

【表紙】

【提出書類】	訂正有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2023年12月15日提出
【発行者名】	りそなアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役 西山 明宏
【本店の所在の場所】	東京都江東区木場一丁目5番65号
【事務連絡者氏名】	塚田 光子
【電話番号】	03-6704-3821
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	ターゲットリターンバランスファンド（目標2%） ターゲットリターンバランスファンド（目標3%） ターゲットリターンバランスファンド（目標4%） ターゲットリターンバランスファンド（目標5%） ターゲットリターンバランスファンド（目標6%）
【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)当初自己設定額 ターゲットリターンバランスファンド（目標2%） 100万円を上限とします。 ターゲットリターンバランスファンド（目標3%） 100万円を上限とします。 ターゲットリターンバランスファンド（目標4%） 100万円を上限とします。 ターゲットリターンバランスファンド（目標5%） 100万円を上限とします。 ターゲットリターンバランスファンド（目標6%） 100万円を上限とします。 (2)継続申込額 ターゲットリターンバランスファンド（目標2%） 1兆円を上限とします。 ターゲットリターンバランスファンド（目標3%） 1兆円を上限とします。 ターゲットリターンバランスファンド（目標4%） 1兆円を上限とします。 ターゲットリターンバランスファンド（目標5%） 1兆円を上限とします。 ターゲットリターンバランスファンド（目標6%） 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。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

半期報告書を提出しましたので2023年2月27日付をもって提出しました有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を新たな情報に訂正するため、また、記載事項の一部に訂正事項がありますのでこれを訂正するため、本訂正届出書を提出します。

2【訂正の内容】

<訂正前>および<訂正後>に記載している下線部_____は訂正部分を示し、<更新後>に記載している内容は原届出書が更新されます。なお、「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 5 運用状況」および「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況」は原届出書の更新後の内容を記載しています。

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】

<更新後>

ファンドの特色

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

● 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。

投資対象資産	マザーファンド	対象指数*
国内債券	RM国内債券マザーファンド	NOMURA-BPI総合
先進国債券	RM先進国債券マザーファンド (為替ヘッジあり)	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)
	RM先進国債券マザーファンド	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)
新興国債券	RM新興国債券マザーファンド	JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(円換算ベース)
国内株式	RM国内株式マザーファンド	東証株価指数(TOPIX、配当込み)
先進国株式	RM先進国株式マザーファンド	MSCI-KOKUSAI指数(配当込み、円換算ベース)
新興国株式	RM新興国株式マザーファンド	MSCIエマージング・マーケット指数(配当込み、円換算ベース)
国内リート	RM国内リートマザーファンド	東証REIT指数(配当込み)
先進国リート	RM先進国リートマザーファンド	S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)

* 各対象指数については、「各マザーファンドが対象とする指数の著作権等について」をご参照ください。

2 目標リターンが異なる5つのファンドがあります。

ファンド 目標リターン（年率） リスク水準（年率）	基本的資産配分 ※2023年3月時点	目標リターンとリスク水準の関係 (イメージ)
目標2% 目標リターン： 短期金利+2% リスク水準： 4.7%		
目標3% 目標リターン： 短期金利+3% リスク水準： 7.0%		
目標4% 目標リターン： 短期金利+4% リスク水準： 9.6%		
目標5% 目標リターン： 短期金利+5% リスク水準： 12.2%		
目標6% 目標リターン： 短期金利+6% リスク水準： 14.9%		

■ 国内債券
 ■ 先進国債券 (為替ヘッジあり)
 ■ 先進国債券 (為替ヘッジなし)
 ■ 新興国債券
 ■ 国内株式
 ■ 先進国株式
 ■ 新興国株式
 ■ 国内リート
 ■ 先進国リート

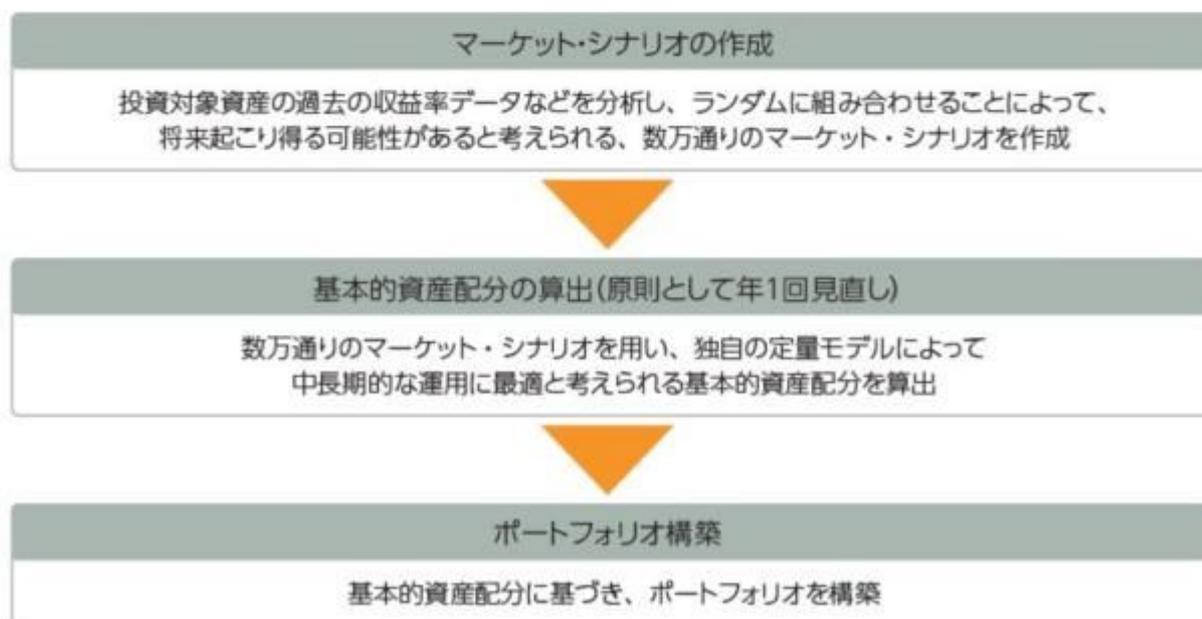
- ※「目標リターン」とは、必ず一定の収益を得ることのできる運用を意味するものではなく、記載されている目標リターンの数値は、その達成を示唆・保証するものではありません。したがって、投資者の元本が保証されるものではなく、各ファンドの基準価額は下落することがあります。
- ※目標リターンは、運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。その他発生する費用につきましては考慮していません。
- ※目標リターンに記載している短期金利は無担保コールO/N物レート(確報)のことを指します。
- ※目標リターンは、中長期的な運用を想定して設定しています。
- ※リスク水準は、2003年4月から2023年1月までの期間に、前記の資産配分で各マザーファンドを保有していたと仮定し、各対象指数の収益率に基づき算出したものです。実際の運用では資産配分の見直しや各マザーファンドのリスク水準の変化等に伴って将来的に変動します。
- ※前記の基本的資産配分は、2023年3月時点のものです。四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。基本的資産配分は、各ファンドの「目標リターン」に応じて、各マザーファンドの対象指数の過去の収益率およびリスクに鑑み定期的に見直します。ただし、信託財産に現金等が含まれることや各マザーファンドの基準価額が変動すること等により、実際の資産別構成比率が前記の基本的資産配分と一致しない場合があります。
- ※「目標リターンとリスク水準の関係」は、あくまでイメージを示したものであり、基準価額の上昇を示唆・保証するものではありません。

3 中長期的な運用に最適なポートフォリオ構築を目指します。

独自の定量モデルを用いて算出した基本的資産配分に基づき、ポートフォリオを構築します。

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

運用プロセスのイメージ



※上記の運用プロセスおよびイメージ図は、今後変更になる場合があります。

4 基本的資産配分は、原則として年1回見直します。

- 各ファンドの基本的資産配分は、独自の定量モデルを用い、各々の中長期的な目標リターンを目指して、各マザーファンドが運用目標とする対象指数の騰落率や変動性（標準偏差）等、公開されているデータに基づく定量的な算出により、原則として年1回見直します。

5 実質組入外貨建資産の一部について、対円での為替ヘッジを行います。

- 各ファンドが外貨建資産として組み入れるRM先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）において為替ヘッジを行います。

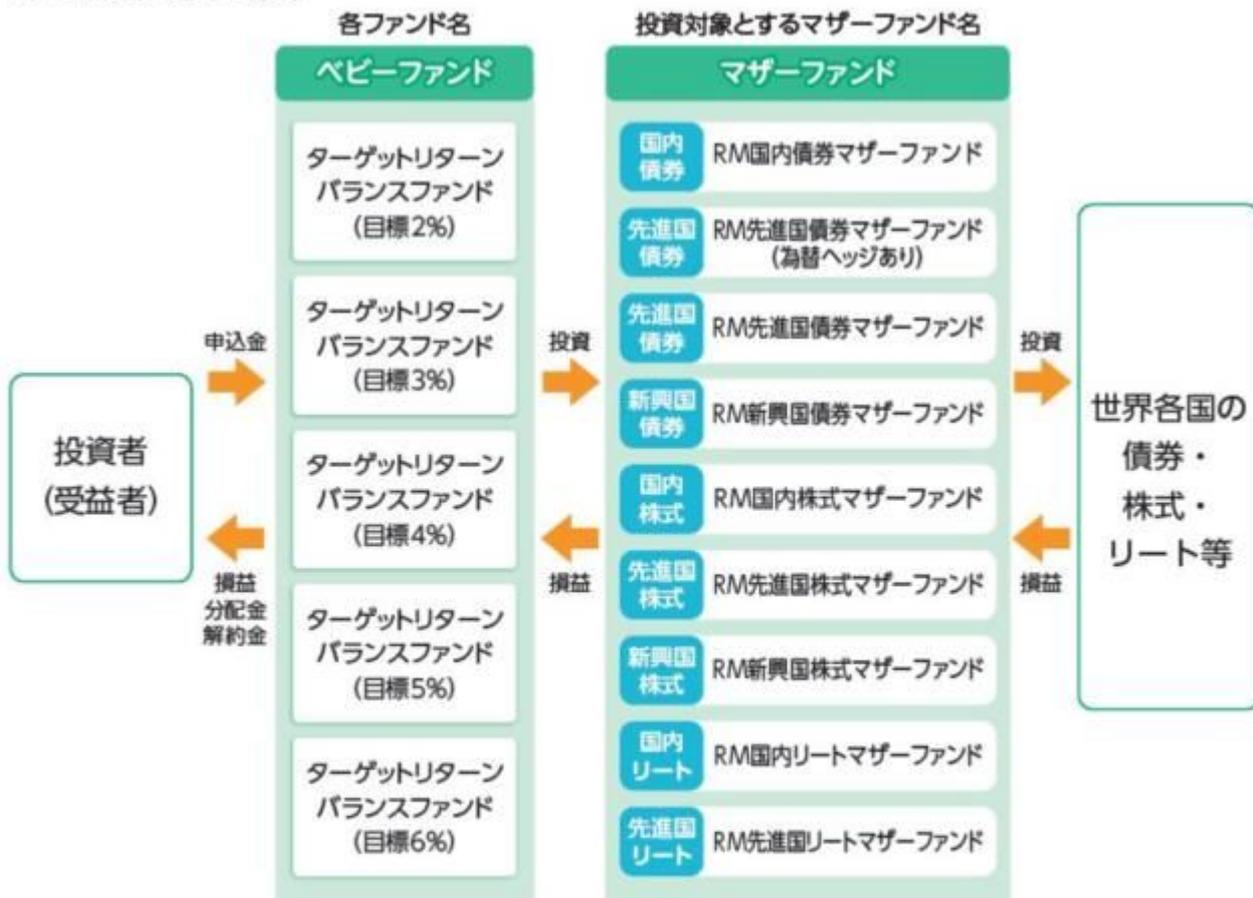
6 購入時手数料のないノーロード型のファンドです。

- 換金時手数料、信託財産留保額もかかりません。

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

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



■ 主な投資制限

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

分配方針

原則、毎年12月20日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、以下の収益分配方針に基づいて分配を行います。

- ①分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等とします。
- ②原則として、基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配金額を決定します。ただし、信託財産の中長期的な成長に資することを考慮して分配を行わないことがあります。
- ③留保金は、運用の基本方針に基づいて運用します。

★将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

各マザーファンドが対象とする指数の著作権等について

● RM国内債券マザーファンド

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

● RM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)

「FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

● RM先進国債券マザーファンド

「FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)」は、FTSE世界国債インデックス(除く日本、米ドルベース)をもとに委託会社が円換算して計算したものです。FTSE世界国債インデックス(除く日本、米ドルベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

● RM新興国債券マザーファンド

「JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(円換算ベース)」は、JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(米ドルベース)をもとに、委託会社が円換算して計算したものです。JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(米ドルベース)は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・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とした指数であり、指数に関する著作権はJ.P.Morgan Securities LLCに帰属します。

● RM国内株式マザーファンド

「東証株価指数(TOPIX、配当込み)」は、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、配当を考慮したものです。なお、TOPIXに関する著作権、知的財産権その他の一切の権利は株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社に帰属します。

● RM先進国株式マザーファンド

「MSCI-KOKUSA指数(配当込み、円換算ベース)」は、MSCI-KOKUSA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-KOKUSA指数(米ドルベース)は、MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものであり、指数に関する著作権、知的財産権その他の権利はMSCI Inc.に帰属します。

● RM新興国株式マザーファンド

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

● RM国内リートマザーファンド

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

● RM先進国リートマザーファンド

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

(3) 【ファンドの仕組み】

< 更新後 >

委託会社の概況(2023年9月末現在)

