【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2024年3月19日提出
【計算期間】	第1期(自 2023年3月17日至 2023年12月20日)
【ファンド名】	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％）
【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
【連絡場所】	東京都江東区木場一丁目５番６５号
【電話番号】	03-6704-3821
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

①　ファンドの目的

＜ターゲットリターンバランスファンド（目標２％）＞
安定した収益の確保および信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。

＜ターゲットリターンバランスファンド（目標３％）＞
安定した収益の確保および慎重性を重視した信託財産の成長を目指して運用を行います。

＜ターゲットリターンバランスファンド（目標４％）＞
安定した収益の確保および慎重性と積極性のバランスを重視した信託財産の成長を目指して運用を行います。

＜ターゲットリターンバランスファンド（目標５％）＞
安定した収益の確保および積極性を重視した信託財産の成長を目指して運用を行います。

＜ターゲットリターンバランスファンド（目標６％）＞
安定した収益の確保および信託財産の積極的な成長を目指して運用を行います。

②　ファンドの基本的性格

１）商品分類

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

２）属性区分

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。
※属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替変動リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

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

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

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

＜属性区分の定義＞

1. 投資対象資産による属性区分
   (1)株式
   ①一般：次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。
   ②大型株：目論見書又は投資信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいう。
   ③中小型株：目論見書又は投資信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいう。
   (2)債券
   ①一般：次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。
   ②公債：目論見書又は投資信託約款において、日本国又は各国の政府の発行する国債(地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含む。以下同じ。)に主として投資する旨の記載があるものをいう。
   ③社債：目論見書又は投資信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいう。
   ④その他債券：目論見書又は投資信託約款において、公債又は社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいう。
   ⑤格付等クレジットによる属性：目論見書又は投資信託約款において、上記①から④の「発行体」による区分のほか、特にクレジットに対して明確な記載があるものについては、上記①から④に掲げる区分に加え「高格付債」「低格付債」等を併記することも可とする。
   (3)不動産投信
   これ以上の詳細な分類は行わないものとする。
   (4)その他資産
   組入れている資産を記載するものとする。
   (5)資産複合
   以下の小分類に該当する場合には当該小分類を併記することができる。
   ①資産配分固定型：目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。
   ②資産配分変更型：目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。
2. 決算頻度による属性区分
   ①年1回：目論見書又は投資信託約款において、年１回決算する旨の記載があるものをいう。
   ②年2回：目論見書又は投資信託約款において、年２回決算する旨の記載があるものをいう。
   ③年4回：目論見書又は投資信託約款において、年４回決算する旨の記載があるものをいう。
   ④年6回(隔月)：目論見書又は投資信託約款において、年６回決算する旨の記載があるものをいう。
   ⑤年12回(毎月)：目論見書又は投資信託約款において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるものをいう。
   ⑥日々：目論見書又は投資信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいう。
   ⑦その他：上記属性にあてはまらない全てのものをいう。
3. 投資対象地域による属性区分(重複使用可能)
   ①グローバル：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。
   ②日本：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
   ③北米：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
   ④欧州：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
   ⑤アジア：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
   ⑥オセアニア：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
   ⑦中南米：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
   ⑧アフリカ：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
   ⑨中近東(中東)：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
   ⑩エマージング：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域(新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
4. 投資形態による属性区分
   ①ファミリーファンド：目論見書又は投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいう。
   ②ファンド・オブ・ファンズ：「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいう。
5. 為替ヘッジによる属性区分
   ①為替ヘッジあり：目論見書又は投資信託約款において、為替のフルヘッジ又は一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいう。
   ②為替ヘッジなし：目論見書又は投資信託約款において、為替のヘッジを行なわない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。
6. インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分
   ①日経225
   ②TOPIX
   ③その他の指数：前記指数にあてはまらない全てのものをいう。
7. 特殊型
   ①ブル・ベア型：目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
   ②条件付運用型：目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
   ③ロング・ショート型／絶対収益追求型：目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨若しくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。
   ④その他型：目論見書又は投資信託約款において、上記①から③に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

※上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。また、商品分類および属性区分の定義は

一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」を基に委託会社が作成したものです。なお、一般社団法人投資信託協会のホームページ（https://www.toushin.or.jp/）でもご覧頂けます。

③　ファンドの特色

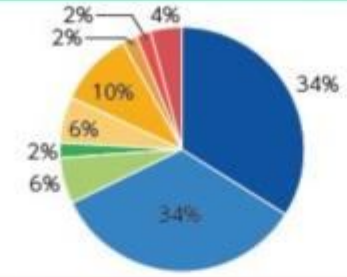
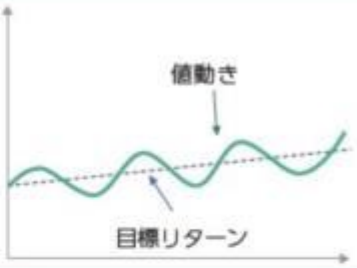
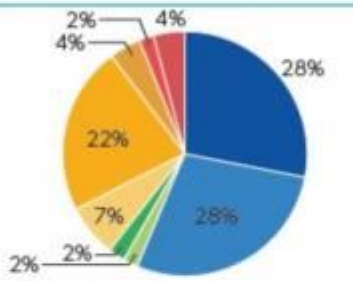
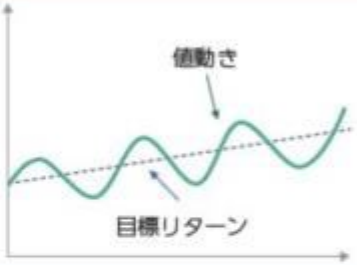
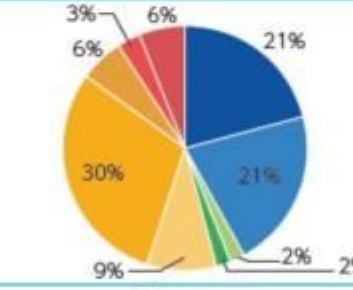
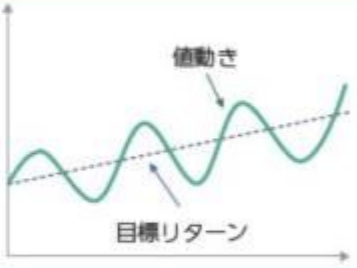
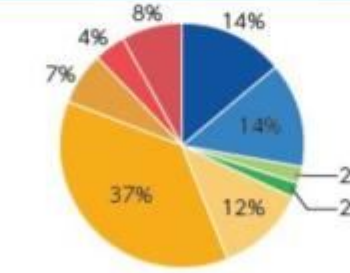
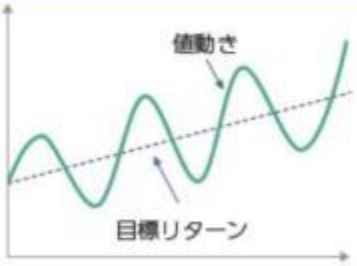
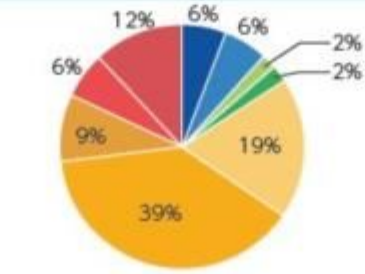
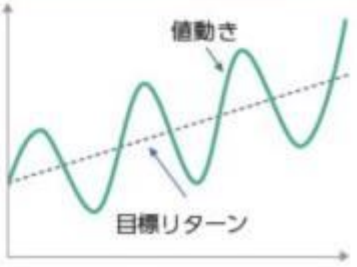
1 各マザーファンドを通じて、世界各国の債券、株式およびリートなどの資産に分散投資します。

● 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

マーケット・シナリオの作成

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

▼

基本的資産配分の算出（原則として年1回見直し）

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

▼

ポートフォリオ構築

基本的資産配分に基づき、ポートフォリオを構築

※上記の運用プロセスおよびイメージ図は、今後変更になる場合があります。

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。

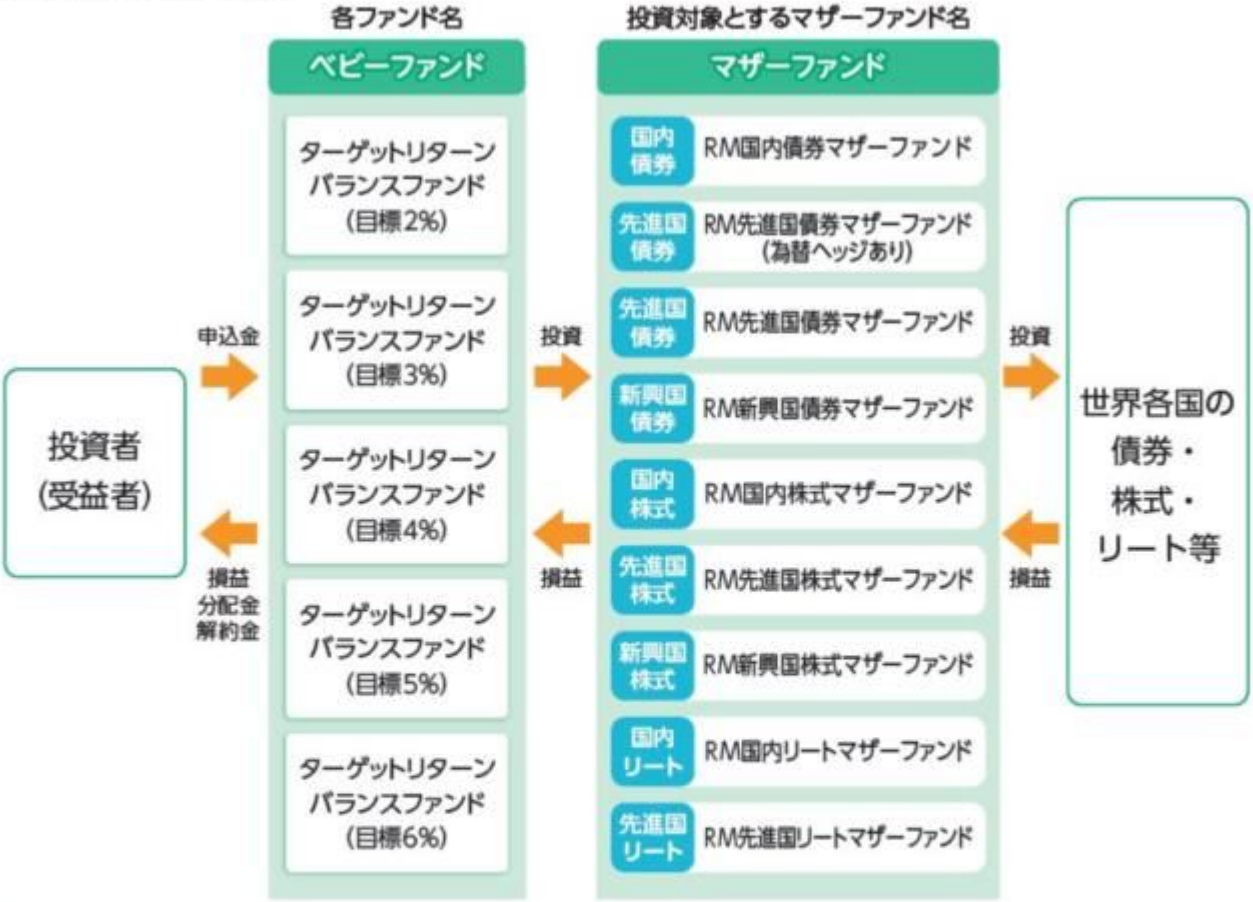
6 購入時手数料のないノーロード型のファンドです。

- 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留保益は、運用の基本方針に基づいて運用します。

★将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

各マザーファンドが対象とする指数の著作権等について

- **RM国内債券マザーファンド**

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

- **RM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にした指数であり、指数に関する著作権はJ.P.Morgan Securities LLCに帰属します。

- **RM国内株式マザーファンド**

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

- **RM新興国株式マザーファンド**

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

- **RM国内リートマザーファンド**

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

- **RM先進国リートマザーファンド**

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

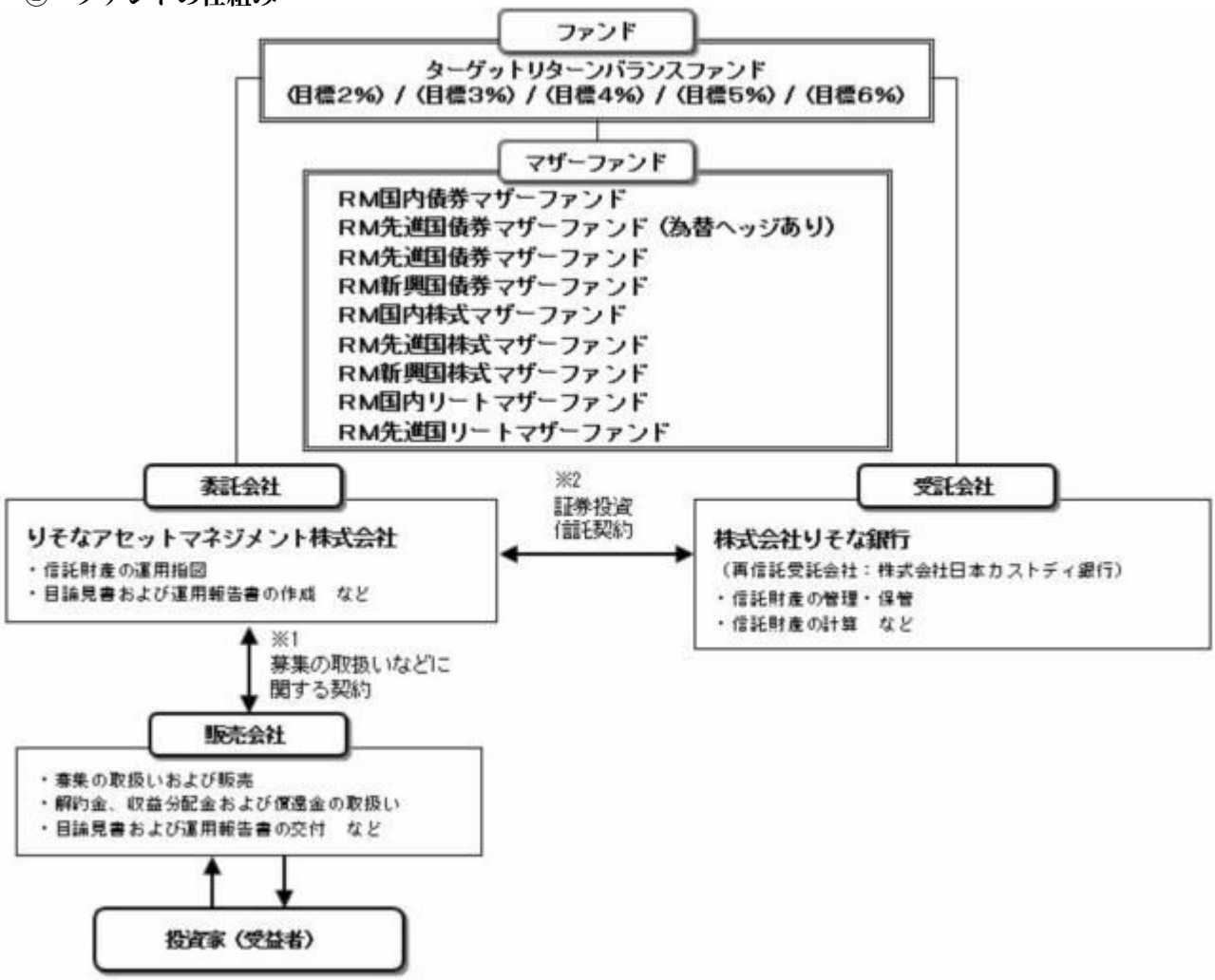
④　信託金限度額
・各ファンド、1兆円を限度として信託金を追加することができます。
・委託会社は受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

（２）【ファンドの沿革】

2023年3月17日
・ファンドの信託契約締結、当初自己設定、運用開始

（３）【ファンドの仕組み】

①　ファンドの仕組み



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

②　委託会社の概況（2023年12月末現在）

１）資本金
1,000百万円

２）沿革
2015年8月3日：　りそなアセットマネジメント株式会社設立
2020年1月1日：　株式会社りそな銀行の資産運用事業に関する権利義務の一部を承継

３）大株主の状況

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

2【投資方針】

（１）【投資方針】

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（以下、各々を「マザーファンド」といいます。）の各受益証券を主要投資対象とします。

①　主として、各マザーファンド受益証券への投資を通じ、実質的に国内、先進国および新興国の債券・株式ならびに国内および先進国の不動産投資信託証券（リート）等への分散投資を行います。また、債券先物取引、株価指数先物取引、不動産投信指数先物取引、ＥＴＦ（上場投資信託証券）等を利用することがあります。

② 各マザーファンドは、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）

③ 各マザーファンド受益証券への投資比率は、中長期的な目標リターンを目指して、独自の定量モデルにて算出した基本的資産配分に基づき決定します。
なお、各ファンドにおける目標リターンは以下の通りです。

ファンド	目標リターン
ターゲットリターンバランスファンド（目標２％）	円短期金利[*1]＋2%[*2]（年率）
ターゲットリターンバランスファンド（目標３％）	円短期金利[*1]＋3%[*2]（年率）
ターゲットリターンバランスファンド（目標４％）	円短期金利[*1]＋4%[*2]（年率）
ターゲットリターンバランスファンド（目標５％）	円短期金利[*1]＋5%[*2]（年率）
ターゲットリターンバランスファンド（目標６％）	円短期金利[*1]＋6%[*2]（年率）

＊1　無担保コールＯ／Ｎ物レート（確報）です。
＊2　信託報酬控除後のものです。その他の費用については考慮しておりません。

④ 基本的資産配分は、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については、一部為替ヘッジを行います。
⑥ 各マザーファンド受益証券への投資比率の合計は、原則として高位を保ちます。
⑦ 資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。

（２）【投資対象】

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

② 有価証券の指図範囲
委託者は、信託金を、主として、各マザーファンドの受益証券、ならびに次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。
１）株券または新株引受権証書
２）国債証券
３）地方債証券
４）特別の法律により法人の発行する債券
５）社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
６）特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
７）特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
８）協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
９）特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条

第1項第8号で定めるものをいいます。）
10）コマーシャル・ペーパー
11）新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
12）外国または外国の者の発行する証券または証書で、1）から11）までの証券または証書の性質を有するもの
13）投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
14）投資証券、新投資口予約権証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
15）外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
16）オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。）
17）預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
18）外国法人が発行する譲渡性預金証書
19）受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）
20）抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
21）外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって19）の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

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

③　金融商品の指図範囲

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

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

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

④　その他の投資対象と指図範囲

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

《参考情報》
◆投資対象とするマザーファンドの概要
＜RM国内債券マザーファンド＞

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	次の有価証券を主要投資対象とします。 ・ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合に採用されている国内の債券
投資方針	①　主として、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合に採用されている国内の債券に投資し、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合への連動性を高めるため、国内債券を対象とした債券先物取引を活用することがあります。 ②　債券の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。 ③　資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。

主な投資制限	① 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限ります。 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ② 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③ 外貨建資産への投資は、行いません。 ④ デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。 ⑤ 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ⑥ 一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
決算日	毎年1月25日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

＜ＲＭ先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）＞

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
主な投資対象	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）に採用されている先進国の債券を主要投資対象とします。
投資方針	① 主として、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）に採用されている先進国の債券に投資し、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）への連動性を高めるため、先進国債券の指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）または海外の債券先物取引を活用することがあります。 ② 債券またはＥＴＦ（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。 ③ 外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行います。 ④ 資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。

主な投資制限	① 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限ります。 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ② 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ④ デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。 ⑤ 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ⑥ 一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
決算日	毎年12月10日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

＜ＲＭ先進国債券マザーファンド＞

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	次の有価証券を主要投資対象とします。 ・FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に採用されている先進国の債券
投資方針	① 主として、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に採用されている先進国の債券に投資し、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）への連動性を高めるため、先進国債券の指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）または海外の債券先物取引を活用することがあります。 ② 債券またはＥＴＦ（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。 ③ 為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。 ④ 資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。

主な投資制限	①　株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限ります。 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ②　投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ④　デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。 ⑤　一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ⑥　一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
決算日	毎年1月25日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

＜RM新興国債券マザーファンド＞

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、ＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	次の有価証券を主要投資対象とします。 ・ＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）に採用されている新興国の債券 ・新興国債券の指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）
投資方針	①　主として、ＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）に採用されている新興国の現地通貨建て債券または新興国債券の指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）に投資し、ＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、ＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の債券先物取引を活用することがあります。 ②　債券またはＥＴＦ（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。 ③　為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。 ④　資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。

主な投資制限	① 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限ります。 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ② 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ④ デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。 ⑤ 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ⑥ 一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
決算日	毎年1月25日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

＜RM国内株式マザーファンド＞

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

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

＜RM先進国株式マザーファンド＞

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

＜ＲＭ新興国株式マザーファンド＞

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

＜ＲＭ国内リートマザーファンド＞

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	次の有価証券を主要投資対象とします。 ・東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）に採用されている不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に規定する不動産投資信託証券をいいます。）

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

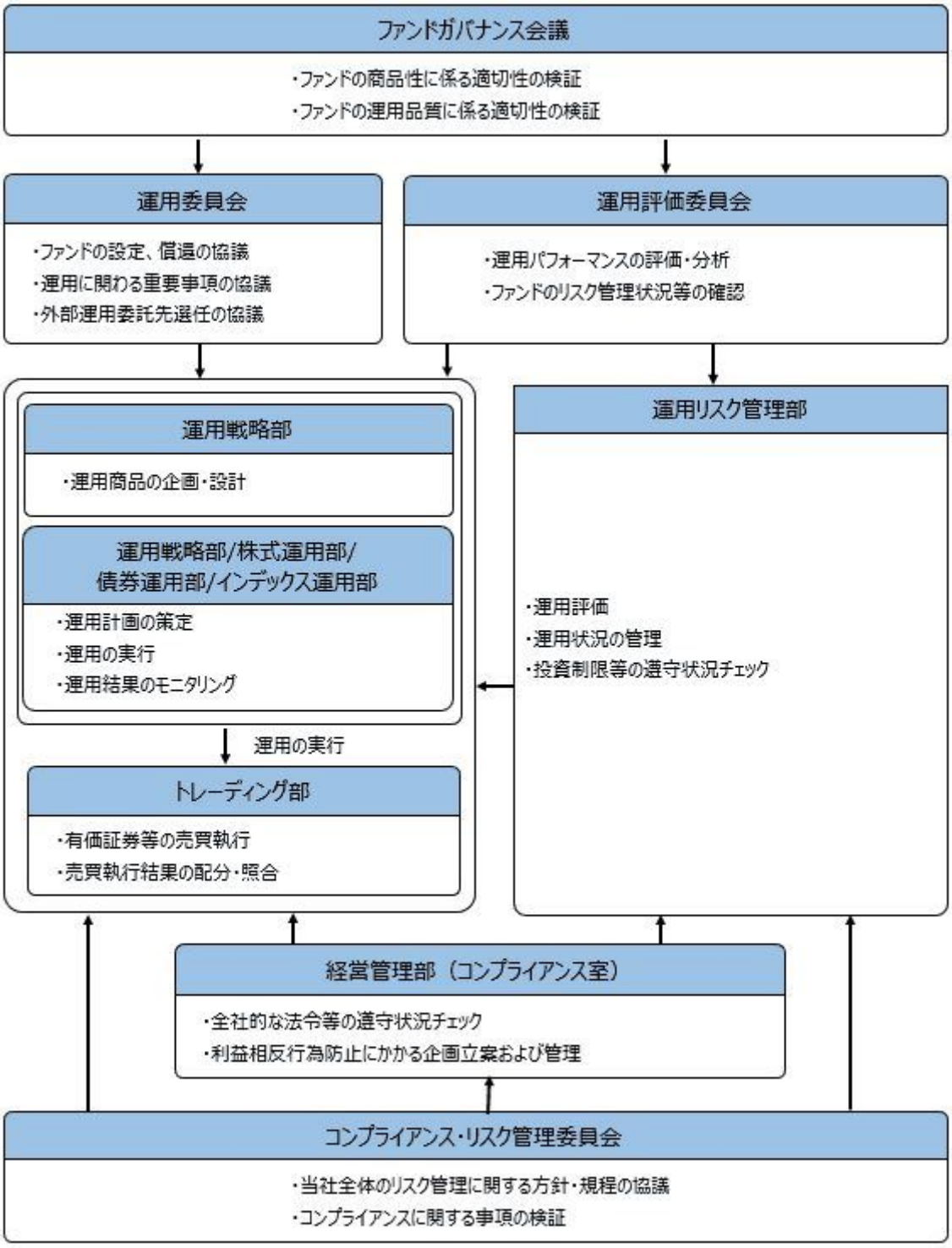
＜RM先進国リートマザーファンド＞

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	次の有価証券を主要投資対象とします。 ・先進国（除く日本）の金融商品取引所に上場（上場予定を含みます。）されているまたは店頭登録されている（登録予定を含みます。）不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に規定する不動産投資信託証券をいいます。） ・先進国（除く日本）の金融商品取引所に上場（上場予定を含みます。）されているまたは店頭登録されている（登録予定を含みます。）不動産関連株式 ・先進国の不動産投資信託証券に関する指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）
投資方針	①　主として、先進国の不動産投資信託証券および不動産関連株式または先進国の不動産投資信託証券に関する指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）に投資し、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の金融商品取引市場に上場する指数先物取引を活用することがあります。 ②　不動産投資信託証券またはＥＴＦ（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。 ③　為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。 ④　資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。

主な投資制限	①　不動産投資信託証券および株式への投資割合には、制限を設けません。 ②　新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ③　投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ④　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ⑤　デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。 ⑥　一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ⑦　一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
決算日	毎年1月25日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

（３）【運用体制】

①　ファンドの運用体制は以下のとおりです。



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

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

③ ファンドの関係法人に対する管理体制
委託会社は、受託会社または再信託受託会社に対して、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行っています。また、外部監査法人による内部統制の整備および運用状況の報告書を受託会社より受け取っております。

※上記の運用体制は、2023年12月末現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

（４）【分配方針】

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

② 収益分配金の支払い
原則として、収益分配金は税金を差し引いた後、無手数料で自動的に再投資されます。

（５）【投資制限】

① 約款に定める投資制限
１）株式への実質投資割合には、制限を設けません。
２）新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20％以下とします。
３）投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5％以下とします。
４）外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
５）デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。
６）一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
７）一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10％、合計で20％を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
８）投資する株式等の範囲
１．委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
２．前記１．の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとします。
９）信用取引の指図範囲
１．委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
２．前記１．の信用取引の指図は、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
イ）信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券
ロ）株式分割により取得する株券
ハ）有償増資により取得する株券
ニ）売出しにより取得する株券
ホ）信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使により取得可能な株券
へ）信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（ホ）に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券
10）先物取引等の運用指図
１．委託者は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。
２．委託者は、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。
３．委託者は、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。
11）スワップ取引の運用指図
１．委託者は、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。
２．スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として、信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
３．スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。
４．委託者は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
12）金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図
１．委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

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

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

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

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

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

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

② 法令による投資制限
同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律）
同一法人の発行する株式について、委託会社が運用の指図を行なう投資信託全体で、当該株式の議決権の過半数を保有することとなる取引は行ないません。

3【投資リスク】

（1）ファンドのリスク

当ファンドの基準価額は、実質的に組み入れている有価証券等の値動きにより影響を受けますが、運用により信託財産に生じた損益はすべて投資者のみなさまに帰属します。
したがって、投資者のみなさまの投資元本が保証されているものではなく、基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。また、投資信託は預貯金と異なります。
当ファンドの基準価額の変動要因として、主に以下のリスクがあります。このため、お申込みの際は、当ファンドのリスクを認識・検討し、慎重にご判断くださいますようお願いします。

① 市場リスク
・株価変動リスク
株価は、政治・経済情勢、発行企業の業績・財務状況、市場の需給、それらに関する外部評価の変化等を反映して変動します。株価が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。
・金利（債券価格）変動リスク
金利（債券価格）は、金融・財政政策、市場の需給、それらに関する外部評価の変化等を反映して変動します。債券価格は、一般に金利が上昇（低下）した場合は値下がり（値上がり）します。債券価格が値下がりした場合は、基準価額の下落要因となります。
・リートの価格変動リスク
リートの価格は、不動産市況（不動産価格、賃貸料等）、金利・景気動向、社会情勢の変化、関係法令・各種規制等の変更、災害等の要因により変動します。リートの価格および分配金がその影響

を受け下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

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

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

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

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

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

※基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

（その他の留意点）
①「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。
②ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリングオフ）の適用はありません。
③当ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行います。そのため、当ファンドと同じマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドの追加設定・解約により資金の流出入が生じた場合、その結果として、当該マザーファンドにおいても組入有価証券の売買等が生じ、当ファンドの基準価額に影響をおよぼすことがあります。
④当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要が生じた場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響をおよぼす可能性や、換金のお申込みの受付けが中止となる可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性があります。
⑤分配金はファンドの純資産から支払われますので、分配金支払い後は純資産が減少し、基準価額が下落する要因となります。収益分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益の水準を示すものではありません。収益分配は、計算期間に生じた収益を超えて行われる場合があります。投資者の購入価額によっては、収益分配金の一部または全部が、実質的な元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。
⑥ファンドは、預金や保険契約ではなく、預金保険機構、保険契約者保護機構の対象ではありません。また、登録金融機関で取扱う場合、投資者保護基金の補償対象ではありません。

（２）リスク管理体制
○委託会社における投資リスクに対する管理体制
①運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス評価を実施するとともに、流動性リスクを含む運用リスクの状況、法令・主な投資制限等の遵守状況および運用事務状況をモニタリングし、定期的に運用評価委員会に報告します。
②運用評価委員会は、運用実績、流動性リスクを含む運用リスクの状況、主な投資制限等の遵守状況および運用事務状況等を確認することを通じ、信託財産の適切な運用に寄与することを目的に運用部門に対する管理・指導、改善提案等を行います。なお、流動性リスクについては、緊急時対応策の有効性検証結果や流動性リスク管理プロセスの見直し結果についても確認を行います。
運用リスクを管理する部門は、運用業務等に係る情報のうち、経営に重要な影響を与えるまたは受益者の利益が著しく阻害される一切の事案についてはすみやかに、また法令・主な投資制限等の遵守状況については定期的に取締役会等に報告します。

※上記体制は2023年12月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

〔参考情報〕

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

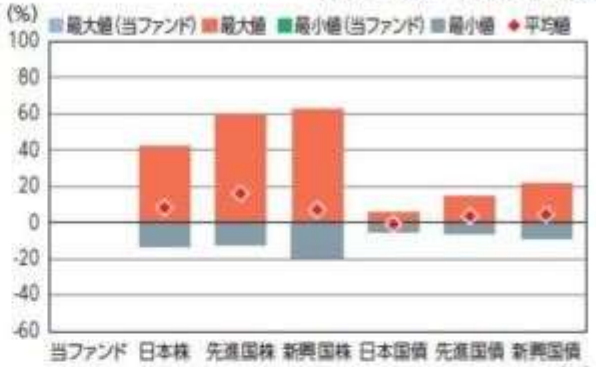
2019年1月末～2023年12月末

＊分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
＊年間騰落率は、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。

2019年1月末～2023年12月末



(%)

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	―	42.1	59.8	62.7	5.4	14.3	21.5
最小値	―	△12.8	△12.4	△19.4	△5.5	△6.1	△8.8
平均値	―	8.4	16.2	7.2	△0.7	3.6	4.8

＊全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
＊2019年1月から2023年12月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
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。

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

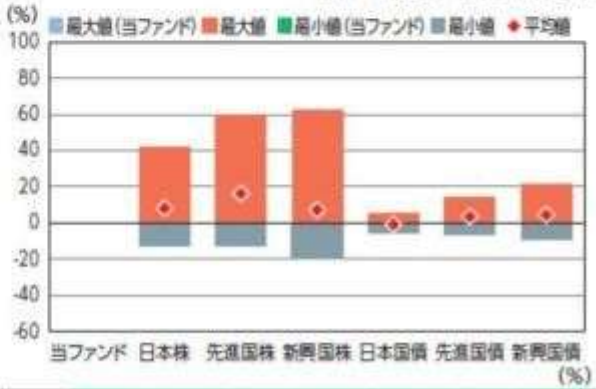
2019年1月末～2023年12月末

＊分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
＊年間騰落率は、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。

2019年1月末～2023年12月末



(%)

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	―	42.1	59.8	62.7	5.4	14.3	21.5
最小値	―	△12.8	△12.4	△19.4	△5.5	△6.1	△8.8
平均値	―	8.4	16.2	7.2	△0.7	3.6	4.8

＊全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
＊2019年1月から2023年12月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
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。

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

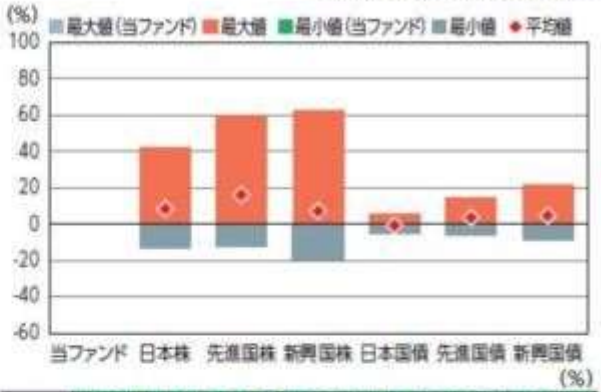
2019年1月末～2023年12月末

＊分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
＊年間騰落率は、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。

2019年1月末～2023年12月末



(%)

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	—	42.1	59.8	62.7	5.4	14.3	21.5
最小値	—	△12.8	△12.4	△19.4	△5.5	△6.1	△8.8
平均値	—	8.4	16.2	7.2	△0.7	3.6	4.8

＊全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
＊2019年1月から2023年12月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
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。

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

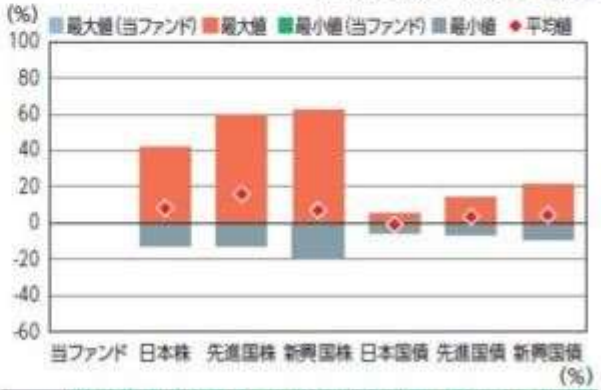
2019年1月末～2023年12月末

＊分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
＊年間騰落率は、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。

2019年1月末～2023年12月末



(%)

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	—	42.1	59.8	62.7	5.4	14.3	21.5
最小値	—	△12.8	△12.4	△19.4	△5.5	△6.1	△8.8
平均値	—	8.4	16.2	7.2	△0.7	3.6	4.8

＊全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
＊2019年1月から2023年12月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
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。

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

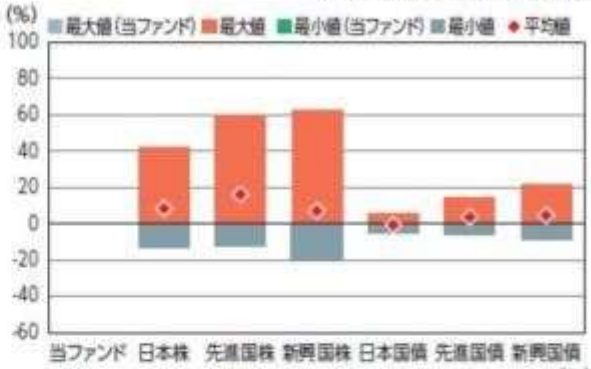
2019年1月末～2023年12月末

＊分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
＊年間騰落率は、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。

2019年1月末～2023年12月末



(%)

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	—	42.1	59.8	62.7	5.4	14.3	21.5
最小値	—	△12.8	△12.4	△19.4	△5.5	△6.1	△8.8
平均値	—	8.4	16.2	7.2	△0.7	3.6	4.8

＊全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
＊2019年1月から2023年12月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
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・・・NOMURA-BPI国債
先進国債・・・FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
新興国債・・・JPモルガンGBI－EMグローバル・ダイバーシファイド(円ベース)
(注)海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

○代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

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

東証株価指数(TOPIX、配当込み)

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

MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み、円ベース)

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

MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)

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

NOMURA-BPI国債

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

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

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

JPモルガンGBI－EMグローバル・ダイバーシファイド(円ベース)

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

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

ありません。

（2）【換金（解約）手数料】

① 換金手数料
ありません。
② 信託財産留保額
ありません。

（３）【信託報酬等】

① 信託報酬
信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、各ファンドの信託財産の純資産総額に対し年0.77％（税抜0.7％）の率を乗じて得た額とします。

② 信託報酬の配分
信託報酬の配分（年率）は、以下の通りとします。

信託報酬＝日々の純資産総額×信託報酬率		
委託会社	販売会社	受託会社
0.27％	0.40％	0.03％

※表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

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

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

（４）【その他の手数料等】

① 監査法人に支払うファンドの監査費用および当該監査費用にかかる消費税等に相当する金額は、計算期間を通じて日々計上され毎計算期間の最初の６ヵ月終了日（当該終了日が休業日の場合は翌営業日）、および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支払われます。
② 有価証券等の売買の際に発生する売買委託手数料、先物取引・オプション取引等に要する費用は証券会社等に信託財産中から都度支払われます。また、外貨建資産の保管等に要する費用は海外の保管機関に信託財産中から都度支払われます。（消費税等相当額を含みます。）
③ 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、信託財産中から都度支払われます。信託財産において資金借入れを行った場合、当該借入金の利息は信託財産中から都度支払われます。
④ 信託財産に属する有価証券等に関連して発生した訴訟係争物たる権利その他の権利に基づいて益金が生じた場合、当該支払いに際して特別に必要となる費用（データ処理費用、郵送料等）は、受益者の負担とし、当該益金から支払われます。
⑤ その他諸費用（法律・税務顧問への報酬、法定書類の作成・印刷・交付費用、公告費用等）および当該諸費用にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁することができます（現在、その他諸費用として受益者負担項目はありません。）。

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

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。
・公募株式投資信託は税法上、一定の要件を満たした場合に少額投資非課税制度（NISA）の適用対象となります。
・当ファンドは、NISAの「成長投資枠（特定非課税管理勘定）」および「つみたて投資枠（特定累積投資勘定）」の対象ですが、販売会社により取扱いが異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

① 個人受益者の場合
１）収益分配金に対する課税
収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については配当所得として、20.315％（所得税15.315％および地方税５％）の税率による源泉徴収（原則として、確定申告は不要です。）が行なわれます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用はありません。）のいずれかを選択することもできます。
２）解約金および償還金に対する課税
解約時および償還時の差益（譲渡益）*については譲渡所得として、20.315％（所得税15.315％および地方税５％）の税率による申告分離課税の対象となり、確定申告が必要となります。なお、源泉徴収ありの特定口座（源泉徴収選択口座）を選択している場合は、20.315％（所得税15.315％および地方税５％）の税率による源泉徴収（原則として、確定申告は不要です。）が行なわれます。
＊解約価額および償還価額から取得費用（申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額を含みます。）を控除した利益
※確定申告等により、解約時および償還時の差損（譲渡損失）については、上場株式等の譲渡益、上場

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

※少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合
NISAは、少額上場株式等に関する非課税制度です。
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し、税法上の要件を満たした商品を購入するなど、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。

② 法人受益者の場合

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

２）益金不算入制度の適用
益金不算入制度は適用されません。

※買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

③ 個別元本

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

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

④ 普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

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

２）受益者が収益分配金を受け取る際

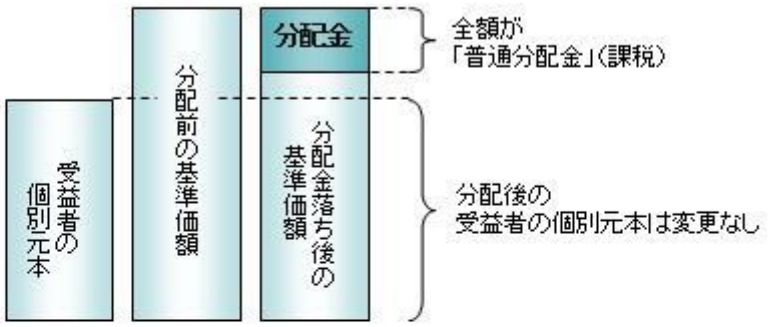
イ）収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の１口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

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

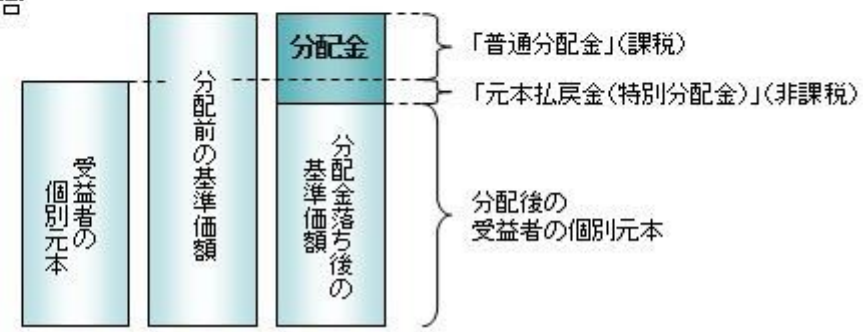
ハ）収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

＜分配金に関するイメージ図＞

イ）の場合



ロ）、ハ）の場合



※外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。
※上記は2024年1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。

〔参考情報〕ファンドの総経費率

	総経費率(①+②)	① 運用管理費用の比率	② その他費用の比率
目標2%	0.81%	0.77%	0.04%
目標3%	0.81%	0.77%	0.04%
目標4%	0.82%	0.77%	0.05%
目標5%	0.82%	0.77%	0.05%
目標6%	0.83%	0.77%	0.06%

※対象期間は2023年3月17日～2023年12月20日です。
※対象期間中の運用・管理にかかった費用の額(原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。)を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口あたり)を乗じた数で除した値(年率)です。
※その他費用とは監査費用や有価証券の保管費用等です。
※詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

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12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	21,280,734	99.82
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	―	39,246	0.18
合計（純資産総額）		21,319,980	100.00

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	RM先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	8,345,614	0.8656	7,224,143	0.8691	7,253,173	34.02
日本	親投資信託受益証券	RM国内債券マザーファンド	7,210,653	1.0086	7,273,178	1.0012	7,219,305	33.86
日本	親投資信託受益証券	RM先進国株式マザーファンド	800,125	2.6849	2,148,271	2.6616	2,129,612	9.99
日本	親投資信託受益証券	RM国内株式マザーファンド	705,310	1.8063	1,274,051	1.8226	1,285,498	6.03
日本	親投資信託受益証券	RM先進国債券マザーファンド	1,052,616	1.2136	1,277,514	1.2069	1,270,402	5.96
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	526,413	1.6224	854,101	1.6308	858,474	4.03
日本	親投資信託受益証券	RM新興国株式マザーファンド	239,713	1.7571	421,220	1.7729	424,987	1.99
日本	親投資信託受益証券	RM国内リートマザーファンド	295,867	1.4138	418,320	1.4279	422,468	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	313,442	1.3421	420,682	1.3298	416,815	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	99.82
合　　計	99.82

②【投資不動産物件】
該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】
該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第1計算期間末　(2023年12月20日)	20	20	1.0501	1.0501
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	―
10月末日	8	―	0.9973	―
11月末日	11	―	1.0331	―
12月末日	21	―	1.0482	―

②【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2023年 3月17日～2023年12月20日	0.0000

③【収益率の推移】

期	期間	収益率（%）
第1期	2023年 3月17日～2023年12月20日	5.01

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

（４）【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	2023年 3月17日～2023年12月20日	20,527,807	1,059,394

(注)第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

【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12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	10,956,374	99.72
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	―	31,102	0.28
合計（純資産総額）		10,987,476	100.00

