランド	209,000	8.00	1,672,000	
カチタス	9,400	2,565.00	24,111,000	
トーセイ	5,800	1,819.00	10,550,200	
穴吹興産	500	2,162.00	1,081,000	
サンフロンティア不動産	5,800	1,482.00	8,595,600	



F Jネクストホールディングス	3,700	1,036.00	3,833,200	
インテリックス	700	515.00	360,500	
ランドビジネス	1,000	273.00	273,000	
サンネクスタグループ	800	973.00	778,400	
グランディハウス	2,300	606.00	1,393,800	
日本空港ビルデング	12,400	6,357.00	78,826,800	
明豊ファシリティワークス	1,400	778.00	1,089,200	
L I F U L L	12,500	291.00	3,637,500	
M I X I	8,300	2,665.00	22,119,500	
ジェイエシーリクルートメント	3,300	2,664.00	8,791,200	
日本M&Aセンターホールディングス	62,700	1,067.00	66,900,900	
メンバーズ	1,100	1,651.00	1,816,100	
中広	400	412.00	164,800	
UTグループ	5,400	2,844.00	15,357,600	
アイティメディア	1,400	1,320.00	1,848,000	
E・Jホールディングス	2,100	1,610.00	3,381,000	
オープンアップグループ	11,000	2,078.00	22,858,000	
コシダカホールディングス	10,900	1,087.00	11,848,300	
アルトナー	700	1,890.00	1,323,000	
パソナグループ	4,400	1,665.00	7,326,000	
C D S	700	1,746.00	1,222,200	
リンクアンドモチベーション	10,500	423.00	4,441,500	
エス・エム・エス	13,900	2,762.50	38,398,750	
サニーサイドアップグループ	800	695.00	556,000	
パーソルホールディングス	40,300	2,705.00	109,011,500	
リニカル	1,600	775.00	1,240,000	
クックパッド	10,000	160.00	1,600,000	
エスクリ	1,200	396.00	475,200	
アイ・ケイ・ケイホールディングス	1,400	609.00	852,600	
学情	1,700	1,907.00	3,241,900	
スタジオアリス	1,800	2,129.00	3,832,200	
シミックホールディングス	1,800	1,926.00	3,466,800	
エプコ	600	739.00	443,400	
N J S	800	2,893.00	2,314,400	
総合警備保障	67,900	785.10	53,308,290	
カカクコム	26,800	2,009.50	53,854,600	

アイロムグループ	1,300	1,935.00	2,515,500
セントケア・ホールディング	2,300	779.00	1,791,700
サイネックス	500	621.00	310,500
ルネサンス	2,600	910.00	2,366,000
ディップ	6,400	3,530.00	22,592,000
デジタルホールディングス	2,900	1,052.00	3,050,800
新日本科学	3,900	2,031.00	7,920,900
キャリアデザインセンター	600	1,730.00	1,038,000
ベネフィット・ワン	16,900	1,430.50	24,175,450
エムスリー	72,200	3,138.00	226,563,600
ツカダ・グローバルホールディング	1,800	486.00	874,800
プラス	300	941.00	282,300
アウトソーシング	21,800	1,413.00	30,803,400
ウェルネット	2,200	565.00	1,243,000
ワールドホールディングス	1,600	2,632.00	4,211,200
ディー・エヌ・エー	14,600	1,731.00	25,272,600
博報堂D Yホールディングス	46,600	1,589.00	74,047,400
ぐるなび	6,700	377.00	2,525,900
タカミヤ	5,000	528.00	2,640,000
ジャパンベストレスキューシステム	1,800	763.00	1,373,400
ファンコミュニケーションズ	7,200	401.00	2,887,200
ライク	1,400	1,717.00	2,403,800
ビジネス・ブレークスルー	1,100	433.00	476,300
エスプール	10,500	569.00	5,974,500
WDBホールディングス	1,900	2,058.00	3,910,200
ティア	1,700	453.00	770,100
C D G	300	1,378.00	413,400
アドウェイズ	5,000	676.00	3,380,000
バリューコマース	2,800	1,310.00	3,668,000
インフォマート	38,000	388.00	14,744,000
J Pホールディングス	10,500	323.00	3,391,500
エコナックホールディングス	4,900	91.00	445,900
C Lホールディングス	1,000	847.00	847,000
プレステージ・インターナショナル	15,400	593.00	9,132,200
アミューズ	2,000	1,747.00	3,494,000
ドリームインキュベータ	1,100	2,721.00	2,993,100

クイック	2,800	2,377.00	6,655,600
T A C	1,300	201.00	261,300
電通グループ	35,900	4,653.00	167,042,700
テイクアンドギヴ・ニーズ	1,100	1,192.00	1,311,200
ぴあ	1,200	3,285.00	3,942,000
イオンファンタジー	1,600	2,817.00	4,507,200
シーティーエス	4,000	740.00	2,960,000
ネクシィーズグループ	900	648.00	583,200
H . U . グループホールディングス	10,700	2,786.50	29,815,550
アルプス技研	3,200	2,773.00	8,873,600
サニックス	5,800	336.00	1,948,800
日本空調サービス	3,900	785.00	3,061,500
オリエンタルランド	193,500	5,426.00	1,049,931,000
ダスキン	8,100	3,177.00	25,733,700
明光ネットワークジャパン	4,400	653.00	2,873,200
ファルコホールディングス	1,700	1,844.00	3,134,800
秀英予備校	600	412.00	247,200
田谷	500	479.00	239,500
ラウンドワン	30,600	558.00	17,074,800
リゾートトラスト	14,400	2,181.50	31,413,600
ビー・エム・エル	4,500	2,980.00	13,410,000
リソー教育	16,600	257.00	4,266,200
早稲田アカデミー	2,000	1,378.00	2,756,000
ユー・エス・エス	37,600	2,419.50	90,973,200
東京個別指導学院	4,300	469.00	2,016,700
サイバーエージェント	80,800	1,010.50	81,648,400
楽天グループ	219,600	531.00	116,607,600
クリーク・アンド・リバー社	2,100	1,967.00	4,130,700
S B I グローバルアセットマネジメント	6,000	515.00	3,090,000
テー・オー・ダブリュー	7,200	308.00	2,217,600
山田コンサルティンググループ	1,900	1,568.00	2,979,200
セントラルスポーツ	1,400	2,360.00	3,304,000
フルキャストホールディングス	3,500	2,281.00	7,983,500
エン・ジャパン	6,600	2,575.00	16,995,000
リソルホールディングス	300	4,725.00	1,417,500
テクノプロ・ホールディングス	21,600	3,469.00	74,930,400

アトラグループ	600	175.00	105,000	
インターワークス	700	355.00	248,500	
アイ・アールジャパンホールディングス	1,900	1,619.00	3,076,100	
K e e P e r 技研	2,300	6,070.00	13,961,000	
ファーストロジック	300	1,065.00	319,500	
三機サービス	400	1,044.00	417,600	
G u n o s y	2,900	574.00	1,664,600	
デザインワン・ジャパン	600	173.00	103,800	
イー・ガーディアン	1,400	2,087.00	2,921,800	
リブセンス	1,300	277.00	360,100	
ジャパンマテリアル	11,200	2,402.00	26,902,400	
ベクトル	5,700	1,322.00	7,535,400	
ウチヤマホールディングス	1,200	338.00	405,600	
チャーム・ケア・コーポレーション	3,000	1,359.00	4,077,000	
キャリアリンク	1,300	2,877.00	3,740,100	
I B J	2,200	706.00	1,553,200	
アサンテ	1,800	1,722.00	3,099,600	
バリューHR	3,200	1,291.00	4,131,200	
M & A キャピタルパートナーズ	3,000	3,185.00	9,555,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	1,300	1,048.00	1,362,400	
E R I ホールディングス	700	1,962.00	1,373,400	
アビスト	400	3,230.00	1,292,000	
シグマクシス・ホールディングス	5,500	1,312.00	7,216,000	
ウィルグループ	3,100	1,105.00	3,425,500	
エスクロー・エージェント・ジャパン	2,900	140.00	406,000	
メドピア	3,200	993.00	3,177,600	
レアジョブ	500	1,014.00	507,000	
リクルートホールディングス	270,700	4,760.00	1,288,532,000	
エラン	4,800	879.00	4,219,200	
土木管理総合試験所	1,200	335.00	402,000	
日本郵政	439,900	1,031.50	453,756,850	
ベルシステム24ホールディングス	4,900	1,388.00	6,801,200	
鎌倉新書	4,200	675.00	2,835,000	
S M N	700	464.00	324,800	
一蔵	400	601.00	240,400	
グローバルキッズCOMPANY	500	674.00	337,000	

エアトリ	2,700	2,508.00	6,771,600	
アトラエ	2,200	772.00	1,698,400	
ストライク	1,500	3,315.00	4,972,500	
ソラスト	10,100	684.00	6,908,400	
セラク	1,100	1,375.00	1,512,500	
インソース	7,900	1,126.00	8,895,400	
ベйкаレント・コンサルティング	28,900	4,704.00	135,945,600	
Orchestra Holdings	800	1,189.00	951,200	
アイモバイル	1,600	1,282.00	2,051,200	
キャリアインデックス	1,000	296.00	296,000	
MS - Japan	900	1,176.00	1,058,400	
船場	500	758.00	379,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	13,000	1,763.00	22,919,000	
フルテック	400	1,116.00	446,400	
グリーンズ	1,000	1,447.00	1,447,000	
ツナググループ・ホールディングス	800	679.00	543,200	
GameWith	800	317.00	253,600	
MS&Consulting	300	644.00	193,200	
ウェルビー	2,700	455.00	1,228,500	
エル・ティー・エス	500	3,550.00	1,775,000	
ミダックホールディングス	2,200	1,702.00	3,744,400	
日総工産	2,700	875.00	2,362,500	
キュービーネットホールディングス	1,700	1,461.00	2,483,700	
RPAホールディングス	4,900	392.00	1,920,800	
スプリックス	800	804.00	643,200	
マネジメントソリューションズ	2,000	3,720.00	7,440,000	
プロレド・パートナーズ	900	516.00	464,400	
and factory	800	364.00	291,200	
テノ・ホールディングス	300	646.00	193,800	
フロンティア・マネジメント	1,200	1,352.00	1,622,400	
ピアラ	500	474.00	237,000	
コプロ・ホールディングス	500	2,169.00	1,084,500	
ギークス	400	710.00	284,000	
アンビスホールディングス	3,900	2,836.00	11,060,400	
カーブスホールディングス	10,000	761.00	7,610,000	

フォーラムエンジニアリング	2,100	1,224.00	2,570,400
Fast Fitness Japan	1,200	1,470.00	1,764,000
ダイレクトマーケティングミックス	4,400	768.00	3,379,200
ポピンズ	500	1,414.00	707,000
LITALICO	2,800	2,193.00	6,140,400
アドバンテッジリスクマネジメント	1,300	586.00	761,800
リログループ	20,400	1,924.50	39,259,800
東祥	2,500	1,308.00	3,270,000
ID&Eホールディングス	2,200	3,460.00	7,612,000
ビーウィズ	900	2,499.00	2,249,100
TREホールディングス	7,700	1,231.00	9,478,700
人・夢・技術グループ	1,400	1,737.00	2,431,800
大栄環境	9,300	2,415.00	22,459,500
日本管財ホールディングス	3,800	2,614.00	9,933,200
エイチ・アイ・エス	9,600	1,998.00	19,180,800
ラックランド	1,500	3,195.00	4,792,500
共立メンテナンス	6,300	5,296.00	33,364,800
イチネンホールディングス	3,900	1,360.00	5,304,000
建設技術研究所	1,900	3,420.00	6,498,000
スペース	2,700	1,092.00	2,948,400
燦ホールディングス	1,600	2,270.00	3,632,000
スバル興業	200	9,980.00	1,996,000
東京テアトル	1,000	1,116.00	1,116,000
タナベコンサルティンググループ	1,100	1,011.00	1,112,100
ナガワ	1,000	6,990.00	6,990,000
東京都競馬	3,100	3,865.00	11,981,500
常磐興産	1,000	1,227.00	1,227,000
カナモト	6,700	2,439.00	16,341,300
ニシオホールディングス	3,400	3,540.00	12,036,000
アゴラ ホスピタリティィー グループ	15,700	25.00	392,500
トランス・コスモス	4,500	3,480.00	15,660,000
乃村工藝社	15,900	888.00	14,119,200
藤田観光	1,600	3,805.00	6,088,000
KNT-CTホールディングス	2,200	1,417.00	3,117,400
トーカイ	3,200	1,892.00	6,054,400
白洋舎	400	2,810.00	1,124,000

セコム	37,200	9,195.00	342,054,000	
セントラル警備保障	2,000	2,823.00	5,646,000	
丹青社	7,100	793.00	5,630,300	
メイテック	14,300	2,510.00	35,893,000	
応用地質	3,400	2,518.00	8,561,200	
船井総研ホールディングス	7,600	2,576.00	19,577,600	
進学会ホールディングス	900	291.00	261,900	
オオバ	1,800	856.00	1,540,800	
いであ	600	1,679.00	1,007,400	
学究社	1,500	2,049.00	3,073,500	
ベネッセホールディングス	13,600	1,839.00	25,010,400	
イオンディライト	4,000	2,958.00	11,832,000	
ナック	1,600	980.00	1,568,000	
ダイセキ	7,500	4,380.00	32,850,000	
ステップ	1,300	1,764.00	2,293,200	
合 計	53,096,800		116,137,223,070	

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

## R M先進国株式マザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）

2023年 7月25日現在

<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	7,394,285,467
コール・ローン	315,823,572
株式	187,439,672,211
投資証券	3,996,977,318
派生商品評価勘定	284,106,444
未収入金	775,929,200
未収配当金	144,131,452
差入委託証拠金	2,224,572,072
流動資産合計	202,575,497,736
資産合計	202,575,497,736
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,333,049
未払解約金	40,000,000
未払利息	856
流動負債合計	42,333,905
負債合計	42,333,905
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	80,327,808,384
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	122,205,355,447
元本等合計	202,533,163,831
純資産合計	202,533,163,831
負債純資産合計	202,575,497,736

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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



5. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	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。
	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25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月26日
期首元本額	65,729,431,517円
期中追加設定元本額	55,073,787,869円
期中一部解約元本額	40,475,411,002円
期末元本額	80,327,808,384円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	1,738,295,594円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	7,808,079,194円
りそなラップ型ファンド(成長型)	6,792,044,834円
DCりそな グローバルバランス	44,927,255円
つみたてバランスファンド	2,902,870,484円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	1,939,434,246円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	1,391,099,991円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	950,533,500円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	490,877,437円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	333,100,052円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	182,824,337円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	380,003,895円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定型)	15,716,261円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定成長型)	49,955,087円
りそな つみたてラップ型ファンド(成長型)	49,721,616円
りそな つみたてリスクコントロールファンド	11,051,664円
ターゲットリターンバランスファンド(目標2%)	41,678円
ターゲットリターンバランスファンド(目標3%)	97,223円
ターゲットリターンバランスファンド(目標4%)	133,753円
ターゲットリターンバランスファンド(目標5%)	168,900円
ターゲットリターンバランスファンド(目標6%)	188,086円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2065	237,343円
FWりそな先進国株式アクティブファンド	130,613,250円
FWりそな先進国+新興国株式アクティブファンド	162,331,583円
FWりそな先進国株式インデックスファンド	30,708,758,680円
Smart-i 先進国株式インデックス	16,160,356,003円

Smart-i 8資産バランス 安定型	479,374,874円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	1,609,031,757円
Smart-i 8資産バランス 成長型	2,044,120,610円
Smart-i Select 全世界株式インデックス	250,163,935円
Smart-i Select 全世界株式インデックス(除く日本)	162,345,482円
りそなFT 先進国株式インデックス(適格機関投資家専用)	279,703,198円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	104,412,175円
りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	1,357,494,098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)	28,255,600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)	36,549,704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)	178,089,363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)	76,322,838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)	93,261,069円
りそなFT パッシブバランス(適格機関投資家専用)	116,127,095円
りそなマルチアセットファンド(適格機関投資家専用)	78,936,552円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	132,283円
りそなDAAファンド202205(適格機関投資家専用)	220,154,581円
りそなFT パッシブバランス202307(適格機関投資家専用)	969,871,224円
2. 計算日における受益権の総数	80,327,808,384口
3. 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	2.5213円
(10,000口当たり純資産額)	(25,213円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2023年 7月25日現在

1.金融商品に対する取組方針

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

2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

3.金融商品に係るリスク管理体制

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

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

## 金融商品の時価等に関する事項

2023年 7月25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25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25日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式	17,224,610,051	

投資証券	75,860,839
合計	17,148,749,212

(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25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	10,905,577,321	-	11,187,135,699	281,558,378
	合計	10,905,577,321	-	11,187,135,699	281,558,378

(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25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	1,160,449,380	-	1,160,664,397	215,017
	米ドル	848,233,184	-	849,233,587	1,000,403
	カナダドル	40,702,516	-	40,834,985	132,469
	ユーロ	111,780,558	-	111,232,704	547,854
	英ポンド	60,030,550	-	59,880,486	150,064
	スイスフラン	37,563,496	-	37,460,901	102,595
	スウェーデンク ローナ	9,547,860	-	9,525,180	22,680
	ノルウェークロー ネ	2,815,940	-	2,815,040	900

	デンマーククローネ	10,589,750	-	10,512,750	77,000
	オーストラリアドル	23,844,825	-	23,826,375	18,450
	ニュージーランドドル	3,507,168	-	3,507,896	728
	香港ドル	6,520,608	-	6,520,428	180
	シンガポールドル	5,312,925	-	5,314,065	1,140
	合計	1,160,449,380	-	1,160,664,397	215,017

## (注) 時価の算定方法

## 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	APA CORP	7,486	39.28	294,050.08	
	BAKER HUGHES COMPANY	24,845	35.84	890,444.80	
	CHENIERE ENERGY INC	5,987	159.55	955,225.85	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	3,035	83.42	253,179.70	
	CHEVRON CORP	44,550	161.82	7,209,081.00	
	CONOCOPHILLIPS	29,958	114.72	3,436,781.76	
	COTERRA ENERGY INC	20,285	26.87	545,057.95	
	DEVON ENERGY CORP	16,058	53.09	852,519.22	

DIAMONDBACK ENERGY INC	4,216	144.45	609,001.20
EOG RESOURCES INC	14,501	126.15	1,829,301.15
EQT CORP	9,515	39.70	377,745.50
EXXON MOBIL CORP	100,509	105.52	10,605,709.68
HALLIBURTON CO	22,158	38.26	847,765.08
HESS CORP	6,795	145.66	989,759.70
HF SINCLAIR CORP	3,758	50.28	188,952.24
KINDER MORGAN INC	49,715	18.11	900,338.65
MARATHON OIL CORP	14,890	25.64	381,779.60
MARATHON PETROLEUM CORP	10,881	128.39	1,397,011.59
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	17,681	62.32	1,101,879.92
ONEOK INC	10,972	67.25	737,867.00
OVINTIV INC	5,876	42.25	248,261.00
PHILLIPS 66	11,345	106.85	1,212,213.25
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	5,757	218.03	1,255,198.71
SCHLUMBERGER LTD	35,043	57.02	1,998,151.86
TARGA RESOURCES CORP	5,417	81.38	440,835.46
TEXAS PACIFIC LAND CORP	151	1,491.23	225,175.73
VALERO ENERGY CORP	9,053	125.71	1,138,052.63
WILLIAMS COS INC	29,974	33.96	1,017,917.04
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	5,476	302.10	1,654,299.60
ALBEMARLE CORP	2,934	210.80	618,487.20
ALCOA CORP	4,122	33.75	139,117.50
AMCOR PLC	36,707	10.11	371,107.77
AVERY DENNISON CORP	2,036	177.61	361,613.96
BALL CORP	7,893	57.95	457,399.35
CELANESE CORP	2,671	122.00	325,862.00
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	4,912	80.55	395,661.60
CLEVELAND-CLIFFS INC	11,727	16.51	193,612.77
CORTEVA INC	17,521	56.70	993,440.70
CROWN HOLDINGS INC	2,893	90.52	261,874.36
DOW INC	17,396	52.55	914,159.80
DUPONT DE NEMOURS INC	11,264	75.49	850,319.36
EASTMAN CHEMICAL CO	2,948	86.50	255,002.00
ECOLAB INC	6,306	189.43	1,194,545.58

FMC CORP	3,105	95.41	296,248.05
FREEMPORT-MCMORAN INC	35,256	42.10	1,484,277.60
INTERNATIONAL PAPER CO	7,868	32.37	254,687.16
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	6,226	84.97	529,023.22
LINDE PLC	12,128	384.69	4,665,520.32
LYONDELLBASELL INDU-CL A	6,534	90.81	593,352.54
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,559	458.51	714,817.09
MOSAIC CO/THE	8,511	39.53	336,439.83
NEWMONT CORP	19,504	43.23	843,157.92
NUCOR CORP	6,400	166.65	1,066,560.00
PACKAGING CORP OF AMERICA	2,403	138.67	333,224.01
PPG INDUSTRIES INC	5,779	145.87	842,982.73
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	1,573	287.41	452,095.93
RPM INTERNATIONAL INC	3,056	91.99	281,121.44
SEALED AIR CORP	3,468	46.05	159,701.40
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,054	268.02	1,622,593.08
STEEL DYNAMICS INC	4,203	101.98	428,621.94
VULCAN MATERIALS CO	3,262	222.60	726,121.20
WESTLAKE CORP	709	128.59	91,170.31
WESTROCK CO	7,139	30.76	219,595.64
3M CO	13,599	104.27	1,417,967.73
AECOM	3,137	87.86	275,616.82
AERCAP HOLDINGS NV	4,225	65.00	274,625.00
ALLEGION PLC	2,088	126.35	263,818.80
AMETEK INC	5,665	158.23	896,372.95
AXON ENTERPRISE INC	1,836	178.30	327,358.80
BOEING CO/THE	14,072	215.87	3,037,722.64
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	3,662	138.25	506,271.50
CARLISLE COS INC	1,273	266.69	339,496.37
CARRIER GLOBAL CORP	20,556	53.81	1,106,118.36
CATERPILLAR INC	12,767	259.37	3,311,376.79
CUMMINS INC	3,481	257.89	897,715.09
DEERE & CO	6,959	442.59	3,079,983.81
DOVER CORP	3,420	152.09	520,147.80
EATON CORP PLC	9,828	207.36	2,037,934.08

EMERSON ELECTRIC CO	14,085	92.24	1,299,200.40
FASTENAL CO	14,036	58.42	819,983.12
FERGUSON PLC	5,190	159.58	828,220.20
FORTIVE CORP	8,662	74.03	641,247.86
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS I	3,093	72.89	225,448.77
GENERAC HOLDINGS INC	1,681	146.60	246,434.60
GENERAL DYNAMICS CORP	5,755	217.64	1,252,518.20
GENERAL ELECTRIC CO	26,953	110.25	2,971,568.25
GRACO INC	3,957	86.53	342,399.21
HEICO CORP	1,073	177.74	190,715.02
HEICO CORP-CLASS A	1,964	141.32	277,552.48
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	16,462	209.32	3,445,825.84
HOWMET AEROSPACE INC	9,573	50.07	479,320.11
HUBBELL INC	1,422	333.78	474,635.16
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,111	231.22	256,885.42
IDEX CORP	1,857	214.85	398,976.45
ILLINOIS TOOL WORKS	7,526	254.34	1,914,162.84
INGERSOLL-RAND INC	10,133	65.27	661,380.91
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	3,600	48.94	176,184.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	16,930	68.90	1,166,477.00
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	4,673	200.67	937,730.91
LENNOX INTERNATIONAL INC	759	331.91	251,919.69
LOCKHEED MARTIN CORP	5,633	456.80	2,573,154.40
MASCO CORP	5,980	59.38	355,092.40
NORDSON CORP	1,267	244.91	310,300.97
NORTHROP GRUMMAN CORP	3,565	452.21	1,612,128.65
OTIS WORLDWIDE CORP	10,165	87.23	886,692.95
OWENS CORNING	2,157	130.77	282,070.89
PACCAR INC	12,869	88.70	1,141,480.30
PARKER HANNIFIN CORP	3,161	397.87	1,257,667.07
PENTAIR PLC	4,364	66.26	289,158.64
QUANTA SERVICES INC	3,563	203.81	726,175.03
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	36,187	97.01	3,510,500.87
ROCKWELL AUTOMATION INC	2,824	338.13	954,879.12
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	3,993	46.48	185,594.64



SMITH (A.O.) CORP	3,305	75.42	249,263.10
SNAP-ON INC	1,311	274.61	360,013.71
STANLEY BLACK & DECKER INC	4,061	96.43	391,602.23
TEXTRON INC	5,445	67.98	370,151.10
TORO CO	2,478	103.18	255,680.04
TRANE TECHNOLOGIES PLC	5,641	194.47	1,097,005.27
TRANSDIGM GROUP INC	1,345	882.04	1,186,343.80
UNITED RENTALS INC	1,732	450.21	779,763.72
WABTEC CORP	4,404	113.25	498,753.00
WATSCO INC	883	366.99	324,052.17
WW GRAINGER INC	1,135	769.26	873,110.10
XYLEM INC	5,872	113.96	669,173.12
AUTOMATIC DATA PROCESSING	10,214	239.50	2,446,253.00
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	3,274	115.87	379,358.38
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	2,853	169.86	484,610.58
CERIDIAN HCM HOLDING INC	3,672	68.42	251,238.24
CINTAS CORP	2,245	510.57	1,146,229.65
CLARIVATE PLC	10,336	9.50	98,192.00
COPART INC	10,502	89.65	941,504.30
COSTAR GROUP INC	10,230	90.58	926,633.40
EQUIFAX INC	3,087	206.55	637,619.85
JACOBS SOLUTIONS INC	3,361	126.00	423,486.00
LEIDOS HOLDINGS INC	3,453	91.43	315,707.79
PAYCHEX INC	7,937	125.25	994,109.25
PAYCOM SOFTWARE INC	1,316	350.98	461,889.68
PAYLOCITY HOLDING CORP	968	219.73	212,698.64
REPUBLIC SERVICES INC	5,560	154.30	857,908.00
ROBERT HALF INC	2,833	80.09	226,894.97
ROLLINS INC	6,535	44.75	292,441.25
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	5,673	61.77	350,421.21
TRANSUNION	5,124	78.97	404,642.28
VERISK ANALYTICS INC	3,528	234.16	826,116.48
WASTE CONNECTIONS INC	6,301	145.25	915,220.25
WASTE MANAGEMENT INC	10,012	171.80	1,720,061.60
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	2,734	97.94	267,767.96

CSX CORP	50,746	32.52	1,650,259.92
DELTA AIR LINES INC	3,957	47.48	187,878.36
EXPEDITORS INTL WASH INC	3,825	124.99	478,086.75
FEDEX CORP	5,915	258.77	1,530,624.55
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	57,786	3.60	208,029.60
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	2,050	198.34	406,597.00
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	3,939	57.48	226,413.72
NORFOLK SOUTHERN CORP	5,639	235.37	1,327,251.43
OLD DOMINION FREIGHT LINE	2,451	389.46	954,566.46
SOUTHWEST AIRLINES CO	3,155	37.20	117,366.00
U-HAUL HOLDING CO	2,277	58.50	133,204.50
UBER TECHNOLOGIES INC	44,901	47.32	2,124,715.32
UNION PACIFIC CORP	15,119	216.94	3,279,915.86
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	17,920	188.34	3,375,052.80
APTIV PLC	6,809	109.43	745,108.87
BORGWARNER INC	6,496	46.15	299,790.40
FORD MOTOR CO	96,339	13.96	1,344,892.44
GENERAL MOTORS CO	34,159	39.30	1,342,448.70
LEAR CORP	1,641	151.26	248,217.66
LUCID GROUP INC	16,974	7.17	121,703.58
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	17,047	25.81	439,983.07
TESLA INC	70,617	269.06	19,000,210.02
DECKERS OUTDOOR CORP	699	549.47	384,079.53
DR HORTON INC	7,522	130.01	977,935.22
GARMIN LTD	3,824	105.87	404,846.88
HASBRO INC	3,664	64.98	238,086.72
LENNAR CORP-A	6,398	127.30	814,465.40
LULULEMON ATHLETICA INC	2,830	380.39	1,076,503.70
MOHAWK INDUSTRIES INC	1,164	111.38	129,646.32
NIKE INC -CL B	30,378	108.77	3,304,215.06
NVR INC	78	6,230.69	485,993.82
PULTEGROUP INC	5,387	78.53	423,041.11
VF CORP	8,818	19.52	172,127.36
WHIRLPOOL CORP	1,517	150.76	228,702.92
AIRBNB INC-CLASS A	10,181	147.62	1,502,919.22

ARAMARK	5,568	42.67	237,586.56
BOOKING HOLDINGS INC	930	2,893.76	2,691,196.80
CAESARS ENTERTAINMENT INC	5,148	57.77	297,399.96
CARNIVAL CORP	25,264	17.85	450,962.40
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	680	2,082.99	1,416,433.20
DARDEN RESTAURANTS INC	3,060	170.08	520,444.80
DOMINO'S PIZZA INC	878	385.90	338,820.20
DOORDASH INC - A	6,214	84.31	523,902.34
EXPEDIA GROUP INC	3,721	116.83	434,724.43
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	6,529	150.46	982,353.34
HYATT HOTELS CORP - CL A	1,264	120.21	151,945.44
LAS VEGAS SANDS CORP	8,597	56.53	485,988.41
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	6,461	194.27	1,255,178.47
MCDONALD'S CORP	18,060	295.31	5,333,298.60
MGM RESORTS INTERNATIONAL	7,436	49.00	364,364.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	5,741	102.93	590,921.13
STARBUCKS CORP	28,393	102.78	2,918,232.54
VAIL RESORTS INC	955	236.05	225,427.75
WYNN RESORTS LTD	2,440	107.51	262,324.40
YUM! BRANDS INC	6,880	137.94	949,027.20
ACTIVISION BLIZZARD INC	18,408	92.55	1,703,660.40
ALPHABET INC-CL A	147,533	121.53	17,929,685.49
ALPHABET INC-CL C	133,044	121.88	16,215,402.72
ATLANTA BRAVES HOLDINGS IN-C	141	36.99	5,215.59
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	2,422	399.43	967,419.46
COMCAST CORP-CLASS A	104,121	43.29	4,507,398.09
ELECTRONIC ARTS INC	6,761	137.76	931,395.36
FOX CORP - CLASS A	7,650	33.20	253,980.00
FOX CORP- CLASS B	2,680	31.14	83,455.20
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	9,761	32.63	318,501.43
LIBERTY BROADBAND-C	3,126	88.86	277,776.36
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	4,896	70.48	345,070.08
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	3,736	31.72	118,505.92
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	4,305	97.16	418,273.80
MATCH GROUP INC	7,064	45.60	322,118.40

META PLATFORMS INC-CLASS A	54,860	291.61	15,997,724.60
NETFLIX INC	11,024	428.37	4,722,350.88
NEWS CORP - CLASS A	9,625	19.34	186,147.50
OMNICOM GROUP	5,185	83.09	430,821.65
PARAMOUNT GLOBAL	13,751	15.48	212,865.48
PINTEREST INC- CLASS A	14,550	27.79	404,344.50
ROBLOX CORP -CLASS A	10,327	39.55	408,432.85
ROKU INC	3,276	71.86	235,413.36
SEA LTD-ADR	9,530	61.16	582,854.80
SIRIUS XM HOLDINGS INC	18,628	6.00	111,768.00
SNAP INC - A	24,460	12.68	310,152.80
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	4,150	150.28	623,662.00
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	10,946	82.07	898,338.22
WALT DISNEY CO/THE	45,214	86.60	3,915,532.40
WARNER BROS DISCOVERY INC	56,995	12.61	718,706.95
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	7,968	25.82	205,733.76
ADVANCE AUTO PARTS INC	1,536	72.76	111,759.36
AMAZON.COM INC	228,670	128.80	29,452,696.00
AUTOZONE INC	452	2,494.79	1,127,645.08
BATH & BODY WORKS INC	5,832	35.25	205,578.00
BEST BUY CO INC	4,752	84.79	402,922.08
BURLINGTON STORES INC	1,583	174.22	275,790.26
CARMAX INC	4,066	83.79	340,690.14
CHEWY INC - CLASS A	1,778	33.89	60,256.42
DICK'S SPORTING GOODS INC	1,663	130.97	217,803.11
EBAY INC	13,552	48.94	663,234.88
ETSY INC	3,342	96.54	322,636.68
GENUINE PARTS CO	3,526	157.55	555,521.30
HOME DEPOT INC	25,060	325.11	8,147,256.60
LKQ CORP	7,165	56.92	407,831.80
LOWE'S COS INC	14,734	234.00	3,447,756.00
MERCADOLIBRE INC	1,113	1,198.43	1,333,852.59
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	1,515	957.98	1,451,339.70
POOL CORP	967	365.16	353,109.72
ROSS STORES INC	8,390	112.70	945,553.00

TJX COMPANIES INC	28,444	86.59	2,462,965.96
TRACTOR SUPPLY COMPANY	2,756	214.66	591,602.96
ULTA BEAUTY INC	1,224	454.67	556,516.08
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	7,590	22.05	167,359.50
COSTCO WHOLESALE CORP	10,971	563.93	6,186,876.03
DOLLAR GENERAL CORP	5,375	167.67	901,226.25
DOLLAR TREE INC	5,419	150.80	817,185.20
KROGER CO	16,693	48.74	813,616.82
SYSCO CORP	12,454	75.81	944,137.74
TARGET CORP	11,338	135.41	1,535,278.58
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	17,852	30.64	546,985.28
WALMART INC	36,676	159.30	5,842,486.80
ALTRIA GROUP INC	44,044	45.60	2,008,406.40
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	13,413	83.11	1,114,754.43
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	7,800	69.09	538,902.00
BUNGE LTD	3,961	106.08	420,182.88
CAMPBELL SOUP CO	5,192	46.41	240,960.72
COCA-COLA CO/THE	101,672	62.46	6,350,433.12
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	5,522	64.73	357,439.06
CONAGRA BRANDS INC	12,600	33.26	419,076.00
CONSTELLATION BRANDS INC-A	4,075	271.26	1,105,384.50
DARLING INGREDIENTS INC	3,777	67.49	254,909.73
GENERAL MILLS INC	14,427	77.25	1,114,485.75
HERSHEY CO/THE	3,609	245.82	887,164.38
HORMEL FOODS CORP	7,411	40.52	300,293.72
JM SMUCKER CO/THE	2,684	153.13	411,000.92
KELLOGG CO	7,243	67.85	491,437.55
KEURIG DR PEPPER INC	22,343	32.36	723,019.48
KRAFT HEINZ CO/THE	19,491	36.35	708,497.85
LAMB WESTON HOLDINGS INC	3,850	112.69	433,856.50
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	6,105	88.77	541,940.85
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	4,430	69.85	309,435.50
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	33,643	74.32	2,500,347.76
MONSTER BEVERAGE CORP	19,279	58.38	1,125,508.02
PEPSICO INC	34,073	190.92	6,505,217.16

PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	38,359	97.62	3,744,605.58
TYSON FOODS INC-CL A	7,546	53.47	403,484.62
CHURCH & DWIGHT CO INC	6,088	98.08	597,111.04
CLOROX COMPANY	3,082	155.16	478,203.12
COLGATE-PALMOLIVE CO	19,542	77.48	1,514,114.16
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	5,723	177.04	1,013,199.92
KIMBERLY-CLARK CORP	8,336	137.17	1,143,449.12
PROCTER & GAMBLE CO/THE	58,429	153.42	8,964,177.18
ABBOTT LABORATORIES	42,990	114.62	4,927,513.80
ALIGN TECHNOLOGY INC	1,828	337.01	616,054.28
AMERISOURCEBERGEN CORP	4,220	191.45	807,919.00
BAXTER INTERNATIONAL INC	12,621	48.28	609,341.88
BECTON DICKINSON AND CO	7,005	279.97	1,961,189.85
BOSTON SCIENTIFIC CORP	35,470	52.17	1,850,469.90
CARDINAL HEALTH INC	6,303	93.05	586,494.15
CENTENE CORP	14,103	70.86	999,338.58
CIGNA GROUP/THE	7,332	292.06	2,141,383.92
COOPER COS INC/THE	1,215	386.96	470,156.40
CVS HEALTH CORP	31,601	75.95	2,400,095.95
DAVITA INC	1,175	102.10	119,967.50
DENTSPLY SIRONA INC	4,858	40.46	196,554.68
DEXCOM INC	9,545	127.72	1,219,087.40
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	14,934	91.40	1,364,967.60
ELEVANCE HEALTH INC	5,862	471.16	2,761,939.92
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES I	10,043	80.63	809,767.09
HCA HEALTHCARE INC	5,127	285.18	1,462,117.86
HENRY SCHEIN INC	3,593	79.41	285,320.13
HOLOGIC INC	6,146	81.32	499,792.72
HUMANA INC	3,082	453.44	1,397,502.08
IDEXX LABORATORIES INC	2,040	554.03	1,130,221.20
INSULET CORP	1,737	279.60	485,665.20
INTUITIVE SURGICAL INC	8,656	323.56	2,800,735.36
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	2,351	218.82	514,445.82
MASIMO CORP	1,285	112.72	144,845.20
MCKESSON CORP	3,375	413.18	1,394,482.50