1) 資本金

1,000百万円

2) 沿革

2015年8月3日： りそなアセットマネジメント株式会社設立

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

3) 大株主の状況

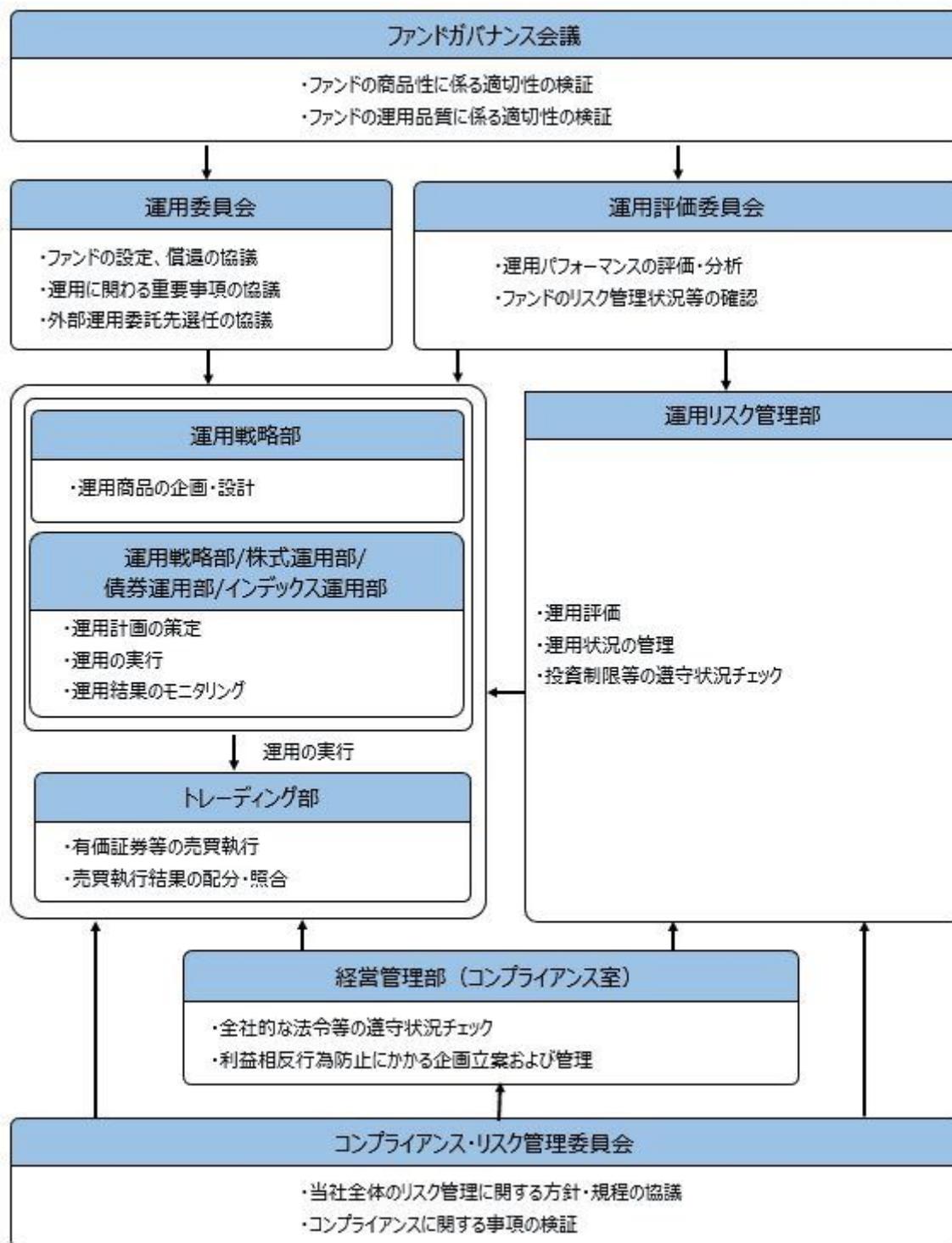
名 称	住 所	所有株数	所有比率
株式会社りそなホールディングス	東京都江東区木場一丁目5番65号	3,960,000株	100%

2 【投資方針】

(3) 【運用体制】

<更新後>

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9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。

3【投資リスク】

<更新後>

(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役会等に報告します。

上記体制は2023年9月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<更新後>

【参考情報】

ターゲットリターンバランスファンド(目標2%)

ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



* 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
* 年間騰落率は、運用期間が1年未満であるため掲載しておりません。

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

ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	—	42.1	59.8	62.7	5.4	7.9	21.5
最小値	—	△16.0	△12.4	△19.4	△5.5	△6.1	△8.8
平均値	—	6.8	15.0	5.9	△0.6	3.0	3.5

* 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
* 2018年10月から2023年9月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
なお、当ファンドの騰落率につきましては、運用期間が1年未満であるため掲載しておりません。
* 決算日に対応した数値とは異なります。

ターゲットリターンバランスファンド(目標3%)

ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



* 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
* 年間騰落率は、運用期間が1年未満であるため掲載しておりません。

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

ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	—	42.1	59.8	62.7	5.4	7.9	21.5
最小値	—	△16.0	△12.4	△19.4	△5.5	△6.1	△8.8
平均値	—	6.8	15.0	5.9	△0.6	3.0	3.5

* 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
* 2018年10月から2023年9月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
なお、当ファンドの騰落率につきましては、運用期間が1年未満であるため掲載しておりません。
* 決算日に対応した数値とは異なります。

ターゲットリターンバランスファンド(目標4%)

ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



- * 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- * 年間騰落率は、運用期間が1年未満であるため掲載しておりません。

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

ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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



当ファンド 日本株 先進国株 新興国株 日本国債 先進国債 新興国債 (%)

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	—	42.1	59.8	62.7	5.4	7.9	21.5
最小値	—	△16.0	△12.4	△19.4	△5.5	△6.1	△8.8
平均値	—	6.8	15.0	5.9	△0.6	3.0	3.5

- * 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- * 2018年10月から2023年9月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。なお、当ファンドの騰落率につきましては、運用期間が1年未満であるため掲載しておりません。
- * 決算日に対応した数値とは異なります。

ターゲットリターンバランスファンド(目標5%)

ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



- * 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- * 年間騰落率は、運用期間が1年未満であるため掲載しておりません。

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

ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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



当ファンド 日本株 先進国株 新興国株 日本国債 先進国債 新興国債 (%)

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	—	42.1	59.8	62.7	5.4	7.9	21.5
最小値	—	△16.0	△12.4	△19.4	△5.5	△6.1	△8.8
平均値	—	6.8	15.0	5.9	△0.6	3.0	3.5

- * 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- * 2018年10月から2023年9月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。なお、当ファンドの騰落率につきましては、運用期間が1年未満であるため掲載しておりません。
- * 決算日に対応した数値とは異なります。

ターゲットリターンバランスファンド(目標6%)

ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



- * 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- * 年間騰落率は、運用期間が1年未満であるため掲載しておりません。

ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	—	42.1	59.8	62.7	5.4	7.9	21.5
最小値	—	△16.0	△12.4	△19.4	△5.5	△6.1	△8.8
平均値	—	6.8	15.0	5.9	△0.6	3.0	3.5

- * 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- * 2018年10月から2023年9月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。なお、当ファンドの騰落率につきましては、運用期間が1年未満であるため掲載しておりません。
- * 決算日に対応した数値とは異なります。

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

各資産クラスの指数

- 日本株・・・東証株価指数(TOPIX, 配当込み)
 - 先進国株・・・MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み, 円ベース)
 - 新興国株・・・MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み, 円ベース)
 - 日本国債・・・NOMJURA-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.が発行した、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.が発行した、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。

NOMJURA-BPI国債

NOMJURA-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、NOMJURA-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。

4【手数料等及び税金】

(5)【課税上の取扱い】

< 訂正前 >

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

個人受益者の場合

1) 収益分配金に対する課税

(略)

2) 解約金および償還金に対する課税

(略)

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

~ (略)

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

上記は2022年11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。

<訂正後>

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

(略)

2) 解約金および償還金に対する課税

(略)

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。

~ (略)

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9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】

【ターゲットリターンバランスファンド（目標2%）】

以下の運用状況は2023年 9月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1) 【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	日本	5,522,753	99.70
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		16,565	0.30
合計（純資産総額）		5,539,318	100.00

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
日本	親投資信託受益証券	RM国内債券マザーファンド	1,897,002	1.0013	1,899,469	0.9924	1,882,584	33.99
日本	親投資信託受益証券	RM先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	2,272,086	0.8499	1,931,046	0.8261	1,876,970	33.88
日本	親投資信託受益証券	RM先進国株式マザーファンド	222,891	2.4578	547,822	2.5086	559,144	10.09
日本	親投資信託受益証券	RM先進国債券マザーファンド	284,314	1.1579	329,208	1.1659	331,481	5.98
日本	親投資信託受益証券	RM国内株式マザーファンド	182,924	1.7159	313,880	1.7865	326,793	5.90
日本	親投資信託受益証券	RM先進国リートマザーファンド	151,323	1.4802	223,997	1.4514	219,630	3.96
日本	親投資信託受益証券	RM国内リートマザーファンド	74,923	1.4423	108,062	1.4539	108,930	1.97
日本	親投資信託受益証券	RM新興国株式マザーファンド	63,190	1.6999	107,417	1.7236	108,914	1.97
日本	親投資信託受益証券	RM新興国債券マザーファンド	84,417	1.2769	107,793	1.2830	108,307	1.96

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】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
2023年 3月末日	1		1.0069	
4月末日	1		1.0126	
5月末日	1		1.0200	
6月末日	1		1.0396	
7月末日	1		1.0342	
8月末日	3		1.0330	
9月末日	5		1.0136	

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
当中間期	2023年 3月17日～2023年 9月16日	

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
当中間期	2023年 3月17日～2023年 9月16日	3.17

(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）
当中間期	2023年 3月17日～2023年 9月16日	5,297,001	70,996

(注)第1中間計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

【ターゲットリターンバランスファンド（目標3％）】

以下の運用状況は2023年 9月29日現在です。

- ・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1) 【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	4,346,800	99.70
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		12,972	0.30
合計（純資産総額）		4,359,772	100.00

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	RM国内債券マザーファンド	1,252,124	1.0016	1,254,200	0.9924	1,242,607	28.50
日本	親投資信託受益証券	RM先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	1,494,621	0.8499	1,270,400	0.8261	1,234,706	28.32
日本	親投資信託受益証券	RM先進国株式マザーファンド	388,957	2.4346	946,956	2.5086	975,737	22.38
日本	親投資信託受益証券	RM国内株式マザーファンド	172,154	1.7355	298,785	1.7865	307,553	7.05
日本	親投資信託受益証券	RM先進国リートマザーファンド	119,160	1.4752	175,794	1.4514	172,948	3.97
日本	親投資信託受益証券	RM新興国株式マザーファンド	91,038	1.6960	154,404	1.7236	156,913	3.60
日本	親投資信託受益証券	RM国内リートマザーファンド	59,329	1.4379	85,312	1.4539	86,258	1.98
日本	親投資信託受益証券	RM先進国債券マザーファンド	73,369	1.1503	84,400	1.1659	85,540	1.96
日本	親投資信託受益証券	RM新興国債券マザーファンド	65,891	1.2647	83,338	1.2830	84,538	1.94

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】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
2023年 3月末日	1		1.0116	
4月末日	1		1.0207	
5月末日	1		1.0347	
6月末日	1		1.0649	
7月末日	1		1.0641	
8月末日	1		1.0647	
9月末日	4		1.0440	

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
当中間期	2023年 3月17日～2023年 9月16日	

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
当中間期	2023年 3月17日～2023年 9月16日	6.54

(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）
当中間期	2023年 3月17日～2023年 9月16日	2,041,368	17,168

(注)第1中間計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

【ターゲットリターンバランスファンド（目標4％）】

以下の運用状況は2023年 9月29日現在です。

- ・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1) 【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	10,067,115	99.70
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		29,808	0.30
合計（純資産総額）		10,096,923	100.00

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	投資比率（％）
日本	親投資信託受益証券	RM先進国株式マザーファンド	1,211,317	2.4972	3,024,913	2.5086	3,038,709	30.10
日本	親投資信託受益証券	RM国内債券マザーファンド	2,149,786	1.0012	2,152,523	0.9924	2,133,447	21.13
日本	親投資信託受益証券	RM先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	2,554,220	0.8488	2,168,206	0.8261	2,110,041	20.90
日本	親投資信託受益証券	RM国内株式マザーファンド	512,603	1.7543	899,275	1.7865	915,765	9.07
日本	親投資信託受益証券	RM先進国リートマザーファンド	417,063	1.4991	625,225	1.4514	605,325	6.00
日本	親投資信託受益証券	RM新興国株式マザーファンド	326,159	1.7263	563,062	1.7236	562,167	5.57
日本	親投資信託受益証券	RM国内リートマザーファンド	211,078	1.4629	308,792	1.4539	306,886	3.04
日本	親投資信託受益証券	RM先進国債券マザーファンド	170,674	1.1653	198,890	1.1659	198,988	1.97
日本	親投資信託受益証券	RM新興国債券マザーファンド	152,601	1.2914	197,084	1.2830	195,787	1.94

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】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
2023年 3月末日	1		1.0159	
4月末日	1		1.0287	
5月末日	1		1.0494	
6月末日	1		1.0914	
7月末日	1		1.0948	
8月末日	4		1.0986	
9月末日	10		1.0762	

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
当中間期	2023年 3月17日～2023年 9月16日	

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
当中間期	2023年 3月17日～2023年 9月16日	10.15

(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）
当中間期	2023年 3月17日～2023年 9月16日	8,584,294	27,534

(注)第1中間計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

【ターゲットリターンバランスファンド（目標5％）】

以下の運用状況は2023年 9月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1) 【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	7,620,339	99.70
コール・ローン等・その他資産（負債控除後）		22,688	0.30
合計（純資産総額）		7,643,027	100.00

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	RM先進国株式マザーファンド	1,141,932	2.4739	2,825,136	2.5086	2,864,650	37.48
日本	親投資信託受益証券	RM国内債券マザーファンド	1,039,921	1.0019	1,041,900	0.9924	1,032,017	13.50
日本	親投資信託受益証券	RM先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	1,239,063	0.8499	1,053,100	0.8261	1,023,589	13.39
日本	親投資信託受益証券	RM国内株式マザーファンド	510,649	1.7246	880,672	1.7865	912,274	11.94
日本	親投資信託受益証券	RM先進国リートマザーファンド	423,890	1.4892	631,266	1.4514	615,233	8.05
日本	親投資信託受益証券	RM新興国株式マザーファンド	328,548	1.7151	563,495	1.7236	566,285	7.41
日本	親投資信託受益証券	RM国内リートマザーファンド	212,061	1.4511	307,735	1.4539	308,315	4.03
日本	親投資信託受益証券	RM先進国債券マザーファンド	128,519	1.1601	149,100	1.1659	149,840	1.96
日本	親投資信託受益証券	RM新興国債券マザーファンド	115,461	1.2839	148,244	1.2830	148,136	1.94

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】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
2023年 3月末日	1		1.0202	
4月末日	1		1.0368	

5月末日	1	1.0640
6月末日	1	1.1174
7月末日	1	1.1250
8月末日	5	1.1318
9月末日	7	1.1079

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
当中間期	2023年 3月17日～2023年 9月16日	

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
当中間期	2023年 3月17日～2023年 9月16日	13.73

(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）
当中間期	2023年 3月17日～2023年 9月16日	5,944,163	8,988

(注)第1中間計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

【ターゲットリターンバランスファンド（目標6％）】

以下の運用状況は2023年 9月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1) 【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	9,698,799	99.70
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		28,783	0.30
合計（純資産総額）		9,727,582	100.00

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	RM先進国株式マザーファンド	1,531,907	2.4867	3,809,488	2.5086	3,842,941	39.51
日本	親投資信託受益証券	RM国内株式マザーファンド	992,374	1.7427	1,729,442	1.7865	1,772,876	18.23
日本	親投資信託受益証券	RM先進国リートマザーファンド	824,038	1.4994	1,235,600	1.4514	1,196,008	12.30
日本	親投資信託受益証券	RM新興国株式マザーファンド	489,724	1.7258	845,200	1.7236	844,088	8.68
日本	親投資信託受益証券	RM国内リートマザーファンド	412,278	1.4539	599,450	1.4539	599,410	6.16
日本	親投資信託受益証券	RM国内債券マザーファンド	536,060	1.0017	537,019	0.9924	531,985	5.47
日本	親投資信託受益証券	RM先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	638,571	0.8495	542,514	0.8261	527,523	5.42
日本	親投資信託受益証券	RM先進国債券マザーファンド	165,374	1.1605	191,917	1.1659	192,809	1.98
日本	親投資信託受益証券	RM新興国債券マザーファンド	148,994	1.2848	191,428	1.2830	191,159	1.97