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	RM先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	3,606,128	0.8655	3,121,104	0.8691	3,134,085	28.52
日本	親投資信託受益証券	RM国内債券マザーファンド	3,110,991	1.0087	3,138,057	1.0012	3,114,724	28.35
日本	親投資信託受益証券	RM先進国株式マザーファンド	910,066	2.6863	2,444,728	2.6616	2,422,231	22.05
日本	親投資信託受益証券	RM国内株式マザーファンド	436,288	1.8067	788,283	1.8226	795,178	7.24
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	269,471	1.6233	437,453	1.6308	439,453	4.00
日本	親投資信託受益証券	RM新興国株式マザーファンド	226,296	1.7577	397,761	1.7729	401,200	3.65
日本	親投資信託受益証券	RM国内リートマザーファンド	153,361	1.4143	216,900	1.4279	218,984	1.99
日本	親投資信託受益証券	RM先進国債券マザーファンド	178,675	1.2137	216,874	1.2069	215,642	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	161,586	1.3423	216,911	1.3298	214,877	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	99.72
合　　計	99.72

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第1計算期間末　(2023年12月20日)	10	10	1.0858	1.0858
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	―
10月末日	5	―	1.0235	―
11月末日	6	―	1.0672	―
12月末日	10	―	1.0833	―

②【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2023年 3月17日～2023年12月20日	0.0000

③【収益率の推移】

期	期間	収益率（%）
第1期	2023年 3月17日～2023年12月20日	8.58

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

（４）【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	2023年 3月17日～2023年12月20日	10,772,079	992,917

(注)第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

【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12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	41,460,810	99.70
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	―	122,887	0.30
合計（純資産総額）		41,583,697	100.00

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	RM先進国株式マザーファンド	4,676,973	2.6846	12,555,942	2.6616	12,448,231	29.94
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）	10,035,842	0.8657	8,688,320	0.8691	8,722,150	20.97
日本	親投資信託受益証券	RM国内債券マザーファンド	8,669,639	1.0085	8,744,025	1.0012	8,680,042	20.87
日本	親投資信託受益証券	RM国内株式マザーファンド	2,084,206	1.8064	3,765,065	1.8226	3,798,673	9.14

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	1,555,730	1.6224	2,524,112	1.6308	2,537,084	6.10
日本	親投資信託受益証券	RM新興国株式マザーファンド	1,335,325	1.7570	2,346,174	1.7729	2,367,397	5.69
日本	親投資信託受益証券	RM国内リートマザーファンド	894,252	1.4139	1,264,454	1.4279	1,276,902	3.07
日本	親投資信託受益証券	RM新興国債券マザーファンド	613,022	1.3419	822,664	1.3298	815,196	1.96
日本	親投資信託受益証券	RM先進国債券マザーファンド	675,396	1.2136	819,690	1.2069	815,135	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

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第1計算期間末　(2023年12月20日)	39	39	1.1232	1.1232
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	—
10月末日	20	—	1.0513	—
11月末日	28	—	1.1034	—
12月末日	41	—	1.1207	—

②【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2023年 3月17日～2023年12月20日	0.0000

③【収益率の推移】

期	期間	収益率（%）
第1期	2023年 3月17日～2023年12月20日	12.32

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

（４）【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	2023年 3月17日～2023年12月20日	35,642,710	669,744

(注)第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

【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12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	16,289,044	99.71
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	―	47,996	0.29
合計（純資産総額）		16,337,040	100.00

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	RM先進国株式マザーファンド	2,271,956	2.6847	6,099,537	2.6616	6,047,038	37.01
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）	2,536,947	0.8656	2,196,200	0.8691	2,204,860	13.50
日本	親投資信託受益証券	RM国内債券マザーファンド	2,191,470	1.0085	2,210,177	1.0012	2,194,099	13.43
日本	親投資信託受益証券	RM国内株式マザーファンド	1,090,455	1.8064	1,969,809	1.8226	1,987,463	12.17
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	810,730	1.6223	1,315,266	1.6308	1,322,138	8.09
日本	親投資信託受益証券	RM新興国株式マザーファンド	694,254	1.7570	1,219,815	1.7729	1,230,842	7.53
日本	親投資信託受益証券	RM国内リートマザーファンド	465,731	1.4139	658,525	1.4279	665,017	4.07
日本	親投資信託受益証券	RM先進国債券マザーファンド	264,157	1.2135	320,566	1.2069	318,811	1.95
日本	親投資信託受益証券	RM新興国債券マザーファンド	239,718	1.3419	321,685	1.3298	318,776	1.95

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.71
合　　計	99.71

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第1計算期間末　(2023年12月20日)	15	15	1.1594	1.1594
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	―
10月末日	9	―	1.0784	―
11月末日	12	―	1.1390	―
12月末日	16	―	1.1571	―

②【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2023年 3月17日～2023年12月20日	0.0000

③【収益率の推移】

期	期間	収益率（%）
第1期	2023年 3月17日～2023年12月20日	15.94

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

（４）【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	2023年 3月17日～2023年12月20日	14,179,324	762,588

(注)第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

【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12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	31,749,296	99.71
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	―	91,968	0.29
合計（純資産総額）		31,841,264	100.00

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	RM先進国株式マザーファンド	4,669,282	2.6846	12,535,155	2.6616	12,427,760	39.03
日本	親投資信託受益証券	RM国内株式マザーファンド	3,233,109	1.8062	5,839,642	1.8226	5,892,664	18.51
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	2,417,556	1.6226	3,922,727	1.6308	3,942,550	12.38
日本	親投資信託受益証券	RM新興国株式マザーファンド	1,580,168	1.7570	2,776,388	1.7729	2,801,479	8.80
日本	親投資信託受益証券	RM国内リートマザーファンド	1,378,266	1.4137	1,948,478	1.4279	1,968,026	6.18
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）	2,003,936	0.8656	1,734,687	0.8691	1,741,620	5.47
日本	親投資信託受益証券	RM国内債券マザーファンド	1,727,866	1.0086	1,742,822	1.0012	1,729,939	5.43
日本	親投資信託受益証券	RM先進国債券マザーファンド	516,299	1.2136	626,594	1.2069	623,121	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	467,843	1.3419	627,841	1.3298	622,137	1.95

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	99.71
合　　計	99.71

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（3）【運用実績】

①【純資産の推移】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第1計算期間末　(2023年12月20日)	30	30	1.1952	1.1952
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	—
10月末日	14	—	1.1052	—
11月末日	22	—	1.1746	—
12月末日	31	—	1.1941	—

②【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）

第1期	2023年 3月17日～2023年12月20日	0.0000

③【収益率の推移】

期	期間	収益率（%）
第1期	2023年 3月17日～2023年12月20日	19.52

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

（４）【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	2023年 3月17日～2023年12月20日	26,356,514	855,592

(注)第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

（参考）

ＲＭ国内債券マザーファンド
以下の運用状況は2023年12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	172,815,009,880	85.05
地方債証券	日本	10,002,498,445	4.92
特殊債券	日本	10,599,165,779	5.22
社債券	日本	7,792,091,000	3.83
	フランス	399,047,000	0.20
	小計	8,191,138,000	4.03
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	―	1,596,029,714	0.79
合計（純資産総額）		203,203,841,818	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１４７回利付国債（５年）	3,320,000,000	99.97	3,319,058,800	99.94	3,318,140,800	0.005	2026/3/20	1.63
日本	国債証券	第４４７回利付国債（２年）	3,220,000,000	100.03	3,221,004,600	100.03	3,220,966,000	0.005	2025/4/1	1.59
日本	国債証券	第１５８回利付国債（５年）	2,740,000,000	99.67	2,730,971,900	99.74	2,733,122,600	0.100	2028/3/20	1.35
日本	国債証券	第１５３回利付国債（５年）	2,510,000,000	99.60	2,500,060,900	99.72	2,503,072,400	0.005	2027/6/20	1.23
日本	国債証券	第３６６回日本国債（１０年）	2,540,000,000	97.67	2,480,991,000	97.67	2,480,894,200	0.200	2032/3/20	1.22
日本	国債証券	第１４６回利付国債（５年）	2,430,000,000	100.23	2,435,718,700	100.15	2,433,790,800	0.100	2025/12/20	1.20
日本	国債証券	第４５０回利付国債（２年）	2,430,000,000	99.97	2,429,501,800	100.00	2,430,170,100	0.005	2025/7/1	1.20

日本	国債証券	第１４８回利付国債（５年）	2,410,000,000	99.90	2,407,665,100	99.92	2,408,216,600	0.005	2026/6/20	1.19
日本	国債証券	第１５０回利付国債（５年）	2,370,000,000	99.80	2,365,432,300	99.85	2,366,492,400	0.005	2026/12/20	1.16
日本	国債証券	第３５９回利付国債（１０年）	2,370,000,000	98.30	2,329,885,800	98.70	2,339,213,700	0.100	2030/6/20	1.15
日本	国債証券	第１４９回利付国債（５年）	2,290,000,000	99.85	2,286,778,000	99.89	2,287,503,900	0.005	2026/9/20	1.13
日本	国債証券	第３６０回利付国債（１０年）	2,310,000,000	97.70	2,257,013,300	98.49	2,275,119,000	0.100	2030/9/20	1.12
日本	国債証券	第３６７回日本国債（１０年）	2,290,000,000	97.21	2,226,251,700	97.40	2,230,620,300	0.200	2032/6/20	1.10
日本	国債証券	第１５６回利付国債（５年）	2,200,000,000	100.12	2,202,854,700	100.27	2,206,050,000	0.200	2027/12/20	1.09
日本	国債証券	第３６４回利付国債（１０年）	2,220,000,000	96.81	2,149,202,900	97.39	2,162,102,400	0.100	2031/9/20	1.06
日本	国債証券	第１５２回利付国債（５年）	2,130,000,000	100.04	2,130,852,400	100.11	2,132,364,300	0.100	2027/3/20	1.05
日本	国債証券	第３５６回利付国債（１０年）	1,970,000,000	98.65	1,943,520,700	99.15	1,953,353,500	0.100	2029/9/20	0.96
日本	国債証券	第３６１回利付国債（１０年）	1,980,000,000	97.65	1,933,648,400	98.23	1,945,033,200	0.100	2030/12/20	0.96
日本	国債証券	第３５３回利付国債（１０年）	1,950,000,000	99.18	1,934,021,600	99.38	1,938,027,000	0.100	2028/12/20	0.95
日本	国債証券	第３６２回利付国債（１０年）	1,950,000,000	97.24	1,896,343,700	97.96	1,910,356,500	0.100	2031/3/20	0.94
日本	国債証券	第３５７回利付国債（１０年）	1,890,000,000	98.52	1,862,110,000	99.03	1,871,704,800	0.100	2029/12/20	0.92
日本	国債証券	第３６３回利付国債（１０年）	1,890,000,000	97.11	1,835,406,200	97.68	1,846,265,400	0.100	2031/6/20	0.91
日本	国債証券	第３６８回日本国債（１０年）	1,890,000,000	98.05	1,853,253,200	97.13	1,835,775,900	0.200	2032/9/20	0.90
日本	国債証券	第３６５回利付国債（１０年）	1,860,000,000	96.42	1,793,412,000	97.12	1,806,506,400	0.100	2031/12/20	0.89
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	100.15	1,772,708,100	0.100	2025/9/20	0.87
日本	国債証券	第３５８回利付国債（１０年）	1,740,000,000	98.51	1,714,089,100	98.90	1,720,894,800	0.100	2030/3/20	0.85
日本	国債証券	第３５５回利付国債（１０年）	1,720,000,000	98.96	1,702,272,000	99.24	1,707,014,000	0.100	2029/6/20	0.84
日本	国債証券	第３４８回利付国債（１０年）	1,690,000,000	99.79	1,686,451,000	100.00	1,690,000,000	0.100	2027/9/20	0.83
日本	国債証券	第３６９回日本国債（１０年）	1,690,000,000	99.17	1,675,973,000	99.48	1,681,347,200	0.500	2032/12/20	0.83
日本	国債証券	第１５４回利付国債（５年）	1,670,000,000	99.73	1,665,546,100	99.98	1,669,682,700	0.100	2027/9/20	0.82

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	85.05
地方債証券	4.92
特殊債券	5.22
社債券	4.03
合　　計	99.21

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

ＲＭ先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

以下の運用状況は2023年12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	57,296,816,604	45.00
	カナダ	2,468,176,849	1.94
	メキシコ	1,130,279,622	0.89
	ドイツ	8,096,690,956	6.36
	イタリア	9,287,818,792	7.29
	フランス	10,284,376,085	8.08
	オランダ	1,878,156,297	1.48
	スペイン	6,057,413,653	4.76
	ベルギー	2,267,155,340	1.78
	オーストリア	1,506,107,071	1.18
	フィンランド	662,386,525	0.52
	アイルランド	743,953,956	0.58
	イギリス	6,466,980,451	5.08
	スウェーデン	267,014,849	0.21
	ノルウェー	224,428,914	0.18
	デンマーク	354,692,814	0.28
	ポーランド	637,095,800	0.50
	オーストラリア	1,771,283,226	1.39
	ニュージーランド	299,236,109	0.24
	シンガポール	532,000,575	0.42
	マレーシア	632,877,036	0.50
	中国	9,177,964,642	7.21
	イスラエル	378,978,416	0.30
	小計	122,421,884,582	96.14
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	―	4,909,981,576	3.86
合計（純資産総額）		127,331,866,158	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	―	118,880,132,730	△93.36

(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	4,610,000	14,045.60	647,502,260	14,462.78	666,734,241	4.125	2032/11/15	0.52

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,050,000	13,775.23	557,897,168	14,216.24	575,757,775	3.875	2033/8/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,930,000	11,303.46	557,260,737	11,607.62	572,255,768	0.625	2030/5/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,610,000	11,205.67	516,581,754	11,521.74	531,152,601	0.625	2030/8/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,960,000	12,807.91	507,193,390	13,182.71	522,035,345	2.875	2032/5/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,430,000	11,430.05	506,351,549	11,768.56	521,347,463	1.250	2031/8/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,850,000	13,172.46	507,139,758	13,374.40	514,914,506	2.250	2027/8/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,310,000	11,466.62	494,211,453	11,810.39	509,028,006	1.375	2031/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,640,000	13,238.94	481,897,563	13,657.78	497,143,402	3.375	2033/5/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,890,000	12,489.35	485,835,729	12,715.66	494,639,521	1.250	2028/3/31	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,220,000	11,352.49	479,075,259	11,675.21	492,693,981	0.875	2030/11/15	0.39
中国	国債証券	GOV OF CHINA	22,990,000	2,021.65	464,777,981	2,024.57	465,449,703	3.030	2026/3/11	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,780,000	11,875.42	448,891,099	12,229.51	462,275,602	1.875	2032/2/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,390,000	13,366.09	453,110,532	13,600.72	461,064,453	2.875	2028/5/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,260,000	13,794.62	449,704,923	13,894.63	452,964,964	3.125	2025/8/15	0.36
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	3,010,000	14,538.09	437,596,618	14,793.94	445,297,830	0.750	2028/5/25	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,300,000	12,922.04	426,427,406	13,083.81	431,765,977	1.250	2026/12/31	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,100,000	13,765.26	426,723,257	13,855.84	429,531,321	2.875	2025/6/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,260,000	12,644.47	412,209,947	13,029.52	424,762,457	2.750	2032/8/15	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,350,000	12,233.66	409,827,893	12,472.72	417,836,442	1.000	2028/7/31	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,100,000	12,517.88	388,054,360	13,226.20	410,012,245	3.625	2053/2/15	0.32
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	2,230,000	17,977.68	400,902,400	18,272.36	407,473,732	5.500	2029/4/25	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,950,000	13,452.52	396,849,340	13,702.93	404,236,689	3.125	2028/11/15	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,070,000	13,017.33	399,632,175	13,148.63	403,663,193	0.750	2026/3/31	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,800,000	13,394.34	375,041,733	14,132.02	395,696,836	4.000	2052/11/15	0.31
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,980,000	13,164.15	392,291,695	13,274.67	395,585,420	0.250	2025/7/31	0.31
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,330,000	11,525.07	383,784,917	11,860.53	394,955,774	1.125	2031/2/15	0.31
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,820,000	13,605.15	383,665,329	13,729.25	387,164,984	2.625	2026/1/31	0.30
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,000,000	12,434.22	373,026,752	12,666.63	379,999,137	1.250	2028/5/31	0.30
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,100,000	11,851.94	367,410,337	12,192.94	377,981,382	1.625	2031/5/15	0.30

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	96.14
合　　計	96.14

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	394,773,000.00	55,617,278,286	55,653,715,834	△43.71
	カナダドル	売建	22,543,000.00	2,400,368,721	2,404,298,867	△1.89
	メキシコペソ	売建	138,117,000.00	1,139,904,462	1,137,241,566	△0.89
	ユーロ	売建	251,831,000.00	39,346,075,440	39,387,249,808	△30.93
	英ポンド	売建	33,948,000.00	6,094,799,184	6,097,749,944	△4.79
	スウェーデンクローナ	売建	18,292,000.00	258,725,523	259,173,860	△0.20
	ノルウェークローネ	売建	16,035,000.00	221,746,090	222,028,627	△0.17

	デンマーククローネ	売建	16,112,000.00	337,862,195	338,258,550	△0.27
	ポーランドズロチ	売建	17,566,000.00	631,291,826	630,668,584	△0.50
	オーストラリアドル	売建	17,797,000.00	1,714,548,742	1,716,814,300	△1.35
	ニュージーランドドル	売建	3,236,000.00	289,016,868	289,218,147	△0.23
	シンガポールドル	売建	4,930,000.00	527,424,218	527,503,591	△0.41
	マレーシアリンギット	売建	20,120,000.00	623,108,352	619,553,148	△0.49
	中国元	売建	462,976,000.00	9,360,911,744	9,218,870,706	△7.24
	イスラエルシュケル	売建	9,722,000.00	375,638,023	377,787,198	△0.30

(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先進国債券マザーファンド

以下の運用状況は2023年12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	26,649,933,840	46.37
	カナダ	1,139,221,215	1.98
	メキシコ	515,351,154	0.90
	ドイツ	3,793,971,227	6.60
	イタリア	4,329,529,828	7.53
	フランス	4,838,475,964	8.42
	オランダ	869,433,758	1.51
	スペイン	2,825,544,692	4.92
	ベルギー	1,020,744,821	1.78
	オーストリア	680,284,975	1.18
	フィンランド	294,151,003	0.51
	アイルランド	332,827,895	0.58
	イギリス	3,001,575,383	5.22
	スウェーデン	121,017,224	0.21
	ノルウェー	103,086,234	0.18
	デンマーク	160,261,403	0.28
	ポーランド	286,880,453	0.50
	オーストラリア	826,105,985	1.44
	ニュージーランド	135,007,498	0.23
	シンガポール	240,382,593	0.42
	マレーシア	283,694,476	0.49
	中国	4,259,947,662	7.41
	イスラエル	183,437,492	0.32
	小計	56,890,866,775	98.99
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	—	577,821,283	1.01
合計（純資産総額）		57,468,688,058	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	―	464,523,492	0.81

(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	2,120,000	14,140.45	299,777,562	14,055.57	297,978,180	3.875	2025/3/31	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,060,000	14,016.56	288,741,138	13,799.33	284,266,379	3.500	2033/2/15	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,860,000	14,078.89	261,867,480	14,390.75	267,668,113	4.625	2026/10/15	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,220,000	11,837.50	262,792,556	11,768.56	261,262,158	1.250	2031/8/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,890,000	13,747.44	259,826,660	13,657.78	258,132,150	3.375	2033/5/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,880,000	12,947.70	243,416,782	13,109.02	246,449,678	0.875	2026/6/30	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,840,000	13,509.61	248,576,958	13,182.71	242,561,877	2.875	2032/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,920,000	12,477.71	239,572,143	12,229.51	234,806,655	1.875	2032/2/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,820,000	12,651.23	230,252,495	12,692.12	230,996,636	1.250	2028/4/30	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,590,000	14,860.40	236,280,488	14,462.78	229,958,231	4.125	2032/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,930,000	12,010.16	231,796,173	11,810.39	227,940,615	1.375	2031/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,650,000	13,382.99	220,819,337	13,029.52	214,987,134	2.750	2032/8/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,800,000	11,990.30	215,825,547	11,860.53	213,489,607	1.125	2031/2/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,800,000	11,759.12	211,664,255	11,675.21	210,153,831	0.875	2030/11/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,660,000	12,384.59	205,584,287	12,192.94	202,402,934	1.625	2031/5/15	0.35
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	1,360,000	14,367.05	195,391,918	14,793.94	201,197,691	0.750	2028/5/25	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,360,000	14,501.00	197,213,728	14,269.70	194,067,983	4.125	2027/10/31	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,450,000	13,037.27	189,040,553	13,154.45	190,739,605	1.500	2027/1/31	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,340,000	13,691.02	183,459,764	13,600.72	182,249,665	2.875	2028/5/15	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,200,000	14,615.93	175,391,244	15,031.76	180,381,167	4.875	2030/10/31	0.31
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,270,000	15,156.15	192,483,185	14,132.02	179,476,778	4.000	2052/11/15	0.31
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,360,000	12,812.34	174,247,906	13,097.66	178,128,285	0.500	2026/2/28	0.31
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,300,000	13,564.70	176,341,227	13,655.29	177,518,805	2.250	2025/11/15	0.31
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,320,000	12,790.18	168,830,443	13,093.51	172,834,368	0.375	2026/1/31	0.30
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,200,000	13,624.15	163,489,856	14,216.24	170,594,895	3.875	2033/8/15	0.30
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,310,000	12,801.81	167,703,835	13,020.65	170,570,631	0.875	2026/9/30	0.30
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	1,060,000	15,792.00	167,395,259	15,994.70	169,543,884	2.500	2030/5/25	0.30
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	1,110,000	14,865.96	165,012,184	15,180.12	168,499,355	0.000	2025/3/25	0.29
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,270,000	12,919.29	164,075,042	13,164.42	167,188,232	0.250	2025/10/31	0.29
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	1,040,000	15,895.36	165,311,797	16,038.65	166,801,986	2.750	2027/10/25	0.29

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	98.99
合　　計	98.99

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	1,568,600.00	221,925,528	222,261,992	0.39
	カナダドル	買建	91,800.00	9,842,979	9,836,103	0.02
	ユーロ	買建	1,049,500.00	165,119,934	164,777,587	0.29
	英ポンド	買建	115,200.00	20,880,806	20,794,936	0.04
	オーストラリアドル	買建	135,300.00	13,147,371	13,105,766	0.02
	中国元	買建	1,694,200.00	33,597,680	33,747,108	0.06

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

ＲＭ新興国債券マザーファンド

以下の運用状況は2023年12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	1,961,705,034	17.49
	アイルランド	9,230,548,437	82.31
	小計	11,192,253,471	99.80
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	―	22,424,048	0.20
合計（純資産総額）		11,214,677,519	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	1,405,047	6,304.14	8,857,623,012	6,569.56	9,230,548,437	82.31
アメリカ	投資信託受益証券	VANECK J.P.MORGAN EM LOCAL	545,832	3,588.29	1,958,608,420	3,593.97	1,961,705,034	17.49

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	99.80
合　　計	99.80

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

ＲＭ国内株式マザーファンド

以下の運用状況は2023年12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	127,058,666,550	99.49
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	―	645,038,824	0.51
合計（純資産総額）		127,703,705,374	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	567,840,000	0.44

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	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	2,077,500	2,110.79	4,385,186,465	2,590.50	5,381,763,750	4.21
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	267,600	12,137.24	3,247,926,888	13,410.00	3,588,516,000	2.81
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	2,269,300	1,007.54	2,286,410,522	1,211.50	2,749,256,950	2.15
日本	株式	キーエンス	電気機器	37,900	60,666.26	2,299,251,600	62,120.00	2,354,348,000	1.84
日本	株式	信越化学工業	化学	343,700	4,139.95	1,422,901,275	5,917.00	2,033,672,900	1.59
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	80,100	17,538.08	1,404,800,284	25,255.00	2,022,925,500	1.58
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	11,287,500	162.08	1,829,484,259	172.30	1,944,836,250	1.52
日本	株式	日立製作所	電気機器	183,700	7,876.41	1,446,896,977	10,170.00	1,868,229,000	1.46
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	264,900	6,015.17	1,593,419,030	6,880.00	1,822,512,000	1.43
日本	株式	三菱商事	卸売業	793,200	1,867.37	1,481,200,861	2,253.50	1,787,476,200	1.40
日本	株式	任天堂	その他製品	238,900	5,821.43	1,390,739,920	7,359.00	1,758,065,100	1.38
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	288,000	4,247.44	1,223,263,608	5,963.00	1,717,344,000	1.34
日本	株式	三井物産	卸売業	301,600	4,544.24	1,370,543,128	5,298.00	1,597,876,800	1.25
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	269,100	4,770.52	1,283,748,376	5,767.00	1,551,899,700	1.22
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	335,800	4,331.26	1,454,437,602	4,054.00	1,361,333,200	1.07
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	922,700	1,268.24	1,170,208,308	1,466.00	1,352,678,200	1.06
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	293,200	4,205.58	1,233,078,438	4,486.00	1,315,295,200	1.03
日本	株式	ＨＯＹＡ	精密機器	74,500	14,829.62	1,104,806,690	17,625.00	1,313,062,500	1.03
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	368,300	2,954.37	1,088,097,620	3,529.00	1,299,730,700	1.02
日本	株式	第一三共	医薬品	330,600	4,326.18	1,430,236,514	3,872.00	1,280,083,200	1.00
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	503,000	2,137.99	1,075,412,930	2,412.50	1,213,487,500	0.95
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	187,200	5,980.56	1,119,561,044	6,293.00	1,178,049,600	0.92
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	205,800	4,748.67	977,278,185	5,251.00	1,080,655,800	0.85
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	610,600	1,549.88	946,360,410	1,759.50	1,074,350,700	0.84
日本	株式	ダイキン工業	機械	45,600	23,821.45	1,086,258,120	22,985.00	1,048,116,000	0.82
日本	株式	村田製作所	電気機器	344,200	2,623.76	903,099,540	2,993.00	1,030,190,600	0.81
日本	株式	ＳＭＣ	機械	11,400	69,438.16	791,595,105	75,760.00	863,664,000	0.68

日本	株式	三菱電機	電気機器	425,300	1,653.91	703,408,278	1,999.00	850,174,700	0.67
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	226,400	2,964.49	671,161,730	3,645.00	825,228,000	0.65
日本	株式	セブン＆アイ・ホールディングス	小売業	138,000	5,909.07	815,451,984	5,595.00	772,110,000	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	0.08
		鉱業	0.34
		建設業	2.11
		食料品	3.36
		繊維製品	0.40
		パルプ・紙	0.17
		化学	6.16
		医薬品	4.59
		石油・石炭製品	0.46
		ゴム製品	0.69
		ガラス・土石製品	0.67
		鉄鋼	0.96
		非鉄金属	0.67
		金属製品	0.52
		機械	5.31
		電気機器	17.46
		輸送用機器	8.15
		精密機器	2.35
		その他製品	2.36
		電気・ガス業	1.40
		陸運業	2.83
		海運業	0.84
		空運業	0.45
		倉庫・運輸関連業	0.15
		情報・通信業	7.69
		卸売業	6.97
		小売業	4.28
		銀行業	6.84
		証券、商品先物取引業	0.80
		保険業	2.37
		その他金融業	1.14
		不動産業	1.94
		サービス業	4.97
合　計			99.49

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	24	日本円	561,493,200	567,840,000	0.44

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

ＲＭ先進国株式マザーファンド

以下の運用状況は2023年12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	150,786,610,625	66.22
	カナダ	7,431,973,691	3.26
	パナマ	66,898,216	0.03
	ドイツ	5,231,450,697	2.30
	イタリア	1,216,322,604	0.53
	フランス	6,738,292,171	2.96
	オランダ	4,144,034,663	1.82
	スペイン	1,588,994,151	0.70
	ベルギー	477,666,064	0.21
	オーストリア	117,681,266	0.05
	ルクセンブルク	111,348,479	0.05
	フィンランド	663,816,906	0.29
	アイルランド	3,914,957,525	1.72
	ポルトガル	111,474,091	0.05
	イギリス	8,351,199,469	3.67
	スイス	6,814,854,050	2.99
	スウェーデン	1,985,368,750	0.87
	ノルウェー	413,614,154	0.18
	デンマーク	2,056,024,479	0.90
	ケイマン	299,248,757	0.13
	リベリア	115,284,016	0.05
	オーストラリア	4,321,791,226	1.90
	バミューダ	259,271,691	0.11
	ニュージーランド	161,625,063	0.07
	香港	1,013,358,552	0.45
	シンガポール	673,021,139	0.30
	イスラエル	422,907,157	0.19
	キュラソー	280,786,422	0.12
	ジャージー	725,578,426	0.32
	マン島	30,461,000	0.01
	小計	210,525,915,500	92.46

新株予約権証券	カナダ	0	0.00
投資証券	アメリカ	3,892,321,747	1.71
	カナダ	15,488,168	0.01
	フランス	79,551,559	0.03
	ベルギー	18,618,519	0.01
	イギリス	74,176,233	0.03
	オーストラリア	265,205,512	0.12
	香港	53,323,792	0.02
	シンガポール	99,897,019	0.04
	小計	4,498,582,549	1.98
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	―	12,681,652,452	5.57
合計（純資産総額）		227,706,150,501	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	10,314,638,159	4.53
	買建	ドイツ	2,370,086,066	1.04

(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	―	789,749,907	0.35

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

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	418,175	20,926.88	8,751,098,369	27,455.45	11,481,183,389	5.04
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	188,773	36,154.64	6,825,021,666	53,225.96	10,047,624,600	4.41
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	248,406	14,394.37	3,575,650,156	21,753.88	5,403,795,657	2.37
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	66,071	32,237.54	2,129,966,780	70,237.05	4,640,632,302	2.04
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	158,747	14,434.98	2,291,510,017	19,888.82	3,157,290,651	1.39
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	59,472	23,142.21	1,376,313,941	50,820.52	3,022,398,298	1.33
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	139,705	14,476.58	2,022,451,741	20,037.74	2,799,372,802	1.23
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	76,455	23,006.68	1,758,976,077	35,908.51	2,745,385,851	1.21
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	11,878	86,321.56	1,025,327,491	159,191.41	1,890,875,572	0.83
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	77,808	19,634.47	1,527,718,866	24,153.64	1,879,347,121	0.83

アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	24,798	69,441.13	1,722,001,248	74,446.56	1,846,125,968	0.81
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	21,606	51,956.83	1,122,579,362	82,381.95	1,779,944,531	0.78
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	35,007	44,735.07	1,566,040,699	50,714.15	1,775,350,358	0.78
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	42,915	31,980.17	1,372,429,086	36,932.53	1,584,959,611	0.70
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	107,205	16,036.00	1,719,139,804	14,209.94	1,523,377,443	0.67
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	64,507	23,608.13	1,522,890,105	22,207.74	1,432,554,774	0.63
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	金融サービス	22,447	53,930.77	1,210,584,173	60,464.96	1,357,257,083	0.60
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	44,710.48	1,191,981,463	49,266.06	1,313,433,394	0.58
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	63,123	20,269.00	1,279,440,143	20,668.88	1,304,682,085	0.57
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	87,470	10,478.88	916,587,765	14,718.05	1,287,388,358	0.57
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	71,570	18,796.65	1,345,276,433	16,283.94	1,165,442,273	0.51
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	10,796	96,974.83	1,046,940,354	107,768.60	1,163,469,892	0.51
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	11,864	70,661.09	838,323,266	94,047.47	1,115,779,220	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	68,027	15,348.30	1,044,099,466	15,426.84	1,049,442,264	0.46
アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	47,324	20,934.83	990,720,240	21,948.19	1,038,676,262	0.46
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	48,573	25,147.42	1,221,485,679	21,241.87	1,031,781,794	0.45
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	12,195	53,726.44	655,194,050	84,462.60	1,030,021,427	0.45
アメリカ	株式	SALESFORCE INC	ソフトウェア・サービス	26,073	23,335.29	608,421,262	37,667.21	982,097,203	0.43
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	110,119	8,571.55	943,891,297	8,332.51	917,567,944	0.40
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	190,341	4,765.04	906,983,504	4,805.20	914,626,649	0.40

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	4.44
		素材	3.85
		資本財	6.56
		商業・専門サービス	1.50

		運輸	1.74
		自動車・自動車部品	1.97
		耐久消費財・アパレル	1.47
		消費者サービス	1.99
		メディア・娯楽	5.68
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.38
		生活必需品流通・小売り	1.62
		食品・飲料・タバコ	3.34
		家庭用品・パーソナル用品	1.54
		ヘルスケア機器・サービス	4.13
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.51
		銀行	5.20
		金融サービス	6.40
		保険	2.88
		ソフトウェア・サービス	9.56
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.40
		電気通信サービス	1.11
		公益事業	2.55
		半導体・半導体製造装置	6.29
		不動産管理・開発	0.34
新株予約権証券	—	—	—
投資証券	—	—	1.98
合　　計			94.43

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	SP500MIN2403	買建	301	米ドル	70,743,500	10,033,550,604	72,725,362.5	10,314,638,159	4.53
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	STX E6002403	買建	628	ユーロ	15,003,879	2,357,409,468	15,084,560	2,370,086,066	1.04

(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	3,940,000.00	558,141,084	558,276,330	0.25
	カナダドル	買建	300,000.00	32,201,559	32,144,130	0.01
	ユーロ	買建	540,000.00	84,967,436	84,783,132	0.04
	英ポンド	買建	220,000.00	39,850,894	39,712,552	0.02
	スイスフラン	買建	130,000.00	21,885,316	21,863,907	0.01
	スウェーデンクローナ	買建	670,000.00	9,551,600	9,527,601	0.00

	ノルウェークローネ	買建	180,000.00	2,503,260	2,503,512	0.00
	デンマーククローネ	買建	290,000.00	6,127,120	6,109,285	0.00
	オーストラリアドル	買建	220,000.00	21,368,144	21,310,190	0.01
	ニュージーランドドル	買建	30,000.00	2,694,387	2,694,744	0.00
	香港ドル	買建	360,000.00	6,528,960	6,528,420	0.00
	シンガポールドル	買建	40,000.00	4,296,120	4,296,104	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新興国株式マザーファンド

以下の運用状況は2023年12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	99,112,215	0.33
	メキシコ	737,270,551	2.42
	ブラジル	1,654,710,604	5.43
	チリ	145,116,483	0.48
	コロンビア	30,161,002	0.10
	ペルー	11,998,554	0.04
	オランダ	18,548,916	0.06
	ルクセンブルク	32,086,458	0.11
	ギリシャ	137,059,069	0.45
	イギリス	33,313,128	0.11
	トルコ	174,754,873	0.57
	チェコ	43,027,410	0.14
	キプロス	0	0.00
	ハンガリー	72,897,428	0.24
	ポーランド	258,047,180	0.85
	ロシア	0	0.00
	ケイマン	4,328,262,365	14.21
	バミューダ	123,030,789	0.40
	香港	267,497,769	0.88
	シンガポール	6,476,827	0.02
	マレーシア	379,445,526	1.25
	タイ	497,810,385	1.63
	フィリピン	179,016,350	0.59
	インドネシア	538,526,395	1.77
	韓国	3,703,070,797	12.15
	台湾	4,441,431,169	14.58
	中国	2,904,186,362	9.53
	インド	4,808,938,452	15.78
	カザフスタン	0	0.00
	カタール	251,705,674	0.83

	エジプト	26,192,347	0.09
	南アフリカ	792,247,410	2.60
	英ヴァージン諸島	0	0.00
	アラブ首長国連邦	357,146,579	1.17
	クウェート	214,430,131	0.70
	サウジアラビア	1,184,273,133	3.89
	小計	28,451,792,331	93.39
投資証券	メキシコ	43,451,205	0.14
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	―	1,971,526,896	6.47
合計（純資産総額）		30,466,770,432	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	1,977,315,848	6.49

(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	―	290,503,737	0.95
	売建	―	2,868,231	△0.01

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	700,000	2,354.58	1,648,206,643	2,745.23	1,921,663,940	6.31
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	135,822	6,919.89	939,873,406	8,674.24	1,178,153,983	3.87
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	189,500	6,883.28	1,304,381,613	5,317.95	1,007,751,525	3.31
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	一般消費財・サービス流通・小売り	462,740	1,935.63	895,696,004	1,376.67	637,043,746	2.09
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	86,649	3,778.76	327,426,327	4,481.54	388,321,479	1.27
ケイマン	株式	PDD HOLDINGS INC	一般消費財・サービス流通・小売り	16,997	13,625.53	231,593,236	20,614.99	350,392,994	1.15
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	147,555	1,509.74	222,770,787	1,730.14	255,291,988	0.84
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	94,576	2,599.78	245,877,173	2,687.75	254,197,401	0.83
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	15,560	10,005.25	155,681,825	15,635.75	243,292,270	0.80
インド	株式	HDFC BANK LIMITED	銀行	79,876	2,811.57	224,577,390	2,933.02	234,278,704	0.77
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	2,732,000	92.19	251,876,632	84.03	229,582,254	0.75
ブラジル	株式	VALE SA	素材	97,104	2,646.40	256,976,216	2,252.72	218,748,791	0.72
ケイマン	株式	MEITUAN	消費者サービス	144,210	2,865.47	413,229,662	1,494.65	215,543,837	0.71

台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	42,800	3,199.22	136,926,731	4,745.13	203,091,778	0.67
サウジアラビア	株式	AL RAJHI BANK	銀行	55,929	2,972.30	166,238,253	3,295.55	184,317,375	0.60
台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	355,800	459.12	163,355,906	481.45	171,302,614	0.56
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	26,086	5,852.09	152,657,758	6,535.82	170,493,609	0.56
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	23,505	6,143.47	144,402,476	6,884.15	161,811,946	0.53
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	エネルギー	135,900	786.46	106,881,027	1,086.67	147,679,553	0.48
ケイマン	株式	NETEASE INC	メディア・娯楽	54,900	2,575.78	141,410,701	2,560.96	140,596,978	0.46
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	銀行	138,200	750.68	103,744,725	991.25	136,991,882	0.45
インドネシア	株式	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	銀行	1,578,700	77.20	121,880,543	86.48	136,525,976	0.45
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	66,760	3,805.42	254,050,293	2,043.68	136,436,744	0.45
ケイマン	株式	BAIDU INC-CLASS A	メディア・娯楽	63,980	2,381.55	152,371,879	2,085.43	133,426,131	0.44
ケイマン	株式	XIAOMI CORP-CLASS B	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	436,600	218.04	95,197,074	295.48	129,007,441	0.42
中国	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	1,849,000	74.50	137,754,587	68.60	126,854,343	0.42
インド	株式	AXIS BANK LTD	銀行	65,042	1,567.06	101,925,054	1,905.50	123,937,661	0.41
サウジアラビア	株式	THE SAUDI NATIONAL BANK	銀行	84,055	1,361.56	114,446,134	1,465.95	123,220,932	0.40
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	25,966.53	138,557,406	23,083.57	123,173,934	0.40
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	190,500	1,059.51	201,838,547	639.78	121,879,519	0.40

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	4.82
		素材	7.41
		資本財	4.41
		商業・専門サービス	0.06
		運輸	1.88
		自動車・自動車部品	3.57
		耐久消費財・アパレル	1.15
		消費者サービス	2.03
		メディア・娯楽	5.59
		一般消費財・サービス流通・小売り	5.16
		生活必需品流通・小売り	1.43
		食品・飲料・タバコ	3.42

		家庭用品・パーソナル用品	0.76
		ヘルスケア機器・サービス	0.95
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.57
		銀行	15.79
		金融サービス	2.73
		保険	2.37
		ソフトウェア・サービス	2.50
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8.79
		電気通信サービス	2.62
		公益事業	2.52
		半導体・半導体製造装置	9.45
		不動産管理・開発	1.41
投資証券	―	―	0.14
合　　計			93.53

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 2403	買建	270	米ドル	13,468,680	1,910,262,893	13,941,450	1,977,315,848	6.49

(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	2,050,211.82	290,459,902	290,503,737	0.95
	ブラジルレアル	売建	98,293.14	2,890,102	2,868,231	△0.01

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

RM国内リートマザーファンド

以下の運用状況は2023年12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	46,842,768,050	98.79
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	―	574,487,215	1.21
合計（純資産総額）		47,417,255,265	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	541,764,000	1.14

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	5,309	574,931.88	3,052,313,401	611,000	3,243,799,000	6.84
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	4,675	556,351.84	2,600,944,870	584,000	2,730,200,000	5.76
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	14,716	156,983.51	2,310,169,393	165,000	2,428,140,000	5.12
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	21,813	98,660.59	2,152,083,619	101,900	2,222,744,700	4.69
日本	投資証券	ＧＬＰ投資法人	15,372	143,220.39	2,201,583,987	140,500	2,159,766,000	4.55
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	7,928	290,323.79	2,301,687,036	271,400	2,151,659,200	4.54
日本	投資証券	ＫＤＸ不動産投資法人	13,096	155,692.64	2,038,950,820	160,800	2,105,836,800	4.44
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	6,860	278,029.16	1,907,280,100	251,700	1,726,662,000	3.64
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	9,068	176,197.02	1,597,754,608	166,500	1,509,822,000	3.18
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	10,180	148,498.6	1,511,715,828	144,100	1,466,938,000	3.09
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	4,465	330,655.98	1,476,378,967	316,000	1,410,940,000	2.98
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	22,034	56,270.22	1,239,858,214	61,000	1,344,074,000	2.83
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	3,112	354,593.92	1,103,496,307	350,000	1,089,200,000	2.30
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	13,675	75,285.77	1,029,532,991	77,100	1,054,342,500	2.22
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	15,234	78,708.25	1,199,041,630	69,200	1,054,192,800	2.22
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	6,944	146,597.23	1,017,971,212	139,600	969,382,400	2.04
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	1,571	604,323.55	949,392,312	604,000	948,884,000	2.00
日本	投資証券	アクティビア・プロパティーズ投資法人	2,387	394,719.44	942,195,304	388,500	927,349,500	1.96
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	5,817	155,239.95	903,030,798	152,000	884,184,000	1.86
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	1,893	466,922.89	883,885,038	457,500	866,047,500	1.83
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	2,915	300,564.53	876,145,631	286,000	833,690,000	1.76
日本	投資証券	イオンリート投資法人	5,582	148,105.72	826,726,169	141,400	789,294,800	1.66
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	5,351	148,714.34	795,770,437	140,200	750,210,200	1.58
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	1,688	484,993.17	818,668,473	433,000	730,904,000	1.54
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	2,238	313,194.97	700,930,351	317,000	709,446,000	1.50
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	6,702	110,266.52	739,006,235	104,300	699,018,600	1.47
日本	投資証券	森トラストリート投資法人	8,772	72,337.05	634,540,604	72,500	635,970,000	1.34
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	4,258	154,878.92	659,474,480	149,200	635,293,600	1.34
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	943	626,198.47	590,505,163	665,000	627,095,000	1.32
日本	投資証券	三菱地所物流リート投資法人	1,571	400,567.94	629,292,249	374,500	588,339,500	1.24

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
投資証券	98.79
合　　計	98.79

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

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	303	日本円	540,681,330	541,764,000	1.14

(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12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	539,502,303	0.81
	オーストラリア	45,314,713	0.07
	小計	584,817,016	0.88
投資証券	アメリカ	50,677,391,277	76.26
	カナダ	997,021,763	1.50
	ドイツ	23,939,375	0.04
	イタリア	5,240,840	0.01
	フランス	1,210,882,646	1.82
	オランダ	117,849,598	0.18
	スペイン	293,668,587	0.44
	ベルギー	777,250,982	1.17
	アイルランド	22,533,541	0.03
	イギリス	3,189,447,503	4.80
	オーストラリア	4,452,200,113	6.70
	ニュージーランド	192,824,039	0.29
	香港	748,168,682	1.13
	シンガポール	2,311,321,467	3.48
	韓国	117,641,573	0.18
	イスラエル	81,256,812	0.12
	ガーンジー	192,353,023	0.29
	小計	65,410,991,821	98.43
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	―	457,776,667	0.69
合計（純資産総額）		66,453,585,504	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	―	20,599,811	0.03
	売建	―	16,362,737	△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。