MEDTRONIC PLC	32,876	88.76	2,918,073.76
MOLINA HEALTHCARE INC	1,538	313.97	482,885.86
NOVOCURE LTD	2,644	38.33	101,344.52
QUEST DIAGNOSTICS INC	2,872	144.02	413,625.44
RESMED INC	3,605	218.16	786,466.80
STERIS PLC	2,425	232.17	563,012.25
STRYKER CORP	8,429	290.73	2,450,563.17
TELEFLEX INC	1,243	257.17	319,662.31
UNITEDHEALTH GROUP INC	23,097	508.68	11,748,981.96
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	1,578	148.32	234,048.96
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	3,560	196.98	701,248.80
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	5,145	140.87	724,776.15
ABBVIE INC	43,655	143.18	6,250,522.90
AGILENT TECHNOLOGIES INC	7,265	127.72	927,885.80
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	3,032	192.32	583,114.24
AMGEN INC	13,204	235.42	3,108,485.68
AVANTOR INC	17,912	22.84	409,110.08
BIO-RAD LABORATORIES-A	545	416.90	227,210.50
BIO-TECHNE CORP	3,857	87.91	339,068.87
BIOGEN INC	3,554	277.00	984,458.00
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	4,978	87.41	435,126.98
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	51,999	64.73	3,365,895.27
CATALENT INC	4,393	47.94	210,600.42
CHARLES RIVER LABORATORIES	1,351	207.25	279,994.75
DANAHER CORP	17,131	257.98	4,419,455.38
ELI LILLY & CO	19,997	459.32	9,185,022.04
EXACT SCIENCES CORP	4,549	93.84	426,878.16
GILEAD SCIENCES INC	30,846	77.66	2,395,500.36
HORIZON THERAPEUTICS PLC	5,364	100.40	538,545.60
ILLUMINA INC	3,876	188.07	728,959.32
INCYTE CORP	4,649	63.46	295,025.54
IQVIA HOLDINGS INC	4,579	228.16	1,044,744.64
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	1,672	131.89	220,520.08
JOHNSON & JOHNSON	64,334	171.08	11,006,260.72
MERCK & CO. INC.	62,811	108.79	6,833,208.69

METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	556	1,362.02	757,283.12
MODERNA INC	8,062	123.01	991,706.62
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	2,714	100.02	271,454.28
PFIZER INC	139,650	37.51	5,238,271.50
REGENERON PHARMACEUTICALS	2,653	727.13	1,929,075.89
REPLIGEN CORP	1,261	176.51	222,579.11
REVVITY INC	3,104	130.01	403,551.04
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	9,995	31.00	309,845.00
SEAGEN INC	3,439	196.23	674,834.97
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	29,745	8.64	256,996.80
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	9,542	571.52	5,453,443.84
UNITED THERAPEUTICS CORP	1,099	245.73	270,057.27
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	6,361	357.05	2,271,195.05
VIATRIS INC	29,814	10.62	316,624.68
WATERS CORP	1,566	286.97	449,395.02
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	1,852	376.06	696,463.12
ZOETIS INC	11,418	185.58	2,118,952.44
BANK OF AMERICA CORP	177,990	32.65	5,811,373.50
CITIGROUP INC	47,986	47.66	2,287,012.76
CITIZENS FINANCIAL GROUP	12,086	32.14	388,444.04
FIFTH THIRD BANCORP	17,207	28.66	493,152.62
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	257	1,386.73	356,389.61
FIRST HORIZON CORP	12,379	13.20	163,402.80
HUNTINGTON BANCSHARES INC	38,289	12.11	463,679.79
JPMORGAN CHASE & CO	72,555	158.00	11,463,690.00
KEYCORP	25,737	11.89	306,012.93
M & T BANK CORP	4,275	139.79	597,602.25
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	9,798	135.60	1,328,608.80
REGIONS FINANCIAL CORP	24,798	20.00	495,960.00
TRUIST FINANCIAL CORP	32,548	33.50	1,090,358.00
US BANCORP	37,617	39.26	1,476,843.42
WEBSTER FINANCIAL CORP	3,958	46.37	183,532.46
WELLS FARGO & CO	92,980	46.42	4,316,131.60
ALLY FINANCIAL INC	6,439	29.61	190,658.79
AMERICAN EXPRESS CO	15,635	167.79	2,623,396.65



AMERIPRISE FINANCIAL INC	2,673	354.98	948,861.54
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	9,817	80.84	793,606.28
ARES MANAGEMENT CORP - A	4,230	100.47	424,988.10
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	19,788	45.51	900,551.88
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	32,147	349.63	11,239,555.61
BLACKROCK INC	3,705	756.58	2,803,128.90
BLACKSTONE INC	17,436	105.13	1,833,046.68
BLOCK INC	13,320	77.14	1,027,504.80
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	9,420	117.22	1,104,212.40
CARLYLE GROUP INC/THE	4,906	34.51	169,306.06
CBOE GLOBAL MARKETS INC	2,618	142.31	372,567.58
CME GROUP INC	8,880	191.04	1,696,435.20
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	4,412	98.85	436,126.20
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	6,374	108.84	693,746.16
EQUITABLE HOLDINGS INC	9,273	28.81	267,155.13
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,023	436.74	446,785.02
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	14,572	61.84	901,132.48
FISERV INC	15,390	129.75	1,996,852.50
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	1,761	251.71	443,261.31
FRANKLIN RESOURCES INC	7,382	29.53	217,990.46
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	1,496	49.38	73,872.48
GLOBAL PAYMENTS INC	6,475	112.50	728,437.50
GOLDMAN SACHS GROUP INC	8,251	358.93	2,961,531.43
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	13,813	116.28	1,606,175.64
INVESCO LTD	7,706	17.96	138,399.76
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	1,802	173.29	312,268.58
KKR & CO INC	14,825	60.77	900,915.25
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	2,100	232.07	487,347.00
MARKETAXESS HOLDINGS INC	905	271.31	245,535.55
MASTERCARD INC-CLASS A	21,073	404.79	8,530,139.67
MOODY'S CORP	4,069	356.88	1,452,144.72
MORGAN STANLEY	31,005	94.67	2,935,243.35
MSCI INC	1,971	502.75	990,920.25
NASDAQ INC	9,140	51.05	466,597.00
NORTHERN TRUST CORP	5,559	79.58	442,385.22

PAYPAL HOLDINGS INC	26,338	73.69	1,940,847.22
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	5,010	109.65	549,346.50
S&P GLOBAL INC	8,110	422.80	3,428,908.00
SCHWAB (CHARLES) CORP	37,123	66.56	2,470,906.88
SEI INVESTMENTS COMPANY	2,972	64.08	190,445.76
STATE STREET CORP	8,253	71.24	587,943.72
SYNCHRONY FINANCIAL	11,238	35.84	402,769.92
T ROWE PRICE GROUP INC	5,637	120.69	680,329.53
TOAST INC-CLASS A	8,567	22.47	192,500.49
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	2,509	74.87	187,848.83
VISA INC-CLASS A SHARES	40,235	240.74	9,686,173.90
AFLAC INC	14,749	72.46	1,068,712.54
ALLSTATE CORP	6,640	112.11	744,410.40
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	1,681	120.41	202,409.21
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	17,973	60.26	1,083,052.98
AON PLC	5,048	342.57	1,729,293.36
ARCH CAPITAL GROUP LTD	9,069	81.19	736,312.11
ARTHUR J GALLAGHER & CO	5,249	219.64	1,152,890.36
ASSURANT INC	1,479	130.51	193,024.29
BROWN & BROWN INC	6,060	70.63	428,017.80
CHUBB LTD	10,199	200.54	2,045,307.46
CINCINNATI FINANCIAL CORP	4,189	102.74	430,377.86
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	563	208.48	117,374.24
EVEREST GROUP LTD	1,143	370.11	423,035.73
FNF GROUP	6,744	38.00	256,272.00
GLOBE LIFE INC	2,275	114.51	260,510.25
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	7,576	74.84	566,987.84
LOEWS CORP	4,757	61.48	292,460.36
MARKEL GROUP INC	332	1,424.97	473,090.04
MARSH & MCLENNAN COS	12,202	192.47	2,348,518.94
METLIFE INC	16,652	61.98	1,032,090.96
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	6,160	83.71	515,653.60
PROGRESSIVE CORP	14,415	125.24	1,805,334.60
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	8,959	96.52	864,722.68
TRAVELERS COS INC/THE	5,654	174.84	988,545.36

WILLIS TOWERS WATSON PLC	2,715	232.25	630,558.75
WR BERKLEY CORP	4,929	61.32	302,246.28
ACCENTURE PLC-CL A	15,629	313.29	4,896,409.41
ADOBE INC	11,354	523.86	5,947,906.44
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	3,929	92.80	364,611.20
ANSYS INC	2,178	339.84	740,171.52
ASPEN TECHNOLOGY INC	677	173.21	117,263.17
ATLASSIAN CORP-CL A	3,741	173.09	647,529.69
AUTODESK INC	5,294	210.53	1,114,545.82
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	5,957	53.18	316,793.26
BILL HOLDINGS INC	2,332	124.25	289,751.00
BLACK KNIGHT INC	4,374	70.80	309,679.20
CADENCE DESIGN SYS INC	6,746	241.27	1,627,607.42
CHECK POINT SOFTWARE TECH	2,185	127.28	278,106.80
CLOUDFLARE INC - CLASS A	7,252	65.39	474,208.28
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	12,836	67.45	865,788.20
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	5,486	149.74	821,473.64
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,005	156.99	157,774.95
DATADOG INC - CLASS A	6,137	111.49	684,214.13
DOCUSIGN INC	4,808	51.82	249,150.56
DROPBOX INC-CLASS A	6,720	26.80	180,096.00
DYNATRACE INC	5,767	52.08	300,345.36
EPAM SYSTEMS INC	1,534	235.21	360,812.14
FAIR ISAAC CORP	617	834.78	515,059.26
FORTINET INC	16,438	77.27	1,270,164.26
GARTNER INC	1,978	357.21	706,561.38
GEN DIGITAL INC	13,976	19.31	269,876.56
GODADDY INC - CLASS A	3,564	74.92	267,014.88
HUBSPOT INC	1,152	536.12	617,610.24
INTL BUSINESS MACHINES CORP	22,434	139.54	3,130,440.36
INTUIT INC	6,939	488.50	3,389,701.50
MICROSOFT CORP	175,194	345.11	60,461,201.34
MONDAY.COM LTD	475	171.84	81,624.00
MONGODB INC	1,722	410.58	707,018.76
OKTA INC	3,667	70.50	258,523.50

ORACLE CORP	40,088	118.07	4,733,190.16
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	44,191	16.32	721,197.12
PALO ALTO NETWORKS INC	7,476	243.33	1,819,135.08
PTC INC	2,758	143.09	394,642.22
ROPER TECHNOLOGIES INC	2,621	495.16	1,297,814.36
SALESFORCE INC	24,750	225.66	5,585,085.00
SERVICENOW INC	5,038	578.04	2,912,165.52
SNOWFLAKE INC-CLASS A	6,411	174.80	1,120,642.80
SPLUNK INC	4,021	103.58	416,495.18
SYNOPSYS INC	3,761	450.75	1,695,270.75
TWILIO INC - A	4,478	61.35	274,725.30
TYLER TECHNOLOGIES INC	1,045	402.70	420,821.50
UIPATH INC - CLASS A	9,453	17.00	160,701.00
UNITY SOFTWARE INC	5,673	43.55	247,059.15
VERISIGN INC	2,384	211.88	505,121.92
VMWARE INC-CLASS A	5,801	160.43	930,654.43
WIX.COM LTD	1,273	83.79	106,664.67
WORKDAY INC-CLASS A	5,030	223.12	1,122,293.60
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	6,246	69.51	434,159.46
ZSCALER INC	2,316	148.33	343,532.28
AMPHENOL CORP-CL A	14,684	83.59	1,227,435.56
APPLE INC	391,985	192.75	75,555,108.75
ARISTA NETWORKS INC	6,419	171.72	1,102,270.68
ARROW ELECTRONICS INC	1,364	138.97	189,555.08
CDW CORP/DE	3,396	189.99	645,206.04
CISCO SYSTEMS INC	101,376	53.11	5,384,079.36
COGNEX CORP	4,114	54.58	224,542.12
CORNING INC	20,148	33.19	668,712.12
DELL TECHNOLOGIES -C	6,107	53.73	328,129.11
F5 INC	1,530	150.21	229,821.30
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	31,783	17.35	551,435.05
HP INC	21,791	32.43	706,682.13
JUNIPER NETWORKS INC	7,685	29.37	225,708.45
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	4,474	168.29	752,929.46
MOTOROLA SOLUTIONS INC	4,131	295.56	1,220,958.36

NETAPP INC	5,397	78.45	423,394.65
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	4,584	59.28	271,739.52
TE CONNECTIVITY LTD	7,802	140.47	1,095,946.94
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	1,153	413.81	477,122.93
TRIMBLE INC	6,056	52.95	320,665.20
WESTERN DIGITAL CORP	8,076	38.92	314,317.92
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	1,301	302.59	393,669.59
AT&T INC	176,235	14.95	2,634,713.25
LIBERTY GLOBAL PLC-A	2,864	19.11	54,731.04
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	6,233	20.19	125,844.27
T-MOBILE US INC	14,879	141.37	2,103,444.23
VERIZON COMMUNICATIONS INC	103,878	33.98	3,529,774.44
AES CORP	17,804	21.62	384,922.48
ALLIANT ENERGY CORP	6,232	55.55	346,187.60
AMEREN CORPORATION	6,393	87.28	557,981.04
AMERICAN ELECTRIC POWER	12,638	87.60	1,107,088.80
AMERICAN WATER WORKS CO INC	4,759	147.72	702,999.48
ATMOS ENERGY CORP	3,846	123.17	473,711.82
CENTERPOINT ENERGY INC	15,334	30.87	473,360.58
CMS ENERGY CORP	7,101	62.67	445,019.67
CONSOLIDATED EDISON INC	8,840	97.13	858,629.20
CONSTELLATION ENERGY	8,015	96.55	773,848.25
DOMINION ENERGY INC	20,521	53.89	1,105,876.69
DTE ENERGY COMPANY	5,024	115.01	577,810.24
DUKE ENERGY CORP	18,993	94.77	1,799,966.61
EDISON INTERNATIONAL	9,348	72.54	678,103.92
ENERGY CORP	5,164	104.46	539,431.44
ESSENTIAL UTILITIES INC	6,186	42.68	264,018.48
EVERGY INC	5,701	61.15	348,616.15
EVERSOURCE ENERGY	8,692	73.70	640,600.40
EXELON CORP	24,412	42.83	1,045,565.96
FIRSTENERGY CORP	13,582	40.00	543,280.00
NEXTERA ENERGY INC	50,009	75.50	3,775,679.50
NISOURCE INC	10,083	28.05	282,828.15
NRG ENERGY INC	6,483	37.88	245,576.04

P G & E CORP	43,973	17.88	786,237.24	
PPL CORP	18,425	27.80	512,215.00	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	12,212	64.56	788,406.72	
SEMPRA ENERGY	7,733	151.25	1,169,616.25	
SOUTHERN CO/THE	26,914	72.95	1,963,376.30	
UGI CORP	4,854	26.45	128,388.30	
VISTRA CORP	8,462	28.30	239,474.60	
WEC ENERGY GROUP INC	7,713	92.21	711,215.73	
XCEL ENERGY INC	13,487	65.08	877,733.96	
ADVANCED MICRO DEVICES	39,828	110.61	4,405,375.08	
ANALOG DEVICES INC	12,505	192.37	2,405,586.85	
APPLIED MATERIALS INC	20,902	138.35	2,891,791.70	
BROADCOM INC	10,324	901.59	9,308,015.16	
ENPHASE ENERGY INC	3,595	177.81	639,226.95	
ENTEGRIS INC	3,670	104.86	384,836.20	
FIRST SOLAR INC	2,665	197.66	526,763.90	
INTEL CORP	103,182	33.63	3,470,010.66	
KLA CORP	3,420	460.98	1,576,551.60	
LAM RESEARCH CORP	3,335	639.03	2,131,165.05	
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	3,791	86.47	327,807.77	
MARVELL TECHNOLOGY INC	21,142	63.11	1,334,271.62	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	13,512	88.87	1,200,811.44	
MICRON TECHNOLOGY INC	27,030	65.48	1,769,924.40	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	1,103	533.22	588,141.66	
NVIDIA CORP	61,185	446.12	27,295,852.20	
NXP SEMICONDUCTORS NV	6,409	210.88	1,351,529.92	
ON SEMICONDUCTOR CORP	10,636	97.69	1,039,030.84	
QORVO INC	2,616	106.75	279,258.00	
QUALCOMM INC	27,580	124.10	3,422,678.00	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	3,887	112.59	437,637.33	
SOLAREGE TECHNOLOGIES INC	1,474	260.09	383,372.66	
TERADYNE INC	3,798	115.14	437,301.72	
TEXAS INSTRUMENTS INC	22,450	183.89	4,128,330.50	
WOLFSPEED INC	2,944	62.43	183,793.92	
CBRE GROUP INC - A	7,998	87.24	697,745.52	

	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	20,100	3.66	73,566.00
	ZILLOW GROUP INC - C	3,663	53.54	196,117.02
	米ドル 小計	8,424,101		978,263,982.30 (138,502,614,614)
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	13,964	19.36	270,343.04
	CAMECO CORP	11,404	43.44	495,389.76
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	27,329	78.63	2,148,879.27
	CENOVUS ENERGY INC	35,098	23.64	829,716.72
	ENBRIDGE INC	50,010	49.65	2,482,996.50
	IMPERIAL OIL LTD	5,025	68.98	346,624.50
	KEYERA CORP	5,128	32.58	167,070.24
	PARKLAND CORP	4,484	36.17	162,186.28
	PEMBINA PIPELINE CORP	14,460	41.86	605,295.60
	SUNCOR ENERGY INC	33,706	39.80	1,341,498.80
	TC ENERGY CORP	25,075	50.89	1,276,066.75
	TOURMALINE OIL CORP	8,465	67.99	575,535.35
	AGNICO EAGLE MINES LTD	12,059	68.26	823,147.34
	BARRICK GOLD CORP	43,252	22.88	989,605.76
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	3,584	65.00	232,960.00
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	14,762	34.68	511,946.16
	FRANCO-NEVADA CORP	4,702	192.71	906,122.42
	IVANHOE MINES LTD-CL A	14,737	12.70	187,159.90
	KINROSS GOLD CORP	35,977	6.54	235,289.58
	LUNDIN MINING CORP	18,302	11.23	205,531.46
	NUTRIEN LTD	12,942	87.22	1,128,801.24
	PAN AMERICAN SILVER CORP	9,012	21.15	190,603.80
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	11,132	56.40	627,844.80
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	1,240	115.27	142,934.80
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	11,194	58.64	656,416.16
	CAE INC	7,267	28.80	209,289.60
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	1,967	108.64	213,694.88
	WSP GLOBAL INC	3,109	178.68	555,516.12
	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	6,180	49.25	304,365.00
	RB GLOBAL INC	4,078	84.13	343,082.14
	THOMSON REUTERS CORP	3,934	173.29	681,722.86

AIR CANADA	5,799	25.58	148,338.42
CANADIAN NATL RAILWAY CO	14,086	156.72	2,207,557.92
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	23,075	108.32	2,499,484.00
TFI INTERNATIONAL INC	1,832	161.41	295,703.12
MAGNA INTERNATIONAL INC	7,184	82.20	590,524.80
BRP INC/CA- SUB VOTING	766	113.70	87,094.20
GILDAN ACTIVEWEAR INC	5,096	41.50	211,484.00
RESTAURANT BRANDS INTERN	7,233	101.20	731,979.60
QUEBECOR INC -CL B	4,795	32.82	157,371.90
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	1,212	185.82	225,213.84
DOLLARAMA INC	6,948	89.15	619,414.20
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	19,313	67.15	1,296,867.95
EMPIRE CO LTD 'A'	3,510	36.64	128,606.40
LOBLAW COMPANIES LTD	4,129	120.60	497,957.40
METRO INC	5,501	74.07	407,459.07
WESTON (GEORGE) LTD	1,755	156.96	275,464.80
SAPUTO INC	6,950	28.38	197,241.00
BANK OF MONTREAL	17,474	123.42	2,156,641.08
BANK OF NOVA SCOTIA	29,326	67.11	1,968,067.86
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	22,211	58.07	1,289,792.77
NATIONAL BANK OF CANADA	8,382	102.03	855,215.46
ROYAL BANK OF CANADA	34,233	132.06	4,520,809.98
TORONTO-DOMINION BANK	44,972	86.32	3,881,983.04
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	9,424	44.45	418,896.80
BROOKFIELD CORP	34,774	46.76	1,626,032.24
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	10,091	20.93	211,204.63
IGM FINANCIAL INC	1,623	41.73	67,727.79
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	1,979	43.40	85,888.60
ONEX CORPORATION	2,236	78.70	175,973.20
TMX GROUP LTD	7,110	30.15	214,366.50
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	545	1,012.47	551,796.15
GREAT-WEST LIFECO INC	7,067	39.95	282,326.65
IA FINANCIAL CORP INC	2,549	93.12	237,362.88
INTACT FINANCIAL CORP	4,377	198.64	869,447.28
MANULIFE FINANCIAL CORP	46,930	25.91	1,215,956.30



	POWER CORP OF CANADA	13,995	37.59	526,072.05	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	14,332	69.35	993,924.20	
	CGI INC	5,277	135.19	713,397.63	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	497	2,806.13	1,394,646.61	
	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	2,169	104.30	226,226.70	
	OPEN TEXT CORP	6,235	55.62	346,790.70	
	SHOPIFY INC - CLASS A	29,594	87.15	2,579,117.10	
	BCE INC	1,259	58.39	73,513.01	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	9,507	59.44	565,096.08	
	TELUS CORP	9,885	24.66	243,764.10	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	15,163	10.87	164,821.81	
	ALTAGAS LTD	7,887	24.81	195,676.47	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	3,622	42.24	152,993.28	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	2,375	34.23	81,296.25	
	EMERA INC	6,165	55.09	339,629.85	
	FORTIS INC	11,815	57.11	674,754.65	
	HYDRO ONE LTD	7,776	38.19	296,965.44	
	NORTHLAND POWER INC	5,997	27.16	162,878.52	
	FIRSTSERVICE CORP	925	206.81	191,299.25	
	カナダドル 小計	1,012,540		60,977,752.36 (6,554,498,601)	
ユーロ	ENI SPA	57,627	13.80	795,713.61	
	GALP ENERGIA SGPS SA	9,563	11.50	109,974.50	
	NESTE OYJ	10,953	37.89	415,009.17	
	OMV AG	3,234	41.63	134,631.42	
	REPSOL SA	33,572	13.89	466,315.08	
	TENARIS SA	10,411	15.04	156,581.44	
	TOTALENERGIES SE	58,669	54.79	3,214,474.51	
	AIR LIQUIDE SA	12,987	160.78	2,088,049.86	
	AKZO NOBEL	4,402	74.22	326,716.44	
	ARCELORMITTAL	13,149	25.22	331,617.78	
	ARKEMA	1,423	93.18	132,595.14	
	BASF SE	22,081	47.33	1,045,093.73	
	COVESTRO AG	5,325	48.79	259,806.75	
	CRH PLC	18,912	53.16	1,005,361.92	

DSM-FIRMENICH AG	4,212	100.88	424,906.56
EVONIK INDUSTRIES AG	5,594	18.28	102,258.32
HEIDELBERG MATERIALS AG	3,445	70.50	242,872.50
OCI NV	1,927	25.45	49,042.15
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	6,131	34.29	210,231.99
SOLVAY SA	1,924	104.45	200,961.80
STORA ENSO OYJ-R SHS	12,773	10.13	129,454.35
SYMRISE AG	3,344	96.08	321,291.52
UMICORE	6,087	27.37	166,601.19
UPM-KYMMENE OYJ	14,037	28.70	402,861.90
VOESTALPINE AG	3,524	28.98	102,125.52
WACKER CHEMIE AG	498	138.00	68,724.00
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	5,784	30.45	176,122.80
AIRBUS SE	14,713	136.36	2,006,264.68
ALSTOM	7,670	27.42	210,311.40
BOUYGUES SA	5,825	31.91	185,875.75
BRENTAG SE	4,188	68.94	288,720.72
CNH INDUSTRIAL NV	25,382	13.99	355,221.09
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	12,202	58.41	712,718.82
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	12,180	33.04	402,427.20
DASSAULT AVIATION SA	468	170.60	79,840.80
EIFFAGE	1,743	95.76	166,909.68
FERROVIAL SE	12,314	30.17	371,513.38
GEA GROUP AG	3,741	37.89	141,746.49
IMCD NV	1,562	136.90	213,837.80
KINGSPAN GROUP PLC	3,621	70.00	253,470.00
KNORR-BREMSE AG	1,728	62.20	107,481.60
KONE OYJ-B	8,387	46.25	387,898.75
LEGRAND SA	6,649	90.38	600,936.62
METSO CORPORATION	15,281	10.30	157,470.70
MTU AERO ENGINES AG	1,320	229.10	302,412.00
PRYSMIAN SPA	6,004	36.40	218,545.60
RATIONAL AG	80	671.00	53,680.00
RHEINMETALL AG	1,033	255.10	263,518.30
SAFRAN SA	8,493	143.08	1,215,178.44

SCHNEIDER ELECTRIC SE	13,463	162.92	2,193,391.96
SIEMENS AG-REG	18,818	151.10	2,843,399.80
SIEMENS ENERGY AG	13,258	15.54	206,095.61
THALES SA	2,680	132.30	354,564.00
VINCI SA	13,200	107.68	1,421,376.00
WARTSILA OYJ ABP	11,668	11.58	135,173.78
BUREAU VERITAS SA	7,102	24.14	171,442.28
RANDSTAD NV	3,070	51.44	157,920.80
TELEPERFORMANCE	1,407	156.85	220,687.95
WOLTERS KLUWER	6,251	112.75	704,800.25
ADP	539	127.20	68,560.80
AENA SME SA	1,862	141.90	264,217.80
DEUTSCHE GROUP AG	25,025	46.29	1,158,407.25
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	15,976	8.82	140,940.27
GETLINK	10,511	16.04	168,596.44
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	8,115	108.60	881,289.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	1,607	101.20	162,628.40
CONTINENTAL AG	2,802	73.50	205,947.00
DR ING HC F PORSCHE AG	2,745	111.55	306,204.75
FERRARI NV	3,102	287.00	890,274.00
MERCEDES-BENZ GROUP AG	21,071	71.40	1,504,469.40
MICHELIN(CGDE)	16,951	28.66	485,815.66
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	3,959	54.46	215,607.14
RENAULT SA	5,408	40.00	216,320.00
STELLANTIS NV	55,357	16.77	928,669.03
VALEO SA	5,805	21.48	124,691.40
VOLKSWAGEN AG	591	150.75	89,093.25
VOLKSWAGEN AG-PREF	5,029	125.60	631,642.40
ADIDAS AG	3,954	174.80	691,159.20
HERMES INTERNATIONAL	782	1,897.40	1,483,766.80
KERING	1,834	532.60	976,788.40
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	6,835	857.60	5,861,696.00
MONCLER SPA	5,451	62.38	340,033.38
PUMA SE	2,836	56.62	160,574.32
SEB SA	417	98.85	41,220.45

ACCOR SA	4,678	33.76	157,929.28
AMADEUS IT GROUP SA	11,010	67.28	740,752.80
DELIVERY HERO SE	4,095	40.30	165,048.97
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	4,347	177.90	773,331.30
JUST EAT TAKEAWAY	6,444	15.73	101,402.78
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	2,283	35.42	80,863.86
SODEXO	2,449	97.36	238,434.64
BOLLORE SE	14,850	5.98	88,877.25
PUBLICIS GROUPE	5,747	69.88	401,600.36
SCOUT24 SE	1,621	60.20	97,584.20
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	19,894	21.70	431,699.80
VIVENDI	16,007	8.36	133,914.56
D'IETEREN GROUP	470	155.70	73,179.00
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	26,700	34.49	920,883.00
PROSUS NV	19,665	67.45	1,326,404.25
ZALANDO SE	5,907	30.82	182,053.74
CARREFOUR SA	15,170	17.63	267,522.95
HELLOFRESH SE	5,039	23.47	118,265.33
JERONIMO MARTINS	6,820	26.86	183,185.20
KESKO OYJ-B SHS	7,834	17.83	139,719.39
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N.V.	23,766	31.46	747,678.36
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	21,501	52.70	1,133,102.70
DANONE	15,918	56.29	896,024.22
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	12,123	12.53	151,961.80
HEINEKEN HOLDING NV	2,621	81.40	213,349.40
HEINEKEN NV	6,531	98.20	641,344.20
JDE PEET'S BV	3,184	27.14	86,413.76
KERRY GROUP PLC-A	3,858	89.42	344,982.36
PERNOD RICARD SA	5,116	201.20	1,029,339.20
REMY COINTREAU	644	145.55	93,734.20
BEIERSDORF AG	2,515	114.90	288,973.50
HENKEL AG & CO KGAA	2,048	63.28	129,597.44
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	4,445	70.22	312,127.90
L'OREAL	5,982	407.60	2,438,263.20
AMPLIFON SPA	3,038	31.17	94,694.46

BIOMERIEUX	820	95.40	78,228.00
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	869	102.25	88,855.25
DIASORIN ITALIA SPA	614	94.02	57,728.28
ESSILORLUXOTTICA	7,224	176.00	1,271,424.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	5,474	48.59	265,981.66
FRESENIUS SE & CO KGAA	10,090	28.00	282,520.00
KONINKLIJKE PHILIPS NV	22,486	19.62	441,355.20
SIEMENS HEALTHINEERS AG	7,641	51.24	391,524.84
ARGENX SE	1,383	478.90	662,318.70
BAYER AG-REG	24,293	51.49	1,250,846.57
EUROFINS SCIENTIFIC	3,415	61.20	208,998.00
GRIFOLS SA	8,799	13.28	116,894.71
IPSEN	693	111.40	77,200.20
MERCK KGAA	3,261	157.55	513,770.55
ORION OYJ-CLASS B	2,913	34.96	101,838.48
QIAGEN N.V.	6,261	42.29	264,777.69
RECORDATI SPA	3,050	45.06	137,433.00
SANOFI	28,143	98.17	2,762,798.31
SARTORIUS AG-VORZUG	611	358.80	219,226.80
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	663	272.90	180,932.70
UCB SA	3,287	81.42	267,627.54
ABN AMRO BANK NV-CVA	10,185	15.64	159,344.32
AIB GROUP PLC	38,239	3.97	151,808.83
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	147,551	7.11	1,050,268.01
BANCO SANTANDER SA	403,850	3.52	1,421,552.00
BANK OF IRELAND GROUP PLC	24,991	9.30	232,416.30
BNP PARIBAS	27,509	58.37	1,605,700.33
CAIXABANK S.A	104,486	3.78	395,792.96
COMMERZBANK AG	25,045	11.20	280,629.22
CREDIT AGRICOLE SA	29,943	11.19	335,301.71
ERSTE GROUP BANK AG	8,330	34.59	288,134.70
FINECOBANK SPA	14,124	13.83	195,334.92
ING GROEP NV-CVA	88,506	13.31	1,178,191.87
INTESA SANPAOLO	398,952	2.53	1,011,742.27
KBC GROEP NV	6,163	67.18	414,030.34

MEDIOBANCA SPA	14,388	11.55	166,181.40
SOCIETE GENERALE SA	18,766	24.51	459,954.66
UNICREDIT SPA	45,573	22.38	1,019,923.74
ADYEN NV	531	1,566.60	831,864.60
AMUNDI SA	1,142	57.40	65,550.80
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	47,876	10.27	491,878.02
DEUTSCHE BOERSE AG	4,699	166.75	783,558.25
EDENRED	6,289	59.18	372,183.02
EURAZEO	846	61.85	52,325.10
EURONEXT NV	2,215	64.40	142,646.00
EXOR NV	2,777	83.14	230,879.78
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	2,398	72.94	174,910.12
NEXI SPA	14,056	7.58	106,544.48
SOFINA	272	199.40	54,236.80
WENDEL	663	93.40	61,924.20
WORLDLINE SA	6,107	34.62	211,424.34
AEGON NV	41,151	4.83	199,006.23
AGEAS	4,697	38.26	179,707.22
ALLIANZ SE-REG	9,962	215.25	2,144,320.50
ASSICURAZIONI GENERALI	24,961	19.10	476,755.10
AXA SA	45,400	27.77	1,260,985.00
HANNOVER RUECK SE	1,645	195.50	321,597.50
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	3,452	340.60	1,175,751.20
NN GROUP NV	6,780	34.50	233,910.00
POSTE ITALIANE SPA	12,729	10.23	130,217.67
SAMPO OYJ-A SHS	10,968	39.86	437,184.48
TALANX AG	1,722	54.95	94,623.90
BECHTLE AG	1,242	37.96	47,146.32
CAPGEMINI SA	4,111	171.60	705,447.60
DASSAULT SYSTEMES SE	16,650	40.03	666,582.75
NEMETSCHKE SE	886	64.40	57,058.40
SAP SE	25,866	119.78	3,098,229.48
NOKIA OYJ	135,587	3.58	486,214.98
CELLNEX TELECOM SA	14,400	36.70	528,480.00
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	80,208	19.89	1,595,657.95

ELISA OYJ	3,137	48.99	153,681.63	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	9,768	11.65	113,846.04	
KONINKLIJKE KPN NV	85,923	3.31	285,006.59	
ORANGE	46,438	10.85	504,223.80	
TELECOM ITALIA SPA	282,105	0.26	74,729.61	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	22,275	2.44	54,506.92	
TELEFONICA SA	126,395	3.77	477,393.91	
ACCIONA SA	678	141.70	96,072.60	
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVA	1,625	29.00	47,125.00	
E.ON SE	55,274	11.59	640,625.66	
EDP RENOVAVEIS SA	7,288	17.75	129,362.00	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	76,676	4.27	327,866.57	
ELIA GROUP SA/NV	575	113.70	65,377.50	
ENAGAS SA	6,843	16.28	111,404.04	
ENDESA SA	6,805	19.30	131,336.50	
ENEL SPA	201,453	6.19	1,248,001.33	
ENGIE	45,320	15.39	697,656.08	
FORTUM OYJ	10,734	12.53	134,497.02	
IBERDROLA SA	143,308	11.47	1,643,742.76	
NATURGY ENERGY GROUP SA	3,070	27.54	84,547.80	
REDEIA CORP SA	10,476	15.31	160,387.56	
RWE AG	16,151	39.85	643,617.35	
SNAM SPA	53,892	4.84	260,945.06	
TERNA SPA	32,839	7.80	256,209.87	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	16,855	29.60	498,908.00	
VERBUND AG	1,686	76.70	129,316.20	
ASM INTERNATIONAL NV	1,168	379.75	443,548.00	
ASML HOLDING NV	9,974	615.70	6,140,991.80	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	32,335	36.82	1,190,736.37	
STMICROELECTRONICS NV	17,030	45.67	777,760.10	
LEG IMMOBILIEN SE	2,018	63.94	129,030.92	
VONOVIA SE	17,755	21.11	374,808.05	
ユーロ 小計	4,508,721		118,861,732.59 (18,625,633,496)	
英ポンド	BP PLC	437,791	4.83	2,117,595.06

SHELL PLC-NEW	169,539	24.43	4,141,837.77
ANGLO AMERICAN PLC	31,334	23.90	749,039.27
ANTOFAGASTA PLC	9,832	15.54	152,838.44
CRODA INTERNATIONAL PLC	3,481	56.62	197,094.22
ENDEAVOUR MINING PLC	5,026	19.38	97,403.88
GLENCORE PLC	263,695	4.78	1,262,176.11
JOHNSON MATTHEY PLC	4,353	18.28	79,594.60
MONDI PLC	11,896	13.05	155,302.28
RIO TINTO PLC	27,824	51.77	1,440,448.48
ASHTED GROUP PLC	11,008	55.88	615,127.04
BAE SYSTEMS PLC	75,384	9.19	693,231.26
BUNZL PLC	9,080	28.36	257,508.80
DCC PLC	2,603	45.56	118,592.68
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	205,443	1.56	321,929.18
SMITHS GROUP PLC	8,753	16.78	146,875.34
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	1,807	108.65	196,330.55
EXPERIAN PLC	23,213	30.12	699,175.56
INTERTEK GROUP PLC	3,767	42.21	159,005.07
RELX PLC	46,905	25.82	1,211,087.10
RENTOKIL INITIAL PLC	61,408	6.40	393,134.01
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	27,219	4.58	124,663.02
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	2,907	43.09	125,262.63
BURBERRY GROUP PLC	8,921	21.82	194,656.22
PERSIMMON PLC	8,500	11.87	100,895.00
TAYLOR WIMPEY PLC	102,300	1.15	118,207.65
COMPASS GROUP PLC	43,059	21.26	915,434.34
ENTAIN PLC	16,920	12.75	215,814.60
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	4,209	56.12	236,209.08
PEARSON PLC	18,520	8.62	159,679.44
WHITBREAD PLC	4,984	33.95	169,206.80
AUTO TRADER GROUP PLC	22,112	6.50	143,728.00
INFORMA PLC	36,756	7.46	274,273.27
WPP PLC	26,173	8.11	212,472.41
JD SPORTS FASHION PLC	67,369	1.57	105,836.69
KINGFISHER PLC	48,904	2.43	118,836.72



NEXT PLC	3,213	71.50	229,729.50
OCADO GROUP PLC	11,932	7.85	93,666.20
SAINSBURY (J) PLC	39,265	2.82	110,923.62
TESCO PLC	179,490	2.61	469,186.86
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	8,443	20.91	176,543.13
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	52,442	26.55	1,392,335.10
COCA-COLA HBC AG-DI	5,331	23.96	127,730.76
DIAGEO PLC	55,718	34.39	1,916,420.61
IMPERIAL BRANDS PLC	21,473	18.35	394,029.55
HALEON PLC	125,835	3.36	423,183.10
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	17,744	58.96	1,046,186.24
UNILEVER PLC	62,586	40.18	2,515,018.41
NMC HEALTH PLC	438	0.00	0.00
SMITH & NEPHEW PLC	21,683	12.01	260,521.24
ASTRAZENECA PLC	38,370	107.80	4,136,286.00
GSK PLC	101,237	13.95	1,413,066.04
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	2,679	20.45	54,785.55
BARCLAYS PLC	397,261	1.64	652,938.17
HSBC HOLDINGS PLC	494,017	6.42	3,175,047.25
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,627,689	0.46	749,469.40
NATWEST GROUP PLC	139,557	2.52	352,381.42
STANDARD CHARTERED PLC	61,177	7.19	440,107.33
3I GROUP PLC	24,778	19.65	486,887.70
ABRDN PLC	51,021	2.33	118,980.97
HARGREAVES LANSDOWN PLC	5,595	9.06	50,735.46
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	9,923	83.46	828,173.58
M&G PLC	53,635	2.01	108,020.89
SCHRODERS PLC	19,357	4.58	88,751.84
ST JAMES'S PLACE PLC	12,910	11.73	151,434.30
WISE PLC - A	16,616	7.62	126,680.38
ADMIRAL GROUP PLC	6,108	22.27	136,025.16
AVIVA PLC	69,482	4.04	280,846.24
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	145,077	2.33	339,190.02
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	16,924	5.56	94,131.28
PRUDENTIAL PLC	67,610	10.53	712,271.35