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】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
2023年 3月末日	1		1.0239	
4月末日	1		1.0450	
5月末日	1		1.0777	
6月末日	1		1.1429	
7月末日	1		1.1551	
8月末日	4		1.1652	
9月末日	9		1.1402	

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
当中間期	2023年 3月17日～2023年 9月16日	

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
当中間期	2023年 3月17日～2023年 9月16日	17.49

(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）
当中間期	2023年 3月17日～2023年 9月16日	7,614,320	26,579

(注)第1中間計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

（参考）

R M国内債券マザーファンド

以下の運用状況は2023年 9月29日現在です。

- ・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	132,249,446,170	84.54
地方債証券	日本	7,865,695,480	5.03
特殊債証券	日本	9,162,479,524	5.86
社債券	日本	5,852,499,000	3.74
	フランス	497,616,000	0.32
	韓国	100,029,000	0.06
	小計	6,450,144,000	4.12
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		706,967,123	0.45
合計（純資産総額）		156,434,732,297	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)	3,740,000,000	100.13	3,744,980,900	100.04	3,741,832,600	0.005	2025/1/1	2.39
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	99.85	2,106,877,200	0.005	2026/3/20	1.35
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	99.22	1,915,100,400	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	100.12	1,862,250,600	0.100	2025/12/20	1.19
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	96.19	1,789,264,200	0.200	2032/3/20	1.14
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	100.14	1,772,601,900	0.100	2025/9/20	1.13
日本	国債証券	第359回利付国債(10年)	1,810,000,000	98.68	1,786,116,600	97.43	1,763,519,200	0.100	2030/6/20	1.13
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	99.59	1,733,022,600	0.005	2026/12/20	1.11
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	100.16	1,722,820,800	0.100	2024/12/20	1.10
日本	国債証券	第356回利付国債(10年)	1,750,000,000	98.90	1,730,767,500	98.19	1,718,395,000	0.100	2029/9/20	1.10
日本	国債証券	第362回利付国債(10年)	1,770,000,000	97.85	1,731,963,400	96.49	1,707,996,900	0.100	2031/3/20	1.09
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	99.78	1,696,311,000	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	99.54	1,682,344,300	0.100	2027/9/20	1.08
日本	国債証券	第367回日本国債(10年)	1,700,000,000	98.81	1,679,885,300	95.93	1,630,844,000	0.200	2032/6/20	1.04
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	99.70	1,535,441,600	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	99.33	1,529,759,000	0.005	2027/6/20	0.98
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	98.76	1,521,042,600	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	97.97	1,479,377,200	0.100	2029/12/20	0.95
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	95.90	1,448,180,600	0.100	2031/9/20	0.93
日本	国債証券	第152回利付国債(5年)	1,420,000,000	100.28	1,424,075,900	99.81	1,417,302,000	0.100	2027/3/20	0.91
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	99.02	1,346,726,400	0.100	2028/6/20	0.86
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	99.39	1,331,879,600	0.100	2027/12/20	0.85
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	96.20	1,327,642,800	0.100	2031/6/20	0.85
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	99.81	1,307,511,000	0.100	2027/3/20	0.84
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	97.70	1,279,987,900	0.100	2030/3/20	0.82
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	96.80	1,277,878,800	0.100	2030/12/20	0.82
日本	国債証券	第365回利付国債(10年)	1,290,000,000	97.22	1,254,147,800	95.63	1,233,691,500	0.100	2031/12/20	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	99.99	1,229,889,300	0.005	2025/6/1	0.79

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	98.05	1,206,088,800	0.500	2032/12/20	0.77
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	97.14	1,194,858,900	0.100	2030/9/20	0.76

口. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	84.54
地方債証券	5.03
特殊債券	5.86
社債券	4.12
合 計	99.55

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

R M先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

以下の運用状況は2023年 9月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	83,651,977,644	48.85
	カナダ	3,485,533,624	2.04
	メキシコ	1,681,867,011	0.98
	ドイツ	11,052,556,141	6.45
	イタリア	12,576,681,944	7.34
	フランス	14,032,164,730	8.19
	オランダ	2,464,526,054	1.44
	スペイン	8,300,413,599	4.85
	ベルギー	3,051,425,442	1.78
	オーストリア	2,023,632,262	1.18
	フィンランド	893,548,841	0.52
	アイルランド	980,749,054	0.57
	イギリス	8,415,597,169	4.91
	スウェーデン	341,259,158	0.20
	ノルウェー	282,186,498	0.16
デンマーク	540,980,714	0.32	

	ポーランド	852,472,257	0.50
	オーストラリア	2,562,217,125	1.50
	ニュージーランド	396,783,059	0.23
	シンガポール	776,104,934	0.45
	マレーシア	915,664,146	0.53
	中国	10,718,473,001	6.26
	イスラエル	528,560,671	0.31
	小計	170,525,375,078	99.58
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		722,322,077	0.42
合計(純資産総額)		171,247,697,155	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	売建		176,015,851,267	102.78

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,760,000	13,945.25	1,082,151,846	12,951.52	1,005,038,308	2.750	2032/8/15	0.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,320,000	14,978.94	946,669,084	13,726.30	867,502,298	3.500	2033/2/15	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,090,000	14,285.18	869,967,591	13,854.26	843,724,631	2.875	2028/5/15	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,570,000	14,204.84	791,209,663	14,127.71	786,913,678	2.250	2025/11/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,930,000	14,068.56	834,265,658	13,128.56	778,523,987	2.875	2032/5/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,390,000	15,575.79	839,535,582	14,425.70	777,545,526	4.125	2032/11/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,470,000	12,387.18	801,450,977	11,685.93	756,080,156	1.250	2031/8/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,000,000	12,839.36	770,361,893	12,139.93	728,396,166	1.625	2031/5/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,970,000	12,973.58	774,522,978	12,148.11	725,242,546	1.875	2032/2/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,010,000	12,452.53	748,397,354	11,718.65	704,291,353	1.375	2031/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,190,000	13,377.24	694,279,190	13,458.10	698,475,902	0.375	2026/1/31	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,010,000	11,999.30	721,158,387	11,474.42	689,612,768	0.625	2030/8/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,830,000	12,488.14	728,058,737	11,792.86	687,523,963	1.125	2031/2/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,820,000	13,936.36	671,732,967	14,246.99	686,705,033	0.375	2024/9/15	0.40
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	3,790,000	18,876.26	715,410,254	17,514.04	663,782,389	5.500	2029/4/25	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,480,000	15,165.91	679,433,046	14,630.20	655,433,385	4.125	2027/10/31	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,550,000	14,422.78	656,236,674	14,382.46	654,402,276	2.625	2025/4/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,850,000	13,598.31	659,518,413	13,462.20	652,916,700	1.500	2027/1/31	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,640,000	14,285.32	662,838,905	13,803.13	640,465,568	2.875	2028/8/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,460,000	12,201.93	666,225,608	11,632.18	635,117,146	0.875	2030/11/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,970,000	12,850.41	638,665,764	12,672.23	629,809,861	0.750	2028/1/31	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,230,000	11,992.85	627,226,185	11,569.66	605,093,341	0.625	2030/5/15	0.35

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,700,000	13,033.08	612,555,225	12,703.49	597,064,050	1.250	2028/9/30	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,100,000	14,010.85	574,445,045	14,178.54	581,320,463	1.125	2025/1/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	15,026.94	601,077,885	14,492.89	579,715,988	3.875	2027/11/30	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,070,000	13,438.24	546,936,524	13,450.51	547,435,922	0.875	2026/6/30	0.32
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	3,590,000	15,016.60	539,096,214	15,007.83	538,781,292	0.000	2025/3/25	0.31
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,270,000	12,718.97	543,100,205	12,616.72	538,734,046	0.375	2027/9/30	0.31
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,730,000	14,806.23	552,272,438	14,327.83	534,428,273	3.625	2028/5/31	0.31
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,740,000	13,971.70	522,541,837	14,231.27	532,249,572	0.625	2024/10/15	0.31

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	99.58
合 計	99.58

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（％）
為替予約取引	米ドル	売建	578,221,000.00	85,901,089,981	85,953,708,092	50.19
	カナダドル	売建	32,725,000.00	3,603,250,920	3,603,209,032	2.10
	メキシコペソ	売建	210,394,000.00	1,771,084,068	1,766,804,654	1.03
	ユーロ	売建	367,937,000.00	57,864,458,560	57,866,077,482	33.79
	英ポンド	売建	47,659,000.00	8,643,268,003	8,646,853,390	5.05
	スウェーデンクローナ	売建	25,533,000.00	347,978,609	347,777,333	0.20
	ノルウェークローネ	売建	20,719,000.00	287,254,431	287,130,117	0.17
	デンマーククローネ	売建	26,873,000.00	566,929,012	566,912,808	0.33
	ポーランドズロチ	売建	25,366,000.00	858,082,316	857,084,164	0.50
	オーストラリアドル	売建	27,662,000.00	2,646,702,926	2,644,099,932	1.54
	ニュージーランドドル	売建	4,605,000.00	408,886,239	408,185,818	0.24
	シンガポールドル	売建	7,276,000.00	792,264,722	792,747,121	0.46
	マレーシアリングット	売建	28,610,000.00	895,332,784	910,496,084	0.53
	中国元	売建	530,580,000.00	10,813,804,038	10,824,733,986	6.32
	イスラエルシェケル	売建	13,916,000.00	539,889,449	540,031,254	0.32

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

R M先進国債券マザーファンド

以下の運用状況は2023年 9月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	27,158,806,340	48.34
	カナダ	1,131,595,014	2.01
	メキシコ	542,001,368	0.96
	ドイツ	3,598,795,090	6.40
	イタリア	4,082,497,765	7.27
	フランス	4,560,099,827	8.12
	オランダ	808,522,019	1.44
	スペイン	2,704,221,122	4.81
	ベルギー	990,489,606	1.76
	オーストリア	656,273,373	1.17
	フィンランド	287,891,410	0.51
	アイルランド	316,369,707	0.56
	イギリス	2,729,894,319	4.86
	スウェーデン	109,444,580	0.19
	ノルウェー	89,775,877	0.16
	デンマーク	176,643,432	0.31
	ポーランド	272,635,285	0.49
	オーストラリア	836,838,668	1.49
	ニュージーランド	125,512,796	0.22
	シンガポール	251,731,231	0.45
マレーシア	294,210,354	0.52	
中国	3,904,124,346	6.95	
イスラエル	170,517,405	0.30	
	小計	55,798,890,934	99.31
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		389,713,071	0.69
合計（純資産総額）		56,188,604,005	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		130,198,917	0.23
	売建		130,087,720	0.23

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,470,000	13,627.36	336,595,859	13,466.87	332,631,796	0.750	2026/4/30	0.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,680,000	13,061.32	350,043,526	12,139.93	325,350,288	1.625	2031/5/15	0.58
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,120,000	14,913.12	316,158,272	14,659.13	310,773,601	3.875	2025/3/31	0.55
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,060,000	14,782.46	304,518,785	13,726.30	282,761,824	3.500	2033/2/15	0.50
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,320,000	12,646.68	293,403,115	11,792.86	273,594,442	1.125	2031/2/15	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,890,000	14,498.64	274,024,337	13,567.37	256,423,356	3.375	2033/5/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,880,000	13,655.20	256,717,777	13,450.51	252,869,664	0.875	2026/6/30	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,110,000	12,593.93	265,732,023	11,685.93	246,573,281	1.250	2031/8/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,840,000	14,247.82	262,159,920	13,128.56	241,565,621	2.875	2032/5/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,820,000	13,342.53	242,834,156	12,868.55	234,207,690	1.250	2028/4/30	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,920,000	13,159.53	252,663,056	12,148.11	233,243,834	1.875	2032/2/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,590,000	15,672.42	249,191,534	14,425.70	229,368,717	4.125	2032/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,930,000	12,666.43	244,462,184	11,718.65	226,170,101	1.375	2031/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,580,000	14,047.08	221,943,881	14,207.17	224,473,421	0.750	2024/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,650,000	14,114.27	232,885,542	12,951.52	213,700,155	2.750	2032/8/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,800,000	12,401.67	223,230,200	11,632.18	209,379,279	0.875	2030/11/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,360,000	15,293.38	207,990,055	14,630.20	198,970,848	4.125	2027/10/31	0.35
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	1,390,000	14,448.18	200,829,736	14,089.83	195,848,770	0.750	2028/5/25	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,450,000	13,749.67	199,370,273	13,462.20	195,201,900	1.500	2027/1/31	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,340,000	14,439.14	193,484,535	13,854.26	185,647,126	2.875	2028/5/15	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,300,000	14,305.92	185,977,020	14,127.71	183,660,283	2.250	2025/11/15	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,260,000	14,840.52	186,990,559	14,549.57	183,324,663	4.000	2028/6/30	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,360,000	13,512.44	183,769,314	13,457.52	183,022,349	0.500	2026/2/28	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,320,000	13,489.07	178,055,826	13,458.10	177,647,049	0.375	2026/1/31	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,310,000	13,501.34	176,867,656	13,338.91	174,739,764	0.875	2026/9/30	0.31
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,270,000	13,625.24	173,040,576	13,553.35	172,127,549	0.250	2025/10/31	0.31
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,190,000	14,026.04	166,909,952	14,246.99	169,539,209	0.375	2024/9/15	0.30
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,370,000	14,898.73	204,112,680	12,370.73	169,479,048	3.625	2053/2/15	0.30
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,270,000	15,984.33	203,001,020	13,256.52	168,357,899	4.000	2052/11/15	0.30
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	1,110,000	14,949.22	165,936,389	15,007.83	166,586,973	0.000	2025/3/25	0.30

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	99.31
合計	99.31

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

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	中国元	買建	6,367,100.00	130,009,814	130,198,917	0.23
	米ドル	売建	870,400.00	129,923,041	130,087,720	0.23

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

R M新興国債券マザーファンド

以下の運用状況は2023年 9月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	アメリカ	1,941,531,192	18.46
	アイルランド	8,553,575,775	81.33
	小計	10,495,106,967	99.79
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		22,549,932	0.21
合計(純資産総額)		10,517,656,899	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	1,351,547	6,650.50	8,988,465,496	6,328.72	8,553,575,775	81.33
アメリカ	投資信託受益証券	VANECK J.P.MORGAN EM LOCAL	545,832	3,784.37	2,065,632,429	3,557.01	1,941,531,192	18.46