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	307,875	17,408.21	5,359,553,947	19,173.99	5,903,194,542	8.88
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	31,276	101,625.44	3,178,437,571	115,462.38	3,611,201,544	5.43
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	184,333	10,820.21	1,994,521,899	12,929.22	2,383,282,426	3.59
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	52,703	42,049.75	2,216,148,417	43,655.27	2,300,763,906	3.46
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	108,649	16,469.29	1,789,372,932	20,463.23	2,223,309,737	3.35
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	241,521	8,828.91	2,132,368,984	8,308.40	2,006,653,415	3.02
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	101,040	14,733.30	1,488,652,673	19,305.89	1,950,668,096	2.94
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	70,497	20,810.71	1,467,093,039	22,999.15	1,621,371,275	2.44
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	345,155	4,637.84	1,600,774,011	4,564.08	1,575,318,277	2.37
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	576,494	1,910.68	1,101,499,822	2,443.85	1,408,869,128	2.12
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	47,379	24,372.06	1,154,724,172	26,890.96	1,274,067,173	1.92
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	115,271	8,661.55	998,426,464	8,864.37	1,021,805,371	1.54
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	97,416	7,630.45	743,328,307	10,013.19	975,445,696	1.47
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	134,185	6,617.78	888,007,856	7,226.23	969,652,813	1.46
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	52,146	18,964.08	988,901,400	18,281.88	953,327,279	1.43
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	191,886	4,531.46	869,525,365	4,921.50	944,367,141	1.42
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	41,508	20,007.95	830,490,325	19,165.48	795,521,072	1.20
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	21,408	30,582.80	654,716,645	35,847.53	767,423,976	1.15
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	38,920	21,555.32	838,933,187	19,366.88	753,759,223	1.13
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	72,910	10,642.92	775,975,531	9,315.39	679,185,406	1.02
香港	投資証券	LINK REIT	853,100	963.58	822,033,083	795.87	678,963,095	1.02
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	409,108	1,414.72	578,775,070	1,621.06	663,189,006	1.00
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	235,079	2,399.76	564,134,027	2,789.79	655,822,477	0.99
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	206,669	2,840.85	587,116,641	3,091.89	638,998,641	0.96
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	62,162	9,485.59	589,643,270	10,157.86	631,433,179	0.95
アメリカ	投資証券	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	89,042	7,220.56	642,933,575	7,044.69	627,273,830	0.94
アメリカ	投資証券	REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	70,408	8,149.55	573,793,643	8,081.47	569,000,379	0.86
アメリカ	投資証券	UDR INC	100,909	5,690.21	574,194,370	5,498.74	554,873,273	0.83
アメリカ	投資証券	AMERICAN HOMES 4 RENT- A	106,056	4,653.44	493,525,477	5,148.42	546,021,786	0.82
アメリカ	投資証券	REGENCY CENTERS CORP	54,757	8,762.25	479,794,928	9,594.79	525,382,436	0.79

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）	0.88
投資証券	―	―	98.43
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	米ドル	買建	90,000.00	12,749,400	12,750,471	0.02
	ユーロ	買建	50,000.00	7,848,600	7,849,340	0.01

	米ドル	売建	90,000.00	12,749,400	12,752,505	△0.02
	英ポンド	売建	20,000.00	3,627,680	3,610,232	△0.01

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

≪参考情報≫

運用実績

ターゲットリターンバランスファンド(目標2%)

2023年12月29日現在

基準価額・純資産の推移

基準価額	10,482円	純資産総額	21.3百万円

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

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

2023年12月20日	0円
－	－
－	－
－	－
－	－
設定来累計	0円

主要な資産の状況

■資産の組入比率

資産	比率(%)
RM国内債券マザーファンド	33.9
RM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)	34.0
RM先進国債券マザーファンド	6.0
RM新興国債券マザーファンド	2.0
RM国内株式マザーファンド	6.0
RM先進国株式マザーファンド	10.0
RM新興国株式マザーファンド	2.0
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	0.2
合計	100.0

※比率はファンドの純資産総額に対する組入比率であり、四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。
※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	76.2
米ドル	13.6
ユーロ	3.1
英ポンド	0.9
中国元	0.6
その他	5.6
合計	100.0

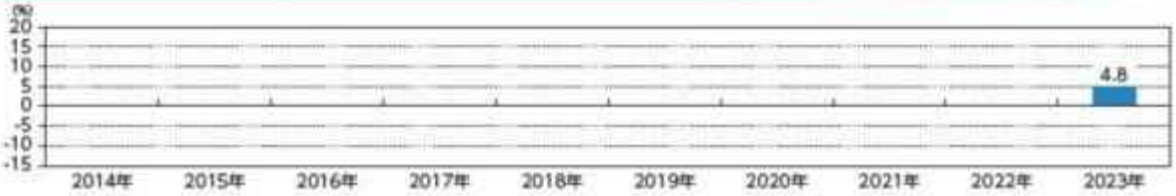
※比率はファンドの純資産総額に対する組入比率であり、四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。
※上記通貨別組入比率は、各マザーファンドが実質的に保有している株式・債券等の通貨を基準に算出しています。
※為替ヘッジをかけている外貨建資産については、日本円に含めています。

■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147回利付国債(5年)	2026/3/20	1.63
	日本	第447回利付国債(2年)	2025/4/1	1.59
	日本	第158回利付国債(5年)	2028/3/20	1.35
先進国債券(為替ヘッジあり)	アメリカ	US TREASURY N/B	2032/11/15	0.52
	アメリカ	US TREASURY N/B	2033/8/15	0.45
	アメリカ	US TREASURY N/B	2030/5/15	0.45
先進国債券	アメリカ	US TREASURY N/B	2025/3/31	0.52
	アメリカ	US TREASURY N/B	2033/2/15	0.49
	アメリカ	US TREASURY N/B	2026/10/15	0.47
新興国債券	アイルランド	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	—	82.31
	アメリカ	VANECK J.P.MORGAN EM LOCAL	—	17.49
国内株式	日本	トヨタ自動車	—	4.21
	日本	ソニーグループ	—	2.81
	日本	三菱UFJフィナンシャル・グループ	—	2.15
先進国株式	アメリカ	APPLE INC	—	5.04
	アメリカ	MICROSOFT CORP	—	4.41
	アメリカ	AMAZON.COM INC	—	2.37
新興国株式	台湾	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	—	6.31
	韓国	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	—	3.87
	ケイマン	TENCENT HOLDINGS LTD	—	3.31
国内リート	日本	日本ビルファンド投資法人	—	6.84
	日本	ジャパンリアルエステイト投資法人	—	5.76
	日本	野村不動産マスターファンド投資法人	—	5.12
先進国リート	アメリカ	PROLOGIS INC	—	8.88
	アメリカ	EQUINIX INC	—	5.43
	アメリカ	WELLTOWER INC	—	3.59

※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12月末までの騰落率です。
※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

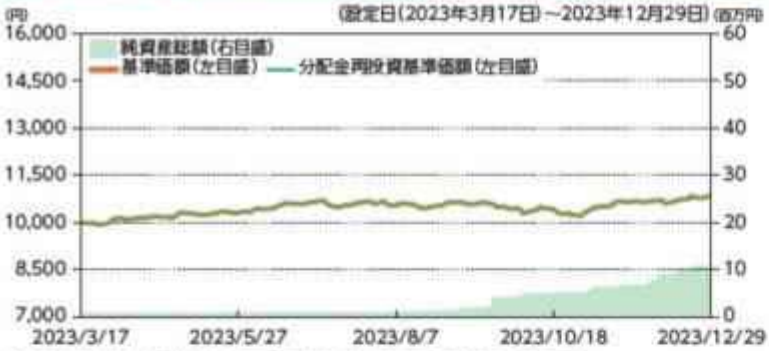
※運用実績は過去のものであり、将来の運用成果を約束するものではありません。
※運用実績については、別途、委託会社のホームページで開示しています。

ターゲットリターンバランスファンド(目標3%)

2023年12月29日現在

基準価額・純資産の推移

基準価額	10,833円	純資産総額	10.9百万円



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

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

2023年12月20日	0円
－	－
－	－
－	－
－	－
設定来累計	0円

主要な資産の状況

■資産の組入比率

資産	比率(%)
RM国内債券マザーファンド	28.3
RM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)	28.5
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	2.0
RM国内株式マザーファンド	7.2
RM先進国株式マザーファンド	22.0
RM新興国株式マザーファンド	3.7
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	66.4
米ドル	20.9
ユーロ	3.0
英ポンド	1.2
香港ドル	0.8
その他	7.6
合計	100.0

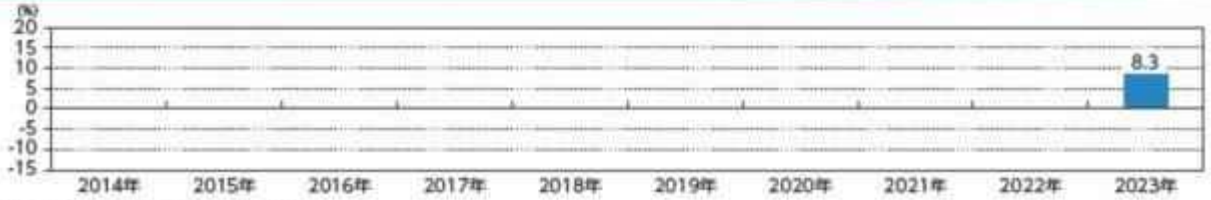
※比率はファンドの純資産総額に対する組入比率であり、四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。
※上記通貨別組入比率は、各マザーファンドが実質的に保有している株式・債券等の通貨を基準に算出しています。
※為替ヘッジをかけている外貨建資産については、日本円に含めています。

■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147回利付国債(5年)	2026/3/20	1.63
	日本	第447回利付国債(2年)	2025/4/1	1.59
	日本	第158回利付国債(5年)	2028/3/20	1.35
先進国債券(為替ヘッジあり)	アメリカ	US TREASURY N/B	2032/11/15	0.52
	アメリカ	US TREASURY N/B	2033/8/15	0.45
	アメリカ	US TREASURY N/B	2030/5/15	0.45
先進国債券	アメリカ	US TREASURY N/B	2025/3/31	0.52
	アメリカ	US TREASURY N/B	2033/2/15	0.49
	アメリカ	US TREASURY N/B	2026/10/15	0.47
新興国債券	アイルランド	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	—	82.31
	アメリカ	VANECK J.P.MORGAN EM LOCAL	—	17.49
国内株式	日本	トヨタ自動車	—	4.21
	日本	ソニーグループ	—	2.81
	日本	三菱UFJフィナンシャル・グループ	—	2.15
先進国株式	アメリカ	APPLE INC	—	5.04
	アメリカ	MICROSOFT CORP	—	4.41
	アメリカ	AMAZON.COM INC	—	2.37
新興国株式	台湾	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	—	6.31
	韓国	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	—	3.87
	ケイマン	TENCENT HOLDINGS LTD	—	3.31
国内リート	日本	日本ビルファンド投資法人	—	6.84
	日本	ジャパンリアルエステイト投資法人	—	5.76
	日本	野村不動産マスターファンド投資法人	—	5.12
先進国リート	アメリカ	PROLOGIS INC	—	8.88
	アメリカ	EQUINIX INC	—	5.43
	アメリカ	WELLTOWER INC	—	3.59

※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12月末までの騰落率です。
※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

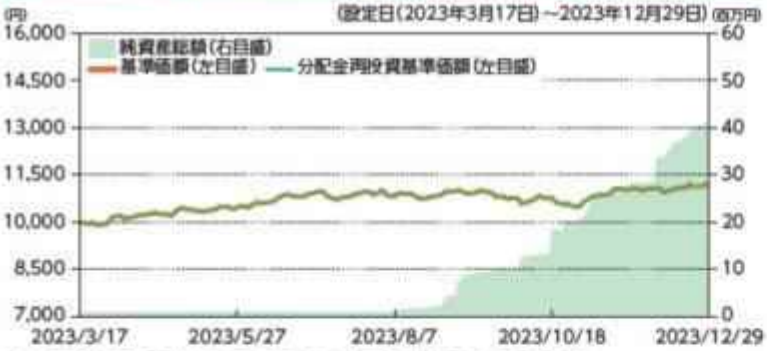
※運用実績は過去のものであり、将来の運用成果を約束するものではありません。
※運用実績については、別途、委託会社のホームページで開示しています。

ターゲットリターンバランスファンド(目標4%)

2023年12月29日現在

基準価額・純資産の推移

基準価額	11,207円	純資産総額	41.5百万円



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

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

2023年12月20日	0円
－	－
－	－
－	－
－	－
設定来累計	0円

主要な資産の状況

■資産の組入比率

資産	比率(%)
RM国内債券マザーファンド	20.9
RM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)	21.0
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	2.0
RM国内株式マザーファンド	9.1
RM先進国株式マザーファンド	29.9
RM新興国株式マザーファンド	5.7
RM国内リートマザーファンド	3.1
RM先進国リートマザーファンド	6.1
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	54.4
米ドル	28.6
ユーロ	3.9
英ポンド	1.6
香港ドル	1.3
その他	10.2
合計	100.0

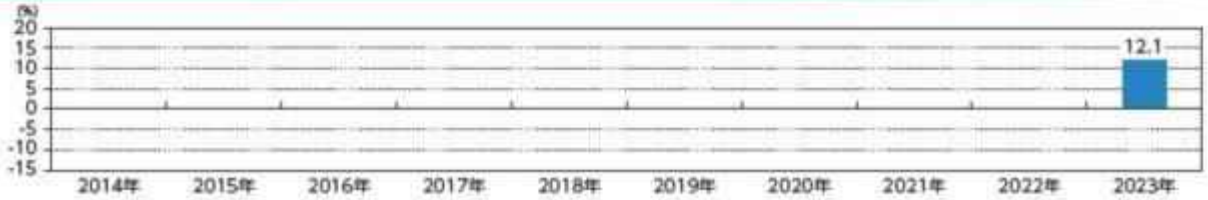
※比率はファンドの純資産総額に対する組入比率であり、四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。
※上記通貨別組入比率は、各マザーファンドが実質的に保有している株式・債券等の通貨を基準に算出しています。
※為替ヘッジをかけている外貨建資産については、日本円に含めています。

■各マザーファンドにおける組入上位銘柄

	国・地域	銘柄名	償還期限	比率(%)
国内債券	日本	第147回利付国債(5年)	2026/3/20	1.63
	日本	第447回利付国債(2年)	2025/4/1	1.59
	日本	第158回利付国債(5年)	2028/3/20	1.35
先進国債券(為替ヘッジあり)	アメリカ	US TREASURY N/B	2032/11/15	0.52
	アメリカ	US TREASURY N/B	2033/8/15	0.45
	アメリカ	US TREASURY N/B	2030/5/15	0.45
先進国債券	アメリカ	US TREASURY N/B	2025/3/31	0.52
	アメリカ	US TREASURY N/B	2033/2/15	0.49
	アメリカ	US TREASURY N/B	2026/10/15	0.47
新興国債券	アイルランド	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	—	82.31
	アメリカ	VANECK J.P.MORGAN EM LOCAL	—	17.49
国内株式	日本	トヨタ自動車	—	4.21
	日本	ソニーグループ	—	2.81
	日本	三菱UFJフィナンシャル・グループ	—	2.15
先進国株式	アメリカ	APPLE INC	—	5.04
	アメリカ	MICROSOFT CORP	—	4.41
	アメリカ	AMAZON.COM INC	—	2.37
新興国株式	台湾	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	—	6.31
	韓国	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	—	3.87
	ケイマン	TENCENT HOLDINGS LTD	—	3.31
国内リート	日本	日本ビルファンド投資法人	—	6.84
	日本	ジャパンリアルエステイト投資法人	—	5.76
	日本	野村不動産マスターファンド投資法人	—	5.12
先進国リート	アメリカ	PROLOGIS INC	—	8.88
	アメリカ	EQUINIX INC	—	5.43
	アメリカ	WELLTOWER INC	—	3.59

※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12月末までの騰落率です。
※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

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

ターゲットリターンバランスファンド(目標5%)

2023年12月29日現在

基準価額・純資産の推移

基準価額	11,571円	純資産総額	16.3百万円

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

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

2023年12月20日	0円
－	－
－	－
－	－
－	－
設定来累計	0円

主要な資産の状況

■資産の組入比率

資産	比率(%)
RM国内債券マザーファンド	13.4
RM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)	13.5
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	2.0
RM国内株式マザーファンド	12.2
RM先進国株式マザーファンド	37.0
RM新興国株式マザーファンド	7.5
RM国内リートマザーファンド	4.1
RM先進国リートマザーファンド	8.1
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	43.5
米ドル	35.6
ユーロ	4.7
英ポンド	2.0
香港ドル	1.7
その他	12.5
合計	100.0

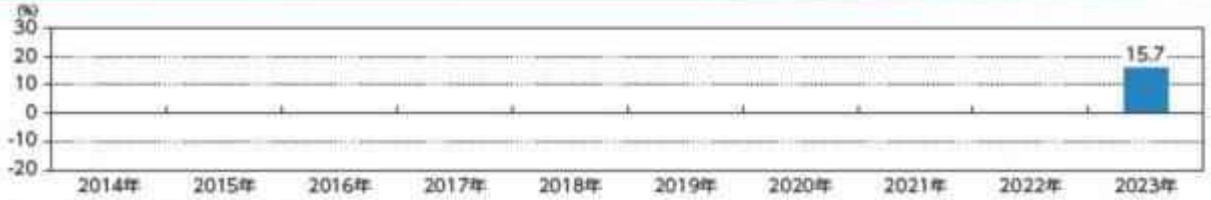
※比率はファンドの純資産総額に対する組入比率であり、四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。
※上記通貨別組入比率は、各マザーファンドが実質的に保有している株式・債券等の通貨を基準に算出しています。
※為替ヘッジをかけている外貨建資産については、日本円に含めています。

■各マザーファンドにおける組入上位銘柄

	国・地域	銘柄名	償還期限	比率(%)
国内債券	日本	第147回利付国債(5年)	2026/3/20	1.63
	日本	第447回利付国債(2年)	2025/4/1	1.59
	日本	第158回利付国債(5年)	2028/3/20	1.35
先進国債券(為替ヘッジあり)	アメリカ	US TREASURY N/B	2032/11/15	0.52
	アメリカ	US TREASURY N/B	2033/8/15	0.45
	アメリカ	US TREASURY N/B	2030/5/15	0.45
先進国債券	アメリカ	US TREASURY N/B	2025/3/31	0.52
	アメリカ	US TREASURY N/B	2033/2/15	0.49
	アメリカ	US TREASURY N/B	2026/10/15	0.47
新興国債券	アイルランド	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	—	82.31
	アメリカ	VANECK J.P.MORGAN EM LOCAL	—	17.49
国内株式	日本	トヨタ自動車	—	4.21
	日本	ソニーグループ	—	2.81
	日本	三菱UFJフィナンシャル・グループ	—	2.15
先進国株式	アメリカ	APPLE INC	—	5.04
	アメリカ	MICROSOFT CORP	—	4.41
	アメリカ	AMAZON.COM INC	—	2.37
新興国株式	台湾	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	—	6.31
	韓国	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	—	3.87
	ケイマン	TENCENT HOLDINGS LTD	—	3.31
国内リート	日本	日本ビルファンド投資法人	—	6.84
	日本	ジャパンリアルエステイト投資法人	—	5.76
	日本	野村不動産マスターファンド投資法人	—	5.12
先進国リート	アメリカ	PROLOGIS INC	—	8.88
	アメリカ	EQUINIX INC	—	5.43
	アメリカ	WELLTOWER INC	—	3.59

※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12月末までの騰落率です。
※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

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

ターゲットリターンバランスファンド(目標6%)

2023年12月29日現在

基準価額・純資産の推移

基準価額	11,941円	純資産総額	31.8百万円

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

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

2023年12月20日	0円
－	－
－	－
－	－
－	－
設定来累計	0円

主要な資産の状況

■資産の組入比率

資産	比率(%)
RM国内債券マザーファンド	5.4
RM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)	5.5
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	2.0
RM国内株式マザーファンド	18.5
RM先進国株式マザーファンド	39.0
RM新興国株式マザーファンド	8.8
RM国内リートマザーファンド	6.2
RM先進国リートマザーファンド	12.4
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(%)
米ドル	40.6
日本円	36.0
ユーロ	5.1
英ポンド	2.3
香港ドル	2.0
その他	14.1
合計	100.0

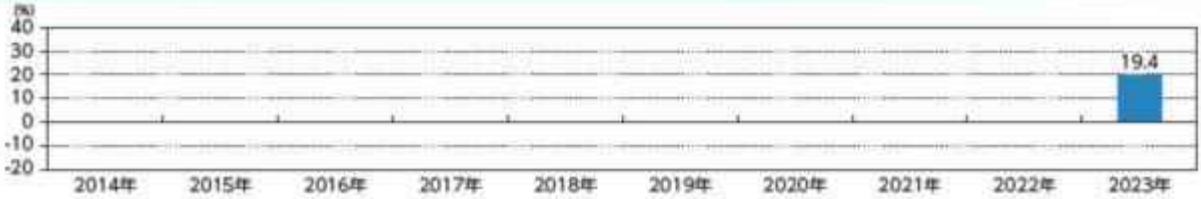
※比率はファンドの純資産総額に対する組入比率であり、四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。
※上記通貨別組入比率は、各マザーファンドが実質的に保有している株式・債券等の通貨を基準に算出しています。
※為替ヘッジをかけている外貨建資産については、日本円に含めています。

■各マザーファンドにおける組入上位銘柄

	国・地域	銘柄名	償還期限	比率(%)
国内債券	日本	第147回利付国債(5年)	2026/3/20	1.63
	日本	第447回利付国債(2年)	2025/4/1	1.59
	日本	第158回利付国債(5年)	2028/3/20	1.35
先進国債券(為替ヘッジあり)	アメリカ	US TREASURY N/B	2032/11/15	0.52
	アメリカ	US TREASURY N/B	2033/8/15	0.45
	アメリカ	US TREASURY N/B	2030/5/15	0.45
先進国債券	アメリカ	US TREASURY N/B	2025/3/31	0.52
	アメリカ	US TREASURY N/B	2033/2/15	0.49
	アメリカ	US TREASURY N/B	2026/10/15	0.47
新興国債券	アイルランド	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	—	82.31
	アメリカ	VANECK J.P.MORGAN EM LOCAL	—	17.49
国内株式	日本	トヨタ自動車	—	4.21
	日本	ソニーグループ	—	2.81
	日本	三菱UFJフィナンシャル・グループ	—	2.15
先進国株式	アメリカ	APPLE INC	—	5.04
	アメリカ	MICROSOFT CORP	—	4.41
	アメリカ	AMAZON.COM INC	—	2.37
新興国株式	台湾	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	—	6.31
	韓国	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	—	3.87
	ケイマン	TENCENT HOLDINGS LTD	—	3.31
国内リート	日本	日本ビルファンド投資法人	—	6.84
	日本	ジャパンリアルエステイト投資法人	—	5.76
	日本	野村不動産マスターファンド投資法人	—	5.12
先進国リート	アメリカ	PROLOGIS INC	—	8.88
	アメリカ	EQUINIX INC	—	5.43
	アメリカ	WELLTOWER INC	—	3.59

※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12月末までの騰落率です。
※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

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

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

（１）申込方法

販売会社所定の方法でお申し込みください。

・各ファンドは、税金を差し引いた後の収益分配金を無手数料で自動的にファンドに再投資する＜分配金

再投資コース（自動けいぞく投資コース）＞専用です。

（２）申込みの受付
販売会社の営業日に受け付けます。

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

（４）取得申込不可日
販売会社の営業日であっても、取得申込日が下記のいずれかに該当する場合は、取得の申込みの受付は行ないません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
・ニューヨークの銀行の休業日
・ニューヨーク証券取引所の休業日
・ロンドンの銀行の休業日
・ロンドン証券取引所の休業日

（５）申込金額
取得申込受付日の翌営業日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額です。

（６）申込単位
販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

（８）受付の中止および取消
委託会社は、金融商品取引所※における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得の申込みの受付を中止すること、および既に受け付けた取得の申込みの受付を取り消すことができます。
※金融商品取引法第２条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第２条第８項第３号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。

２【換金（解約）手続等】

（１）解約の受付
販売会社の営業日に受け付けます。

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

（３）解約請求不可日
販売会社の営業日であっても、解約請求日が下記のいずれかに該当する場合は、解約請求の受付は行ないません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
・ニューヨークの銀行の休業日
・ニューヨーク証券取引所の休業日
・ロンドンの銀行の休業日
・ロンドン証券取引所の休業日

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

（５）解約価額
解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。
・基準価額につきましては、販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

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

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

（７）解約単位
販売会社が定める単位とします。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

（８）解約代金の支払い
原則として、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

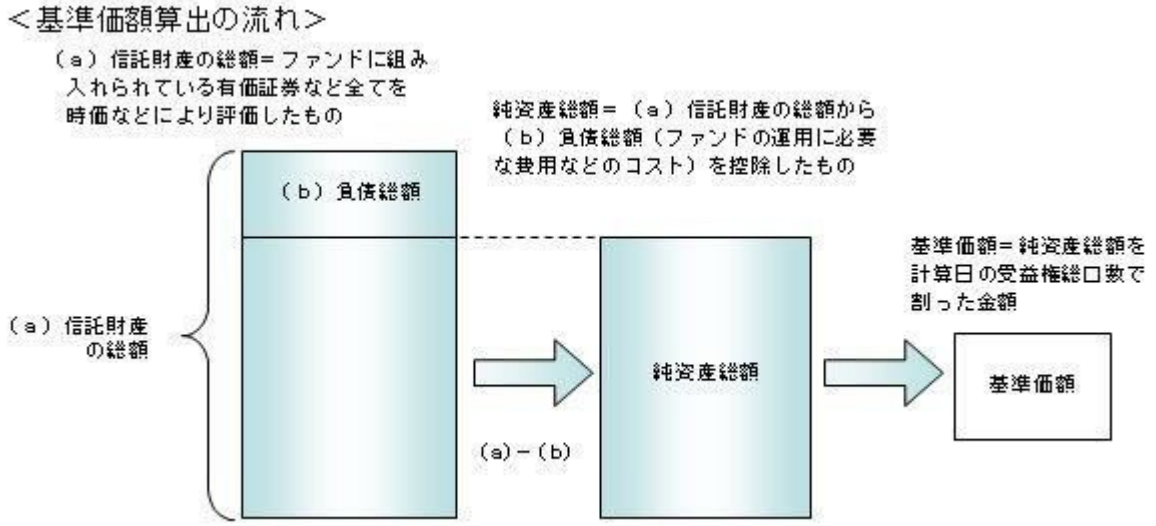
（９）受付の中止および取消
・委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止すること、および既に受け付けた解約請求の受付を取り消すことができます。
・解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日（この計算日が解約請求を受け付けない日であるときは、この計算日以降の最初の解約請求を受け付けることができる日とします。）に解約請求を受け付けたものとして取り扱い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

３【資産管理等の概要】

（１）【資産の評価】

① 基準価額の算出

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



② 有価証券などの評価基準

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

＜主な資産の評価方法＞

◇マザーファンド受益証券
基準価額計算日の基準価額で評価します。

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

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

◇公社債（国内・外国）
原則として、基準価額計算日*における以下のいずれかの価額で評価します。
・日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）
・金融商品取引業者（第一種金融商品取引業者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。）、銀行などの提示する価額（売気配相場を除きます。）
・価格情報会社の提供する価額
※残存期間１年以内の公社債などについては、一部償却原価法により評価することができます。
＊外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

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

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

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

③ 基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

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

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

無期限とします（2023年3月17日設定）。ただし、約款の規定に基づき、信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

（４）【計算期間】

毎年12月21日から翌年12月20日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

（５）【その他】

① 信託の終了（繰上償還）

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

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

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

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

② 償還金について

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

③ 信託約款の変更など

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

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

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

④ 書面決議

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

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

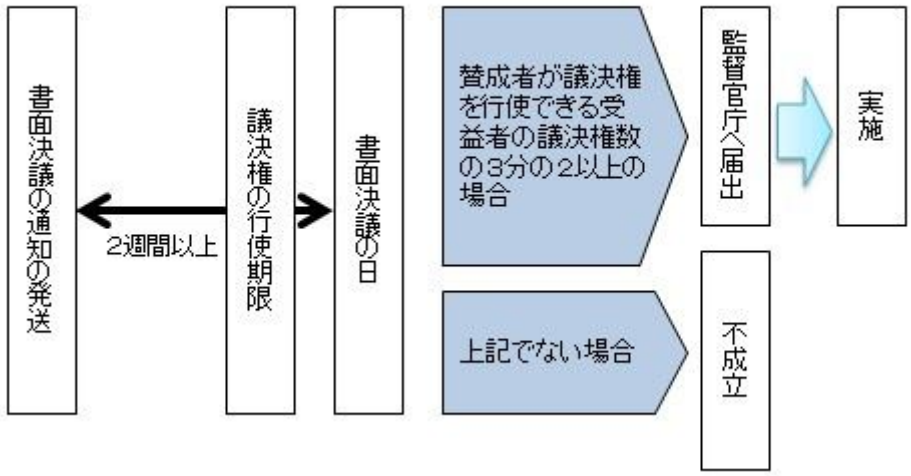
３）書面決議は、議決権を行使することができる受益者の議決権の３分の２以上にあたる多数をもって行ないます。

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

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

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

＜書面決議の主な流れ＞



⑤　公告
公告は電子公告により行ない、委託会社のホームページに掲載します。
　ホームページアドレス　https://www.resona-am.co.jp/
※なお、やむを得ない事由によって公告を電子公告によって行なうことができない場合には、公告は日本経済新聞に掲載します。

⑥　運用報告書の作成
・委託会社は、毎期決算後および償還後に期中の運用経過、組入有価証券の内容および有価証券の売買状況などを記載した運用報告書を作成します。
・交付運用報告書は、原則として知れている受益者に対して交付されます。
・運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページに掲載されます。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の交付請求があった場合には、交付します。
　ホームページアドレス　https://www.resona-am.co.jp/

⑦　関係法人との契約について
販売会社との募集の取扱いなどに関する契約の有効期間は契約日より１年間とします。ただし、期間満了の３ヵ月前までに、販売会社、委託会社いずれからも別段の意思表示がないときは、自動的に１年間延長されるものとし、以後も同様とします。

⑧　他の受益者の氏名などの開示の請求の制限
受益者は、委託会社または受託会社に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行なうことはできません。
１．他の受益者の氏名または名称および住所
２．他の受益者が有する受益権の内容

４【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

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

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

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

第３【ファンドの経理状況】

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

（２）　当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1期計算期間(2023年 3月17日から2023年12月20日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

１【財務諸表】

【ターゲットリターンバランスファンド（目標２％）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 2023年12月20日現在
資産の部	
流動資産	
金銭信託	103,978
親投資信託受益証券	20,413,780
流動資産合計	20,517,758
資産合計	20,517,758
負債の部	
流動負債	
未払解約金	55,115
未払受託者報酬	815
未払委託者報酬	18,272
その他未払費用	128
流動負債合計	74,330
負債合計	74,330
純資産の部	
元本等	
元本	19,468,413
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	975,015
（分配準備積立金）	502,098
元本等合計	20,443,428
純資産合計	20,443,428
負債純資産合計	20,517,758

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自　2023年 3月17日 至　2023年12月20日
営業収益	
有価証券売買等損益	539,180
営業収益合計	539,180
営業費用	
支払利息	8
受託者報酬	1,067
委託者報酬	23,625
その他費用	314
営業費用合計	25,014
営業利益又は営業損失（△）	514,166
経常利益又は経常損失（△）	514,166
当期純利益又は当期純損失（△）	514,166
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	12,068
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	495,564
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	495,564
剰余金減少額又は欠損金増加額	22,647
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	22,647
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	975,015

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１.有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
２.その他財務諸表作成のための基礎となる事項	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、設定日（2023年 3月17日）から2023年12月20日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

第1期 2023年12月20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	19,527,807円
期中一部解約元本額	1,059,394円
２． 計算期間の末日における受益権の総数	19,468,413口
３． 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.0501円
(10,000口当たり純資産額)	(10,501円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第1期 自 2023年 3月17日 至 2023年12月20日	
分配金の計算過程	
A 費用控除後の配当等収益額	59,948円
B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	442,150円
C 収益調整金額	472,917円
D 分配準備積立金額	0円
E 当ファンドの分配対象収益額(E=A+B+C+D)	975,015円
F 当ファンドの期末残存口数	19,468,413口
G 10,000口当たり収益分配対象額(G=E/F×10,000)	500円
H 10,000口当たり分配金額	0円
I 収益分配金金額(I=F×H/10,000)	0円

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

第1期 自 2023年 3月17日 至 2023年12月20日
１.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 ２.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、株価変動リスク、金利変動リスク、リートの価格変動リスク、投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 ３.金融商品に係るリスク管理体制 運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

第1期 2023年12月20日現在
１.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 ２.時価の算定方法 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。

（関連当事者との取引に関する注記）

第1期 自 2023年 3月17日 至 2023年12月20日
該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）
該当事項はありません。

（その他の注記）
1　有価証券に関する注記
売買目的有価証券

種類	第1期 自 2023年 3月17日 至 2023年12月20日
	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	526,611
合計	526,611

2　デリバティブ取引に関する注記
該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１　有価証券明細表
(1)株式
該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種　類	銘　柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	RM国内債券マザーファンド	6,899,959	6,960,678	
	RM先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	7,969,548	6,897,643	
	RM先進国債券マザーファンド	1,013,935	1,230,714	
	RM新興国債券マザーファンド	303,473	407,382	
	RM国内株式マザーファンド	679,165	1,227,251	
	RM先進国株式マザーファンド	770,165	2,068,971	
	RM新興国株式マザーファンド	229,674	403,720	
	RM国内リートマザーファンド	282,588	399,720	
	RM先進国リートマザーファンド	503,697	817,701	
合計		18,652,204	20,413,780	

(注)券面総額欄の数値は口数を表しております。

第２　信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

【ターゲットリターンバランスファンド（目標３％）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 2023年12月20日現在
資産の部	
流動資産	
金銭信託	43,258
親投資信託受益証券	10,586,799
流動資産合計	10,630,057
資産合計	10,630,057
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	525
未払委託者報酬	11,637
その他未払費用	92
流動負債合計	12,254
負債合計	12,254
純資産の部	
元本等	
元本	9,779,162
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	838,641
（分配準備積立金）	319,868
元本等合計	10,617,803
純資産合計	10,617,803
負債純資産合計	10,630,057

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自　2023年 3月17日 至　2023年12月20日
営業収益	
有価証券売買等損益	341,399
営業収益合計	341,399
営業費用	
支払利息	7
受託者報酬	729
委託者報酬	16,002
その他費用	278
営業費用合計	17,016
営業利益又は営業損失（△）	324,383
経常利益又は経常損失（△）	324,383
当期純利益又は当期純損失（△）	324,383
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	4,515
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	563,049
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	563,049
剰余金減少額又は欠損金増加額	44,276
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	44,276
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	838,641

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１.有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
２.その他財務諸表作成のための基礎となる事項	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、設定日（2023年 3月17日）から2023年12月20日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

第1期 2023年12月20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	9,772,079円
期中一部解約元本額	992,917円
２． 計算期間の末日における受益権の総数	
	9,779,162口
３． 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.0858円
(10,000口当たり純資産額)	(10,858円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第1期 自 2023年 3月17日 至 2023年12月20日	
分配金の計算過程	
A 費用控除後の配当等収益額	41,799円
B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	278,069円
C 収益調整金額	518,773円
D 分配準備積立金額	0円
E 当ファンドの分配対象収益額(E=A+B+C+D)	838,641円
F 当ファンドの期末残存口数	9,779,162口
G 10,000口当たり収益分配対象額(G=E/F×10,000)	857円
H 10,000口当たり分配金額	0円
I 収益分配金金額(I=F×H/10,000)	0円

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

第1期 自 2023年 3月17日 至 2023年12月20日
１.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 ２.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、株価変動リスク、金利変動リスク、リートの価格変動リスク、投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 ３.金融商品に係るリスク管理体制 運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

第1期 2023年12月20日現在
１.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 ２.時価の算定方法 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。

（関連当事者との取引に関する注記）

第1期 自 2023年 3月17日 至 2023年12月20日
該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）
該当事項はありません。

（その他の注記）
1　有価証券に関する注記
売買目的有価証券

種類	第1期 自 2023年 3月17日 至 2023年12月20日
	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	334,131
合計	334,131

2　デリバティブ取引に関する注記
該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１　有価証券明細表
(1)株式
該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種　類	銘　柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	RM国内債券マザーファンド	2,992,157	3,018,487	
	RM先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	3,456,040	2,991,202	
	RM先進国債券マザーファンド	172,989	209,974	
	RM新興国債券マザーファンド	157,115	210,911	
	RM国内株式マザーファンド	421,131	760,983	
	RM先進国株式マザーファンド	886,662	2,381,928	
	RM新興国株式マザーファンド	218,035	383,261	
	RM国内リートマザーファンド	146,271	206,900	
	RM先進国リートマザーファンド	260,659	423,153	
合計		8,711,059	10,586,799	

(注)券面総額欄の数値は口数を表しております。

第２　信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

【ターゲットリターンバランスファンド（目標４％）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 2023年12月20日現在
資産の部	
流動資産	
金銭信託	127,840
親投資信託受益証券	39,196,246
流動資産合計	39,324,086
資産合計	39,324,086
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	1,835
未払委託者報酬	40,888
その他未払費用	320
流動負債合計	43,043
負債合計	43,043
純資産の部	
元本等	
元本	34,972,966
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	4,308,077
（分配準備積立金）	1,341,542
元本等合計	39,281,043
純資産合計	39,281,043
負債純資産合計	39,324,086

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自　2023年 3月17日 至　2023年12月20日
営業収益	
有価証券売買等損益	1,393,846
営業収益合計	1,393,846
営業費用	
支払利息	7
受託者報酬	2,152
委託者報酬	47,758
その他費用	506
営業費用合計	50,423
営業利益又は営業損失（△）	1,343,423
経常利益又は経常損失（△）	1,343,423
当期純利益又は当期純損失（△）	1,343,423
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	1,881
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	3,019,957
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,019,957
剰余金減少額又は欠損金増加額	53,422
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	53,422
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	4,308,077

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１.有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
２.その他財務諸表作成のための基礎となる事項	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、設定日（2023年 3月17日）から2023年12月20日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

第1期 2023年12月20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	34,642,710円
期中一部解約元本額	669,744円
２． 計算期間の末日における受益権の総数	34,972,966口
３． 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.1232円
(10,000口当たり純資産額)	(11,232円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第1期 自 2023年 3月17日 至 2023年12月20日	
分配金の計算過程	
A 費用控除後の配当等収益額	126,532円
B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	1,215,010円
C 収益調整金額	2,966,535円
D 分配準備積立金額	0円
E 当ファンドの分配対象収益額(E=A+B+C+D)	4,308,077円
F 当ファンドの期末残存口数	34,972,966口
G 10,000口当たり収益分配対象額(G=E/F×10,000)	1,231円
H 10,000口当たり分配金額	0円
I 収益分配金金額(I=F×H/10,000)	0円

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

第1期 自 2023年 3月17日 至 2023年12月20日
１.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 ２.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、株価変動リスク、金利変動リスク、リートの価格変動リスク、投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 ３.金融商品に係るリスク管理体制 運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

第1期 2023年12月20日現在
１.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 ２.時価の算定方法 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。

（関連当事者との取引に関する注記）

第1期 自 2023年 3月17日 至 2023年12月20日
該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）
該当事項はありません。

（その他の注記）
1　有価証券に関する注記
売買目的有価証券

種類	第1期 自 2023年 3月17日 至 2023年12月20日
	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	1,389,729
合計	1,389,729

2　デリバティブ取引に関する注記
該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１　有価証券明細表
(1)株式
該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種　類	銘　柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	RM国内債券マザーファンド	8,139,399	8,211,025	
	RM先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	9,401,295	8,136,820	
	RM先進国債券マザーファンド	639,224	775,890	
	RM新興国債券マザーファンド	580,501	779,264	
	RM国内株式マザーファンド	1,986,312	3,589,265	
	RM先進国株式マザーファンド	4,443,211	11,936,242	
	RM新興国株式マザーファンド	1,252,176	2,201,074	
	RM国内リートマザーファンド	829,660	1,173,554	
	RM先進国リートマザーファンド	1,474,136	2,393,112	
合計		28,745,914	39,196,246	

(注)券面総額欄の数値は口数を表しております。

第２　信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

【ターゲットリターンバランスファンド（目標５％）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 2023年12月20日現在
資産の部	
流動資産	
金銭信託	68,441
親投資信託受益証券	15,510,280
流動資産合計	15,578,721
資産合計	15,578,721
負債の部	
流動負債	
未払解約金	2,049
未払受託者報酬	902
未払委託者報酬	20,136
その他未払費用	136
流動負債合計	23,223
負債合計	23,223
純資産の部	
元本等	
元本	13,416,736
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	2,138,762
（分配準備積立金）	617,812
元本等合計	15,555,498
純資産合計	15,555,498
負債純資産合計	15,578,721

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自　2023年 3月17日 至　2023年12月20日
営業収益	
有価証券売買等損益	672,480
営業収益合計	672,480
営業費用	
支払利息	7
受託者報酬	1,207
委託者報酬	26,766
その他費用	322
営業費用合計	28,302
営業利益又は営業損失（△）	644,178
経常利益又は経常損失（△）	644,178
当期純利益又は当期純損失（△）	644,178
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	26,366
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	1,601,316
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,601,316
剰余金減少額又は欠損金増加額	80,366
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	80,366
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	2,138,762

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１.有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
２.その他財務諸表作成のための基礎となる事項	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、設定日（2023年 3月17日）から2023年12月20日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

第1期 2023年12月20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	13,179,324円
期中一部解約元本額	762,588円
２． 計算期間の末日における受益権の総数	13,416,736口
３． 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.1594円
(10,000口当たり純資産額)	(11,594円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第1期 自 2023年 3月17日 至 2023年12月20日	
分配金の計算過程	
A 費用控除後の配当等収益額	75,658円
B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	542,154円
C 収益調整金額	1,520,950円
D 分配準備積立金額	0円
E 当ファンドの分配対象収益額(E=A+B+C+D)	2,138,762円
F 当ファンドの期末残存口数	13,416,736口
G 10,000口当たり収益分配対象額(G=E/F×10,000)	1,594円
H 10,000口当たり分配金額	0円
I 収益分配金金額(I=F×H/10,000)	0円

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

第1期 自 2023年 3月17日 至 2023年12月20日
１.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 ２.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、株価変動リスク、金利変動リスク、リートの価格変動リスク、投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 ３.金融商品に係るリスク管理体制 運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

第1期 2023年12月20日現在
１.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 ２.時価の算定方法 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。

（関連当事者との取引に関する注記）

第1期 自 2023年 3月17日 至 2023年12月20日
該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）
該当事項はありません。

（その他の注記）
1　有価証券に関する注記
売買目的有価証券

種類	第1期 自 2023年 3月17日 至 2023年12月20日
	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	643,059
合計	643,059

2　デリバティブ取引に関する注記
該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１　有価証券明細表
(1)株式
該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種　類	銘　柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	RM国内債券マザーファンド	2,070,755	2,088,977	
	RM先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	2,391,913	2,070,200	
	RM先進国債券マザーファンド	252,485	306,466	
	RM新興国債券マザーファンド	229,280	307,785	
	RM国内株式マザーファンド	1,040,625	1,880,409	
	RM先進国株式マザーファンド	2,171,619	5,833,837	
	RM新興国株式マザーファンド	655,487	1,152,215	
	RM国内リートマザーファンド	435,437	615,925	
	RM先進国リートマザーファンド	772,740	1,254,466	
合計		10,020,341	15,510,280	

(注)券面総額欄の数値は口数を表しております。

第２　信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

【ターゲットリターンバランスファンド（目標６％）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 2023年12月20日現在
資産の部	
流動資産	
金銭信託	118,324
親投資信託受益証券	30,398,447
流動資産合計	30,516,771
資産合計	30,516,771
負債の部	
流動負債	
未払解約金	4,080
未払受託者報酬	1,502
未払委託者報酬	33,503
その他未払費用	254
流動負債合計	39,339
負債合計	39,339
純資産の部	
元本等	
元本	25,500,922
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	4,976,510
（分配準備積立金）	1,166,791
元本等合計	30,477,432
純資産合計	30,477,432
負債純資産合計	30,516,771