	SAGE GROUP PLC/THE	27,848	9.19	256,034.51	
	HALMA PLC	9,001	22.54	202,882.54	
	BT GROUP PLC	167,081	1.25	210,438.51	
	VODAFONE GROUP PLC	564,910	0.76	432,212.64	
	CENTRICA PLC	133,494	1.25	168,135.69	
	NATIONAL GRID PLC	90,679	10.60	961,197.40	
	SEVERN TRENT PLC	6,844	25.72	176,027.68	
	SSE PLC	26,768	18.09	484,233.12	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	18,553	10.06	186,643.18	
	英ポンド 小計	6,864,789		45,149,992.49 (8,195,175,136)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	4,450	13.76	61,232.00	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	128	712.00	91,136.00	
	GIVAUDAN-REG	226	2,873.00	649,298.00	
	HOLCIM LTD	13,620	59.20	806,304.00	
	SIG GROUP AG	7,142	24.80	177,121.60	
	SIKA AG-REG	3,591	257.40	924,323.40	
	ABB LTD-REG	38,776	35.10	1,361,037.60	
	GEBERIT AG-REG	891	474.60	422,868.60	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	370	202.00	74,740.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,097	211.00	231,467.00	
	VAT GROUP AG	716	354.40	253,750.40	
	ADECCO SA-REG	4,419	33.00	145,827.00	
	SGS SA-REG	4,000	82.88	331,520.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	1,386	265.20	367,567.20	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	12,837	138.20	1,774,073.40	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	667	268.10	178,822.70	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	959	50.90	48,813.10	
	DUFY AG-REG	3,059	42.00	128,478.00	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	90	1,651.00	148,590.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	22	10,790.00	237,380.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	3	107,000.00	321,000.00	
	NESTLE SA-REG	68,056	104.40	7,105,046.40	
	ALCON INC	12,288	72.82	894,812.16	
	SONOVA HOLDING AG-REG	1,404	238.40	334,713.60	

	STRAUMANN HOLDING AG-REG	2,819	139.70	393,814.30	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	580	74.45	43,181.00	
	LONZA GROUP AG-REG	1,833	485.50	889,921.50	
	NOVARTIS AG-REG	50,712	90.80	4,604,649.60	
	ROCHE HOLDING AG-BR	863	293.80	253,549.40	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	17,383	273.50	4,754,250.50	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	737	97.40	71,783.80	
	JULIUS BAER GROUP LTD	5,378	61.04	328,273.12	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	577	969.40	559,343.80	
	UBS GROUP AG-REG	81,191	18.63	1,512,588.33	
	BALOISE HOLDING AG - REG	1,130	135.10	152,663.00	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	1,070	128.60	137,602.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	766	544.20	416,857.20	
	SWISS RE AG	7,356	93.28	686,167.68	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	3,703	422.30	1,563,776.90	
	TEMENOS GROUP AG-REG	1,696	73.08	123,943.68	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	3,865	54.96	212,420.40	
	SWISSCOM AG-REG	661	561.00	370,821.00	
	BKW AG	522	153.90	80,335.80	
	SWISS PRIME SITE-REG	2,082	83.10	173,014.20	
	スイスフラン 小計	365,121		34,398,879.37 (5,603,233,460)	
スウェーデンク ローナ	BOLIDEN AB	6,682	288.65	1,928,759.30	
	HOLMEN AB-B SHARES	1,774	385.60	684,054.40	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	17,171	132.10	2,268,289.10	
	ALFA LAVAL AB	7,597	384.30	2,919,527.10	
	ASSA ABLOY AB-B	25,285	252.60	6,386,991.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	67,317	148.15	9,973,013.55	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	40,380	128.55	5,190,849.00	
	BEIJER REF AB	10,131	140.40	1,422,392.40	
	EPIROC AB-A	17,281	202.10	3,492,490.10	
	EPIROC AB-B	7,209	174.70	1,259,412.30	
	HUSQVARNA AB-B SHS	8,099	98.64	798,885.36	
	INDUTRADE AB	5,147	220.30	1,133,884.10	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	2,737	208.60	570,938.20	

LIFCO AB-B SHS	4,582	206.60	946,641.20	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	38,567	93.48	3,605,243.16	
SAAB AB-B	2,409	568.00	1,368,312.00	
SANDVIK AB	26,969	207.30	5,590,673.70	
SKANSKA AB-B SHS	8,250	167.35	1,380,637.50	
SKF AB-B SHARES	9,296	193.40	1,797,846.40	
VOLVO AB-A SHS	3,298	234.60	773,710.80	
VOLVO AB-B SHS	37,909	228.50	8,662,206.50	
SECURITAS AB-B SHS	12,044	89.62	1,079,383.28	
VOLVO CAR AB-B	10,746	53.00	569,538.00	
EVOLUTION AB	4,614	1,289.80	5,951,137.20	
EMBRACER GROUP AB	12,140	28.59	347,143.30	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	16,091	176.64	2,842,314.24	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	15,619	258.50	4,037,511.50	
GETINGE AB-B SHS	6,454	191.90	1,238,522.60	
SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	3,105	204.40	634,662.00	
NORDEA BANK ABP	80,934	119.76	9,692,655.84	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	42,139	125.90	5,305,300.10	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	37,765	91.28	3,447,189.20	
SWEDBANK AB - A SHARES	21,356	192.75	4,116,369.00	
EQT AB	8,465	244.90	2,073,078.50	
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	2,067	294.20	608,111.40	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	3,625	293.20	1,062,850.00	
INVESTOR AB-A SHS	10,067	213.00	2,144,271.00	
INVESTOR AB-B SHS	43,445	215.20	9,349,364.00	
KINNEVIK AB - B	5,852	141.50	828,058.00	
LUNDBERGS AB-B SHS	1,611	456.30	735,099.30	
ERICSSON LM-B SHS	76,779	53.43	4,102,301.97	
HEXAGON AB-B SHS	52,429	114.85	6,021,470.65	
TELE2 AB-B SHS	13,442	81.72	1,098,480.24	
TELIA CO AB	75,050	24.37	1,828,968.50	
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	17,865	48.84	872,526.60	
SAGAX AB-B	3,246	235.80	765,406.80	
スウェーデンクローナ 小計	925,040		132,906,470.39	(1,808,857,062)

ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	8,475	279.40	2,367,915.00	
	EQUINOR ASA	24,419	315.85	7,712,741.15	
	NORSK HYDRO ASA	32,396	62.30	2,018,270.80	
	YARA INTERNATIONAL ASA	3,755	407.80	1,531,289.00	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	1,670	446.00	744,820.00	
	ADEVINTA ASA	3,943	71.25	280,938.75	
	MOWI ASA	9,892	176.95	1,750,389.40	
	ORKLA ASA	18,647	80.34	1,498,099.98	
	SALMAR ASA	2,244	451.10	1,012,268.40	
	DNB BANK ASA	24,205	207.80	5,029,799.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	4,317	159.80	689,856.60	
	TELENOR ASA	17,808	111.35	1,982,920.80	
ノルウェークローネ 小計		151,771		26,619,308.88	(374,799,869)
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	2,533	500.00	1,266,500.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	5,223	332.20	1,735,080.60	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	129	1,785.00	230,265.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	24,975	189.28	4,727,268.00	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	78	13,340.00	1,040,520.00	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-B	122	13,610.00	1,660,420.00	
	DSV A/S	4,636	1,464.50	6,789,422.00	
	PANDORA A/S	2,289	663.20	1,518,064.80	
	CARLSBERG AS-B	2,455	1,034.50	2,539,697.50	
	COLOPLAST-B	2,990	817.80	2,445,222.00	
	DEMANT A/S	1,941	270.00	524,070.00	
	GENMAB A/S	1,630	2,694.00	4,391,220.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	41,004	1,100.00	45,104,400.00	
	DANSKE BANK A/S	16,850	162.00	2,729,700.00	
TRYG A/S	10,027	135.75	1,361,165.25		
ORSTED A/S	4,796	616.00	2,954,336.00		
デンマーククローネ 小計		121,678		81,017,351.15	(1,703,794,894)
オーストラリア ドル	AMPOL LTD	6,343	32.89	208,621.27	
	SANTOS LTD	85,587	7.90	676,137.30	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	47,076	37.25	1,753,581.00	

BHP GROUP LTD	125,515	44.34	5,565,335.10
BLUESCOPE STEEL LTD	10,228	20.29	207,526.12
FORTESCUE METALS GROUP LTD	41,881	22.19	929,339.39
IGO LTD	16,726	14.00	234,164.00
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	10,393	41.33	429,542.69
MINERAL RESOURCES LTD	4,720	68.31	322,423.20
NEWCREST MINING LTD	23,571	26.48	624,160.08
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	26,877	11.59	311,504.43
ORICA LTD	13,514	15.26	206,223.64
PILBARA MINERALS LTD	63,063	4.59	289,459.17
RIO TINTO LTD	9,198	115.25	1,060,069.50
SOUTH32 LTD	113,540	3.72	422,368.80
REECE LTD	5,105	18.86	96,280.30
BRAMBLES LTD	32,920	14.05	462,526.00
COMPUTERSHARE LTD	13,214	25.07	331,274.98
AURIZON HOLDINGS LTD	45,292	3.75	169,845.00
QANTAS AIRWAYS LTD	17,415	6.69	116,506.35
TRANSURBAN GROUP	77,119	14.08	1,085,835.52
ARISTOCRAT LEISURE LTD	14,554	38.66	562,657.64
IDP EDUCATION LTD	6,171	23.18	143,043.78
LOTTERY CORP LTD/THE	59,224	5.07	300,265.68
REA GROUP LTD	1,458	148.28	216,192.24
SEEK LTD	7,251	23.59	171,051.09
WESFARMERS LTD	28,061	49.26	1,382,284.86
COLES GROUP LTD	34,879	18.09	630,961.11
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	40,049	5.96	238,692.04
WOOLWORTHS GROUP LTD	30,143	38.83	1,170,452.69
TREASURY WINE ESTATES LTD	19,494	11.18	217,942.92
COCHLEAR LTD	1,539	234.78	361,326.42
RAMSAY HEALTH CARE LTD	4,302	56.58	243,407.16
SONIC HEALTHCARE LTD	10,437	35.50	370,513.50
CSL LTD	11,954	266.27	3,182,991.58
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	74,201	25.12	1,863,929.12
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	41,783	104.43	4,363,398.69
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	77,573	27.69	2,147,996.37

	WESTPAC BANKING CORP	86,706	21.96	1,904,063.76	
	ASX LTD	4,554	61.80	281,437.20	
	MACQUARIE GROUP LTD	9,111	183.59	1,672,688.49	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	6,799	32.46	220,695.54	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	56,323	5.90	332,305.70	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	64,169	3.50	224,591.50	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	39,069	15.84	618,852.96	
	SUNCORP GROUP LTD	29,257	13.96	408,427.72	
	WISETECH GLOBAL LTD	3,650	81.56	297,694.00	
	XERO LTD	3,659	120.72	441,714.48	
	TELSTRA GROUP LTD	101,989	4.25	433,453.25	
	APA GROUP	29,125	9.84	286,590.00	
	ORIGIN ENERGY LTD	40,047	8.59	344,003.73	
	LENDLEASE GROUP	19,139	8.31	159,045.09	
	オーストラリアドル 小計	1,745,967		40,695,394.15 (3,879,491,924)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	30,815	8.37	257,921.55	
	EBOS GROUP LTD	3,341	38.30	127,960.30	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	14,964	24.52	366,917.28	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	46,094	5.10	235,309.87	
	MERCURY NZ LTD	15,009	6.45	96,808.05	
	MERIDIAN ENERGY LTD	33,959	5.52	187,453.68	
	ニュージーランドドル 小計	144,182		1,272,370.73 (111,637,807)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	70,000	47.20	3,304,000.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	33,000	83.50	2,755,500.00	
	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	52,000	11.24	584,480.00	
	MTR CORP	44,500	35.15	1,564,175.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	24,000	15.66	375,840.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	54,000	53.05	2,864,700.00	
	SANDS CHINA LTD	56,600	27.55	1,559,330.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	45,800	18.40	842,720.00	
	WH GROUP LTD	210,000	3.97	833,700.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	94,500	22.75	2,149,875.00	
	HANG SENG BANK LTD	18,600	113.30	2,107,380.00	

	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	29,500	290.20	8,560,900.00	
	AIA GROUP LTD	286,600	75.70	21,695,620.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	69,000	9.34	644,460.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD (CKI)	11,900	40.55	482,545.00	
	CLP HOLDINGS LTD	43,500	61.40	2,670,900.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	311,717	6.37	1,985,637.29	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	37,500	40.40	1,515,000.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	47,000	42.70	2,006,900.00	
	ESR GROUP LTD	39,200	12.74	499,408.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	45,000	11.10	499,500.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	32,916	22.75	748,839.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	38,000	18.08	687,040.00	
	SINO LAND CO	106,000	9.28	983,680.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	35,200	96.05	3,380,960.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	13,700	64.15	878,855.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	21,400	17.94	383,916.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	40,000	39.35	1,574,000.00	
	香港ドル 小計	1,911,133		68,139,860.29 (1,234,694,268)	
シンガポールド ル	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	2,400	33.29	79,896.00	
	KEPPEL CORP LTD	34,600	6.72	232,512.00	
	SEATRIM LTD	849,242	0.14	123,140.09	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	33,900	3.69	125,091.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	27,000	7.41	200,070.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	178,600	0.93	166,098.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	45,400	3.74	169,796.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	44,400	32.44	1,440,336.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	82,700	12.64	1,045,328.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	32,700	28.36	927,372.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	18,200	9.50	172,900.00	
	VENTURE CORP LTD	6,500	14.46	93,990.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	214,800	2.62	562,776.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	62,600	3.31	207,206.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	20,000	7.05	141,000.00	
	UOL GROUP LTD	9,400	6.75	63,450.00	



シンガポールドル 小計		1,662,442		5,750,961.09 (611,442,183)
イスラエルシュケル	ICL GROUP LTD	17,069	24.02	409,997.38
	ELBIT SYSTEMS LTD	724	775.50	561,462.00
	BANK HAPOALIM BM	30,571	32.22	984,997.62
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	37,127	29.39	1,091,162.53
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	34,303	19.59	671,995.77
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	4,617	136.50	630,220.50
	NICE SYSTEMS LTD	1,508	789.80	1,191,018.40
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	2,636	132.20	348,479.20
	AZRIELI GROUP	723	211.70	153,059.10
イスラエルシュケル 小計		129,278		6,042,392.50 (233,798,897)
合 計		27,966,763		187,439,672,211 (187,439,672,211)

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。

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

## (2)株式以外の有価証券

種 類	通貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	4,011	493,794.21	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	8,191	305,442.39	
		AMERICAN TOWER CORP	11,506	2,195,689.98	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	12,077	245,646.18	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	3,540	695,539.20	
		BOSTON PROPERTIES INC	3,897	251,200.62	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	2,862	322,919.46	
		CROWN CASTLE INC	10,676	1,190,053.72	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	7,148	880,061.76	
		EQUINIX INC	2,307	1,889,663.70	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	4,429	317,116.40	
		EQUITY RESIDENTIAL	9,106	625,035.84	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,729	422,567.60	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	5,217	763,716.63	

	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	6,429	317,978.34
	HEALTHCARE REALTY TRUST INC	9,221	185,803.15
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	13,518	299,018.16
	HOST HOTELS & RESORTS INC	17,410	303,456.30
	INVITATION HOMES INC	14,931	539,904.96
	IRON MOUNTAIN INC	7,115	442,197.25
	KIMCO REALTY CORP	15,495	324,775.20
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	2,845	440,292.20
	PROLOGIS INC	22,815	2,897,733.15
	PUBLIC STORAGE	3,893	1,150,965.45
	REALTY INCOME CORP	16,233	1,028,685.21
	REGENCY CENTERS CORP	4,031	265,078.56
	SBA COMMUNICATIONS CORP	2,721	619,326.81
	SIMON PROPERTY GROUP INC	8,027	998,639.07
	SUN COMMUNITIES INC	3,036	425,799.00
	UDR INC	7,646	330,536.58
	VENTAS INC	9,762	484,976.16
	VICI PROPERTIES INC	24,630	809,834.40
	WELLTOWER INC	12,198	1,008,408.66
	WEYERHAEUSER CO	18,644	639,302.76
	WP CAREY INC	5,737	418,628.89
	米ドル 小計	313,033	24,529,787.95 (3,472,927,377)
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	1,821	95,602.50
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	2,998	60,619.56
	カナダドル 小計	4,819	156,222.06 (16,792,309)
ユーロ	COVIVIO	968	43,734.24
	GECINA SA	1,087	107,395.60
	KLEPIERRE	5,091	121,929.45
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	3,132	164,617.92
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	4,126	114,950.36
	ユーロ 小計	14,404	552,627.57 (86,596,740)
英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	19,992	68,152.72
	LAND SECURITIES GROUP PLC	14,625	95,325.75

	SEGRO PLC	28,480	222,428.80	
	英ポンド 小計	63,097	385,907.27 (70,046,028)	
オーストラリアドル	DEXUS/AU	25,345	205,294.50	
	GOODMAN GROUP	44,620	923,634.00	
	GPT GROUP	46,863	200,105.01	
	MIRVAC GROUP	109,547	255,244.51	
	SCENTRE GROUP	121,224	335,790.48	
	STOCKLAND	56,253	234,012.48	
	VICINITY CENTRES	97,692	191,964.78	
	オーストラリアドル 小計	501,544	2,346,045.76 (223,648,542)	
香港ドル	LINK REIT	67,000	2,894,400.00	
	香港ドル 小計	67,000	2,894,400.00 (52,446,528)	
シンガポールドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	81,100	227,080.00	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	115,763	231,526.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	70,800	120,360.00	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA	73,900	121,935.00	
	シンガポールドル 小計	341,563	700,901.00 (74,519,794)	
	合計		3,996,977,318 (3,996,977,318)	

(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 605銘柄	97.6%		72.4%
	投資証券 35銘柄		2.4%	1.8%
カナダドル	株式 85銘柄	99.7%		3.5%
	投資証券 2銘柄		0.3%	0.0%

ユーロ	株式	221銘柄	99.5%		9.8%
	投資証券	5銘柄		0.5%	0.0%
英ポンド	株式	80銘柄	99.2%		4.4%
	投資証券	3銘柄		0.8%	0.0%
スイスフラン	株式	44銘柄	100.0%		2.9%
スウェーデンクローナ	株式	46銘柄	100.0%		0.9%
ノルウェークローネ	株式	12銘柄	100.0%		0.2%
デンマーククローネ	株式	16銘柄	100.0%		0.9%
オーストラリアドル	株式	52銘柄	94.5%		2.0%
	投資証券	7銘柄		5.5%	0.1%
ニュージーランドドル	株式	6銘柄	100.0%		0.1%
香港ドル	株式	28銘柄	95.9%		0.6%
	投資証券	1銘柄		4.1%	0.0%
シンガポールドル	株式	16銘柄	89.1%		0.3%
	投資証券	4銘柄		10.9%	0.0%
イスラエルシェケル	株式	9銘柄	100.0%		0.1%

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

## R M新興国株式マザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

2023年 7月25日現在

資産の部	
流動資産	
預金	907,557,701
コール・ローン	112,660,003

2023年 7月25日現在

株式	25,613,009,125
投資証券	28,751,861
派生商品評価勘定	21,024,443
未収入金	7,171,828
未収配当金	150,166,792
差入委託証拠金	494,213,979
流動資産合計	27,334,555,732
資産合計	27,334,555,732
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,031,725
未払金	3,140,393
未払解約金	9,840,000
未払利息	305
流動負債合計	14,012,423
負債合計	14,012,423
純資産の部	
元本等	
元本	15,689,394,124
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	11,631,149,185
元本等合計	27,320,543,309
純資産合計	27,320,543,309
負債純資産合計	27,334,555,732

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

5. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>原則として、約定日基準で計上しております。</p> <p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産等については、投資信託財産の計算に関する規則第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分して整理する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
-------------------------	---

## (貸借対照表に関する注記)

2023年 7月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月26日
期首元本額	11,723,887,865円
期中追加設定元本額	7,602,935,904円
期中一部解約元本額	3,637,429,645円
期末元本額	15,689,394,124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)	2,333,489,421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	1,036,134,667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	91,049,505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)	50,413,131円
ラップ型ファンド・プラスESG(成長型)	108,054,658円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定型)	5,687,765円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定成長型)	15,207,628円
りそな つみたてラップ型ファンド(成長型)	17,180,373円
りそな つみたてリスクコントロールファンド	845,843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%)	35,192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	144,696,807円
FWりそな新興国株式インデックスファンド	3,894,142,575円

Smart-i 新興国株式インデックス	2,555,467,790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	45,127,311円
Smart-i Select 全世界株式インデックス(除く日本)	29,288,196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)	20,419,474円
2. 計算日における受益権の総数	15,689,394,124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	1.7413円
(10,000口当たり純資産額)	(17,413円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

#### (金融商品に関する注記)

##### 金融商品の状況に関する事項

2023年 7月25日現在	
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、株価変動リスク、リートの価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

##### 金融商品の時価等に関する事項

2023年 7月25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25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25日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式	115,926,505	
投資証券	2,605,217	
合計	118,531,722	

(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25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	1,677,481,606	-	1,696,580,040	19,098,434
合計		1,677,481,606	-	1,696,580,040	19,098,434

(注) 時価の算定方法

先物取引

外国先物取引について

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

(通貨関連)

(2023年 7月25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	130,195,853	-	131,090,110	894,257
	米ドル	130,195,853	-	131,090,110	894,257
	売建	18,404	-	18,377	27
	オフショア人民元	18,404	-	18,377	27
合計		130,214,257	-	131,108,487	894,284

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	29,100	1.39	40,536.30	
	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	7.49	41,741.77	
	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	79.37	183,106.59	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	11,187	26.63	297,909.81	
	NIO INC - ADR	36,208	11.73	424,719.84	
	H WORLD GROUP LTD	5,136	42.77	219,666.72	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	11,675	6.31	73,669.25	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	11,085	58.17	644,814.45	
	AUTOHOME INC-ADR	2,118	30.23	64,027.14	
	IQIYI INC-ADR	11,203	5.36	60,048.08	
	JOYY INC	1,098	33.40	36,673.20	
	KANZHUN LTD	4,502	17.29	77,839.58	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	19,111	6.88	131,483.68	
	VK CO LTD	2,211	0.00	0.00	
	WEIBO CORP-SPON ADR	1,731	14.29	24,735.99	
MINISO GROUP HOLDING LTD-ADR	2,291	20.34	46,598.94		
PDD HOLDINGS INC	13,382	78.85	1,055,170.70		
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	9,598	17.52	168,156.96		
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	73.03	118,016.48
	COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	105,788	1.23	130,965.54
	CREDICORP LTD	1,808	154.91	280,077.28
	TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	2,188	0.00	0.00
	LUFAX HOLDING LTD-ADR	16,257	1.70	27,636.90
	QIFU TECHNOLOGY INC	3,164	19.08	60,369.12
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	14,388	2.59	37,322.47
	DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	1,554	37.70	58,585.80
	KE HOLDINGS INC	17,711	15.84	280,542.24
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	31,080	0.63	19,673.64
	米ドル 小計	418,211		4,604,088.47 (651,846,845)
メキシコペソ	CEMEX SAB-CPO	385,000	12.44	4,789,400.00
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	83,000	85.75	7,117,250.00
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	5,350	233.28	1,248,048.00
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	27,700	38.58	1,068,666.00
	ALFA S.A.B. -A	87,800	10.30	904,340.00
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	14,500	129.84	1,882,680.00
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	10,200	299.15	3,051,330.00
	GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	5,295	453.92	2,403,506.40
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	5,980	176.33	1,054,453.40
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	59,200	16.32	966,144.00
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	139,200	68.24	9,499,008.00
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	13,400	173.38	2,323,292.00
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	14,350	137.86	1,978,291.00
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	51,800	181.63	9,408,434.00
	GRUMA S.A.B. -B	5,455	289.89	1,581,349.95
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	33,400	86.79	2,898,786.00
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	40,200	39.89	1,603,578.00
	BANCO DEL BAJIO SA	22,200	56.21	1,247,862.00
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	69,000	148.51	10,247,190.00
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	54,000	41.89	2,262,060.00
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	830,200	17.67	14,669,634.00
		1,957,230		82,205,302.75

メキシコペソ 小計				(690,886,246)
ブラジルリアル	COSAN SA	34,500	20.09	693,105.00
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	99,000	34.00	3,366,000.00
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	126,500	30.30	3,832,950.00
	PRIO SA	19,700	46.17	909,549.00
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	20,900	19.46	406,714.00
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	17,000	13.05	221,850.00
	GERDAU SA-PREF	31,695	28.02	888,093.90
	KLABIN SA - UNIT	18,200	21.70	394,940.00
	SUZANO SA	21,307	45.02	959,241.14
	VALE SA	89,704	69.85	6,265,824.40
	WEG SA	45,000	41.54	1,869,300.00
	CCR SA	26,700	13.48	359,916.00
	LOCALIZA RENT A CAR	23,710	69.55	1,649,030.50
	RUMO SA	36,000	24.02	864,720.00
	LOJAS RENNER S.A.	23,620	18.86	445,473.20
	MAGAZINE LUIZA SA	86,300	3.01	259,763.00
	VIBRA ENERGIA SA	28,100	17.70	497,370.00
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	19,100	11.15	212,965.00
	RAIA DROGASIL SA	33,876	28.56	967,498.56
	SENDAS DISTRIBUIDORA SA	34,700	12.78	443,466.00
	AMBEV SA	126,400	15.12	1,911,168.00
	JBS SA	21,300	17.89	381,057.00
	NATURA &CO HOLDING SA	22,400	17.89	400,736.00
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	150,892	4.34	654,871.28
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	14,200	35.91	509,922.00
	HYPERA SA	9,800	44.20	433,160.00
	BANCO BRADESCO S.A.	42,615	14.84	632,406.60
	BANCO BRADESCO SA-PREF	142,636	16.60	2,367,757.60
	BANCO DO BRASIL S.A.	22,000	47.57	1,046,540.00
	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	8,100	29.78	241,218.00
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	129,000	28.54	3,681,660.00	
ITAUSA SA	129,170	9.82	1,268,449.40	
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	153,300	15.10	2,314,830.00	
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	32,400	33.70	1,091,880.00	

	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	18,600	31.47	585,342.00	
	TOTVS SA	12,700	29.53	375,031.00	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	11,000	41.22	453,420.00	
	TIM SA	24,000	14.19	340,560.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	7,100	43.42	308,282.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	30,800	38.87	1,197,196.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	34,434	12.68	436,623.12	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	8,100	55.51	449,631.00	
	CPFL ENERGIA SA	7,200	35.78	257,616.00	
	ENERGISA SA-UNITS	6,100	50.88	310,368.00	
	ENEVA SA	22,700	13.12	297,824.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	6,275	45.44	285,136.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	28,200	34.46	971,772.00	
	ブラジルリアル 小計	2,057,034		48,712,226.70 (1,457,484,436)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	9,594	6,489.80	62,263,141.20	
	EMPRESAS CMPC SA	33,869	1,631.00	55,240,339.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	3,822	60,100.00	229,702,200.00	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES	466,759	60.00	28,005,540.00	
	FALABELLA SA	21,259	2,204.90	46,873,969.10	
	CENCOSUD SA	35,890	1,824.90	65,495,661.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	3,292	7,217.60	23,760,339.20	
	BANCO DE CHILE	1,244,596	94.80	117,987,700.80	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	1,739	24,698.00	42,949,822.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	1,641,012	43.80	71,876,325.60	
	ENEL AMERICAS SA	517,290	110.35	57,082,951.50	
	ENEL CHILE SA	827,632	62.50	51,727,000.00	
	チリペソ 小計	4,806,754		852,964,989.40 (145,654,007)	
コロンビアペソ	BANCOLOMBIA SA	6,380	33,100.00	211,178,000.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	10,944	29,400.00	321,753,600.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	12,989	17,200.00	223,410,800.00	
	コロンビアペソ 小計	30,313		756,342,400.00 (27,086,134)	
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	1,474	23.24	34,255.76	

	MYTILINEOS S.A.	2,599	35.74	92,888.26	
	OPAP SA	4,870	16.22	78,991.40	
	JUMBO SA	2,974	28.08	83,509.92	
	ALPHA SERVICES AND HOLDINGS	65,690	1.62	106,549.18	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	74,565	1.63	121,540.95	
	NATIONAL BANK OF GREECE	14,028	6.21	87,169.99	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	4,849	14.41	69,874.09	
	PUBLIC POWER CORP	5,654	11.00	62,194.00	
	TERNA ENERGY SA	1,400	17.92	25,088.00	
	ユーロ 小計	178,103		762,061.55	(119,415,044)
英債券	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	5,948	0.00	0.00	
	英債券 小計	5,948		0.00	(0)
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	27,711	91.85	2,545,255.35	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	34,746	37.96	1,318,958.16	
	HEKTAS TICARET T.A.S	35,672	30.20	1,077,294.40	
	KOZA ALTIN ISLETMELERI AS	25,931	26.18	678,873.58	
	SASA POLYESTER SANAYI	27,188	60.75	1,651,671.00	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	15,288	70.30	1,074,746.40	
	KOC HOLDING AS	18,208	117.50	2,139,440.00	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	37,427	47.92	1,793,501.84	
	PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS	1,253	757.50	949,147.50	
	TURK HAVA YOLLARI AO	14,261	221.80	3,163,089.80	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	1,780	900.00	1,602,000.00	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	3,208	260.80	836,646.40	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	11,198	198.30	2,220,563.40	
	AKBANK T.A.S.	83,796	24.80	2,078,140.80	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	30,648	52.25	1,601,358.00	
	TURKIYE IS BANKASI-C	90,125	13.90	1,252,737.50	
	YAPI VE KREDI BANKASI	92,810	12.78	1,186,111.80	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	31,132	45.70	1,422,732.40	
	トルコリラ 小計	582,382		28,592,268.33	(150,289,540)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	2,117	703.00	1,488,251.00	

	MONETA MONEY BANK AS	7,045	83.40	587,553.00	
	CEZ AS	4,323	905.00	3,912,315.00	
	チェココルナ 小計	13,485		5,988,119.00	(38,884,449)
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	11,609	2,816.00	32,690,944.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	3,960	8,915.00	35,303,400.00	
	OTP BANK PLC	6,308	12,845.00	81,026,260.00	
	ハンガリーフォリント 小計	21,877		149,020,604.00	(61,810,468)
ポーランドズロ チ	ORLEN SA	14,813	71.12	1,053,500.56	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	3,988	117.00	466,596.00	
	LPP SA	26	14,450.00	375,700.00	
	CD PROJEKT SA	1,602	158.25	253,516.50	
	CYFROWY POLSAT SA	8,679	16.50	143,203.50	
	ALLEGRO.EU SA	11,388	32.70	372,387.60	
	PEPCO GROUP NV	5,086	35.62	181,163.32	
	DINO POLSKA SA	1,364	480.00	654,720.00	
	BANK PEKAO SA	5,176	114.15	590,840.40	
	MBANK SA	290	461.00	133,690.00	
	PKO BANK POLSKI SA	22,290	39.80	887,142.00	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	977	405.00	395,685.00	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	15,971	38.89	621,112.19	
	PGE SA	29,021	8.53	247,607.17	
	ポーランドズロチ 小計	120,671		6,376,864.24	(224,478,374)
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	5.62	325,960.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	50,000	8.91	445,500.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	650,000	4.53	2,944,500.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	89,500	22.75	2,036,125.00	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	38,000	8.29	315,020.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	560,000	5.76	3,225,600.00	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO-H	57,000	11.54	657,780.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	110,000	3.40	374,000.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	30,500	19.68	600,240.00	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	64,500	6.39	412,155.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	100,000	4.27	427,000.00	
	CHINA RESOURCES CEMENT	68,000	2.96	201,280.00	
	CMOC GROUP LTD-H	87,000	4.77	414,990.00	
	DONGYUE GROUP	44,000	7.75	341,000.00	
	GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD-H	9,640	46.95	452,598.00	
	JIANGXI COPPER CO LTD-H	31,000	12.00	372,000.00	
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	42,000	4.82	202,440.00	
	SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	20,500	15.84	324,720.00	
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	31,500	11.58	364,770.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	152,000	12.48	1,896,960.00	
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	61,000	3.81	232,410.00	
	BOC AVIATION LTD	6,100	65.00	396,500.00	
	CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	68,000	3.67	249,560.00	
	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	43,000	8.83	379,690.00	
	CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	26,000	4.64	120,640.00	
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	113,000	4.92	555,960.00	
	CHINA STATE CONSTRUCTION INT	58,000	9.30	539,400.00	
	CITIC LTD	155,000	8.17	1,266,350.00	
	CRRC CORP LTD - H	118,000	4.20	495,600.00	



FOSUN INTERNATIONAL LTD	72,500	5.33	386,425.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	17,000	17.38	295,460.00	
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	27,000	11.20	302,400.00	
WEICHAJ POWER CO LTD-H	49,000	11.18	547,820.00	
ZHUZHOU CRRG TIMES ELECTRI-H	13,800	29.80	411,240.00	
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL LIMITED	92,000	2.95	271,400.00	
AIR CHINA LTD-H	42,000	6.02	252,840.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	46,000	4.86	223,560.00	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	40,000	10.48	419,200.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	46,000	4.70	216,200.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	83,700	8.01	670,437.00	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	46,000	4.75	218,500.00	
JD LOGISTICS INC	52,200	11.66	608,652.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	30,000	7.07	212,100.00	
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	3,500	119.50	418,250.00	
SHENZHEN INTL HOLDINGS	32,500	7.17	233,025.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	32,000	6.10	195,200.00	
BYD CO LTD-H	26,500	260.40	6,900,600.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	70,000	3.49	244,300.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	16,400	32.60	534,640.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	161,000	9.37	1,508,570.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	64,000	9.38	600,320.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	70,000	4.54	317,800.00	
LI AUTO INC-CLASS A	29,688	142.30	4,224,602.40	
MINIH GROUP LTD	22,000	22.05	485,100.00	
XPENG INC-CLASS A SHARES	27,664	57.65	1,594,829.60	
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	32,000	17.02	544,640.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	32,400	81.65	2,645,460.00	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	110,000	3.38	371,800.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	61,000	23.05	1,406,050.00	
LI NING CO LTD	62,500	39.55	2,471,875.00	
SHENZHOI INTERNATIONAL GROUP	21,900	75.05	1,643,595.00	
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	41,500	7.48	310,420.00	
EAST BUY HOLDING LTD	10,500	31.15	327,075.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	44,000	17.74	780,560.00	

JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	27,000	12.48	336,960.00	
MEITUAN	133,810	125.00	16,726,250.00	
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	41,510	38.20	1,585,682.00	
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LT	34,800	17.50	609,000.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	25,000	14.00	350,000.00	
TRIP.COM GROUP LTD	14,460	283.40	4,097,964.00	
BAIDU INC-CLASS A	59,530	135.30	8,054,409.00	
BILIBILI INC-CLASS Z	5,117	121.50	621,715.50	
CHINA LITERATURE LTD	9,800	32.35	317,030.00	
CHINA RUYI HOLDINGS LIMITED	136,000	2.57	349,520.00	
KINGSOFT CORP LTD	24,200	32.25	780,450.00	
KUAISHOU TECHNOLOGY	61,100	58.35	3,565,185.00	
NETEASE INC	52,100	158.00	8,231,800.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	164,400	325.00	53,430,000.00	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	437,740	89.55	39,199,617.00	
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	20,000	7.93	158,600.00	
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-H	1,900	102.70	195,130.00	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	49,600	12.64	626,944.00	
JD.COM INC - CL A	62,210	141.40	8,796,494.00	
POP MART INTERNATIONAL GROUP	15,000	19.00	285,000.00	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	50,000	6.75	337,500.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	19,500	26.50	516,750.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	118,000	5.05	595,900.00	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	29,550	51.15	1,511,482.50	
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	15,000	18.60	279,000.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	2,600	138.01	358,826.00	
CHINA FEIHE LTD	95,000	4.37	415,150.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	84,000	26.95	2,263,800.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	42,000	48.50	2,037,000.00	
DALI FOODS GROUP CO LTD	66,500	3.57	237,405.00	
NONGFU SPRING CO LTD-H	46,800	42.75	2,000,700.00	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	48,000	7.95	381,600.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	50,000	11.62	581,000.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	16,000	68.35	1,093,600.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	31,000	6.41	198,710.00	

WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	123,000	5.25	645,750.00	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	14,000	15.80	221,200.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	17,500	30.25	529,375.00	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	9,000	16.70	150,300.00	
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	9,000	45.30	407,700.00	
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	24,200	15.00	363,000.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	64,000	10.50	672,000.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	21,500	14.08	302,720.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	33,600	23.75	798,000.00	
3SBIO INC	52,500	7.42	389,550.00	
AKESO INC	13,000	38.55	501,150.00	
BEIGENE LTD	18,296	119.10	2,179,053.60	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	33,000	12.12	399,960.00	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	43,500	5.87	255,345.00	
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	90,000	3.40	306,000.00	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	240,000	6.27	1,504,800.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	30,000	19.18	575,400.00	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	2,700	46.50	125,550.00	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	32,000	12.50	400,000.00	
INNOVENT BIOLOGICS INC	29,500	33.20	979,400.00	
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	9,600	17.44	167,424.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	14,000	20.35	284,900.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	279,250	3.43	957,827.50	
WUXI APPTTEC CO LTD-H	10,168	69.60	707,692.80	
WUXI BIOLOGICS (CAYMAN) INC.	101,500	40.55	4,115,825.00	
ZAI LAB LTD	23,030	23.85	549,265.50	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	772,000	2.63	2,030,360.00	
BANK OF CHINA LTD-H	2,100,000	2.73	5,733,000.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	232,000	4.45	1,032,400.00	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	245,000	3.61	884,450.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	2,546,000	4.27	10,871,420.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	69,000	2.20	151,800.00	
CHINA MERCHANTS BANK-H	103,000	32.55	3,352,650.00	
CHINA MINSHENG BANKING-H	171,600	2.80	480,480.00	
IND & COMM BK OF CHINA-H	1,497,000	3.59	5,374,230.00	

POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	214,000	4.40	941,600.00	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	250,000	0.76	190,000.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	82,000	3.95	323,900.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	38,800	13.92	540,096.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	53,000	13.78	730,340.00	
FAR EAST HORIZON LTD	38,000	5.50	209,000.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	26,800	10.24	274,432.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	65,200	4.99	325,348.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	35,800	9.68	346,544.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	199,000	11.20	2,228,800.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	71,200	17.94	1,277,328.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	33,400	7.35	245,490.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	20,700	18.60	385,020.00	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	224,000	2.76	618,240.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	184,000	8.29	1,525,360.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	168,000	48.80	8,198,400.00	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	19,800	21.75	430,650.00	
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	80,000	4.31	344,800.00	
GDS HOLDINGS LTD-CL A	25,524	10.76	274,638.24	
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	72,000	10.82	779,040.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	17,500	17.06	298,550.00	
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	19,500	27.45	535,275.00	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	19,000	20.25	384,750.00	
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	24,000	7.39	177,360.00	
LENOVO GROUP LTD	196,000	8.41	1,648,360.00	
SUNNY OPTICAL TECH	19,100	66.25	1,265,375.00	
XIAOMI CORP-CLASS B	403,400	11.02	4,445,468.00	
ZTE CORP-H	18,800	29.50	554,600.00	
CHINA TOWER CORP LTD-H	1,178,000	0.84	989,520.00	
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	14,500	28.25	409,625.00	
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	122,000	1.90	231,800.00	
CGN POWER CO LTD-H	285,000	1.89	538,650.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	78,000	8.23	641,940.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	88,000	7.54	663,520.00	
CHINA POWER INTERNATIONAL	126,000	3.09	389,340.00	

	CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	24,200	25.45	615,890.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	52,000	17.22	895,440.00	
	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	21,000	85.60	1,797,600.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD	78,000	6.26	488,280.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	96,000	4.57	438,720.00	
	KUNLUN ENERGY CO LTD	102,000	6.03	615,060.00	
	FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	11,000	22.45	246,950.00	
	GCL TECHNOLOGY HOLDINGS LTD	517,000	1.58	816,860.00	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	16,000	24.80	396,800.00	
	SHANGHAI FUDAN MICROELECT-H	7,000	19.84	138,880.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	130,000	7.87	1,023,100.00	
	C&D INTERNATIONAL INVESTMENT	16,000	18.64	298,240.00	
	CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	94,000	1.04	97,760.00	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	102,000	15.80	1,611,600.00	
	CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	40,000	7.99	319,600.00	
	CHINA RESOURCES LAND LTD	86,000	30.80	2,648,800.00	
	CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	18,800	35.25	662,700.00	
	CHINA VANKE CO LTD-H	56,400	9.35	527,340.00	
	COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	276,000	1.26	347,760.00	
	COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	57,000	7.41	422,370.00	
	GREENTOWN CHINA HOLDINGS	21,500	7.29	156,735.00	
	GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	36,000	3.80	136,800.00	
	LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	50,500	14.78	746,390.00	
	SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	20,000	4.42	88,400.00	
	YUEXIU PROPERTY CO LTD	50,800	8.40	426,720.00	
	香港ドル 小計	22,221,387		312,219,800.64 (5,657,422,787)	
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	95,700	2.20	210,540.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	5,900	22.18	130,862.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	66,900	6.50	434,850.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	102,800	4.81	494,468.00	
	GAMUDA BHD	49,000	4.57	223,930.00	
	SIME DARBY BERHAD	56,700	2.12	120,204.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	13,800	6.88	94,944.00	
	MISC BHD	36,800	7.14	262,752.00	

	GENTING BHD	57,900	4.22	244,338.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	91,400	2.54	232,156.00	
	MR DIY GROUP M BHD	92,550	1.44	133,272.00	
	IOI CORP BHD	69,200	4.07	281,644.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	12,000	23.32	279,840.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	1,800	131.80	237,240.00	
	PPB GROUP BERHAD	16,120	16.56	266,947.20	
	QL RESOURCES BHD	30,350	5.42	164,497.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	63,000	4.57	287,910.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	59,200	5.85	346,320.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	153,200	0.87	134,050.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	36,600	3.69	135,054.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	172,800	5.35	924,480.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	16,200	18.94	306,828.00	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	5,300	17.68	93,704.00	
	MALAYAN BANKING BHD	142,900	8.92	1,274,668.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	389,100	3.98	1,548,618.00	
	RHB BANK BHD	39,200	5.55	217,560.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	72,600	2.60	188,760.00	
	CELCOMDIGI BHD	90,500	4.43	400,915.00	
	MAXIS BHD	64,700	4.05	262,035.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	36,600	5.00	183,000.00	
	PETRONAS GAS BHD	22,900	17.00	389,300.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	71,400	9.46	675,444.00	
	INARI AMERTRON BHD	74,800	3.10	231,880.00	
	マレーシアリングット 小計	2,309,920		11,413,010.20 (353,296,578)	
タイパーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	201,000	9.40	1,889,400.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	37,900	159.50	6,045,050.00	
	PTT PCL-NVDR	270,400	34.50	9,328,800.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	31,600	48.50	1,532,600.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	53,800	33.00	1,775,400.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	54,100	37.25	2,015,225.00	
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	32,200	38.50	1,239,700.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	19,700	319.00	6,284,300.00	

AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	115,700	71.00	8,214,700.00	
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	4.34	827,204.00	
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	75,900	31.00	2,352,900.00	
CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	45,225	40.75	1,842,918.75	
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	145,900	14.10	2,057,190.00	
PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	85,300	21.20	1,808,360.00	
BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	36,100	34.25	1,236,425.00	
CP ALL PCL-NVDR	157,200	63.00	9,903,600.00	
CP AXTRA PCL-NVDR	59,000	34.25	2,020,750.00	
CARABAO GROUP PCL-NVDR	4,900	70.00	343,000.00	
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	94,100	19.70	1,853,770.00	
OSOTSPA PCL-NVDR	31,400	28.75	902,750.00	
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	280,500	28.75	8,064,375.00	
BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	16,900	217.00	3,667,300.00	
KASIKORNBANK PCL-NVDR	13,200	124.50	1,643,400.00	
KRUNG THAI BANK - NVDR	84,100	20.20	1,698,820.00	
SCB X PCL-NVDR	21,200	107.50	2,279,000.00	
KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	23,600	46.50	1,097,400.00	
MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	16,300	34.75	566,425.00	
SRISAWAD CORP PCL-NVDR	16,200	46.75	757,350.00	
DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	84,500	109.00	9,210,500.00	
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	30,000	222.00	6,660,000.00	
INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	28,600	76.00	2,173,600.00	
TRUE CORP PCL/NEW-NVDR	327,315	6.90	2,258,473.50	
B GRIMM POWER PCL-NVDR	25,200	36.75	926,100.00	
ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	6,300	137.50	866,250.00	
ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	48,000	55.75	2,676,000.00	
GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	21,300	55.00	1,171,500.00	
GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	81,400	48.75	3,968,250.00	
RATCH GROUP PCL-NVDR	21,900	37.25	815,775.00	
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	57,400	64.50	3,702,300.00	
LAND & HOUSES PUB - NVDR	207,600	8.50	1,764,600.00	
	3,595,140		123,099,841.25	

タイパーツ 小計				(504,709,349)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	51,250	53.65	2,749,562.50	
	AYALA CORPORATION	7,910	639.00	5,054,490.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	72,731	43.90	3,192,890.90	
	SM INVESTMENTS CORP	6,870	923.00	6,341,010.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	24,500	204.00	4,998,000.00	
	JOLLIBEE FOODS CORP	11,290	258.00	2,912,820.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	24,530	131.10	3,215,883.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	54,578	115.00	6,276,470.00	
	BDO UNIBANK INC	65,396	150.00	9,809,400.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	45,472	57.60	2,619,187.20	
	PLDT INC	1,865	1,300.00	2,424,500.00	
	ACEN CORP	14,250	5.43	77,377.50	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	7,490	347.00	2,599,030.00	
	AYALA LAND INC	181,100	27.50	4,980,250.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	252,700	33.30	8,414,910.00	
フィリピンペソ 小計		821,932		65,665,781.10	(170,166,305)
インドネシアルピア	ADARO ENERGY TBK PT	355,100	2,470.00	877,097,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	45,500	25,400.00	1,155,700,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK	175,600	1,975.00	346,810,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	909,184	770.00	700,071,680.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	89,700	8,950.00	802,815,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	292,209	3,370.00	984,744,330.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	101,289	6,950.00	703,958,550.00	
	VALE INDONESIA TBK	49,100	6,575.00	322,832,500.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	507,600	6,550.00	3,324,780,000.00	
	GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT	22,100,000	111.00	2,453,100,000.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	409,300	2,840.00	1,162,412,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	181,300	5,075.00	920,097,500.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	75,400	11,525.00	868,985,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	117,600	7,275.00	855,540,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	202,200	4,290.00	867,438,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	526,300	1,970.00	1,036,811,000.00	
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	1,473,900	9,100.00	13,412,490,000.00		



	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	999,900	5,500.00	5,499,450,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	207,300	9,025.00	1,870,882,500.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	1,816,545	5,600.00	10,172,652,000.00	
	SARANA MENARA NUSANTARA PT	412,300	1,025.00	422,607,500.00	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	1,327,300	3,900.00	5,176,470,000.00	
	インドネシアルピア 小計	32,374,627		53,937,744,560.00 (512,408,573)	
韓国ウォン	HD HYUNDAI	1,185	59,500.00	70,507,500.00	
	S-OIL CORP	1,083	72,500.00	78,517,500.00	
	SK INNOVATION CO LTD	1,402	196,500.00	275,493,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORP	2,898	43,200.00	125,193,600.00	
	HYUNDAI STEEL CO	2,249	33,950.00	76,353,550.00	
	KOREA ZINC CO LTD	231	469,500.00	108,454,500.00	
	KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	458	122,300.00	56,013,400.00	
	LG CHEM LTD	1,320	713,000.00	941,160,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	197	446,000.00	87,862,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORP	484	147,800.00	71,535,200.00	
	POSCO FUTURE M CO LTD	803	542,000.00	435,226,000.00	
	POSCO HOLDINGS INC	1,912	642,000.00	1,227,504,000.00	
	SK IE TECHNOLOGY CO LTD	775	100,000.00	77,500,000.00	
	SKC CO LTD	602	99,000.00	59,598,000.00	
	CJ CORP	425	62,900.00	26,732,500.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	1,487	60,000.00	89,220,000.00	
	DOOSAN ENERBILITY	11,421	17,280.00	197,354,880.00	
	ECOPRO BM CO LTD	1,314	404,500.00	531,513,000.00	
	GS HOLDINGS	1,411	38,200.00	53,900,200.00	
	HANWHA AEROSPACE CO LTD	957	129,100.00	123,548,700.00	
	HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	607	140,600.00	85,344,200.00	
	HD KOREA SHIPBUILDING & OFFS	1,038	126,400.00	131,203,200.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONST	2,000	37,800.00	75,600,000.00	
	HYUNDAI MIPO DOCKYARD	517	89,600.00	46,323,200.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	1,854	51,300.00	95,110,200.00	
	LG CORP	2,401	87,300.00	209,607,300.00	
	LG ENERGY SOLUTION	938	597,000.00	559,986,000.00	
	POSCO INTERNATIONAL CORP	1,476	66,000.00	97,416,000.00	

SAMSUNG C&T CORP	2,130	102,700.00	218,751,000.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	3,781	33,200.00	125,529,200.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	15,535	8,480.00	131,736,800.00	
SK	1,030	148,200.00	152,646,000.00	
SK SQUARE CO LTD	2,400	43,950.00	105,480,000.00	
HMM CO LTD	6,429	17,650.00	113,471,850.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	524	184,500.00	96,678,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	4,956	25,600.00	126,873,600.00	
PAN OCEAN CO LTD	5,356	4,805.00	25,735,580.00	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	1,948	36,350.00	70,809,800.00	
HANON SYSTEMS	3,541	8,710.00	30,842,110.00	
HYUNDAI MOBIS CO LTD	1,635	240,000.00	392,400,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	3,690	199,200.00	735,048,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	870	103,700.00	90,219,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	533	103,700.00	55,272,100.00	
KIA CORP	7,008	83,500.00	585,168,000.00	
COWAY CO LTD	1,442	43,100.00	62,150,200.00	
F&F CO LTD / NEW	518	99,700.00	51,644,600.00	
LG ELECTRONICS INC	2,914	120,000.00	349,680,000.00	
KANGWON LAND INC	3,072	15,890.00	48,814,080.00	
HYBE CO LTD	525	262,000.00	137,550,000.00	
KAKAO CORP	8,310	49,850.00	414,253,500.00	
KAKAO GAMES CORP	1,051	31,850.00	33,474,350.00	
KRAFTON INC	724	177,500.00	128,510,000.00	
NAVER CORP	3,490	203,000.00	708,470,000.00	
NCSOFT CORP	383	276,000.00	105,708,000.00	
NETMARBLE CORPORATION	392	47,150.00	18,482,800.00	
PEARL ABYSS CORP	960	56,500.00	54,240,000.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	885	70,600.00	62,481,000.00	
BGF RETAIL CO LTD/NEW	138	164,000.00	22,632,000.00	
E-MART INC	557	75,600.00	42,109,200.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	221	273,000.00	60,333,000.00	
KT&G CORP	2,766	82,000.00	226,812,000.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	591	117,800.00	69,619,800.00	
AMOREPACIFIC CORP	788	101,600.00	80,060,800.00	

LG H&H	260	432,500.00	112,450,000.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	2,829	64,100.00	181,338,900.00	
HLB INC	2,982	32,300.00	96,318,600.00	
CELLTRION INC	2,900	147,400.00	427,460,000.00	
CELLTRION PHARM INC	355	84,300.00	29,926,500.00	
HANMI PHARM CO LTD	214	278,000.00	59,492,000.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	477	742,000.00	353,934,000.00	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	783	84,600.00	66,241,800.00	
SK BIOSCIENCE CO LTD	710	74,900.00	53,179,000.00	
YUHAN CORP	1,526	65,900.00	100,563,400.00	
HANA FINANCIAL GROUP	7,972	38,500.00	306,922,000.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	6,372	10,160.00	64,739,520.00	
KAKAObANK CORP	4,052	24,800.00	100,489,600.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	10,410	47,650.00	496,036,500.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	11,243	33,300.00	374,391,900.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	15,149	11,670.00	176,788,830.00	
KAKAOPAY CORP	730	49,150.00	35,879,500.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	1,162	48,550.00	56,415,100.00	
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	2,513	47,800.00	120,121,400.00	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	5,653	6,830.00	38,609,990.00	
NH INVESTMENT & SECURITIES C	2,964	9,640.00	28,572,960.00	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	1,943	35,400.00	68,782,200.00	
DB INSURANCE CO LTD	1,260	71,300.00	89,838,000.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	856	236,500.00	202,444,000.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	2,205	68,400.00	150,822,000.00	
SAMSUNG SDS CO LTD	1,032	127,500.00	131,580,000.00	
COSMOAM&T CO LTD	620	212,000.00	131,440,000.00	
L&F CO LTD	644	281,000.00	180,964,000.00	
LG DISPLAY CO LTD	5,817	13,810.00	80,332,770.00	
LG INNOTEK CO LTD	384	279,000.00	107,136,000.00	
LOTTE ENERGY MATERIALS CORP	440	53,100.00	23,364,000.00	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	1,437	150,900.00	216,843,300.00	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	126,333	70,400.00	8,893,843,200.00	
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	21,845	58,300.00	1,273,563,500.00	
SAMSUNG SDI CO LTD	1,461	712,000.00	1,040,232,000.00	

	KT CORP	1,598	29,900.00	47,780,200.00	
	LG UPLUS CORP	6,485	10,270.00	66,600,950.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	7,197	19,440.00	139,909,680.00	
	SK HYNIX INC	14,474	114,000.00	1,650,036,000.00	
	韓国ウォン 小計	411,825		29,522,847,300.00 (3,256,370,057)	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	31,000	78.40	2,430,400.00	
	ASIA CEMENT CORP	54,000	38.20	2,062,800.00	
	CHINA STEEL CORP	315,000	29.40	9,261,000.00	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	88,000	64.10	5,640,800.00	
	FORMOSA PLASTICS CORP	102,000	82.20	8,384,400.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	127,000	70.00	8,890,000.00	
	TAIWAN CEMENT	152,917	36.50	5,581,470.50	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	3,600	958.00	3,448,800.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	92,000	29.15	2,681,800.00	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	1,500	1,770.00	2,655,000.00	
	WALSIN LIHWA CORP	74,000	39.10	2,893,400.00	
	CHINA AIRLINES LTD	75,000	25.30	1,897,500.00	
	EVA AIRWAYS CORP	66,000	36.75	2,425,500.00	
	EVERGREEN MARINE CORP LTD	27,420	99.30	2,722,806.00	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	55,000	30.05	1,652,750.00	
	WAN HAI LINES LTD	18,650	49.30	919,445.00	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	41,000	45.75	1,875,750.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	53,000	38.00	2,014,000.00	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	5,420	535.00	2,899,700.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	10,080	205.00	2,066,400.00	
	GIANT MANUFACTURING	9,000	241.50	2,173,500.00	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	5,000	311.50	1,557,500.00	
	POU CHEN	61,000	31.00	1,891,000.00	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	8,000	757.00	6,056,000.00	
MOMO.COM INC	2,000	618.00	1,236,000.00		
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	16,000	283.50	4,536,000.00		
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	130,000	76.30	9,919,000.00		
PHARMAESSENTIA CORP	7,000	357.00	2,499,000.00		
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	151,265	18.55	2,805,965.75		

CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	470,000	26.10	12,267,000.00	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	359,578	26.25	9,438,922.50	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	285,168	28.05	7,998,962.40	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	222,430	21.90	4,871,217.00	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	297,125	39.00	11,587,875.00	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	276,814	18.00	4,982,652.00	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	276,445	19.15	5,293,921.75	
TAIWAN BUSINESS BANK	172,000	14.10	2,425,200.00	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	244,741	28.20	6,901,696.20	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	106,000	43.50	4,611,000.00	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	38,245	205.00	7,840,225.00	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	251,437	24.10	6,059,631.70	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	252,000	44.20	11,138,400.00	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	414,000	12.25	5,071,500.00	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	198,825	62.60	12,446,445.00	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	366,835	9.12	3,345,535.20	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	14,000	401.50	5,621,000.00	
ACER INC	78,000	37.05	2,889,900.00	
ADVANTECH CO LTD	12,427	400.00	4,970,800.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	18,000	366.00	6,588,000.00	
AUO CORP	176,200	18.90	3,330,180.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	16,000	176.00	2,816,000.00	
COMPAL ELECTRONICS	100,000	31.65	3,165,000.00	
DELTA ELECTRONICS INC	52,000	361.00	18,772,000.00	
E INK HOLDINGS INC	24,000	208.50	5,004,000.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	330,800	108.00	35,726,400.00	
INNOLUX CORP	254,475	15.60	3,969,810.00	
INVENTEC CORP	73,000	70.20	5,124,600.00	
LARGAN PRECISION CO LTD	2,500	2,195.00	5,487,500.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	56,000	149.00	8,344,000.00	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	17,000	192.00	3,264,000.00	
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	6,000	261.50	1,569,000.00	
PEGATRON CORP	56,000	78.80	4,412,800.00	
QUANTA COMPUTER INC	72,000	248.50	17,892,000.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	34,000	58.40	1,985,600.00	

	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	35,000	199.50	6,982,500.00	
	WISTRON CORP	73,000	158.00	11,534,000.00	
	WIWYNN CORP	2,000	2,115.00	4,230,000.00	
	WPG HOLDINGS LTD	35,960	56.80	2,042,528.00	
	YAGEO CORPORATION	8,524	457.50	3,899,730.00	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	18,000	105.00	1,890,000.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	101,000	116.00	11,716,000.00	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	44,000	71.70	3,154,800.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	47,000	93.90	4,413,300.00	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	82,000	110.50	9,061,000.00	
	EEMORY TECHNOLOGY INC	1,800	1,965.00	3,537,000.00	
	GLOBAL UNICHIP CORP	2,300	1,885.00	4,335,500.00	
	GLOBALWAFERS CO LTD	6,000	508.00	3,048,000.00	
	MEDIATEK INC	39,800	675.00	26,865,000.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	30,000	69.30	2,079,000.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS COR	16,000	405.50	6,488,000.00	
	PARADE TECHNOLOGIES LTD	2,000	849.00	1,698,000.00	
	POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU	70,000	29.60	2,072,000.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	13,000	406.50	5,284,500.00	
	SILERGY CORP	8,640	327.00	2,825,280.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	652,000	558.00	363,816,000.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	298,000	45.05	13,424,900.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	21,000	77.60	1,629,600.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	9,000	172.50	1,552,500.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	77,000	27.25	2,098,250.00	
	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	49,608	35.15	1,743,721.20	
	新台湾ドル 小計	9,148,529		863,711,570.20 (3,897,066,604)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	19,660	389.55	7,658,553.00	
	COAL INDIA LTD	42,402	230.95	9,792,741.90	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	14,851	300.95	4,469,408.45	
	INDIAN OIL CORP LTD	70,217	99.85	7,011,167.45	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	81,360	171.00	13,912,560.00	
	PETRONET LNG LTD	18,996	223.85	4,252,254.60	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	80,649	2,487.40	200,606,322.60	

ACC LTD	1,469	1,804.60	2,650,957.40
AMBUJA CEMENTS LTD	13,736	422.75	5,806,894.00
ASIAN PAINTS LTD	10,272	3,543.70	36,400,886.40
BERGER PAINTS INDIA LTD	6,576	685.85	4,510,149.60
GRASIM INDUSTRIES LTD	7,281	1,813.05	13,200,817.05
HINDALCO INDUSTRIES LTD	31,670	432.95	13,711,526.50
JINDAL STEEL & POWER LTD	10,594	629.35	6,667,333.90
JSW STEEL LTD	15,763	775.65	12,226,570.95
PI INDUSTRIES LTD	2,083	3,631.20	7,563,789.60
PIDILITE INDUSTRIES LTD	4,189	2,651.60	11,107,552.40
SHREE CEMENT LTD	251	23,237.00	5,832,487.00
SRF LTD	4,133	2,144.35	8,862,598.55
TATA STEEL LTD	197,316	115.50	22,789,998.00
ULTRATECH CEMENT LTD	3,033	8,219.85	24,930,805.05
UPL LTD	13,811	632.15	8,730,623.65
VEDANTA LTD	18,821	271.30	5,106,137.30
ABB INDIA LTD	1,585	4,322.05	6,850,449.25
ADANI ENTERPRISES LTD	4,197	2,418.20	10,149,185.40
BHARAT ELECTRONICS LTD	102,464	126.00	12,910,464.00
CG POWER AND INDUSTRIAL SOLU	15,444	401.85	6,206,171.40
HAVELLS INDIA LTD	7,120	1,296.70	9,232,504.00
HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	2,237	3,885.25	8,691,304.25
LARSEN & TOUBRO LTD	18,402	2,605.25	47,941,810.50
SIEMENS LTD	2,310	3,694.90	8,535,219.00
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	6,472	620.30	4,014,581.60
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	14,130	735.30	10,389,789.00
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	7,859	680.55	5,348,442.45
INTERGLOBE AVIATION LTD	3,501	2,670.65	9,349,945.65
BAJAJ AUTO LTD	1,903	4,882.75	9,291,873.25
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	2,334	2,373.85	5,540,565.90
BHARAT FORGE LTD	6,216	852.20	5,297,275.20
EICHER MOTORS LTD	3,761	3,307.85	12,440,823.85
HERO MOTOCORP LTD	2,952	3,134.05	9,251,715.60
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	24,535	1,546.85	37,951,964.75
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	3,577	9,694.80	34,678,299.60

MRF LTD	54	102,723.50	5,547,069.00
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN	53,088	97.05	5,152,190.40
SONA BLW PRECISION FORGINGS	10,800	580.80	6,272,640.00
TATA MOTORS LTD	44,047	629.25	27,716,574.75
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LT	2,841	3,174.25	9,018,044.25
TVS MOTOR CO LTD	6,191	1,307.10	8,092,256.10
PAGE INDUSTRIES LTD	149	37,457.50	5,581,167.50
TITAN CO LTD	9,515	2,979.20	28,347,088.00
INDIAN HOTELS CO LTD	22,920	391.60	8,975,472.00
JUBILANT FOODWORKS LTD	10,195	467.00	4,761,065.00
ZOMATO LTD	116,147	81.30	9,442,751.10
INFO EDGE INDIA LTD	1,911	4,568.05	8,729,543.55
TRENT LTD	4,453	1,709.20	7,611,067.60
AVENUE SUPERMARTS LTD	4,103	3,668.20	15,050,624.60
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	3,003	4,968.90	14,921,606.70
ITC LTD	79,816	471.35	37,621,271.60
MARICO LTD	12,369	535.40	6,622,362.60
NESTLE INDIA LTD	851	22,820.10	19,419,905.10
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	15,548	863.10	13,419,478.80
UNITED SPIRITS LTD	7,422	977.65	7,256,118.30
VARUN BEVERAGES LTD	11,762	817.70	9,617,787.40
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	3,413	1,888.60	6,445,791.80
DABUR INDIA LTD	17,113	565.30	9,673,978.90
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	11,134	1,036.40	11,539,277.60
HINDUSTAN UNILEVER LTD	21,860	2,580.25	56,404,265.00
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	2,793	5,180.80	14,469,974.40
MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	20,500	611.65	12,538,825.00
AUROBINDO PHARMA LTD	7,383	785.30	5,797,869.90
CIPLA LTD	13,421	1,048.95	14,077,957.95
DIVI'S LABORATORIES LTD	3,145	3,686.00	11,592,470.00
DR. REDDY'S LABORATORIES	2,966	5,391.70	15,991,782.20
LUPIN LTD	4,421	936.80	4,141,592.80
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	25,785	1,100.40	28,373,814.00
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	2,579	1,941.00	5,005,839.00
AU SMALL FINANCE BANK LTD	5,313	739.15	3,927,103.95



AXIS BANK LTD	60,500	971.50	58,775,750.00
BANDHAN BANK LTD	19,777	218.65	4,324,241.05
BANK OF BARODA	27,026	198.35	5,360,607.10
HDFC BANK LIMITED	73,394	1,678.40	123,184,489.60
ICICI BANK LTD	136,870	992.00	135,775,040.00
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	28,784	1,897.25	54,610,444.00
STATE BANK OF INDIA	47,984	617.65	29,637,317.60
YES BANK LTD	275,079	17.40	4,786,374.60
BAJAJ FINANCE LTD	7,278	7,581.60	55,178,884.80
BAJAJ FINSERV LTD	9,746	1,657.50	16,153,995.00
BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMEN	806	7,428.10	5,987,048.60
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	11,638	1,145.35	13,329,583.30
MUTHOOT FINANCE LTD	2,371	1,296.75	3,074,594.25
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	7,713	859.80	6,631,637.40
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	7,408	1,796.30	13,306,990.40
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	24,553	653.15	16,036,791.95
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	5,683	1,387.50	7,885,162.50
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	8,896	570.20	5,072,499.20
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	11,421	1,317.15	15,043,170.15
HCL TECHNOLOGIES LTD	25,519	1,112.90	28,400,095.10
INFOSYS LTD	87,548	1,336.60	117,016,656.80
LTIMINDTREE LTD	2,255	4,879.05	11,002,257.75
MPHASIS LTD	1,924	2,272.60	4,372,482.40
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	24,319	3,394.75	82,556,925.25
TATA ELXSI LTD	853	7,256.70	6,189,965.10
TECH MAHINDRA LTD	14,666	1,161.85	17,039,692.10
WIPRO LTD	37,402	404.05	15,112,278.10
BHARTI AIRTEL LTD	59,315	888.15	52,680,617.25
ADANI GREEN ENERGY LTD	7,170	989.15	7,092,205.50
ADANI POWER LTD	20,741	238.00	4,936,358.00
GAIL INDIA LTD	58,140	112.05	6,514,587.00
INDRAPRASTHA GAS LTD	7,746	470.55	3,644,880.30
NTPC LTD	113,658	195.90	22,265,602.20
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	90,939	247.45	22,502,855.55
TATA POWER CO LTD	39,023	217.35	8,481,649.05

	DLF LTD	15,745	493.80	7,774,881.00	
	GODREJ PROPERTIES LTD	3,754	1,648.40	6,188,093.60	
	インドルピー 小計	2,836,787		2,148,957,850.40	(3,739,186,659)
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	16,008	16.53	264,612.24	
	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	68,061	4.24	289,191.18	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	107,154	1.91	205,628.52	
	INDUSTRIES QATAR	41,380	12.23	506,077.40	
	COMMERCIAL BANK PQSC	89,506	6.00	537,036.00	
	DUKHAN BANK	47,311	4.13	195,820.22	
	MASRAF AL RAYAN	156,266	2.48	388,633.54	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	26,217	10.11	265,053.87	
	QATAR ISLAMIC BANK	41,163	19.36	796,915.68	
	QATAR NATIONAL BANK	122,744	15.96	1,958,994.24	
	OOREDOO QPSC	18,307	11.31	207,052.17	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	11,535	18.11	208,898.85	
	BARWA REAL ESTATE CO	60,279	2.84	171,192.36	
	カタールリアル 小計	805,931		5,995,106.27	(233,269,584)
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	5,798	165.56	959,916.88	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	2,290	199.37	456,557.30	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	1,807	900.51	1,627,221.57	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	11,272	398.18	4,488,284.96	
	GOLD FIELDS LTD	23,923	273.27	6,537,438.21	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	15,256	80.32	1,225,361.92	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	23,265	130.50	3,036,082.50	
	KUMBA IRON ORE LTD	1,694	439.00	743,666.00	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	9,656	147.06	1,420,011.36	
	SASOL LTD	14,307	238.83	3,416,940.81	
	SIBANYE STILLWATER LTD	72,813	31.85	2,319,094.05	
	BIDVEST GROUP LTD	8,221	267.38	2,198,130.98	
	MULTICHOICE GROUP LTD	9,584	82.85	794,034.40	
	MR PRICE GROUP LTD	6,240	145.80	909,792.00	
	NASPERS LTD-N SHS	5,199	3,246.52	16,878,657.48	
PEPKOR HOLDINGS LTD	52,043	16.56	861,832.08		

	THE FOSCHINI GROUP LTD	10,240	96.09	983,961.60	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	22,905	76.71	1,757,042.55	
	BID CORP LTD	8,546	421.57	3,602,737.22	
	CLICKS GROUP LTD	6,931	258.99	1,795,059.69	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	12,899	242.86	3,132,651.14	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	9,547	193.81	1,850,304.07	
	ABSA GROUP LTD	22,911	182.54	4,182,173.94	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	2,173	1,663.00	3,613,699.00	
	NEDBANK GROUP LTD	12,732	228.88	2,914,100.16	
	STANDARD BANK GROUP LTD	35,808	187.00	6,696,096.00	
	FIRSTRAND LTD	134,868	70.98	9,572,930.64	
	REINET INVESTMENTS SCA	3,701	426.40	1,578,106.40	
	REMGRO LTD	14,915	157.51	2,349,261.65	
	DISCOVERY LTD	13,990	152.85	2,138,371.50	
	OLD MUTUAL LTD	121,527	12.60	1,531,240.20	
	OUTSURANCE GROUP LTD	22,382	37.96	849,620.72	
	SANLAM LTD	49,120	63.63	3,125,505.60	
	MTN GROUP LTD	45,604	134.75	6,145,139.00	
	VODACOM GROUP LTD	15,613	115.09	1,796,900.17	
	NEPI ROCKCASTLE N.V.	10,844	109.61	1,188,610.84	
	南アフリカランド 小計	840,624		108,676,534.59 (866,151,980)	
アラブディルハム	MULTIPLY GROUP	88,559	3.28	290,473.52	
	AMERICANA RESTAURANTS INTERN	70,134	3.78	265,106.52	
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	88,102	4.00	352,408.00	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	73,466	8.75	642,827.50	
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	35,275	11.26	397,196.50	
	DUBAI ISLAMIC BANK	80,564	5.70	459,214.80	
	EMIRATES NBD PJSC	47,764	16.20	773,776.80	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	117,934	14.30	1,686,456.20	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	92,661	22.36	2,071,899.96	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	106,834	5.24	559,810.16	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	179,649	6.70	1,203,648.30	
	アラブディルハム 小計	980,942		8,702,818.26 (336,015,813)	

クウェートディ ナール	AGILITY	35,573	0.64	22,766.72
	BOUBYAN BANK K.S.C	38,661	0.64	24,743.04
	GULF BANK	32,739	0.27	8,970.48
	KUWAIT FINANCE HOUSE	216,159	0.78	169,252.49
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	200,495	0.96	193,878.66
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	52,466	0.52	27,334.78
	MABANEE CO KPSC	20,333	0.86	17,506.71
クウェートディナール 小計		596,426		464,452.88 (214,540,074)
オフショア人民 元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	18,900	6.32	119,448.00
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	47,900	6.36	304,644.00
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	11,500	27.58	317,170.00
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-A	8,100	14.05	113,805.00
	GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	9,700	6.71	65,087.00
	INNER MONGOLIA DIAN TOU EN-A	2,700	13.50	36,450.00
	JIZHONG ENERGY RESOURCES-A	4,900	6.42	31,458.00
	OFFSHORE OIL ENGINEERING-A	10,500	6.40	67,200.00
	PETROCHINA CO LTD-A	33,500	7.96	266,660.00
	PINGDINGSHAN TIANAN COAL -A	3,200	7.61	24,352.00
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	15,700	16.10	252,770.00
	SHAN XI HUA YANG GROUP NEW-A	5,100	7.91	40,341.00
	SHANXI COKING COAL ENERGY-A	12,420	8.66	107,557.20
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	6,500	16.46	106,990.00
	YANKUANG ENERGY GROUP CO-A	6,736	17.61	118,620.96
	YANTAI JEREH OILFIELD-A	900	27.05	24,345.00
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	23,100	5.76	133,056.00
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	6,200	23.88	148,056.00
	ANHUI HONGLU STEEL CONSTRU-A	650	30.30	19,695.00
	ASIA-POTASH INTERNATIONAL-A	1,500	26.24	39,360.00
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	33,700	5.76	194,112.00
	BBMG CORPORATION-A	900	2.27	2,043.00
	CANMAX TECHNOLOGIES CO LTD-A	1,040	31.43	32,687.20
CHENGXIN LITHIUM GROUP CO-A	1,400	26.84	37,576.00	
CHINA JUSHI CO LTD -A	7,414	13.92	103,202.88	
CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	5,700	23.64	134,748.00	

CHINA RARE EARTH RESOURCES-A	1,900	29.64	56,316.00	
CMOC GROUP LTD-A	28,400	5.75	163,300.00	
CNGR ADVANCED MATERIAL CO -A	600	58.33	34,998.00	
CNNC HUA YUAN TITANIUM -A	4,785	5.65	27,035.25	
DO-FLUORIDE NEW MATERIALS -A	2,100	18.62	39,102.00	
GANFENG LITHIUM GROUP CO L-A	2,740	55.46	151,960.40	
GEM CO LTD-A	10,800	6.84	73,872.00	
GUANGDONG HEC TECHNOLOGY H-A	6,300	6.70	42,210.00	
GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	4,180	33.62	140,531.60	
HANGZHOU OXYGEN PLANT GROU-A	2,000	32.62	65,240.00	
HENAN SHENHUO COAL & POWER-A	3,500	14.07	49,245.00	
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	9,320	14.59	135,978.80	
HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	1,950	7.01	13,669.50	
HESTEEL CO LTD-A	1,500	2.24	3,360.00	
HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A	1,400	69.80	97,720.00	
HUAFON CHEMICAL CO LTD -A	4,600	7.38	33,948.00	
HUAIBEI MINING HOLDINGS CO-A	3,700	12.16	44,992.00	
HUAXIN CEMENT CO LTD-A	1,100	12.43	13,673.00	
HUBEI FEILIHUA QUARTZ GLAS-A	1,000	41.88	41,880.00	
HUBEI XINGFA CHEMICALS GRP-A	1,900	24.73	46,987.00	
HUNAN CHANGYUAN LICO CO LT-A	3,324	10.84	36,032.16	
HUNAN VALIN STEEL CO LTD -A	14,600	5.22	76,212.00	
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	73,300	1.79	131,207.00	
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	15,700	4.23	66,411.00	
INNER MONGOLIA YUAN XING-A	5,900	7.14	42,126.00	
JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	7,600	11.58	88,008.00	
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	390	69.78	27,214.20	
JIANGSU YOKE TECHNOLOGY-A	500	72.96	36,480.00	
JIANGXI COPPER CO LTD-A	2,000	18.92	37,840.00	
JINDUICHENG MOLYBDENUM CO -A	6,700	11.00	73,700.00	
LB GROUP CO LTD-A	4,500	17.29	77,805.00	
LUXI CHEMICAL GROUP CO LT-A	1,900	10.42	19,798.00	
LUXIANG COMPANY,LTD.	400	59.60	23,840.00	
NINGBO SHANSHAN CO LTD-A	2,300	14.73	33,879.00	
NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	11,900	13.39	159,341.00	

PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	18,100	3.90	70,590.00
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY-A	8,400	19.09	160,356.00
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	15,750	11.98	188,685.00
SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A	8,090	15.28	123,615.20
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	6,368	25.57	162,829.76
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	3,520	32.35	113,872.00
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	10,000	3.07	30,700.00
SHANDONG SUN PAPER INDUSTR-A	2,200	11.10	24,420.00
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	4,408	37.15	163,757.20
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	3,700	7.44	27,528.00
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	4,800	4.01	19,248.00
SHENGHE RESOURCES HOLDINGS-A	1,700	12.24	20,808.00
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	1,080	48.19	52,045.20
SHENZHEN DYNANONIC CO LTD-A	320	108.41	34,691.20
SHENZHEN SENIOR TECHNOLOGY-A	1,798	16.18	29,091.64
SHENZHEN YUTO PACKAGING TE-A	1,700	25.08	42,636.00
SICHUAN HEBANG BIOTECHNOL- A	14,200	2.59	36,778.00
SICHUAN YAHUA INDUSTRIAL-A	1,900	16.77	31,863.00
SINOMA SCIENCE&TECHNOLOGY -A	2,200	19.78	43,516.00
SINOMINE RESOURCE GROUP CO-A	980	44.66	43,766.80
SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A	600	3.08	1,848.00
SKSHU PAINT CO LTD-A	784	68.30	53,547.20
SUNRESIN NEW MATERIALS CO -A	1,200	59.16	70,992.00
TANGSHAN JIDONG CEMENT INV-A	3,700	7.55	27,935.00
TIANQI LITHIUM CORP-A	2,300	63.04	144,992.00
TIANSHAN ALUMINUM GROUP CO-A	7,500	6.51	48,825.00
TIBET SUMMIT RESOURCES CO-A	1,500	17.20	25,800.00
TONGKUN GROUP CO LTD-A	1,500	14.41	21,615.00
TONGLING NONFERROUS METALS-A	10,400	3.08	32,032.00
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	5,500	92.00	506,000.00
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	640	29.01	18,566.40
WESTERN MINING CO -A	3,300	11.49	37,917.00
WESTERN SUPERCONDUCTING TE-A	560	51.65	28,924.00
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD-A	1,200	18.37	22,044.00
XINJIANG ZHONGTAI CHEMICAL-A	4,100	6.83	28,003.00

YINTAI GOLD CO LTD-A	2,380	13.25	31,535.00
YONGXING SPECIAL MATERIALS-A	910	51.68	47,028.80
YUNNAN ALUMINIUM CO LTD-A	7,300	13.15	95,995.00
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	1,400	90.85	127,190.00
YUNNAN TIN CO LTD-A	3,500	15.85	55,475.00
YUNNAN YUNTIANHUA CO-A	1,500	17.94	26,910.00
ZANGGE MINING CO LTD-A	3,300	22.72	74,976.00
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	2,708	49.25	133,369.00
ZHEJIANG JUHUA CO-A	5,700	15.38	87,666.00
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	6,700	9.49	63,583.00
ZHONGJIN GOLD CORP-A	10,000	10.96	109,600.00
ZIBO QIXIANG TENGDA CHEMIC-A	4,500	6.48	29,160.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	36,000	12.43	447,480.00
AECC AERO-ENGINE CONTROL-A	1,000	22.92	22,920.00
AECC AVIATION POWER CO-A	4,600	40.27	185,242.00
AVICOPTER PLC-A	500	40.46	20,230.00
BEIJING EASPRING MATERIAL-A	700	46.71	32,697.00
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	3,700	24.54	90,798.00
BEIJING UNITED INFORMATION-A	841	34.42	28,947.22
CHINA BAOAN GROUP-A	4,500	11.46	51,570.00
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	6,900	32.27	222,663.00
CHINA ENERGY ENGINEERING COR	52,300	2.35	122,905.00
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	9,700	8.25	80,025.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	31,200	7.66	238,992.00
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	73,200	5.56	406,992.00
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	6,960	218.98	1,524,100.80
COSCO SHIPPING DEVELOPMENT CO	18,400	2.51	46,184.00
CRRG CORP LTD-A	36,500	6.46	235,790.00
DAJIN HEAVY INDUSTRY CO LT-A	1,200	29.47	35,364.00
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	4,400	19.10	84,040.00
EVE ENERGY CO LTD-A	3,020	54.64	165,012.80
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	417	5.94	2,476.98
FAW JIEFANG GROUP CO LTD-A	3,200	8.94	28,608.00
GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A	600	95.60	57,360.00
GOLDWIND SCIENCE &TECHNOL-A	3,400	10.82	36,788.00

GOODWE TECHNOLOGIES CO LTD-A	280	158.41	44,354.80
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	3,900	25.79	100,581.00
GUANGDONG KINLONG HARDWARE-A	400	56.31	22,524.00
GUANGZHOU GREAT POWER ENER-A	1,000	46.28	46,280.00
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	1,680	33.05	55,524.00
HOYMILES POWER ELECTRONICS-A	298	334.73	99,749.54
HOYUAN GREEN ENERGY CO LTD	978	47.98	46,924.44
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	2,436	66.18	161,214.48
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	5,300	15.54	82,362.00
JIANGXI SPECIAL ELECTRIC -A	2,500	11.48	28,700.00
KEDA INDUSTRIAL GROUP CO LTD	2,800	10.82	30,296.00
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A	2,200	14.59	32,098.00
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	39,700	4.01	159,197.00
MING YANG SMART ENERGY GRO-A	4,300	16.57	71,251.00
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	11,682	23.83	278,382.06
NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO -A	540	128.20	69,228.00
NINGBO ORIENT WIRES & CABL-A	1,000	44.62	44,620.00
NINGBO RONBAY NEW ENERGY T-A	450	48.20	21,690.00
NORTH INDUSTRIES GROUP RED-A	2,400	17.16	41,184.00
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	26,400	5.67	149,688.00
PYLON TECHNOLOGIES CO LTD-A	200	173.66	34,732.00
RIYUE HEAVY INDUSTRY CO LT-A	2,000	17.67	35,340.00
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	12,600	17.13	215,838.00
SHANGHAI CONSTRUCTION GROU-A	5,600	2.79	15,624.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	24,000	4.65	111,600.00
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	2,400	66.66	159,984.00
SHENZHEN KSTAR SCIENCE AND-A	1,200	33.92	40,704.00
SICHUAN NEW ENERGY POWER CO	2,400	14.10	33,840.00
SICHUAN ROAD&BRIDGE GROUP-A	13,860	9.67	134,026.20
SIEYUAN ELECTRIC CO LTD-A	1,500	50.67	76,005.00
SINOMA INTERNATIONAL ENGIN-A	5,500	12.54	68,970.00
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	2,200	106.90	235,180.00
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	1,300	15.53	20,189.00
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	409	182.80	74,765.20
TBEA CO LTD-A	10,920	16.08	175,593.60



TITAN WIND ENERGY SUZHOU-A	2,800	13.78	38,584.00
WEICHAI POWER CO LTD-A	9,500	12.57	119,415.00
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	20,700	7.02	145,314.00
XIAMEN C & D INC-A	4,400	9.19	40,436.00
ZHEFU HOLDING GROUP CO LTD-A	5,300	4.26	22,578.00
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	4,100	27.26	111,766.00
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	420	59.92	25,166.40
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	3,800	27.06	102,828.00
ZHEJIANG WEIXING NEW BUILD-A	1,300	20.01	26,013.00
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-A	800	41.63	33,304.00
ZHUZHOU KIBING GROUP CO LT-A	4,000	8.31	33,240.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	15,500	6.61	102,455.00
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	1,800	42.55	76,590.00
ZHEJIANG WEIMING ENVIRONME-A	2,340	17.43	40,786.20
AIR CHINA LTD-A	11,400	8.83	100,662.00
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	56,400	5.49	309,636.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	24,800	4.74	117,552.00
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	17,600	6.60	116,160.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	20,770	9.85	204,584.50
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	24,100	7.19	173,279.00
HAINAN AIRLINES HOLDING CO-A	81,700	1.60	130,720.00
JUNEYAO AIRLINES CO LTD-A	3,500	17.60	61,600.00
LIAONING PORT CO LTD-A	21,900	1.61	35,259.00
S F HOLDING CO LTD-A	8,600	46.36	398,696.00
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	2,100	43.78	91,938.00
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	8,900	5.27	46,903.00
SPRING AIRLINES CO LTD-A	1,900	61.66	117,154.00
YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	7,400	15.39	113,886.00
YUNDA HOLDING CO LTD-A	4,870	9.70	47,239.00
BETHEL AUTOMOTIVE SAFETY S-A	900	82.28	74,052.00
BYD CO LTD -A	2,800	257.50	721,000.00
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	200	130.80	26,160.00
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	10,226	13.27	135,699.02
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	3,400	36.39	123,726.00
GREAT WALL MOTOR CO LTD-A	3,300	24.89	82,137.00

GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A	6,900	10.71	73,899.00	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	7,100	18.10	128,510.00	
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	1,000	151.50	151,500.00	
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	1,200	19.14	22,968.00	
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	1,900	71.28	135,432.00	
SAIC MOTOR CORP LTD-A	12,410	14.23	176,594.30	
SAILUN GROUP CO LTD-A	3,100	11.05	34,255.00	
SERES GROUP CO L-A	3,100	40.84	126,604.00	
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	1,300	23.64	30,732.00	
SHENZHEN KEDALI INDUSTRY C-A	400	120.60	48,240.00	
BEIJING ROBOROCK TECHNOLOG-A	280	254.48	71,254.40	
ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A	600	70.38	42,228.00	
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	4,600	36.62	168,452.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-A	9,400	22.68	213,192.00	
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	1,000	24.66	24,660.00	
JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	1,040	39.81	41,402.40	
OPPEIN HOME GROUP INC-A	1,040	91.33	94,983.20	
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	31,790	4.26	135,425.40	
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	300	50.12	15,036.00	
BTG HOTELS GROUP CO LTD-A	1,600	19.75	31,600.00	
OFFCN EDUCATION TECHNOLOGY-A	10,200	4.55	46,410.00	
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	1,700	45.47	77,299.00	
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	8,300	4.50	37,350.00	
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	5,080	12.73	64,668.40	
37 INTERACTIVE ENTERTAINME-A	3,900	27.26	106,314.00	
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	1,300	8.08	10,504.00	
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	23,800	7.10	168,980.00	
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY XI	100	407.11	40,711.00	
GIANT NETWORK GROUP CO LTD-A	4,100	14.56	59,696.00	
KUNLUN TECH CO LTD-A	2,500	38.27	95,675.00	
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	3,110	33.14	103,065.40	
PERFECT WORLD CO LTD-A	4,450	14.86	66,127.00	
WANDA FILM HOLDING CO LTD-A	4,500	14.03	63,135.00	
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	17,100	5.71	97,641.00	
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	3,400	111.27	378,318.00	

SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	5,000	7.19	35,950.00
WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A	6,000	4.90	29,400.00
DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	1,036	26.85	27,816.60
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	2,164	37.06	80,197.84
ANGEL YEAST CO LTD-A	700	35.35	24,745.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	600	248.09	148,854.00
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	500	53.73	26,865.00
ANHUI YINGJIA DISTILLERY C-A	600	65.44	39,264.00
ANJOY FOODS GROUP CO LTD	400	148.50	59,400.00
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	6,600	6.83	45,078.00
BEIJING YANJING BREWERY CO-A	3,900	11.02	42,978.00
CHONGQING BREWERY CO-A	800	85.70	68,560.00
CHONGQING FULING ZHACAI -A	910	18.00	16,380.00
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	8,170	43.75	357,437.50
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	900	20.39	18,351.00
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	2,800	47.61	133,308.00
HEBEI YANGYUAN ZHIHUI BEVERA	2,600	25.70	66,820.00
HEILONGJIANG AGRICULTURE-A	2,500	14.04	35,100.00
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	7,400	24.32	179,968.00
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	11,500	27.27	313,605.00
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	2,000	55.69	111,380.00
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	2,700	133.29	359,883.00
JIUGUI LIQUOR CO LTD-A	400	94.07	37,628.00
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	300	34.65	10,395.00
JUEWEI FOOD CO LTD-A	300	36.85	11,055.00
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	2,000	1,771.15	3,542,300.00
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	2,500	223.07	557,675.00
MEIHUA HOLDINGS GROUP CO -A	5,400	9.03	48,762.00
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	9,416	42.74	402,439.84
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	7,600	11.77	89,452.00
SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT-A	1,372	35.03	48,061.16
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	2,120	209.30	443,716.00
SHEDE SPIRITS CO LTD-A	700	127.68	89,376.00
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	400	63.67	25,468.00
TOLY BREAD CO LTD-A	1,176	9.92	11,665.92

TSINGTAO BREWERY CO LTD-A	1,500	95.67	143,505.00	
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	10,060	18.82	189,329.20	
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	6,400	169.36	1,083,904.00	
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	2,200	39.80	87,560.00	
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	1,100	15.96	17,556.00	
BY-HEALTH CO LTD-A	1,300	20.89	27,157.00	
YUNNAN BOTANEE BIO-TECHNOL-A	400	92.03	36,812.00	
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	13,168	19.63	258,487.84	
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD-A	1,000	55.71	55,710.00	
CHINA MEHECO CO LTD -A	2,240	13.11	29,366.40	
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	3,300	31.24	103,092.00	
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	700	71.79	50,253.00	
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	2,940	44.39	130,506.60	
IRAY TECHNOLOGY CO LTD-A	280	276.00	77,280.00	
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	1,180	22.07	26,042.60	
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A	500	35.08	17,540.00	
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	5,960	9.97	59,421.20	
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	1,900	21.62	41,078.00	
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	8,380	7.21	60,419.80	
OVCTEK CHINA INC-A	920	32.19	29,614.80	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	4,400	20.31	89,364.00	
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	1,900	297.72	565,668.00	
SHENZHEN NEW INDUSTRIES BI-A	1,000	62.02	62,020.00	
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	300	106.76	32,028.00	
APELOA PHARMACEUTICAL CO-A	900	17.06	15,354.00	
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	680	118.38	80,498.40	
BEIJING TIAN TAN BIOLOGICAL-A	3,300	25.47	84,051.00	
BEIJING TONGRENTANG CO-A	2,300	52.02	119,646.00	
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	1,015	66.98	67,984.70	
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	300	51.89	15,567.00	
BGI GENOMICS CO LTD-A	300	58.05	17,415.00	
BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY COR-A	800	93.30	74,640.00	
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	700	143.28	100,296.00	
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	1,500	54.20	81,300.00	
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	4,050	46.49	188,284.50	

DAAN GENE CO LTD-A	960	9.94	9,542.40
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	1,200	52.25	62,700.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	300	64.38	19,314.00
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	4,680	22.45	105,066.00
HUBEI JUMPCAN PHARMACEUT-A	1,300	28.00	36,400.00
HUMANWELL HEALTHCARE GROUP-A	3,800	24.68	93,784.00
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	300	444.50	133,350.00
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	11,016	47.29	520,946.64
JOINCARE PHARMACEUTICAL GR-A	1,600	12.41	19,856.00
JOINN LABORATORIES CHINA C-A	784	37.23	29,188.32
LIVZON PHARMACEUTICAL GROU-A	500	37.61	18,805.00
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	1,098	13.80	15,152.40
PHARMARON BEIJING CO LTD-A	2,450	37.87	92,781.50
PORTON PHARMA SOLUTIONS L-A	800	27.29	21,832.00
SHANDONG BUCHANG PHARMACEU-A	260	20.21	5,254.60
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	3,600	30.87	111,132.00
SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCE-A	835	39.79	33,224.65
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	10,500	7.55	79,275.00
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	960	28.99	27,830.40
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	1,700	33.56	57,052.00
SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A	2,600	24.32	63,232.00
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	2,400	28.60	68,640.00
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	3,000	26.51	79,530.00
WUXI APPTec CO LTD-A	3,728	67.73	252,497.44
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	2,960	53.22	157,531.20
ZHANGZHOU PIENZEHUANG PHA-A	900	277.53	249,777.00
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	1,210	18.15	21,961.50
ZHEJIANG JIUZHOU PHARMACEU-A	1,300	25.24	32,812.00
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	5,463	16.29	88,992.27
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A	400	34.79	13,916.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	125,400	3.43	430,122.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	32,600	4.57	148,982.00
BANK OF CHANGSHA CO LTD-A	7,500	7.71	57,825.00
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	5,400	12.83	69,282.00
BANK OF CHINA LTD-A	52,600	3.71	195,146.00

BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	62,200	5.52	343,344.00	
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	13,000	11.31	147,030.00	
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	23,800	6.97	165,886.00	
BANK OF NANJING CO LTD -A	15,500	8.15	126,325.00	
BANK OF NINGBO CO LTD -A	9,900	24.47	242,253.00	
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	24,610	6.00	147,660.00	
BANK OF SUZHOU CO LTD-A	5,100	6.64	33,864.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	9,200	5.88	54,096.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	78,400	2.96	232,064.00	
CHINA MERCHANTS BANK-A	34,000	31.45	1,069,300.00	
CHINA MINSHENG BANKING-A	46,000	3.91	179,860.00	
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	21,970	2.58	56,682.60	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-A	8,500	3.74	31,790.00	
HUAXIA BANK CO LTD-A	24,300	5.54	134,622.00	
IND & COMM BK OF CHINA-A	94,400	4.57	431,408.00	
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	35,300	15.66	552,798.00	
PING AN BANK CO LTD-A	34,400	11.26	387,344.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	42,400	4.75	201,400.00	
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	44,600	7.13	317,998.00	
SHANGHAI RURAL COMMERCIAL -A	13,500	5.66	76,410.00	
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A	13,900	3.77	52,403.00	
BOC INTERNATIONAL CHINA CO-A	3,000	10.50	31,500.00	
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	8,800	7.50	66,000.00	
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	6,800	6.06	41,208.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-A	8,000	11.66	93,280.00	
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	3,000	8.13	24,390.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPTAL-A	3,500	35.96	125,860.00	
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	11,900	13.94	165,886.00	
CITIC SECURITIES CO-A	21,500	20.39	438,385.00	
CSC FINANCIAL CO LTD-A	7,500	24.45	183,375.00	
DONGXING SECURITIES CO LT-A	6,200	8.19	50,778.00	
EAST MONEY INFORMATION CO-A	27,812	14.09	391,871.08	
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	6,600	16.36	107,976.00	
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	500	5.75	2,875.00	
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	17,000	6.73	114,410.00	

GF SECURITIES CO LTD-A	9,500	14.69	139,555.00
GUANGZHOU YUEXIU CAPITAL H-A	4,374	6.44	28,168.56
GUOLIAN SECURITIES CO LTD-A	2,200	9.14	20,108.00
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	11,300	9.04	102,152.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	12,000	14.45	173,400.00
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	9,500	6.70	63,650.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	18,700	9.60	179,520.00
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	1,000	157.49	157,490.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	13,100	14.66	192,046.00
HUAXI SECURITIES CO LTD-A	300	8.31	2,493.00
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	16,300	6.31	102,853.00
NANJING SECURITIES CO LTD	7,600	8.17	62,092.00
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	10,800	9.75	105,300.00
SDIC CAPITAL CO LTD-A	11,000	7.32	80,520.00
SHANXI SECURITIES CO LTD-A	400	5.78	2,312.00
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	45,600	4.65	212,040.00
SINOLINK SECURITIES CO LTD-A	7,700	8.80	67,760.00
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	9,700	7.59	73,623.00
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	3,800	3.76	14,288.00
WESTERN SECURITIES CO LTD-A	10,000	6.62	66,200.00
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	6,000	10.01	60,060.00
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD-A	10,500	6.97	73,185.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	4,500	31.60	142,200.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	11,100	26.14	290,154.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	3,800	38.39	145,882.00
PICC HOLDING CO-A	15,500	5.90	91,450.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	16,500	46.62	769,230.00
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	11,700	11.73	137,241.00
BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	800	415.36	332,288.00
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	4,674	13.58	63,472.92
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	1,170	50.54	59,131.80
DHC SOFTWARE CO LTD -A	400	6.71	2,684.00
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	3,073	36.64	112,594.72
IFLYTEK CO LTD - A	3,600	63.41	228,276.00
NAVINFO CO LTD-A	4,800	11.15	53,520.00

QI AN XIN TECHNOLOGY GROUP-A	1,252	48.61	60,859.72
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	900	107.91	97,119.00
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	2,995	50.43	151,037.85
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	900	89.38	80,442.00
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	5,908	18.14	107,171.12
AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A	2,300	23.96	55,108.00
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	57,300	4.18	239,514.00
CETC CYBERSPACE SECURITY T-A	1,300	26.09	33,917.00
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	4,500	31.96	143,820.00
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	6,700	12.16	81,472.00
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-A	11,000	5.86	64,460.00
CHINA ZHENHUA GROUP SCIENC-A	1,200	93.28	111,936.00
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	17,600	23.66	416,416.00
GOERTEK INC -A	6,100	17.43	106,323.00
GRG BANKING EQUIPMENT CO -A	2,200	11.35	24,970.00
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	6,900	6.68	46,092.00
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICAT-A	300	10.17	3,051.00
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	1,500	60.85	91,275.00
HENGDIAN GROUP DMEGC -A	2,700	17.03	45,981.00
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO-A	3,700	15.03	55,611.00
HUAGONG TECH CO LTD-A	2,700	39.43	106,461.00
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	2,400	45.86	110,064.00
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	9,600	12.02	115,392.00
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	10,433	32.03	334,168.99
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	576	113.70	65,491.20
NINESTAR CORP-A	1,800	33.36	60,048.00
RAYTRON TECHNOLOGY CO LTD-A	700	45.77	32,039.00
SHANGHAI FRIENDESS ELECTRO-A	280	210.33	58,892.40
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	2,300	15.83	36,409.00
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	780	77.58	60,512.40
SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY-A	3,500	19.50	68,250.00
SHENZHEN SUNLORD ELECTRONI-A	800	25.23	20,184.00
SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	1,794	127.75	229,183.50
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	3,300	22.49	74,217.00
TIANJIN712 COMMUNICATION &-A	700	28.60	20,020.00



TIANMA MICROELECTRONICS-A	2,400	9.25	22,200.00
UNISPLENDOR CORP LTD-A	4,876	28.25	137,747.00
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	2,700	44.17	119,259.00
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	3,464	8.29	28,716.56
MUS PRINTED CIRCUIT KUNSHA-A	1,760	24.19	42,574.40
XIAMEN FARATRONIC CO LTD-A	400	130.67	52,268.00
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	2,240	40.90	91,616.00
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	6,300	20.85	131,355.00
ZHEJIANG SUPCON TECHNOLOGY-A	870	54.48	47,397.60
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	1,700	131.00	222,700.00
ZTE CORP-A	6,400	41.18	263,552.00
CHINA UNITED NETWORK-A	46,500	5.18	240,870.00
CECEP SOLAR ENERGY CO LT-A	6,500	6.48	42,120.00
CECEP WIND POWER CORP-A	7,900	3.55	28,045.00
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	32,500	7.14	232,050.00
CHINA THREE GORGES RENEWAB-A	42,200	5.29	223,238.00
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	35,300	21.56	761,068.00
DATANG INTL POWER GEN CO-A	20,000	3.11	62,200.00
ENN NATURAL GAS CO LTD-A	4,800	18.80	90,240.00
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	31,000	3.59	111,290.00
HUADIAN POWER INTL CORP-A	12,500	6.03	75,375.00
HUANENG POWER INTL INC-A	18,200	9.26	168,532.00
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	13,800	12.70	175,260.00
SHANGHAI ELECTRIC POWER CO-A	7,100	10.28	72,988.00
SHENZHEN ENERGY GROUP CO L-A	11,600	6.74	78,184.00
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A	5,200	14.81	77,012.00
ZHEJIANG ZHENENG ELECTRIC-A	21,300	5.04	107,352.00
3PEAK INC-A	200	233.35	46,670.00
ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	943	132.09	124,560.87
AMLOGIC SHANGHAI INC-A	600	92.13	55,278.00
CAMBRICON TECHNOLOGIES-A	800	167.16	133,728.00
CHINA RESOURCES MICROELECT-A	2,200	54.60	120,120.00
FLAT GLASS GROUP CO LTD-A	2,300	33.45	76,935.00
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR I-A	1,356	110.93	150,421.08
HANGZHOU CHANG CHUAN TECHN-A	1,300	41.45	53,885.00

HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	2,352	32.33	76,040.16
HANGZHOU LION ELECTRONICS -A	1,000	36.09	36,090.00
HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	2,000	29.62	59,240.00
INGENIC SEMICONDUCTOR CO -A	1,200	90.13	108,156.00
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	4,312	31.97	137,854.64
JCET GROUP CO LTD-A	3,800	34.30	130,340.00
JIANGSU PACIFIC QUARTZ CO -A	700	102.79	71,953.00
JINKO SOLAR CO LTD-A	13,400	11.98	160,532.00
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	12,936	28.34	366,606.24
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A	1,514	58.59	88,705.26
NATIONAL SILICON INDUSTRY -A	5,600	20.61	115,416.00
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	900	267.44	240,696.00
RISEN ENERGY CO LTD-A	2,400	23.10	55,440.00
SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	9,900	16.41	162,459.00
SG MICRO CORP-A	1,007	83.48	84,064.36
SHANGHAI AIKO SOLAR ENERGY-A	3,220	26.58	85,587.60
SHANGHAI FUDAN MICROELE-DO-A	800	55.35	44,280.00
SHENZHEN SC NEW ENERGY TEC-A	300	97.00	29,100.00
STARPOWER SEMICONDUCTOR LT-A	200	212.72	42,544.00
TCL ZHONGHUAN RENEWABLE EN-A	5,375	28.72	154,370.00
TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	1,900	9.67	18,373.00
TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	3,200	23.91	76,512.00
TONGWEI CO LTD-A	6,600	33.19	219,054.00
TRINA SOLAR CO LTD-A	3,200	35.34	113,088.00
UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	1,819	88.22	160,472.18
VERISILICON MICROELECTRONI-A	1,000	65.86	65,860.00
WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	2,185	101.18	221,078.30
WUXI AUTOWELL TECHNOLOGY C-A	400	178.39	71,356.00
XINJIANG DAQO NEW ENERGY C-A	3,600	40.30	145,080.00
YANGZHOU YANGJIE ELECTRONI-A	700	40.88	28,616.00
ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	1,800	62.32	112,176.00
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	12,100	12.43	150,403.00
CHINA VANKE CO LTD -A	16,400	13.80	226,320.00
GEMDALE CORP-A	7,200	6.84	49,248.00
HAINAN AIRPORT INFRASTRUCT-A	21,800	4.12	89,816.00

	HANGZHOU BINJIANG REAL EST-A	5,600	8.78	49,168.00	
	POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	17,400	12.61	219,414.00	
	SHANGHAI LINGANG HOLDINGS-A	1,680	12.23	20,546.40	
	YOUNGOR GROUP CO-A	3,100	6.67	20,677.00	
	ZHEJIANG CHINA COMMODITIES-A	13,000	8.17	106,210.00	
	オフショア人民元 小計	4,121,493		61,532,226.02 (1,212,941,698)	
サウジアラビア リアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	7,849	10.60	83,199.40	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	70,868	32.25	2,285,493.00	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	3,568	46.60	166,268.80	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	8,294	14.50	120,263.00	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	6,122	131.60	805,655.20	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	10,211	36.90	376,785.90	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	34,492	42.80	1,476,257.60	
	SAUDI ARAMCO BASE OIL CO	1,374	145.60	200,054.40	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	23,960	85.20	2,041,392.00	
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	9,618	25.00	240,450.00	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	18,931	12.64	239,287.84	
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	7,669	46.70	358,142.30	
	SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	1,076	170.80	183,780.80	
	JARIR MARKETING CO	14,720	15.82	232,870.40	
	NAHDI MEDICAL CO	871	174.60	152,076.60	
	ALMARAI CO	6,924	65.90	456,291.60	
	SAVOLA	6,673	41.10	274,260.30	
	DALLAH HEALTHCARE CO	835	180.00	150,300.00	
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	2,355	296.40	698,022.00	
	MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	1,322	262.40	346,892.80	
	AL RAJHI BANK	51,979	73.90	3,841,248.10	
	ALINMA BANK	24,489	36.65	897,521.85	
	ARAB NATIONAL BANK	16,584	28.25	468,498.00	
BANK AL-JAZIRA	11,133	18.28	203,511.24		
BANK ALBILAD	13,423	45.15	606,048.45		
BANQUE SAUDI FRANSI	16,111	44.15	711,300.65		
RIYAD BANK	38,641	34.40	1,329,250.40		
SAUDI AWWAL BANK	26,419	40.80	1,077,895.20		

SAUDI INVESTMENT BANK/THE	13,432	17.52	235,328.64	
THE SAUDI NATIONAL BANK	78,054	40.30	3,145,576.20	
SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING	1,363	197.40	269,056.20	
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	1,990	184.20	366,558.00	
ARABIAN INTERNET & COMMUNICA	542	364.00	197,288.00	
ELM CO	642	694.00	445,548.00	
ETIHAD ETISALAT CO	10,475	49.05	513,798.75	
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	13,459	13.76	185,195.84	
SAUDI TELECOM CO	52,586	45.80	2,408,438.80	
ACWA POWER CO	2,007	184.60	370,492.20	
SAUDI ELECTRICITY CO	21,376	22.86	488,655.36	
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	14,772	16.16	238,715.52	
EMAAR ECONOMIC CITY	8,295	9.12	75,650.40	
サウジアラビアリアル 小計	655,504		28,963,319.74 (1,091,627,521)	
合 計	159,081,968		25,613,009,125 (25,613,009,125)	

(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	1,911,528.00	
		OPERADORA DE SITES MEX- A-1	33,000	533,280.00	
	メキシコペソ 小計		109,400	2,444,808.00 (20,547,144)	
	南アフリカランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	81,251	1,029,450.17	
		南アフリカランド 小計	81,251	1,029,450.17 (8,204,717)	
	合 計				28,751,861 (28,751,861)

(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%		2.5%
メキシコペソ	株式 21銘柄	97.1%		2.7%
	投資証券 2銘柄		2.9%	0.1%
ブラジルリアル	株式 47銘柄	100.0%		5.7%
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%		22.0%
マレーシアリングット	株式 33銘柄	100.0%		1.4%
タイバーツ	株式 42銘柄	100.0%		2.0%
フィリピンペソ	株式 15銘柄	100.0%		0.7%
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%		15.1%
インドルピー	株式 114銘柄	100.0%		14.6%
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%		4.3%

(注) 時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

## R M国内債券マザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）	
2023年 7月25日現在	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
金銭信託	509,392
コール・ローン	959,303,448
国債証券	136,237,564,090
地方債証券	7,392,042,190
特殊債券	8,670,155,392
社債券	6,318,945,000
未収入金	731,285,600
未収利息	183,336,524
前払費用	50,413,947
流動資産合計	160,543,555,583
<b>資産合計</b>	<b>160,543,555,583</b>
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払金	100,000,000
未払解約金	988,319,200
未払利息	2,601
流動負債合計	1,088,321,801
<b>負債合計</b>	<b>1,088,321,801</b>
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	156,564,944,985
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	2,890,288,797
元本等合計	159,455,233,782
<b>純資産合計</b>	<b>159,455,233,782</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>160,543,555,583</b>

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## (貸借対照表に関する注記)

2023年 7月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月26日
期首元本額	137,316,275,841円
期中追加設定元本額	115,726,818,219円
期中一部解約元本額	96,478,149,075円
期末元本額	156,564,944,985円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	12,843,743,709円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	9,750,099,567円
りそなラップ型ファンド(成長型)	2,370,364,550円
DCりそな グローバルバランス	946,080,326円
つみたてバランスファンド	7,107,817,779円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	5,618,684,666円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	1,602,599,049円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	504,158,054円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	845,285,135円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	261,202,221円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	62,070,871円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	73,210,665円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定型)	122,392,626円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定成長型)	88,569,991円
りそな つみたてラップ型ファンド(成長型)	23,185,522円
りそな つみたてリスクコントロールファンド	67,210,852円
ターゲットリターンバランスファンド(目標2%)	345,270円
ターゲットリターンバランスファンド(目標3%)	299,410円
ターゲットリターンバランスファンド(目標4%)	226,186円
ターゲットリターンバランスファンド(目標5%)	148,851円
ターゲットリターンバランスファンド(目標6%)	60,506円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2065	14,565円
FWりそな円建債券アクティブファンド	1,802,392,727円
FWりそな国内債券インデックスファンド	89,699,979,446円
Smart-i 国内債券インデックス	2,356,647,442円
Smart-i 8資産バランス 安定型	1,788,438,074円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	1,334,968,083円
Smart-i 8資産バランス 成長型	332,675,100円
りそなFT 国内債券インデックス(適格機関投資家専用)	9,521,824,437円
りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	6,573,847,393円

りそなV I グローバル・バランスファンド(安定型)(適格機関投資家専用)	151,731,050円
りそなV I グローバル・バランスファンド(安定成長型)(適格機関投資家専用)	45,455,157円
りそなV I グローバル・バランスファンド(成長型)(適格機関投資家専用)	46,899,381円
りそなF T マルチアセットファンド(適格機関投資家専用)	82,154,212円
りそなD A A マルチアセットファンド(適格機関投資家専用)	197,050,874円
りそなマルチアセットファンド(適格機関投資家専用)	343,111,238円
2. 計算日における受益権の総数	156,564,944,985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	1.0185円
(10,000口当たり純資産額)	(10,185円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

### (金融商品に関する注記)

#### 金融商品の状況に関する事項

2023年 7月25日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

#### 金融商品の時価等に関する事項

2023年 7月25日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ
	ん。
2. 時価の算定方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	



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

（関連当事者との取引に関する注記）

2023年 7月25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25日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	1,307,646,050
地方債証券	43,463,730
特殊債券	107,654,774
社債券	44,736,000
合計	1,503,500,554

(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439回利付国債（2年）	340,000,000	340,499,800	
	第441回利付国債（2年）	60,000,000	60,096,000	
	第444回利付国債（2年）	5,350,000,000	5,357,650,500	
	第445回利付国債（2年）	210,000,000	210,287,700	
	第446回利付国債（2年）	130,000,000	130,165,100	
	第447回利付国債（2年）	1,160,000,000	1,161,357,200	
	第448回利付国債（2年）	420,000,000	420,441,000	
	第449回利付国債（2年）	1,230,000,000	1,231,242,300	
	第141回利付国債（5年）	520,000,000	521,346,800	
	第142回利付国債（5年）	1,720,000,000	1,724,816,000	
	第143回利付国債（5年）	1,010,000,000	1,012,828,000	
	第144回利付国債（5年）	1,000,000,000	1,003,140,000	
	第145回利付国債（5年）	1,770,000,000	1,776,088,800	
	第146回利付国債（5年）	1,860,000,000	1,866,919,200	
	第147回利付国債（5年）	2,110,000,000	2,113,059,500	
	第148回利付国債（5年）	1,700,000,000	1,702,465,000	
	第149回利付国債（5年）	1,540,000,000	1,541,940,400	
	第150回利付国債（5年）	1,740,000,000	1,741,774,800	
	第151回利付国債（5年）	270,000,000	270,197,100	
	第152回利付国債（5年）	1,310,000,000	1,315,488,900	
	第153回利付国債（5年）	1,540,000,000	1,540,600,600	
	第154回利付国債（5年）	1,160,000,000	1,164,083,200	
	第155回利付国債（5年）	90,000,000	91,027,800	
	第156回利付国債（5年）	1,190,000,000	1,198,365,700	
	第157回利付国債（5年）	220,000,000	221,375,000	
	第158回利付国債（5年）	1,930,000,000	1,932,682,700	
	第1回利付国債（40年）	100,000,000	125,087,000	
第2回利付国債（40年）	180,000,000	217,004,400		
第3回利付国債（40年）	110,000,000	132,612,700		

第4回利付国債(40年)	170,000,000	205,079,500	
第5回利付国債(40年)	220,000,000	255,884,200	
第6回利付国債(40年)	200,000,000	228,616,000	
第7回利付国債(40年)	320,000,000	349,584,000	
第8回利付国債(40年)	370,000,000	375,350,200	
第9回利付国債(40年)	610,000,000	456,932,700	
第10回利付国債(40年)	550,000,000	481,041,000	
第11回利付国債(40年)	450,000,000	378,612,000	
第12回利付国債(40年)	470,000,000	353,035,800	
第13回利付国債(40年)	620,000,000	460,839,800	
第14回利付国債(40年)	600,000,000	475,356,000	
第15回利付国債(40年)	670,000,000	583,750,900	
第16回利付国債(40年)	140,000,000	133,203,000	
第335回利付国債(10年)	345,000,000	347,487,450	
第336回利付国債(10年)	210,000,000	211,768,200	
第337回利付国債(10年)	170,000,000	170,953,700	
第338回利付国債(10年)	631,000,000	635,896,560	
第339回利付国債(10年)	385,000,000	388,407,250	
第340回利付国債(10年)	934,000,000	943,255,940	
第341回利付国債(10年)	440,000,000	443,757,600	
第342回利付国債(10年)	380,000,000	381,508,600	
第343回利付国債(10年)	780,000,000	783,283,800	
第344回利付国債(10年)	960,000,000	964,089,600	
第345回利付国債(10年)	1,070,000,000	1,074,547,500	
第346回利付国債(10年)	1,310,000,000	1,315,488,900	
第347回利付国債(10年)	750,000,000	753,067,500	
第348回利付国債(10年)	1,690,000,000	1,695,948,800	
第349回利付国債(10年)	1,340,000,000	1,343,524,200	
第350回利付国債(10年)	980,000,000	981,587,600	
第351回利付国債(10年)	1,360,000,000	1,360,326,400	
第352回利付国債(10年)	1,180,000,000	1,179,386,400	
第353回利付国債(10年)	1,540,000,000	1,537,921,000	
第354回利付国債(10年)	1,090,000,000	1,087,547,500	
第355回利付国債(10年)	1,200,000,000	1,196,136,000	
第356回利付国債(10年)	1,810,000,000	1,802,271,300	
第357回利付国債(10年)	1,510,000,000	1,501,876,200	