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	99.79
合計	99.79

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

R M国内株式マザーファンド

以下の運用状況は2023年 9月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	112,682,181,390	98.74
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		1,435,566,679	1.26
合計（純資産総額）		114,117,748,069	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	1,510,275,000	1.32

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

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	1,874,200	1,965.31	3,683,398,343	2,677.50	5,018,170,500	4.40
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	241,400	11,949.85	2,884,695,573	12,240.00	2,954,736,000	2.59
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	2,105,200	951.36	2,002,816,771	1,268.50	2,670,446,200	2.34
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	10,965,800	159.19	1,745,688,872	176.60	1,936,560,280	1.70
日本	株式	キーエンス	電気機器	34,100	61,122.42	2,084,274,714	55,500.00	1,892,550,000	1.66
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	238,900	5,723.66	1,367,383,156	7,347.00	1,755,198,300	1.54
日本	株式	三菱商事	卸売業	220,200	5,145.26	1,132,987,818	7,128.00	1,569,585,600	1.38
日本	株式	日立製作所	電気機器	167,600	7,497.48	1,256,578,530	9,275.00	1,554,490,000	1.36
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	72,200	16,550.01	1,194,910,731	20,440.00	1,475,768,000	1.29
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	302,900	4,342.03	1,315,201,775	4,641.00	1,405,758,900	1.23
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	832,300	1,187.96	988,745,176	1,682.00	1,399,928,600	1.23
日本	株式	三井物産	卸売業	252,600	4,247.52	1,072,923,899	5,423.00	1,369,849,800	1.20
日本	株式	任天堂	その他製品	215,500	5,660.88	1,219,921,132	6,230.00	1,342,565,000	1.18
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	486,200	2,050.82	997,108,967	2,541.00	1,235,434,200	1.08
日本	株式	信越化学工業	化学	284,200	3,939.96	1,119,738,554	4,343.00	1,234,280,600	1.08
日本	株式	第一三共	医薬品	298,200	4,398.00	1,311,485,910	4,106.00	1,224,409,200	1.07

日本	株式	KDDI	情報・通信業	264,500	4,119.83	1,089,696,980	4,577.00	1,210,616,500	1.06
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	222,500	4,485.74	998,079,206	5,406.00	1,202,835,000	1.05
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	259,800	4,093.57	1,063,510,655	4,609.00	1,197,418,200	1.05
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	332,300	2,839.12	943,442,442	3,465.00	1,151,419,500	1.01
日本	株式	HOYA	精密機器	72,300	14,624.65	1,057,362,831	15,325.00	1,107,997,500	0.97
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	168,900	5,900.68	996,625,538	6,335.00	1,069,981,500	0.94
日本	株式	ダイキン工業	機械	41,200	24,020.61	989,649,267	23,475.00	967,170,000	0.85
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	550,500	1,512.38	832,567,626	1,690.50	930,620,250	0.82
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	185,700	4,685.34	870,068,683	4,909.00	911,601,300	0.80
日本	株式	村田製作所	電気機器	310,500	2,582.85	801,975,259	2,734.00	848,907,000	0.74
日本	株式	S M C	機械	11,200	68,734.86	769,830,474	66,980.00	750,176,000	0.66
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	124,500	5,965.23	742,672,263	5,855.00	728,947,500	0.64
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	204,200	2,819.22	575,686,126	3,440.00	702,448,000	0.62
日本	株式	パナソニックホールディングス	電気機器	407,200	1,307.08	532,245,881	1,682.00	684,910,400	0.60

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	0.09
		鉱業	0.40
		建設業	2.12
		食料品	3.35
		繊維製品	0.42
		パルプ・紙	0.18
		化学	5.70
		医薬品	5.03
		石油・石炭製品	0.49
		ゴム製品	0.70
		ガラス・土石製品	0.67
		鉄鋼	1.00
		非鉄金属	0.65
		金属製品	0.50
		機械	5.26
		電気機器	16.63
		輸送用機器	8.72
		精密機器	2.25
		その他製品	2.22
		電気・ガス業	1.38
陸運業	2.87		
海運業	0.67		
空運業	0.47		

	倉庫・運輸関連業	0.14
	情報・通信業	7.95
	卸売業	6.69
	小売業	4.27
	銀行業	7.03
	証券、商品先物取引業	0.77
	保険業	2.40
	その他金融業	1.20
	不動産業	1.91
	サービス業	4.64
合 計		98.74

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	65	日本円	1,529,210,750	1,510,275,000	1.32

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

R M先進国株式マザーファンド

以下の運用状況は2023年 9月29日現在です。

- ・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	142,019,227,786	65.86
	カナダ	7,061,426,937	3.27
	パナマ	54,568,603	0.03
	ドイツ	4,794,191,496	2.22
	イタリア	1,104,544,843	0.51
	フランス	6,410,383,025	2.97
	オランダ	3,704,704,353	1.72
	スペイン	1,496,416,197	0.69
	ベルギー	447,756,788	0.21
	オーストリア	107,496,839	0.05
	ルクセンブルク	103,282,473	0.05
	フィンランド	646,385,324	0.30
	アイルランド	3,803,892,538	1.76

	ポルトガル	103,907,856	0.05
	イギリス	8,399,115,791	3.89
	スイス	6,428,004,295	2.98
	スウェーデン	1,669,095,748	0.77
	ノルウェー	417,158,637	0.19
	デンマーク	1,914,962,619	0.89
	ケイマン	319,190,649	0.15
	リベリア	88,056,104	0.04
	オーストラリア	3,964,531,680	1.84
	バミューダ	314,585,207	0.15
	ニュージーランド	149,473,131	0.07
	香港	991,017,567	0.46
	シンガポール	668,204,129	0.31
	イスラエル	401,670,793	0.19
	キュラソー	345,446,511	0.16
	ジャージー	704,924,544	0.33
	マン島	28,567,770	0.01
	小計	198,662,190,233	92.12
新株予約権証券	カナダ	0	0.00
投資証券	アメリカ	3,417,137,557	1.58
	カナダ	15,074,048	0.01
	フランス	63,165,605	0.03
	ベルギー	14,915,655	0.01
	イギリス	59,125,033	0.03
	オーストラリア	229,328,435	0.11
	香港	47,309,671	0.02
	シンガポール	93,200,355	0.04
	小計	3,939,256,359	1.83
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		13,048,472,533	6.05
合計(純資産総額)		215,649,919,125	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	10,835,014,271	5.02
	買建	ドイツ	2,489,362,680	1.15

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

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		1,459,089,110	0.68

(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	416,552	22,045.67	9,183,168,607	25,531.81	10,635,326,602	4.93
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	187,073	37,961.68	7,101,606,605	46,914.27	8,776,393,456	4.07
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	244,604	15,077.22	3,687,950,064	18,844.08	4,609,339,399	2.14
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	65,414	33,637.91	2,200,390,378	64,452.52	4,216,097,549	1.96
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	157,418	15,184.91	2,390,378,191	19,790.92	3,115,448,587	1.44
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	140,089	15,268.28	2,138,919,286	19,913.58	2,789,674,265	1.29
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	75,566	24,126.80	1,823,165,775	36,853.52	2,784,873,123	1.29
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	58,624	24,051.95	1,410,021,703	45,466.33	2,665,418,529	1.24
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	107,119	16,927.44	1,813,251,314	17,870.32	1,914,251,087	0.89
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	24,677	73,189.11	1,806,087,806	76,300.75	1,882,873,805	0.87
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	34,361	47,054.11	1,616,826,483	53,409.03	1,835,187,845	0.85
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	21,383	54,445.34	1,164,204,908	81,438.83	1,741,406,523	0.81
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	77,463	20,695.59	1,603,143,103	22,076.51	1,710,112,865	0.79
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	63,817	24,917.22	1,590,142,321	23,466.11	1,497,536,767	0.69
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	42,915	33,727.66	1,447,422,567	34,651.70	1,487,077,826	0.69
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	62,481	21,360.24	1,334,609,491	21,889.53	1,367,680,174	0.63
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	10,934	91,998.69	1,005,913,740	124,450.55	1,360,742,423	0.63
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	金融サービス	22,447	56,877.71	1,276,733,982	59,748.23	1,341,168,636	0.62
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	48,097	26,571.44	1,278,006,590	25,516.85	1,227,284,040	0.57
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	一般消費財・サービス流通・小売り	26,660	47,153.59	1,257,114,766	45,396.03	1,210,258,272	0.56

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	86,598	10,491.22	908,519,171	13,805.28	1,195,510,070	0.55
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	70,779	18,285.20	1,294,208,754	16,820.03	1,190,505,186	0.55
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	46,785	22,087.75	1,033,375,765	22,773.55	1,065,460,771	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	67,282	16,196.48	1,089,731,710	15,601.19	1,049,679,535	0.49
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	11,756	74,392.30	874,555,924	85,055.67	999,914,520	0.46
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需品流通・小売り	39,292	21,626.27	849,739,425	24,312.73	955,295,913	0.44
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	10,683	97,508.26	1,041,680,753	87,026.39	929,703,031	0.43
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	36,514	25,743.79	940,008,787	25,353.80	925,769,018	0.43
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	12,091	56,363.44	681,490,436	75,488.53	912,731,920	0.42
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	108,972	9,043.07	985,441,538	8,348.05	909,704,773	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	5.25
		素材	3.79
		資本財	6.25
		商業・専門サービス	1.48
		運輸	1.71
		自動車・自動車部品	2.09
		耐久消費財・アパレル	1.42
		消費者サービス	1.97
		メディア・娯楽	5.81
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.14
		生活必需品流通・小売り	1.63
		食品・飲料・タバコ	3.57
		家庭用品・パーソナル用品	1.63
		ヘルスケア機器・サービス	4.26
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.12
		銀行	5.06
		金融サービス	6.20
保険	2.99		
ソフトウェア・サービス	8.85		

		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.33
		電気通信サービス	1.11
		公益事業	2.54
		半導体・半導体製造装置	5.62
		不動産管理・開発	0.32
新株予約権証券			
投資証券			1.83
合 計			93.95

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	SP500MIN2312	買建	334	米ドル	74,836,035	11,193,974,114	72,436,250	10,835,014,271	5.02
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	STX E6002312	買建	699	ユーロ	16,034,019	2,533,375,002	15,755,460	2,489,362,680	1.15

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

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	7,643,000.00	1,140,423,318	1,142,539,125	0.53
	カナダドル	買建	400,000.00	44,318,000	44,269,160	0.02
	ユーロ	買建	700,000.00	110,055,570	110,551,610	0.05
	英ポンド	買建	250,000.00	45,283,095	45,607,825	0.02
	スイスフラン	買建	350,000.00	57,023,040	57,197,060	0.03
	スウェーデンクローナ	買建	1,500,000.00	20,517,000	20,520,450	0.01
	オーストラリアドル	買建	400,000.00	38,035,200	38,403,880	0.02

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

R M新興国株式マザーファンド

以下の運用状況は2023年 9月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	119,654,433	0.43

	メキシコ	636,938,920	2.29
	ブラジル	1,409,683,120	5.07
	チリ	128,422,266	0.46
	コロンビア	25,175,548	0.09
	ペルー	7,077,343	0.03
	オランダ	15,332,707	0.06
	ルクセンブルク	24,202,818	0.09
	ギリシャ	112,972,499	0.41
	イギリス	27,389,161	0.10
	トルコ	195,641,689	0.70
	チェコ	40,490,797	0.15
	キプロス	0	0.00
	ハンガリー	60,453,942	0.22
	ポーランド	180,960,135	0.65
	ロシア	0	0.00
	ケイマン	4,385,642,359	15.76
	バミューダ	110,118,087	0.40
	香港	256,467,933	0.92
	シンガポール	6,417,234	0.02
	マレーシア	368,714,591	1.33
	タイ	493,386,408	1.77
	フィリピン	164,838,054	0.59
	インドネシア	525,677,338	1.89
	韓国	3,217,926,833	11.57
	台湾	3,802,154,598	13.67
	中国	3,016,183,490	10.84
	インド	4,141,913,541	14.89
	カタール	243,202,216	0.87
	エジプト	20,634,195	0.07
	南アフリカ	737,262,679	2.65
	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	371,759,050	1.34
	クウェート	216,129,525	0.78
	サウジアラビア	1,092,002,154	3.92
	小計	26,154,825,663	94.00
投資証券	メキシコ	22,486,614	0.08
	南アフリカ	8,833,073	0.03
	小計	31,319,687	0.11
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		1,637,252,728	5.88
合計(純資産総額)		27,823,398,078	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	1,643,622,427	5.91

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

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		68,648,884	0.25
	売建		1,381,657	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	666,000	2,341.14	1,559,205,518	2,424.05	1,614,419,098	5.80
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	181,300	7,292.18	1,322,073,974	5,683.31	1,030,384,828	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	129,277	6,900.08	892,021,780	7,599.23	982,406,949	3.53
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	一般消費財・サービス流通・小売り	444,240	2,064.92	917,322,796	1,586.12	704,622,391	2.53
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	82,528	3,959.11	326,737,697	4,224.72	348,657,775	1.25
ケイマン	株式	MEITUAN	消費者サービス	137,310	3,081.54	423,126,436	2,117.38	290,738,546	1.04
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	140,523	1,583.74	222,551,976	1,706.10	239,747,133	0.86
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	90,150	2,740.27	247,035,601	2,605.40	234,877,216	0.84
ケイマン	株式	PDD HOLDINGS INC	一般消費財・サービス流通・小売り	16,193	13,988.50	226,515,794	14,301.34	231,581,660	0.83
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	2,605,000	97.58	254,216,659	83.31	217,047,558	0.78
インド	株式	HDFC BANK LIMITED	銀行	75,729	2,967.37	224,716,150	2,757.89	208,852,782	0.75
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	14,838	9,824.95	145,782,715	12,743.16	189,083,156	0.68
ブラジル	株式	VALE SA	素材	92,604	2,716.81	251,588,307	1,980.30	183,383,978	0.66
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	338,800	459.11	155,549,663	482.02	163,311,628	0.59
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	24,892	6,149.35	153,069,647	6,401.51	159,346,574	0.57
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	181,500	1,136.72	206,315,636	840.84	152,612,460	0.55
ケイマン	株式	BAIDU INC-CLASS A	メディア・娯楽	61,180	2,520.62	154,211,870	2,461.36	150,586,494	0.54

ケイマン	株式	NETEASE INC	メディア・娯楽	52,100	2,676.50	139,446,102	2,889.43	150,539,407	0.54
サウジアラビア	株式	AL RAJHI BANK	銀行	53,379	3,138.38	167,523,925	2,712.60	144,796,142	0.52
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	41,800	3,174.83	132,707,894	3,406.65	142,398,033	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	22,421	6,164.35	138,211,085	6,054.95	135,758,034	0.49
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	63,610	4,104.03	261,057,391	2,123.12	135,051,727	0.49
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	エネルギー	129,800	787.66	102,238,688	1,022.81	132,760,759	0.48
インドネシア	株式	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	銀行	1,511,900	81.14	122,683,979	86.08	130,155,691	0.47
中国	株式	BYD CO LTD-H	自動車・自動車部品	28,500	4,378.17	124,777,971	4,490.85	127,989,225	0.46
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	5,336	26,784.37	142,921,419	23,706.23	126,496,452	0.45
中国	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	1,766,000	78.76	139,101,909	70.70	124,868,562	0.45
韓国	株式	POSCO HOLDINGS INC	素材	1,961	35,698.47	70,004,700	59,438.50	116,558,899	0.42
インド	株式	AXIS BANK LTD	銀行	62,131	1,635.92	101,641,623	1,865.92	115,932,035	0.42
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	エネルギー	101,600	893.18	90,747,898	1,113.66	113,147,922	0.41