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自　2023年 3月17日 至　2023年12月20日
営業収益	
有価証券売買等損益	1,241,347
営業収益合計	1,241,347
営業費用	
支払利息	9
受託者報酬	1,853
委託者報酬	41,242
その他費用	440
営業費用合計	43,544
営業利益又は営業損失（△）	1,197,803
経常利益又は経常損失（△）	1,197,803
当期純利益又は当期純損失（△）	1,197,803
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	31,012
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	3,929,094
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,929,094
剰余金減少額又は欠損金増加額	119,375
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	119,375
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	4,976,510

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１.有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
２.その他財務諸表作成のための基礎となる事項	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、設定日（2023年 3月17日）から2023年12月20日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

第1期 2023年12月20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	25,356,514円
期中一部解約元本額	855,592円
２． 計算期間の末日における受益権の総数	
	25,500,922口
３． 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.1952円
(10,000口当たり純資産額)	(11,952円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第1期 自 2023年 3月17日 至 2023年12月20日	
分配金の計算過程	
A 費用控除後の配当等収益額	122,785円
B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	1,044,006円
C 収益調整金額	3,809,719円
D 分配準備積立金額	0円
E 当ファンドの分配対象収益額(E=A+B+C+D)	4,976,510円
F 当ファンドの期末残存口数	25,500,922口
G 10,000口当たり収益分配対象額(G=E/F×10,000)	1,951円
H 10,000口当たり分配金額	0円
I 収益分配金金額(I=F×H/10,000)	0円

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

第1期 自 2023年 3月17日 至 2023年12月20日
１.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 ２.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、株価変動リスク、金利変動リスク、リートの価格変動リスク、投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 ３.金融商品に係るリスク管理体制 運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

第1期 2023年12月20日現在
１.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 ２.時価の算定方法 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。

（関連当事者との取引に関する注記）

第1期 自 2023年 3月17日 至 2023年12月20日
該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）
該当事項はありません。

（その他の注記）
1　有価証券に関する注記
売買目的有価証券

種類	第1期 自 2023年 3月17日 至 2023年12月20日
	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	1,237,143
合計	1,237,143

2　デリバティブ取引に関する注記
該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１　有価証券明細表
(1)株式
該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種　類	銘　柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	RM国内債券マザーファンド	1,637,314	1,651,722	
	RM先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	1,899,697	1,644,187	
	RM先進国債券マザーファンド	488,297	592,694	
	RM新興国債券マザーファンド	443,416	595,241	
	RM国内株式マザーファンド	3,106,005	5,612,551	
	RM先進国株式マザーファンド	4,479,015	12,032,425	
	RM新興国株式マザーファンド	1,494,987	2,627,888	
	RM国内リートマザーファンド	1,298,394	1,836,578	
	RM先進国リートマザーファンド	2,343,946	3,805,161	
合計		17,191,071	30,398,447	

(注)券面総額欄の数値は口数を表しております。

第２　信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

（参考）
「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、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12月20日現在
資産の部	
流動資産	
金銭信託	1,494,642,208
国債証券	172,715,989,570
地方債証券	9,932,887,800
特殊債券	10,443,566,395
社債券	8,206,600,000
未収利息	167,525,064
前払費用	22,862,857
流動資産合計	202,984,073,894
資産合計	202,984,073,894
負債の部	
流動負債	
未払金	100,000,000
未払解約金	505,220,000
その他未払費用	2,528
流動負債合計	605,222,528
負債合計	605,222,528
純資産の部	
元本等	
元本	200,621,088,482
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	1,757,762,884
元本等合計	202,378,851,366
純資産合計	202,378,851,366
負債純資産合計	202,984,073,894

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12月20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	121,731,518,008円
期中一部解約元本額	51,752,613,835円
期末元本額	200,621,088,482円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド（安定型）	12,706,853,452円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	10,516,473,580円
りそなラップ型ファンド（成長型）	2,626,874,282円
ＤＣりそな　グローバルバランス	1,013,578,716円
つみたてバランスファンド	8,183,255,642円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	6,248,420,842円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	1,869,601,296円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	598,772,000円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	1,046,103,733円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	321,325,862円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	78,170,238円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	96,028,215円
りそな　つみたてラップ型ファンド（安定型）	366,932,000円
りそな　つみたてラップ型ファンド（安定成長型）	272,438,731円
りそな　つみたてラップ型ファンド（成長型）	67,289,285円
りそな　つみたてリスクコントロールファンド	131,906,724円

ターゲットリターンバランスファンド（目標２％）	6,899,959円
ターゲットリターンバランスファンド（目標３％）	2,992,157円
ターゲットリターンバランスファンド（目標４％）	8,139,399円
ターゲットリターンバランスファンド（目標５％）	2,070,755円
ターゲットリターンバランスファンド（目標６％）	1,637,314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	205,094,436円
ＦＷりそな国内債券インデックスファンド	135,224,399,585円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　国内債券インデックス	2,678,717,249円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	2,067,516,890円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	1,554,647,424円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	410,790,077円
りそなＦＴ　国内債券インデックス（適格機関投資家専用）	6,698,593,148円
りそなＦＴ　ＲＣバランスファンド（適格機関投資家専用）	4,735,105,783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）	48,240,471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）	47,503,835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）	74,663,532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）	790,073円
りそなマルチアセットファンド（適格機関投資家専用）	356,476,380円
２．　計算日における受益権の総数	200,621,088,482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	1.0088円
(10,000口当たり純資産額)	(10,088円)

（注）※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

2023年12月20日現在
１.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 ２.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 ３.金融商品に係るリスク管理体制 運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

2023年12月20日現在
１.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 ２.時価の算定方法 国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。 ３.金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

2023年12月20日現在
該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1　有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2023年12月20日現在
	損益に含まれた評価差額（円）

国債証券	601,879,580
地方債証券	33,028,840
特殊債券	29,585,008
社債券	31,061,000
合計	695,554,428

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

2　デリバティブ取引に関する注記
該当事項はありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表
(1)株式
該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種　類	銘　柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第４４４回利付国債（２年）	440,000,000	440,224,400	
	第４４５回利付国債（２年）	210,000,000	210,105,000	
	第４４６回利付国債（２年）	130,000,000	130,061,100	
	第４４７回利付国債（２年）	3,220,000,000	3,221,223,600	
	第４４８回利付国債（２年）	420,000,000	420,113,400	
	第４４９回利付国債（２年）	1,230,000,000	1,230,258,300	
	第４５０回利付国債（２年）	2,430,000,000	2,430,364,500	
	第４５１回利付国債（２年）	280,000,000	280,067,200	
	第４５２回利付国債（２年）	1,000,000,000	1,000,000,000	
	第４５３回利付国債（２年）	1,190,000,000	1,189,678,700	
	第４５４回利付国債（２年）	600,000,000	601,056,000	
	第１４３回利付国債（５年）	1,010,000,000	1,011,626,100	
	第１４４回利付国債（５年）	1,000,000,000	1,001,570,000	
	第１４５回利付国債（５年）	1,770,000,000	1,772,938,200	
	第１４６回利付国債（５年）	2,430,000,000	2,434,106,700	
	第１４７回利付国債（５年）	3,320,000,000	3,318,871,200	
	第１４８回利付国債（５年）	2,410,000,000	2,408,481,700	
	第１４９回利付国債（５年）	2,240,000,000	2,237,827,200	
	第１５０回利付国債（５年）	2,370,000,000	2,366,445,000	
	第１５１回利付国債（５年）	270,000,000	269,430,300	
	第１５２回利付国債（５年）	2,130,000,000	2,132,066,100	
	第１５３回利付国債（５年）	2,510,000,000	2,502,997,100	
	第１５４回利付国債（５年）	1,670,000,000	1,669,682,700	
	第１５５回利付国債（５年）	90,000,000	90,626,400	
	第１５６回利付国債（５年）	2,200,000,000	2,206,556,000	
	第１５７回利付国債（５年）	220,000,000	220,508,200	
	第１５８回利付国債（５年）	2,740,000,000	2,734,794,000	
	第１５９回利付国債（５年）	490,000,000	488,686,800	

第１６０回利付国債（５年）	480,000,000	480,854,400	
第１６１回利付国債（５年）	1,450,000,000	1,458,729,000	
第１６２回利付国債（５年）	660,000,000	663,253,800	
第１６３回利付国債（５年）	570,000,000	575,358,000	
第１回利付国債（４０年）	100,000,000	119,945,000	
第２回利付国債（４０年）	180,000,000	208,216,800	
第３回利付国債（４０年）	110,000,000	127,132,500	
第４回利付国債（４０年）	170,000,000	196,820,900	
第５回利付国債（４０年）	220,000,000	244,981,000	
第６回利付国債（４０年）	200,000,000	218,482,000	
第７回利付国債（４０年）	410,000,000	427,502,900	
第８回利付国債（４０年）	470,000,000	455,157,400	
第９回利付国債（４０年）	790,000,000	563,198,900	
第１０回利付国債（４０年）	710,000,000	593,134,000	
第１１回利付国債（４０年）	580,000,000	466,511,400	
第１２回利付国債（４０年）	590,000,000	422,776,300	
第１３回利付国債（４０年）	790,000,000	560,426,000	
第１４回利付国債（４０年）	760,000,000	574,879,200	
第１５回利付国債（４０年）	850,000,000	707,183,000	
第１６回利付国債（４０年）	400,000,000	363,620,000	
第３３８回利付国債（１０年）	631,000,000	634,375,850	
第３３９回利付国債（１０年）	385,000,000	387,329,250	
第３４０回利付国債（１０年）	934,000,000	940,444,600	
第３４１回利付国債（１０年）	440,000,000	442,503,600	
第３４２回利付国債（１０年）	380,000,000	380,680,200	
第３４３回利付国債（１０年）	780,000,000	781,357,200	
第３４４回利付国債（１０年）	960,000,000	961,574,400	
第３４５回利付国債（１０年）	1,070,000,000	1,071,433,800	
第３４６回利付国債（１０年）	1,310,000,000	1,311,270,700	
第３４７回利付国債（１０年）	750,000,000	750,390,000	
第３４８回利付国債（１０年）	1,690,000,000	1,689,678,900	
第３４９回利付国債（１０年）	1,340,000,000	1,338,660,000	
第３５０回利付国債（１０年）	980,000,000	978,138,000	
第３５１回利付国債（１０年）	1,360,000,000	1,356,355,200	
第３５２回利付国債（１０年）	1,180,000,000	1,174,725,400	
第３５３回利付国債（１０年）	1,950,000,000	1,939,860,000	
第３５４回利付国債（１０年）	1,440,000,000	1,431,028,800	
第３５５回利付国債（１０年）	1,720,000,000	1,708,321,200	
第３５６回利付国債（１０年）	1,770,000,000	1,756,441,800	
第３５７回利付国債（１０年）	1,890,000,000	1,873,235,700	
第３５８回利付国債（１０年）	1,740,000,000	1,722,356,400	
第３５９回利付国債（１０年）	2,370,000,000	2,342,034,000	
第３６０回利付国債（１０年）	2,210,000,000	2,180,032,400	

第３６１回利付国債（１０年）	1,980,000,000	1,949,508,000	
第３６２回利付国債（１０年）	1,950,000,000	1,914,880,500	
第３６３回利付国債（１０年）	1,890,000,000	1,851,425,100	
第３６４回利付国債（１０年）	2,120,000,000	2,071,409,600	
第３６５回利付国債（１０年）	1,960,000,000	1,909,980,800	
第３６６回日本国債（１０年）	2,540,000,000	2,489,504,800	
第３６７回日本国債（１０年）	2,290,000,000	2,238,566,600	
第３６８回日本国債（１０年）	1,890,000,000	1,843,241,400	
第３６９回日本国債（１０年）	1,890,000,000	1,889,168,400	
第３７０回利付国債（１０年）	1,540,000,000	1,536,596,600	
第３７１回利付国債（１０年）	1,600,000,000	1,579,040,000	
第３７２回利付国債（１０年）	1,040,000,000	1,063,556,000	
第１回利付国債（３０年）	60,000,000	68,786,400	
第７回利付国債（３０年）	40,000,000	46,071,600	
第１０回利付国債（３０年）	30,000,000	31,548,300	
第１１回利付国債（３０年）	80,000,000	88,581,600	
第１２回利付国債（３０年）	80,000,000	91,684,000	
第１３回利付国債（３０年）	200,000,000	227,588,000	
第１４回利付国債（３０年）	60,000,000	70,729,800	
第１５回利付国債（３０年）	200,000,000	238,226,000	
第１６回利付国債（３０年）	140,000,000	166,941,600	
第１７回利付国債（３０年）	160,000,000	189,515,200	
第１８回利付国債（３０年）	60,000,000	70,483,800	
第１９回利付国債（３０年）	100,000,000	117,649,000	
第２０回利付国債（３０年）	100,000,000	119,995,000	
第２１回利付国債（３０年）	180,000,000	212,108,400	
第２２回利付国債（３０年）	50,000,000	60,115,500	
第２３回利付国債（３０年）	220,000,000	264,741,400	
第２４回利付国債（３０年）	170,000,000	204,853,400	
第２５回利付国債（３０年）	200,000,000	236,292,000	
第２６回利付国債（３０年）	205,000,000	245,009,850	
第２７回利付国債（３０年）	295,000,000	356,891,000	
第２８回利付国債（３０年）	290,000,000	351,018,900	
第２９回利付国債（３０年）	150,000,000	179,761,500	
第３０回利付国債（３０年）	190,000,000	224,903,000	
第３１回利付国債（３０年）	170,000,000	198,701,100	
第３２回利付国債（３０年）	335,000,000	395,856,100	
第３３回利付国債（３０年）	290,000,000	329,005,000	
第３４回利付国債（３０年）	335,000,000	389,822,750	
第３５回利付国債（３０年）	406,000,000	459,234,720	
第３６回利付国債（３０年）	425,000,000	480,560,250	
第３７回利付国債（３０年）	570,000,000	634,951,500	
第３８回利付国債（３０年）	220,000,000	240,823,000	

第３９回利付国債（３０年）	380,000,000	421,693,600	
第４０回利付国債（３０年）	275,000,000	300,143,250	
第４１回利付国債（３０年）	385,000,000	413,047,250	
第４２回利付国債（３０年）	440,000,000	471,605,200	
第４３回利付国債（３０年）	340,000,000	364,072,000	
第４４回利付国債（３０年）	450,000,000	481,774,500	
第４５回利付国債（３０年）	450,000,000	464,841,000	
第４６回利付国債（３０年）	580,000,000	598,310,600	
第４７回利付国債（３０年）	570,000,000	597,724,800	
第４８回利付国債（３０年）	463,000,000	467,676,300	
第４９回利付国債（３０年）	520,000,000	524,409,600	
第５０回利付国債（３０年）	560,000,000	499,615,200	
第５１回利付国債（３０年）	590,000,000	467,763,800	
第５２回利付国債（３０年）	560,000,000	463,836,800	
第５３回利付国債（３０年）	510,000,000	431,143,800	
第５４回利付国債（３０年）	550,000,000	485,314,500	
第５５回利付国債（３０年）	320,000,000	281,571,200	
第５６回利付国債（３０年）	510,000,000	447,484,200	
第５７回利付国債（３０年）	540,000,000	472,462,200	
第５８回利付国債（３０年）	820,000,000	715,400,800	
第５９回利付国債（３０年）	490,000,000	416,049,200	
第６０回利付国債（３０年）	450,000,000	399,825,000	
第６１回利付国債（３０年）	440,000,000	371,276,400	
第６２回利付国債（３０年）	530,000,000	423,263,300	
第６３回利付国債（３０年）	410,000,000	317,454,800	
第６４回利付国債（３０年）	500,000,000	385,660,000	
第６５回利付国債（３０年）	400,000,000	307,632,000	
第６６回利付国債（３０年）	620,000,000	474,591,400	
第６７回利付国債（３０年）	460,000,000	371,293,600	
第６８回利付国債（３０年）	580,000,000	466,546,200	
第６９回利付国債（３０年）	540,000,000	445,429,800	
第７０回利付国債（３０年）	800,000,000	658,392,000	
第７１回利付国債（３０年）	540,000,000	442,967,400	
第７２回利付国債（３０年）	570,000,000	466,488,000	
第７３回利付国債（３０年）	470,000,000	383,755,000	
第７４回利付国債（３０年）	720,000,000	636,580,800	
第７５回利付国債（３０年）	550,000,000	523,853,000	
第７６回利付国債（３０年）	460,000,000	448,504,600	
第７７回利付国債（３０年）	530,000,000	541,251,900	
第７８回利付国債（３０年）	740,000,000	720,560,200	
第７９回利付国債（３０年）	550,000,000	508,970,000	
第８０回利付国債（３０年）	260,000,000	277,469,400	
第７５回利付国債（２０年）	100,000,000	102,650,000	

第７６回利付国債（２０年）	100,000,000	102,401,000	
第７７回利付国債（２０年）	20,000,000	20,505,000	
第７８回利付国債（２０年）	50,000,000	51,424,500	
第７９回利付国債（２０年）	20,000,000	20,599,800	
第８０回利付国債（２０年）	90,000,000	92,834,100	
第８１回利付国債（２０年）	30,000,000	31,045,800	
第８２回利付国債（２０年）	170,000,000	176,223,700	
第８３回利付国債（２０年）	10,000,000	10,416,300	
第８４回利付国債（２０年）	120,000,000	124,755,600	
第８５回利付国債（２０年）	150,000,000	156,997,500	
第８６回利付国債（２０年）	100,000,000	105,113,000	
第８７回利付国債（２０年）	90,000,000	94,400,100	
第８８回利付国債（２０年）	185,000,000	195,472,850	
第８９回利付国債（２０年）	120,000,000	126,494,400	
第９０回利付国債（２０年）	170,000,000	180,079,300	
第９１回利付国債（２０年）	80,000,000	84,962,400	
第９２回利付国債（２０年）	255,000,000	270,603,450	
第９３回利付国債（２０年）	80,000,000	84,996,800	
第９４回利付国債（２０年）	140,000,000	149,198,000	
第９５回利付国債（２０年）	185,000,000	199,317,150	
第９６回利付国債（２０年）	70,000,000	74,929,400	
第９７回利付国債（２０年）	130,000,000	140,193,300	
第９８回利付国債（２０年）	70,000,000	75,226,900	
第９９回利付国債（２０年）	85,000,000	91,694,600	
第１００回利付国債（２０年）	151,000,000	164,121,900	
第１０１回利付国債（２０年）	20,000,000	21,906,800	
第１０２回利付国債（２０年）	145,000,000	159,533,350	
第１０３回利付国債（２０年）	100,000,000	109,576,000	
第１０４回利付国債（２０年）	10,000,000	10,868,300	
第１０５回利付国債（２０年）	12,000,000	13,081,560	
第１０６回利付国債（２０年）	40,000,000	43,793,200	
第１０７回利付国債（２０年）	80,000,000	87,541,600	
第１０８回利付国債（２０年）	220,000,000	238,563,600	
第１０９回利付国債（２０年）	80,000,000	87,012,000	
第１１０回利付国債（２０年）	195,000,000	214,113,900	
第１１１回利付国債（２０年）	50,000,000	55,390,500	
第１１２回利付国債（２０年）	205,000,000	225,987,900	
第１１３回利付国債（２０年）	85,000,000	94,043,150	
第１１４回利付国債（２０年）	160,000,000	177,593,600	
第１１５回利付国債（２０年）	100,000,000	111,587,000	
第１１６回利付国債（２０年）	140,000,000	156,783,200	
第１１７回利付国債（２０年）	225,000,000	250,589,250	
第１１８回利付国債（２０年）	131,000,000	145,467,640	

第１１９回利付国債（２０年）	150,000,000	164,650,500	
第１２０回利付国債（２０年）	240,000,000	260,376,000	
第１２１回利付国債（２０年）	115,000,000	127,253,250	
第１２２回利付国債（２０年）	190,000,000	208,986,700	
第１２３回利付国債（２０年）	265,000,000	297,587,050	
第１２４回利付国債（２０年）	200,000,000	223,224,000	
第１２５回利付国債（２０年）	120,000,000	135,826,800	
第１２６回利付国債（２０年）	100,000,000	111,775,000	
第１２７回利付国債（２０年）	130,000,000	144,388,400	
第１２８回利付国債（２０年）	225,000,000	250,290,000	
第１２９回利付国債（２０年）	240,000,000	265,224,000	
第１３０回利付国債（２０年）	220,000,000	243,419,000	
第１３１回利付国債（２０年）	30,000,000	32,967,900	
第１３２回利付国債（２０年）	80,000,000	88,024,800	
第１３３回利付国債（２０年）	355,000,000	393,361,300	
第１３４回利付国債（２０年）	45,000,000	49,927,950	
第１３５回利付国債（２０年）	40,000,000	44,062,000	
第１３６回利付国債（２０年）	220,000,000	240,587,600	
第１３７回利付国債（２０年）	160,000,000	176,364,800	
第１３８回利付国債（２０年）	60,000,000	65,155,200	
第１４０回利付国債（２０年）	790,000,000	872,009,900	
第１４１回利付国債（２０年）	145,000,000	160,256,900	
第１４２回利付国債（２０年）	240,000,000	267,321,600	
第１４３回利付国債（２０年）	335,000,000	367,394,500	
第１４４回利付国債（２０年）	480,000,000	522,177,600	
第１４５回利付国債（２０年）	755,000,000	835,988,850	
第１４６回利付国債（２０年）	560,000,000	620,440,800	
第１４７回利付国債（２０年）	775,000,000	851,701,750	
第１４８回利付国債（２０年）	995,000,000	1,084,032,600	
第１４９回利付国債（２０年）	610,000,000	664,534,000	
第１５０回利付国債（２０年）	1,030,000,000	1,110,947,700	
第１５１回利付国債（２０年）	1,005,000,000	1,062,274,950	
第１５２回利付国債（２０年）	970,000,000	1,024,281,200	
第１５３回利付国債（２０年）	760,000,000	810,236,000	
第１５４回利付国債（２０年）	1,028,000,000	1,083,203,600	
第１５５回利付国債（２０年）	940,000,000	967,457,400	
第１５６回利付国債（２０年）	980,000,000	938,369,600	
第１５７回利付国債（２０年）	970,000,000	902,342,500	
第１５８回利付国債（２０年）	690,000,000	664,511,400	
第１５９回利付国債（２０年）	850,000,000	826,574,000	
第１６０回利付国債（２０年）	1,010,000,000	991,961,400	
第１６１回利付国債（２０年）	660,000,000	638,088,000	
第１６２回利付国債（２０年）	800,000,000	771,104,000	

	第１６３回利付国債（２０年）	800,000,000	768,728,000	
	第１６４回利付国債（２０年）	1,030,000,000	972,453,900	
	第１６５回利付国債（２０年）	840,000,000	790,322,400	
	第１６６回利付国債（２０年）	710,000,000	685,263,600	
	第１６７回利付国債（２０年）	740,000,000	690,841,800	
	第１６８回利付国債（２０年）	1,010,000,000	924,937,800	
	第１６９回利付国債（２０年）	620,000,000	556,543,000	
	第１７０回利付国債（２０年）	910,000,000	812,821,100	
	第１７１回利付国債（２０年）	670,000,000	595,462,500	
	第１７２回利付国債（２０年）	910,000,000	818,262,900	
	第１７３回利付国債（２０年）	820,000,000	733,703,200	
	第１７４回利付国債（２０年）	1,080,000,000	961,524,000	
	第１７５回利付国債（２０年）	740,000,000	667,339,400	
	第１７６回利付国債（２０年）	1,070,000,000	961,609,000	
	第１７７回利付国債（２０年）	820,000,000	720,968,600	
	第１７８回利付国債（２０年）	1,130,000,000	1,007,621,000	
	第１７９回利付国債（２０年）	500,000,000	444,250,000	
	第１８０回利付国債（２０年）	1,060,000,000	990,601,800	
	第１８１回利付国債（２０年）	800,000,000	759,072,000	
	第１８２回利付国債（２０年）	920,000,000	901,774,800	
	第１８３回利付国債（２０年）	640,000,000	658,272,000	
	第１８４回利付国債（２０年）	1,020,000,000	994,714,200	
	第１８５回利付国債（２０年）	760,000,000	738,651,600	
	第１８６回利付国債（２０年）	560,000,000	581,711,200	
	国債証券合計	175,406,000,000	172,715,989,570	
地方債証券	第１４回東京都公募公債	100,000,000	108,607,000	
	第７４６回東京都公募公債	100,000,000	100,580,000	
	第７５１回東京都公募公債	200,000,000	200,956,000	
	第７６１回東京都公募公債	100,000,000	99,794,000	
	第７８５回東京都公募公債	100,000,000	99,604,000	
	第７８９回東京都公募公債	100,000,000	98,848,000	
	第８１７回東京都公募公債	100,000,000	96,756,000	
	第８４３回東京都公募公債	100,000,000	101,288,000	
	第２４回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	110,822,000	
	平成２８年度第８回北海道公募公債	100,000,000	99,702,000	
	第１５回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	110,123,000	
	第２２０回神奈川県公募公債	100,000,000	99,876,000	
	第２０回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	109,173,000	
	第１７０回大阪府公募公債	100,000,000	99,855,000	
	第４０３回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	100,647,000	
	第４５１回大阪府公募公債	100,000,000	98,138,000	
	第４７１回大阪府公募公債	140,000,000	135,336,600	
	第５回大阪府公募公債（１５年）	200,000,000	202,952,000	

第４回大阪府公募公債（２０年）	100,000,000	111,227,000	
平成２７年度第１３回京都府公募公債	100,000,000	99,943,000	
平成２９年度第１回兵庫県公募公債	100,000,000	99,965,000	
令和元年度第２回兵庫県公募公債	100,000,000	98,662,000	
第５回静岡県公募公債（２０年）	100,000,000	107,700,000	
第６回静岡県公募公債（１５年）	200,000,000	207,684,000	
平成３０年度第１４回静岡県公募公債	100,000,000	99,167,000	
平成２２年度第８回愛知県公募公債	100,000,000	109,670,000	
平成２６年度第１１回愛知県公募公債（１５年）	100,000,000	103,390,000	
平成２８年度第８回愛知県公募公債	100,000,000	99,782,000	
平成２９年度第１１回愛知県公募公債	100,000,000	99,988,000	
令和３年度第１２回愛知県公募公債	100,000,000	87,075,000	
平成３０年度第１回広島県公募公債	100,000,000	99,689,000	
令和３年度第１回広島県公募公債	100,000,000	97,488,000	
令和５年度第１回広島県公募公債（２０年）	100,000,000	100,660,000	
第８回埼玉県公募公債	100,000,000	110,351,000	
第１４回埼玉県公募公債（２０年）	100,000,000	107,937,000	
令和３年度第９回埼玉県公募公債	100,000,000	92,735,000	
第３回埼玉県公募公債（１０年）	100,000,000	101,812,000	
平成２７年度第１回福岡県公募公債（２０年）	200,000,000	209,732,000	
令和５年度第２回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	96,890,000	
第１１回千葉県公募公債	100,000,000	110,266,000	
令和４年度第６回千葉県公募公債	100,000,000	99,349,000	
令和３年度第５回千葉県公募公債	100,000,000	96,802,000	
令和５年度第８回千葉県公募公債	100,000,000	101,817,000	
第１５回千葉県公募公債	90,000,000	84,656,700	
令和３年度第３回茨城県公募公債	100,000,000	99,622,000	
令和５年度第２回茨城県公募公債	100,000,000	100,274,000	
第１８回群馬県公募公債（５年）	100,000,000	100,953,000	
第１５２回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,714,000	
第１５６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,921,000	
第１６９回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,071,000	
第１７２回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,087,000	
第１７４回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,721,000	
第１８１回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,645,000	
第１８５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,748,000	
第１８７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,792,000	
第１９１回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,984,000	
第１９７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,360,000	
第２０７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,387,000	
第２０９回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,076,000	
第２１７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	97,952,000	
第２２２回共同発行市場公募地方債	100,000,000	96,876,000	

	第２３１回共同発行市場公募地方債	100,000,000	97,691,000	
	第２４５回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,976,000	
	第２４６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,764,000	
	第２４９回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,773,000	
	令和３年度第２回堺市公募公債	90,000,000	84,339,000	
	令和元年度第３回堺市公募公債	100,000,000	98,419,000	
	令和４年度第２回長崎県公募公債（２０年・定時償還）	95,000,000	90,422,900	
	令和５年度第２回島根県公募公債（２０年）	100,000,000	100,208,000	
	令和４年度第１回島根県公募公債	100,000,000	92,935,000	
	令和２年度第１回佐賀県公募公債	100,000,000	97,917,000	
	令和４年度第３回奈良県公募公債（２０年・定時償還）	95,000,000	91,096,450	
	平成２７年度第１回静岡市公募公債	100,000,000	100,676,000	
	第１１回大阪市公募公債	100,000,000	111,483,000	
	第９回大阪市公募公債（２０年）	100,000,000	110,149,000	
	第１７回名古屋市公募公債	100,000,000	103,965,000	
	令和元年度第４回京都市公募公債	114,500,000	112,902,725	
	平成２２年度第９回神戸市公募公債	100,000,000	111,324,000	
	平成２６年度第３回神戸市公募公債（２０年）	100,000,000	107,230,000	
	第２３回横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	111,729,000	
	第２１回横浜市公募公債	100,000,000	110,078,000	
	第２５回横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	109,319,000	
	平成２６年度第５回札幌市公募公債（１５年）	100,000,000	103,378,000	
	令和４年度第３回札幌市公募公債（１０年）	100,000,000	98,180,000	
	第１２回川崎市公募公債（３０年）	100,000,000	76,264,000	
	第３７回川崎市公募公債	92,500,000	86,917,625	
	第７０回川崎市公募公債（５年）	100,000,000	100,647,000	
	平成２７年度第２回広島市公募公債	100,000,000	100,671,000	
	平成２９年度第３回千葉市公募公債	120,000,000	119,878,800	
	平成２６年度第１回福井県公募公債	100,000,000	107,237,000	
	平成２９年度第５回福井県公募公債	100,000,000	99,688,000	
	令和２年度第１回山梨県公募公債（１０年）	100,000,000	98,004,000	
	平成２９年度第２回岡山県公募公債	100,000,000	99,947,000	
	地方債証券合計	9,837,000,000	9,932,887,800	
特殊債券	第３４回新関西国際空港株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	98,253,000	
	第２８回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,485,000	
	第４７回株式会社日本政策投資銀行無担保社債（社債間限定同順位	100,000,000	103,459,000	
	第４９回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	99,669,000	
	第８９回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	99,824,000	
	第１１７回株式会社日本政策投資銀行無担保社債（社債間限定同順	100,000,000	76,172,000	
	第１３１回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	80,352,000	

第１６回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,919,000	
第１２７回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,847,000	
第１３８回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,401,000	
第１４８回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,803,000	
第１８３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,648,000	
第２０５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,090,000	
第２４９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,607,000	
第２５１回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	103,000,000	103,775,590	
第２６６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	133,000,000	133,622,440	
第２７０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,554,000	
第３００回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,929,000	
第３３０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,817,000	
第３４５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,515,000	
第３７５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	98,826,000	
第３８７回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	98,189,000	
第１２回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,746,000	
第２８３回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	94,329,000	
第３１２回日本高速道路保有・債務返済機構債券（ソーシャルボン	100,000,000	99,739,000	
第３１４回日本高速道路保有・債務返済機構債券（ソーシャルボン	100,000,000	99,429,000	
第３１６回日本高速道路保有・債務返済機構債券（ソーシャルボン	100,000,000	101,028,000	
第３２０回日本高速道路保有・債務返済機構債券（ソーシャルボン	100,000,000	103,524,000	
第１回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	107,234,000	
第５回地方公共団体金融機構債券（２０年）	100,000,000	110,695,000	
第１３回公営企業債券	100,000,000	102,996,000	
第１８回公営企業債券（２０年）	100,000,000	105,961,000	
第３０回地方公共団体金融機構債券（５年）	100,000,000	99,405,000	
第７８回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,545,000	
第９５回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,906,000	
第９６回政府保証地方公共団体金融機構債券	120,000,000	119,806,800	
第９７回政府保証地方公共団体金融機構債券	145,000,000	144,843,400	
第１１１回政府保証地方公共団体金融機構債券	213,000,000	212,454,720	
Ｆ１３２回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,502,000	
Ｆ３０５回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,890,000	
Ｆ１４３回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	207,944,000	
Ｆ１５９回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,415,000	
Ｆ１４回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	80,251,000	

Ｆ１５１回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	96,197,000	
第１０回株式会社日本政策金融公庫社債（一般担保付）	100,000,000	110,506,000	
第１１７回都市再生債券	100,000,000	101,960,000	
第２回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	105,796,000	
第６回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	42,913,000	42,413,921	
第７回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	45,883,000	45,465,005	
第９７回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	109,967,000	
第１０２回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,897,000	
第１１７回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	208,610,000	
第１２３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,846,000	68,666,777	
第１２５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,480,000	68,100,595	
第１２７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,609,000	69,968,210	
第１２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,161,000	68,715,908	
第１３５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,371,000	71,382,029	
第１３７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,445,000	72,792,353	
第１５０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,812,000	77,024,361	
第１５４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,603,000	79,252,299	
第１６１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,775,000	81,542,861	
第１６８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,602,000	83,447,913	
第１７０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,005,000	84,639,304	
第１７１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,315,000	85,462,375	
第１７２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,740,000	84,904,808	
第１７３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,594,000	85,783,458	
第１７４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,838,000	86,445,074	
第１７５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,729,000	87,104,941	
第１８３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,168,000	90,492,622	
第１８４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	189,224,000	181,363,635	
第１８５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,133,000	91,786,221	
第１８６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,437,000	93,465,271	
第１８７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,647,000	93,812,490	
第１８８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,106,000	96,334,732	
第１９８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,832,000	101,897,524	
第１９９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,472,000	
第２２３回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	97,431,000	
第３５１回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	94,996,000	
第１回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	31,120,000	30,903,404	
第２回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	31,793,000	31,590,796	
第３回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	33,053,000	32,908,558	
第３３４回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	86,465,000	
第３５６回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,181,000	
第２７回成田国際空港株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	93,200,000	
第７２回日本学生支援債券	100,000,000	99,886,000	

	い第８６６号商工債	100,000,000	99,449,000	
	い第８７０号商工債	100,000,000	99,471,000	
	い第８７９号商工債	100,000,000	99,866,000	
	第３７２回信金中金債	100,000,000	99,739,000	
	第３７６回信金中金債	100,000,000	99,650,000	
	第３８５回信金中金債	100,000,000	99,417,000	
	第２５回国際協力機構債券	100,000,000	106,683,000	
	第３１回国際協力機構債券	100,000,000	100,627,000	
	第５８回東日本高速道路株式会社社債（一般担保付、独立行政法人	100,000,000	98,655,000	
	第８５回東日本高速道路株式会社社債（一般担保付、独立行政法人	100,000,000	96,575,000	
	第１０９回東日本高速道路株式会社社債（一般担保付、独立行政法	100,000,000	99,943,000	
	第８７回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,654,000	
	第８８回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,597,000	
	第１０１回中日本高速道路株式会社社債（一般担保付、独立行政法	100,000,000	100,203,000	
	第７９回西日本高速道路株式会社社債（一般担保付、独立行政法人	100,000,000	99,938,000	
	第８１回西日本高速道路株式会社社債（一般担保付、独立行政法人	100,000,000	99,972,000	
	第８３回西日本高速道路株式会社社債（一般担保付、独立行政法人	100,000,000	100,029,000	
	第７５回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	102,842,000	
	第９３回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	91,898,000	
	第１０３回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	88,829,000	
	第１６５回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券（サステナビリテ	100,000,000	99,897,000	
	特殊債券合計	10,480,234,000	10,443,566,395	
社債券	第３８回フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）円貨社債（２０２	100,000,000	100,249,000	
	第２７回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー期限前償還条項付円	100,000,000	99,828,000	
	第１７回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,968,000	
	第６回フランス電力円貨社債（２０２３）	100,000,000	99,422,000	
	第３３回清水建設株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	100,490,000	
	第１３回大和ハウス工業株式会社無担保社債（特定社債間限定同順	100,000,000	99,666,000	
	第１回株式会社日清製粉グループ本社無担保社債	100,000,000	97,859,000	
	第２２回キリンホールディングス株式会社無担保社債（社債間限定	100,000,000	100,478,000	
	第２７回味の素株式会社無担保社債	100,000,000	98,129,000	
	第２７回株式会社ニチレイ無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	100,004,000	
	第８回トヨタ紡織株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	101,833,000	
	第１８回株式会社セブン＆アイ・ホールディングス無担保社債（社	100,000,000	101,964,000	
	第１８回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	94,762,000	

第２９回北越コーポレーション株式会社無担保社債（社債間限定同	100,000,000	100,108,000	
第３５回昭和電工株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	94,274,000	
第１３回イビデン株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	99,854,000	
第５４回三井化学株式会社無担保社債	100,000,000	94,534,000	
第３回三菱ケミカルグループ株式会社無担保社債（社債間限定同順	100,000,000	100,298,000	
第３回株式会社電通無担保社債	100,000,000	99,305,000	
第１回アステラス製薬株式会社無担保社債（社債間限定	100,000,000	99,949,000	
第２０回株式会社オリエンタルランド無担保社債	100,000,000	99,420,000	
第１２回Ｚホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,059,000	
第１８回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	98,123,000	
第１０回株式会社資生堂無担保社債	100,000,000	99,823,000	
第１４回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	98,844,000	
第１５回旭硝子株式会社無担保社債	100,000,000	99,588,000	
第２８回ジェイ　エフ　イー　ホールディングス株式会社無担保社	100,000,000	99,783,000	
第３０回ダイキン工業株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約	100,000,000	98,980,000	
第４６回三菱電機株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	100,288,000	
第１６回日本電産株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	99,432,000	
第１９回パナソニック株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約	100,000,000	96,804,000	
第３８回ソニーグループ株式会社無担保社債	100,000,000	99,821,000	
第４３回三菱重工業株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,082,000	
第１７回ＪＡ三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,719,000	
第２１回株式会社パン・パシフィック・インターナショナルホール	100,000,000	99,818,000	
第５回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	97,817,000	
第３０回豊田通商株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	97,160,000	
第６２回住友商事株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	101,260,000	
第９７回株式会社クレディセゾン無担保社債（社債間限定同順位特	100,000,000	100,154,000	
第１７回株式会社三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ無担保社債	100,000,000	98,029,000	
第１９回三井住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	99,462,000	
第１８回ＮＴＴファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	97,853,000	
第２１回ＮＴＴファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,372,000	
第２７回ＮＴＴファイナンス株式会社無担保社債（社債間限定同順	100,000,000	100,147,000	
第２９回ＮＴＴファイナンス株式会社無担保社債（社債間限定同順	100,000,000	100,970,000	
第７１回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,345,000	
第２９回ＳＢＩホールディングス株式会社無担	100,000,000	100,011,000	

	保社債			
	第１００回トヨタファイナンス株式会社無担保社債（社債間限定同	100,000,000	100,195,000	
	第１７回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債（社債	100,000,000	99,466,000	
	第８１アコム株式会社無担保社債	100,000,000	99,064,000	
	第８４回アコム株式会社無担保社債（特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,095,000	
	第２１９回オリックス株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約	100,000,000	100,179,000	
	第２２０回オリックス株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約	100,000,000	100,417,000	
	第４０回株式会社大和証券グループ本社無担保社債（社債間限定同	100,000,000	100,193,000	
	第７回三井住友海上火災保険株式会社無担保社債	100,000,000	99,430,000	
	第８４回三井不動産株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,455,000	
	第１２０回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	99,457,000	
	第１３４回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	98,379,000	
	第４４回相鉄ホールディングス株式会社無担保社債（相模鉄道株式	100,000,000	99,359,000	
	第１４回東急株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	98,285,000	
	第１１２回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	100,287,000	
	第１２５回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	87,259,000	
	第１９６回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債（社債間限定同	100,000,000	102,874,000	
	第３回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	95,764,000	
	第２６回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	110,152,000	
	第１０回九州旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	84,093,000	
	第２２回ＫＤＤＩ株式会社無担保社債	100,000,000	98,830,000	
	第５４３回中部電力株式会社社債	100,000,000	99,763,000	
	第５３６回関西電力株式会社社債	100,000,000	96,987,000	
	第５４１回関西電力株式会社社債	100,000,000	95,592,000	
	第４３３回中国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	99,478,000	
	第３３８回北陸電力株式会社社債	100,000,000	96,710,000	
	第５３１回東北電力株式会社社債	100,000,000	95,701,000	
	第５０３回九州電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	99,693,000	
	第３７５回北海道電力株式会社社債	100,000,000	99,788,000	
	第３２回沖縄電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	99,899,000	
	第２８回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,406,000	
	第４７回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	96,075,000	
	第６８回東京電力パワーグリッド株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	100,653,000	
	第１０回株式会社ＪＥＲＡ無担保社債	100,000,000	99,896,000	
	第７０回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	99,482,000	
	第４９回大阪瓦斯株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	88,690,000	
	第７回株式会社ファーストリテイリング無担保	100,000,000	99,416,000	

	社債			
		社債券合計	8,300,000,000	8,206,600,000	
合計				201,299,043,765	

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

ＲＭ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12月20日現在
資産の部	
流動資産	
預金	221,444,241
金銭信託	710,124,560
国債証券	123,190,825,829
派生商品評価勘定	2,161,431,091
未収入金	264,004,455
未収利息	857,396,167
前払費用	52,504,996
流動資産合計	127,457,731,339
資産合計	127,457,731,339
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	9,770,856
未払金	3,745,441
未払解約金	625,568,100
その他未払費用	1,321
流動負債合計	639,085,718
負債合計	639,085,718
純資産の部	
元本等	
元本	146,526,345,291
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△19,707,699,670
元本等合計	126,818,645,621
純資産合計	126,818,645,621
負債純資産合計	127,457,731,339

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額、又は価格情報会社の提供する価額で評価しております。
２.デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則としてわが国における計算日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。
３.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
４.収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 原則として、約定日基準で計上しております。
５.その他財務諸表作成のための基礎と	外貨建取引等の処理基準

なる事項	外貨建資産等については、投資信託財産の計算に関する規則第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分して整理する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。

（貸借対照表に関する注記）

2023年12月20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	25,479,241,950円
期中一部解約元本額	139,444,483,506円
期末元本額	146,526,345,291円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド（安定型）	25,661,345,608円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	17,191,993,761円
りそなラップ型ファンド（成長型）	472,234,209円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	7,302,336,443円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	2,210,238,723円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	710,436,112円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	1,218,309,883円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	374,764,508円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	92,502,279円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	112,170,162円
りそな　つみたてラップ型ファンド（安定型）	739,561,954円
りそな　つみたてラップ型ファンド（安定成長型）	462,081,540円
りそな　つみたてラップ型ファンド（成長型）	14,697,020円
りそな　つみたてリスクコントロールファンド	64,021,764円
ターゲットリターンバランスファンド（目標２％）	7,969,548円
ターゲットリターンバランスファンド（目標３％）	3,456,040円
ターゲットリターンバランスファンド（目標４％）	9,401,295円
ターゲットリターンバランスファンド（目標５％）	2,391,913円
ターゲットリターンバランスファンド（目標６％）	1,899,697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	374,820,627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）	68,787,882,505円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　先進国債券インデックス（為替ヘッジあり）	2,732,331,194円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	2,397,535,613円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	1,844,341,841円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	487,357,207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）	8,544,134,966円
りそなＤＡＡファンド（適格機関投資家専用）	393,466,879円
りそなＦＴ　ＲＣバランスファンド（適格機関投資家専用）	2,295,416,714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）	96,958,129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）	74,038,203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）	15,363,692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）	3,657,407円
りそなマルチアセットファンド（適格機関投資家専用）	421,281,360円
りそなＤＡＡファンドⅡ（適格機関投資家専用）	478,123,759円
りそなＤＡＡファンド２０２２０５（適格機関投資家専用）	824,114,902円
２．　計算日における受益権の総数	
	146,526,345,291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	19,707,699,670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	0.8655円
(10,000口当たり純資産額)	(8,655円)

（注）※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

2023年12月20日現在
１.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 ２.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。
これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。
デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。

3.金融商品に係るリスク管理体制

運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。
また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

2023年12月20日現在

1.貸借対照表計上額、時価及び差額

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

2.時価の算定方法

国債証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

デリバティブ取引

（その他の注記）の2　デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

（関連当事者との取引に関する注記）

2023年12月20日現在

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1　有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2023年12月20日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	2,270,702,037
合計	2,270,702,037

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

2　デリバティブ取引に関する注記

(通貨関連)