第358回利付国債(10年)	1,310,000,000	1,300,974,100	
第359回利付国債(10年)	1,740,000,000	1,725,210,000	
第360回利付国債(10年)	1,230,000,000	1,217,023,500	
第361回利付国債(10年)	1,320,000,000	1,303,236,000	
第362回利付国債(10年)	1,750,000,000	1,723,820,000	
第363回利付国債(10年)	1,380,000,000	1,356,595,200	
第364回利付国債(10年)	1,510,000,000	1,481,234,500	
第365回利付国債(10年)	900,000,000	881,271,000	
第366回日本国債(10年)	1,860,000,000	1,833,495,000	
第367回日本国債(10年)	1,520,000,000	1,495,786,400	
第368回日本国債(10年)	1,280,000,000	1,256,832,000	
第369回日本国債(10年)	1,230,000,000	1,238,892,900	
第370回利付国債(10年)	1,200,000,000	1,206,660,000	
第1回利付国債(30年)	60,000,000	69,651,600	
第7回利付国債(30年)	40,000,000	46,670,800	
第10回利付国債(30年)	30,000,000	31,862,100	
第11回利付国債(30年)	80,000,000	89,606,400	
第12回利付国債(30年)	80,000,000	92,861,600	
第13回利付国債(30年)	200,000,000	230,576,000	
第14回利付国債(30年)	60,000,000	71,743,800	
第15回利付国債(30年)	200,000,000	241,600,000	
第16回利付国債(30年)	140,000,000	169,489,600	
第17回利付国債(30年)	160,000,000	192,275,200	
第18回利付国債(30年)	60,000,000	71,573,400	
第19回利付国債(30年)	100,000,000	119,414,000	
第20回利付国債(30年)	100,000,000	121,936,000	
第21回利付国債(30年)	180,000,000	215,695,800	
第22回利付国債(30年)	50,000,000	61,169,000	
第23回利付国債(30年)	220,000,000	269,728,800	
第24回利付国債(30年)	170,000,000	208,741,300	
第25回利付国債(30年)	200,000,000	240,684,000	
第26回利付国債(30年)	205,000,000	249,505,500	
第27回利付国債(30年)	295,000,000	363,847,100	
第28回利付国債(30年)	290,000,000	358,640,100	
第29回利付国債(30年)	150,000,000	183,676,500	
第30回利付国債(30年)	190,000,000	230,278,100	

第31回利付国債(30年)	170,000,000	203,753,500	
第32回利付国債(30年)	335,000,000	406,736,900	
第33回利付国債(30年)	290,000,000	338,659,100	
第34回利付国債(30年)	335,000,000	401,936,350	
第35回利付国債(30年)	406,000,000	473,838,540	
第36回利付国債(30年)	425,000,000	496,089,750	
第37回利付国債(30年)	570,000,000	655,619,700	
第38回利付国債(30年)	220,000,000	248,901,400	
第39回利付国債(30年)	380,000,000	436,764,400	
第40回利付国債(30年)	245,000,000	277,175,850	
第41回利付国債(30年)	315,000,000	350,582,400	
第42回利付国債(30年)	330,000,000	367,022,700	
第43回利付国債(30年)	240,000,000	266,966,400	
第44回利付国債(30年)	340,000,000	377,923,600	
第45回利付国債(30年)	370,000,000	397,013,700	
第46回利付国債(30年)	450,000,000	482,314,500	
第47回利付国債(30年)	430,000,000	469,185,900	
第48回利付国債(30年)	443,000,000	465,841,080	
第49回利付国債(30年)	420,000,000	441,058,800	
第50回利付国債(30年)	430,000,000	399,723,700	
第51回利付国債(30年)	450,000,000	372,226,500	
第52回利付国債(30年)	430,000,000	371,756,500	
第53回利付国債(30年)	400,000,000	352,924,000	
第54回利付国債(30年)	440,000,000	405,336,800	
第55回利付国債(30年)	210,000,000	192,962,700	
第56回利付国債(30年)	400,000,000	366,604,000	
第57回利付国債(30年)	410,000,000	374,797,400	
第58回利付国債(30年)	640,000,000	583,526,400	
第59回利付国債(30年)	380,000,000	337,424,800	
第60回利付国債(30年)	350,000,000	324,691,500	
第61回利付国債(30年)	350,000,000	308,423,500	
第62回利付国債(30年)	380,000,000	316,950,400	
第63回利付国債(30年)	290,000,000	234,650,600	
第64回利付国債(30年)	380,000,000	306,371,200	
第65回利付国債(30年)	280,000,000	225,153,600	
第66回利付国債(30年)	480,000,000	384,225,600	

第67回利付国債(30年)	340,000,000	286,286,800	
第68回利付国債(30年)	440,000,000	369,292,000	
第69回利付国債(30年)	430,000,000	370,019,300	
第70回利付国債(30年)	570,000,000	489,487,500	
第71回利付国債(30年)	440,000,000	377,445,200	
第72回利付国債(30年)	440,000,000	377,040,400	
第73回利付国債(30年)	340,000,000	290,744,200	
第74回利付国債(30年)	510,000,000	471,658,200	
第75回利付国債(30年)	440,000,000	438,156,400	
第76回利付国債(30年)	330,000,000	336,619,800	
第77回利付国債(30年)	410,000,000	438,027,600	
第78回利付国債(30年)	540,000,000	550,373,400	
第72回利付国債(20年)	210,000,000	215,397,000	
第73回利付国債(20年)	180,000,000	185,308,200	
第75回利付国債(20年)	100,000,000	103,583,000	
第76回利付国債(20年)	100,000,000	103,252,000	
第77回利付国債(20年)	20,000,000	20,683,600	
第78回利付国債(20年)	50,000,000	51,870,000	
第79回利付国債(20年)	20,000,000	20,786,200	
第80回利付国債(20年)	90,000,000	93,708,900	
第81回利付国債(20年)	30,000,000	31,332,300	
第82回利付国債(20年)	170,000,000	177,916,900	
第83回利付国債(20年)	10,000,000	10,518,400	
第84回利付国債(20年)	120,000,000	125,932,800	
第85回利付国債(20年)	150,000,000	158,554,500	
第86回利付国債(20年)	100,000,000	106,234,000	
第87回利付国債(20年)	90,000,000	95,371,200	
第88回利付国債(20年)	185,000,000	197,602,200	
第89回利付国債(20年)	120,000,000	127,826,400	
第90回利付国債(20年)	170,000,000	181,993,500	
第91回利付国債(20年)	80,000,000	85,896,800	
第92回利付国債(20年)	255,000,000	273,451,800	
第93回利付国債(20年)	80,000,000	85,885,600	
第94回利付国債(20年)	140,000,000	150,810,800	
第95回利付国債(20年)	185,000,000	201,638,900	
第96回利付国債(20年)	70,000,000	75,749,100	

第97回利付国債(20年)	130,000,000	141,789,700	
第98回利付国債(20年)	70,000,000	76,057,800	
第99回利付国債(20年)	85,000,000	92,695,050	
第100回利付国債(20年)	151,000,000	165,980,710	
第101回利付国債(20年)	20,000,000	22,169,800	
第102回利付国債(20年)	145,000,000	161,305,250	
第103回利付国債(20年)	100,000,000	110,757,000	
第104回利付国債(20年)	10,000,000	10,978,100	
第105回利付国債(20年)	12,000,000	13,227,000	
第106回利付国債(20年)	40,000,000	44,295,200	
第107回利付国債(20年)	80,000,000	88,502,400	
第108回利付国債(20年)	220,000,000	241,018,800	
第109回利付国債(20年)	80,000,000	87,916,000	
第110回利付国債(20年)	195,000,000	216,481,200	
第111回利付国債(20年)	50,000,000	56,012,000	
第112回利付国債(20年)	205,000,000	228,449,950	
第113回利付国債(20年)	85,000,000	95,047,850	
第114回利付国債(20年)	160,000,000	179,500,800	
第115回利付国債(20年)	100,000,000	112,821,000	
第116回利付国債(20年)	140,000,000	158,425,400	
第117回利付国債(20年)	225,000,000	253,134,000	
第118回利付国債(20年)	131,000,000	146,900,780	
第119回利付国債(20年)	150,000,000	166,167,000	
第120回利付国債(20年)	240,000,000	262,603,200	
第121回利付国債(20年)	115,000,000	128,469,950	
第122回利付国債(20年)	190,000,000	210,919,000	
第123回利付国債(20年)	265,000,000	300,411,950	
第124回利付国債(20年)	200,000,000	225,274,000	
第125回利付国債(20年)	120,000,000	137,253,600	
第126回利付国債(20年)	100,000,000	112,880,000	
第127回利付国債(20年)	130,000,000	145,771,600	
第128回利付国債(20年)	225,000,000	252,785,250	
第129回利付国債(20年)	240,000,000	267,784,800	
第130回利付国債(20年)	220,000,000	245,872,000	
第131回利付国債(20年)	30,000,000	33,289,500	
第132回利付国債(20年)	80,000,000	88,924,000	

第133回利付国債(20年)	355,000,000	397,500,600	
第134回利付国債(20年)	45,000,000	50,477,400	
第135回利付国債(20年)	40,000,000	44,533,200	
第136回利付国債(20年)	220,000,000	243,084,600	
第137回利付国債(20年)	160,000,000	178,414,400	
第138回利付国債(20年)	60,000,000	65,871,000	
第140回利付国債(20年)	790,000,000	881,853,300	
第141回利付国債(20年)	145,000,000	162,081,000	
第142回利付国債(20年)	240,000,000	270,446,400	
第143回利付国債(20年)	335,000,000	371,655,700	
第144回利付国債(20年)	490,000,000	539,073,500	
第145回利付国債(20年)	755,000,000	845,660,400	
第146回利付国債(20年)	730,000,000	818,600,100	
第147回利付国債(20年)	565,000,000	628,319,550	
第148回利付国債(20年)	755,000,000	832,176,100	
第149回利付国債(20年)	540,000,000	595,204,200	
第150回利付国債(20年)	780,000,000	851,455,800	
第151回利付国債(20年)	745,000,000	796,531,650	
第152回利付国債(20年)	740,000,000	790,926,800	
第153回利付国債(20年)	500,000,000	539,775,000	
第154回利付国債(20年)	778,000,000	830,406,080	
第155回利付国債(20年)	700,000,000	730,212,000	
第156回利付国債(20年)	720,000,000	697,737,600	
第157回利付国債(20年)	710,000,000	668,784,500	
第158回利付国債(20年)	450,000,000	439,420,500	
第159回利付国債(20年)	620,000,000	611,648,600	
第160回利付国債(20年)	720,000,000	717,760,800	
第161回利付国債(20年)	530,000,000	520,316,900	
第162回利付国債(20年)	530,000,000	518,827,600	
第163回利付国債(20年)	620,000,000	605,547,800	
第164回利付国債(20年)	720,000,000	691,675,200	
第165回利付国債(20年)	620,000,000	593,650,000	
第166回利付国債(20年)	840,000,000	825,854,400	
第167回利付国債(20年)	570,000,000	542,457,600	
第168回利付国債(20年)	750,000,000	700,477,500	
第169回利付国債(20年)	460,000,000	421,309,400	



	第170回利付国債(20年)	770,000,000	702,856,000	
	第171回利付国債(20年)	520,000,000	473,038,800	
	第172回利付国債(20年)	630,000,000	580,601,700	
	第173回利付国債(20年)	640,000,000	587,449,600	
	第174回利付国債(20年)	850,000,000	777,597,000	
	第175回利付国債(20年)	590,000,000	547,077,500	
	第176回利付国債(20年)	750,000,000	693,217,500	
	第177回利付国債(20年)	640,000,000	579,052,800	
	第178回利付国債(20年)	790,000,000	725,409,600	
	第179回利付国債(20年)	330,000,000	302,006,100	
	第180回利付国債(20年)	720,000,000	694,087,200	
	第181回利付国債(20年)	610,000,000	596,976,500	
	第182回利付国債(20年)	590,000,000	596,602,100	
	第183回利付国債(20年)	490,000,000	520,154,600	
	第184回利付国債(20年)	550,000,000	554,026,000	
	国債証券合計	135,821,000,000	136,237,564,090	
地方債証券	第14回東京都公募公債	100,000,000	109,632,000	
	第746回東京都公募公債	100,000,000	100,827,000	
	第751回東京都公募公債	100,000,000	100,695,000	
	第761回東京都公募公債	100,000,000	99,940,000	
	第785回東京都公募公債	100,000,000	99,821,000	
	第789回東京都公募公債	100,000,000	98,987,000	
	第817回東京都公募公債	100,000,000	96,801,000	
	平成28年度第8回北海道公募公債	100,000,000	99,838,000	
	第15回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	110,807,000	
	第211回神奈川県公募公債	100,000,000	100,566,000	
	第220回神奈川県公募公債	100,000,000	100,000,000	
	第164回大阪府公募公債	100,000,000	99,990,000	
	第170回大阪府公募公債	100,000,000	99,871,000	
	第451回大阪府公募公債	100,000,000	98,135,000	
	第471回大阪府公募公債	140,000,000	135,238,600	
	平成27年度第13回京都府公募公債	100,000,000	100,079,000	
	平成29年度第1回兵庫県公募公債	100,000,000	100,195,000	
	令和元年度第2回兵庫県公募公債	100,000,000	98,797,000	
	第6回静岡県公募公債(15年)	100,000,000	104,370,000	
	平成26年度第6回静岡県公募公債	100,000,000	100,604,000	

平成30年度第14回静岡県公募公債	100,000,000	99,334,000	
平成22年度第8回愛知県公募公債	100,000,000	110,345,000	
平成28年度第8回愛知県公募公債	100,000,000	99,909,000	
平成29年度第11回愛知県公募公債	100,000,000	100,253,000	
令和3年度第12回愛知県公募公債	100,000,000	89,731,000	
平成30年度第1回広島県公募公債	100,000,000	99,832,000	
令和3年度第1回広島県公募公債	100,000,000	97,513,000	
第8回埼玉県公募公債	100,000,000	111,256,000	
第14回埼玉県公募公債（20年）	100,000,000	108,702,000	
平成26年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	100,637,000	
令和3年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	93,543,000	
平成27年度第1回福岡県公募公債（20年）	200,000,000	211,274,000	
令和5年度第2回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	100,697,000	
第11回千葉県公募公債	100,000,000	110,978,000	
令和4年度第6回千葉県公募公債	100,000,000	99,544,000	
第15回千葉県公募公債	92,500,000	88,327,325	
令和3年度第3回茨城県公募公債	100,000,000	99,725,000	
第152回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,981,000	
第156回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,039,000	
第169回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,315,000	
第172回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,354,000	
第174回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,958,000	
第181回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,788,000	
第185回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,949,000	
第187回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,020,000	
第191回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,176,000	
第197回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,390,000	
第207回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,416,000	
第209回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,072,000	
第217回共同発行市場公募地方債	100,000,000	97,977,000	
第231回共同発行市場公募地方債	100,000,000	97,784,000	
令和3年度第2回堺市公募公債	92,500,000	88,181,175	
令和4年度第2回長崎県公募公債（20年・定時償還）	97,500,000	94,114,800	
令和4年度第1回島根県公募公債	100,000,000	96,863,000	
令和2年度第1回佐賀県公募公債	100,000,000	97,863,000	

	令和4年度第3回奈良県公募公債(20年・定時償還)	97,500,000	94,997,175	
	平成27年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	100,934,000	
	第11回大阪市公募公債	100,000,000	112,344,000	
	第17回名古屋市公募公債	100,000,000	104,754,000	
	令和元年度第4回京都市公募公債	114,500,000	112,939,365	
	平成22年度第9回神戸市公募公債	100,000,000	112,066,000	
	第23回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	112,533,000	
	第21回横浜市公募公債	100,000,000	110,809,000	
	令和4年度第3回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	98,297,000	
	第12回川崎市公募公債(30年)	100,000,000	79,605,000	
	第37回川崎市公募公債	92,500,000	87,984,150	
	平成26年度第5回福岡市公募公債	100,000,000	100,653,000	
	平成27年度第2回広島市公募公債	100,000,000	100,939,000	
	平成29年度第3回千葉市公募公債	120,000,000	120,183,600	
	平成29年度第5回福井県公募公債	100,000,000	99,835,000	
	令和2年度第1回山梨県公募公債(10年)	100,000,000	97,955,000	
	平成29年度第2回岡山県公募公債	100,000,000	100,179,000	
	地方債証券合計	7,347,000,000	7,392,042,190	
特殊債券	第34回新関西国際空港株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	101,680,000	
	第28回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,687,000	
	第49回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	99,918,000	
	第89回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	100,088,000	
	第117回株式会社日本政策投資銀行無担保社債(社債間限定同順)	100,000,000	79,442,000	
	第131回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	83,777,000	
	第16回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	122,034,000	
	第127回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,563,000	
	第138回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,146,000	
	第148回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,581,000	
	第183回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,440,000	

第205回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,765,000	
第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,649,000	
第249回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,858,000	
第251回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	103,000,000	104,072,230	
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	133,000,000	133,901,740	
第270回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,651,000	
第300回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,120,000	
第330回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,108,000	
第345回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,693,000	
第375回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,089,000	
第387回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	98,378,000	
第283回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	95,958,000	
第1回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	111,488,000	
第5回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	111,657,000	
第13回公営企業債券	100,000,000	103,936,000	
第18回公営企業債券(20年)	100,000,000	107,174,000	
第30回地方公共団体金融機構債券(5年)	100,000,000	99,535,000	
第78回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,777,000	
F82回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,773,000	
第95回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,166,000	
第96回政府保証地方公共団体金融機構債券	120,000,000	120,064,800	
第97回政府保証地方公共団体金融機構債券	145,000,000	145,189,950	
第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	213,000,000	212,880,720	
F132回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,020,000	
F305回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,250,000	
F14回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	84,047,000	
F151回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	96,386,000	
第10回株式会社日本政策金融公庫社債(一般)	100,000,000	111,444,000	

担保付)			
第117回都市再生債券	100,000,000	102,255,000	
第2回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	106,950,000	
第6回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	48,172,000	47,749,531	
第7回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	51,475,000	51,121,881	
第97回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	111,010,000	
第117回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,071,000	
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,715,000	71,462,847	
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,464,000	71,010,372	
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,551,000	72,884,039	
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,253,000	71,749,848	
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,648,000	74,791,585	
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,483,000	76,000,750	
第150回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,735,000	80,256,648	
第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,362,000	82,282,992	
第161回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,877,000	84,916,423	
第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,981,000	87,148,398	
第170回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,215,000	88,141,054	
第171回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,441,000	88,906,056	
第172回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,977,000	88,442,323	
第173回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,591,000	89,124,392	
第174回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,913,000	89,853,374	
第175回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,816,000	90,543,697	
第183回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,352,000	94,175,408	
第184回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	193,280,000	188,428,672	
第185回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,049,000	95,239,036	
第186回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,348,000	96,973,210	
第187回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,631,000	97,405,472	
第188回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,857,000	99,775,975	
第223回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	97,799,000	
第351回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	96,849,000	
第1回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	34,228,000	34,050,698	
第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	35,258,000	35,096,518	
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	36,282,000	36,229,753	
第334回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	89,598,000	
第27回成田国際空港株式会社社債（一般担保	100,000,000	94,715,000	

	付)			
	い第866号商工債	100,000,000	99,819,000	
	い第870号商工債	100,000,000	99,892,000	
	第358回信金中金債（5年）	100,000,000	99,952,000	
	第372回信金中金債	100,000,000	99,847,000	
	第376回信金中金債	100,000,000	99,773,000	
	第385回信金中金債	100,000,000	99,554,000	
	第25回国際協力機構債券	100,000,000	107,761,000	
	第31回国際協力機構債券	100,000,000	100,921,000	
	第58回東日本高速道路株式会社社債（一般担保付、独立行政法人	100,000,000	98,987,000	
	第87回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,736,000	
	第88回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,694,000	
	第52回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,922,000	
	第75回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	103,896,000	
	第93回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	93,349,000	
	第103回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	92,657,000	
	特殊債券合計	8,647,954,000	8,670,155,392	
社債券	第24回フランス相互信用連合銀行（BF C M）円貨社債	100,000,000	99,923,000	
	第38回フランス相互信用連合銀行（BF C M）円貨社債（202	100,000,000	100,504,000	
	第1回新韓銀行円貨社債（2022）（ソーシャルボンド）	100,000,000	100,119,000	
	第27回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー期限前償還条項付円	100,000,000	100,303,000	
	第17回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,182,000	
	第6回フランス電力円貨社債（2023）	100,000,000	99,824,000	
	第13回大和ハウス工業株式会社無担保社債（特定社債間限定同順	100,000,000	99,930,000	
	第1回株式会社日清製粉グループ本社無担保社債	100,000,000	98,112,000	
	第1回コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス社債	100,000,000	99,929,000	
	第27回味の素株式会社無担保社債	100,000,000	98,412,000	
	第18回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	95,080,000	
	第35回昭和電工株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	94,864,000	

第13回イビデン株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	99,966,000	
第54回三井化学株式会社無担保社債	100,000,000	94,865,000	
第3回株式会社電通無担保社債	100,000,000	99,559,000	
第1回アステラス製薬株式会社無担保社債(社債間限定)	100,000,000	100,091,000	
第20回株式会社オリエンタルランド無担保社債	100,000,000	99,533,000	
第12回Zホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,109,000	
第18回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	98,298,000	
第10回株式会社資生堂無担保社債	100,000,000	99,840,000	
第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,187,000	
第15回旭硝子株式会社無担保社債	100,000,000	99,864,000	
第28回ジェイエフイーホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,940,000	
第30回ダイキン工業株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約)	100,000,000	99,203,000	
第16回日本電産株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	99,728,000	
第19回パナソニック株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約)	100,000,000	96,983,000	
第38回ソニーグループ株式会社無担保社債	100,000,000	100,171,000	
第17回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,714,000	
第5回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	98,042,000	
第30回豊田通商株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	98,453,000	
第17回株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ無担保社債	100,000,000	98,146,000	
第19回三井住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	99,559,000	
第18回NTTファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	98,372,000	
第21回NTTファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,542,000	
第71回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,448,000	
第29回SBIホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,144,000	
第81回アコム株式会社無担保社債	100,000,000	99,228,000	
第16回三井住友ファイナンス&リース株式会	100,000,000	100,083,000	

社無担保社債			
第7回三井住友海上火災保険株式会社無担保社債	100,000,000	99,569,000	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	99,698,000	
第134回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	98,538,000	
第44回相鉄ホールディングス株式会社無担保社債（相模鉄道株式	100,000,000	99,700,000	
第14回東急株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	99,011,000	
第112回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	100,374,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	90,399,000	
第3回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	95,966,000	
第26回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	110,916,000	
第10回九州旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	87,371,000	
第22回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	99,056,000	
第543回中部電力株式会社社債	100,000,000	99,761,000	
第536回関西電力株式会社社債	100,000,000	97,380,000	
第541回関西電力株式会社社債	100,000,000	95,893,000	
第433回中国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	99,626,000	
第338回北陸電力株式会社社債	100,000,000	96,942,000	
第531回東北電力株式会社社債	100,000,000	95,933,000	
第503回九州電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	99,887,000	
第375回北海道電力株式会社社債	100,000,000	99,835,000	
第32回沖縄電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	100,009,000	
第28回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,501,000	
第47回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	96,287,000	
第10回株式会社JERA無担保社債	100,000,000	99,950,000	
第70回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	99,441,000	
第49回大阪瓦斯株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	92,770,000	
第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	99,882,000	
社債券合計	6,400,000,000	6,318,945,000	
合計		158,618,706,672	



## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## R M先進国債券マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

2023年 7月25日現在

資産の部	
流動資産	
預金	104,409,636
コール・ローン	82,126,337
国債証券	55,638,709,991
未収利息	364,246,865
前払費用	59,743,299
流動資産合計	56,249,236,128
資産合計	56,249,236,128
負債の部	
流動負債	
未払解約金	20,200,000
未払利息	222
流動負債合計	20,200,222
負債合計	20,200,222
純資産の部	
元本等	
元本	48,349,695,889
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	7,879,340,017
元本等合計	56,229,035,906
純資産合計	56,229,035,906
負債純資産合計	56,249,236,128

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券
--------------------	------

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

## (貸借対照表に関する注記)

2023年 7月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月26日
期首元本額	41,861,413,400円
期中追加設定元本額	25,982,304,007円
期中一部解約元本額	19,494,021,518円
期末元本額	48,349,695,889円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	2,528,794,422円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	2,212,233,031円
りそなラップ型ファンド(成長型)	643,302,203円
DCりそな グローバルバランス	67,761,670円
つみたてバランスファンド	1,548,717,725円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	1,104,749,358円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	315,436,859円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	98,075,749円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	167,047,397円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	51,453,331円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	12,081,623円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	13,804,861円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定型)	25,921,732円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定成長型)	8,870,743円
りそな つみたてラップ型ファンド(成長型)	5,757,561円
ターゲットリターンバランスファンド(目標2%)	52,631円
ターゲットリターンバランスファンド(目標3%)	18,181円
ターゲットリターンバランスファンド(目標4%)	18,612円
ターゲットリターンバランスファンド(目標5%)	19,133円
ターゲットリターンバランスファンド(目標6%)	18,181円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2065	2,609円

FWりそな先進国債券アクティブファンド	85,781,661円
FWりそな先進国+新興国債券アクティブファンド	109,690,731円
FWりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジなし）	34,490,404,595円
Smart-i 先進国債券インデックス（為替ヘッジなし）	1,927,246,746円
Smart-i 8資産バランス 安定型	346,025,516円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	258,019,552円
Smart-i 8資産バランス 成長型	62,532,714円
りそなFT 先進国債券インデックス（適格機関投資家専用）	911,192,894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）	14,261,889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）	5,317,651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）	14,718,758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）	93,207,283円
りそなFT パッシブバランス（適格機関投資家専用）	92,103,995円
りそなマルチアセットファンド（適格機関投資家専用）	17,904,533円
りそなFT パッシブバランス202307（適格機関投資家専用）	1,117,149,759円
2. 計算日における受益権の総数	48,349,695,889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	1.1630円
(10,000口当たり純資産額)	(11,630円)

（注） は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

#### （金融商品に関する注記）

##### 金融商品の状況に関する事項

2023年 7月25日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

##### 金融商品の時価等に関する事項

2023年 7月25日現在

## 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

ん。

## 2. 時価の算定方法

## 国債証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

## コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

## 3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

（関連当事者との取引に関する注記）

2023年 7月25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25日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
国債証券		1,046,814,385
合計		1,046,814,385

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

## 2 デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY N/B	390,000.00	378,012.39	
		US TREASURY N/B	600,000.00	580,268.42	
		US TREASURY N/B	1,050,000.00	1,000,746.57	
		US TREASURY N/B	220,000.00	212,963.60	
		US TREASURY N/B	730,000.00	703,971.40	
		US TREASURY N/B	1,230,000.00	1,201,134.77	
		US TREASURY N/B	950,000.00	920,879.16	
		US TREASURY N/B	390,000.00	370,138.18	
		US TREASURY N/B	650,000.00	625,993.16	
		US TREASURY N/B	600,000.00	573,855.46	
		US TREASURY N/B	700,000.00	684,250.00	
		US TREASURY N/B	1,190,000.00	1,125,270.50	
		US TREASURY N/B	220,000.00	211,969.13	
		US TREASURY N/B	710,000.00	679,173.24	
		US TREASURY N/B	900,000.00	888,802.73	
		US TREASURY N/B	1,070,000.00	1,011,233.58	
		US TREASURY N/B	310,000.00	298,526.36	
		US TREASURY N/B	1,030,000.00	982,402.73	
		US TREASURY N/B	700,000.00	692,056.63	
		US TREASURY N/B	750,000.00	721,625.97	
		US TREASURY N/B	1,580,000.00	1,490,569.53	
		US TREASURY N/B	400,000.00	383,867.18	
		US TREASURY N/B	700,000.00	666,080.07	

US TREASURY N/B	1,000,000.00	989,902.34
US TREASURY N/B	1,130,000.00	1,066,459.56
US TREASURY N/B	400,000.00	383,742.18
US TREASURY N/B	860,000.00	819,267.57
US TREASURY N/B	560,000.00	552,475.00
US TREASURY N/B	700,000.00	659,900.38
US TREASURY N/B	430,000.00	413,413.08
US TREASURY N/B	550,000.00	519,803.71
US TREASURY N/B	770,000.00	758,239.45
US TREASURY N/B	730,000.00	695,766.99
US TREASURY N/B	930,000.00	879,522.07
US TREASURY N/B	340,000.00	327,907.42
US TREASURY N/B	960,000.00	901,781.25
US TREASURY N/B	850,000.00	843,541.98
US TREASURY N/B	590,000.00	559,128.71
US TREASURY N/B	250,000.00	240,249.02
US TREASURY N/B	1,160,000.00	1,075,469.53
US TREASURY N/B	2,120,000.00	2,079,297.65
US TREASURY N/B	600,000.00	576,210.93
US TREASURY N/B	250,000.00	240,961.91
US TREASURY N/B	1,060,000.00	977,705.07
US TREASURY N/B	400,000.00	392,359.37
US TREASURY N/B	570,000.00	541,845.11
US TREASURY N/B	880,000.00	845,968.74
US TREASURY N/B	240,000.00	231,164.06
US TREASURY N/B	850,000.00	779,642.57
US TREASURY N/B	900,000.00	866,548.82
US TREASURY N/B	290,000.00	278,405.66
US TREASURY N/B	650,000.00	594,965.81
US TREASURY N/B	780,000.00	752,273.43
US TREASURY N/B	470,000.00	452,136.32
US TREASURY N/B	630,000.00	574,579.68
US TREASURY N/B	810,000.00	765,133.59
US TREASURY N/B	820,000.00	792,389.05
US TREASURY N/B	310,000.00	297,115.62

US TREASURY N/B	1,000,000.00	909,492.19
US TREASURY N/B	920,000.00	895,400.78
US TREASURY N/B	230,000.00	221,455.85
US TREASURY N/B	1,180,000.00	1,070,942.18
US TREASURY N/B	500,000.00	494,248.04
US TREASURY N/B	570,000.00	548,402.34
US TREASURY N/B	1,270,000.00	1,148,531.44
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,229,312.50
US TREASURY N/B	1,000,000.00	994,375.00
US TREASURY N/B	480,000.00	460,331.25
US TREASURY N/B	980,000.00	886,268.36
US TREASURY N/B	400,000.00	393,585.93
US TREASURY N/B	300,000.00	285,890.62
US TREASURY N/B	1,130,000.00	1,020,310.54
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,275,599.61
US TREASURY N/B	330,000.00	314,221.87
US TREASURY N/B	1,320,000.00	1,187,407.02
US TREASURY N/B	1,060,000.00	983,315.62
US TREASURY N/B	720,000.00	708,848.43
US TREASURY N/B	350,000.00	332,007.81
US TREASURY N/B	1,360,000.00	1,223,893.75
US TREASURY N/B	310,000.00	310,121.09
US TREASURY N/B	430,000.00	404,972.65
US TREASURY N/B	1,000,000.00	905,039.06
US TREASURY N/B	980,000.00	959,136.72
US TREASURY N/B	450,000.00	424,687.50
US TREASURY N/B	2,470,000.00	2,227,920.70
US TREASURY N/B	880,000.00	812,831.25
US TREASURY N/B	470,000.00	440,129.29
US TREASURY N/B	1,090,000.00	980,638.08
US TREASURY N/B	200,000.00	197,921.87
US TREASURY N/B	450,000.00	418,122.07
US TREASURY N/B	1,880,000.00	1,696,369.53
US TREASURY N/B	520,000.00	481,944.53
US TREASURY N/B	1,050,000.00	936,714.84

US TREASURY N/B	1,130,000.00	1,034,347.26
US TREASURY N/B	320,000.00	291,531.25
US TREASURY N/B	1,030,000.00	920,039.45
US TREASURY N/B	400,000.00	366,773.43
US TREASURY N/B	1,310,000.00	1,173,754.87
US TREASURY N/B	350,000.00	320,414.06
US TREASURY N/B	1,170,000.00	1,053,434.17
US TREASURY N/B	250,000.00	231,513.67
US TREASURY N/B	300,000.00	274,154.29
US TREASURY N/B	1,210,000.00	1,091,670.50
US TREASURY N/B	440,000.00	403,261.72
US TREASURY N/B	900,000.00	810,966.79
US TREASURY N/B	1,450,000.00	1,315,053.70
US TREASURY N/B	340,000.00	316,332.81
US TREASURY N/B	590,000.00	527,208.78
US TREASURY N/B	470,000.00	431,289.25
US TREASURY N/B	300,000.00	262,435.54
US TREASURY N/B	1,040,000.00	975,385.93
US TREASURY N/B	1,130,000.00	981,025.38
US TREASURY N/B	550,000.00	519,911.13
US TREASURY N/B	580,000.00	540,374.22
US TREASURY N/B	1,120,000.00	970,090.62
US TREASURY N/B	660,000.00	620,644.91
US TREASURY N/B	1,180,000.00	1,019,340.23
US TREASURY N/B	490,000.00	471,481.44
US TREASURY N/B	1,100,000.00	942,498.05
US TREASURY N/B	400,000.00	377,367.18
US TREASURY N/B	800,000.00	739,718.75
US TREASURY N/B	410,000.00	352,287.69
US TREASURY N/B	1,050,000.00	1,004,739.25
US TREASURY N/B	810,000.00	690,635.74
US TREASURY N/B	580,000.00	576,714.84
US TREASURY N/B	1,230,000.00	1,051,601.95
US TREASURY N/B	1,360,000.00	1,352,748.43
US TREASURY N/B	690,000.00	636,066.79



US TREASURY N/B	1,180,000.00	1,012,264.84
US TREASURY N/B	740,000.00	729,434.76
US TREASURY N/B	1,040,000.00	889,992.18
US TREASURY N/B	750,000.00	739,335.93
US TREASURY N/B	1,150,000.00	987,540.04
US TREASURY N/B	600,000.00	582,644.53
US TREASURY N/B	850,000.00	798,867.18
US TREASURY N/B	1,110,000.00	968,323.24
US TREASURY N/B	550,000.00	545,756.83
US TREASURY N/B	980,000.00	858,591.01
US TREASURY N/B	210,000.00	205,061.71
US TREASURY N/B	1,820,000.00	1,591,469.13
US TREASURY N/B	780,000.00	757,696.87
US TREASURY N/B	1,340,000.00	1,264,415.62
US TREASURY N/B	1,170,000.00	1,021,350.58
US TREASURY N/B	930,000.00	909,147.65
US TREASURY N/B	870,000.00	758,242.38
US TREASURY N/B	1,090,000.00	935,845.89
US TREASURY N/B	1,170,000.00	1,102,565.03
US TREASURY N/B	1,280,000.00	1,104,074.99
US TREASURY N/B	920,000.00	796,932.03
US TREASURY N/B	1,000,000.00	870,566.41
US TREASURY N/B	890,000.00	847,916.20
US TREASURY N/B	1,110,000.00	971,380.08
US TREASURY N/B	1,020,000.00	885,567.18
US TREASURY N/B	1,190,000.00	1,052,638.66
US TREASURY N/B	1,140,000.00	1,056,058.59
US TREASURY N/B	1,000,000.00	889,531.25
US TREASURY N/B	1,120,000.00	1,022,459.37
US TREASURY N/B	790,000.00	740,516.99
US TREASURY N/B	930,000.00	848,225.38
US TREASURY N/B	1,000,000.00	930,410.16
US TREASURY N/B	480,000.00	458,803.12
US TREASURY N/B	900,000.00	830,830.07
US TREASURY N/B	850,000.00	741,458.98

US TREASURY N/B	660,000.00	626,316.79
US TREASURY N/B	710,000.00	702,026.36
US TREASURY N/B	470,000.00	467,989.65
US TREASURY N/B	680,000.00	596,142.18
US TREASURY N/B	840,000.00	831,025.78
US TREASURY N/B	500,000.00	494,755.86
US TREASURY N/B	600,000.00	581,214.84
US TREASURY N/B	770,000.00	659,162.11
US TREASURY N/B	620,000.00	618,425.78
US TREASURY N/B	600,000.00	585,750.00
US TREASURY N/B	1,000,000.00	969,062.50
US TREASURY N/B	120,000.00	135,750.00
US TREASURY N/B	1,430,000.00	1,145,396.48
US TREASURY N/B	900,000.00	885,515.62
US TREASURY N/B	870,000.00	692,720.50
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,456,242.19
US TREASURY N/B	160,000.00	174,862.49
US TREASURY N/B	2,320,000.00	1,905,753.11
US TREASURY N/B	2,680,000.00	2,273,707.81
US TREASURY N/B	2,110,000.00	1,727,562.50
US TREASURY N/B	1,930,000.00	1,587,952.73
US TREASURY N/B	1,920,000.00	1,640,100.00
US TREASURY N/B	1,990,000.00	1,839,117.58
US TREASURY N/B	1,650,000.00	1,507,236.32
US TREASURY N/B	1,590,000.00	1,618,321.87
US TREASURY N/B	2,060,000.00	1,998,200.00
US TREASURY N/B	1,510,000.00	1,449,717.95
US TREASURY N/B	80,000.00	85,845.31
US TREASURY N/B	90,000.00	101,406.44
US TREASURY N/B	280,000.00	296,138.28
US TREASURY N/B	100,000.00	106,978.51
US TREASURY N/B	470,000.00	447,904.48
US TREASURY N/B	140,000.00	145,452.34
US TREASURY N/B	190,000.00	202,921.48
US TREASURY N/B	440,000.00	462,756.25

US TREASURY N/B	190,000.00	205,660.15	
US TREASURY N/B	210,000.00	220,356.44	
US TREASURY N/B	450,000.00	289,045.89	
US TREASURY N/B	150,000.00	147,747.07	
US TREASURY N/B	1,110,000.00	706,844.53	
US TREASURY N/B	210,000.00	216,722.46	
US TREASURY N/B	1,200,000.00	795,492.19	
US TREASURY N/B	230,000.00	252,061.13	
US TREASURY N/B	1,210,000.00	871,200.00	
US TREASURY N/B	250,000.00	261,088.86	
US TREASURY N/B	1,110,000.00	847,307.22	
US TREASURY N/B	230,000.00	220,525.97	
US TREASURY N/B	1,340,000.00	934,440.62	
US TREASURY N/B	130,000.00	113,752.53	
US TREASURY N/B	1,290,000.00	936,786.91	
US TREASURY N/B	180,000.00	157,021.87	
US TREASURY N/B	840,000.00	648,358.59	
US TREASURY N/B	200,000.00	170,542.96	
US TREASURY N/B	800,000.00	707,531.24	
US TREASURY N/B	200,000.00	163,421.87	
US TREASURY N/B	680,000.00	611,588.28	
US TREASURY N/B	400,000.00	326,179.68	
US TREASURY N/B	800,000.00	787,500.00	
US TREASURY N/B	320,000.00	276,162.49	
US TREASURY N/B	810,000.00	782,219.52	
US TREASURY N/B	590,000.00	488,524.60	
US TREASURY N/B	390,000.00	376,837.50	
US TREASURY N/B	360,000.00	334,293.75	
US TREASURY N/B	720,000.00	680,442.18	
US TREASURY N/B	410,000.00	379,970.70	
US TREASURY N/B	390,000.00	347,602.73	
US TREASURY N/B	230,000.00	196,820.70	
US TREASURY N/B	380,000.00	317,960.54	
US TREASURY N/B	530,000.00	405,387.88	
US TREASURY N/B	320,000.00	267,143.75	