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	4.96
		素材	7.53
		資本財	4.41
		商業・専門サービス	0.05
		運輸	1.90
		自動車・自動車部品	3.57
		耐久消費財・アパレル	1.27
		消費者サービス	2.56
		メディア・娯楽	6.23
		一般消費財・サービス流通・小売り	5.35
		生活必需品流通・小売り	1.45
		食品・飲料・タバコ	3.59
		家庭用品・パーソナル用品	0.77
		ヘルスケア機器・サービス	1.02
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.54
		銀行	15.64
		金融サービス	2.69
保険	2.66		
ソフトウェア・サービス	2.39		
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8.37		

	電気通信サービス	2.66
	公益事業	2.45
	半導体・半導体製造装置	8.42
	不動産管理・開発	1.52
投資証券		0.11
合計		94.12

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 2312	買建	230	米ドル	11,360,265	1,699,268,443	10,988,250	1,643,622,427	5.91

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

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	459,216.74	68,479,776	68,648,884	0.25
	オフショア人民元	売建	4,516.20	92,108	92,340	0.00
	サウジアラビアリアル	売建	32,273.29	1,289,640	1,289,317	0.00

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

RM国内リートマザーファンド

以下の運用状況は2023年 9月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	日本	43,836,168,100	98.33
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		744,738,132	1.67
合計(純資産総額)		44,580,906,232	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	745,550,000	1.67

(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	4,841	568,999.71	2,754,527,599	606,000	2,933,646,000	6.58
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	4,262	554,310.1	2,362,469,659	583,000	2,484,746,000	5.57
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	13,418	155,477.46	2,086,196,559	167,400	2,246,173,200	5.04
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	7,228	293,453.33	2,121,080,709	279,200	2,018,057,600	4.53
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	19,889	98,704.37	1,963,131,249	97,000	1,929,233,000	4.33
日本	投資証券	G L P 投資法人	14,016	144,117.3	2,019,948,211	133,700	1,873,939,200	4.20
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	6,255	279,844.24	1,750,425,745	263,800	1,650,069,000	3.70
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	8,267	176,988.76	1,463,166,154	179,400	1,483,099,800	3.33
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	9,282	148,415.82	1,377,595,726	155,700	1,445,207,400	3.24
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	4,071	331,257.64	1,348,549,891	339,000	1,380,069,000	3.10
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	20,090	55,920.72	1,123,447,296	61,800	1,241,562,000	2.78
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	13,890	80,383.86	1,116,531,861	78,100	1,084,809,000	2.43
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	12,468	74,647.23	930,701,719	83,300	1,038,584,400	2.33
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	2,838	354,412.58	1,005,822,903	361,000	1,024,518,000	2.30
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	1,433	603,012.76	864,117,290	631,000	904,223,000	2.03
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	2,177	393,473.83	856,592,531	412,500	898,012,500	2.01
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	6,331	148,309.29	938,946,151	138,200	874,944,200	1.96
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	2,414	316,140.04	763,162,080	346,000	835,244,000	1.87
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	1,726	467,495.76	806,897,699	471,000	812,946,000	1.82
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	2,658	303,360.83	806,333,088	289,900	770,554,200	1.73
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	5,304	156,153.48	828,238,080	143,400	760,593,600	1.71
日本	投資証券	イオンリート投資法人	5,090	149,047.04	758,649,441	146,500	745,685,000	1.67
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	1,540	491,116.41	756,319,278	457,500	704,550,000	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	3,046	205,518.79	626,010,250	228,300	695,401,800	1.56
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	4,879	150,100.47	732,340,238	141,700	691,354,300	1.55
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	2,040	311,939.6	636,356,793	331,500	676,260,000	1.52
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	5,757	110,546.11	636,414,008	110,900	638,451,300	1.43
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	3,882	155,407.86	603,293,319	159,400	618,790,800	1.39
日本	投資証券	森トラストリート投資法人	7,998	72,187.7	577,357,225	72,800	582,254,400	1.31
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	860	620,146	533,325,568	668,000	574,480,000	1.29

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率 (%)
投資証券	98.33
合計	98.33

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	403	日本円	764,635,030	745,550,000	1.67

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

RM先進国リートマザーファンド

以下の運用状況は2023年 9月29日現在です。

- ・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	536,907,047	0.88
	オーストラリア	34,933,972	0.06
	小計	571,841,019	0.94
投資証券	アメリカ	46,781,570,307	76.91
	カナダ	982,018,701	1.61
	ドイツ	25,120,905	0.04
	イタリア	4,732,885	0.01
	フランス	1,014,860,543	1.67
	オランダ	115,842,955	0.19
	スペイン	238,494,275	0.39
	ベルギー	624,028,344	1.03
	アイルランド	22,216,233	0.04
	イギリス	2,668,903,838	4.39
	オーストラリア	3,949,745,886	6.49
	ニュージーランド	181,910,084	0.30
	香港	697,592,873	1.15
	シンガポール	2,203,715,703	3.62
	韓国	120,281,028	0.20
	イスラエル	78,528,463	0.13
ガーンジー	114,517,759	0.19	
小計	59,824,080,782	98.35	
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		430,278,140	0.71
合計（純資産総額）		60,826,199,941	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		219,646,389	0.36
	売建		53,822,340	0.09

(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	316,260	18,479.68	5,844,386,342	16,772.40	5,304,440,932	8.72
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	32,032	106,935.64	3,425,362,716	107,842.69	3,454,417,129	5.68
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	54,183	44,631.40	2,418,263,260	39,531.00	2,141,908,303	3.52
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	177,645	11,244.88	1,997,597,374	12,035.20	2,137,994,312	3.51
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	103,657	15,371.47	1,593,361,047	17,731.21	1,837,964,367	3.02
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	112,052	17,427.39	1,952,774,271	16,278.79	1,824,071,134	3.00
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	242,737	9,427.51	2,288,407,425	7,422.15	1,801,632,755	2.96
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	347,151	4,929.24	1,711,193,808	4,408.12	1,530,284,169	2.52
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	72,359	22,178.37	1,604,804,895	18,072.25	1,307,690,343	2.15
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	48,637	25,703.36	1,250,134,490	25,621.55	1,246,155,726	2.05
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	587,366	1,880.42	1,104,494,934	2,072.97	1,217,594,916	2.00
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	118,145	9,164.66	1,082,759,554	8,790.81	1,038,591,027	1.71
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	197,053	4,780.94	942,100,094	4,750.66	936,131,963	1.54
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	99,986	7,994.81	799,369,480	8,955.35	895,410,085	1.47
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	137,927	7,018.91	968,097,865	6,312.27	870,633,292	1.43
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	53,362	20,316.00	1,084,102,549	14,854.78	792,681,293	1.30
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	39,976	22,956.59	917,712,966	19,286.84	771,010,924	1.27
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	42,629	21,356.43	910,403,515	17,708.77	754,907,421	1.24
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	21,993	32,265.39	709,612,831	31,523.98	693,307,002	1.14
アメリカ	投資証券	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	90,084	7,661.83	690,208,360	6,895.63	621,186,654	1.02
香港	投資証券	LINK REIT	876,300	1,030.53	903,056,473	706.11	618,768,136	1.02
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	63,839	10,022.46	639,823,840	9,502.81	606,650,360	1.00
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	73,363	11,607.03	851,526,559	8,179.03	600,038,501	0.99
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	243,850	2,538.99	619,134,296	2,456.10	598,920,863	0.98
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	212,595	3,018.86	641,794,651	2,637.09	560,633,297	0.92
アメリカ	投資証券	UDR INC	103,901	6,040.03	627,565,982	5,335.51	554,365,718	0.91
アメリカ	投資証券	AMERICAN HOMES 4 RENT- A	109,002	4,897.59	533,847,689	5,064.77	552,071,019	0.91
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	419,564	1,433.40	601,405,428	1,284.64	538,991,273	0.89
アメリカ	投資証券	REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	70,802	8,673.46	614,098,826	7,422.15	525,503,744	0.86
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	36,601	16,446.41	601,955,331	14,153.25	518,023,455	0.85

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)	0.94
投資証券			98.35
合計			99.29

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	買建	1,102,000.00	164,338,188	164,737,014	0.27
	ユーロ	買建	80,000.00	12,599,856	12,634,191	0.02
	英ポンド	買建	30,000.00	5,425,605	5,473,287	0.01
	オーストラリアドル	買建	190,000.00	18,236,770	18,239,449	0.03
	ニュージーランドドル	買建	20,000.00	1,772,900	1,782,930	0.00
	香港ドル	買建	65,000.00	1,241,825	1,241,396	0.00
	シンガポールドル	買建	142,000.00	15,487,490	15,538,122	0.03
	米ドル	売建	360,000.00	53,823,600	53,822,340	0.09

(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

< 更新後 >

ターゲットリターンバランスファンド(目標3%)

2023年9月29日現在

基準価額・純資産の推移



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

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

—	—
—	—
—	—
—	—
—	—
—	—
設定来累計	0円

主要な資産の状況

■資産の組入比率

資産	比率(%)
RM国内債券マザーファンド	28.5
RM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)	28.3
RM先進国債券マザーファンド	2.0
RM新興国債券マザーファンド	1.9
RM国内株式マザーファンド	7.1
RM先進国株式マザーファンド	22.4
RM新興国株式マザーファンド	3.6
RM国内リートマザーファンド	2.0
RM先進国リートマザーファンド	4.0
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	66.2
米ドル	21.1
ユーロ	3.0
英ポンド	1.2
香港ドル	0.9
その他	7.6
合計	100.0

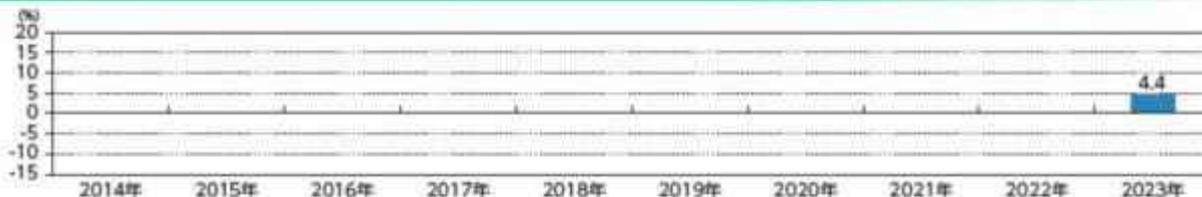
※比率はファンドの純資産総額に対する組入比率であり、四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。
 ※上記通貨別組入比率は、各マザーファンドが実質的に保有している株式・債券等の通貨を基準に算出しています。
 ※為替ヘッジをかけている外貨建て資産については、日本円に含めています。

■各マザーファンドにおける組入上位銘柄

	国・地域	銘柄名	償還期限	比率(%)
国内債券	日本	第444回利付国債(2年)	2025/1/1	2.39
	日本	第147回利付国債(5年)	2026/3/20	1.35
	日本	第158回利付国債(5年)	2028/3/20	1.22
先進国債券	アメリカ	US TREASURY N/B	2032/8/15	0.59
	アメリカ	US TREASURY N/B	2033/2/15	0.51
	アメリカ	US TREASURY N/B	2028/5/15	0.49
先進国債券	アメリカ	US TREASURY N/B	2026/4/30	0.59
	アメリカ	US TREASURY N/B	2031/5/15	0.58
	アメリカ	US TREASURY N/B	2025/3/31	0.55
新興国債券	アイルランド	iSHARES JPM EM LCL GOV BND	—	81.33
	アメリカ	VANECK J.P.MORGAN EM LOCAL	—	18.46
国内株式	日本	トヨタ自動車	—	4.40
	日本	ソニーグループ	—	2.59
	日本	三菱UFJフィナンシャルグループ	—	2.34
先進国株式	アメリカ	APPLE INC	—	4.93
	アメリカ	MICROSOFT CORP	—	4.07
	アメリカ	AMAZON.COM INC	—	2.14
新興国株式	台湾	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	—	5.80
	ケイマン	TENCENT HOLDINGS LTD	—	3.70
	韓国	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	—	3.53
国内リート	日本	日本ビルファンド投資法人	—	6.58
	日本	ジャパンリアルエステイト投資法人	—	5.57
	日本	野村不動産マスターファンド投資法人	—	5.04
先進国リート	アメリカ	PROLOGIS INC	—	8.72
	アメリカ	EQUINIX INC	—	5.68
	アメリカ	PUBLIC STORAGE	—	3.52

※比率は、各マザーファンドの純資産総額に対する組入比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)



※ファンドにベンチマークはありません。
 ※2023年3月17日が設定日のため、2022年以前の実績はありません。2023年は3月17日から9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3【ファンドの経理状況】

ターゲットリターンバランスファンド（目標2%）
 ターゲットリターンバランスファンド（目標3%）
 ターゲットリターンバランスファンド（目標4%）
 ターゲットリターンバランスファンド（目標5%）
 ターゲットリターンバランスファンド（目標6%）

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)ならびに同規則第38条の3および第57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、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1期中間計算期間(2023年3月17日から2023年9月16日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

【中間財務諸表】

【ターゲットリターンバランスファンド（目標2%）】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第1期中間計算期間末 2023年9月16日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	31,097
親投資信託受益証券	5,365,917
流動資産合計	5,397,014
資産合計	5,397,014
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	233
未払委託者報酬	4,918
その他未払費用	182
流動負債合計	5,333
負債合計	5,333
純資産の部	
元本等	
元本	5,226,005
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金()	165,676
(分配準備積立金)	-
元本等合計	5,391,681
純資産合計	5,391,681
負債純資産合計	5,397,014

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第1期中間計算期間 自 2023年 3月17日 至 2023年 9月16日
営業収益	
有価証券売買等損益	56,117
営業収益合計	56,117
営業費用	
支払利息	7
受託者報酬	233
委託者報酬	4,918
その他費用	182
営業費用合計	5,340
営業利益又は営業損失（ ）	50,777
経常利益又は経常損失（ ）	50,777
中間純利益又は中間純損失（ ）	50,777
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	1,200
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	117,026
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	117,026
剰余金減少額又は欠損金増加額	927
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	927
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	165,676

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1.有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2.その他中間財務諸表作成のための重要な事項	当ファンドの中間計算期間は、信託約款の規定により、設定日（2023年 3月17日）から2023年 9月16日までとなっております。

(中間貸借対照表に関する注記)