（2023年12月20日現在）　（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	123,011,317,323	－	120,859,657,088	2,151,660,235
	米ドル	57,852,462,806	－	56,800,312,177	1,052,150,629
	カナダドル	2,427,497,150	－	2,426,050,608	1,446,542
	メキシコペソ	1,160,569,768	－	1,157,586,200	2,983,568
	ユーロ	40,576,494,373	－	39,790,576,665	785,917,708
	英ポンド	6,363,418,796	－	6,259,001,815	104,416,981
	スウェーデンクローナ	258,788,375	－	258,531,810	256,565
	ノルウェークローネ	220,206,740	－	223,970,465	△3,763,725
	デンマーククローネ	347,319,085	－	340,792,968	6,526,117

	ポーランドズロチ	647,930,898	－	639,395,373	8,535,525
	オーストラリアドル	1,724,705,490	－	1,726,406,883	△1,701,393
	ニュージーランドドル	291,748,496	－	291,087,908	660,588
	シンガポールドル	541,701,318	－	533,037,516	8,663,802
	マレーシアリンギット	634,413,780	－	620,537,016	13,876,764
	中国元	9,576,603,619	－	9,410,120,088	166,483,531
	イスラエルシュケル	387,456,629	－	382,249,596	5,207,033
合計		123,011,317,323	－	120,859,657,088	2,151,660,235

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種　類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,266,034.69	
		US TREASURY N/B	1,330,000.00	1,287,613.48	
		US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,692,971.89	
		US TREASURY N/B	2,070,000.00	1,993,117.59	
		US TREASURY N/B	980,000.00	954,399.26	
		US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,259,438.02	
		US TREASURY N/B	1,280,000.00	1,272,163.26	
		US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,923,459.60	
		US TREASURY N/B	530,000.00	516,770.69	
		US TREASURY N/B	1,290,000.00	1,242,532.02	
		US TREASURY N/B	1,630,000.00	1,618,252.54	
		US TREASURY N/B	1,750,000.00	1,694,663.09	
		US TREASURY N/B	1,940,000.00	1,868,235.15	
		US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,269,734.37	
		US TREASURY N/B	1,260,000.00	1,207,335.93	
		US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,928,242.18	
		US TREASURY N/B	1,030,000.00	1,003,183.78	

		US TREASURY N/B	840,000.00	796,031.25
		US TREASURY N/B	1,790,000.00	1,742,383.20
		US TREASURY N/B	950,000.00	927,196.28
		US TREASURY N/B	1,990,000.00	1,877,440.62
		US TREASURY N/B	1,150,000.00	1,137,421.87
		US TREASURY N/B	2,620,000.00	2,530,142.17
		US TREASURY N/B	1,750,000.00	1,704,506.84
		US TREASURY N/B	870,000.00	848,538.86
		US TREASURY N/B	2,520,000.00	2,365,994.53
		US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,889,164.07
		US TREASURY N/B	3,100,000.00	3,022,136.71
		US TREASURY N/B	2,120,000.00	2,062,983.59
		US TREASURY N/B	690,000.00	646,025.97
		US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,100,171.87
		US TREASURY N/B	1,890,000.00	1,844,743.36
		US TREASURY N/B	2,250,000.00	2,191,245.12
		US TREASURY N/B	2,980,000.00	2,781,701.94
		US TREASURY N/B	600,000.00	601,605.46
		US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,439,824.21
		US TREASURY N/B	3,260,000.00	3,186,522.66
		US TREASURY N/B	1,890,000.00	1,835,847.07
		US TREASURY N/B	1,120,000.00	1,042,256.25
		US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,179,726.56
		US TREASURY N/B	2,430,000.00	2,368,822.85
		US TREASURY N/B	2,520,000.00	2,338,875.00
		US TREASURY N/B	550,000.00	547,776.36
		US TREASURY N/B	1,190,000.00	1,159,390.03
		US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,203,058.59
		US TREASURY N/B	2,270,000.00	2,179,909.37
		US TREASURY N/B	1,430,000.00	1,431,424.40
		US TREASURY N/B	920,000.00	893,801.56
		US TREASURY N/B	1,130,000.00	1,045,625.19
		US TREASURY N/B	1,550,000.00	1,537,739.25
		US TREASURY N/B	840,000.00	811,715.62
		US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,292,402.34
		US TREASURY N/B	1,940,000.00	1,920,865.23
		US TREASURY N/B	2,820,000.00	2,722,732.02
		US TREASURY N/B	1,590,000.00	1,463,172.66
		US TREASURY N/B	2,010,000.00	1,898,429.30
		US TREASURY N/B	1,550,000.00	1,539,101.56
		US TREASURY N/B	1,020,000.00	981,271.87
		US TREASURY N/B	2,340,000.00	2,154,582.42
		US TREASURY N/B	1,410,000.00	1,418,812.50

US TREASURY N/B	1,000,000.00	956,250.00	
US TREASURY N/B	3,070,000.00	2,837,231.64	
US TREASURY N/B	750,000.00	741,108.39	
US TREASURY N/B	750,000.00	718,417.96	
US TREASURY N/B	2,820,000.00	2,598,365.62	
US TREASURY N/B	1,220,000.00	1,146,990.62	
US TREASURY N/B	840,000.00	827,908.59	
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,568,585.92	
US TREASURY N/B	1,580,000.00	1,452,612.50	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,994,062.50	
US TREASURY N/B	1,150,000.00	1,086,570.31	
US TREASURY N/B	1,670,000.00	1,538,128.71	
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,207,898.42	
US TREASURY N/B	2,600,000.00	2,450,652.33	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,280,322.27	
US TREASURY N/B	1,330,000.00	1,240,173.05	
US TREASURY N/B	200,000.00	200,800.78	
US TREASURY N/B	1,280,000.00	1,188,950.00	
US TREASURY N/B	2,170,000.00	1,981,057.42	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,718,726.55	
US TREASURY N/B	860,000.00	803,394.53	
US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,463,562.49	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,821,445.30	
US TREASURY N/B	2,120,000.00	1,976,527.34	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,562,173.82	
US TREASURY N/B	1,640,000.00	1,544,290.61	
US TREASURY N/B	1,450,000.00	1,349,632.81	
US TREASURY N/B	2,600,000.00	2,393,777.33	
US TREASURY N/B	640,000.00	597,175.00	
US TREASURY N/B	3,300,000.00	3,034,001.94	
US TREASURY N/B	2,550,000.00	2,356,957.04	
US TREASURY N/B	1,180,000.00	1,115,814.45	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	912,070.31	
US TREASURY N/B	2,060,000.00	1,923,042.17	
US TREASURY N/B	1,750,000.00	1,565,498.04	
US TREASURY N/B	800,000.00	761,734.37	
US TREASURY N/B	650,000.00	577,484.37	
US TREASURY N/B	900,000.00	862,541.01	
US TREASURY N/B	620,000.00	586,529.68	
US TREASURY N/B	1,570,000.00	1,391,289.85	
US TREASURY N/B	2,400,000.00	2,288,015.61	
US TREASURY N/B	1,230,000.00	1,086,940.43	
US TREASURY N/B	1,850,000.00	1,801,040.03	

US TREASURY N/B	470,000.00	412,250.58	
US TREASURY N/B	1,140,000.00	1,089,880.08	
US TREASURY N/B	3,850,000.00	3,615,616.19	
US TREASURY N/B	820,000.00	720,767.19	
US TREASURY N/B	1,480,000.00	1,432,796.09	
US TREASURY N/B	2,270,000.00	1,981,240.04	
US TREASURY N/B	1,890,000.00	1,895,204.88	
US TREASURY N/B	2,310,000.00	2,020,122.07	
US TREASURY N/B	2,180,000.00	2,185,790.62	
US TREASURY N/B	940,000.00	879,799.60	
US TREASURY N/B	1,450,000.00	1,271,780.26	
US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,391,714.84	
US TREASURY N/B	1,680,000.00	1,469,967.18	
US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,088,556.63	
US TREASURY N/B	2,770,000.00	2,430,458.60	
US TREASURY N/B	2,410,000.00	2,362,788.48	
US TREASURY N/B	1,650,000.00	1,570,690.42	
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,156,923.83	
US TREASURY N/B	1,610,000.00	1,609,339.64	
US TREASURY N/B	3,890,000.00	3,471,900.97	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,477,939.45	
US TREASURY N/B	2,770,000.00	2,467,355.86	
US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,372,437.50	
US TREASURY N/B	3,390,000.00	3,236,192.00	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,667,011.73	
US TREASURY N/B	1,670,000.00	1,646,189.45	
US TREASURY N/B	2,570,000.00	2,280,573.82	
US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,102,337.88	
US TREASURY N/B	3,350,000.00	2,932,166.02	
US TREASURY N/B	2,520,000.00	2,401,284.36	
US TREASURY N/B	2,390,000.00	2,100,119.14	
US TREASURY N/B	700,000.00	712,427.73	
US TREASURY N/B	2,400,000.00	2,117,156.25	
US TREASURY N/B	2,230,000.00	1,975,553.52	
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,352,558.59	
US TREASURY N/B	2,950,000.00	2,839,029.28	
US TREASURY N/B	2,170,000.00	1,931,342.38	
US TREASURY N/B	1,990,000.00	1,756,175.00	
US TREASURY N/B	2,060,000.00	1,850,217.96	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,155,800.78	
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,173,402.34	
US TREASURY N/B	2,130,000.00	1,969,293.16	
US TREASURY N/B	2,080,000.00	1,970,637.51	

		US TREASURY N/B	1,530,000.00	1,412,799.61
		US TREASURY N/B	1,630,000.00	1,533,218.75
		US TREASURY N/B	1,630,000.00	1,571,994.91
		US TREASURY N/B	1,270,000.00	1,184,771.08
		US TREASURY N/B	1,770,000.00	1,567,832.81
		US TREASURY N/B	1,450,000.00	1,387,751.94
		US TREASURY N/B	980,000.00	974,946.87
		US TREASURY N/B	1,350,000.00	1,351,687.50
		US TREASURY N/B	1,320,000.00	1,173,407.80
		US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,492,294.92
		US TREASURY N/B	1,360,000.00	1,352,960.93
		US TREASURY N/B	1,040,000.00	1,013,573.43
		US TREASURY N/B	2,610,000.00	2,263,971.10
		US TREASURY N/B	1,870,000.00	1,873,141.02
		US TREASURY N/B	1,850,000.00	1,815,131.82
		US TREASURY N/B	800,000.00	779,312.49
		US TREASURY N/B	780,000.00	879,785.15
		US TREASURY N/B	4,930,000.00	4,009,765.41
		US TREASURY N/B	430,000.00	424,860.15
		US TREASURY N/B	1,560,000.00	1,541,353.13
		US TREASURY N/B	960,000.00	962,231.24
		US TREASURY N/B	4,610,000.00	3,722,214.86
		US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,371,500.00
		US TREASURY N/B	4,220,000.00	3,453,064.45
		US TREASURY N/B	1,210,000.00	1,323,177.54
		US TREASURY N/B	3,330,000.00	2,766,696.66
		US TREASURY N/B	3,100,000.00	2,649,046.87
		US TREASURY N/B	4,430,000.00	3,653,279.10
		US TREASURY N/B	4,310,000.00	3,566,525.00
		US TREASURY N/B	3,780,000.00	3,238,987.50
		US TREASURY N/B	3,960,000.00	3,658,204.67
		US TREASURY N/B	3,260,000.00	2,976,278.12
		US TREASURY N/B	4,610,000.00	4,673,027.36
		US TREASURY N/B	2,370,000.00	2,291,401.17
		US TREASURY N/B	3,640,000.00	3,483,593.75
		US TREASURY N/B	4,050,000.00	4,033,546.87
		US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,198,765.62
		US TREASURY N/B	10,000.00	10,626.56
		US TREASURY N/B	730,000.00	812,723.82
		US TREASURY N/B	100,000.00	104,550.78
		US TREASURY N/B	300,000.00	317,033.20
		US TREASURY N/B	60,000.00	56,430.46
		US TREASURY N/B	270,000.00	276,275.39

US TREASURY N/B	480,000.00	504,506.25	
US TREASURY N/B	520,000.00	538,017.18	
US TREASURY N/B	780,000.00	829,999.21	
US TREASURY N/B	950,000.00	979,965.82	
US TREASURY N/B	340,000.00	217,433.98	
US TREASURY N/B	610,000.00	590,806.44	
US TREASURY N/B	1,040,000.00	659,323.43	
US TREASURY N/B	1,220,000.00	1,235,678.90	
US TREASURY N/B	2,130,000.00	1,402,721.48	
US TREASURY N/B	530,000.00	569,584.37	
US TREASURY N/B	1,910,000.00	1,365,165.03	
US TREASURY N/B	1,130,000.00	1,160,037.69	
US TREASURY N/B	1,620,000.00	1,227,561.33	
US TREASURY N/B	1,080,000.00	1,023,131.25	
US TREASURY N/B	2,010,000.00	1,390,786.51	
US TREASURY N/B	1,040,000.00	900,839.06	
US TREASURY N/B	2,450,000.00	1,764,143.54	
US TREASURY N/B	1,340,000.00	1,156,875.38	
US TREASURY N/B	860,000.00	657,295.31	
US TREASURY N/B	1,070,000.00	902,833.39	
US TREASURY N/B	1,590,000.00	1,390,100.97	
US TREASURY N/B	240,000.00	194,114.06	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,510,708.97	
US TREASURY N/B	1,560,000.00	1,257,628.13	
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,163,203.12	
US TREASURY N/B	440,000.00	375,452.34	
US TREASURY N/B	1,350,000.00	1,284,266.59	
US TREASURY N/B	1,180,000.00	966,770.31	
US TREASURY N/B	1,530,000.00	1,455,173.43	
US TREASURY N/B	930,000.00	853,166.01	
US TREASURY N/B	1,140,000.00	1,161,285.93	
US TREASURY N/B	1,060,000.00	989,174.60	
US TREASURY N/B	740,000.00	677,056.64	
US TREASURY N/B	910,000.00	800,853.31	
US TREASURY N/B	1,780,000.00	1,504,899.61	
US TREASURY N/B	170,000.00	140,538.86	
US TREASURY N/B	1,380,000.00	1,044,002.34	
US TREASURY N/B	1,100,000.00	906,898.43	
US TREASURY N/B	390,000.00	314,178.51	
US TREASURY N/B	620,000.00	509,865.23	
US TREASURY N/B	120,000.00	89,934.37	
US TREASURY N/B	1,780,000.00	1,331,419.13	
US TREASURY N/B	1,050,000.00	746,279.29	

		US TREASURY N/B	1,010,000.00	808,512.88	
		US TREASURY N/B	840,000.00	686,880.46	
		US TREASURY N/B	950,000.00	776,142.58	
		US TREASURY N/B	2,230,000.00	1,737,744.91	
		US TREASURY N/B	1,200,000.00	934,781.25	
		US TREASURY N/B	1,250,000.00	1,019,506.83	
		US TREASURY N/B	580,000.00	483,699.60	
		US TREASURY N/B	1,460,000.00	1,189,586.32	
		US TREASURY N/B	1,580,000.00	1,377,963.67	
		US TREASURY N/B	1,480,000.00	1,205,650.78	
		US TREASURY N/B	1,290,000.00	1,026,431.83	
		US TREASURY N/B	1,100,000.00	769,119.14	
		US TREASURY N/B	1,590,000.00	1,142,284.57	
		US TREASURY N/B	1,710,000.00	1,127,765.04	
		US TREASURY N/B	2,460,000.00	1,328,976.57	
		US TREASURY N/B	2,920,000.00	1,631,036.72	
		US TREASURY N/B	2,870,000.00	1,714,376.56	
		US TREASURY N/B	2,940,000.00	1,871,264.07	
		US TREASURY N/B	2,840,000.00	2,032,929.68	
		US TREASURY N/B	3,010,000.00	1,973,137.29	
		US TREASURY N/B	2,840,000.00	1,802,678.89	
		US TREASURY N/B	1,860,000.00	1,294,843.35	
		US TREASURY N/B	2,590,000.00	2,069,976.56	
		US TREASURY N/B	1,540,000.00	1,263,702.34	
		US TREASURY N/B	2,800,000.00	2,771,671.86	
		US TREASURY N/B	3,100,000.00	2,870,830.08	
		US TREASURY N/B	2,380,000.00	2,207,821.87	
		US TREASURY N/B	1,150,000.00	1,166,082.02	
		US TREASURY N/B	900,000.00	1,011,937.50	
		米ドル 小計	443,570,000.00	401,960,560.89 (57,894,379,584)	
	カナダドル	GOV OF CANADA	590,000.00	585,042.30	
		GOV OF CANADA	600,000.00	578,589.13	
		GOV OF CANADA	760,000.00	733,111.79	
		GOV OF CANADA	350,000.00	340,728.43	
		GOV OF CANADA	660,000.00	653,268.11	
		GOV OF CANADA	1,020,000.00	961,712.96	
		GOV OF CANADA	470,000.00	461,733.96	
		GOV OF CANADA	650,000.00	655,892.12	
		GOV OF CANADA	1,000,000.00	926,966.10	
		GOV OF CANADA	130,000.00	127,758.20	
		GOV OF CANADA	850,000.00	807,176.60	
		GOV OF CANADA	730,000.00	681,764.02	

	GOV OF CANADA	610,000.00	569,355.12	
	GOV OF CANADA	650,000.00	600,746.86	
	GOV OF CANADA	90,000.00	87,980.98	
	GOV OF CANADA	740,000.00	745,043.76	
	GOV OF CANADA	440,000.00	417,924.04	
	GOV OF CANADA	620,000.00	619,603.29	
	GOV OF CANADA	480,000.00	541,203.97	
	GOV OF CANADA	250,000.00	238,781.66	
	GOV OF CANADA	1,260,000.00	1,119,428.22	
	GOV OF CANADA	1,220,000.00	1,018,496.71	
	GOV OF CANADA	1,000,000.00	890,834.49	
	GOV OF CANADA	1,510,000.00	1,335,610.56	
	GOV OF CANADA	980,000.00	896,897.52	
	GOV OF CANADA	1,000,000.00	949,767.43	
	GOV OF CANADA	910,000.00	1,102,187.36	
	GOV OF CANADA	260,000.00	251,929.98	
	GOV OF CANADA	250,000.00	300,788.00	
	GOV OF CANADA	260,000.00	293,460.19	
	GOV OF CANADA	410,000.00	442,533.68	
	GOV OF CANADA	380,000.00	365,542.15	
	GOV OF CANADA	1,710,000.00	1,398,602.29	
	GOV OF CANADA	1,050,000.00	802,368.40	
	GOV OF CANADA	290,000.00	278,015.84	
	GOV OF CANADA	250,000.00	240,956.53	
	カナダドル 小計	24,430,000.00	23,021,802.75 (2,484,973,388)	
メキシコペソ	UNITED MEXICAN STATE	8,130,000.00	8,077,150.28	
	UNITED MEXICAN STATE	5,750,000.00	5,434,900.00	
	UNITED MEXICAN STATE	17,830,000.00	16,423,270.94	
	UNITED MEXICAN STATE	3,160,000.00	2,957,191.20	
	UNITED MEXICAN STATE	14,300,000.00	12,765,181.00	
	UNITED MEXICAN STATE	13,110,000.00	12,350,799.90	
	UNITED MEXICAN STATE	12,900,000.00	12,534,930.00	
	UNITED MEXICAN STATE	16,566,000.00	15,309,800.22	
	UNITED MEXICAN STATE	9,060,000.00	8,129,538.00	
	UNITED MEXICAN STATE	3,620,000.00	3,272,335.20	
	UNITED MEXICAN STATE	3,370,000.00	3,593,532.10	
	UNITED MEXICAN STATE	10,570,000.00	10,021,734.10	
	UNITED MEXICAN STATE	9,660,000.00	8,447,959.80	
	UNITED MEXICAN STATE	9,880,000.00	8,790,236.00	
	UNITED MEXICAN STATE	7,030,000.00	6,207,138.50	
	メキシコペソ 小計	144,936,000.00	134,315,697.24 (1,133,423,011)	

ユーロ	GOV OF AUSTRIA	310,000.00	298,689.34	
	GOV OF AUSTRIA	460,000.00	448,638.92	
	GOV OF AUSTRIA	470,000.00	493,105.67	
	GOV OF AUSTRIA	220,000.00	217,520.60	
	GOV OF AUSTRIA	550,000.00	524,795.15	
	GOV OF AUSTRIA	530,000.00	498,464.47	
	GOV OF AUSTRIA	370,000.00	418,289.44	
	GOV OF AUSTRIA	460,000.00	431,209.74	
	GOV OF AUSTRIA	280,000.00	250,101.60	
	GOV OF AUSTRIA	830,000.00	755,544.85	
	GOV OF AUSTRIA	600,000.00	517,877.23	
	GOV OF AUSTRIA	570,000.00	478,354.83	
	GOV OF AUSTRIA	440,000.00	387,627.68	
	GOV OF AUSTRIA	440,000.00	452,334.08	
	GOV OF AUSTRIA	490,000.00	480,540.55	
	GOV OF AUSTRIA	250,000.00	183,289.00	
	GOV OF AUSTRIA	590,000.00	678,969.05	
	GOV OF AUSTRIA	280,000.00	176,145.20	
	GOV OF AUSTRIA	490,000.00	514,104.57	
	GOV OF AUSTRIA	300,000.00	232,582.20	
	GOV OF AUSTRIA	110,000.00	90,793.50	
	GOV OF AUSTRIA	490,000.00	301,639.59	
	GOV OF AUSTRIA	80,000.00	84,581.12	
	GOV OF AUSTRIA	180,000.00	218,466.00	
	GOV OF AUSTRIA	30,000.00	14,624.58	
	GOV OF AUSTRIA	160,000.00	77,344.00	
	GOV OF AUSTRIA	240,000.00	192,435.36	
	GOV OF AUSTRIA	160,000.00	102,761.28	
	GOV OF BELGIUM	830,000.00	805,618.75	
	GOV OF BELGIUM	460,000.00	479,937.18	
	GOV OF BELGIUM	650,000.00	627,536.65	
	GOV OF BELGIUM	630,000.00	598,062.15	
	GOV OF BELGIUM	390,000.00	357,459.57	
	GOV OF BELGIUM	990,000.00	1,118,238.66	
	GOV OF BELGIUM	690,000.00	647,103.39	
	GOV OF BELGIUM	840,000.00	780,315.89	
	GOV OF BELGIUM	730,000.00	632,034.00	
	GOV OF BELGIUM	570,000.00	514,718.55	
	GOV OF BELGIUM	630,000.00	520,977.87	
	GOV OF BELGIUM	500,000.00	556,836.50	
	GOV OF BELGIUM	640,000.00	535,379.20	
	GOV OF BELGIUM	580,000.00	519,932.30	
	GOV OF BELGIUM	280,000.00	289,825.48	

		GOV OF BELGIUM	90,000.00	92,900.52	
		GOV OF BELGIUM	780,000.00	952,820.70	
		GOV OF BELGIUM	250,000.00	212,291.25	
		GOV OF BELGIUM	330,000.00	293,100.06	
		GOV OF BELGIUM	310,000.00	208,311.63	
		GOV OF BELGIUM	680,000.00	800,993.76	
		GOV OF BELGIUM	160,000.00	170,277.76	
		GOV OF BELGIUM	450,000.00	502,552.35	
		GOV OF BELGIUM	430,000.00	327,705.58	
		GOV OF BELGIUM	470,000.00	355,790.00	
		GOV OF BELGIUM	440,000.00	300,479.52	
		GOV OF BELGIUM	430,000.00	445,768.10	
		GOV OF BELGIUM	240,000.00	201,024.24	
		GOV OF BELGIUM	480,000.00	389,437.92	
		GOV OF BELGIUM	250,000.00	116,463.25	
		GOV OF FINLAND	150,000.00	152,724.60	
		GOV OF FINLAND	310,000.00	300,722.01	
		GOV OF FINLAND	210,000.00	200,621.40	
		GOV OF FINLAND	230,000.00	215,192.37	
		GOV OF FINLAND	260,000.00	251,637.10	
		GOV OF FINLAND	160,000.00	149,594.40	
		GOV OF FINLAND	280,000.00	285,289.48	
		GOV OF FINLAND	310,000.00	284,531.02	
		GOV OF FINLAND	260,000.00	234,369.46	
		GOV OF FINLAND	200,000.00	170,379.60	
		GOV OF FINLAND	290,000.00	257,658.33	
		GOV OF FINLAND	370,000.00	309,589.54	
		GOV OF FINLAND	190,000.00	175,153.59	
		GOV OF FINLAND	230,000.00	199,621.83	
		GOV OF FINLAND	260,000.00	190,018.66	
		GOV OF FINLAND	80,000.00	79,513.53	
		GOV OF FINLAND	100,000.00	66,323.00	
		GOV OF FINLAND	190,000.00	185,198.70	
		GOV OF FINLAND	230,000.00	151,130.24	
		GOV OF FINLAND	320,000.00	244,652.48	
		GOV OF FINLAND	160,000.00	79,591.02	
		GOV OF FRANCE	1,110,000.00	1,071,738.30	
		GOV OF FRANCE	1,790,000.00	1,724,551.46	
		GOV OF FRANCE	1,460,000.00	1,412,834.70	
		GOV OF FRANCE	1,240,000.00	1,314,207.80	
		GOV OF FRANCE	1,450,000.00	1,406,877.00	
		GOV OF FRANCE	1,680,000.00	1,591,899.12	
		GOV OF FRANCE	1,720,000.00	1,758,947.68	

GOV OF FRANCE	1,820,000.00	1,736,791.42	
GOV OF FRANCE	1,550,000.00	1,552,463.72	
GOV OF FRANCE	1,690,000.00	1,589,537.95	
GOV OF FRANCE	2,210,000.00	2,053,001.60	
GOV OF FRANCE	1,330,000.00	1,272,179.58	
GOV OF FRANCE	1,680,000.00	1,706,490.24	
GOV OF FRANCE	1,580,000.00	1,484,081.36	
GOV OF FRANCE	3,010,000.00	2,818,079.39	
GOV OF FRANCE	1,860,000.00	1,729,729.32	
GOV OF FRANCE	110,000.00	112,359.28	
GOV OF FRANCE	2,230,000.00	2,582,440.35	
GOV OF FRANCE	2,200,000.00	2,002,319.00	
GOV OF FRANCE	1,850,000.00	1,618,233.85	
GOV OF FRANCE	2,240,000.00	2,266,818.40	
GOV OF FRANCE	2,230,000.00	1,901,881.13	
GOV OF FRANCE	2,410,000.00	2,273,880.79	
GOV OF FRANCE	1,800,000.00	1,494,230.40	
GOV OF FRANCE	1,280,000.00	1,047,633.92	
GOV OF FRANCE	1,330,000.00	1,675,890.44	
GOV OF FRANCE	1,770,000.00	1,707,727.59	
GOV OF FRANCE	1,680,000.00	1,752,129.12	
GOV OF FRANCE	290,000.00	314,521.90	
GOV OF FRANCE	1,730,000.00	1,524,711.28	
GOV OF FRANCE	1,130,000.00	1,365,390.18	
GOV OF FRANCE	1,640,000.00	1,393,212.80	
GOV OF FRANCE	510,000.00	417,592.59	
GOV OF FRANCE	1,030,000.00	1,184,612.27	
GOV OF FRANCE	1,020,000.00	892,500.00	
GOV OF FRANCE	910,000.00	634,467.47	
GOV OF FRANCE	1,570,000.00	1,926,795.06	
GOV OF FRANCE	530,000.00	497,672.65	
GOV OF FRANCE	750,000.00	475,015.50	
GOV OF FRANCE	1,190,000.00	1,253,480.55	
GOV OF FRANCE	1,150,000.00	963,505.65	
GOV OF FRANCE	1,400,000.00	1,031,692.20	
GOV OF FRANCE	1,070,000.00	623,684.81	
GOV OF FRANCE	1,110,000.00	634,897.80	
GOV OF FRANCE	810,000.00	807,712.63	
GOV OF FRANCE	780,000.00	934,597.56	
GOV OF FRANCE	780,000.00	948,190.62	
GOV OF FRANCE	570,000.00	416,188.35	
GOV OF FRANCE	450,000.00	194,534.13	
GOV OF GERMANY	600,000.00	594,515.88	

GOV OF GERMANY	1,190,000.00	1,156,979.88	
GOV OF GERMANY	580,000.00	576,968.79	
GOV OF GERMANY	890,000.00	857,889.06	
GOV OF GERMANY	420,000.00	420,033.09	
GOV OF GERMANY	1,730,000.00	1,684,274.94	
GOV OF GERMANY	280,000.00	282,209.20	
GOV OF GERMANY	970,000.00	927,276.35	
GOV OF GERMANY	350,000.00	335,431.95	
GOV OF GERMANY	480,000.00	485,338.26	
GOV OF GERMANY	1,300,000.00	1,248,845.00	
GOV OF GERMANY	1,030,000.00	977,081.49	
GOV OF GERMANY	1,070,000.00	1,009,490.43	
GOV OF GERMANY	930,000.00	874,841.70	
GOV OF GERMANY	1,100,000.00	1,038,061.20	
GOV OF GERMANY	860,000.00	802,684.44	
GOV OF GERMANY	960,000.00	1,101,937.15	
GOV OF GERMANY	840,000.00	794,729.88	
GOV OF GERMANY	1,370,000.00	1,333,411.41	
GOV OF GERMANY	500,000.00	462,191.00	
GOV OF GERMANY	1,230,000.00	1,399,620.69	
GOV OF GERMANY	660,000.00	621,190.68	
GOV OF GERMANY	490,000.00	493,430.98	
GOV OF GERMANY	710,000.00	794,485.03	
GOV OF GERMANY	1,110,000.00	1,026,846.57	
GOV OF GERMANY	1,050,000.00	1,069,114.20	
GOV OF GERMANY	1,050,000.00	955,116.75	
GOV OF GERMANY	1,060,000.00	973,406.48	
GOV OF GERMANY	1,150,000.00	1,032,553.95	
GOV OF GERMANY	900,000.00	906,975.90	
GOV OF GERMANY	460,000.00	571,884.19	
GOV OF GERMANY	970,000.00	863,241.80	
GOV OF GERMANY	1,130,000.00	996,189.92	
GOV OF GERMANY	700,000.00	617,757.00	
GOV OF GERMANY	150,000.00	154,224.94	
GOV OF GERMANY	870,000.00	1,071,592.22	
GOV OF GERMANY	1,090,000.00	951,419.20	
GOV OF GERMANY	1,090,000.00	941,935.14	
GOV OF GERMANY	500,000.00	432,221.18	
GOV OF GERMANY	1,650,000.00	1,410,052.05	
GOV OF GERMANY	810,000.00	793,026.62	
GOV OF GERMANY	1,540,000.00	1,580,062.90	
GOV OF GERMANY	810,000.00	851,253.30	
GOV OF GERMANY	950,000.00	1,190,651.15	

GOV OF GERMANY	880,000.00	694,188.00	
GOV OF GERMANY	1,000,000.00	768,634.00	
GOV OF GERMANY	1,100,000.00	1,327,795.70	
GOV OF GERMANY	800,000.00	682,569.64	
GOV OF GERMANY	650,000.00	821,284.75	
GOV OF GERMANY	840,000.00	1,129,392.34	
GOV OF GERMANY	700,000.00	804,226.50	
GOV OF GERMANY	1,190,000.00	1,238,225.94	
GOV OF GERMANY	1,100,000.00	1,151,460.20	
GOV OF GERMANY	1,460,000.00	1,198,835.20	
GOV OF GERMANY	1,560,000.00	881,370.36	
GOV OF GERMANY	1,280,000.00	692,526.08	
GOV OF GERMANY	1,280,000.00	1,168,029.44	
GOV OF IRELAND	550,000.00	566,140.02	
GOV OF IRELAND	460,000.00	444,778.64	
GOV OF IRELAND	280,000.00	261,589.44	
GOV OF IRELAND	210,000.00	198,818.29	
GOV OF IRELAND	330,000.00	311,345.76	
GOV OF IRELAND	410,000.00	414,142.23	
GOV OF IRELAND	330,000.00	287,301.96	
GOV OF IRELAND	160,000.00	150,534.88	
GOV OF IRELAND	390,000.00	327,765.75	
GOV OF IRELAND	280,000.00	236,626.74	
GOV OF IRELAND	240,000.00	218,989.44	
GOV OF IRELAND	160,000.00	127,522.24	
GOV OF IRELAND	250,000.00	224,570.00	
GOV OF IRELAND	90,000.00	63,592.20	
GOV OF IRELAND	190,000.00	199,218.80	
GOV OF IRELAND	420,000.00	366,754.92	
GOV OF IRELAND	410,000.00	313,845.16	
GOV OF ITALY	920,000.00	912,819.40	
GOV OF ITALY	580,000.00	561,827.88	
GOV OF ITALY	1,170,000.00	1,133,345.07	
GOV OF ITALY	1,050,000.00	1,071,421.47	
GOV OF ITALY	800,000.00	782,428.80	
GOV OF ITALY	660,000.00	645,249.66	
GOV OF ITALY	970,000.00	952,404.20	
GOV OF ITALY	200,000.00	194,171.80	
GOV OF ITALY	200,000.00	201,963.76	
GOV OF ITALY	740,000.00	734,516.60	
GOV OF ITALY	780,000.00	766,630.02	
GOV OF ITALY	730,000.00	738,451.21	
GOV OF ITALY	710,000.00	675,100.66	

		GOV OF ITALY	710,000.00	733,897.96
		GOV OF ITALY	1,180,000.00	1,105,530.20
		GOV OF ITALY	900,000.00	918,711.00
		GOV OF ITALY	880,000.00	854,569.99
		GOV OF ITALY	1,010,000.00	991,737.25
		GOV OF ITALY	200,000.00	185,823.20
		GOV OF ITALY	440,000.00	451,289.08
		GOV OF ITALY	1,140,000.00	1,089,923.22
		GOV OF ITALY	710,000.00	668,970.08
		GOV OF ITALY	600,000.00	567,500.19
		GOV OF ITALY	700,000.00	685,461.00
		GOV OF ITALY	820,000.00	797,437.70
		GOV OF ITALY	860,000.00	802,208.00
		GOV OF ITALY	1,010,000.00	1,142,507.75
		GOV OF ITALY	650,000.00	644,267.65
		GOV OF ITALY	840,000.00	810,954.48
		GOV OF ITALY	800,000.00	715,808.97
		GOV OF ITALY	800,000.00	814,435.20
		GOV OF ITALY	780,000.00	699,160.02
		GOV OF ITALY	610,000.00	630,851.02
		GOV OF ITALY	860,000.00	925,958.56
		GOV OF ITALY	630,000.00	625,077.81
		GOV OF ITALY	730,000.00	641,036.36
		GOV OF ITALY	820,000.00	808,011.60
		GOV OF ITALY	600,000.00	597,789.60
		GOV OF ITALY	1,660,000.00	1,851,021.51
		GOV OF ITALY	760,000.00	788,265.16
		GOV OF ITALY	1,000,000.00	1,019,918.00
		GOV OF ITALY	870,000.00	780,287.60
		GOV OF ITALY	980,000.00	1,006,885.32
		GOV OF ITALY	590,000.00	510,504.58
		GOV OF ITALY	180,000.00	188,070.84
		GOV OF ITALY	310,000.00	279,098.89
		GOV OF ITALY	860,000.00	728,506.00
		GOV OF ITALY	1,540,000.00	1,816,548.58
		GOV OF ITALY	810,000.00	663,414.30
		GOV OF ITALY	170,000.00	177,741.29
		GOV OF ITALY	1,190,000.00	992,662.30
		GOV OF ITALY	1,280,000.00	1,123,493.12
		GOV OF ITALY	400,000.00	328,812.00
		GOV OF ITALY	750,000.00	695,812.50
		GOV OF ITALY	1,080,000.00	1,268,137.61
		GOV OF ITALY	690,000.00	739,368.94

GOV OF ITALY	670,000.00	611,488.90	
GOV OF ITALY	150,000.00	159,764.25	
GOV OF ITALY	1,500,000.00	1,678,223.10	
GOV OF ITALY	540,000.00	522,296.10	
GOV OF ITALY	380,000.00	390,586.04	
GOV OF ITALY	390,000.00	302,085.22	
GOV OF ITALY	440,000.00	372,040.24	
GOV OF ITALY	1,790,000.00	1,826,990.35	
GOV OF ITALY	450,000.00	318,125.25	
GOV OF ITALY	410,000.00	380,247.94	
GOV OF ITALY	630,000.00	563,757.39	
GOV OF ITALY	460,000.00	513,453.84	
GOV OF ITALY	580,000.00	519,756.56	
GOV OF ITALY	1,050,000.00	1,175,436.15	
GOV OF ITALY	690,000.00	504,514.20	
GOV OF ITALY	560,000.00	587,025.60	
GOV OF ITALY	700,000.00	765,320.50	
GOV OF ITALY	560,000.00	361,392.64	
GOV OF ITALY	790,000.00	697,521.02	
GOV OF ITALY	870,000.00	699,538.29	
GOV OF ITALY	440,000.00	401,028.32	
GOV OF ITALY	370,000.00	357,067.39	
GOV OF ITALY	700,000.00	523,376.00	
GOV OF ITALY	690,000.00	434,978.76	
GOV OF ITALY	320,000.00	218,689.92	
GOV OF ITALY	390,000.00	411,301.41	
GOV OF ITALY	290,000.00	217,777.82	
GOV OF ITALY	260,000.00	162,687.72	
GOV OF NETHERLANDS	820,000.00	789,703.54	
GOV OF NETHERLANDS	550,000.00	522,449.55	
GOV OF NETHERLANDS	680,000.00	648,851.51	
GOV OF NETHERLANDS	980,000.00	914,536.00	
GOV OF NETHERLANDS	280,000.00	265,952.12	
GOV OF NETHERLANDS	680,000.00	765,055.08	
GOV OF NETHERLANDS	500,000.00	468,834.50	
GOV OF NETHERLANDS	550,000.00	492,718.05	
GOV OF NETHERLANDS	380,000.00	341,875.74	
GOV OF NETHERLANDS	350,000.00	355,733.00	
GOV OF NETHERLANDS	320,000.00	277,582.40	
GOV OF NETHERLANDS	580,000.00	491,636.14	
GOV OF NETHERLANDS	700,000.00	605,009.41	
GOV OF NETHERLANDS	640,000.00	651,350.40	
GOV OF NETHERLANDS	200,000.00	203,062.00	

GOV OF NETHERLANDS	850,000.00	994,996.40	
GOV OF NETHERLANDS	270,000.00	191,324.70	
GOV OF NETHERLANDS	670,000.00	497,794.59	
GOV OF NETHERLANDS	630,000.00	745,426.26	
GOV OF NETHERLANDS	890,000.00	937,539.35	
GOV OF NETHERLANDS	740,000.00	383,941.48	
GOV OF NETHERLANDS	350,000.00	318,396.75	
GOV OF SPAIN	830,000.00	801,539.01	
GOV OF SPAIN	660,000.00	647,443.50	
GOV OF SPAIN	840,000.00	804,595.33	
GOV OF SPAIN	890,000.00	913,778.13	
GOV OF SPAIN	1,050,000.00	1,038,576.00	
GOV OF SPAIN	570,000.00	538,228.20	
GOV OF SPAIN	1,290,000.00	1,268,047.87	
GOV OF SPAIN	600,000.00	601,282.55	
GOV OF SPAIN	960,000.00	1,036,384.32	
GOV OF SPAIN	1,110,000.00	1,069,984.50	
GOV OF SPAIN	890,000.00	820,979.61	
GOV OF SPAIN	1,010,000.00	974,571.22	
GOV OF SPAIN	900,000.00	844,983.90	
GOV OF SPAIN	880,000.00	843,978.96	
GOV OF SPAIN	1,010,000.00	909,602.97	
GOV OF SPAIN	1,090,000.00	1,037,648.39	
GOV OF SPAIN	940,000.00	892,612.41	
GOV OF SPAIN	700,000.00	781,470.90	
GOV OF SPAIN	1,120,000.00	1,301,086.08	
GOV OF SPAIN	820,000.00	773,321.14	
GOV OF SPAIN	1,100,000.00	995,894.08	
GOV OF SPAIN	940,000.00	837,305.00	
GOV OF SPAIN	930,000.00	813,406.83	
GOV OF SPAIN	860,000.00	822,289.86	
GOV OF SPAIN	890,000.00	809,530.65	
GOV OF SPAIN	1,120,000.00	925,236.25	
GOV OF SPAIN	690,000.00	580,262.40	
GOV OF SPAIN	900,000.00	759,870.00	
GOV OF SPAIN	840,000.00	1,027,042.80	
GOV OF SPAIN	890,000.00	868,870.51	
GOV OF SPAIN	830,000.00	845,781.28	
GOV OF SPAIN	800,000.00	762,210.72	
GOV OF SPAIN	960,000.00	1,007,525.76	
GOV OF SPAIN	900,000.00	792,657.90	
GOV OF SPAIN	860,000.00	954,286.96	
GOV OF SPAIN	570,000.00	421,399.86	

		GOV OF SPAIN	280,000.00	298,250.36	
		GOV OF SPAIN	800,000.00	952,990.32	
		GOV OF SPAIN	440,000.00	317,568.68	
		GOV OF SPAIN	1,140,000.00	1,340,117.19	
		GOV OF SPAIN	350,000.00	235,566.10	
		GOV OF SPAIN	320,000.00	319,292.70	
		GOV OF SPAIN	630,000.00	789,492.06	
		GOV OF SPAIN	710,000.00	647,152.22	
		GOV OF SPAIN	710,000.00	616,836.12	
		GOV OF SPAIN	880,000.00	503,326.56	
		GOV OF SPAIN	700,000.00	491,104.60	
		GOV OF SPAIN	570,000.00	541,533.63	
		GOV OF SPAIN	290,000.00	148,451.00	
		ユーロ 小計	271,330,000.00	258,190,088.45 (40,812,107,281)	
	英ポンド	UK TREASURY	1,300,000.00	1,239,877.34	
		UK TREASURY	640,000.00	643,719.04	
		UK TREASURY	470,000.00	445,522.40	
		UK TREASURY	840,000.00	809,886.00	
		UK TREASURY	530,000.00	522,871.50	
		UK TREASURY	420,000.00	388,011.79	
		UK TREASURY	870,000.00	821,344.20	
		UK TREASURY	1,240,000.00	1,126,750.80	
		UK TREASURY	950,000.00	958,241.25	
		UK TREASURY	790,000.00	727,242.40	
		UK TREASURY	580,000.00	593,056.72	
		UK TREASURY	780,000.00	677,884.57	
		UK TREASURY	350,000.00	361,990.37	
		UK TREASURY	500,000.00	458,174.00	
		UK TREASURY	580,000.00	643,150.40	
		UK TREASURY	950,000.00	815,166.50	
		UK TREASURY	590,000.00	509,104.39	
		UK TREASURY	750,000.00	608,115.00	
		UK TREASURY	640,000.00	687,799.04	
		UK TREASURY	1,120,000.00	875,011.20	
		UK TREASURY	1,470,000.00	1,204,767.90	
		UK TREASURY	860,000.00	902,518.40	
		UK TREASURY	1,350,000.00	1,309,554.00	
		UK TREASURY	720,000.00	558,360.00	
		UK TREASURY	570,000.00	608,141.55	
		UK TREASURY	480,000.00	338,160.00	
		UK TREASURY	1,060,000.00	1,105,262.00	
		UK TREASURY	740,000.00	571,058.00	