US TREASURY N/B	610,000.00	497,435.93	
US TREASURY N/B	290,000.00	241,521.28	
US TREASURY N/B	180,000.00	136,778.90	
US TREASURY N/B	460,000.00	349,375.39	
US TREASURY N/B	870,000.00	627,283.58	
US TREASURY N/B	350,000.00	284,833.00	
US TREASURY N/B	770,000.00	640,182.81	
US TREASURY N/B	170,000.00	141,269.33	
US TREASURY N/B	620,000.00	492,064.45	
US TREASURY N/B	770,000.00	610,871.67	
US TREASURY N/B	190,000.00	157,974.60	
US TREASURY N/B	760,000.00	646,608.59	
US TREASURY N/B	1,130,000.00	939,930.47	
US TREASURY N/B	830,000.00	739,364.64	
US TREASURY N/B	410,000.00	341,869.52	
US TREASURY N/B	970,000.00	790,758.39	
US TREASURY N/B	200,000.00	143,281.25	
US TREASURY N/B	1,090,000.00	802,704.10	
US TREASURY N/B	1,260,000.00	851,336.71	
US TREASURY N/B	1,060,000.00	587,202.73	
US TREASURY N/B	1,050,000.00	601,330.06	
US TREASURY N/B	1,330,000.00	813,923.63	
US TREASURY N/B	1,680,000.00	1,095,609.37	
US TREASURY N/B	900,000.00	659,794.92	
US TREASURY N/B	1,380,000.00	926,810.15	
US TREASURY N/B	1,050,000.00	682,766.60	
US TREASURY N/B	1,240,000.00	883,596.86	
US TREASURY N/B	1,050,000.00	858,128.90	
US TREASURY N/B	770,000.00	645,747.26	
US TREASURY N/B	1,270,000.00	1,287,660.93	
US TREASURY N/B	1,370,000.00	1,296,469.52	
US TREASURY N/B	720,000.00	681,974.99	
	米ドル 小計	212,820,000.00	190,182,619.05 (26,926,055,205)
カナダドル	GOV OF CANADA	180,000.00	173,229.31

GOV OF CANADA	230,000.00	218,828.36
GOV OF CANADA	540,000.00	526,521.40
GOV OF CANADA	340,000.00	334,121.49
GOV OF CANADA	200,000.00	189,159.59
GOV OF CANADA	190,000.00	179,810.45
GOV OF CANADA	200,000.00	196,542.53
GOV OF CANADA	150,000.00	143,603.87
GOV OF CANADA	100,000.00	97,767.40
GOV OF CANADA	600,000.00	550,821.49
GOV OF CANADA	160,000.00	154,689.61
GOV OF CANADA	350,000.00	314,358.95
GOV OF CANADA	230,000.00	221,790.05
GOV OF CANADA	250,000.00	231,607.10
GOV OF CANADA	250,000.00	226,880.34
GOV OF CANADA	350,000.00	316,805.36
GOV OF CANADA	160,000.00	143,435.52
GOV OF CANADA	170,000.00	162,055.93
GOV OF CANADA	360,000.00	353,968.79
GOV OF CANADA	150,000.00	138,531.50
GOV OF CANADA	160,000.00	155,753.51
GOV OF CANADA	120,000.00	133,078.60
GOV OF CANADA	130,000.00	120,676.74
GOV OF CANADA	130,000.00	120,017.46
GOV OF CANADA	610,000.00	523,567.37
GOV OF CANADA	670,000.00	537,888.28
GOV OF CANADA	510,000.00	438,458.91
GOV OF CANADA	720,000.00	614,475.28
GOV OF CANADA	310,000.00	274,172.16
GOV OF CANADA	490,000.00	450,789.84
GOV OF CANADA	160,000.00	189,418.47
GOV OF CANADA	230,000.00	215,854.71
GOV OF CANADA	50,000.00	48,957.02
GOV OF CANADA	120,000.00	139,537.22
GOV OF CANADA	140,000.00	149,717.81
GOV OF CANADA	190,000.00	192,165.76

	GOV OF CANADA	260,000.00	232,412.46	
	GOV OF CANADA	690,000.00	519,484.61	
	GOV OF CANADA	560,000.00	391,647.90	
	GOV OF CANADA	60,000.00	52,952.74	
	GOV OF CANADA	120,000.00	104,107.57	
	カナダドル 小計	11,590,000.00	10,479,663.46 (1,126,459,025)	
メキシコペソ	UNITED MEXICAN STATE	3,600,000.00	3,488,389.66	
	UNITED MEXICAN STATE	5,150,000.00	5,121,558.76	
	UNITED MEXICAN STATE	5,310,000.00	4,926,671.10	
	UNITED MEXICAN STATE	7,930,000.00	7,237,169.53	
	UNITED MEXICAN STATE	500,000.00	465,760.00	
	UNITED MEXICAN STATE	5,670,000.00	5,010,579.00	
	UNITED MEXICAN STATE	6,280,000.00	5,942,512.80	
	UNITED MEXICAN STATE	5,760,000.00	5,681,145.60	
	UNITED MEXICAN STATE	7,760,000.00	7,308,756.00	
	UNITED MEXICAN STATE	3,070,000.00	2,812,273.50	
	UNITED MEXICAN STATE	2,490,000.00	2,309,026.80	
	UNITED MEXICAN STATE	1,470,000.00	1,612,972.20	
	UNITED MEXICAN STATE	2,480,000.00	2,409,816.00	
	UNITED MEXICAN STATE	6,210,000.00	5,571,425.70	
	UNITED MEXICAN STATE	3,950,000.00	3,624,559.50	
	UNITED MEXICAN STATE	2,660,000.00	2,417,062.20	
	メキシコペソ 小計	70,290,000.00	65,939,678.35 (554,183,432)	
ユーロ	GOV OF AUSTRIA	70,000.00	67,810.68	
	GOV OF AUSTRIA	280,000.00	274,632.20	
	GOV OF AUSTRIA	240,000.00	227,281.44	
	GOV OF AUSTRIA	310,000.00	297,621.70	
	GOV OF AUSTRIA	120,000.00	125,480.78	
	GOV OF AUSTRIA	80,000.00	77,728.08	
	GOV OF AUSTRIA	380,000.00	354,443.10	
	GOV OF AUSTRIA	190,000.00	173,841.26	
	GOV OF AUSTRIA	130,000.00	145,983.37	
	GOV OF AUSTRIA	250,000.00	227,292.75	

GOV OF AUSTRIA	190,000.00	163,534.71
GOV OF AUSTRIA	210,000.00	184,400.58
GOV OF AUSTRIA	60,000.00	60,067.93
GOV OF AUSTRIA	230,000.00	190,313.96
GOV OF AUSTRIA	260,000.00	208,469.56
GOV OF AUSTRIA	260,000.00	219,692.46
GOV OF AUSTRIA	190,000.00	188,003.67
GOV OF AUSTRIA	160,000.00	150,672.14
GOV OF AUSTRIA	160,000.00	111,267.52
GOV OF AUSTRIA	260,000.00	288,829.47
GOV OF AUSTRIA	130,000.00	76,753.43
GOV OF AUSTRIA	160,000.00	160,878.88
GOV OF AUSTRIA	180,000.00	131,933.60
GOV OF AUSTRIA	80,000.00	62,323.28
GOV OF AUSTRIA	160,000.00	91,551.20
GOV OF AUSTRIA	80,000.00	92,001.60
GOV OF AUSTRIA	60,000.00	26,775.35
GOV OF AUSTRIA	110,000.00	44,657.80
GOV OF AUSTRIA	84,000.00	60,947.37
GOV OF AUSTRIA	50,000.00	29,789.05
GOV OF BELGIUM	240,000.00	231,623.70
GOV OF BELGIUM	410,000.00	392,043.47
GOV OF BELGIUM	190,000.00	196,883.70
GOV OF BELGIUM	320,000.00	302,273.28
GOV OF BELGIUM	330,000.00	304,419.48
GOV OF BELGIUM	210,000.00	186,016.59
GOV OF BELGIUM	350,000.00	390,068.70
GOV OF BELGIUM	370,000.00	336,030.30
GOV OF BELGIUM	270,000.00	242,148.96
GOV OF BELGIUM	300,000.00	248,896.26
GOV OF BELGIUM	340,000.00	294,353.64
GOV OF BELGIUM	320,000.00	251,854.96
GOV OF BELGIUM	110,000.00	118,515.96
GOV OF BELGIUM	350,000.00	278,452.26
GOV OF BELGIUM	150,000.00	128,634.18

GOV OF BELGIUM	240,000.00	238,658.70	
GOV OF BELGIUM	140,000.00	138,429.07	
GOV OF BELGIUM	370,000.00	435,141.46	
GOV OF BELGIUM	130,000.00	104,384.54	
GOV OF BELGIUM	180,000.00	150,908.63	
GOV OF BELGIUM	70,000.00	65,296.77	
GOV OF BELGIUM	250,000.00	156,241.58	
GOV OF BELGIUM	310,000.00	347,550.23	
GOV OF BELGIUM	50,000.00	50,360.80	
GOV OF BELGIUM	170,000.00	179,990.90	
GOV OF BELGIUM	210,000.00	149,460.78	
GOV OF BELGIUM	200,000.00	140,747.60	
GOV OF BELGIUM	180,000.00	113,281.92	
GOV OF BELGIUM	200,000.00	193,640.40	
GOV OF BELGIUM	80,000.00	62,112.08	
GOV OF BELGIUM	150,000.00	110,375.85	
GOV OF BELGIUM	100,000.00	40,523.00	
GOV OF FINLAND	90,000.00	86,631.62	
GOV OF FINLAND	80,000.00	81,175.72	
GOV OF FINLAND	100,000.00	95,424.00	
GOV OF FINLAND	130,000.00	121,730.83	
GOV OF FINLAND	80,000.00	72,967.12	
GOV OF FINLAND	70,000.00	66,176.39	
GOV OF FINLAND	120,000.00	108,995.54	
GOV OF FINLAND	70,000.00	69,753.81	
GOV OF FINLAND	140,000.00	124,411.14	
GOV OF FINLAND	150,000.00	130,441.50	
GOV OF FINLAND	120,000.00	98,068.68	
GOV OF FINLAND	40,000.00	34,205.28	
GOV OF FINLAND	100,000.00	80,104.64	
GOV OF FINLAND	140,000.00	124,135.48	
GOV OF FINLAND	50,000.00	50,103.36	
GOV OF FINLAND	90,000.00	74,674.62	
GOV OF FINLAND	80,000.00	55,307.08	
GOV OF FINLAND	70,000.00	66,579.02	



GOV OF FINLAND	30,000.00	18,700.62	
GOV OF FINLAND	130,000.00	121,804.02	
GOV OF FINLAND	100,000.00	61,999.70	
GOV OF FINLAND	80,000.00	58,235.14	
GOV OF FINLAND	100,000.00	46,227.80	
GOV OF FRANCE	530,000.00	518,986.92	
GOV OF FRANCE	740,000.00	702,943.69	
GOV OF FRANCE	1,190,000.00	1,128,120.00	
GOV OF FRANCE	650,000.00	618,886.77	
GOV OF FRANCE	340,000.00	360,874.47	
GOV OF FRANCE	690,000.00	657,712.83	
GOV OF FRANCE	1,040,000.00	962,042.64	
GOV OF FRANCE	820,000.00	829,794.90	
GOV OF FRANCE	980,000.00	914,432.12	
GOV OF FRANCE	460,000.00	452,939.00	
GOV OF FRANCE	580,000.00	530,791.99	
GOV OF FRANCE	970,000.00	874,796.44	
GOV OF FRANCE	740,000.00	689,720.70	
GOV OF FRANCE	1,040,000.00	1,035,207.93	
GOV OF FRANCE	430,000.00	391,556.71	
GOV OF FRANCE	1,390,000.00	1,260,296.32	
GOV OF FRANCE	960,000.00	863,032.80	
GOV OF FRANCE	490,000.00	487,398.10	
GOV OF FRANCE	620,000.00	706,310.20	
GOV OF FRANCE	1,100,000.00	965,251.92	
GOV OF FRANCE	880,000.00	738,928.08	
GOV OF FRANCE	1,060,000.00	1,041,092.36	
GOV OF FRANCE	970,000.00	791,297.62	
GOV OF FRANCE	1,030,000.00	937,086.79	
GOV OF FRANCE	1,160,000.00	918,406.80	
GOV OF FRANCE	570,000.00	444,106.38	
GOV OF FRANCE	720,000.00	884,377.94	
GOV OF FRANCE	950,000.00	880,859.00	
GOV OF FRANCE	200,000.00	200,941.05	
GOV OF FRANCE	760,000.00	637,871.04	

GOV OF FRANCE	580,000.00	675,276.60	
GOV OF FRANCE	780,000.00	628,636.32	
GOV OF FRANCE	260,000.00	200,929.45	
GOV OF FRANCE	480,000.00	527,107.20	
GOV OF FRANCE	370,000.00	305,319.19	
GOV OF FRANCE	730,000.00	474,308.37	
GOV OF FRANCE	730,000.00	853,717.48	
GOV OF FRANCE	210,000.00	186,148.20	
GOV OF FRANCE	380,000.00	224,647.07	
GOV OF FRANCE	510,000.00	507,914.61	
GOV OF FRANCE	550,000.00	431,869.90	
GOV OF FRANCE	530,000.00	364,248.86	
GOV OF FRANCE	720,000.00	386,763.84	
GOV OF FRANCE	600,000.00	314,284.80	
GOV OF FRANCE	220,000.00	205,347.29	
GOV OF FRANCE	380,000.00	429,120.70	
GOV OF FRANCE	340,000.00	388,943.39	
GOV OF FRANCE	270,000.00	180,093.78	
GOV OF FRANCE	240,000.00	90,798.84	
GOV OF GERMANY	260,000.00	253,872.64	
GOV OF GERMANY	350,000.00	338,629.85	
GOV OF GERMANY	270,000.00	259,251.30	
GOV OF GERMANY	340,000.00	335,107.65	
GOV OF GERMANY	640,000.00	614,528.64	
GOV OF GERMANY	600,000.00	593,630.55	
GOV OF GERMANY	290,000.00	275,208.84	
GOV OF GERMANY	360,000.00	358,071.12	
GOV OF GERMANY	490,000.00	470,498.16	
GOV OF GERMANY	610,000.00	571,731.04	
GOV OF GERMANY	50,000.00	46,937.35	
GOV OF GERMANY	650,000.00	612,611.35	
GOV OF GERMANY	520,000.00	482,002.56	
GOV OF GERMANY	570,000.00	525,062.10	
GOV OF GERMANY	440,000.00	403,533.48	
GOV OF GERMANY	580,000.00	533,614.50	

GOV OF GERMANY	360,000.00	326,895.12	
GOV OF GERMANY	140,000.00	160,197.38	
GOV OF GERMANY	740,000.00	682,155.68	
GOV OF GERMANY	630,000.00	598,680.18	
GOV OF GERMANY	550,000.00	493,886.80	
GOV OF GERMANY	170,000.00	192,022.20	
GOV OF GERMANY	670,000.00	613,056.03	
GOV OF GERMANY	420,000.00	414,071.28	
GOV OF GERMANY	190,000.00	209,954.37	
GOV OF GERMANY	770,000.00	690,082.47	
GOV OF GERMANY	280,000.00	246,347.36	
GOV OF GERMANY	630,000.00	559,471.28	
GOV OF GERMANY	800,000.00	692,832.80	
GOV OF GERMANY	470,000.00	460,952.05	
GOV OF GERMANY	210,000.00	257,777.62	
GOV OF GERMANY	340,000.00	291,379.20	
GOV OF GERMANY	610,000.00	517,295.25	
GOV OF GERMANY	80,000.00	67,939.20	
GOV OF GERMANY	370,000.00	447,724.05	
GOV OF GERMANY	660,000.00	553,583.58	
GOV OF GERMANY	700,000.00	580,791.40	
GOV OF GERMANY	650,000.00	532,839.45	
GOV OF GERMANY	670,000.00	634,306.30	
GOV OF GERMANY	660,000.00	654,977.83	
GOV OF GERMANY	490,000.00	598,044.51	
GOV OF GERMANY	450,000.00	337,950.90	
GOV OF GERMANY	460,000.00	336,113.58	
GOV OF GERMANY	540,000.00	631,146.60	
GOV OF GERMANY	290,000.00	235,758.40	
GOV OF GERMANY	340,000.00	415,294.83	
GOV OF GERMANY	370,000.00	481,735.89	
GOV OF GERMANY	370,000.00	409,294.00	
GOV OF GERMANY	550,000.00	549,651.30	
GOV OF GERMANY	560,000.00	563,146.08	
GOV OF GERMANY	650,000.00	508,105.65	

GOV OF GERMANY	800,000.00	421,816.80	
GOV OF GERMANY	130,000.00	68,926.16	
GOV OF GERMANY	440,000.00	221,068.97	
GOV OF GERMANY	310,000.00	266,421.02	
GOV OF GERMANY	110,000.00	94,776.11	
GOV OF IRELAND	200,000.00	207,151.78	
GOV OF IRELAND	180,000.00	170,902.47	
GOV OF IRELAND	180,000.00	162,901.62	
GOV OF IRELAND	150,000.00	137,483.95	
GOV OF IRELAND	190,000.00	173,203.85	
GOV OF IRELAND	160,000.00	156,464.00	
GOV OF IRELAND	140,000.00	116,591.23	
GOV OF IRELAND	120,000.00	108,672.84	
GOV OF IRELAND	110,000.00	87,860.09	
GOV OF IRELAND	130,000.00	104,368.68	
GOV OF IRELAND	110,000.00	95,562.01	
GOV OF IRELAND	100,000.00	74,893.00	
GOV OF IRELAND	130,000.00	109,797.48	
GOV OF IRELAND	80,000.00	51,803.68	
GOV OF IRELAND	80,000.00	78,388.32	
GOV OF IRELAND	170,000.00	138,041.70	
GOV OF IRELAND	160,000.00	112,152.00	
GOV OF ITALY	360,000.00	353,483.64	
GOV OF ITALY	270,000.00	270,136.59	
GOV OF ITALY	430,000.00	418,091.58	
GOV OF ITALY	550,000.00	541,921.05	
GOV OF ITALY	300,000.00	285,460.84	
GOV OF ITALY	440,000.00	418,874.72	
GOV OF ITALY	370,000.00	377,785.91	
GOV OF ITALY	350,000.00	348,547.50	
GOV OF ITALY	350,000.00	337,155.00	
GOV OF ITALY	410,000.00	394,697.53	
GOV OF ITALY	340,000.00	329,069.00	
GOV OF ITALY	380,000.00	362,042.78	
GOV OF ITALY	310,000.00	303,109.32	

GOV OF ITALY	320,000.00	309,026.56
GOV OF ITALY	190,000.00	189,750.15
GOV OF ITALY	380,000.00	352,292.30
GOV OF ITALY	530,000.00	542,159.26
GOV OF ITALY	580,000.00	527,674.72
GOV OF ITALY	90,000.00	90,540.00
GOV OF ITALY	440,000.00	417,072.48
GOV OF ITALY	330,000.00	316,742.91
GOV OF ITALY	270,000.00	242,863.38
GOV OF ITALY	570,000.00	529,557.93
GOV OF ITALY	360,000.00	328,889.52
GOV OF ITALY	430,000.00	394,243.35
GOV OF ITALY	270,000.00	257,272.12
GOV OF ITALY	410,000.00	387,506.17
GOV OF ITALY	230,000.00	207,329.82
GOV OF ITALY	450,000.00	502,899.43
GOV OF ITALY	310,000.00	298,735.60
GOV OF ITALY	500,000.00	468,000.50
GOV OF ITALY	400,000.00	343,980.00
GOV OF ITALY	480,000.00	476,448.30
GOV OF ITALY	350,000.00	301,439.44
GOV OF ITALY	280,000.00	282,439.36
GOV OF ITALY	350,000.00	368,933.60
GOV OF ITALY	440,000.00	423,525.74
GOV OF ITALY	60,000.00	50,497.56
GOV OF ITALY	330,000.00	315,161.22
GOV OF ITALY	560,000.00	540,989.68
GOV OF ITALY	480,000.00	523,921.63
GOV OF ITALY	260,000.00	262,109.64
GOV OF ITALY	510,000.00	505,124.40
GOV OF ITALY	530,000.00	456,988.79
GOV OF ITALY	230,000.00	229,338.32
GOV OF ITALY	420,000.00	348,804.12
GOV OF ITALY	570,000.00	493,756.80
GOV OF ITALY	520,000.00	421,716.88

GOV OF ITALY	400,000.00	461,126.00	
GOV OF ITALY	420,000.00	328,755.00	
GOV OF ITALY	370,000.00	295,331.04	
GOV OF ITALY	520,000.00	438,659.62	
GOV OF ITALY	500,000.00	393,029.00	
GOV OF ITALY	450,000.00	402,493.50	
GOV OF ITALY	340,000.00	388,756.00	
GOV OF ITALY	410,000.00	425,870.69	
GOV OF ITALY	350,000.00	307,071.72	
GOV OF ITALY	220,000.00	226,736.96	
GOV OF ITALY	430,000.00	466,325.54	
GOV OF ITALY	260,000.00	242,767.20	
GOV OF ITALY	120,000.00	119,372.42	
GOV OF ITALY	350,000.00	260,396.50	
GOV OF ITALY	320,000.00	260,969.60	
GOV OF ITALY	510,000.00	504,514.95	
GOV OF ITALY	370,000.00	250,660.57	
GOV OF ITALY	220,000.00	197,336.04	
GOV OF ITALY	250,000.00	216,101.25	
GOV OF ITALY	400,000.00	435,600.80	
GOV OF ITALY	380,000.00	329,249.10	
GOV OF ITALY	380,000.00	415,309.60	
GOV OF ITALY	330,000.00	232,644.72	
GOV OF ITALY	320,000.00	325,408.76	
GOV OF ITALY	340,000.00	360,646.84	
GOV OF ITALY	110,000.00	68,217.05	
GOV OF ITALY	330,000.00	282,749.94	
GOV OF ITALY	230,000.00	178,526.00	
GOV OF ITALY	340,000.00	298,515.24	
GOV OF ITALY	330,000.00	307,076.22	
GOV OF ITALY	200,000.00	142,840.00	
GOV OF ITALY	320,000.00	191,336.71	
GOV OF ITALY	140,000.00	91,442.74	
GOV OF ITALY	120,000.00	122,301.60	
GOV OF ITALY	150,000.00	106,763.85	

GOV OF ITALY	140,000.00	82,607.34	
GOV OF NETHERLANDS	310,000.00	305,943.89	
GOV OF NETHERLANDS	380,000.00	359,642.71	
GOV OF NETHERLANDS	200,000.00	185,962.00	
GOV OF NETHERLANDS	340,000.00	317,078.56	
GOV OF NETHERLANDS	370,000.00	335,856.40	
GOV OF NETHERLANDS	350,000.00	323,602.30	
GOV OF NETHERLANDS	210,000.00	233,488.29	
GOV OF NETHERLANDS	400,000.00	363,563.00	
GOV OF NETHERLANDS	300,000.00	258,794.70	
GOV OF NETHERLANDS	50,000.00	43,329.33	
GOV OF NETHERLANDS	130,000.00	128,273.57	
GOV OF NETHERLANDS	220,000.00	182,990.72	
GOV OF NETHERLANDS	360,000.00	291,694.59	
GOV OF NETHERLANDS	220,000.00	182,075.01	
GOV OF NETHERLANDS	250,000.00	245,910.50	
GOV OF NETHERLANDS	100,000.00	98,335.20	
GOV OF NETHERLANDS	330,000.00	373,616.43	
GOV OF NETHERLANDS	260,000.00	174,163.69	
GOV OF NETHERLANDS	310,000.00	217,902.10	
GOV OF NETHERLANDS	330,000.00	375,451.16	
GOV OF NETHERLANDS	370,000.00	372,281.79	
GOV OF NETHERLANDS	320,000.00	153,217.13	
GOV OF NETHERLANDS	130,000.00	110,878.82	
GOV OF SPAIN	300,000.00	289,909.80	
GOV OF SPAIN	390,000.00	386,259.12	
GOV OF SPAIN	380,000.00	360,970.74	
GOV OF SPAIN	420,000.00	407,431.50	
GOV OF SPAIN	510,000.00	479,365.97	
GOV OF SPAIN	340,000.00	348,570.04	
GOV OF SPAIN	480,000.00	468,564.48	
GOV OF SPAIN	420,000.00	387,275.28	
GOV OF SPAIN	420,000.00	405,831.30	
GOV OF SPAIN	350,000.00	345,479.75	
GOV OF SPAIN	360,000.00	386,798.76	

GOV OF SPAIN	310,000.00	292,072.95	
GOV OF SPAIN	650,000.00	581,811.86	
GOV OF SPAIN	550,000.00	518,071.40	
GOV OF SPAIN	330,000.00	300,984.75	
GOV OF SPAIN	440,000.00	410,400.32	
GOV OF SPAIN	590,000.00	512,754.25	
GOV OF SPAIN	450,000.00	415,873.04	
GOV OF SPAIN	510,000.00	469,334.33	
GOV OF SPAIN	360,000.00	394,246.80	
GOV OF SPAIN	410,000.00	468,124.26	
GOV OF SPAIN	410,000.00	373,865.47	
GOV OF SPAIN	410,000.00	357,225.36	
GOV OF SPAIN	430,000.00	368,362.51	
GOV OF SPAIN	510,000.00	427,976.70	
GOV OF SPAIN	500,000.00	461,443.74	
GOV OF SPAIN	480,000.00	419,978.40	
GOV OF SPAIN	390,000.00	307,298.55	
GOV OF SPAIN	470,000.00	377,128.47	
GOV OF SPAIN	340,000.00	273,757.80	
GOV OF SPAIN	390,000.00	464,252.88	
GOV OF SPAIN	480,000.00	450,469.99	
GOV OF SPAIN	500,000.00	490,780.00	
GOV OF SPAIN	380,000.00	347,351.16	
GOV OF SPAIN	280,000.00	282,851.80	
GOV OF SPAIN	240,000.00	201,343.83	
GOV OF SPAIN	470,000.00	499,642.28	
GOV OF SPAIN	280,000.00	195,027.70	
GOV OF SPAIN	130,000.00	132,187.53	
GOV OF SPAIN	350,000.00	400,134.66	
GOV OF SPAIN	290,000.00	197,340.48	
GOV OF SPAIN	470,000.00	528,101.87	
GOV OF SPAIN	180,000.00	112,928.61	
GOV OF SPAIN	180,000.00	170,194.72	
GOV OF SPAIN	380,000.00	454,119.90	
GOV OF SPAIN	220,000.00	190,184.50	



	GOV OF SPAIN	270,000.00	221,418.66
	GOV OF SPAIN	470,000.00	249,824.74
	GOV OF SPAIN	300,000.00	197,394.00
	GOV OF SPAIN	260,000.00	235,690.64
	GOV OF SPAIN	130,000.00	62,680.15
	ユーロ 小計	131,014,000.00	119,843,447.63 (18,779,468,243)
英ポンド	UK TREASURY	350,000.00	340,977.84
	UK TREASURY	430,000.00	400,521.78
	UK TREASURY	250,000.00	250,191.25
	UK TREASURY	370,000.00	342,097.78
	UK TREASURY	250,000.00	235,468.50
	UK TREASURY	140,000.00	135,081.24
	UK TREASURY	500,000.00	447,000.69
	UK TREASURY	250,000.00	228,465.00
	UK TREASURY	700,000.00	610,085.00
	UK TREASURY	400,000.00	391,292.30
	UK TREASURY	240,000.00	211,884.00
	UK TREASURY	280,000.00	276,934.00
	UK TREASURY	300,000.00	247,815.00
	UK TREASURY	160,000.00	159,134.92
	UK TREASURY	320,000.00	279,808.00
	UK TREASURY	140,000.00	150,557.40
	UK TREASURY	550,000.00	446,105.00
	UK TREASURY	270,000.00	220,795.30
	UK TREASURY	390,000.00	297,656.58
	UK TREASURY	280,000.00	289,646.00
	UK TREASURY	470,000.00	344,773.20
	UK TREASURY	640,000.00	494,042.88
	UK TREASURY	480,000.00	483,096.00
	UK TREASURY	400,000.00	369,194.23
	UK TREASURY	430,000.00	313,525.90
	UK TREASURY	220,000.00	224,422.00
	UK TREASURY	430,000.00	283,099.10
	UK TREASURY	270,000.00	268,329.78

	UK TREASURY	400,000.00	289,729.20
	UK TREASURY	160,000.00	148,375.87
	UK TREASURY	280,000.00	290,953.15
	UK TREASURY	340,000.00	215,133.64
	UK TREASURY	330,000.00	322,985.52
	UK TREASURY	240,000.00	234,616.03
	UK TREASURY	290,000.00	176,027.68
	UK TREASURY	450,000.00	452,917.44
	UK TREASURY	380,000.00	318,216.33
	UK TREASURY	360,000.00	311,580.50
	UK TREASURY	370,000.00	183,631.00
	UK TREASURY	300,000.00	290,187.00
	UK TREASURY	350,000.00	199,556.00
	UK TREASURY	210,000.00	125,055.00
	UK TREASURY	220,000.00	213,555.32
	UK TREASURY	340,000.00	139,060.00
	UK TREASURY	430,000.00	214,409.68
	UK TREASURY	240,000.00	214,634.40
	UK TREASURY	320,000.00	167,820.60
	UK TREASURY	250,000.00	222,520.00
	UK TREASURY	240,000.00	129,330.24
	UK TREASURY	310,000.00	304,537.80
	UK TREASURY	280,000.00	154,394.80
	UK TREASURY	280,000.00	265,177.80
	UK TREASURY	400,000.00	124,808.80
	UK TREASURY	120,000.00	113,657.02
	UK TREASURY	260,000.00	173,193.80
	UK TREASURY	270,000.00	231,471.00
	UK TREASURY	290,000.00	141,517.10
	UK TREASURY	170,000.00	65,178.00
	英bond 小計	18,790,000.00	15,176,231.39 (2,754,637,759)
スウェーデンクローナ	GOV OF SWEDEN	1,460,000.00	1,439,660.25
	GOV OF SWEDEN	1,480,000.00	1,393,090.95
	GOV OF SWEDEN	1,300,000.00	1,192,471.78
	GOV OF SWEDEN	1,220,000.00	1,098,070.03

	GOV OF SWEDEN	1,080,000.00	901,215.72	
	GOV OF SWEDEN	790,000.00	777,861.80	
	GOV OF SWEDEN	600,000.00	565,517.35	
	GOV OF SWEDEN	770,000.00	867,343.40	
	スウェーデンクローナ 小計	8,700,000.00	8,235,231.28	(112,081,497)
ノルウェークローネ	GOV OF NORWAY	1,080,000.00	1,039,591.47	
	GOV OF NORWAY	880,000.00	825,418.00	
	GOV OF NORWAY	810,000.00	750,909.69	
	GOV OF NORWAY	720,000.00	662,326.56	
	GOV OF NORWAY	690,000.00	614,031.00	
	GOV OF NORWAY	1,060,000.00	905,425.50	
	GOV OF NORWAY	940,000.00	778,738.30	
	GOV OF NORWAY	470,000.00	414,258.00	
	GOV OF NORWAY	560,000.00	528,803.52	
	ノルウェークローネ 小計	7,210,000.00	6,519,502.04	(91,794,588)
デンマーククローネ	GOV OF DENMARK	1,070,000.00	1,025,512.62	
	GOV OF DENMARK	1,090,000.00	1,058,755.46	
	GOV OF DENMARK	1,100,000.00	1,002,598.51	
	GOV OF DENMARK	1,240,000.00	1,090,027.95	
	GOV OF DENMARK	1,250,000.00	1,009,494.66	
	GOV OF DENMARK	2,000,000.00	2,458,000.00	
	GOV OF DENMARK	1,040,000.00	543,196.16	
	デンマーククローネ 小計	8,790,000.00	8,187,585.36	(172,184,920)
ポーランドズロチ	GOV OF POLAND	80,000.00	75,720.00	
	GOV OF POLAND	860,000.00	825,987.00	
	GOV OF POLAND	570,000.00	527,164.50	
	GOV OF POLAND	820,000.00	788,415.32	
	GOV OF POLAND	840,000.00	777,000.00	
	GOV OF POLAND	990,000.00	847,093.50	
	GOV OF POLAND	220,000.00	209,176.00	
	GOV OF POLAND	610,000.00	552,050.00	
	GOV OF POLAND	460,000.00	413,839.00	

	GOV OF POLAND	570,000.00	624,832.74
	GOV OF POLAND	190,000.00	195,187.00
	GOV OF POLAND	980,000.00	855,785.00
	GOV OF POLAND	640,000.00	489,917.44
	GOV OF POLAND	690,000.00	519,535.50
	GOV OF POLAND	190,000.00	199,880.00
	ポーランドズロチ 小計	8,710,000.00	7,901,583.00 (278,151,524)
オーストラリアドル	GOV OF AUSTRALIA	550,000.00	522,669.49
	GOV OF AUSTRALIA	390,000.00	384,681.44
	GOV OF AUSTRALIA	330,000.00	302,959.93
	GOV OF AUSTRALIA	380,000.00	382,975.81
	GOV OF AUSTRALIA	560,000.00	503,722.54
	GOV OF AUSTRALIA	330,000.00	339,818.52
	GOV OF AUSTRALIA	280,000.00	267,695.26
	GOV OF AUSTRALIA	310,000.00	288,272.19
	GOV OF AUSTRALIA	280,000.00	265,095.59
	GOV OF AUSTRALIA	340,000.00	328,874.33
	GOV OF AUSTRALIA	250,000.00	233,906.83
	GOV OF AUSTRALIA	560,000.00	512,657.75
	GOV OF AUSTRALIA	490,000.00	398,067.39
	GOV OF AUSTRALIA	320,000.00	267,054.44
	GOV OF AUSTRALIA	550,000.00	435,072.62
	GOV OF AUSTRALIA	640,000.00	511,022.86
	GOV OF AUSTRALIA	440,000.00	363,813.53
	GOV OF AUSTRALIA	440,000.00	458,041.27
	GOV OF AUSTRALIA	330,000.00	302,513.03
	GOV OF AUSTRALIA	430,000.00	420,490.54
	GOV OF AUSTRALIA	330,000.00	314,454.54
	GOV OF AUSTRALIA	190,000.00	166,926.60
	GOV OF AUSTRALIA	190,000.00	182,732.81
	GOV OF AUSTRALIA	190,000.00	169,429.56
	GOV OF AUSTRALIA	250,000.00	203,739.05
	GOV OF AUSTRALIA	250,000.00	202,775.68
	GOV OF AUSTRALIA	370,000.00	218,887.29

オーストラリアドル 小計		9,970,000.00	8,948,350.89 (853,046,290)
ニュージーランドドル	GOV OF NEWZEALAND	130,000.00	124,479.92
	GOV OF NEWZEALAND	150,000.00	132,676.57
	GOV OF NEWZEALAND	190,000.00	187,990.74
	GOV OF NEWZEALAND	100,000.00	81,083.82
	GOV OF NEWZEALAND	110,000.00	100,868.22
	GOV OF NEWZEALAND	100,000.00	99,184.49
	GOV OF NEWZEALAND	120,000.00	95,796.22
	GOV OF NEWZEALAND	120,000.00	97,626.91
	GOV OF NEWZEALAND	120,000.00	109,869.32
	GOV OF NEWZEALAND	90,000.00	87,122.35
	GOV OF NEWZEALAND	110,000.00	88,002.71
	GOV OF NEWZEALAND	80,000.00	50,795.40
	GOV OF NEWZEALAND	100,000.00	69,081.18
	ニュージーランドドル 小計		1,520,000.00
シンガポールドル	GOV OF SINGAPORE	120,000.00	119,340.67
	GOV OF SINGAPORE	250,000.00	245,201.25
	GOV OF SINGAPORE	120,000.00	112,608.00
	GOV OF SINGAPORE	130,000.00	125,970.00
	GOV OF SINGAPORE	110,000.00	103,411.00
	GOV OF SINGAPORE	180,000.00	182,412.00
	GOV OF SINGAPORE	40,000.00	39,788.00
	GOV OF SINGAPORE	70,000.00	68,893.65
	GOV OF SINGAPORE	120,000.00	119,400.00
	GOV OF SINGAPORE	180,000.00	179,100.00
	GOV OF SINGAPORE	120,000.00	108,840.00
	GOV OF SINGAPORE	100,000.00	97,384.96
	GOV OF SINGAPORE	110,000.00	114,056.80
	GOV OF SINGAPORE	150,000.00	140,700.00
	GOV OF SINGAPORE	100,000.00	95,593.50
	GOV OF SINGAPORE	110,000.00	112,674.65
	GOV OF SINGAPORE	120,000.00	123,960.00
	GOV OF SINGAPORE	150,000.00	132,000.00