	第1期中間計算期間末 2023年 9月16日現在
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	4,297,001円
期中一部解約元本額	70,996円
2. 中間計算期間の末日における受益権の総数	
	5,226,005口
3. 中間計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.0317円
(10,000口当たり純資産額)	(10,317円)

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

第1期中間計算期間末 2023年 9月16日現在
<p>1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p style="padding-left: 2em;">中間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、中間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 style="padding-left: 2em;">親投資信託受益証券</p> <p style="padding-left: 4em;">（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 style="padding-left: 2em;">コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p style="padding-left: 4em;">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 style="padding-left: 2em;">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>

（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）

デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

【ターゲットリターンバランスファンド（目標3%）】

（1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

第1期中間計算期間末
2023年 9月16日現在

資産の部
流動資産

第1期中間計算期間末
2023年 9月16日現在

コール・ローン	7,791
親投資信託受益証券	2,153,455
流動資産合計	2,161,246
資産合計	2,161,246
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	196
未払委託者報酬	4,192
その他未払費用	182
流動負債合計	4,570
負債合計	4,570
純資産の部	
元本等	
元本	2,024,200
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	132,476
（分配準備積立金）	-
元本等合計	2,156,676
純資産合計	2,156,676
負債純資産合計	2,161,246

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位 : 円)

第1期中間計算期間
自 2023年 3月17日
至 2023年 9月16日

営業収益	
有価証券売買等損益	75,255
営業収益合計	75,255
営業費用	
支払利息	7
受託者報酬	196
委託者報酬	4,192
その他費用	182
営業費用合計	4,577
営業利益又は営業損失（ ）	70,678
経常利益又は経常損失（ ）	70,678
中間純利益又は中間純損失（ ）	70,678
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	599
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	62,649
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	62,649
剰余金減少額又は欠損金増加額	252
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	252
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	132,476

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券
--------------------	-----------

2. その他中間財務諸表作成のための重要な事項	移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。 当ファンドの中間計算期間は、信託約款の規定により、設定日（2023年 3月17日）から2023年 9月16日までとなっております。
-------------------------	---

（中間貸借対照表に関する注記）

第1期中間計算期間末 2023年 9月16日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	1,041,368円
期中一部解約元本額	17,168円
2. 中間計算期間の末日における受益権の総数	2,024,200口
3. 中間計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.0654円
(10,000口当たり純資産額)	(10,654円)

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

第1期中間計算期間末 2023年 9月16日現在	
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	中間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、中間貸借対照表計上額と時価との差額は ありません。
2. 時価の算定方法	
親投資信託受益証券	（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額 が異なることもあります。

（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）
デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

【ターゲットリターンバランスファンド（目標４％）】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第1期中間計算期間末 2023年 9月16日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	34,328
親投資信託受益証券	9,397,425
流動資産合計	9,431,753
資産合計	9,431,753
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	283
未払委託者報酬	6,109
その他未払費用	182
流動負債合計	6,574
負債合計	6,574
純資産の部	
元本等	
元本	8,556,760
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	868,419
（分配準備積立金）	-
元本等合計	9,425,179
純資産合計	9,425,179
負債純資産合計	9,431,753

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期中間計算期間 自 2023年 3月17日 至 2023年 9月16日
営業収益	
有価証券売買等損益	161,825
営業収益合計	161,825
営業費用	
支払利息	7
受託者報酬	283
委託者報酬	6,109
その他費用	182

第1期中間計算期間
自 2023年 3月17日
至 2023年 9月16日

営業費用合計	6,581
営業利益又は営業損失（ ）	155,244
経常利益又は経常損失（ ）	155,244
中間純利益又は中間純損失（ ）	155,244
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	366
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	715,799
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	715,799
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,258
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,258
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	868,419

（3）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他中間財務諸表作成のための重要な事項	当ファンドの中間計算期間は、信託約款の規定により、設定日（2023年 3月17日）から2023年 9月16日までとなっております。

（中間貸借対照表に関する注記）

第1期中間計算期間末 2023年 9月16日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	7,584,294円
期中一部解約元本額	27,534円
2. 中間計算期間の末日における受益権の総数	8,556,760口
3. 中間計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.1015円
(10,000口当たり純資産額)	(11,015円)

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

第1期中間計算期間末
2023年 9月16日現在

1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額

中間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、中間貸借対照表計上額と時価との差額は
ありません。

2. 時価の算定方法

親投資信託受益証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

（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）

デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

【ターゲットリターンバランスファンド（目標5%）】

（1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

第1期中間計算期間末
2023年 9月16日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	30,959
親投資信託受益証券	6,725,924
流動資産合計	6,756,883
資産合計	6,756,883
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	281
未払委託者報酬	6,085
その他未払費用	182
流動負債合計	6,548

第1期中間計算期間末
2023年 9月16日現在

負債合計	6,548
純資産の部	
元本等	
元本	5,935,175
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	815,160
（分配準備積立金）	-
元本等合計	6,750,335
純資産合計	6,750,335
負債純資産合計	6,756,883

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第1期中間計算期間 自 2023年 3月17日 至 2023年 9月16日
営業収益	
有価証券売買等損益	214,924
営業収益合計	214,924
営業費用	
支払利息	7
受託者報酬	281
委託者報酬	6,085
その他費用	182
営業費用合計	6,555
営業利益又は営業損失（ ）	208,369
経常利益又は経常損失（ ）	208,369
中間純利益又は中間純損失（ ）	208,369
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	1,097
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	607,897
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	607,897
剰余金減少額又は欠損金増加額	9
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	9
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	815,160

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他中間財務諸表作成のための重要な事項	当ファンドの中間計算期間は、信託約款の規定により、設定日（2023年 3月17日）から2023年 9月16日までとなっております。

(中間貸借対照表に関する注記)

第1期中間計算期間末 2023年 9月16日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	4,944,163円
期中一部解約元本額	8,988円
2. 中間計算期間の末日における受益権の総数	5,935,175口
3. 中間計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.1373円
(10,000口当たり純資産額)	(11,373円)

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

第1期中間計算期間末 2023年 9月16日現在	
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	
中間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、中間貸借対照表計上額と時価との差額は ありません。	
2. 時価の算定方法	
親投資信託受益証券	
（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。	
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	
これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	
金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額 が異なることもあります。	

（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）

デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

【ターゲットリターンバランスファンド（目標6%）】

（1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第1期中間計算期間末 2023年 9月16日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	33,514
親投資信託受益証券	8,888,540
流動資産合計	8,922,054
資産合計	8,922,054
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	319
未払委託者報酬	7,019
その他未払費用	182
流動負債合計	7,520
負債合計	7,520
純資産の部	
元本等	
元本	7,587,741
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,326,793
（分配準備積立金）	-
元本等合計	8,914,534
純資産合計	8,914,534
負債純資産合計	8,922,054

（2）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期中間計算期間 自 2023年 3月17日 至 2023年 9月16日
営業収益	
有価証券売買等損益	303,940
営業収益合計	303,940
営業費用	
支払利息	7
受託者報酬	319
委託者報酬	7,019
その他費用	182
営業費用合計	7,527
営業利益又は営業損失（ ）	296,413
経常利益又は経常損失（ ）	296,413
中間純利益又は中間純損失（ ）	296,413
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	991
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,034,821
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,034,821

第1期中間計算期間 自 2023年 3月17日 至 2023年 9月16日	
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,450
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,450
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,326,793

（ 3 ）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他中間財務諸表作成のための重要な事項	当ファンドの中間計算期間は、信託約款の規定により、設定日（2023年 3月17日）から2023年 9月16日までとなっております。

（中間貸借対照表に関する注記）

第1期中間計算期間末 2023年 9月16日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	6,614,320円
期中一部解約元本額	26,579円
2. 中間計算期間の末日における受益権の総数	7,587,741口
3. 中間計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.1749円
(10,000口当たり純資産額)	(11,749円)

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

第1期中間計算期間末 2023年 9月16日現在	
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	
中間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、中間貸借対照表計上額と時価との差額は ありません。	
2. 時価の算定方法	

親投資信託受益証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

（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）

デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

（参考）

「ターゲットリターンバランスファンド」の各ファンドは「RM国内債券マザーファンド」、「RM先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）」、「RM先進国債券マザーファンド」、「RM新興国債券マザーファンド」、「RM国内株式マザーファンド」、「RM先進国株式マザーファンド」、「RM新興国株式マザーファンド」、「RM国内リートマザーファンド」および「RM先進国リートマザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同親投資信託の受益証券です。

なお、以下に記載した状況は監査意見の対象外となっております。

RM国内債券マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2023年 9月16日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	175,256
コール・ローン	1,299,359,639
国債証券	133,573,314,520
地方債証券	7,796,941,260
特殊債券	9,195,928,487
社債券	6,367,418,000
未収利息	300,897,661
前払費用	57,264,779
流動資産合計	158,591,299,602
資産合計	158,591,299,602

2023年 9月16日現在

負債の部	
流動負債	
未払金	600,000,000
未払解約金	146,460,100
未払利息	3,524
流動負債合計	746,463,624
負債合計	746,463,624
純資産の部	
元本等	
元本	158,362,145,524
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	517,309,546
元本等合計	157,844,835,978
純資産合計	157,844,835,978
負債純資産合計	158,591,299,602

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 9月16日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 3月17日
期首元本額	130,642,184,309円
期中追加設定元本額	67,449,151,079円
期中一部解約元本額	39,729,189,864円
期末元本額	158,362,145,524円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	13,002,696,024円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	10,139,065,530円
りそなラップ型ファンド(成長型)	2,532,536,835円
DCりそな グローバルバランス	978,470,430円
つみたてバランスファンド	7,603,435,884円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	5,867,109,232円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	1,723,868,474円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	551,196,231円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	917,893,847円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	283,975,393円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	68,794,487円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	81,237,441円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定型)	190,914,848円

りそな つみたてラップ型ファンド(安定成長型)	148,129,268円
りそな つみたてラップ型ファンド(成長型)	39,570,981円
りそな つみたてリスクコントロールファンド	107,554,604円
ターゲットリターンバランスファンド(目標2%)	1,828,987円
ターゲットリターンバランスファンド(目標3%)	612,883円
ターゲットリターンバランスファンド(目標4%)	1,968,657円
ターゲットリターンバランスファンド(目標5%)	903,987円
ターゲットリターンバランスファンド(目標6%)	484,947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	1,162,100,578円
FWりそな国内債券インデックスファンド	88,819,643,814円
Smart-i 国内債券インデックス	2,459,080,840円
Smart-i 8資産バランス 安定型	1,940,741,402円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	1,430,388,808円
Smart-i 8資産バランス 成長型	370,850,769円
りそなFT 国内債券インデックス(適格機関投資家専用)	9,617,795,646円
りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	7,244,528,368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)	62,822,454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)	49,337,903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)	69,864,671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)	352,770,852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)	196,844,646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	158,362,145,524口
3. 元本の欠損	
純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	517,309,546円
4. 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	0.9967円
(10,000口当たり純資産額)	(9,967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)

金融商品の時価等に関する事項

2023年 9月16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。

（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）

デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

R M先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

貸借対照表

（単位：円）

2023年 9月16日現在

資産の部	
流動資産	
預金	165,780,915
コール・ローン	231,509,805
国債証券	172,996,878,754
派生商品評価勘定	1,062,421,343
未収入金	27,010,632
未収利息	1,205,440,124
前払費用	88,269,387
流動資産合計	175,777,310,960
資産合計	
175,777,310,960	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,308,647,233
未払金	22,203,740
未払解約金	135,154,400
未払利息	627
流動負債合計	1,466,006,000
負債合計	
1,466,006,000	
純資産の部	
元本等	
元本	206,664,470,579
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	32,353,165,619
元本等合計	174,311,304,960
純資産合計	
174,311,304,960	
負債純資産合計	
175,777,310,960	

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2023年 9月16日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 3月17日
期首元本額	260,491,586,847円
期中追加設定元本額	19,575,301,852円
期中一部解約元本額	73,402,418,120円
期末元本額	206,664,470,579円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	26,597,842,644円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	16,818,863,499円
りそなラップ型ファンド(成長型)	456,644,401円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	6,937,730,500円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	2,032,574,861円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	649,904,137円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	1,082,236,970円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	335,794,872円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	81,111,113円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	95,782,748円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定型)	390,964,654円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定成長型)	257,216,108円
りそな つみたてラップ型ファンド(成長型)	8,888,523円
りそな つみたてリスクコントロールファンド	49,545,638円
ターゲットリターンバランスファンド(目標2%)	2,161,389円

ターゲットリターンバランスファンド（目標3%）	722,625円
ターゲットリターンバランスファンド（目標4%）	2,327,872円
ターゲットリターンバランスファンド（目標5%）	1,067,716円
ターゲットリターンバランスファンド（目標6%）	573,452円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2065	17,416円
FWりそな円建債券アクティブファンド	317,701,208円
FWりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジあり）	128,651,330,163円
Smart-i 先進国債券インデックス（為替ヘッジあり）	2,437,317,971円
Smart-i 8資産バランス 安定型	2,288,332,720円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	1,690,171,315円
Smart-i 8資産バランス 成長型	438,102,987円
りそなFT 先進国債券インデックス・為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）	8,550,722,518円
りそなDAAファンド（適格機関投資家専用）	474,571,614円
りそなFT RCバランスファンド（適格機関投資家専用）	3,352,406,353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）	127,950,695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）	77,787,678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）	14,432,243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）	103,690,418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）	937,551,203円
りそなマルチアセットファンド（適格機関投資家専用）	405,812,514円
りそなDAAファンド（適格機関投資家専用）	608,334円
りそなDAAファンド202205（適格機関投資家専用）	994,009,507円
2. 計算日における受益権の総数	206,664,470,579口
3. 元本の欠損	
純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	32,353,165,619円
4. 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	0.8435円
(10,000口当たり純資産額)	(8,435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）

金融商品の時価等に関する事項

2023年 9月16日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	
国債証券	
（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。	
デリバティブ取引	
（その他の注記）の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。

(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)

デリバティブ取引に関する注記

(通貨関連)

(2023年 9月16日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	175,499,903,613	-	175,746,129,503	246,225,890
	米ドル	83,962,590,848	-	85,049,580,680	1,086,989,832
	カナダドル	3,517,425,628	-	3,565,938,642	48,513,014
	メキシコペソ	1,816,425,012	-	1,803,925,199	12,499,813
	ユーロ	58,534,500,196	-	57,653,868,943	880,631,253
	英ポンド	8,812,531,946	-	8,703,961,439	108,570,507
	スウェーデンクローナ	342,988,493	-	336,509,620	6,478,873
	ノルウェークローネ	284,698,392	-	284,123,790	574,602
	デンマーククローネ	573,714,950	-	564,628,603	9,086,347
	ポーランドズロチ	900,803,951	-	856,261,101	44,542,850
	オーストラリアドル	2,590,557,593	-	2,605,168,961	14,611,368
	ニュージーランドドル	398,723,890	-	400,976,690	2,252,800
	シンガポールドル	784,945,018	-	785,817,760	872,742