		UK TREASURY	630,000.00	615,762.00	
		UK TREASURY	880,000.00	956,912.00	
		UK TREASURY	960,000.00	648,292.80	
		UK TREASURY	460,000.00	472,052.00	
		UK TREASURY	720,000.00	736,770.60	
		UK TREASURY	890,000.00	574,962.25	
		UK TREASURY	750,000.00	789,112.50	
		UK TREASURY	840,000.00	738,667.99	
		UK TREASURY	630,000.00	572,556.19	
		UK TREASURY	640,000.00	341,281.03	
		UK TREASURY	640,000.00	649,781.63	
		UK TREASURY	950,000.00	576,276.12	
		UK TREASURY	340,000.00	214,918.38	
		UK TREASURY	600,000.00	610,536.72	
		UK TREASURY	780,000.00	343,743.48	
		UK TREASURY	840,000.00	447,234.96	
		UK TREASURY	400,000.00	375,183.22	
		UK TREASURY	860,000.00	479,106.00	
		UK TREASURY	810,000.00	756,132.38	
		UK TREASURY	540,000.00	308,691.86	
		UK TREASURY	790,000.00	809,925.77	
		UK TREASURY	540,000.00	315,471.48	
		UK TREASURY	500,000.00	496,009.67	
		UK TREASURY	760,000.00	258,248.00	
		UK TREASURY	430,000.00	426,896.83	
		UK TREASURY	530,000.00	371,922.20	
		UK TREASURY	570,000.00	514,046.22	
		UK TREASURY	690,000.00	358,813.35	
		UK TREASURY	400,000.00	166,716.12	
	英ポンド 小計		41,510,000.00	35,436,764.51 (6,494,850,199)	
	スウェーデンクローナ	GOV OF SWEDEN	3,170,000.00	3,151,934.55	
		GOV OF SWEDEN	3,300,000.00	3,180,208.18	
		GOV OF SWEDEN	2,790,000.00	2,639,632.97	
		GOV OF SWEDEN	2,680,000.00	2,500,317.79	
		GOV OF SWEDEN	1,620,000.00	1,416,296.34	
		GOV OF SWEDEN	2,320,000.00	2,362,610.04	
		GOV OF SWEDEN	1,340,000.00	1,311,879.96	
		GOV OF SWEDEN	1,840,000.00	2,159,074.40	
	スウェーデンクローナ 小計		19,060,000.00	18,721,954.23 (265,290,091)	
	ノルウェークローネ	GOV OF NORWAY	430,000.00	418,990.96	
		GOV OF NORWAY	2,680,000.00	2,564,076.60	

		GOV OF NORWAY	1,890,000.00	1,799,812.98	
		GOV OF NORWAY	2,110,000.00	2,009,353.00	
		GOV OF NORWAY	2,070,000.00	1,915,801.56	
		GOV OF NORWAY	2,410,000.00	2,149,132.44	
		GOV OF NORWAY	2,150,000.00	1,867,543.75	
		GOV OF NORWAY	2,030,000.00	1,870,206.52	
		GOV OF NORWAY	1,570,000.00	1,541,352.52	
	ノルウェークローネ 小計		17,340,000.00	16,136,270.33 (226,069,147)	
	デンマーククローネ	GOV OF DENMARK	2,500,000.00	2,462,948.00	
		GOV OF DENMARK	2,370,000.00	2,225,294.67	
		GOV OF DENMARK	2,320,000.00	2,114,900.40	
		GOV OF DENMARK	2,640,000.00	2,232,545.04	
		GOV OF DENMARK	1,200,000.00	1,200,630.00	
		GOV OF DENMARK	4,020,000.00	5,155,867.08	
		GOV OF DENMARK	2,280,000.00	1,313,526.24	
	デンマーククローネ 小計		17,330,000.00	16,705,711.43 (354,161,082)	
	ポーランドズロチ	GOV OF POLAND	1,760,000.00	1,664,125.76	
		GOV OF POLAND	1,510,000.00	1,470,430.45	
		GOV OF POLAND	2,250,000.00	2,126,029.50	
		GOV OF POLAND	820,000.00	723,850.90	
		GOV OF POLAND	1,410,000.00	1,366,384.47	
		GOV OF POLAND	2,510,000.00	2,329,197.17	
		GOV OF POLAND	1,620,000.00	1,496,095.92	
		GOV OF POLAND	780,000.00	814,067.28	
		GOV OF POLAND	2,310,000.00	2,089,244.85	
		GOV OF POLAND	2,000,000.00	1,601,172.00	
		GOV OF POLAND	1,320,000.00	1,037,657.28	
		GOV OF POLAND	920,000.00	989,330.28	
	ポーランドズロチ 小計		19,210,000.00	17,707,585.86 (646,930,712)	
	オーストラリアドル	GOV OF AUSTRALIA	830,000.00	822,041.86	
		GOV OF AUSTRALIA	610,000.00	569,804.34	
		GOV OF AUSTRALIA	810,000.00	818,237.36	
		GOV OF AUSTRALIA	960,000.00	878,798.00	
		GOV OF AUSTRALIA	790,000.00	814,284.99	
		GOV OF AUSTRALIA	720,000.00	693,619.08	
		GOV OF AUSTRALIA	630,000.00	591,270.90	
		GOV OF AUSTRALIA	680,000.00	648,520.80	
		GOV OF AUSTRALIA	700,000.00	680,854.70	
		GOV OF AUSTRALIA	710,000.00	668,593.63	
		GOV OF AUSTRALIA	910,000.00	838,071.72	
			800,000.00	656,785.92	

		GOV OF AUSTRALIA			
		GOV OF AUSTRALIA	1,000,000.00	839,926.01	
		GOV OF AUSTRALIA	1,210,000.00	964,102.78	
		GOV OF AUSTRALIA	1,160,000.00	930,131.63	
		GOV OF AUSTRALIA	940,000.00	777,468.42	
		GOV OF AUSTRALIA	920,000.00	948,730.49	
		GOV OF AUSTRALIA	760,000.00	691,878.06	
		GOV OF AUSTRALIA	740,000.00	716,935.47	
		GOV OF AUSTRALIA	670,000.00	632,429.17	
		GOV OF AUSTRALIA	380,000.00	331,353.55	
		GOV OF AUSTRALIA	590,000.00	561,396.52	
		GOV OF AUSTRALIA	460,000.00	404,983.65	
		GOV OF AUSTRALIA	390,000.00	312,974.79	
		GOV OF AUSTRALIA	620,000.00	489,757.10	
		GOV OF AUSTRALIA	800,000.00	459,682.24	
		GOV OF AUSTRALIA	250,000.00	263,347.60	
	オーストラリアドル 小計		20,040,000.00	18,005,980.78 (1,751,261,690)	
	ニュージーランドドル	GOV OF NEWZEALAND	330,000.00	320,543.34	
		GOV OF NEWZEALAND	240,000.00	217,872.47	
		GOV OF NEWZEALAND	320,000.00	320,209.66	
		GOV OF NEWZEALAND	450,000.00	375,667.84	
		GOV OF NEWZEALAND	330,000.00	308,270.30	
		GOV OF NEWZEALAND	150,000.00	150,495.43	
		GOV OF NEWZEALAND	250,000.00	203,413.84	
		GOV OF NEWZEALAND	420,000.00	347,038.26	
		GOV OF NEWZEALAND	460,000.00	424,316.91	
		GOV OF NEWZEALAND	150,000.00	146,098.13	
		GOV OF NEWZEALAND	180,000.00	145,190.19	
		GOV OF NEWZEALAND	140,000.00	89,914.72	
		GOV OF NEWZEALAND	330,000.00	228,550.06	
	ニュージーランドドル 小計		3,750,000.00	3,277,581.15 (295,801,698)	
	シンガポールドル	GOV OF SINGAPORE	340,000.00	335,070.00	
		GOV OF SINGAPORE	300,000.00	285,013.50	
		GOV OF SINGAPORE	260,000.00	253,942.00	
		GOV OF SINGAPORE	170,000.00	161,857.00	
		GOV OF SINGAPORE	410,000.00	416,970.00	
		GOV OF SINGAPORE	80,000.00	80,288.00	
		GOV OF SINGAPORE	210,000.00	209,013.00	
		GOV OF SINGAPORE	510,000.00	513,060.00	
		GOV OF SINGAPORE	330,000.00	332,310.00	
		GOV OF SINGAPORE	210,000.00	193,872.00	

		GOV OF SINGAPORE	190,000.00	188,062.00	
		GOV OF SINGAPORE	300,000.00	315,988.50	
		GOV OF SINGAPORE	330,000.00	312,675.00	
		GOV OF SINGAPORE	240,000.00	227,733.60	
		GOV OF SINGAPORE	190,000.00	186,970.45	
		GOV OF SINGAPORE	330,000.00	323,070.00	
		GOV OF SINGAPORE	250,000.00	204,000.00	
		GOV OF SINGAPORE	290,000.00	238,316.20	
		GOV OF SINGAPORE	130,000.00	137,085.00	
	シンガポールドル 小計		5,070,000.00	4,915,296.25 (532,818,113)	
	マレーシアリンギット	GOV OF MALAYSIA	640,000.00	644,329.08	
		GOV OF MALAYSIA	1,170,000.00	1,178,714.74	
		GOV OF MALAYSIA	340,000.00	346,507.49	
		GOV OF MALAYSIA	690,000.00	696,986.31	
		GOV OF MALAYSIA	930,000.00	939,815.12	
		GOV OF MALAYSIA	130,000.00	131,294.21	
		GOV OF MALAYSIA	590,000.00	587,215.46	
		GOV OF MALAYSIA	1,470,000.00	1,484,571.81	
		GOV OF MALAYSIA	820,000.00	822,844.49	
		GOV OF MALAYSIA	370,000.00	384,037.98	
		GOV OF MALAYSIA	760,000.00	765,808.60	
		GOV OF MALAYSIA	780,000.00	812,964.04	
		GOV OF MALAYSIA	1,050,000.00	969,866.63	
		GOV OF MALAYSIA	470,000.00	482,912.72	
		GOV OF MALAYSIA	530,000.00	520,472.37	
		GOV OF MALAYSIA	660,000.00	659,520.92	
		GOV OF MALAYSIA	620,000.00	665,293.48	
		GOV OF MALAYSIA	800,000.00	793,873.10	
		GOV OF MALAYSIA	910,000.00	933,292.54	
		GOV OF MALAYSIA	820,000.00	883,883.82	
		GOV OF MALAYSIA	800,000.00	880,663.12	
		GOV OF MALAYSIA	920,000.00	882,617.85	
		GOV OF MALAYSIA	660,000.00	711,206.76	
		GOV OF MALAYSIA	510,000.00	557,859.82	
		GOV OF MALAYSIA	450,000.00	481,795.56	
		GOV OF MALAYSIA	900,000.00	991,439.19	
		GOV OF MALAYSIA	1,010,000.00	994,151.79	
		GOV OF MALAYSIA	320,000.00	331,564.32	
	マレーシアリンギット 小計		20,120,000.00	20,535,503.32 (634,598,391)	
	中国元	GOV OF CHINA	6,300,000.00	6,298,310.65	
		GOV OF CHINA	6,420,000.00	6,414,761.46	

		GOV OF CHINA	9,400,000.00	9,398,557.47	
		GOV OF CHINA	11,910,000.00	11,850,070.90	
		GOV OF CHINA	7,880,000.00	7,863,525.83	
		GOV OF CHINA	11,670,000.00	11,604,648.57	
		GOV OF CHINA	7,220,000.00	7,194,015.00	
		GOV OF CHINA	5,500,000.00	5,487,055.53	
		GOV OF CHINA	13,160,000.00	13,325,000.08	
		GOV OF CHINA	6,650,000.00	6,631,227.05	
		GOV OF CHINA	5,130,000.00	5,132,844.07	
		GOV OF CHINA	22,990,000.00	23,332,178.56	
		GOV OF CHINA	10,240,000.00	10,217,505.17	
		GOV OF CHINA	15,840,000.00	15,940,612.51	
		GOV OF CHINA	1,800,000.00	1,789,499.73	
		GOV OF CHINA	8,250,000.00	8,226,566.35	
		GOV OF CHINA	8,300,000.00	8,301,028.37	
		GOV OF CHINA	11,720,000.00	11,867,134.04	
		GOV OF CHINA	9,840,000.00	9,842,295.67	
		GOV OF CHINA	5,160,000.00	5,150,736.92	
		GOV OF CHINA	11,890,000.00	12,285,174.85	
		GOV OF CHINA	9,610,000.00	9,659,519.36	
		GOV OF CHINA	12,660,000.00	12,939,140.34	
		GOV OF CHINA	7,200,000.00	7,174,100.37	
		GOV OF CHINA	14,780,000.00	15,056,548.58	
		GOV OF CHINA	15,100,000.00	15,140,051.24	
		GOV OF CHINA	9,780,000.00	9,901,219.18	
		GOV OF CHINA	11,940,000.00	12,057,318.85	
		GOV OF CHINA	9,420,000.00	9,436,419.06	
		GOV OF CHINA	6,700,000.00	6,775,253.73	
		GOV OF CHINA	8,950,000.00	9,057,238.90	
		GOV OF CHINA	11,250,000.00	11,301,167.25	
		GOV OF CHINA	9,870,000.00	9,879,844.33	
		GOV OF CHINA	10,830,000.00	11,338,943.93	
		GOV OF CHINA	9,600,000.00	9,883,687.68	
		GOV OF CHINA	4,250,000.00	4,332,158.87	
		GOV OF CHINA	8,380,000.00	8,456,204.36	
		GOV OF CHINA	7,140,000.00	7,209,972.71	
		GOV OF CHINA	6,220,000.00	6,247,786.60	
		GOV OF CHINA	5,260,000.00	5,246,033.01	
		GOV OF CHINA	3,900,000.00	3,954,581.28	
		GOV OF CHINA	8,260,000.00	8,429,470.42	
		GOV OF CHINA	7,230,000.00	7,240,246.35	
		GOV OF CHINA	7,290,000.00	7,226,919.70	
		GOV OF CHINA	5,010,000.00	5,985,873.35	

		GOV OF CHINA	7,500,000.00	8,650,850.25	
		GOV OF CHINA	6,070,000.00	6,555,298.32	
		GOV OF CHINA	6,890,000.00	7,906,283.26	
		GOV OF CHINA	4,170,000.00	4,773,378.56	
		GOV OF CHINA	4,500,000.00	4,940,680.95	
		GOV OF CHINA	3,610,000.00	3,862,047.67	
		GOV OF CHINA	4,220,000.00	4,313,926.65	
		GOV OF CHINA	5,360,000.00	5,650,141.08	
	中国元 小計		450,220,000.00	458,735,054.97 (9,278,237,601)	
	イスラエルシュケル	GOV OF ISRAEL	580,000.00	557,438.00	
		GOV OF ISRAEL	1,330,000.00	1,296,816.50	
		GOV OF ISRAEL	570,000.00	536,142.00	
		GOV OF ISRAEL	760,000.00	822,586.00	
		GOV OF ISRAEL	1,030,000.00	998,018.50	
		GOV OF ISRAEL	930,000.00	881,593.50	
		GOV OF ISRAEL	360,000.00	371,970.00	
		GOV OF ISRAEL	1,070,000.00	918,809.00	
		GOV OF ISRAEL	700,000.00	582,190.00	
		GOV OF ISRAEL	940,000.00	699,219.00	
		GOV OF ISRAEL	820,000.00	995,849.00	
		GOV OF ISRAEL	910,000.00	853,352.50	
		GOV OF ISRAEL	370,000.00	272,468.00	
	イスラエルシュケル 小計		10,370,000.00	9,786,452.00 (385,923,841)	
合計				123,190,825,829 (123,190,825,829)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。

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

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数		組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	国債証券	261銘柄	100.0%	47.1%
カナダドル	国債証券	36銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券	15銘柄	100.0%	0.9%
ユーロ	国債証券	357銘柄	100.0%	33.2%
英ポンド	国債証券	57銘柄	100.0%	5.3%
スウェーデンクローナ	国債証券	8銘柄	100.0%	0.2%
ノルウェークローネ	国債証券	9銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券	7銘柄	100.0%	0.3%
ポーランドズロチ	国債証券	12銘柄	100.0%	0.5%
オーストラリアドル	国債証券	27銘柄	100.0%	1.4%
ニュージーランドドル	国債証券	13銘柄	100.0%	0.2%
シンガポールドル	国債証券	19銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリンギット	国債証券	28銘柄	100.0%	0.5%

中国元	国債証券	53銘柄	100.0%	7.5%
イスラエルシュケル	国債証券	13銘柄	100.0%	0.3%

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

ＲＭ先進国債券マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2023年12月20日現在
資産の部	
流動資産	
預金	79,554,239
金銭信託	92,167,391
国債証券	56,859,137,935
未収利息	371,864,284
前払費用	23,722,004
流動資産合計	57,426,445,853
資産合計	57,426,445,853
負債の部	
流動負債	
未払金	13,343,529
未払解約金	45,040,000
その他未払費用	379
流動負債合計	58,383,908
負債合計	58,383,908
純資産の部	
元本等	
元本	47,264,849,853
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	10,103,212,092
元本等合計	57,368,061,945
純資産合計	57,368,061,945
負債純資産合計	57,426,445,853

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

2023年12月20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	22,593,183,723円
期中一部解約元本額	19,549,322,634円
期末元本額	47,264,849,853円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド（安定型）	2,360,692,492円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	2,300,178,127円
りそなラップ型ファンド（成長型）	672,804,208円
ＤＣりそな　グローバルバランス	68,759,442円
つみたてバランスファンド	1,678,992,339円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	1,160,897,535円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	344,281,994円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	107,734,624円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	194,657,420円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	59,353,672円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	14,158,608円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	17,238,302円
りそな　つみたてラップ型ファンド（安定型）	74,343,145円
りそな　つみたてラップ型ファンド（安定成長型）	25,919,203円
りそな　つみたてラップ型ファンド（成長型）	15,813,435円
ターゲットリターンバランスファンド（目標２％）	1,013,935円
ターゲットリターンバランスファンド（目標３％）	172,989円
ターゲットリターンバランスファンド（目標４％）	639,224円
ターゲットリターンバランスファンド（目標５％）	252,485円
ターゲットリターンバランスファンド（目標６％）	488,297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	27,079,320円
ＦＷりそな先進国＋新興国債券アクティブファンド	36,218,598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）	32,426,672,488円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　先進国債券インデックス（為替ヘッジなし）	2,494,010,889円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	382,425,717円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	282,398,776円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	72,654,264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）	910,509,674円
りそなＶＩグローバル・バランスファンド（安定型）（適格機関投資家専用）	4,313,852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）	5,241,771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）	21,728,578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Ｉ（適格機関投資家専用）	352,822,553円
りそなマルチアセットファンド（適格機関投資家専用）	17,047,985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	
	47,264,849,853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	1.2138円
(10,000口当たり純資産額)	(12,138円)

（注）※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

2023年12月20日現在

１.金融商品に対する取組方針

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

２.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

３.金融商品に係るリスク管理体制

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

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

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

2023年12月20日現在
1.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 2.時価の算定方法 国債証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。 3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

2023年12月20日現在
該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）
該当事項はありません。

（その他の注記）
1　有価証券に関する注記
売買目的有価証券

種類	2023年12月20日現在 損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	30,875,551
合計	30,875,551

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

2　デリバティブ取引に関する注記
該当事項はありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表
(1)株式
該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種　類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY N/B	400,000.00	389,549.13	
		US TREASURY N/B	700,000.00	677,691.30	
		US TREASURY N/B	1,000,000.00	995,865.82	
		US TREASURY N/B	1,130,000.00	1,088,030.37	
		US TREASURY N/B	400,000.00	389,550.72	
		US TREASURY N/B	860,000.00	833,166.69	
		US TREASURY N/B	560,000.00	556,571.42	
		US TREASURY N/B	700,000.00	673,210.86	
		US TREASURY N/B	430,000.00	419,266.79	
		US TREASURY N/B	550,000.00	529,761.71	
		US TREASURY N/B	770,000.00	764,450.58	
		US TREASURY N/B	730,000.00	706,916.60	
		US TREASURY N/B	930,000.00	895,597.26	
		US TREASURY N/B	340,000.00	332,084.37	
		US TREASURY N/B	960,000.00	919,874.99	

		US TREASURY N/B	850,000.00	848,472.65
		US TREASURY N/B	590,000.00	568,831.44
		US TREASURY N/B	250,000.00	243,491.21
		US TREASURY N/B	1,160,000.00	1,099,281.25
		US TREASURY N/B	2,120,000.00	2,097,516.40
		US TREASURY N/B	600,000.00	584,039.06
		US TREASURY N/B	250,000.00	243,999.02
		US TREASURY N/B	1,060,000.00	1,000,043.75
		US TREASURY N/B	400,000.00	395,625.00
		US TREASURY N/B	570,000.00	550,450.77
		US TREASURY N/B	880,000.00	857,123.44
		US TREASURY N/B	240,000.00	234,079.68
		US TREASURY N/B	850,000.00	798,053.71
		US TREASURY N/B	900,000.00	877,394.52
		US TREASURY N/B	290,000.00	282,200.58
		US TREASURY N/B	650,000.00	608,575.19
		US TREASURY N/B	780,000.00	761,322.65
		US TREASURY N/B	470,000.00	457,726.75
		US TREASURY N/B	630,000.00	588,077.92
		US TREASURY N/B	810,000.00	777,505.07
		US TREASURY N/B	820,000.00	801,517.97
		US TREASURY N/B	310,000.00	301,117.77
		US TREASURY N/B	1,000,000.00	930,585.94
		US TREASURY N/B	1,050,000.00	1,057,628.90
		US TREASURY N/B	920,000.00	904,457.03
		US TREASURY N/B	230,000.00	224,209.57
		US TREASURY N/B	1,180,000.00	1,095,187.50
		US TREASURY N/B	500,000.00	497,978.51
		US TREASURY N/B	570,000.00	555,338.08
		US TREASURY N/B	1,270,000.00	1,175,295.70
		US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,248,406.25
		US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,000,996.09
		US TREASURY N/B	480,000.00	466,331.25
		US TREASURY N/B	980,000.00	906,825.38
		US TREASURY N/B	400,000.00	396,835.93
		US TREASURY N/B	300,000.00	289,898.43
		US TREASURY N/B	1,130,000.00	1,043,153.31
		US TREASURY N/B	800,000.00	792,109.37
		US TREASURY N/B	330,000.00	318,617.57
		US TREASURY N/B	1,320,000.00	1,214,709.38
		US TREASURY N/B	1,060,000.00	1,001,161.72
		US TREASURY N/B	720,000.00	714,937.50
		US TREASURY N/B	350,000.00	336,710.93

US TREASURY N/B	1,360,000.00	1,252,235.93	
US TREASURY N/B	310,000.00	311,937.50	
US TREASURY N/B	430,000.00	411,187.50	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	924,179.69	
US TREASURY N/B	980,000.00	968,381.63	
US TREASURY N/B	450,000.00	431,050.77	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	921,406.25	
US TREASURY N/B	880,000.00	827,337.50	
US TREASURY N/B	470,000.00	447,124.21	
US TREASURY N/B	1,090,000.00	1,002,118.75	
US TREASURY N/B	200,000.00	199,406.25	
US TREASURY N/B	450,000.00	425,179.68	
US TREASURY N/B	1,880,000.00	1,731,546.10	
US TREASURY N/B	520,000.00	490,130.46	
US TREASURY N/B	1,050,000.00	957,735.35	
US TREASURY N/B	1,130,000.00	1,053,680.86	
US TREASURY N/B	320,000.00	297,237.50	
US TREASURY N/B	1,030,000.00	940,317.58	
US TREASURY N/B	400,000.00	373,671.87	
US TREASURY N/B	1,310,000.00	1,198,291.79	
US TREASURY N/B	1,860,000.00	1,882,160.15	
US TREASURY N/B	350,000.00	326,313.47	
US TREASURY N/B	1,170,000.00	1,075,143.16	
US TREASURY N/B	250,000.00	235,410.15	
US TREASURY N/B	850,000.00	860,691.40	
US TREASURY N/B	300,000.00	279,234.37	
US TREASURY N/B	1,210,000.00	1,114,027.14	
US TREASURY N/B	440,000.00	410,557.81	
US TREASURY N/B	900,000.00	827,455.07	
US TREASURY N/B	1,450,000.00	1,340,230.47	
US TREASURY N/B	340,000.00	321,505.85	
US TREASURY N/B	590,000.00	538,121.48	
US TREASURY N/B	470,000.00	438,752.34	
US TREASURY N/B	300,000.00	268,371.09	
US TREASURY N/B	1,040,000.00	990,254.68	
US TREASURY N/B	1,130,000.00	1,003,934.37	
US TREASURY N/B	550,000.00	527,108.40	
US TREASURY N/B	580,000.00	548,689.05	
US TREASURY N/B	1,120,000.00	992,512.50	
US TREASURY N/B	660,000.00	629,204.29	
US TREASURY N/B	1,180,000.00	1,042,755.86	
US TREASURY N/B	490,000.00	477,032.22	
US TREASURY N/B	1,100,000.00	964,841.80	

US TREASURY N/B	400,000.00	382,414.06	
US TREASURY N/B	800,000.00	751,296.87	
US TREASURY N/B	410,000.00	360,383.59	
US TREASURY N/B	1,050,000.00	1,016,510.74	
US TREASURY N/B	810,000.00	706,962.30	
US TREASURY N/B	580,000.00	581,597.26	
US TREASURY N/B	1,230,000.00	1,075,649.41	
US TREASURY N/B	1,360,000.00	1,363,612.50	
US TREASURY N/B	690,000.00	645,810.35	
US TREASURY N/B	1,180,000.00	1,034,966.01	
US TREASURY N/B	740,000.00	735,620.70	
US TREASURY N/B	1,040,000.00	909,979.68	
US TREASURY N/B	750,000.00	745,913.08	
US TREASURY N/B	1,150,000.00	1,009,035.16	
US TREASURY N/B	600,000.00	588,246.09	
US TREASURY N/B	850,000.00	809,143.55	
US TREASURY N/B	1,110,000.00	987,834.96	
US TREASURY N/B	550,000.00	549,774.41	
US TREASURY N/B	980,000.00	874,669.13	
US TREASURY N/B	840,000.00	827,646.09	
US TREASURY N/B	1,820,000.00	1,621,150.78	
US TREASURY N/B	780,000.00	764,643.75	
US TREASURY N/B	1,340,000.00	1,279,202.73	
US TREASURY N/B	1,170,000.00	1,040,134.57	
US TREASURY N/B	930,000.00	916,740.23	
US TREASURY N/B	870,000.00	772,023.04	
US TREASURY N/B	900,000.00	901,001.95	
US TREASURY N/B	1,090,000.00	954,048.04	
US TREASURY N/B	1,170,000.00	1,114,882.02	
US TREASURY N/B	1,280,000.00	1,124,750.00	
US TREASURY N/B	700,000.00	712,427.73	
US TREASURY N/B	920,000.00	811,576.56	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	885,898.44	
US TREASURY N/B	430,000.00	447,384.76	
US TREASURY N/B	890,000.00	856,520.70	
US TREASURY N/B	1,110,000.00	987,921.67	
US TREASURY N/B	1,020,000.00	900,150.00	
US TREASURY N/B	1,190,000.00	1,068,815.23	
US TREASURY N/B	1,140,000.00	1,068,527.34	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	902,617.19	
US TREASURY N/B	1,120,000.00	1,035,496.87	
US TREASURY N/B	790,000.00	748,463.28	
US TREASURY N/B	930,000.00	858,760.54	

US TREASURY N/B	1,000,000.00	940,625.00	
US TREASURY N/B	480,000.00	462,918.74	
US TREASURY N/B	570,000.00	531,747.65	
US TREASURY N/B	850,000.00	752,914.06	
US TREASURY N/B	660,000.00	631,666.40	
US TREASURY N/B	710,000.00	706,339.06	
US TREASURY N/B	470,000.00	470,587.50	
US TREASURY N/B	680,000.00	604,482.81	
US TREASURY N/B	840,000.00	835,685.15	
US TREASURY N/B	880,000.00	875,445.31	
US TREASURY N/B	600,000.00	584,753.90	
US TREASURY N/B	770,000.00	667,914.84	
US TREASURY N/B	620,000.00	621,041.40	
US TREASURY N/B	600,000.00	588,691.40	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	974,140.62	
US TREASURY N/B	120,000.00	135,351.56	
US TREASURY N/B	1,430,000.00	1,163,075.97	
US TREASURY N/B	900,000.00	889,242.19	
US TREASURY N/B	840,000.00	829,959.37	
US TREASURY N/B	1,410,000.00	1,138,464.84	
US TREASURY N/B	650,000.00	675,695.31	
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,266,000.00	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,472,871.09	
US TREASURY N/B	160,000.00	174,965.62	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,495,511.71	
US TREASURY N/B	1,660,000.00	1,418,521.87	
US TREASURY N/B	2,220,000.00	1,830,762.88	
US TREASURY N/B	1,930,000.00	1,597,075.00	
US TREASURY N/B	1,920,000.00	1,645,200.00	
US TREASURY N/B	1,840,000.00	1,699,771.87	
US TREASURY N/B	1,650,000.00	1,506,398.43	
US TREASURY N/B	1,590,000.00	1,611,738.28	
US TREASURY N/B	2,060,000.00	1,991,682.03	
US TREASURY N/B	1,890,000.00	1,808,789.06	
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,195,125.00	
US TREASURY N/B	770,000.00	806,214.06	
US TREASURY N/B	80,000.00	85,012.50	
US TREASURY N/B	90,000.00	100,198.82	
US TREASURY N/B	280,000.00	292,742.18	
US TREASURY N/B	100,000.00	105,677.73	
US TREASURY N/B	470,000.00	442,038.67	
US TREASURY N/B	140,000.00	143,253.90	
US TREASURY N/B	190,000.00	199,700.39	

US TREASURY N/B	440,000.00	455,245.31	
US TREASURY N/B	190,000.00	202,179.29	
US TREASURY N/B	210,000.00	216,624.02	
US TREASURY N/B	450,000.00	287,780.27	
US TREASURY N/B	150,000.00	145,280.27	
US TREASURY N/B	1,110,000.00	703,700.97	
US TREASURY N/B	210,000.00	212,698.82	
US TREASURY N/B	1,200,000.00	790,265.62	
US TREASURY N/B	230,000.00	247,178.12	
US TREASURY N/B	1,210,000.00	864,842.76	
US TREASURY N/B	250,000.00	256,645.50	
US TREASURY N/B	1,110,000.00	841,106.84	
US TREASURY N/B	230,000.00	217,889.06	
US TREASURY N/B	1,340,000.00	927,191.01	
US TREASURY N/B	130,000.00	112,604.88	
US TREASURY N/B	1,290,000.00	928,875.58	
US TREASURY N/B	180,000.00	155,401.17	
US TREASURY N/B	840,000.00	642,009.37	
US TREASURY N/B	200,000.00	168,753.90	
US TREASURY N/B	800,000.00	699,421.87	
US TREASURY N/B	200,000.00	161,761.71	
US TREASURY N/B	680,000.00	604,283.59	
US TREASURY N/B	400,000.00	322,468.75	
US TREASURY N/B	800,000.00	775,468.75	
US TREASURY N/B	320,000.00	273,056.24	
US TREASURY N/B	810,000.00	770,559.95	
US TREASURY N/B	590,000.00	483,385.15	
US TREASURY N/B	390,000.00	370,926.56	
US TREASURY N/B	360,000.00	330,257.81	
US TREASURY N/B	190,000.00	193,547.65	
US TREASURY N/B	720,000.00	671,892.18	
US TREASURY N/B	410,000.00	375,125.97	
US TREASURY N/B	390,000.00	343,222.85	
US TREASURY N/B	230,000.00	194,453.32	
US TREASURY N/B	380,000.00	314,145.70	
US TREASURY N/B	530,000.00	400,957.42	
US TREASURY N/B	320,000.00	263,824.99	
US TREASURY N/B	610,000.00	491,407.42	
US TREASURY N/B	290,000.00	238,485.35	
US TREASURY N/B	180,000.00	134,901.56	
US TREASURY N/B	460,000.00	344,074.60	
US TREASURY N/B	870,000.00	618,345.70	
US TREASURY N/B	350,000.00	280,177.73	

		US TREASURY N/B	170,000.00	138,888.67	
		US TREASURY N/B	620,000.00	483,139.84	
		US TREASURY N/B	770,000.00	599,817.97	
		US TREASURY N/B	190,000.00	154,965.03	
		US TREASURY N/B	760,000.00	633,813.27	
		US TREASURY N/B	1,040,000.00	847,376.56	
		US TREASURY N/B	830,000.00	723,866.99	
		US TREASURY N/B	410,000.00	333,997.85	
		US TREASURY N/B	970,000.00	771,813.08	
		US TREASURY N/B	200,000.00	139,839.84	
		US TREASURY N/B	1,090,000.00	783,075.58	
		US TREASURY N/B	1,260,000.00	830,984.76	
		US TREASURY N/B	1,060,000.00	572,648.44	
		US TREASURY N/B	1,050,000.00	586,502.93	
		US TREASURY N/B	1,330,000.00	794,467.18	
		US TREASURY N/B	1,680,000.00	1,069,293.75	
		US TREASURY N/B	900,000.00	644,238.27	
		US TREASURY N/B	1,380,000.00	904,627.72	
		US TREASURY N/B	1,050,000.00	666,483.39	
		US TREASURY N/B	1,240,000.00	863,228.90	
		US TREASURY N/B	1,050,000.00	839,179.68	
		US TREASURY N/B	770,000.00	631,851.17	
		US TREASURY N/B	1,270,000.00	1,257,151.16	
		US TREASURY N/B	1,250,000.00	1,157,592.77	
		US TREASURY N/B	930,000.00	862,720.31	
		US TREASURY N/B	680,000.00	689,509.37	
		US TREASURY N/B	370,000.00	416,018.75	
		米ドル 小計	205,820,000.00	185,707,589.38 (26,747,464,098)	
	カナダドル	GOV OF CANADA	340,000.00	337,143.02	
		GOV OF CANADA	200,000.00	192,863.04	
		GOV OF CANADA	190,000.00	183,277.94	
		GOV OF CANADA	200,000.00	198,616.84	
		GOV OF CANADA	230,000.00	223,907.25	
		GOV OF CANADA	380,000.00	376,124.06	
		GOV OF CANADA	600,000.00	565,713.51	
		GOV OF CANADA	160,000.00	157,186.03	
		GOV OF CANADA	170,000.00	171,541.01	
		GOV OF CANADA	350,000.00	324,438.13	
		GOV OF CANADA	230,000.00	226,033.74	
		GOV OF CANADA	250,000.00	237,404.88	
		GOV OF CANADA	250,000.00	233,480.83	
		GOV OF CANADA	350,000.00	326,679.16	

		GOV OF CANADA	160,000.00	147,876.15	
		GOV OF CANADA	170,000.00	166,186.30	
		GOV OF CANADA	320,000.00	322,181.08	
		GOV OF CANADA	150,000.00	142,474.10	
		GOV OF CANADA	290,000.00	289,814.44	
		GOV OF CANADA	120,000.00	135,300.99	
		GOV OF CANADA	130,000.00	124,166.46	
		GOV OF CANADA	130,000.00	123,787.08	
		GOV OF CANADA	580,000.00	515,292.35	
		GOV OF CANADA	670,000.00	559,338.35	
		GOV OF CANADA	510,000.00	454,325.58	
		GOV OF CANADA	600,000.00	530,706.18	
		GOV OF CANADA	310,000.00	283,712.48	
		GOV OF CANADA	490,000.00	465,386.04	
		GOV OF CANADA	160,000.00	193,791.18	
		GOV OF CANADA	230,000.00	222,861.14	
		GOV OF CANADA	150,000.00	151,501.07	
		GOV OF CANADA	120,000.00	144,378.24	
		GOV OF CANADA	140,000.00	158,017.02	
		GOV OF CANADA	190,000.00	205,076.58	
		GOV OF CANADA	260,000.00	250,107.78	
		GOV OF CANADA	690,000.00	564,348.29	
		GOV OF CANADA	560,000.00	427,929.81	
		GOV OF CANADA	90,000.00	86,280.77	
		GOV OF CANADA	120,000.00	115,659.13	
	カナダドル 小計		11,240,000.00	10,534,908.03 (1,137,137,972)	
	メキシコペソ	UNITED MEXICAN STATE	4,010,000.00	3,983,932.67	
		UNITED MEXICAN STATE	3,900,000.00	3,686,280.00	
		UNITED MEXICAN STATE	7,930,000.00	7,304,348.77	
		UNITED MEXICAN STATE	500,000.00	467,910.00	
		UNITED MEXICAN STATE	5,670,000.00	5,061,438.90	
		UNITED MEXICAN STATE	6,280,000.00	5,916,325.20	
		UNITED MEXICAN STATE	5,760,000.00	5,596,992.00	
		UNITED MEXICAN STATE	7,760,000.00	7,171,559.20	
		UNITED MEXICAN STATE	3,270,000.00	2,934,171.00	
		UNITED MEXICAN STATE	2,490,000.00	2,250,860.40	
		UNITED MEXICAN STATE	1,470,000.00	1,567,505.10	
		UNITED MEXICAN STATE	2,480,000.00	2,351,362.40	
		UNITED MEXICAN STATE	6,650,000.00	5,815,624.50	
		UNITED MEXICAN STATE	5,050,000.00	4,492,985.00	
		UNITED MEXICAN STATE	2,990,000.00	2,640,020.50	
	メキシコペソ 小計		66,210,000.00	61,241,315.64	

				(516,784,842)	
	ユーロ	GOV OF AUSTRIA	70,000.00	67,445.98	
		GOV OF AUSTRIA	310,000.00	302,343.62	
		GOV OF AUSTRIA	120,000.00	125,899.32	
		GOV OF AUSTRIA	80,000.00	79,098.40	
		GOV OF AUSTRIA	380,000.00	362,585.74	
		GOV OF AUSTRIA	280,000.00	263,339.72	
		GOV OF AUSTRIA	130,000.00	146,966.56	
		GOV OF AUSTRIA	220,000.00	206,230.75	
		GOV OF AUSTRIA	190,000.00	169,711.80	
		GOV OF AUSTRIA	210,000.00	191,161.95	
		GOV OF AUSTRIA	60,000.00	61,749.42	
		GOV OF AUSTRIA	230,000.00	198,519.59	
		GOV OF AUSTRIA	40,000.00	42,473.34	
		GOV OF AUSTRIA	260,000.00	218,196.94	
		GOV OF AUSTRIA	260,000.00	229,052.72	
		GOV OF AUSTRIA	190,000.00	195,326.08	
		GOV OF AUSTRIA	160,000.00	156,911.20	
		GOV OF AUSTRIA	160,000.00	117,304.96	
		GOV OF AUSTRIA	260,000.00	299,206.70	
		GOV OF AUSTRIA	100,000.00	62,909.00	
		GOV OF AUSTRIA	160,000.00	167,870.88	
		GOV OF AUSTRIA	180,000.00	139,549.32	
		GOV OF AUSTRIA	80,000.00	66,031.64	
		GOV OF AUSTRIA	160,000.00	98,494.56	
		GOV OF AUSTRIA	50,000.00	52,863.20	
		GOV OF AUSTRIA	80,000.00	97,096.00	
		GOV OF AUSTRIA	60,000.00	29,249.16	
		GOV OF AUSTRIA	110,000.00	53,174.00	
		GOV OF AUSTRIA	84,000.00	67,352.37	
		GOV OF AUSTRIA	50,000.00	32,112.90	
		GOV OF BELGIUM	410,000.00	397,956.25	
		GOV OF BELGIUM	190,000.00	198,234.92	
		GOV OF BELGIUM	320,000.00	308,941.12	
		GOV OF BELGIUM	260,000.00	246,819.30	
		GOV OF BELGIUM	210,000.00	192,478.23	
		GOV OF BELGIUM	350,000.00	395,336.90	
		GOV OF BELGIUM	310,000.00	290,727.61	
		GOV OF BELGIUM	270,000.00	250,815.82	
		GOV OF BELGIUM	300,000.00	259,740.00	
		GOV OF BELGIUM	340,000.00	307,025.10	
		GOV OF BELGIUM	320,000.00	264,623.68	
		GOV OF BELGIUM	110,000.00	122,504.03	

		GOV OF BELGIUM	350,000.00	292,785.50	
		GOV OF BELGIUM	150,000.00	134,465.25	
		GOV OF BELGIUM	240,000.00	248,421.84	
		GOV OF BELGIUM	140,000.00	144,511.92	
		GOV OF BELGIUM	370,000.00	451,979.05	
		GOV OF BELGIUM	130,000.00	110,391.45	
		GOV OF BELGIUM	180,000.00	159,872.76	
		GOV OF BELGIUM	70,000.00	68,812.80	
		GOV OF BELGIUM	180,000.00	120,955.14	
		GOV OF BELGIUM	310,000.00	365,158.92	
		GOV OF BELGIUM	50,000.00	53,211.80	
		GOV OF BELGIUM	170,000.00	189,853.11	
		GOV OF BELGIUM	210,000.00	160,042.26	
		GOV OF BELGIUM	200,000.00	151,400.00	
		GOV OF BELGIUM	180,000.00	122,923.44	
		GOV OF BELGIUM	200,000.00	207,334.00	
		GOV OF BELGIUM	80,000.00	67,008.08	
		GOV OF BELGIUM	150,000.00	121,699.35	
		GOV OF BELGIUM	120,000.00	55,902.36	
		GOV OF FINLAND	100,000.00	101,816.40	
		GOV OF FINLAND	100,000.00	97,007.10	
		GOV OF FINLAND	130,000.00	124,194.20	
		GOV OF FINLAND	40,000.00	37,424.76	
		GOV OF FINLAND	110,000.00	106,461.85	
		GOV OF FINLAND	120,000.00	112,195.80	
		GOV OF FINLAND	70,000.00	71,322.37	
		GOV OF FINLAND	140,000.00	128,497.88	
		GOV OF FINLAND	150,000.00	135,213.15	
		GOV OF FINLAND	120,000.00	102,227.76	
		GOV OF FINLAND	40,000.00	35,539.08	
		GOV OF FINLAND	140,000.00	117,141.99	
		GOV OF FINLAND	140,000.00	129,060.54	
		GOV OF FINLAND	50,000.00	51,888.70	
		GOV OF FINLAND	90,000.00	78,112.89	
		GOV OF FINLAND	80,000.00	58,467.28	
		GOV OF FINLAND	70,000.00	69,574.34	
		GOV OF FINLAND	30,000.00	19,896.90	
		GOV OF FINLAND	100,000.00	97,473.00	
		GOV OF FINLAND	100,000.00	65,708.80	
		GOV OF FINLAND	90,000.00	68,808.51	
		GOV OF FINLAND	100,000.00	49,744.39	
		GOV OF FRANCE	700,000.00	675,871.00	
		GOV OF FRANCE	1,110,000.00	1,069,414.57	

GOV OF FRANCE	650,000.00	629,001.75	
GOV OF FRANCE	340,000.00	360,347.30	
GOV OF FRANCE	690,000.00	669,479.40	
GOV OF FRANCE	820,000.00	776,998.38	
GOV OF FRANCE	720,000.00	736,303.68	
GOV OF FRANCE	980,000.00	935,195.38	
GOV OF FRANCE	660,000.00	661,049.06	
GOV OF FRANCE	580,000.00	545,521.90	
GOV OF FRANCE	740,000.00	687,430.40	
GOV OF FRANCE	740,000.00	707,829.24	
GOV OF FRANCE	1,040,000.00	1,056,398.72	
GOV OF FRANCE	550,000.00	516,610.60	
GOV OF FRANCE	1,360,000.00	1,273,285.04	
GOV OF FRANCE	960,000.00	892,763.52	
GOV OF FRANCE	490,000.00	500,509.52	
GOV OF FRANCE	620,000.00	717,987.90	
GOV OF FRANCE	1,100,000.00	1,001,159.50	
GOV OF FRANCE	880,000.00	769,754.48	
GOV OF FRANCE	1,060,000.00	1,072,690.85	
GOV OF FRANCE	950,000.00	810,218.42	
GOV OF FRANCE	1,030,000.00	971,824.57	
GOV OF FRANCE	1,010,000.00	838,429.28	
GOV OF FRANCE	570,000.00	466,524.48	
GOV OF FRANCE	620,000.00	781,242.16	
GOV OF FRANCE	900,000.00	868,336.06	
GOV OF FRANCE	550,000.00	573,613.70	
GOV OF FRANCE	270,000.00	292,830.74	
GOV OF FRANCE	760,000.00	669,815.36	
GOV OF FRANCE	580,000.00	700,819.74	
GOV OF FRANCE	780,000.00	662,625.60	
GOV OF FRANCE	310,000.00	253,830.79	
GOV OF FRANCE	480,000.00	552,052.32	
GOV OF FRANCE	370,000.00	323,750.00	
GOV OF FRANCE	630,000.00	439,246.71	
GOV OF FRANCE	730,000.00	895,898.34	
GOV OF FRANCE	210,000.00	197,191.05	
GOV OF FRANCE	380,000.00	240,674.52	
GOV OF FRANCE	510,000.00	537,205.95	
GOV OF FRANCE	550,000.00	460,807.05	
GOV OF FRANCE	530,000.00	390,569.19	
GOV OF FRANCE	540,000.00	314,756.82	
GOV OF FRANCE	560,000.00	320,308.80	
GOV OF FRANCE	320,000.00	319,096.34	