	GOV OF SINGAPORE	50,000.00	44,526.50
	GOV OF SINGAPORE	40,000.00	47,020.00
	シンガポールドル 小計	2,370,000.00	2,312,880.98 (245,905,505)
マレーシアリングgit	GOV OF MALAYSIA	240,000.00	242,109.81
	GOV OF MALAYSIA	410,000.00	414,540.38
	GOV OF MALAYSIA	520,000.00	525,974.90
	GOV OF MALAYSIA	210,000.00	215,073.72
	GOV OF MALAYSIA	280,000.00	283,892.70
	GOV OF MALAYSIA	440,000.00	445,245.85
	GOV OF MALAYSIA	270,000.00	269,360.16
	GOV OF MALAYSIA	620,000.00	628,170.48
	GOV OF MALAYSIA	80,000.00	79,768.89
	GOV OF MALAYSIA	350,000.00	351,358.14
	GOV OF MALAYSIA	180,000.00	187,211.61
	GOV OF MALAYSIA	470,000.00	474,094.40
	GOV OF MALAYSIA	250,000.00	261,011.05
	GOV OF MALAYSIA	430,000.00	396,301.59
	GOV OF MALAYSIA	340,000.00	349,598.40
	GOV OF MALAYSIA	210,000.00	205,521.48
	GOV OF MALAYSIA	190,000.00	190,361.58
	GOV OF MALAYSIA	280,000.00	299,285.70
	GOV OF MALAYSIA	420,000.00	415,130.05
	GOV OF MALAYSIA	220,000.00	226,131.31
	GOV OF MALAYSIA	550,000.00	593,369.03
	GOV OF MALAYSIA	150,000.00	164,899.45
	GOV OF MALAYSIA	450,000.00	433,358.35
	GOV OF MALAYSIA	340,000.00	367,223.42
	GOV OF MALAYSIA	140,000.00	154,405.90
	GOV OF MALAYSIA	280,000.00	302,826.60
	GOV OF MALAYSIA	250,000.00	276,658.20
	GOV OF MALAYSIA	490,000.00	473,488.17
	GOV OF MALAYSIA	90,000.00	93,898.53
	マレーシアリングgit 小計	9,150,000.00	9,320,269.85 (288,514,545)
中国元	GOV OF CHINA	2,770,000.00	2,785,865.45

GOV OF CHINA	3,100,000.00	3,100,993.55	
GOV OF CHINA	3,320,000.00	3,332,396.88	
GOV OF CHINA	3,130,000.00	3,138,509.21	
GOV OF CHINA	4,720,000.00	4,742,905.68	
GOV OF CHINA	5,130,000.00	5,120,317.94	
GOV OF CHINA	3,140,000.00	3,148,148.61	
GOV OF CHINA	4,800,000.00	4,803,045.10	
GOV OF CHINA	2,690,000.00	2,744,246.26	
GOV OF CHINA	4,450,000.00	4,457,533.40	
GOV OF CHINA	2,500,000.00	2,516,412.00	
GOV OF CHINA	4,480,000.00	4,582,205.37	
GOV OF CHINA	3,500,000.00	3,569,351.80	
GOV OF CHINA	3,300,000.00	3,402,704.58	
GOV OF CHINA	4,650,000.00	4,711,463.70	
GOV OF CHINA	320,000.00	329,383.68	
GOV OF CHINA	1,960,000.00	1,962,184.22	
GOV OF CHINA	2,740,000.00	2,753,028.97	
GOV OF CHINA	7,030,000.00	7,158,821.23	
GOV OF CHINA	2,630,000.00	2,640,652.55	
GOV OF CHINA	3,120,000.00	3,124,856.28	
GOV OF CHINA	3,630,000.00	3,774,988.00	
GOV OF CHINA	3,200,000.00	3,233,354.88	
GOV OF CHINA	3,090,000.00	3,120,130.59	
GOV OF CHINA	1,030,000.00	1,057,698.76	
GOV OF CHINA	2,200,000.00	2,349,376.04	
GOV OF CHINA	4,360,000.00	4,455,133.89	
GOV OF CHINA	1,900,000.00	1,980,293.62	
GOV OF CHINA	3,850,000.00	3,907,074.32	
GOV OF CHINA	2,300,000.00	2,404,431.27	
GOV OF CHINA	1,220,000.00	1,233,096.82	
GOV OF CHINA	2,920,000.00	2,925,924.09	
GOV OF CHINA	4,140,000.00	4,187,883.65	
GOV OF CHINA	4,000,000.00	4,050,588.40	
GOV OF CHINA	4,080,000.00	4,100,540.76	
GOV OF CHINA	4,540,000.00	4,768,031.03	

	GOV OF CHINA	2,690,000.00	2,767,500.77	
	GOV OF CHINA	1,820,000.00	1,851,121.45	
	GOV OF CHINA	2,260,000.00	2,273,403.60	
	GOV OF CHINA	2,170,000.00	2,183,562.06	
	GOV OF CHINA	1,970,000.00	1,971,679.02	
	GOV OF CHINA	1,900,000.00	1,886,832.58	
	GOV OF CHINA	2,060,000.00	2,082,351.00	
	GOV OF CHINA	3,770,000.00	3,843,036.96	
	GOV OF CHINA	1,700,000.00	1,707,543.58	
	GOV OF CHINA	1,740,000.00	2,067,140.70	
	GOV OF CHINA	2,260,000.00	2,598,070.68	
	GOV OF CHINA	3,670,000.00	3,910,393.07	
	GOV OF CHINA	3,150,000.00	3,602,801.47	
	GOV OF CHINA	1,340,000.00	1,517,358.24	
	GOV OF CHINA	2,430,000.00	2,659,817.97	
	GOV OF CHINA	750,000.00	791,760.15	
	GOV OF CHINA	1,150,000.00	1,178,279.65	
	GOV OF CHINA	700,000.00	729,169.84	
	中国元 小計	157,470,000.00	161,295,395.37 (3,176,293,443)	
イスラエルシュケル	GOV OF ISRAEL	390,000.00	372,079.50	
	GOV OF ISRAEL	750,000.00	704,737.50	
	GOV OF ISRAEL	50,000.00	48,452.50	
	GOV OF ISRAEL	290,000.00	267,061.00	
	GOV OF ISRAEL	260,000.00	290,108.00	
	GOV OF ISRAEL	380,000.00	358,891.00	
	GOV OF ISRAEL	430,000.00	409,102.00	
	GOV OF ISRAEL	440,000.00	370,788.00	
	GOV OF ISRAEL	200,000.00	164,210.00	
	GOV OF ISRAEL	360,000.00	269,262.00	
	GOV OF ISRAEL	370,000.00	451,363.00	
	GOV OF ISRAEL	430,000.00	414,133.00	
	GOV OF ISRAEL	140,000.00	110,943.00	
		イスラエルシュケル 小計	4,490,000.00	4,231,130.50 (163,715,555)



合計		55,638,709,991	
		(55,638,709,991)	

(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 265銘柄	100.0%	48.4%
カナダドル	国債証券 41銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 16銘柄	100.0%	1.0%
ユーロ	国債証券 365銘柄	100.0%	33.8%
英ポンド	国債証券 58銘柄	100.0%	5.0%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.2%
ノルウェークローネ	国債証券 9銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.3%
ポーランドズロチ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.5%
オーストラリアドル	国債証券 27銘柄	100.0%	1.5%
ニュージーランドドル	国債証券 13銘柄	100.0%	0.2%
シンガポールドル	国債証券 20銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングギット	国債証券 29銘柄	100.0%	0.5%
中国元	国債証券 54銘柄	100.0%	5.7%
イスラエルシェケル	国債証券 13銘柄	100.0%	0.3%

(注)時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

#### 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

#### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## R M新興国債券マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

2023年 7月25日現在

資産の部	
流動資産	
預金	6,842,277
コール・ローン	55,384,273
投資信託受益証券	10,255,992,194
未収入金	1,375,800
未収配当金	215,558,011
流動資産合計	10,535,152,555
資産合計	10,535,152,555
負債の部	
流動負債	
未払解約金	5,354,000
未払利息	150
流動負債合計	5,354,150
負債合計	5,354,150
純資産の部	
元本等	
元本	8,031,483,237
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	2,498,315,168
元本等合計	10,529,798,405
純資産合計	10,529,798,405
負債純資産合計	10,535,152,555

## 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	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25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月26日
期首元本額	8,250,061,279円
期中追加設定元本額	1,854,479,535円
期中一部解約元本額	2,073,057,577円
期末元本額	8,031,483,237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	1,384,380,885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	60,554,560円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	111,341,202円
九州SDGs・グローバルバランス	35,517,117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)	23,063,343円
ラップ型ファンド・プラスESG(成長型)	29,566,858円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定型)	7,601,766円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定成長型)	7,907,711円
りそな つみたてラップ型ファンド(成長型)	5,132,220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	2,475,589,996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V I グローバル・バランスファンド(安定型)(適格機関投資家専用)	9,532,998円
りそなV I グローバル・バランスファンド(安定成長型)(適格機関投資家専用)	4,749,077円
りそなV I グローバル・バランスファンド(成長型)(適格機関投資家専用)	13,150,387円
りそなF T マルチアセットファンド(適格機関投資家専用)	14,899,990円
りそなD A A マルチアセットファンド(適格機関投資家専用)	6,525,076円
2. 計算日における受益権の総数	8,031,483,237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	1.3111円
(10,000口当たり純資産額)	(13,111円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

### (金融商品に関する注記)

#### 金融商品の状況に関する事項

2023年 7月25日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

#### 金融商品の時価等に関する事項

2023年 7月25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25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25日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
投資信託受益証券	275,141,474
合計	275,141,474

(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	58,329,797.78	
		VANECK J.P.MORGAN EM LOCAL	545,832	14,109,757.20	
		米ドル 小計	1,821,079	72,439,554.98 (10,255,992,194)	
合計				10,255,992,194 (10,255,992,194)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

## 外貨建有価証券の内訳

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

(注)時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## R M国内リートマザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）

2023年 7月25日現在

<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	325,196,432
投資証券	45,186,018,200
派生商品評価勘定	5,614,670
未収入金	127,785,700
未収配当金	233,425,471
差入委託証拠金	28,462,500
流動資産合計	45,906,502,973
資産合計	45,906,502,973
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	120,800
前受金	6,913,200
未払金	110,387,080
未払解約金	82,572,000
未払利息	882
流動負債合計	199,993,962
負債合計	199,993,962
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	31,374,352,452
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	14,332,156,559
元本等合計	45,706,509,011
純資産合計	45,706,509,011
負債純資産合計	45,906,502,973

## 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25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	

期首	2022年 7月26日
期首元本額	20,399,310,082円
期中追加設定元本額	25,821,018,361円
期中一部解約元本額	14,845,975,991円
期末元本額	31,374,352,452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	53,938,901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	61,839,718円
りそな国内リートインデックス(ラップ専用)	1,373,005,735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)	43,981,399円
ラップ型ファンド・プラスESG(成長型)	47,862,663円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定型)	9,614,989円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定成長型)	16,041,571円
りそな つみたてラップ型ファンド(成長型)	17,347,158円
りそな つみたてリスクコントロールファンド	2,705,125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%)	47,754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	7,394,346,213円
FWりそな国内リートインデックスファンド	6,389,585,209円
Smart-i Jリートインデックス	3,154,539,336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)	4,113,199,227円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	162,109,460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）	5,829,101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（適格機関投資家専用）	14,832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）	341,811,360円
2. 計算日における受益権の総数	31,374,352,452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	1.4568円
(10,000口当たり純資産額)	(14,568円)

（注） は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

2023年 7月25日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、リートの価格変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

金融商品の時価等に関する事項

2023年 7月25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25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25日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
投資証券		1,155,177,015
合計		1,155,177,015

(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25日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	不動産投信指数先物取引				
	買建	466,604,130	-	472,098,000	5,493,870
	合計	466,604,130	-	472,098,000	5,493,870

## (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	862	103,871,000	
	サンケイリアルエステート投資法人	1,358	129,281,600	
	S O S i L A 物流リート投資法人	2,109	270,373,800	
	東海道リート投資法人	705	88,336,500	
	日本アコモデーションファンド投資法人	1,464	979,416,000	
	森ヒルズリート投資法人	4,987	732,091,600	
	産業ファンド投資法人	6,470	984,087,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	4,240	1,511,560,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	3,110	699,439,000	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	2,225	930,050,000	
	G L P 投資法人	14,297	2,005,869,100	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	2,028	711,828,000	
	日本プロロジスリート投資法人	7,373	2,194,204,800	
	星野リゾート・リート投資法人	742	467,460,000	
	O n e リート投資法人	740	190,920,000	
	イオンリート投資法人	4,868	747,238,000	
	ヒューリックリート投資法人	3,968	653,132,800	
	日本リート投資法人	1,377	469,557,000	
積水ハウス・リート投資法人	12,743	1,102,269,500		

トーセイ・リート投資法人	941	127,505,500	
ケネディクス商業リート投資法人	1,843	517,145,800	
ヘルスケア&メディカル投資法人	1,046	165,895,600	
サムティ・レジデンシャル投資法人	1,102	133,121,600	
野村不動産マスターファンド投資法人	13,713	2,218,763,400	
いちごホテルリート投資法人	703	78,033,000	
ラサールロジポート投資法人	5,421	822,907,800	
スターアジア不動産投資法人	5,295	311,346,000	
マリモ地方創生リート投資法人	648	83,462,400	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	1,675	852,575,000	
大江戸温泉リート投資法人	684	44,665,200	
投資法人みらい	5,152	238,795,200	
三菱地所物流リート投資法人	1,457	587,899,500	
C R E ロジスティクスファンド投資法人	1,817	322,699,200	
ザイマックス・リート投資法人	688	79,739,200	
タカラレーベン不動産投資法人	1,999	192,303,800	
アドバンス・ロジスティクス投資法人	1,848	244,675,200	
日本ビルファンド投資法人	4,947	3,052,299,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	4,349	2,491,977,000	
日本都市ファンド投資法人	21,396	2,032,620,000	
オリックス不動産投資法人	8,449	1,518,285,300	
日本プライムリアルティ投資法人	2,900	1,025,150,000	
N T T 都市開発リート投資法人	4,076	552,298,000	
東急リアル・エステート投資法人	2,843	549,267,600	
グローバル・ワン不動産投資法人	3,121	366,405,400	
ユナイテッド・アーバン投資法人	9,486	1,486,456,200	
森トラストリート投資法人	7,893	566,717,400	
インヴィンシブル投資法人	18,665	1,058,305,500	
フロンティア不動産投資法人	1,573	742,456,000	
平和不動産リート投資法人	2,988	431,766,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	2,859	874,854,000	
福岡リート投資法人	2,193	364,476,600	
ケネディクス・オフィス投資法人	2,468	832,950,000	
いちごオフィスリート投資法人	3,475	308,927,500	
大和証券オフィス投資法人	878	558,408,000	
阪急阪神リート投資法人	1,915	274,419,500	

スターツプロシード投資法人	735	162,949,500	
大和ハウスリート投資法人	6,392	1,790,399,200	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	13,675	949,045,000	
大和証券リビング投資法人	5,876	681,028,400	
ジャパンエクセレント投資法人	3,890	522,038,000	
合計	258,740	45,186,018,200	

(注) 券面総額欄の数値は口数を表しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

## R M先進国リートマザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

2023年 7月25日現在

資産の部	
流動資産	
預金	464,919,738
コール・ローン	4,218,646
株式	592,027,060
投資証券	60,544,329,181
派生商品評価勘定	88,760
未収入金	100,614,700
未収配当金	91,305,885
流動資産合計	61,797,503,970
資産合計	61,797,503,970
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	208,705
未払金	466,572,534
未払解約金	12,967,000
未払利息	11
流動負債合計	479,748,250
負債合計	479,748,250
純資産の部	
元本等	

2023年 7月25日現在

元本	39,496,849,883
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	21,820,905,837
元本等合計	61,317,755,720
純資産合計	61,317,755,720
負債純資産合計	61,797,503,970

## 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25日現在

1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月26日
期首元本額	19,526,755,514円
期中追加設定元本額	34,511,453,269円
期中一部解約元本額	14,541,358,900円
期末元本額	39,496,849,883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	541,769,255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	104,547,171円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	266,443,248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)	59,485,542円
ラップ型ファンド・プラスESG(成長型)	60,028,141円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定型)	10,317,666円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定成長型)	22,200,187円
りそな つみたてラップ型ファンド(成長型)	27,618,990円
りそな つみたてリスクコントロールファンド	957,848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%)	92,355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	14,121,520,749円
FWりそな先進国リートインデックスファンド	12,199,010,692円
Smart-i 先進国リートインデックス	2,744,849,243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)	141,140,145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)	23,132,123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(適格機関投資家専用)	28,474円
りそなDAAファンド202205(適格機関投資家専用)	297,596,304円

## 2. 計算日における受益権の総数

39,496,849,883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	1.5525円
(10,000口当たり純資産額)	(15,525円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2023年 7月25日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、株価変動リスク、リートの価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

金融商品の時価等に関する事項

2023年 7月25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25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25日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式		42,280,293
投資証券		1,433,638,270
合計		1,475,918,563

(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25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	146,597,936	-	146,389,231	208,705
	米ドル	105,610,976	-	105,444,394	166,582
	オーストラリアドル	30,047,850	-	30,025,075	22,775
	香港ドル	5,078,640	-	5,072,872	5,768
	シンガポールドル	5,860,470	-	5,846,890	13,580
	売建	56,712,000	-	56,623,240	88,760
	米ドル	56,712,000	-	56,623,240	88,760
合計		203,309,936	-	203,012,471	119,945

## (注) 時価の算定方法

## 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

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	33.08	2,872,270.24	
	BROADSTONE NET LEASE INC-A	59,516	16.87	1,004,034.92	
	STAR HOLDINGS	3,563	15.29	54,478.27	
米ドル 小計		149,907		3,930,783.43 (556,520,318)	
オーストラリアドル	CENTURIA CAPITAL GROUP	222,365	1.67	372,461.37	
オーストラリアドル 小計		222,365		372,461.37 (35,506,742)	
合計		372,272		592,027,060 (592,027,060)	

(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	485,733.51	
		AGREE REALTY CORP	30,188	2,059,123.48	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	22,884	442,576.56	
		ALEXANDER'S INC	738	139,231.08	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	50,911	6,267,653.21	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	3,468	59,302.80	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	16,990	380,745.90	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	101,523	3,785,792.67	
		APARTMENT INCOME REIT CO	48,219	1,747,938.75	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	48,768	433,547.52	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	69,391	1,051,273.65	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	21,671	264,386.20	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	12,741	48,288.39	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	45,878	9,014,109.44	
		BLUEROCK HOMES TRUST INC	607	9,778.77	
		BOSTON PROPERTIES INC	46,198	2,977,923.08	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	21,236	76,874.32	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	55,191	256,638.15	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	97,325	2,251,127.25	
		BRT APARTMENTS CORP	3,225	64,951.50	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	34,497	3,892,296.51	
		CARETRUST REIT INC	31,518	665,975.34	
		CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	8,439	189,033.60	
		CENTERSPACE	4,898	314,304.66	
		CHATHAM LODGING TRUST	17,055	157,929.30	
		CITY OFFICE REIT INC	14,501	81,350.61	
		CLIPPER REALTY INC	2,188	13,959.44	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	8,122	297,752.52	
		CORPORATE OFFICE PROPERTIES	36,572	947,946.24	
		COUSINS PROPERTIES INC	49,201	1,179,347.97	
		CTO REALTY GROWTH INC	6,920	124,560.00	
		CUBESMART	72,731	3,245,257.22	
		DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	66,372	537,613.20	
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	92,300	47,996.00			

DIGITAL REALTY TRUST INC	94,164	11,593,471.68	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	82,808	205,363.84	
DOUGLAS EMMETT INC	55,281	761,219.37	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	82,000		
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	29,974	444,214.68	
EASTGROUP PROPERTIES INC	14,278	2,656,279.12	
ELME COMMUNITIES	28,983	477,060.18	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	42,453	336,652.29	
EPR PROPERTIES	24,436	1,101,819.24	
EQUINIX INC	30,220	24,753,202.00	
EQUITY COMMONWEALTH	34,709	715,005.40	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	56,557	4,049,481.20	
EQUITY RESIDENTIAL	110,178	7,562,617.92	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	48,291	1,246,873.62	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	20,737	5,068,122.80	
EXTRA SPACE STORAGE INC	68,277	9,995,070.03	
FARMLAND PARTNERS INC	15,087	198,243.18	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	23,585	2,433,028.60	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	42,813	2,266,948.35	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	27,857	763,838.94	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	33,544	51,657.76	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	84,906	4,199,450.76	
GETTY REALTY CORP	14,649	496,601.10	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	13,837	186,937.87	
GLADSTONE LAND CORP	11,212	193,070.64	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	21,276	214,462.08	
GLOBAL NET LEASE INC	33,604	375,020.64	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	122,343	2,465,211.45	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	176,835	3,911,590.20	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	8,823	53,908.53	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	34,295	874,865.45	
HOST HOTELS & RESORTS INC	230,278	4,013,745.54	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	39,736	224,111.04	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	71,361	1,263,803.31	

INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	17,584	71,742.72	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	8,924	707,048.52	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	21,401	520,900.34	
INVITATION HOMES INC	187,821	6,791,607.36	
IRON MOUNTAIN INC	94,318	5,861,863.70	
JBG SMITH PROPERTIES	30,544	498,783.52	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	274,900	83,844.50	
KILROY REALTY CORP	34,224	1,166,353.92	
KIMCO REALTY CORP	200,517	4,202,836.32	
KITE REALTY GROUP TRUST	71,081	1,660,452.16	
LTC PROPERTIES INC	13,323	471,101.28	
LXP INDUSTRIAL TRUST	94,968	999,063.36	
MACERICH CO/THE	68,338	867,209.22	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	635,700	68,655.60	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	193,545	2,024,480.70	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	37,693	5,833,368.68	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	26,147	912,268.83	
NATL HEALTH INVESTORS INC	13,760	773,036.80	
NECESSITY RETAIL REIT INC/TH	42,346	313,360.40	
NETSTREIT CORP	18,899	349,631.50	
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES	11,428	143,649.96	
NEXPOINT RESIDENTIAL	7,337	349,387.94	
NNN REIT INC	58,523	2,618,904.25	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	17,029	134,529.10	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	75,791	2,488,976.44	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	5,669	118,085.27	
ORION OFFICE REIT INC	19,499	131,033.28	
PARAMOUNT GROUP INC	52,275	263,466.00	
PARK HOTELS & RESORTS INC	70,332	913,612.68	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	40,092	560,085.24	
PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	38,045	1,347,173.45	
PHYSICIANS REALTY TRUST	77,193	1,171,789.74	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	39,816	293,045.76	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	12,349	289,337.07	
POSTAL REALTY TRUST INC- A	6,456	98,970.48	

PRIME US REIT	183,100	30,028.40	
PROLOGIS INC	298,372	37,896,227.72	
PUBLIC STORAGE	51,141	15,119,836.65	
REALTY INCOME CORP	217,576	13,787,791.12	
REGENCY CENTERS CORP	49,794	3,274,453.44	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	41,175	599,096.25	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	65,006	3,655,937.44	
RLJ LODGING TRUST	50,339	496,845.93	
RPT REALTY	27,355	303,914.05	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	19,028	1,758,377.48	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	73,389	972,404.25	
SAFEHOLD INC	12,956	316,774.20	
SAUL CENTERS INC	4,442	171,105.84	
SERVICE PROPERTIES TRUST	52,270	447,431.20	
SIMON PROPERTY GROUP INC	105,679	13,147,524.39	
SITE CENTERS CORP	57,839	843,292.62	
SL GREEN REALTY CORP	20,343	737,026.89	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	45,775	1,917,057.00	
STAG INDUSTRIAL INC	58,074	2,230,622.34	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	33,606	210,037.50	
SUN COMMUNITIES INC	40,196	5,637,489.00	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	65,630	638,579.90	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	33,411	797,186.46	
TERRENO REALTY CORP	24,017	1,476,565.16	
UDR INC	99,978	4,322,048.94	
UMH PROPERTIES INC	18,720	306,820.80	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	4,387	215,664.92	
URBAN EDGE PROPERTIES	37,301	637,847.10	
URSTADT BIDDLE - CLASS A	9,974	226,808.76	
VENTAS INC	129,294	6,423,325.92	
VERIS RESIDENTIAL INC	26,189	444,165.44	
VICI PROPERTIES INC	324,507	10,669,790.16	
VORNADO REALTY TRUST	52,358	1,092,187.88	
WELLTOWER INC	160,603	13,277,050.01	
WHITESTONE REIT	15,983	161,428.30	

	WP CAREY INC	69,166	5,047,043.02
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	35,531	438,452.54
	米ドル 小計	8,235,301	333,493,162.76 (47,215,961,983)
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	20,562	466,757.40
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	20,272	145,350.24
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	5,322	63,544.68
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	7,377	500,455.68
	BSR REAL ESTATE INVESTMENT T	6,564	117,889.44
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	14,969	50,445.53
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	26,590	1,395,975.00
	CHOICE PROPERTIES REIT	52,611	731,292.90
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	15,851	221,438.47
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	16,684	259,269.36
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	39,654	567,845.28
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	5,350	78,056.50
	EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	15,851	45,967.90
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	32,437	486,555.00
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	9,850	767,906.00
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	42,850	452,924.50
	INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	2,543	9,332.81
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	22,620	295,643.40
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	18,755	337,965.10
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	5,378	82,552.30
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	6,979	114,944.13
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	12,242	103,322.48
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	37,128	263,980.08
	PRIMARIS REIT	14,963	203,047.91
	PRO REAL ESTATE INVESTMENT T	8,626	46,839.18
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	47,761	965,727.42
	SLATE GROCERY REIT	10,423	141,961.26
	SLATE OFFICE REIT	6,335	12,226.55
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	23,279	587,329.17
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	16,181	43,526.89
		566,007	9,560,072.56

	カナダドル 小計		(1,027,612,199)
ユーロ	AEDIFICA	15,227	951,687.50
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	2,209	11,221.72
	ALTAREA	1,602	164,365.20
	CARE PROPERTY INVEST	11,306	145,395.16
	CARMILA	18,272	286,504.96
	COFINIMMO	9,912	714,655.20
	COVIVIO	15,119	683,076.42
	CROMWELL REIT EUR	114,140	180,341.20
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	13,695	308,411.40
	GECINA SA	17,501	1,729,098.80
	HAMBORNER REIT AG	22,165	147,618.90
	ICADE	10,070	371,381.60
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	14,471	37,335.18
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	93,814	536,616.08
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	9,152	122,636.80
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	132,455	127,024.34
	KLEPIERRE	63,217	1,514,047.15
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	19,976	118,857.20
	MERCIALYS	26,360	218,788.00
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	108,344	913,881.64
	MONTEA NV	4,410	324,135.00
	NSI NV	5,397	105,241.50
	RETAIL ESTATES	3,532	203,443.20
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	34,458	1,811,112.48
	VASTNED RETAIL NV	6,207	122,277.90
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	50,026	1,393,724.36
WERELDHAVE NV	13,508	214,101.80	
XIOR STUDENT HOUSING NV	8,062	225,736.00	
	ユーロ 小計	844,607	13,682,716.69 (2,144,081,705)
英ポンド	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	141,815	71,616.57
	AEW UK REIT PLC	42,887	42,715.45
	ASSURA PLC	936,180	445,996.15
	BALANCED COMM PROPERTY TRUST	252,276	181,386.44
	BIG YELLOW GROUP PLC	55,646	595,968.66



	BRITISH LAND CO PLC	302,823	1,032,323.60	
	CLS HOLDINGS PLC	64,468	91,931.36	
	CUSTODIAN PROPERTY INCOME REIT PLC	153,661	134,299.71	
	DERWENT LONDON PLC	36,322	801,989.76	
	EDISTON PROPERTY INVESTMENT	57,084	35,506.24	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	188,158	162,568.51	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	83,526	356,656.02	
	HAMMERSON PLC	1,312,197	328,311.68	
	HELICAL PLC	33,175	88,577.25	
	HOME REIT PLC	147,401	56,086.08	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	142,814	132,245.76	
	INTU PROPERTIES PLC	117,549		
	LAND SECURITIES GROUP PLC	242,000	1,577,356.00	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	320,018	585,952.95	
	LXI REIT PLC	558,595	530,665.25	
	NEWRIVER REIT PLC	107,134	91,492.43	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	190,871	139,717.57	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	421,955	405,709.73	
	PRS REIT PLC/THE	171,235	144,008.63	
	REGIONAL REIT LTD	151,551	70,471.21	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	69,285	629,107.80	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	197,166	87,147.37	
	SEGRO PLC	395,950	3,092,369.50	
	SHAFTESBURY CAPITAL PLC	634,595	782,455.63	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	398,928	309,568.12	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	106,966	63,323.87	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	607,025	847,406.90	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	267,793	142,198.08	
	UNITE GROUP PLC	129,490	1,223,680.50	
	URBAN LOGISTICS REIT PLC	147,659	178,076.75	
	WAREHOUSE REIT PLC	145,941	129,011.84	
	WORKSPACE GROUP PLC	43,511	224,951.87	
	英ボンド 小計	9,375,650	15,812,851.24 (2,870,190,628)	
オーストラリアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	126,889	331,180.29	

	ARENA REIT	111,944	420,909.44
	BWP TRUST	155,714	582,370.36
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	176,579	561,521.22
	CENTURIA OFFICE REIT	150,261	216,375.84
	CHARTER HALL GROUP	153,730	1,734,074.40
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	212,716	861,499.80
	CHARTER HALL RETAIL REIT	169,064	633,990.00
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	102,691	312,180.64
	CROMWELL PROPERTY GROUP	432,684	244,466.46
	DEXUS INDUSTRIA REIT	71,835	201,856.35
	DEXUS/AU	345,560	2,799,036.00
	GDI PROPERTY GROUP	181,458	122,484.15
	GOODMAN GROUP	553,340	11,454,138.00
	GPT GROUP	621,294	2,652,925.38
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	88,398	251,934.30
	HEALTHCO REIT	136,880	192,316.40
	HMC CAPITAL LTD	77,093	399,341.74
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	507,628	609,153.60
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	67,652	206,338.60
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	119,014	490,337.68
	MIRVAC GROUP	1,267,475	2,953,216.75
	NATIONAL STORAGE REIT	397,707	898,817.82
	RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE	96,236	69,771.10
	REGION RE LTD	362,765	874,263.65
	RURAL FUNDS GROUP	133,000	271,320.00
	SCENTRE GROUP	1,680,919	4,656,145.63
	STOCKLAND	766,711	3,189,517.76
	VICINITY CENTRES	1,255,947	2,467,935.85
	WAYPOINT REIT	219,293	565,775.94
	オーストラリアドル 小計	10,742,477	41,225,195.15 (3,929,997,853)
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	256,643	310,538.03
	GOODMAN PROPERTY TRUST	342,168	768,167.16
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	498,622	468,704.68
	PRECINCT PROPERTIES GROUP	432,348	566,375.88

	STRIDE STAPLED GROUP	186,933	280,399.50
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	159,328	379,200.64
	ニュージーランドドル 小計	1,876,042	2,773,385.89 (243,336,877)
香港ドル	CHAMPION REIT	601,000	1,664,770.00
	FORTUNE REIT	470,000	2,655,500.00
	LINK REIT	823,300	35,566,560.00
	PROSPERITY REIT	431,000	741,320.00
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	345,000	1,010,850.00
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	795,000	1,248,150.00
	香港ドル 小計	3,465,300	42,887,150.00 (777,115,158)
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LT	184,100	230,125.00
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	1,081,400	3,027,920.00
	CAPITALAND ASCOTT TRUST	695,096	764,605.60
	CAPITALAND CHINA TRUST	376,400	391,456.00
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	1,620,532	3,241,064.00
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	266,200	319,440.00
	DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	209,200	128,658.00
	EC WORLD REIT	50,000	14,750.00
	ESR-LOGOS REIT	2,101,050	714,357.00
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	321,400	210,517.00
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	461,400	122,271.00
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	338,500	744,700.00
	FRASERS LOGISTICS & COMMERC I	942,479	1,215,797.91
	KEPPEL DC REIT	432,200	981,094.00
	KEPPEL REIT	649,200	590,772.00
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	611,800	416,024.00
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	650,700	1,483,596.00
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,069,600	1,818,320.00
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA	750,400	1,238,160.00
	OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	779,700	237,808.50
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	126,100	481,702.00
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	188,100	134,491.50
	SPH REIT	333,900	315,535.50
STARHILL GLOBAL REIT	435,300	222,003.00	

	SUNTEC REIT	734,500	954,850.00	
	シンガポールドル 小計	15,409,257	20,000,018.01 (2,126,401,914)	
韓国ウォン	D&D PLATFORM REIT CO LTD	15,215	47,242,575.00	
	E KOCREF CR-REIT CO LTD	3,951	20,466,180.00	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	43,823	170,690,585.00	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	16,308	71,755,200.00	
	JR REIT XXVII	47,106	192,428,010.00	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	14,612	81,681,080.00	
	LOTTE REIT CO LTD	44,180	161,036,100.00	
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	34,232	140,864,680.00	
	NH ALL-ONE REIT CO LTD	11,869	39,464,425.00	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	26,417	165,106,250.00	
	SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LT	4,632	14,822,400.00	
SK REITS CO LTD	27,542	135,644,350.00		
	韓国ウォン 小計	289,887	1,241,201,835.00 (136,904,562)	
イスラエルシェケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	237,765	378,284.11	
	REIT 1 LTD	62,662	1,008,231.58	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	64,116	493,052.04	
	イスラエルシェケル 小計	364,543	1,879,567.73 (72,726,302)	
	合計		60,544,329,181 (60,544,329,181)	

(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 140銘柄		98.8%	77.2%
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%	3.5%
英ポンド	投資証券	37銘柄		100.0%	4.7%
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%	6.4%
ニュージーランドドル	投資証券	6銘柄		100.0%	0.4%
香港ドル	投資証券	6銘柄		100.0%	1.3%
シンガポールドル	投資証券	25銘柄		100.0%	3.5%
韓国ウォン	投資証券	12銘柄		100.0%	0.2%
イスラエルシェケル	投資証券	3銘柄		100.0%	0.1%

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

## 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。

## 【つみたてバランスファンド】

## 【純資産額計算書】

資産総額	36,542,792,655円
負債総額	22,927,301円
純資産総額（ - ）	36,519,865,354円
発行済口数	25,191,111,982口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4497円

（参考）

## R M国内株式マザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	119,892,245,022円
負債総額	715,929,789円
純資産総額（ - ）	119,176,315,233円
発行済口数	67,343,764,471口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7697円

## R M先進国株式マザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	203,343,465,907円
負債総額	13,063,679円
純資産総額（ - ）	203,330,402,228円
発行済口数	80,469,138,052口
1口当たり純資産額（ / ）	2.5268円

## R M新興国株式マザーファンド

## 純資産額計算書

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

## R M国内債券マザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	157,919,618,291円
負債総額	95,202,407円
純資産総額（ - ）	157,824,415,884円
発行済口数	156,749,768,517口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0069円

## R M先進国債券マザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	55,776,606,277円
負債総額	25,800,364円
純資産総額（ - ）	55,750,805,913円
発行済口数	48,390,022,502口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1521円

## R M新興国債券マザーファンド

## 純資産額計算書

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

## R M国内リートマザーファンド

## 純資産額計算書

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

## R M先進国リートマザーファンド

### 純資産額計算書

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

譲渡制限はありません。

#### 受益権の譲渡

- ・受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。
- ・前述の申請のある場合には、振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社債、株式等の振替に関する法律の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。
- ・前述の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合などにおいて、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

#### 受益権の譲渡の対抗要件

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

### （4）受益証券の再発行

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

### （5）受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議のうえ、社債、株式等の振替に関する法律に定めるところにしたがい、一



定日現在の受益権を均等に再分割できるものとしします。

(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）

###### 会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

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

###### PLAN：計画

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

###### DO：実行

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

###### CHECK：検証 ACTION：改善

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

## 2【事業の内容及び営業の概況】

当社は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社として、証券投資信託の設定を行うとともに、「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者として、その運用（投資運用業）を行っています。また、「金融商品取引法」に定める投資助言・代理業および第二種金融商品取引業を行っています。

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
単体型株式投資信託	5	22,206
単体型公社債投資信託	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	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					株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他 利益剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	

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

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

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					株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他 利益剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	1,000,000	490,000	490,000	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。

### 投資運用業（投資信託委託業）

投資信託約款に基づき、信託財産の運用指図等を行っております。

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

### 投資運用業（投資一任業）

投資一任契約に基づき、顧客資産を一任して運用指図等を行っております。

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

### 投資助言・代理業

投資助言契約に基づき、運用に関する投資判断の助言等を行っております。

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

## 5．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

### （1）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

## 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

## 営業収益

本邦の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

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

## 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

## (3) 主要な顧客ごとの情報

(単位：千円)

顧客の名称又は氏名	営業収益額
株式会社りそな銀行	5,964,710

## 3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

## 4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

## 5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

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

## 営業収益

本邦の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

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

## 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

## (3) 主要な顧客ごとの情報

(単位：千円)

顧客の名称又は氏名	営業収益額
株式会社りそな銀行	5,545,681

## 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) 通常の利用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
auカブコム証券株式会社	7,196百万円	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
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	
株式会社 S B I 証券	48,323百万円	
岡三証券株式会社	5,000百万円	

松井証券株式会社	11,945百万円	ます。
マネックス証券株式会社（注）	12,200百万円	
楽天証券株式会社	19,495百万円	
株式会社関西みらい銀行	38,971百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社埼玉りそな銀行	70,000百万円	
株式会社みなと銀行	39,984百万円	
株式会社りそな銀行	279,928百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

（注）マネックス証券株式会社は、株式会社SBI新生銀行との金融商品仲介業務における包括的業務提携に伴い、株式会社SBI新生銀行に募集の取扱いを委託します。

## 2【関係業務の概要】

### （1）受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行ないます。

### （2）販売会社

日本におけるファンドの募集、解約、収益分配金および償還金の取扱いなどを行ないます。

## 3【資本関係】

### （1）受託会社

該当事項はありません。

### （2）販売会社

該当事項はありません。

## 第3【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。
 

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。

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。

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。

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。

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。

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

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

### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

## 独立監査人の監査報告書

2023年10月10日

りそなアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 松崎 雅則  
業務執行社員

### 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているつみたてバランスファンドの2022年7月26日から2023年7月25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、つみたてバランスファンドの2023年7月25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を検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。