	マレーシアリン ギット	895,332,784	-	899,403,987	4,071,203
	中国元	11,549,653,160	-	11,700,072,844	150,419,684
	イスラエルシケ ル	535,011,752	-	535,891,244	879,492
	合計	175,499,903,613	-	175,746,129,503	246,225,890

(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。

R M先進国債券マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2023年 9月16日現在

資産の部	
流動資産	
預金	109,142,020
コール・ローン	97,439,888
国債証券	56,221,669,441
未収利息	359,975,619
前払費用	37,111,530
流動資産合計	56,825,338,498
資産合計	56,825,338,498
負債の部	
流動負債	
未払解約金	48,245,200
未払利息	264
流動負債合計	48,245,464
負債合計	48,245,464
純資産の部	
元本等	
元本	48,263,500,104
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	8,513,592,930
元本等合計	56,777,093,034
純資産合計	56,777,093,034

2023年 9月16日現在

負債純資産合計

56,825,338,498

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重要な事項	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 9月16日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 3月17日
期首元本額	44,220,988,764円
期中追加設定元本額	21,380,103,225円
期中一部解約元本額	17,337,591,885円
期末元本額	48,263,500,104円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	2,477,584,634円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	2,239,356,273円
りそなラップ型ファンド(成長型)	668,061,841円
DCりそな グローバルバランス	68,187,408円
つみたてバランスファンド	1,592,856,099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	322,098,514円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	102,326,767円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	171,726,313円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	52,629,643円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	12,665,038円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	14,843,514円

りそな つみたてラップ型ファンド（安定型）	38,847,353円
りそな つみたてラップ型ファンド（安定成長型）	14,292,833円
りそな つみたてラップ型ファンド（成長型）	9,474,501円
ターゲットリターンバランスファンド（目標2%）	272,818円
ターゲットリターンバランスファンド（目標3%）	36,216円
ターゲットリターンバランスファンド（目標4%）	156,455円
ターゲットリターンバランスファンド（目標5%）	111,629円
ターゲットリターンバランスファンド（目標6%）	147,596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	34,629,015円
FWりそな先進国+新興国債券アクティブファンド	38,954,229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）	34,158,104,032円
Smart-i 先進国債券インデックス（為替ヘッジなし）	2,089,271,735円
Smart-i 8資産バランス 安定型	362,508,564円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	263,909,882円
Smart-i 8資産バランス 成長型	66,746,084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）	5,672,104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）	5,495,563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）	21,015,124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）	16,181,544円
りそなFT パッシブバランス（適格機関投資家専用）	264,337,630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	48,263,500,104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	1.1764円
(10,000口当たり純資産額)	(11,764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）

金融商品の時価等に関する事項

2023年 9月16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。

（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）

デリバティブ取引に関する注記

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 9月16日現在

資産の部	
流動資産	
預金	11,446,901
コール・ローン	15,324,263
投資信託受益証券	10,653,724,226
流動資産合計	10,680,495,390
資産合計	10,680,495,390
負債の部	
流動負債	
未払解約金	1,604,000
未払利息	41
流動負債合計	1,604,041
負債合計	1,604,041
純資産の部	
元本等	
元本	8,165,610,150
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	2,513,281,199
元本等合計	10,678,891,349
純資産合計	10,678,891,349
負債純資産合計	10,680,495,390

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重要な事項	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 9月16日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 3月17日
期首元本額	8,481,096,268円
期中追加設定元本額	880,409,477円
期中一部解約元本額	1,195,895,595円
期末元本額	8,165,610,150円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	783,818,502円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	942,996,766円
りそなラップ型ファンド(成長型)	598,951,072円
DCりそな グローバルバランス	21,534,761円
つみたてバランスファンド	1,440,544,589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	226,948,513円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	157,466,246円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	80,123,361円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	54,465,324円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	30,796,337円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	65,680,152円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	98,138,064円
九州SDGs・グローバルバランス	34,223,265円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定型)	4,643,518円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定成長型)	28,169,538円
ラップ型ファンド・プラスESG(成長型)	36,428,904円

りそな つみたてラップ型ファンド（安定型）	11,572,871円
りそな つみたてラップ型ファンド（安定成長型）	12,898,304円
りそな つみたてラップ型ファンド（成長型）	8,549,478円
ターゲットリターンバランスファンド（目標2%）	81,209円
ターゲットリターンバランスファンド（目標3%）	32,712円
ターゲットリターンバランスファンド（目標4%）	141,630円
ターゲットリターンバランスファンド（目標5%）	100,964円
ターゲットリターンバランスファンド（目標6%）	133,652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	24,937,293円
FWりそな新興国債券インデックスファンド	2,482,937,142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	251,780,563円
Smart-i 8資産バランス 成長型	340,092,977円
りそなVIグローバル・バランスファンド（安定型）（適格機関投資家専用）	3,838,538円
りそなVIグローバル・バランスファンド（安定成長型）（適格機関投資家専用）	4,979,688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）	19,027,790円
りそなFT マルチアセットファンド（適格機関投資家専用）	14,294,203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）	5,490,570円
2. 計算日における受益権の総数	8,165,610,150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	1.3078円
(10,000口当たり純資産額)	(13,078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）

金融商品の時価等に関する事項

2023年 9月16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。	

（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）

デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

R M国内株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2023年 9月16日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	852,156,745
株式	116,661,494,290
派生商品評価勘定	16,185,150
未収入金	343,505
未収配当金	42,722,122
差入委託証拠金	25,515,000
流動資産合計	117,598,416,812
資産合計	117,598,416,812
負債の部	
流動負債	
前受金	10,665,000
未払解約金	185,827,500
未払利息	2,311
流動負債合計	196,494,811
負債合計	196,494,811
純資産の部	
元本等	
元本	63,438,654,943
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	53,963,267,058
元本等合計	117,401,922,001
純資産合計	117,401,922,001
負債純資産合計	117,598,416,812

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 9月16日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 3月17日
期首元本額	36,055,607,488円
期中追加設定元本額	43,413,278,236円
期中一部解約元本額	16,030,230,781円
期末元本額	63,438,654,943円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	1,061,549,437円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	1,679,761,923円
りそなラップ型ファンド(成長型)	3,056,342,721円
DCりそな グローバルバランス	28,154,913円
つみたてバランスファンド	6,384,421,740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	334,351,294円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	231,204,806円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	118,330,435円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	81,037,667円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	45,247,767円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	95,491,212円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定型)	15,387,855円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定成長型)	40,854,276円
りそな つみたてラップ型ファンド(成長型)	54,780,909円
りそな つみたてリスクコントロールファンド	24,761,742円
ターゲットリターンバランスファンド(目標2%)	176,272円
ターゲットリターンバランスファンド(目標3%)	85,302円
ターゲットリターンバランスファンド(目標4%)	470,988円
ターゲットリターンバランスファンド(目標5%)	448,392円
ターゲットリターンバランスファンド(目標6%)	898,932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	97,049,332円

FWりそな国内株式インデックスファンド	40,378,250,733円
Smart-i TOPIXインデックス	3,499,798,977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	380,996,539円
Smart-i 8資産バランス 成長型	501,361,564円
TOPIXインデックスファンド（適格機関投資家専用）	496,698,535円
りそなFT TOPIXインデックス（適格機関投資家専用）	920,338,665円
りそなDAAファンド（適格機関投資家専用）	133,062,813円
りそなFT RCバランスファンド（適格機関投資家専用）	1,757,344,962円
りそなVIグローバル・バランスファンド（安定型）（適格機関投資家専用）	5,951,154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）	22,172,584円
りそなVIグローバル・バランスファンド（成長型）（適格機関投資家専用）	24,964,053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）	75,025,281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）	17,381,419円
りそなFT パッシブバランス（適格機関投資家専用）	206,097,152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）	21,745円
りそなDAAファンド202205（適格機関投資家専用）	278,673,633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	63,438,654,943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	1.8506円
(10,000口当たり純資産額)	(18,506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）

金融商品の時価等に関する事項

2023年 9月16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。

（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）

デリバティブ取引に関する注記

（株式関連）

（2023年 9月16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	633,299,850	-	649,485,000	16,185,150
	合計	633,299,850	-	649,485,000	16,185,150

（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。

R M先進国株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2023年 9月16日現在

資産の部	
流動資産	
預金	6,292,240,836
コール・ローン	111,828,499
株式	204,504,689,728
投資証券	4,201,238,820
派生商品評価勘定	94,006,069
未収入金	13,314,762
未収配当金	320,092,978
差入委託証拠金	3,527,014,146
流動資産合計	219,064,425,838

2023年 9月16日現在

資産合計	219,064,425,838
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	174,634
未払金	20,205,871
未払解約金	38,180,700
未払利息	303
流動負債合計	58,561,508
負債合計	58,561,508
純資産の部	
元本等	
元本	84,752,258,757
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	134,253,605,573
元本等合計	219,005,864,330
純資産合計	219,005,864,330
負債純資産合計	219,064,425,838

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

5. その他財務諸表作成のための重要な事項	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 9月16日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 3月17日
期首元本額	79,173,782,849円
期中追加設定元本額	23,333,155,874円
期中一部解約元本額	17,754,679,966円
期末元本額	84,752,258,757円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	2,577,092,061円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	8,819,432,475円
りそなラップ型ファンド(成長型)	7,560,687,764円
DCりそな グローバルバランス	71,683,975円
つみたてバランスファンド	2,972,204,982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	1,406,111,730円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	973,102,759円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	498,279,371円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	337,597,855円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	190,294,043円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	404,702,985円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定型)	36,729,337円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定成長型)	94,644,872円
りそな つみたてラップ型ファンド(成長型)	90,686,993円
りそな つみたてリスクコントロールファンド	13,487,271円
ターゲットリターンバランスファンド(目標2%)	208,693円
ターゲットリターンバランスファンド(目標3%)	186,631円
ターゲットリターンバランスファンド(目標4%)	1,099,984円
ターゲットリターンバランスファンド(目標5%)	974,237円
ターゲットリターンバランスファンド(目標6%)	1,352,309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	36,051,039円
FWりそな先進国+新興国株式アクティブファンド	131,007,829円
FWりそな先進国株式インデックスファンド	31,301,464,546円
Smart-i 先進国株式インデックス	17,033,479,232円
Smart-i 8資産バランス 安定型	480,504,398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	2,103,474,917円
Smart-i Select 全世界株式インデックス	296,344,665円

Smart - i Select 全世界株式インデックス(除く日本)	165,802,899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)	248,659,424円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	89,366,391円
りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	1,167,736,266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)	15,553,376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)	42,934,466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)	273,712,024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)	118,082,940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)	78,860,019円
りそなFT パッシブバランス(適格機関投資家専用)	333,849,205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)	113,447円
りそなDAAファンド202205(適格機関投資家専用)	187,190,225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	84,752,258,757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	2.5841円
(10,000口当たり純資産額)	(25,841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)

金融商品の時価等に関する事項

2023年 9月16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、新株予約権証券、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。	

（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）

デリバティブ取引に関する注記

（株式関連）

（2023年 9月16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	10,377,668,398	-	10,471,438,759	93,770,361
合計		10,377,668,398	-	10,471,438,759	93,770,361

（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 9月16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	356,865,820	-	356,926,894	61,074
	米ドル	249,182,600	-	249,281,033	98,433
	カナダドル	32,667,520	-	32,753,557	86,037
	ユーロ	29,908,650	-	29,815,818	92,832
	英ポンド	25,658,240	-	25,625,824	32,416
	スイスフラン	14,819,130	-	14,820,300	1,170
	デンマーククローネ	4,629,680	-	4,630,362	682
合計		356,865,820	-	356,926,894	61,074

（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。

R M新興国株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2023年 9月16日現在

資産の部	
流動資産	
預金	904,745,388
コール・ローン	18,931,383
株式	26,817,959,993
投資証券	32,990,892
派生商品評価勘定	4,333,673
未収入金	60,109
未収配当金	61,430,803
差入委託証拠金	450,258,794
流動資産合計	28,290,711,035
資産合計	28,290,711,035
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	7,381
未払解約金	2,506,200
未払利息	51
流動負債合計	2,513,632
負債合計	2,513,632
純資産の部	
元本等	
元本	16,008,601,292
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	12,279,596,111
元本等合計	28,288,197,403
純資産合計	28,288,197,403
負債純資産合計	28,290,711,035

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 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。</p> <p>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。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。</p> <p>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。</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 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 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 原則として、約定日基準で計上しております。</p>
5. その他財務諸表作成のための重要な事項	<p>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。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2023年 9月16日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 3月17日
期首元本額	13,660,004,895円
期中追加設定元本額	3,668,381,199円
期中一部解約元本額	1,319,784,802円
期末元本額	16,008,601,292円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	580,302,568円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	2,336,059,288円
りそなラップ型ファンド(成長型)	2,208,396,680円
DCりそな グローバルバランス	15,940,852円
つみたてバランスファンド	1,077,595,629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	340,605,592円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	235,980,731円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	121,239,264円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	82,189,792円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	46,189,492円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	98,272,288円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	145,011,232円
九州SDGs・グローバルバランス	80,751,071円
ラップ型ファンド・プラスESG（安定型）	3,444,359円
ラップ型ファンド・プラスESG（安定成長型）	61,043,347円
ラップ型ファンド・プラスESG（成長型）	132,022,962円
りそな つみたてラップ型ファンド（安定型）	8,584,010円
りそな つみたてラップ型ファンド（安定成長型）	24,605,126円
りそな つみたてラップ型ファンド（成長型）	28,379,719円
りそな つみたてリスクコントロールファンド	1,041,093円
ターゲットリターンバランスファンド（目標2%）	60,221円
ターゲットリターンバランスファンド（目標3%）	44,570円
ターゲットリターンバランスファンド（目標4%）	299,513円
ターゲットリターンバランスファンド（目標5%）	284,440円
ターゲットリターンバランスファンド（目標6%）	437,098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	88,636,943円
FWりそな新興国株式インデックスファンド	3,941,624,382円
Smart-i 新興国株式インデックス	2,653,273,939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	383,206,403円
Smart-i 8資産バランス 成長型	509,902,773円
Smart-i Select 全世界株式インデックス	54,315,742円
Smart-i Select 全世界株式インデックス（除く日本）	30,324,499円
りそなVIグローバル・バランスファンド（安定型）（適格機関投資家専用）	2,860,191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）	10,431,456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）	87,603,563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）	25,226,638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）	17,540,694円
2. 計算日における受益権の総数	16,008,601,292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	1.7671円
(10,000口当たり純資産額)	(17,671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）

金融商品の時価等に関する事項

2023年 9月16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。

（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）

デリバティブ取引に関する注記

（株式関連）

（2023年 9月16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	1,469,166,645	-	1,473,492,649	4,326,004
	合計	1,469,166,645	-	1,473,492,649	4,326,004

（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 9月16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	70,800,000	-	70,800,288	288
	米ドル	70,800,000	-	70,800,288	288
	合計	70,800,000	-	70,800,288	288