GOV OF FRANCE	380,000.00	455,316.76	
GOV OF FRANCE	380,000.00	461,939.02	
GOV OF FRANCE	270,000.00	197,141.85	
GOV OF FRANCE	240,000.00	103,751.54	
GOV OF GERMANY	260,000.00	257,623.54	
GOV OF GERMANY	640,000.00	622,241.28	
GOV OF GERMANY	340,000.00	338,223.08	
GOV OF GERMANY	290,000.00	279,536.88	
GOV OF GERMANY	360,000.00	360,028.36	
GOV OF GERMANY	490,000.00	477,048.97	
GOV OF GERMANY	140,000.00	141,104.60	
GOV OF GERMANY	580,000.00	554,453.90	
GOV OF GERMANY	50,000.00	47,918.85	
GOV OF GERMANY	650,000.00	624,422.50	
GOV OF GERMANY	520,000.00	493,283.85	
GOV OF GERMANY	570,000.00	537,765.93	
GOV OF GERMANY	440,000.00	413,903.60	
GOV OF GERMANY	580,000.00	547,341.36	
GOV OF GERMANY	360,000.00	336,007.44	
GOV OF GERMANY	140,000.00	160,699.16	
GOV OF GERMANY	740,000.00	700,119.18	
GOV OF GERMANY	490,000.00	476,913.57	
GOV OF GERMANY	550,000.00	508,410.10	
GOV OF GERMANY	170,000.00	193,443.51	
GOV OF GERMANY	670,000.00	630,602.66	
GOV OF GERMANY	420,000.00	422,940.84	
GOV OF GERMANY	190,000.00	212,608.67	
GOV OF GERMANY	700,000.00	647,560.90	
GOV OF GERMANY	190,000.00	193,458.76	
GOV OF GERMANY	350,000.00	318,372.25	
GOV OF GERMANY	590,000.00	541,801.72	
GOV OF GERMANY	670,000.00	601,574.91	
GOV OF GERMANY	470,000.00	473,642.97	
GOV OF GERMANY	210,000.00	261,077.56	
GOV OF GERMANY	650,000.00	578,461.00	
GOV OF GERMANY	610,000.00	537,766.24	
GOV OF GERMANY	80,000.00	70,600.80	
GOV OF GERMANY	370,000.00	455,734.62	
GOV OF GERMANY	660,000.00	576,088.63	
GOV OF GERMANY	700,000.00	604,912.47	
GOV OF GERMANY	600,000.00	512,746.20	
GOV OF GERMANY	580,000.00	567,846.22	
GOV OF GERMANY	820,000.00	841,332.19	

GOV OF GERMANY	290,000.00	304,769.70	
GOV OF GERMANY	490,000.00	614,125.33	
GOV OF GERMANY	400,000.00	315,540.00	
GOV OF GERMANY	360,000.00	276,708.24	
GOV OF GERMANY	540,000.00	651,826.98	
GOV OF GERMANY	290,000.00	247,431.49	
GOV OF GERMANY	340,000.00	429,595.10	
GOV OF GERMANY	370,000.00	497,470.43	
GOV OF GERMANY	370,000.00	425,091.15	
GOV OF GERMANY	550,000.00	572,289.30	
GOV OF GERMANY	560,000.00	586,197.92	
GOV OF GERMANY	650,000.00	533,728.00	
GOV OF GERMANY	700,000.00	395,486.70	
GOV OF GERMANY	130,000.00	73,862.49	
GOV OF GERMANY	440,000.00	238,055.84	
GOV OF GERMANY	440,000.00	401,510.12	
GOV OF GERMANY	110,000.00	100,616.78	
GOV OF IRELAND	200,000.00	205,869.10	
GOV OF IRELAND	180,000.00	174,043.81	
GOV OF IRELAND	130,000.00	121,452.24	
GOV OF IRELAND	150,000.00	142,013.07	
GOV OF IRELAND	190,000.00	179,259.68	
GOV OF IRELAND	160,000.00	161,616.48	
GOV OF IRELAND	140,000.00	121,885.68	
GOV OF IRELAND	120,000.00	112,901.16	
GOV OF IRELAND	110,000.00	92,446.75	
GOV OF IRELAND	130,000.00	109,862.41	
GOV OF IRELAND	110,000.00	100,370.16	
GOV OF IRELAND	100,000.00	79,701.40	
GOV OF IRELAND	130,000.00	116,776.40	
GOV OF IRELAND	50,000.00	35,329.00	
GOV OF IRELAND	80,000.00	83,881.60	
GOV OF IRELAND	170,000.00	148,448.42	
GOV OF IRELAND	160,000.00	122,476.16	
GOV OF ITALY	550,000.00	545,707.25	
GOV OF ITALY	300,000.00	290,600.63	
GOV OF ITALY	440,000.00	426,215.24	
GOV OF ITALY	370,000.00	377,548.51	
GOV OF ITALY	350,000.00	350,741.65	
GOV OF ITALY	350,000.00	342,312.60	
GOV OF ITALY	410,000.00	400,836.91	
GOV OF ITALY	340,000.00	333,832.40	
GOV OF ITALY	120,000.00	116,503.08	

GOV OF ITALY	120,000.00	121,178.25	
GOV OF ITALY	310,000.00	307,702.90	
GOV OF ITALY	320,000.00	314,514.88	
GOV OF ITALY	190,000.00	192,199.63	
GOV OF ITALY	380,000.00	361,321.48	
GOV OF ITALY	530,000.00	547,839.32	
GOV OF ITALY	580,000.00	543,396.20	
GOV OF ITALY	90,000.00	91,871.10	
GOV OF ITALY	440,000.00	427,284.99	
GOV OF ITALY	330,000.00	324,032.96	
GOV OF ITALY	270,000.00	250,861.32	
GOV OF ITALY	60,000.00	61,539.42	
GOV OF ITALY	570,000.00	544,961.61	
GOV OF ITALY	360,000.00	339,196.10	
GOV OF ITALY	430,000.00	406,708.46	
GOV OF ITALY	270,000.00	264,392.10	
GOV OF ITALY	410,000.00	398,718.85	
GOV OF ITALY	230,000.00	214,544.00	
GOV OF ITALY	450,000.00	509,038.11	
GOV OF ITALY	310,000.00	307,266.11	
GOV OF ITALY	500,000.00	482,711.00	
GOV OF ITALY	400,000.00	357,904.48	
GOV OF ITALY	420,000.00	427,578.48	
GOV OF ITALY	250,000.00	224,089.75	
GOV OF ITALY	240,000.00	248,203.68	
GOV OF ITALY	350,000.00	376,843.60	
GOV OF ITALY	440,000.00	436,562.28	
GOV OF ITALY	50,000.00	52,434.76	
GOV OF ITALY	60,000.00	52,687.92	
GOV OF ITALY	330,000.00	325,175.40	
GOV OF ITALY	560,000.00	557,936.96	
GOV OF ITALY	480,000.00	535,235.13	
GOV OF ITALY	330,000.00	342,273.03	
GOV OF ITALY	510,000.00	520,158.18	
GOV OF ITALY	420,000.00	376,690.56	
GOV OF ITALY	230,000.00	236,309.82	
GOV OF ITALY	320,000.00	276,883.84	
GOV OF ITALY	230,000.00	240,312.74	
GOV OF ITALY	500,000.00	450,159.50	
GOV OF ITALY	520,000.00	440,492.00	
GOV OF ITALY	500,000.00	589,788.50	
GOV OF ITALY	420,000.00	343,992.60	
GOV OF ITALY	370,000.00	308,642.90	

GOV OF ITALY	520,000.00	456,419.08	
GOV OF ITALY	500,000.00	411,015.00	
GOV OF ITALY	390,000.00	361,822.50	
GOV OF ITALY	340,000.00	399,228.51	
GOV OF ITALY	410,000.00	439,335.17	
GOV OF ITALY	350,000.00	319,434.50	
GOV OF ITALY	320,000.00	340,830.40	
GOV OF ITALY	430,000.00	481,090.62	
GOV OF ITALY	260,000.00	251,475.90	
GOV OF ITALY	120,000.00	123,342.96	
GOV OF ITALY	350,000.00	271,102.12	
GOV OF ITALY	320,000.00	270,574.72	
GOV OF ITALY	510,000.00	520,539.15	
GOV OF ITALY	370,000.00	261,569.65	
GOV OF ITALY	220,000.00	204,035.48	
GOV OF ITALY	250,000.00	223,713.25	
GOV OF ITALY	400,000.00	446,481.60	
GOV OF ITALY	220,000.00	197,149.04	
GOV OF ITALY	380,000.00	425,395.94	
GOV OF ITALY	330,000.00	241,289.40	
GOV OF ITALY	300,000.00	314,478.00	
GOV OF ITALY	340,000.00	371,727.10	
GOV OF ITALY	250,000.00	161,336.00	
GOV OF ITALY	330,000.00	291,369.54	
GOV OF ITALY	230,000.00	184,935.41	
GOV OF ITALY	340,000.00	309,885.52	
GOV OF ITALY	330,000.00	318,465.51	
GOV OF ITALY	200,000.00	149,536.00	
GOV OF ITALY	220,000.00	138,688.88	
GOV OF ITALY	140,000.00	95,676.84	
GOV OF ITALY	180,000.00	189,831.42	
GOV OF ITALY	150,000.00	112,643.70	
GOV OF ITALY	110,000.00	68,829.42	
GOV OF NETHERLANDS	380,000.00	365,960.17	
GOV OF NETHERLANDS	200,000.00	189,981.66	
GOV OF NETHERLANDS	340,000.00	324,425.75	
GOV OF NETHERLANDS	270,000.00	251,964.00	
GOV OF NETHERLANDS	350,000.00	332,440.15	
GOV OF NETHERLANDS	210,000.00	236,267.01	
GOV OF NETHERLANDS	400,000.00	375,067.60	
GOV OF NETHERLANDS	300,000.00	268,755.30	
GOV OF NETHERLANDS	50,000.00	44,983.65	
GOV OF NETHERLANDS	130,000.00	132,129.40	

GOV OF NETHERLANDS	220,000.00	190,837.90	
GOV OF NETHERLANDS	360,000.00	305,153.47	
GOV OF NETHERLANDS	220,000.00	190,145.81	
GOV OF NETHERLANDS	250,000.00	254,433.75	
GOV OF NETHERLANDS	170,000.00	172,602.70	
GOV OF NETHERLANDS	330,000.00	386,292.72	
GOV OF NETHERLANDS	130,000.00	92,119.30	
GOV OF NETHERLANDS	310,000.00	230,322.87	
GOV OF NETHERLANDS	330,000.00	390,461.37	
GOV OF NETHERLANDS	50,000.00	55,971.30	
GOV OF NETHERLANDS	370,000.00	389,763.55	
GOV OF NETHERLANDS	320,000.00	166,028.69	
GOV OF NETHERLANDS	160,000.00	145,552.80	
GOV OF SPAIN	330,000.00	318,684.18	
GOV OF SPAIN	420,000.00	412,009.50	
GOV OF SPAIN	460,000.00	440,611.73	
GOV OF SPAIN	340,000.00	349,083.78	
GOV OF SPAIN	480,000.00	474,777.60	
GOV OF SPAIN	420,000.00	396,589.20	
GOV OF SPAIN	420,000.00	412,852.79	
GOV OF SPAIN	350,000.00	350,748.16	
GOV OF SPAIN	360,000.00	388,644.12	
GOV OF SPAIN	310,000.00	298,824.50	
GOV OF SPAIN	510,000.00	470,448.99	
GOV OF SPAIN	550,000.00	530,707.10	
GOV OF SPAIN	330,000.00	309,827.43	
GOV OF SPAIN	440,000.00	421,989.48	
GOV OF SPAIN	490,000.00	441,292.53	
GOV OF SPAIN	450,000.00	428,386.95	
GOV OF SPAIN	480,000.00	455,802.08	
GOV OF SPAIN	360,000.00	401,899.32	
GOV OF SPAIN	410,000.00	476,290.44	
GOV OF SPAIN	410,000.00	386,660.57	
GOV OF SPAIN	40,000.00	41,745.12	
GOV OF SPAIN	460,000.00	416,464.79	
GOV OF SPAIN	430,000.00	383,022.50	
GOV OF SPAIN	510,000.00	446,061.81	
GOV OF SPAIN	420,000.00	401,583.42	
GOV OF SPAIN	440,000.00	400,217.40	
GOV OF SPAIN	390,000.00	322,180.48	
GOV OF SPAIN	470,000.00	395,251.20	
GOV OF SPAIN	390,000.00	329,277.00	
GOV OF SPAIN	390,000.00	476,841.30	

		GOV OF SPAIN	480,000.00	468,604.32	
		GOV OF SPAIN	420,000.00	427,985.71	
		GOV OF SPAIN	280,000.00	266,773.75	
		GOV OF SPAIN	520,000.00	545,743.12	
		GOV OF SPAIN	240,000.00	211,375.44	
		GOV OF SPAIN	470,000.00	521,528.92	
		GOV OF SPAIN	280,000.00	207,003.44	
		GOV OF SPAIN	130,000.00	138,473.38	
		GOV OF SPAIN	350,000.00	416,933.26	
		GOV OF SPAIN	290,000.00	209,306.63	
		GOV OF SPAIN	470,000.00	552,504.45	
		GOV OF SPAIN	180,000.00	121,148.28	
		GOV OF SPAIN	180,000.00	179,602.14	
		GOV OF SPAIN	380,000.00	476,201.56	
		GOV OF SPAIN	220,000.00	200,526.04	
		GOV OF SPAIN	270,000.00	234,571.48	
		GOV OF SPAIN	470,000.00	268,822.14	
		GOV OF SPAIN	300,000.00	210,473.40	
		GOV OF SPAIN	260,000.00	247,015.34	
		GOV OF SPAIN	120,000.00	61,428.00	
		ユーロ 小計	125,974,000.00	119,373,253.90 (18,869,330,243)	
	英ポンド	UK TREASURY	430,000.00	410,113.27	
		UK TREASURY	250,000.00	251,452.75	
		UK TREASURY	370,000.00	350,730.40	
		UK TREASURY	250,000.00	241,037.50	
		UK TREASURY	440,000.00	434,082.00	
		UK TREASURY	460,000.00	424,965.29	
		UK TREASURY	250,000.00	236,018.45	
		UK TREASURY	590,000.00	536,115.30	
		UK TREASURY	510,000.00	514,424.25	
		UK TREASURY	240,000.00	220,934.40	
		UK TREASURY	280,000.00	286,303.24	
		UK TREASURY	300,000.00	260,724.84	
		UK TREASURY	160,000.00	165,481.31	
		UK TREASURY	320,000.00	293,231.36	
		UK TREASURY	140,000.00	155,243.20	
		UK TREASURY	550,000.00	471,938.50	
		UK TREASURY	270,000.00	232,979.97	
		UK TREASURY	300,000.00	243,246.00	
		UK TREASURY	280,000.00	300,912.08	
		UK TREASURY	470,000.00	367,192.20	
		UK TREASURY	580,000.00	475,350.60	

		UK TREASURY	480,000.00	503,731.20	
		UK TREASURY	580,000.00	562,623.20	
		UK TREASURY	380,000.00	294,690.00	
		UK TREASURY	50,000.00	53,815.00	
		UK TREASURY	220,000.00	234,721.30	
		UK TREASURY	430,000.00	302,935.00	
		UK TREASURY	270,000.00	281,529.00	
		UK TREASURY	400,000.00	308,680.00	
		UK TREASURY	470,000.00	459,378.00	
		UK TREASURY	280,000.00	304,472.00	
		UK TREASURY	340,000.00	229,603.70	
		UK TREASURY	330,000.00	338,646.00	
		UK TREASURY	240,000.00	245,590.20	
		UK TREASURY	290,000.00	187,347.25	
		UK TREASURY	450,000.00	473,467.50	
		UK TREASURY	30,000.00	32,490.15	
		UK TREASURY	380,000.00	334,159.33	
		UK TREASURY	360,000.00	327,174.96	
		UK TREASURY	220,000.00	117,315.34	
		UK TREASURY	300,000.00	304,585.14	
		UK TREASURY	350,000.00	212,312.25	
		UK TREASURY	210,000.00	132,743.70	
		UK TREASURY	220,000.00	223,863.46	
		UK TREASURY	340,000.00	149,836.90	
		UK TREASURY	430,000.00	228,941.70	
		UK TREASURY	240,000.00	225,109.93	
		UK TREASURY	320,000.00	178,272.00	
		UK TREASURY	380,000.00	354,728.77	
		UK TREASURY	240,000.00	137,196.38	
		UK TREASURY	310,000.00	317,818.97	
		UK TREASURY	280,000.00	163,577.80	
		UK TREASURY	280,000.00	277,765.41	
		UK TREASURY	400,000.00	135,920.00	
		UK TREASURY	180,000.00	178,700.99	
		UK TREASURY	260,000.00	182,452.40	
		UK TREASURY	270,000.00	243,495.57	
		UK TREASURY	290,000.00	150,805.61	
		UK TREASURY	170,000.00	70,854.35	
		英ポンド 小計	19,110,000.00	16,333,827.37 (2,993,663,880)	
	スウェーデンクローナ	GOV OF SWEDEN	1,460,000.00	1,451,679.63	
		GOV OF SWEDEN	1,480,000.00	1,426,275.18	
		GOV OF SWEDEN	1,300,000.00	1,229,936.51	

	GOV OF SWEDEN	1,220,000.00	1,138,204.36	
	GOV OF SWEDEN	1,080,000.00	944,197.56	
	GOV OF SWEDEN	790,000.00	804,509.45	
	GOV OF SWEDEN	600,000.00	587,408.94	
	GOV OF SWEDEN	770,000.00	903,525.70	
スウェーデンクローナ 小計		8,700,000.00	8,485,737.33 (120,242,897)	
ノルウェークローネ	GOV OF NORWAY	1,080,000.00	1,052,349.40	
	GOV OF NORWAY	880,000.00	841,935.60	
	GOV OF NORWAY	810,000.00	771,348.42	
	GOV OF NORWAY	720,000.00	685,656.00	
	GOV OF NORWAY	690,000.00	638,600.52	
	GOV OF NORWAY	1,060,000.00	945,261.57	
	GOV OF NORWAY	940,000.00	816,507.50	
	GOV OF NORWAY	470,000.00	433,003.48	
	GOV OF NORWAY	880,000.00	863,942.81	
	GOV OF NORWAY	340,000.00	360,528.52	
ノルウェークローネ 小計		7,870,000.00	7,409,133.82 (103,801,964)	
デンマーククローネ	GOV OF DENMARK	1,090,000.00	1,073,845.32	
	GOV OF DENMARK	1,160,000.00	1,089,173.76	
	GOV OF DENMARK	1,050,000.00	957,174.75	
	GOV OF DENMARK	1,250,000.00	1,057,076.25	
	GOV OF DENMARK	450,000.00	450,236.25	
	GOV OF DENMARK	1,810,000.00	2,321,422.74	
	GOV OF DENMARK	1,040,000.00	599,152.32	
デンマーククローネ 小計		7,850,000.00	7,548,081.39 (160,019,325)	
ポーランドズロチ	GOV OF POLAND	570,000.00	538,949.82	
	GOV OF POLAND	820,000.00	798,511.90	
	GOV OF POLAND	840,000.00	793,717.68	
	GOV OF POLAND	910,000.00	803,297.95	
	GOV OF POLAND	330,000.00	319,792.11	
	GOV OF POLAND	610,000.00	566,059.87	
	GOV OF POLAND	700,000.00	646,461.20	
	GOV OF POLAND	700,000.00	776,833.46	
	GOV OF POLAND	380,000.00	396,596.88	
	GOV OF POLAND	940,000.00	850,168.90	
	GOV OF POLAND	640,000.00	512,375.04	
	GOV OF POLAND	690,000.00	542,411.76	
	GOV OF POLAND	400,000.00	430,143.60	
ポーランドズロチ 小計		8,530,000.00	7,975,320.17 (291,371,144)	
オーストラリアドル	GOV OF AUSTRALIA	350,000.00	346,644.16	

		GOV OF AUSTRALIA	350,000.00	326,936.92	
		GOV OF AUSTRALIA	380,000.00	383,864.44	
		GOV OF AUSTRALIA	450,000.00	411,936.56	
		GOV OF AUSTRALIA	330,000.00	340,144.36	
		GOV OF AUSTRALIA	310,000.00	298,641.54	
		GOV OF AUSTRALIA	310,000.00	290,942.82	
		GOV OF AUSTRALIA	210,000.00	200,278.48	
		GOV OF AUSTRALIA	340,000.00	330,700.85	
		GOV OF AUSTRALIA	310,000.00	291,921.16	
		GOV OF AUSTRALIA	480,000.00	442,059.81	
		GOV OF AUSTRALIA	490,000.00	402,281.38	
		GOV OF AUSTRALIA	320,000.00	268,776.32	
		GOV OF AUSTRALIA	510,000.00	406,357.37	
		GOV OF AUSTRALIA	490,000.00	392,900.43	
		GOV OF AUSTRALIA	510,000.00	421,817.97	
		GOV OF AUSTRALIA	480,000.00	494,989.81	
		GOV OF AUSTRALIA	360,000.00	327,731.71	
		GOV OF AUSTRALIA	350,000.00	339,091.10	
		GOV OF AUSTRALIA	330,000.00	311,494.96	
		GOV OF AUSTRALIA	190,000.00	165,676.77	
		GOV OF AUSTRALIA	190,000.00	180,788.71	
		GOV OF AUSTRALIA	190,000.00	167,275.85	
		GOV OF AUSTRALIA	240,000.00	192,599.87	
		GOV OF AUSTRALIA	250,000.00	197,482.70	
		GOV OF AUSTRALIA	320,000.00	183,872.89	
		GOV OF AUSTRALIA	140,000.00	147,474.65	
	オーストラリアドル 小計		9,180,000.00	8,264,683.59 (803,823,125)	
	ニュージーランドドル	GOV OF NEWZEALAND	130,000.00	126,274.64	
		GOV OF NEWZEALAND	150,000.00	136,170.29	
		GOV OF NEWZEALAND	190,000.00	190,124.48	
		GOV OF NEWZEALAND	130,000.00	108,526.26	
		GOV OF NEWZEALAND	110,000.00	102,756.76	
		GOV OF NEWZEALAND	100,000.00	100,330.29	
		GOV OF NEWZEALAND	120,000.00	97,638.64	
		GOV OF NEWZEALAND	120,000.00	99,153.78	
		GOV OF NEWZEALAND	240,000.00	221,382.73	
		GOV OF NEWZEALAND	90,000.00	87,658.87	
		GOV OF NEWZEALAND	110,000.00	88,727.33	
		GOV OF NEWZEALAND	80,000.00	51,379.84	
		GOV OF NEWZEALAND	100,000.00	69,257.59	
	ニュージーランドドル 小計		1,670,000.00	1,479,381.50	

			(133,514,180)	
シンガポールドル	GOV OF SINGAPORE	220,000.00	216,810.00	
	GOV OF SINGAPORE	120,000.00	114,005.40	
	GOV OF SINGAPORE	130,000.00	126,971.00	
	GOV OF SINGAPORE	110,000.00	104,731.00	
	GOV OF SINGAPORE	180,000.00	183,060.00	
	GOV OF SINGAPORE	40,000.00	40,144.00	
	GOV OF SINGAPORE	90,000.00	89,577.00	
	GOV OF SINGAPORE	120,000.00	120,720.00	
	GOV OF SINGAPORE	130,000.00	130,910.00	
	GOV OF SINGAPORE	120,000.00	110,784.00	
	GOV OF SINGAPORE	100,000.00	98,980.00	
	GOV OF SINGAPORE	110,000.00	115,862.45	
	GOV OF SINGAPORE	200,000.00	189,500.00	
	GOV OF SINGAPORE	100,000.00	94,889.00	
	GOV OF SINGAPORE	110,000.00	108,246.05	
	GOV OF SINGAPORE	120,000.00	117,480.00	
	GOV OF SINGAPORE	150,000.00	122,400.00	
	GOV OF SINGAPORE	50,000.00	41,089.00	
	GOV OF SINGAPORE	90,000.00	94,905.00	
	シンガポールドル 小計	2,290,000.00	2,221,063.90 (240,763,326)	
マレーシアリンギット	GOV OF MALAYSIA	250,000.00	251,691.05	
	GOV OF MALAYSIA	520,000.00	523,873.22	
	GOV OF MALAYSIA	210,000.00	214,019.33	
	GOV OF MALAYSIA	280,000.00	282,835.02	
	GOV OF MALAYSIA	440,000.00	444,643.71	
	GOV OF MALAYSIA	270,000.00	268,725.72	
	GOV OF MALAYSIA	500,000.00	504,956.40	
	GOV OF MALAYSIA	130,000.00	129,731.87	
	GOV OF MALAYSIA	350,000.00	351,214.11	
	GOV OF MALAYSIA	180,000.00	186,829.29	
	GOV OF MALAYSIA	470,000.00	473,592.16	
	GOV OF MALAYSIA	250,000.00	260,565.40	
	GOV OF MALAYSIA	430,000.00	397,183.47	
	GOV OF MALAYSIA	340,000.00	349,341.12	
	GOV OF MALAYSIA	320,000.00	314,247.46	
	GOV OF MALAYSIA	190,000.00	189,862.08	
	GOV OF MALAYSIA	280,000.00	300,455.12	
	GOV OF MALAYSIA	420,000.00	416,783.37	
	GOV OF MALAYSIA	220,000.00	225,631.16	
	GOV OF MALAYSIA	550,000.00	592,848.90	
	GOV OF MALAYSIA	300,000.00	330,248.67	

		GOV OF MALAYSIA	450,000.00	431,715.25	
		GOV OF MALAYSIA	370,000.00	398,706.82	
		GOV OF MALAYSIA	140,000.00	153,137.99	
		GOV OF MALAYSIA	280,000.00	299,783.90	
		GOV OF MALAYSIA	250,000.00	275,399.77	
		GOV OF MALAYSIA	490,000.00	482,311.26	
		GOV OF MALAYSIA	150,000.00	155,420.77	
	マレーシアリンギット 小計		9,030,000.00	9,205,754.39 (284,480,825)	
	中国元	GOV OF CHINA	2,170,000.00	2,169,418.10	
		GOV OF CHINA	3,130,000.00	3,127,446.01	
		GOV OF CHINA	4,720,000.00	4,719,275.66	
		GOV OF CHINA	5,130,000.00	5,104,186.70	
		GOV OF CHINA	3,140,000.00	3,133,435.42	
		GOV OF CHINA	3,960,000.00	3,937,824.19	
		GOV OF CHINA	4,800,000.00	4,782,724.65	
		GOV OF CHINA	2,880,000.00	2,873,221.80	
		GOV OF CHINA	2,690,000.00	2,723,727.22	
		GOV OF CHINA	4,450,000.00	4,437,437.65	
		GOV OF CHINA	2,500,000.00	2,501,386.00	
		GOV OF CHINA	4,480,000.00	4,546,679.42	
		GOV OF CHINA	3,500,000.00	3,540,124.00	
		GOV OF CHINA	3,300,000.00	3,372,629.37	
		GOV OF CHINA	4,650,000.00	4,679,535.87	
		GOV OF CHINA	4,460,000.00	4,433,982.67	
		GOV OF CHINA	7,400,000.00	7,396,250.19	
		GOV OF CHINA	320,000.00	326,836.96	
		GOV OF CHINA	5,780,000.00	5,763,582.24	
		GOV OF CHINA	2,740,000.00	2,740,339.48	
		GOV OF CHINA	6,770,000.00	6,854,991.25	
		GOV OF CHINA	2,630,000.00	2,630,613.57	
		GOV OF CHINA	3,120,000.00	3,114,399.06	
		GOV OF CHINA	3,630,000.00	3,750,646.31	
		GOV OF CHINA	3,200,000.00	3,216,489.28	
		GOV OF CHINA	3,090,000.00	3,107,676.03	
		GOV OF CHINA	3,230,000.00	3,301,218.27	
		GOV OF CHINA	2,200,000.00	2,326,927.46	
		GOV OF CHINA	3,410,000.00	3,397,733.65	
		GOV OF CHINA	4,020,000.00	4,014,476.72	
		GOV OF CHINA	4,360,000.00	4,441,579.96	
		GOV OF CHINA	1,850,000.00	1,854,906.94	
		GOV OF CHINA	1,900,000.00	1,969,001.35	
		GOV OF CHINA	3,850,000.00	3,897,719.21	

		GOV OF CHINA	2,300,000.00	2,394,146.13	
		GOV OF CHINA	3,950,000.00	3,988,811.51	
		GOV OF CHINA	2,930,000.00	2,935,106.99	
		GOV OF CHINA	3,750,000.00	3,792,119.62	
		GOV OF CHINA	4,000,000.00	4,047,928.00	
		GOV OF CHINA	4,080,000.00	4,098,556.65	
		GOV OF CHINA	3,400,000.00	3,403,391.16	
		GOV OF CHINA	3,420,000.00	3,421,860.48	
		GOV OF CHINA	4,540,000.00	4,753,352.30	
		GOV OF CHINA	4,320,000.00	4,447,659.45	
		GOV OF CHINA	1,820,000.00	1,855,183.33	
		GOV OF CHINA	2,260,000.00	2,280,551.53	
		GOV OF CHINA	2,170,000.00	2,191,266.21	
		GOV OF CHINA	3,690,000.00	3,706,484.33	
		GOV OF CHINA	1,900,000.00	1,894,954.89	
		GOV OF CHINA	3,960,000.00	4,015,420.99	
		GOV OF CHINA	3,770,000.00	3,847,349.09	
		GOV OF CHINA	1,700,000.00	1,702,409.24	
		GOV OF CHINA	2,000,000.00	1,982,694.02	
		GOV OF CHINA	2,840,000.00	2,855,648.68	
		GOV OF CHINA	2,540,000.00	3,034,754.15	
		GOV OF CHINA	2,260,000.00	2,606,789.54	
		GOV OF CHINA	3,670,000.00	3,963,417.60	
		GOV OF CHINA	3,150,000.00	3,614,628.78	
		GOV OF CHINA	1,340,000.00	1,533,891.43	
		GOV OF CHINA	2,430,000.00	2,667,967.71	
		GOV OF CHINA	1,650,000.00	1,765,201.84	
		GOV OF CHINA	1,660,000.00	1,696,947.44	
		GOV OF CHINA	1,650,000.00	1,739,315.82	
		GOV OF CHINA	1,270,000.00	1,292,350.47	
	中国元 小計		207,880,000.00	211,718,582.04 (4,282,156,524)	
	イスラエルシュケル	GOV OF ISRAEL	750,000.00	720,825.00	
		GOV OF ISRAEL	50,000.00	48,752.50	
		GOV OF ISRAEL	290,000.00	272,774.00	
		GOV OF ISRAEL	260,000.00	281,411.00	
		GOV OF ISRAEL	560,000.00	542,612.00	
		GOV OF ISRAEL	430,000.00	407,618.50	
		GOV OF ISRAEL	240,000.00	247,980.00	
		GOV OF ISRAEL	440,000.00	377,828.00	
		GOV OF ISRAEL	330,000.00	274,461.00	
		GOV OF ISRAEL	360,000.00	267,786.00	
		GOV OF ISRAEL	370,000.00	449,346.50	

		GOV OF ISRAEL	430,000.00	403,232.50	
		GOV OF ISRAEL	180,000.00	132,552.00	
	イスラエルシュケル 小計		4,690,000.00	4,427,179.00 (174,583,590)	
合計				56,859,137,935 (56,859,137,935)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。
(注2)合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数		組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	国債証券	257銘柄	100.0%	47.1%
カナダドル	国債証券	39銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券	15銘柄	100.0%	0.9%
ユーロ	国債証券	363銘柄	100.0%	33.2%
英ポンド	国債証券	59銘柄	100.0%	5.3%
スウェーデンクローナ	国債証券	8銘柄	100.0%	0.2%
ノルウェークローネ	国債証券	10銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券	7銘柄	100.0%	0.3%
ポーランドズロチ	国債証券	13銘柄	100.0%	0.5%
オーストラリアドル	国債証券	27銘柄	100.0%	1.4%
ニュージーランドドル	国債証券	13銘柄	100.0%	0.2%
シンガポールドル	国債証券	19銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリンギット	国債証券	28銘柄	100.0%	0.5%
中国元	国債証券	64銘柄	100.0%	7.5%
イスラエルシュケル	国債証券	13銘柄	100.0%	0.3%

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

ＲＭ新興国債券マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2023年12月20日現在
資産の部	
流動資産	
預金	2,379,464
金銭信託	14,899,675
投資信託受益証券	11,218,227,592
流動資産合計	11,235,506,731
資産合計	11,235,506,731
負債の部	
流動負債	
未払解約金	7,850,000
その他未払費用	190
流動負債合計	7,850,190
負債合計	7,850,190

	2023年12月20日現在
純資産の部	
元本等	
元本	8,363,933,801
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	2,863,722,740
元本等合計	11,227,656,541
純資産合計	11,227,656,541
負債純資産合計	11,235,506,731

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

2023年12月20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	1,382,905,255円
期中一部解約元本額	1,500,067,722円
期末元本額	8,363,933,801円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド（安定型）	746,492,793円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	984,417,482円
りそなラップ型ファンド（成長型）	600,177,766円
ＤＣりそな　グローバルバランス	21,559,724円
つみたてバランスファンド	1,517,269,701円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	324,902,797円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	244,639,148円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	168,454,343円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	91,964,096円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	62,112,035円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	35,112,180円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	77,059,603円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスＥＳＧ	94,246,629円
九州ＳＤＧｓ・グローバルバランス	29,986,182円
ラップ型ファンド・プラスＥＳＧ（安定型）	4,879,811円
ラップ型ファンド・プラスＥＳＧ（安定成長型）	40,178,432円
ラップ型ファンド・プラスＥＳＧ（成長型）	46,156,477円
りそな　つみたてラップ型ファンド（安定型）	22,377,348円
りそな　つみたてラップ型ファンド（安定成長型）	23,539,787円
りそな　つみたてラップ型ファンド（成長型）	14,361,717円
ターゲットリターンバランスファンド（目標２％）	303,473円
ターゲットリターンバランスファンド（目標３％）	157,115円
ターゲットリターンバランスファンド（目標４％）	580,501円
ターゲットリターンバランスファンド（目標５％）	229,280円
ターゲットリターンバランスファンド（目標６％）	443,416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	26,980,410円

ＦＷりそな新興国債券インデックスファンド	2,413,975,927円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	80,114,206円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	274,681,847円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	375,179,695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）	2,880,377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）	4,797,025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）	19,360,518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）	30,324円
２．　計算日における受益権の総数	8,363,933,801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	1.3424円
(10,000口当たり純資産額)	(13,424円)

（注）※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

2023年12月20日現在
１.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 ２.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。 ３.金融商品に係るリスク管理体制 運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

2023年12月20日現在
１.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 ２.時価の算定方法 投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。 ３.金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

2023年12月20日現在
該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1　有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2023年12月20日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
投資信託受益証券	324,400,630
合計	324,400,630

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

2　デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種　類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	米ドル	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	1,391,547	63,969,415.59	
		VANECK J.P.MORGAN EM LOCAL	545,832	13,918,716.00	
		米ドル 小計	1,937,379	77,888,131.59 (11,218,227,592)	
合計				11,218,227,592 (11,218,227,592)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の(　)内は、邦貨換算額（単位:円）であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

外貨建有価証券の内訳

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

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

ＲＭ国内株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2023年12月20日現在
資産の部	
流動資産	
金銭信託	351,410,782
株式	124,714,639,070
派生商品評価勘定	1,426,800
未収入金	411,810,800
未収配当金	15,768,404
前払金	1,560,000
差入委託証拠金	27,053,675
流動資産合計	125,523,669,531
資産合計	125,523,669,531
負債の部	
流動負債	
未払金	162,972,220
未払解約金	25,800,000
その他未払費用	2,255
流動負債合計	188,774,475
負債合計	188,774,475

	2023年12月20日現在
純資産の部	
元本等	
元本	69,358,842,449
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	55,976,052,607
元本等合計	125,334,895,056
純資産合計	125,334,895,056
負債純資産合計	125,523,669,531

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12月20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	57,056,644,106円
期中一部解約元本額	23,753,409,145円
期末元本額	69,358,842,449円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド（安定型）	2,345,060,354円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	3,495,444,409円
りそなラップ型ファンド（成長型）	4,251,228,214円
ＤＣりそな　グローバルバランス	68,795,837円
つみたてバランスファンド	6,752,158,448円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	479,032,520円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	359,782,932円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	248,063,806円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	134,484,646円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	90,798,908円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	51,328,213円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	114,104,316円
りそな　つみたてラップ型ファンド（安定型）	69,442,669円
りそな　つみたてラップ型ファンド（安定成長型）	118,752,983円
りそな　つみたてラップ型ファンド（成長型）	121,048,059円
りそな　つみたてリスクコントロールファンド	53,681,473円
ターゲットリターンバランスファンド（目標２％）	679,165円
ターゲットリターンバランスファンド（目標３％）	421,131円
ターゲットリターンバランスファンド（目標４％）	1,986,312円
ターゲットリターンバランスファンド（目標５％）	1,040,625円
ターゲットリターンバランスファンド（目標６％）	3,106,005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	168,551,815円
ＦＷりそな国内株式インデックスファンド	39,881,937,235円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　ＴＯＰＩＸインデックス	4,052,463,926円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	119,099,929円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	405,530,639円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	550,170,646円
ＴＯＰＩＸインデックスファンド（適格機関投資家専用）	496,319,470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）	176,010,560円
りそなＦＴ　ＲＣバランスファンド（適格機関投資家専用）	1,910,339,888円

りそなＶＩグローバル・バランスファンド（安定型）（適格機関投資家専用）	9,739,242円
りそなＶＩグローバル・バランスファンド（安定成長型）（適格機関投資家専用）	30,171,638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）	61,538,376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）	74,154,377円
りそなＤＡＡマルチアセットファンド（適格機関投資家専用）	93,144円
りそなＦＴ　パッシブバランスＩ（適格機関投資家専用）	273,994,027円
りそなマルチアセットファンド（適格機関投資家専用）	47,435,457円
りそなＤＡＡファンドⅡ（適格機関投資家専用）	28,506,911円
りそなＤＡＡファンド２０２２０５（適格機関投資家専用）	368,654,072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
りそなマルチアセットファンド２０２３１０（適格機関投資家専用）	269,511,594円
２．　計算日における受益権の総数	69,358,842,449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	1.8070円
(10,000口当たり純資産額)	(18,070円)

（注）※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

2023年12月20日現在
１.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 ２.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、株価変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。 ３.金融商品に係るリスク管理体制 運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

2023年12月20日現在
１.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 ２.時価の算定方法 株式 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 デリバティブ取引 （その他の注記）の2　デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。 ３.金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

2023年12月20日現在
該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1　有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2023年12月20日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
株式	13,341,990,917

合計	13,341,990,917

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

2　デリバティブ取引に関する注記

(株式関連)

（2023年12月20日現在）　　（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	561,493,200	－	562,920,000	1,426,800
合計		561,493,200	－	562,920,000	1,426,800

（注）時価の算定方法

先物取引

国内先物取引について

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

（単位：円）

銘　柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	2,000	3,730.00	7,460,000	
ニッスイ	52,400	753.00	39,457,200	
マルハニチロ	7,800	2,720.00	21,216,000	
雪国まいたけ	4,500	927.00	4,171,500	
カネコ種苗	1,600	1,396.00	2,233,600	
サカタのタネ	6,000	3,900.00	23,400,000	
ホクト	4,200	1,727.00	7,253,400	
ホクリヨウ	500	1,038.00	519,000	
住石ホールディングス	5,200	1,126.00	5,855,200	
日鉄鉱業	2,100	5,150.00	10,815,000	
三井松島ホールディングス	3,100	2,703.00	8,379,300	
ＩＮＰＥＸ	193,700	1,945.50	376,843,350	
石油資源開発	6,100	5,220.00	31,842,000	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	2,400	2,093.00	5,023,200	
ショーボンドホールディングス	7,100	6,070.00	43,097,000	
ミライト・ワン	17,300	1,835.00	31,745,500	
タマホーム	3,300	3,790.00	12,507,000	
サンヨーホームズ	400	729.00	291,600	
日本アクア	1,200	862.00	1,034,400	
ファーストコーポレーション	700	728.00	509,600	
ベステラ	700	1,039.00	727,300	
キャンディル	500	557.00	278,500	

ダイセキ環境ソリューション	600	1,102.00	661,200	
第一カッター興業	1,300	1,317.00	1,712,100	
安藤・間	30,300	1,075.00	32,572,500	
東急建設	16,400	783.00	12,841,200	
コムシスホールディングス	16,700	3,108.00	51,903,600	
ビーアールホールディングス	7,700	351.00	2,702,700	
高松コンストラクショングループ	3,900	2,652.00	10,342,800	
東建コーポレーション	1,500	9,050.00	13,575,000	
ソネック	300	949.00	284,700	
ヤマウラ	2,700	1,373.00	3,707,100	
オリエンタル白石	19,400	332.00	6,440,800	
大成建設	34,300	4,829.00	165,634,700	
大林組	131,000	1,187.50	155,562,500	
清水建設	103,900	912.90	94,850,310	
飛島建設	3,800	1,265.00	4,807,000	
長谷工コーポレーション	33,600	1,785.50	59,992,800	
松井建設	3,400	807.00	2,743,800	
錢高組	300	3,980.00	1,194,000	
鹿島建設	81,200	2,297.00	186,516,400	
不動テトラ	2,500	2,174.00	5,435,000	
大末建設	800	1,296.00	1,036,800	
鉄建建設	2,600	1,904.00	4,950,400	
西松建設	7,000	3,819.00	26,733,000	
三井住友建設	27,300	393.00	10,728,900	
大豊建設	1,300	3,680.00	4,784,000	
佐田建設	1,300	616.00	800,800	
ナカノフドー建設	1,400	456.00	638,400	
奥村組	5,900	4,415.00	26,048,500	
東鉄工業	4,500	3,030.00	13,635,000	
イチケン	500	2,228.00	1,114,000	
富士ピー・エス	900	456.00	410,400	
淺沼組	2,700	3,625.00	9,787,500	
戸田建設	49,600	914.80	45,374,080	
熊谷組	6,100	3,495.00	21,319,500	
北野建設	400	3,090.00	1,236,000	
植木組	600	1,460.00	876,000	
矢作建設工業	5,000	1,315.00	6,575,000	
ピーエス三菱	4,600	865.00	3,979,000	
日本ハウスホールディングス	7,800	301.00	2,347,800	
新日本建設	5,100	1,072.00	5,467,200	
東亜道路工業	1,500	6,750.00	10,125,000	
日本道路	4,300	1,956.00	8,410,800	
東亜建設工業	2,800	3,395.00	9,506,000	

日本国土開発	10,400	563.00	5,855,200	
若築建設	1,300	2,962.00	3,850,600	
東洋建設	9,200	1,207.00	11,104,400	
五洋建設	51,900	778.80	40,419,720	
世紀東急工業	4,700	1,590.00	7,473,000	
福田組	1,400	5,010.00	7,014,000	
住友林業	31,700	4,241.00	134,439,700	
日本基礎技術	1,200	429.00	514,800	
巴コーポレーション	2,600	560.00	1,456,000	
大和ハウス工業	101,300	4,150.00	420,395,000	
ライト工業	7,500	1,900.00	14,250,000	
積水ハウス	111,100	2,997.00	332,966,700	
日特建設	3,500	1,019.00	3,566,500	
北陸電気工事	2,500	971.00	2,427,500	
ユアテック	8,100	1,032.00	8,359,200	
日本リーテック	2,900	1,139.00	3,303,100	
四電工	1,500	3,025.00	4,537,500	
中電工	5,700	2,556.00	14,569,200	
関電工	22,900	1,348.00	30,869,200	
きんでん	25,800	2,326.00	60,010,800	
東京エネシス	3,600	1,032.00	3,715,200	
トーエネック	1,200	4,350.00	5,220,000	
住友電設	3,500	2,620.00	9,170,000	
日本電設工業	6,900	1,926.00	13,289,400	
エクシオグループ	18,400	3,061.00	56,322,400	
新日本空調	2,400	2,237.00	5,368,800	
九電工	7,900	4,948.00	39,089,200	
三機工業	7,900	1,705.00	13,469,500	
日揮ホールディングス	36,300	1,605.00	58,261,500	
中外炉工業	1,200	2,183.00	2,619,600	
ヤマト	1,700	912.00	1,550,400	
太平電業	2,300	4,120.00	9,476,000	
高砂熱学工業	9,800	3,210.00	31,458,000	
三晃金属工業	300	4,560.00	1,368,000	
朝日工業社	1,700	2,947.00	5,009,900	
明星工業	7,100	1,091.00	7,746,100	
大氣社	4,200	4,140.00	17,388,000	
ダイダン	4,800	1,404.00	6,739,200	
日比谷総合設備	2,700	2,419.00	6,531,300	
フィル・カンパニー	600	568.00	340,800	
テスホールディングス	7,900	409.00	3,231,100	
インフロニア・ホールディングス	42,200	1,397.50	58,974,500	
東洋エンジニアリング	5,400	740.00	3,996,000	