(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。

R M国内リートマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2023年 9月16日現在	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	264,927,375
投資証券	44,235,751,600
未収配当金	573,718,322
前払金	13,197,200
差入委託証拠金	46,143,500
流動資産合計	45,133,737,997
資産合計	45,133,737,997
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	12,637,030
未払金	72,577,324
未払解約金	37,598,600
未払利息	718
流動負債合計	122,813,672

2023年 9月16日現在

負債合計	122,813,672
純資産の部	
元本等	
元本	30,699,461,221
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	14,311,463,104
元本等合計	45,010,924,325
純資産合計	45,010,924,325
負債純資産合計	45,133,737,997

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 9月16日現在

1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 3月17日
期首元本額	23,257,249,849円
期中追加設定元本額	14,794,811,820円
期中一部解約元本額	7,352,600,448円
期末元本額	30,699,461,221円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	464,266,570円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	722,248,067円
りそなラップ型ファンド(成長型)	1,242,501,005円
DCりそな グローバルバランス	9,768,454円
つみたてバランスファンド	2,557,851,638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	199,938,660円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	138,685,653円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	70,561,504円

りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	48,699,826円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	27,185,280円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	57,843,171円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	130,425,886円
九州SDGs・グローバルバランス	59,176,843円
りそな国内リートインデックス（ラップ専用）	1,776,310,575円
ラップ型ファンド・プラスESG（安定型）	2,812,040円
ラップ型ファンド・プラスESG（安定成長型）	35,169,040円
ラップ型ファンド・プラスESG（成長型）	34,884,810円
りそな つみたてラップ型ファンド（安定型）	7,001,707円
りそな つみたてラップ型ファンド（安定成長型）	17,659,877円
りそな つみたてラップ型ファンド（成長型）	22,962,714円
りそな つみたてリスクコントロールファンド	3,329,680円
ターゲットリターンバランスファンド（目標2%）	71,722円
ターゲットリターンバランスファンド（目標3%）	28,812円
ターゲットリターンバランスファンド（目標4%）	194,165円
ターゲットリターンバランスファンド（目標5%）	181,451円
ターゲットリターンバランスファンド（目標6%）	371,933円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2065	33,508円
りそなJリートインデックス（年1回決算型）	672,120円
りそなJリートインデックス（年4回決算型）	672,120円
FWりそな国内リートインデックスオープン	7,333,637,871円
FWりそな国内リートインデックスファンド	6,436,304,833円
Smart-i Jリートインデックス	3,172,788,397円
Smart-i 8資産バランス 安定型	66,099,498円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	224,096,531円
Smart-i 8資産バランス 成長型	299,508,294円
J-REITインデックスファンド（適格機関投資家専用）	4,182,736,555円
りそなDAAファンド（適格機関投資家専用）	140,387,176円
りそなVIグローバル・バランスファンド（安定型）（適格機関投資家専用）	2,289,896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）	9,473,176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）	10,366,638円
りそなDAAマルチアセットファンド（適格機関投資家専用）	4,954,317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）	12,832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）	294,009,381円
りそなFT グローバルリートファンド202307（適格機関投資家専用）	475,849,854円
2. 計算日における受益権の総数	30,699,461,221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	1.4662円
(10,000口当たり純資産額)	(14,662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）

金融商品の時価等に関する事項

2023年 9月16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。

（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）

デリバティブ取引に関する注記

（投資証券関連）

（2023年 9月16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	764,635,030	-	751,998,000	12,637,030
	合計	764,635,030	-	751,998,000	12,637,030

（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。

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 9月16日現在

資産の部	
流動資産	
預金	166,765,178
コール・ローン	73,842,976
株式	634,946,765
投資証券	62,805,277,750
派生商品評価勘定	255
未収入金	6,196,104
未収配当金	191,885,614
流動資産合計	63,878,914,642
資産合計	63,878,914,642
負債の部	
流動負債	
未払解約金	55,316,300
未払利息	200
流動負債合計	55,316,500
負債合計	55,316,500
純資産の部	
元本等	
元本	41,548,257,002
剰余金	
剰余金又は欠損金()	22,275,341,140
元本等合計	63,823,598,142
純資産合計	63,823,598,142
負債純資産合計	63,878,914,642

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	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
5.その他財務諸表作成のための重要な事項	<p>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。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2023年 9月16日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 3月17日
期首元本額	24,047,705,857円
期中追加設定元本額	24,505,950,404円
期中一部解約元本額	7,005,399,259円
期末元本額	41,548,257,002円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	1,576,637,932円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	2,346,846,498円
りそなラップ型ファンド(成長型)	2,998,899,830円
DCりそな グローバルバランス	46,292,058円
つみたてバランスファンド	1,234,653,441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	391,752,349円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	271,469,621円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	138,902,382円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	94,011,562円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	53,086,690円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	113,049,201円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	254,197,153円
九州SDGs・グローバルバランス	115,674,386円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定型)	9,289,325円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定成長型)	91,038,256円
ラップ型ファンド・プラスESG(成長型)	97,877,412円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定型)	23,156,274円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定成長型)	44,790,816円
りそな つみたてラップ型ファンド(成長型)	51,937,586円
りそな つみたてリスクコントロールファンド	1,203,496円
ターゲットリターンバランスファンド(目標2%)	140,370円
ターゲットリターンバランスファンド(目標3%)	56,339円

ターゲットリターンバランスファンド（目標4%）	373,933円
ターゲットリターンバランスファンド（目標5%）	354,761円
ターゲットリターンバランスファンド（目標6%）	714,329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	14,004,295,621円
FWりそな先進国リートインデックスファンド	12,314,735,766円
Smart-i 先進国リートインデックス	2,789,401,130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	586,564,106円
りそなDAAファンド（適格機関投資家専用）	125,693,420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）	7,696,266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）	11,798,686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）	137,307,481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）	20,329,337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）	25,425円
りそなDAAファンド202205（適格機関投資家専用）	263,273,093円
りそなFT グローバルリートファンド202307（適格機関投資家専用）	194,032,762円
2. 計算日における受益権の総数	41,548,257,002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	1.5361円
(10,000口当たり純資産額)	(15,361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）

金融商品の時価等に関する事項

2023年 9月16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。

（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）

デリバティブ取引に関する注記

（通貨関連）

（2023年 9月16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	75,237,240	-	75,237,495	255
	米ドル	75,237,240	-	75,237,495	255
	合計	75,237,240	-	75,237,495	255

（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。

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2023年 9月29日現在です。

【ターゲットリターンバランスファンド（目標2%）】

【純資産額計算書】

資産総額	5,570,366円
負債総額	31,048円
純資産総額（ - ）	5,539,318円
発行済口数	5,464,814口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0136円

【ターゲットリターンバランスファンド（目標3%）】

【純資産額計算書】

資産総額	4,360,738円
負債総額	966円
純資産総額（ - ）	4,359,772円
発行済口数	4,175,956口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0440円

【ターゲットリターンバランスファンド（目標4%）】

【純資産額計算書】

資産総額	10,099,018円
負債総額	2,095円
純資産総額（ - ）	10,096,923円
発行済口数	9,382,252口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0762円

【ターゲットリターンバランスファンド（目標5%）】

【純資産額計算書】

資産総額	7,644,561円
負債総額	1,534円
純資産総額（ - ）	7,643,027円
発行済口数	6,898,734口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1079円

【ターゲットリターンバランスファンド（目標6%）】

【純資産額計算書】

資産総額	9,729,620円
負債総額	2,038円
純資産総額（ - ）	9,727,582円
発行済口数	8,531,625口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1402円

（参考）

R M国内債券マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	156,610,872,662円
負債総額	176,140,365円
純資産総額（ - ）	156,434,732,297円
発行済口数	157,634,673,459口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9924円

R M先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

純資産額計算書

資産総額	174,155,605,697円
負債総額	2,907,908,542円
純資産総額（ - ）	171,247,697,155円
発行済口数	207,287,993,007口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8261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	56,490,847,522円
負債総額	302,243,517円
純資産総額（ - ）	56,188,604,005円
発行済口数	48,192,041,087口

1口当たり純資産額（ / ）	1.1659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	10,528,204,718円
負債総額	10,547,819円
純資産総額（ - ）	10,517,656,899円
発行済口数	8,197,927,984口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2830円

R M国内株式マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	114,479,239,254円
負債総額	361,491,185円
純資産総額（ - ）	114,117,748,069円
発行済口数	63,877,500,670口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7865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	216,092,839,360円
負債総額	442,920,235円
純資産総額（ - ）	215,649,919,125円
発行済口数	85,964,841,786口
1口当たり純資産額（ / ）	2.5086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	27,881,969,549円
負債総額	58,571,471円
純資産総額（ - ）	27,823,398,078円
発行済口数	16,142,267,524口

1口当たり純資産額（ / ）	1.7236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	44,686,232,961円
負債総額	105,326,729円
純資産総額（ - ）	44,580,906,232円
発行済口数	30,662,781,103口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4539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	61,187,542,152円
負債総額	361,342,211円
純資産総額（ - ）	60,826,199,941円
発行済口数	41,909,262,440口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4514円

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】

< 更新後 >

(1) 資本金の額

2023年9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9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】

<更新後>

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9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	159	1,583,364
単位型株式投資信託	5	22,067
単位型公社債投資信託	10	19,150
合計	174	1,624,582

3【委託会社等の経理状況】

<更新後>

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

（1）【貸借対照表】

	（単位：千円）	
	前事業年度 （2022年3月31日）	当事業年度 （2023年3月31日）
資産の部		
流動資産		
預金	7,480,501	9,745,910
前払費用	270,287	323,722
未収入金	247	314
未収委託者報酬	972,599	948,037
未収運用受託報酬	3,009,122	2,750,484
未収投資助言報酬	507,363	479,787
流動資産計	12,240,121	14,248,255
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 8,415	11,556
器具備品	1 15,450	17,947
有形固定資産計	23,866	29,503
無形固定資産		

ソフトウェア	3,919	11,002
ソフトウェア仮勘定	3,100	-
無形固定資産計	7,019	11,002
投資その他の資産		
投資有価証券	37,596	60,103
繰延税金資産	118,572	117,863
投資その他の資産計	156,168	177,967
固定資産計	187,054	218,474
資産合計	12,427,176	14,466,729

(単位：千円)

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

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	4,788,765	4,696,038
運用受託報酬	5,438,177	5,142,361

投資助言報酬		982,472	952,145
営業収益計		11,209,415	10,790,545
営業費用			
支払手数料		1,460,131	1,210,415
広告宣伝費		49,322	68,988
調査費			
調査費		1,502,951	1,772,867
委託調査費		137,291	148,470
委託計算費		269,116	300,448
事務委託費		23,751	26,903
営業雑経費			
印刷費		95,519	114,901
協会費		12,887	13,978
販売促進費		2,277	836
その他		64,110	70,972
営業費用計		3,617,359	3,728,783
一般管理費			
給料			
役員報酬		127,995	124,995
給料・手当		1,260,284	1,361,136
賞与		169,303	192,845
賞与引当金繰入額		253,537	265,505
旅費交通費		6,944	20,681
租税公課		92,204	85,343
不動産賃借料		99,813	113,302
固定資産減価償却費		15,365	13,938
諸経費		270,995	267,977
一般管理費計		2,296,443	2,445,724
営業利益		5,295,612	4,616,037
営業外収益			
受取利息		-	5,137
受取配当金		506	64
投資有価証券売却益		866	564
雑収入		3,244	2,431
営業外収益計		4,617	8,198
営業外費用			
投資有価証券売却損		-	290
為替差損		170	64,517
雑損失		1,455	22
営業外費用計		1,625	64,829
経常利益		5,298,604	4,559,406
特別損失			
固定資産除去損		-	2,368
特別損失計		-	2,368
税引前当期純利益		5,298,604	4,557,038
法人税、住民税及び事業税	1	1,632,846	1,384,185
法人税等調整額		10,297	1,450
法人税等計		1,643,143	1,385,636
当期純利益		3,655,460	3,171,401

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本					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	40,455千円

2 関係会社に対する資産及び負債

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

(注) 当該金額は、連結納税親会社と受払いする金額であります。

（損益計算書関係）

1 関係会社に対する主な取引

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

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 配当に関する事項

該当事項はありません。

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 配当に関する事項

該当事項はありません。

（金融商品関係）

1 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

資金運用については、短期的な預金等に限定しております。

（2）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：千円）

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

（注）金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

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

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：千円）

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

（注）金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

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

3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：千円）

区分	時価			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
投資有価証券 投資信託	-	37,596	-	37,596
資産計	-	37,596	-	37,596

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：千円）

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

（有価証券関係）

1．その他有価証券

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：千円）

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

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：千円）

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

2．事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：千円）

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

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：千円）

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

（税効果会計関係）

1．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

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

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

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

（収益認識関係）

1．顧客との契約から生じる収益を分解した情報

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

2．収益を理解するための基礎となる情報

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

- 3．当事業年度及び翌事業年度以降の収益の金額を理解するための情報
重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（セグメント情報等）

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

1．セグメント情報

当社は、「資産運用業」の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2．関連情報

（1）製品及びサービスごとの情報

単一の商品・サービスの区分の外部顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

（2）地域ごとの情報

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。

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】

<訂正前>

(1) 受託会社

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

<再信託受託会社の概要>

名称 : 株式会社日本カストディ銀行

資本金の額 : 51,000百万円(2022年3月末現在)

事業の内容 : 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

再信託の目的 : 原信託契約にかかる信託業務の一部(信託財産の管理)を原信託受託者から再信託受託者(株式会社日本カストディ銀行)へ委託するため、原信託財産のすべてを再信託受託者へ移管することを目的とします。

(2) 販売会社

名 称	資本金の額 (2022年3月末現在)	事業の内容
株式会社りそな銀行	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。

<訂正後>

(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
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。

独立監査人の中間監査報告書

2023年11月30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

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているターゲットリターンバランスファンド（目標2%）の2023年3月17日から2023年9月16日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ターゲットリターンバランスファンド（目標2%）の2023年9月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年3月17日から2023年9月16日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、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、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論

付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、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。

- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

2023年11月30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

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているターゲットリターンバランスファンド（目標3%）の2023年3月17日から2023年9月16日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ターゲットリターンバランスファンド（目標3%）の2023年9月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年3月17日から2023年9月16日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、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、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論

付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、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。

- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

2023年11月30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

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているターゲットリターンバランスファンド（目標4%）の2023年3月17日から2023年9月16日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ターゲットリターンバランスファンド（目標4%）の2023年9月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年3月17日から2023年9月16日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、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、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論

付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、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。

- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

2023年11月30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

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているターゲットリターンバランスファンド（目標5%）の2023年3月17日から2023年9月16日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ターゲットリターンバランスファンド（目標5%）の2023年9月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年3月17日から2023年9月16日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、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、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論

付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、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。

- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

2023年11月30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

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているターゲットリターンバランスファンド（目標6%）の2023年3月17日から2023年9月16日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ターゲットリターンバランスファンド（目標6%）の2023年9月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年3月17日から2023年9月16日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、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、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論

付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、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。

- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。

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。