レイズネクスト	5,300	1,446.00	7,663,800	
ニップン	11,000	2,243.00	24,673,000	
日清製粉グループ本社	34,000	1,882.50	64,005,000	
日東富士製粉	700	4,745.00	3,321,500	
昭和産業	3,600	3,080.00	11,088,000	
鳥越製粉	1,800	670.00	1,206,000	
中部飼料	5,100	1,077.00	5,492,700	
フィード・ワン	5,400	759.00	4,098,600	
東洋精糖	400	1,976.00	790,400	
日本甜菜製糖	2,100	1,925.00	4,042,500	
ＤＭ三井製糖ホールディングス	3,600	2,863.00	10,306,800	
塩水港精糖	2,700	226.00	610,200	
ウェルネオシュガー	1,800	2,068.00	3,722,400	
森永製菓	7,900	5,056.00	39,942,400	
中村屋	900	3,050.00	2,745,000	
江崎グリコ	10,500	4,086.00	42,903,000	
名糖産業	1,400	1,655.00	2,317,000	
井村屋グループ	2,200	2,331.00	5,128,200	
不二家	2,500	2,490.00	6,225,000	
山崎製パン	24,600	3,156.00	77,637,600	
第一屋製パン	400	643.00	257,200	
モロゾフ	1,200	3,745.00	4,494,000	
亀田製菓	2,100	3,915.00	8,221,500	
寿スピリッツ	17,400	2,159.50	37,575,300	
カルビー	16,800	2,774.00	46,603,200	
森永乳業	13,400	2,628.50	35,221,900	
六甲バター	2,700	1,313.00	3,545,100	
ヤクルト本社	52,600	3,141.00	165,216,600	
明治ホールディングス	45,100	3,308.00	149,190,800	
雪印メグミルク	8,900	2,077.00	18,485,300	
プリマハム	4,900	2,261.00	11,078,900	
日本ハム	15,800	4,613.00	72,885,400	
林兼産業	700	570.00	399,000	
丸大食品	3,700	1,587.00	5,871,900	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	4,100	3,290.00	13,489,000	
柿安本店	1,400	2,402.00	3,362,800	
伊藤ハム米久ホールディングス	5,600	3,775.00	21,140,000	
サッポロホールディングス	12,100	6,015.00	72,781,500	
アサヒグループホールディングス	85,000	5,378.00	457,130,000	
キリンホールディングス	153,200	2,066.00	316,511,200	
宝ホールディングス	25,100	1,231.50	30,910,650	
オエノンホールディングス	11,000	360.00	3,960,000	
養命酒製造	1,200	1,841.00	2,209,200	

コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	28,800	2,053.00	59,126,400	
ライフドリンク　カンパニー	500	4,640.00	2,320,000	
サントリー食品インターナショナル	25,900	4,707.00	121,911,300	
ダイドーグループホールディングス	2,100	5,810.00	12,201,000	
伊藤園	12,500	4,138.00	51,725,000	
キーコーヒー	4,100	2,041.00	8,368,100	
ユニカフェ	700	965.00	675,500	
ジャパンフーズ	300	1,225.00	367,500	
日清オイリオグループ	5,200	4,135.00	21,502,000	
不二製油グループ本社	8,600	2,314.50	19,904,700	
かどや製油	200	3,515.00	703,000	
Ｊ－オイルミルズ	4,200	1,900.00	7,980,000	
キッコーマン	24,400	8,806.00	214,866,400	
味の素	87,400	5,466.00	477,728,400	
ブルドックソース	1,900	2,121.00	4,029,900	
キユーピー	19,800	2,446.00	48,430,800	
ハウス食品グループ本社	12,700	3,045.00	38,671,500	
カゴメ	15,800	3,082.00	48,695,600	
焼津水産化学工業	900	1,222.00	1,099,800	
アリアケジャパン	3,700	4,555.00	16,853,500	
ピエトロ	300	1,850.00	555,000	
エバラ食品工業	900	2,781.00	2,502,900	
やまみ	200	3,380.00	676,000	
ニチレイ	16,900	3,466.00	58,575,400	
東洋水産	18,600	7,269.00	135,203,400	
イートアンドホールディングス	1,700	2,060.00	3,502,000	
大冷	300	1,919.00	575,700	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	1,700	1,038.00	1,764,600	
日清食品ホールディングス	12,900	14,340.00	184,986,000	
永谷園ホールディングス	1,800	2,109.00	3,796,200	
一正蒲鉾	900	734.00	660,600	
フジッコ	3,800	1,886.00	7,166,800	
ロック・フィールド	4,100	1,530.00	6,273,000	
日本たばこ産業	223,500	3,715.00	830,302,500	
ケンコーマヨネーズ	2,500	1,659.00	4,147,500	
わらべや日洋ホールディングス	2,500	3,410.00	8,525,000	
なとり	2,300	2,040.00	4,692,000	
イフジ産業	400	1,393.00	557,200	
ファーマフーズ	5,300	1,028.00	5,448,400	
ユーグレナ	22,900	720.00	16,488,000	
紀文食品	3,200	1,180.00	3,776,000	
ピックルスホールディングス	2,200	1,198.00	2,635,600	
ミヨシ油脂	800	1,357.00	1,085,600	

理研ビタミン	3,200	2,196.00	7,027,200	
片倉工業	3,400	1,644.00	5,589,600	
グンゼ	2,700	5,010.00	13,527,000	
東洋紡	16,200	1,037.00	16,799,400	
ユニチカ	12,000	175.00	2,100,000	
富士紡ホールディングス	1,600	3,700.00	5,920,000	
倉敷紡績	2,800	2,706.00	7,576,800	
シキボウ	1,700	1,058.00	1,798,600	
日本毛織	9,900	1,269.00	12,563,100	
ダイトウボウ	3,300	89.00	293,700	
トーア紡コーポレーション	800	436.00	348,800	
ダイドーリミテッド	3,000	437.00	1,311,000	
帝国繊維	4,200	2,015.00	8,463,000	
帝人	36,000	1,306.00	47,016,000	
東レ	250,700	737.60	184,916,320	
住江織物	400	2,089.00	835,600	
日本フエルト	1,200	422.00	506,400	
イチカワ	300	1,590.00	477,000	
日東製網	200	1,506.00	301,200	
アツギ	1,500	501.00	751,500	
ダイニック	700	724.00	506,800	
セーレン	7,200	2,480.00	17,856,000	
ソトー	700	694.00	485,800	
東海染工	200	895.00	179,000	
小松マテーレ	5,400	737.00	3,979,800	
ワコールホールディングス	7,700	3,341.00	25,725,700	
ホギメディカル	4,900	3,530.00	17,297,000	
クラウディアホールディングス	500	384.00	192,000	
ＴＳＩホールディングス	12,200	752.00	9,174,400	
マツオカコーポレーション	600	1,575.00	945,000	
ワールド	5,300	1,698.00	8,999,400	
三陽商会	1,200	2,753.00	3,303,600	
ナイガイ	700	269.00	188,300	
オンワードホールディングス	22,100	500.00	11,050,000	
ルックホールディングス	900	2,522.00	2,269,800	
キムラタン	12,800	19.00	243,200	
ゴールドウイン	6,600	10,735.00	70,851,000	
デサント	6,400	3,785.00	24,224,000	
キング	800	685.00	548,000	
ヤマトインターナショナル	1,600	297.00	475,200	
特種東海製紙	2,000	3,780.00	7,560,000	
王子ホールディングス	155,900	532.20	82,969,980	
日本製紙	21,100	1,277.00	26,944,700	

三菱製紙	2,800	508.00	1,422,400	
北越コーポレーション	18,400	1,595.00	29,348,000	
中越パルプ工業	800	1,706.00	1,364,800	
大王製紙	16,500	1,122.50	18,521,250	
阿波製紙	600	374.00	224,400	
レンゴー	34,100	928.00	31,644,800	
トーモク	2,200	2,112.00	4,646,400	
ザ・パック	2,800	3,200.00	8,960,000	
北の達人コーポレーション	15,700	205.00	3,218,500	
クラレ	54,500	1,450.00	79,025,000	
旭化成	253,200	1,023.00	259,023,600	
共和レザー	1,200	724.00	868,800	
巴川製紙所	600	901.00	540,600	
レゾナック・ホールディングス	36,200	2,890.50	104,636,100	
住友化学	277,700	334.10	92,779,570	
住友精化	1,800	4,785.00	8,613,000	
日産化学	17,600	5,512.00	97,011,200	
ラサ工業	1,400	2,108.00	2,951,200	
クレハ	2,700	8,560.00	23,112,000	
多木化学	1,500	3,370.00	5,055,000	
テイカ	3,200	1,332.00	4,262,400	
石原産業	6,200	1,334.00	8,270,800	
片倉コープアグリ	500	1,032.00	516,000	
日本曹達	4,400	5,420.00	23,848,000	
東ソー	50,000	1,793.50	89,675,000	
トクヤマ	12,100	2,327.00	28,156,700	
セントラル硝子	4,000	2,633.00	10,532,000	
東亜合成	18,800	1,312.50	24,675,000	
大阪ソーダ	2,600	9,380.00	24,388,000	
関東電化工業	7,200	855.00	6,156,000	
デンカ	13,600	2,428.00	33,020,800	
信越化学工業	339,400	5,640.00	1,914,216,000	
日本カーバイド工業	1,400	1,409.00	1,972,600	
堺化学工業	2,900	1,848.00	5,359,200	
第一稀元素化学工業	4,100	949.00	3,890,900	
エア・ウォーター	35,300	1,855.00	65,481,500	
日本酸素ホールディングス	36,300	3,795.00	137,758,500	
日本化学工業	1,400	1,869.00	2,616,600	
東邦アセチレン	400	1,942.00	776,800	
日本パーカライジング	16,700	1,114.00	18,603,800	
高圧ガス工業	5,400	861.00	4,649,400	
チタン工業	300	1,197.00	359,100	
四国化成ホールディングス	4,800	1,623.00	7,790,400	

戸田工業	900	1,529.00	1,376,100	
ステラ　ケミファ	2,000	3,255.00	6,510,000	
保土谷化学工業	1,200	3,460.00	4,152,000	
日本触媒	5,700	5,291.00	30,158,700	
大日精化工業	2,600	2,456.00	6,385,600	
カネカ	9,500	3,510.00	33,345,000	
三菱瓦斯化学	27,900	2,225.00	62,077,500	
三井化学	30,900	4,310.00	133,179,000	
ＪＳＲ	40,400	4,019.00	162,367,600	
東京応化工業	6,000	9,205.00	55,230,000	
大阪有機化学工業	3,100	2,639.00	8,180,900	
三菱ケミカルグループ	273,600	938.50	256,773,600	
ＫＨネオケム	5,700	2,257.00	12,864,900	
ダイセル	48,100	1,338.00	64,357,800	
住友ベークライト	5,200	7,255.00	37,726,000	
積水化学工業	75,900	2,024.50	153,659,550	
日本ゼオン	25,700	1,323.50	34,013,950	
アイカ工業	9,400	3,301.00	31,029,400	
ＵＢＥ	17,800	2,241.50	39,898,700	
積水樹脂	5,600	2,452.00	13,731,200	
タキロンシーアイ	9,500	632.00	6,004,000	
旭有機材	2,500	3,835.00	9,587,500	
ニチバン	2,000	1,718.00	3,436,000	
リケンテクノス	8,100	823.00	6,666,300	
大倉工業	1,700	2,682.00	4,559,400	
積水化成品工業	5,300	478.00	2,533,400	
群栄化学工業	900	2,991.00	2,691,900	
タイガースポリマー	900	822.00	739,800	
ミライアル	700	1,422.00	995,400	
ダイキアクシス	900	780.00	702,000	
ダイキョーニシカワ	8,300	711.00	5,901,300	
竹本容器	800	792.00	633,600	
森六ホールディングス	2,100	2,812.00	5,905,200	
恵和	2,700	1,212.00	3,272,400	
日本化薬	28,600	1,353.50	38,710,100	
カーリットホールディングス	4,000	916.00	3,664,000	
日本精化	2,500	2,898.00	7,245,000	
扶桑化学工業	4,000	4,120.00	16,480,000	
トリケミカル研究所	4,500	3,595.00	16,177,500	
ＡＤＥＫＡ	13,000	2,797.50	36,367,500	
日油	11,600	6,899.00	80,028,400	
新日本理化	2,800	180.00	504,000	
ハリマ化成グループ	2,000	785.00	1,570,000	

花王	84,600	5,852.00	495,079,200	
第一工業製薬	1,500	1,781.00	2,671,500	
石原ケミカル	1,700	1,898.00	3,226,600	
日華化学	800	937.00	749,600	
ニイタカ	400	1,917.00	766,800	
三洋化成工業	2,300	4,245.00	9,763,500	
有機合成薬品工業	1,700	277.00	470,900	
大日本塗料	4,200	998.00	4,191,600	
日本ペイントホールディングス	198,700	1,111.00	220,755,700	
関西ペイント	36,700	2,360.00	86,612,000	
神東塗料	1,700	126.00	214,200	
中国塗料	7,700	1,639.00	12,620,300	
日本特殊塗料	1,500	1,163.00	1,744,500	
藤倉化成	4,600	421.00	1,936,600	
太陽ホールディングス	6,500	3,125.00	20,312,500	
ＤＩＣ	14,600	2,554.00	37,288,400	
サカタインクス	8,300	1,310.00	10,873,000	
東洋インキＳＣホールディングス	8,100	2,663.00	21,570,300	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	3,000	1,443.00	4,329,000	
富士フイルムホールディングス	69,500	8,705.00	604,997,500	
資生堂	78,200	4,073.00	318,508,600	
ライオン	49,000	1,317.50	64,557,500	
高砂香料工業	2,800	3,350.00	9,380,000	
マンダム	8,100	1,267.00	10,262,700	
ミルボン	5,100	3,627.00	18,497,700	
ファンケル	16,400	2,344.00	38,441,600	
コーセー	7,600	10,375.00	78,850,000	
コタ	3,500	1,527.00	5,344,500	
シーボン	300	1,481.00	444,300	
ポーラ・オルビスホールディングス	19,200	1,593.50	30,595,200	
ノエビアホールディングス	3,300	5,070.00	16,731,000	
アジュバンホールディングス	500	921.00	460,500	
新日本製薬	2,100	1,662.00	3,490,200	
Ｉ－ｎｅ	700	2,427.00	1,698,900	
アクシージア	1,900	959.00	1,822,100	
エステー	2,900	1,506.00	4,367,400	
アグロ　カネショウ	1,500	1,562.00	2,343,000	
コニシ	5,400	2,582.00	13,942,800	
長谷川香料	7,200	3,135.00	22,572,000	
小林製薬	10,900	6,530.00	71,177,000	
荒川化学工業	3,200	1,006.00	3,219,200	
メック	3,100	4,325.00	13,407,500	
日本高純度化学	800	2,388.00	1,910,400	

タカラバイオ	10,100	1,207.00	12,190,700	
ＪＣＵ	4,200	3,640.00	15,288,000	
新田ゼラチン	1,400	740.00	1,036,000	
ＯＡＴアグリオ	1,100	1,780.00	1,958,000	
デクセリアルズ	9,400	4,283.00	40,260,200	
アース製薬	3,400	4,660.00	15,844,000	
北興化学工業	3,800	975.00	3,705,000	
大成ラミック	1,100	2,798.00	3,077,800	
クミアイ化学工業	14,900	788.00	11,741,200	
日本農薬	6,900	637.00	4,395,300	
アキレス	2,400	1,554.00	3,729,600	
有沢製作所	6,600	1,031.00	6,804,600	
日東電工	24,100	10,610.00	255,701,000	
レック	4,800	1,025.00	4,920,000	
三光合成	4,700	503.00	2,364,100	
きもと	3,400	186.00	632,400	
藤森工業	3,000	3,715.00	11,145,000	
前澤化成工業	2,400	1,518.00	3,643,200	
未来工業	1,300	3,055.00	3,971,500	
ウェーブロックホールディングス	800	630.00	504,000	
ＪＳＰ	2,600	1,762.00	4,581,200	
エフピコ	7,100	2,886.00	20,490,600	
天馬	2,700	2,172.00	5,864,400	
信越ポリマー	8,100	1,572.00	12,733,200	
東リ	5,100	325.00	1,657,500	
ニフコ	11,200	3,524.00	39,468,800	
バルカー	3,100	3,955.00	12,260,500	
ユニ・チャーム	78,100	4,938.00	385,657,800	
ショーエイコーポレーション	700	572.00	400,400	
協和キリン	45,300	2,384.00	107,995,200	
武田薬品工業	331,600	3,996.00	1,325,073,600	
アステラス製薬	328,700	1,672.00	549,586,400	
住友ファーマ	27,800	451.00	12,537,800	
塩野義製薬	47,200	6,955.00	328,276,000	
わかもと製薬	2,100	193.00	405,300	
日本新薬	9,800	4,951.00	48,519,800	
中外製薬	117,300	5,450.00	639,285,000	
科研製薬	6,400	3,216.00	20,582,400	
エーザイ	45,600	7,070.00	322,392,000	
ロート製薬	36,300	2,828.50	102,674,550	
小野薬品工業	79,500	2,503.50	199,028,250	
久光製薬	8,300	4,281.00	35,532,300	
持田製薬	4,300	3,255.00	13,996,500	

参天製薬	68,300	1,380.00	94,254,000	
扶桑薬品工業	1,300	1,864.00	2,423,200	
日本ケミファ	200	1,606.00	321,200	
ツムラ	11,800	2,631.50	31,051,700	
キッセイ薬品工業	6,200	3,205.00	19,871,000	
生化学工業	6,400	739.00	4,729,600	
栄研化学	7,300	1,713.00	12,504,900	
鳥居薬品	2,000	3,540.00	7,080,000	
ＪＣＲファーマ	12,700	1,141.00	14,490,700	
東和薬品	5,800	2,330.00	13,514,000	
富士製薬工業	2,800	1,636.00	4,580,800	
ゼリア新薬工業	5,200	1,975.00	10,270,000	
そーせいグループ	12,300	1,423.00	17,502,900	
第一三共	326,400	3,911.00	1,276,550,400	
杏林製薬	8,100	1,760.00	14,256,000	
大幸薬品	7,700	283.00	2,179,100	
ダイト	2,900	1,853.00	5,373,700	
大塚ホールディングス	77,900	5,273.00	410,766,700	
大正製薬ホールディングス	8,200	8,626.00	70,733,200	
ペプチドリーム	18,200	1,200.50	21,849,100	
セルソース	1,000	1,470.00	1,470,000	
あすか製薬ホールディングス	3,800	1,744.00	6,627,200	
サワイグループホールディングス	8,600	4,969.00	42,733,400	
日本コークス工業	38,000	123.00	4,674,000	
ニチレキ	4,900	2,402.00	11,769,800	
ユシロ化学工業	1,900	1,639.00	3,114,100	
ビーピー・カストロール	800	889.00	711,200	
富士石油	10,900	351.00	3,825,900	
ＭＯＲＥＳＣＯ	700	1,249.00	874,300	
出光興産	41,600	3,861.00	160,617,600	
ＥＮＥＯＳホールディングス	593,200	562.30	333,556,360	
コスモエネルギーホールディングス	11,100	5,538.00	61,471,800	
横浜ゴム	19,000	3,219.00	61,161,000	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	21,500	2,383.50	51,245,250	
ブリヂストン	109,700	5,940.00	651,618,000	
住友ゴム工業	36,800	1,592.50	58,604,000	
藤倉コンポジット	2,500	1,347.00	3,367,500	
オカモト	1,800	5,030.00	9,054,000	
フコク	2,000	1,350.00	2,700,000	
ニッタ	3,800	3,555.00	13,509,000	
住友理工	5,800	1,031.00	5,979,800	
三ツ星ベルト	4,600	4,355.00	20,033,000	
バンドー化学	5,600	1,562.00	8,747,200	

日東紡績	4,700	4,350.00	20,445,000	
ＡＧＣ	33,400	5,317.00	177,587,800	
日本板硝子	17,900	549.00	9,827,100	
石塚硝子	400	3,545.00	1,418,000	
日本山村硝子	800	1,341.00	1,072,800	
日本電気硝子	15,300	3,061.00	46,833,300	
オハラ	1,800	1,084.00	1,951,200	
住友大阪セメント	6,200	3,653.00	22,648,600	
太平洋セメント	22,200	2,699.00	59,917,800	
日本ヒューム	3,300	871.00	2,874,300	
日本コンクリート工業	7,300	316.00	2,306,800	
三谷セキサン	1,600	4,545.00	7,272,000	
アジアパイルホールディングス	5,300	676.00	3,582,800	
東海カーボン	34,600	1,033.00	35,741,800	
日本カーボン	2,000	4,570.00	9,140,000	
東洋炭素	2,600	4,890.00	12,714,000	
ノリタケカンパニーリミテド	2,100	6,630.00	13,923,000	
ＴＯＴＯ	24,700	3,689.00	91,118,300	
日本碍子	43,600	1,667.00	72,681,200	
日本特殊陶業	31,400	3,293.00	103,400,200	
ダントーホールディングス	1,400	930.00	1,302,000	
ＭＡＲＵＷＡ	1,400	29,100.00	40,740,000	
品川リフラクトリーズ	4,600	1,690.00	7,774,000	
黒崎播磨	800	11,310.00	9,048,000	
ヨータイ	2,300	1,534.00	3,528,200	
東京窯業	2,200	425.00	935,000	
ニッカトー	900	553.00	497,700	
フジミインコーポレーテッド	10,100	3,060.00	30,906,000	
クニミネ工業	600	980.00	588,000	
エーアンドエーマテリアル	400	1,256.00	502,400	
ニチアス	9,500	3,260.00	30,970,000	
ニチハ	4,700	2,903.00	13,644,100	
日本製鉄	172,600	3,199.00	552,147,400	
神戸製鋼所	77,500	1,722.00	133,455,000	
中山製鋼所	8,800	795.00	6,996,000	
合同製鐵	2,200	4,370.00	9,614,000	
ＪＦＥホールディングス	107,200	2,166.00	232,195,200	
東京製鐵	10,800	1,739.00	18,781,200	
共英製鋼	4,400	1,923.00	8,461,200	
大和工業	7,300	7,369.00	53,793,700	
東京鐵鋼	1,700	3,890.00	6,613,000	
大阪製鐵	1,800	2,089.00	3,760,200	
淀川製鋼所	4,400	3,760.00	16,544,000	

中部鋼鈑	2,500	2,064.00	5,160,000	
丸一鋼管	11,700	3,709.00	43,395,300	
モリ工業	700	4,215.00	2,950,500	
大同特殊鋼	4,900	7,200.00	35,280,000	
日本高周波鋼業	800	545.00	436,000	
日本冶金工業	2,800	4,105.00	11,494,000	
山陽特殊製鋼	3,800	2,603.00	9,891,400	
愛知製鋼	2,200	3,055.00	6,721,000	
日本金属	600	857.00	514,200	
大平洋金属	3,300	1,203.00	3,969,900	
新日本電工	19,100	276.00	5,271,600	
栗本鐵工所	1,800	3,075.00	5,535,000	
虹技	300	1,135.00	340,500	
日本鋳鉄管	200	1,071.00	214,200	
三菱製鋼	2,900	1,437.00	4,167,300	
日亜鋼業	2,200	320.00	704,000	
日本精線	600	4,790.00	2,874,000	
エンビプロ・ホールディングス	2,100	593.00	1,245,300	
シンニッタン	2,700	253.00	683,100	
新家工業	500	2,805.00	1,402,500	
大紀アルミニウム工業所	4,900	1,157.00	5,669,300	
日本軽金属ホールディングス	11,300	1,691.00	19,108,300	
三井金属鉱業	11,200	4,340.00	48,608,000	
東邦亜鉛	2,500	1,097.00	2,742,500	
三菱マテリアル	27,600	2,438.50	67,302,600	
住友金属鉱山	44,700	4,279.00	191,271,300	
ＤＯＷＡホールディングス	9,500	5,078.00	48,241,000	
古河機械金属	5,100	1,865.00	9,511,500	
エス・サイエンス	12,400	22.00	272,800	
大阪チタニウムテクノロジーズ	6,700	2,831.00	18,967,700	
東邦チタニウム	8,000	1,910.00	15,280,000	
ＵＡＣＪ	5,400	3,780.00	20,412,000	
ＣＫサンエツ	900	3,775.00	3,397,500	
古河電気工業	12,800	2,217.50	28,384,000	
住友電気工業	144,200	1,798.00	259,271,600	
フジクラ	45,500	1,087.50	49,481,250	
ＳＷＣＣ	4,300	2,698.00	11,601,400	
タツタ電線	6,200	679.00	4,209,800	
カナレ電気	400	1,533.00	613,200	
平河ヒューテック	2,500	1,256.00	3,140,000	
リョービ	4,100	2,691.00	11,033,100	
アーレスティ	2,400	715.00	1,716,000	
ＡＲＥホールディングス	14,500	1,898.00	27,521,000	

稲葉製作所	1,900	1,451.00	2,756,900	
宮地エンジニアリンググループ	1,900	3,165.00	6,013,500	
トーカロ	11,100	1,459.00	16,194,900	
アルファＣｏ	800	1,389.00	1,111,200	
ＳＵＭＣＯ	68,500	2,186.00	149,741,000	
川田テクノロジーズ	900	6,210.00	5,589,000	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	2,600	3,005.00	7,813,000	
ジェイテックコーポレーション	300	1,840.00	552,000	
信和	1,400	735.00	1,029,000	
東洋製罐グループホールディングス	23,000	2,235.50	51,416,500	
ホッカンホールディングス	1,900	1,599.00	3,038,100	
コロナ	2,200	948.00	2,085,600	
横河ブリッジホールディングス	6,000	2,516.00	15,096,000	
駒井ハルテック	400	2,045.00	818,000	
高田機工	200	3,290.00	658,000	
三和ホールディングス	38,700	2,167.00	83,862,900	
文化シヤッター	10,100	1,356.00	13,695,600	
三協立山	4,400	770.00	3,388,000	
アルインコ	2,900	979.00	2,839,100	
東洋シヤッター	500	657.00	328,500	
ＬＩＸＩＬ	60,200	1,726.00	103,905,200	
日本フイルコン	1,400	466.00	652,400	
ノーリツ	6,400	1,509.00	9,657,600	
長府製作所	3,800	2,016.00	7,660,800	
リンナイ	18,900	3,194.00	60,366,600	
ダイニチ工業	1,100	702.00	772,200	
日東精工	5,600	532.00	2,979,200	
三洋工業	200	2,526.00	505,200	
岡部	6,900	716.00	4,940,400	
ジーテクト	4,900	1,664.00	8,153,600	
東プレ	6,800	1,906.00	12,960,800	
高周波熱錬	5,900	962.00	5,675,800	
東京製綱	2,500	1,301.00	3,252,500	
サンコール	3,000	441.00	1,323,000	
モリテック　スチール	1,900	285.00	541,500	
パイオラックス	4,800	2,190.00	10,512,000	
エイチワン	4,000	760.00	3,040,000	
日本発條	34,100	1,096.50	37,390,650	
中央発條	2,900	693.00	2,009,700	
アドバネクス	300	899.00	269,700	
立川ブラインド工業	1,700	1,459.00	2,480,300	
三益半導体工業	3,000	2,772.00	8,316,000	
日本ドライケミカル	500	2,765.00	1,382,500	

日本製鋼所	10,400	2,461.50	25,599,600	
三浦工業	15,800	2,808.00	44,366,400	
タクマ	12,800	1,719.00	22,003,200	
ツガミ	8,400	1,218.00	10,231,200	
オークマ	3,300	6,057.00	19,988,100	
芝浦機械	3,800	3,560.00	13,528,000	
アマダ	60,200	1,482.50	89,246,500	
アイダエンジニアリング	8,700	823.00	7,160,100	
ＴＡＫＩＳＡＷＡ	100	2,595.00	259,500	
ＦＵＪＩ	17,800	2,459.00	43,770,200	
牧野フライス製作所	4,200	5,970.00	25,074,000	
オーエスジー	16,600	1,970.00	32,702,000	
ダイジェット工業	200	840.00	168,000	
旭ダイヤモンド工業	9,000	828.00	7,452,000	
ＤＭＧ森精機	22,900	2,671.50	61,177,350	
ソディック	9,200	722.00	6,642,400	
ディスコ	18,200	33,620.00	611,884,000	
日東工器	1,800	1,834.00	3,301,200	
日進工具	3,500	997.00	3,489,500	
パンチ工業	2,100	401.00	842,100	
冨士ダイス	2,000	638.00	1,276,000	
豊和工業	1,100	743.00	817,300	
石川製作所	500	1,019.00	509,500	
リケンＮＰＲ	4,100	1,949.00	7,990,900	
東洋機械金属	1,700	660.00	1,122,000	
津田駒工業	400	346.00	138,400	
エンシュウ	500	675.00	337,500	
島精機製作所	6,000	1,489.00	8,934,000	
オプトラン	6,200	1,714.00	10,626,800	
ＮＣホールディングス	500	1,636.00	818,000	
イワキポンプ	2,500	2,136.00	5,340,000	
フリュー	3,600	1,424.00	5,126,400	
ヤマシンフィルタ	9,000	310.00	2,790,000	
日阪製作所	4,100	911.00	3,735,100	
やまびこ	6,200	1,488.00	9,225,600	
野村マイクロ・サイエンス	1,300	13,480.00	17,524,000	
平田機工	1,800	6,120.00	11,016,000	
ＰＥＧＡＳＵＳ	4,200	439.00	1,843,800	
マルマエ	1,600	1,867.00	2,987,200	
タツモ	2,300	2,950.00	6,785,000	
ナブテスコ	23,700	2,831.00	67,094,700	
三井海洋開発	4,800	1,867.00	8,961,600	
レオン自動機	4,400	1,466.00	6,450,400	

ＳＭＣ	11,300	76,960.00	869,648,000	
ホソカワミクロン	2,400	4,010.00	9,624,000	
ユニオンツール	1,700	3,435.00	5,839,500	
瑞光	2,700	1,410.00	3,807,000	
オイレス工業	5,100	1,915.00	9,766,500	
日精エー・エス・ビー機械	1,500	4,680.00	7,020,000	
サトーホールディングス	5,400	2,032.00	10,972,800	
技研製作所	3,500	1,784.00	6,244,000	
日本エアーテック	1,800	1,338.00	2,408,400	
カワタ	700	1,051.00	735,700	
日精樹脂工業	2,800	1,110.00	3,108,000	
オカダアイヨン	700	2,281.00	1,596,700	
ワイエイシイホールディングス	1,200	2,226.00	2,671,200	
小松製作所	176,900	3,756.00	664,436,400	
住友重機械工業	22,300	3,606.00	80,413,800	
日立建機	15,000	3,756.00	56,340,000	
日工	5,600	663.00	3,712,800	
巴工業	1,500	4,105.00	6,157,500	
井関農機	3,500	1,100.00	3,850,000	
ＴＯＷＡ	4,200	7,160.00	30,072,000	
丸山製作所	400	2,501.00	1,000,400	
北川鉄工所	1,500	1,235.00	1,852,500	
ローツェ	2,000	14,910.00	29,820,000	
タカキタ	700	498.00	348,600	
クボタ	198,000	2,125.50	420,849,000	
荏原実業	2,000	2,834.00	5,668,000	
三菱化工機	1,300	3,160.00	4,108,000	
月島ホールディングス	5,100	1,298.00	6,619,800	
帝国電機製作所	2,700	3,045.00	8,221,500	
東京機械製作所	500	466.00	233,000	
新東工業	7,600	1,072.00	8,147,200	
澁谷工業	3,500	2,451.00	8,578,500	
アイチ　コーポレーション	5,300	1,077.00	5,708,100	
小森コーポレーション	9,300	1,110.00	10,323,000	
鶴見製作所	2,900	3,695.00	10,715,500	
日本ギア工業	800	583.00	466,400	
酒井重工業	500	5,800.00	2,900,000	
荏原製作所	15,500	8,609.00	133,439,500	
石井鐵工所	200	2,701.00	540,200	
西島製作所	3,200	2,163.00	6,921,600	
北越工業	3,800	2,610.00	9,918,000	
ダイキン工業	45,000	22,930.00	1,031,850,000	
オルガノ	4,500	5,790.00	26,055,000	

トーヨーカネツ	1,400	3,755.00	5,257,000	
栗田工業	21,100	5,472.00	115,459,200	
椿本チエイン	5,300	3,985.00	21,120,500	
大同工業	900	729.00	656,100	
木村化工機	2,900	745.00	2,160,500	
アネスト岩田	5,800	1,083.00	6,281,400	
ダイフク	63,700	2,892.50	184,252,250	
サムコ	1,000	3,995.00	3,995,000	
加藤製作所	1,100	1,262.00	1,388,200	
油研工業	300	2,133.00	639,900	
タダノ	21,700	1,122.50	24,358,250	
フジテック	8,800	3,547.00	31,213,600	
ＣＫＤ	10,400	2,481.00	25,802,400	
平和	11,200	2,048.00	22,937,600	
理想科学工業	3,000	2,683.00	8,049,000	
ＳＡＮＫＹＯ	9,300	8,041.00	74,781,300	
日本金銭機械	4,600	1,310.00	6,026,000	
マースグループホールディングス	1,900	2,440.00	4,636,000	
フクシマガリレイ	2,500	4,860.00	12,150,000	
オーイズミ	800	400.00	320,000	
ダイコク電機	1,900	3,270.00	6,213,000	
竹内製作所	6,800	4,275.00	29,070,000	
アマノ	10,700	3,261.00	34,892,700	
ＪＵＫＩ	5,800	477.00	2,766,600	
サンデン	3,000	157.00	471,000	
ジャノメ	3,800	662.00	2,515,600	
マックス	5,300	3,015.00	15,979,500	
グローリー	9,100	2,811.50	25,584,650	
新晃工業	3,800	2,610.00	9,918,000	
大和冷機工業	5,800	1,487.00	8,624,600	
セガサミーホールディングス	33,700	1,954.50	65,866,650	
ＴＰＲ	4,800	1,575.00	7,560,000	
ツバキ・ナカシマ	7,600	717.00	5,449,200	
ホシザキ	22,300	5,048.00	112,570,400	
大豊工業	3,300	814.00	2,686,200	
日本精工	69,900	759.50	53,089,050	
ＮＴＮ	81,800	263.10	21,521,580	
ジェイテクト	33,600	1,219.00	40,958,400	
不二越	2,800	3,620.00	10,136,000	
日本トムソン	10,300	582.00	5,994,600	
ＴＨＫ	21,800	2,837.00	61,846,600	
ユーシン精機	3,000	663.00	1,989,000	
前澤給装工業	2,900	1,256.00	3,642,400	

イーグル工業	4,200	1,584.00	6,652,800	
前澤工業	1,200	947.00	1,136,400	
日本ピラー工業	3,500	4,360.00	15,260,000	
キッツ	12,600	1,168.00	14,716,800	
マキタ	43,000	3,939.00	169,377,000	
三井Ｅ＆Ｓ	18,100	607.00	10,986,700	
日立造船	33,300	913.00	30,402,900	
三菱重工業	66,000	7,881.00	520,146,000	
ＩＨＩ	28,100	2,617.00	73,537,700	
サノヤスホールディングス	3,000	136.00	408,000	
スター精密	7,000	1,767.00	12,369,000	
日清紡ホールディングス	28,400	1,113.00	31,609,200	
イビデン	19,700	7,820.00	154,054,000	
コニカミノルタ	84,300	415.30	35,009,790	
ブラザー工業	50,400	2,356.00	118,742,400	
ミネベアミツミ	65,600	2,919.00	191,486,400	
日立製作所	181,400	9,933.00	1,801,846,200	
三菱電機	420,000	2,036.50	855,330,000	
富士電機	22,900	6,126.00	140,285,400	
東洋電機製造	700	951.00	665,700	
安川電機	41,000	5,860.00	240,260,000	
シンフォニアテクノロジー	4,200	2,101.00	8,824,200	
明電舎	7,000	2,372.00	16,604,000	
オリジン	500	1,204.00	602,000	
山洋電気	1,600	6,090.00	9,744,000	
デンヨー	2,900	2,220.00	6,438,000	
ＰＨＣホールディングス	7,000	1,422.00	9,954,000	
ＫＯＫＵＳＡＩ　ＥＬＥＣＴＲＩＣ	14,500	3,080.00	44,660,000	
ソシオネクスト	5,500	11,840.00	65,120,000	
東芝テック	4,800	2,879.00	13,819,200	
芝浦メカトロニクス	2,100	6,650.00	13,965,000	
マブチモーター	9,400	4,689.00	44,076,600	
ニデック	83,300	5,627.00	468,729,100	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	2,400	352.00	844,800	
トレックス・セミコンダクター	1,900	1,746.00	3,317,400	
東光高岳	2,300	2,060.00	4,738,000	
ダブル・スコープ	10,800	912.00	9,849,600	
ダイヘン	3,800	6,140.00	23,332,000	
ヤーマン	6,500	999.00	6,493,500	
ＪＶＣケンウッド	29,800	745.00	22,201,000	
ミマキエンジニアリング	3,600	907.00	3,265,200	
Ｉ－ＰＥＸ	2,600	1,495.00	3,887,000	
大崎電気工業	8,300	631.00	5,237,300	

オムロン	28,800	6,392.00	184,089,600	
日東工業	5,100	3,480.00	17,748,000	
ＩＤＥＣ	5,600	2,785.00	15,596,000	
正興電機製作所	700	1,118.00	782,600	
不二電機工業	400	1,157.00	462,800	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	14,700	1,979.00	29,091,300	
サクサホールディングス	500	2,654.00	1,327,000	
メルコホールディングス	1,200	3,435.00	4,122,000	
テクノメディカ	900	2,284.00	2,055,600	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	1,400	675.00	945,000	
日本電気	49,600	8,183.00	405,876,800	
富士通	34,700	20,680.00	717,596,000	
沖電気工業	17,100	898.00	15,355,800	
岩崎通信機	1,000	774.00	774,000	
電気興業	1,700	2,274.00	3,865,800	
サンケン電気	3,500	7,805.00	27,317,500	
ナカヨ	300	1,215.00	364,500	
アイホン	2,000	2,634.00	5,268,000	
ルネサスエレクトロニクス	246,300	2,579.50	635,330,850	
セイコーエプソン	48,400	2,072.00	100,284,800	
ワコム	28,700	678.00	19,458,600	
アルバック	9,000	6,746.00	60,714,000	
アクセル	1,300	2,129.00	2,767,700	
ＥＩＺＯ	2,800	4,810.00	13,468,000	
ジャパンディスプレイ	162,400	21.00	3,410,400	
日本信号	8,600	935.00	8,041,000	
京三製作所	7,900	455.00	3,594,500	
能美防災	5,100	2,007.00	10,235,700	
ホーチキ	2,800	1,600.00	4,480,000	
星和電機	900	485.00	436,500	
エレコム	9,000	1,735.00	15,615,000	
パナソニック　ホールディングス	445,800	1,390.50	619,884,900	
シャープ	63,600	1,011.50	64,331,400	
アンリツ	26,600	1,301.00	34,606,600	
富士通ゼネラル	10,700	2,191.00	23,443,700	
ソニーグループ	264,300	13,155.00	3,476,866,500	
ＴＤＫ	59,700	6,805.00	406,258,500	
帝国通信工業	1,700	1,868.00	3,175,600	
タムラ製作所	15,000	531.00	7,965,000	
アルプスアルパイン	33,700	1,231.50	41,501,550	
池上通信機	700	888.00	621,600	
日本電波工業	4,500	1,159.00	5,215,500	
鈴木	2,000	1,112.00	2,224,000	

メイコー	3,700	4,080.00	15,096,000	
日本トリム	800	3,050.00	2,440,000	
ローランド　ディー．ジー．	2,100	3,705.00	7,780,500	
フォスター電機	2,800	1,003.00	2,808,400	
ＳＭＫ	1,000	2,512.00	2,512,000	
ヨコオ	3,300	1,424.00	4,699,200	
ティアック	3,300	98.00	323,400	
ホシデン	8,600	1,650.00	14,190,000	
ヒロセ電機	5,600	16,260.00	91,056,000	
日本航空電子工業	9,000	3,105.00	27,945,000	
ＴＯＡ	4,300	1,010.00	4,343,000	
マクセル	8,300	1,568.00	13,014,400	
古野電気	4,900	1,775.00	8,697,500	
スミダコーポレーション	5,100	1,172.00	5,977,200	
アイコム	1,500	3,395.00	5,092,500	
リオン	1,600	2,292.00	3,667,200	
横河電機	41,300	2,764.00	114,153,200	
新電元工業	1,400	3,010.00	4,214,000	
アズビル	25,700	4,707.00	120,969,900	
東亜ディーケーケー	1,000	897.00	897,000	
日本光電工業	16,000	3,757.00	60,112,000	
チノー	1,600	2,066.00	3,305,600	
共和電業	1,900	409.00	777,100	
日本電子材料	2,300	1,808.00	4,158,400	
堀場製作所	7,100	10,615.00	75,366,500	
アドバンテスト	107,000	4,986.00	533,502,000	
小野測器	900	447.00	402,300	
エスペック	3,000	2,283.00	6,849,000	
キーエンス	37,400	62,580.00	2,340,492,000	
日置電機	1,800	6,180.00	11,124,000	
シスメックス	32,200	7,931.00	255,378,200	
日本マイクロニクス	6,700	3,585.00	24,019,500	
メガチップス	3,000	4,655.00	13,965,000	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	2,000	3,715.00	7,430,000	
澤藤電機	200	1,195.00	239,000	
原田工業	900	758.00	682,200	
コーセル	4,500	1,263.00	5,683,500	
イリソ電子工業	3,400	3,685.00	12,529,000	
オプテックスグループ	6,900	1,739.00	11,999,100	
千代田インテグレ	1,500	2,912.00	4,368,000	
レーザーテック	17,100	35,150.00	601,065,000	
スタンレー電気	23,900	2,641.50	63,131,850	
ウシオ電機	19,000	2,076.00	39,444,000	

岡谷電機産業	1,600	281.00	449,600	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	2,100	501.00	1,052,100	
エノモト	600	1,535.00	921,000	
日本セラミック	3,000	2,825.00	8,475,000	
遠藤照明	900	1,188.00	1,069,200	
古河電池	2,700	844.00	2,278,800	
双信電機	800	291.00	232,800	
山一電機	3,400	1,850.00	6,290,000	
図研	3,300	3,935.00	12,985,500	
日本電子	9,400	6,083.00	57,180,200	
カシオ計算機	27,000	1,205.50	32,548,500	
ファナック	182,200	4,187.00	762,871,400	
日本シイエムケイ	7,900	727.00	5,743,300	
エンプラス	1,100	12,590.00	13,849,000	
大真空	5,600	813.00	4,552,800	
ローム	69,100	2,804.50	193,790,950	
浜松ホトニクス	30,000	5,843.00	175,290,000	
三井ハイテック	3,300	7,781.00	25,677,300	
新光電気工業	13,100	5,520.00	72,312,000	
京セラ	58,000	8,196.00	475,368,000	
太陽誘電	18,200	3,662.00	66,648,400	
村田製作所	339,900	2,833.00	962,936,700	
双葉電子工業	7,100	499.00	3,542,900	
北陸電気工業	800	1,331.00	1,064,800	
ニチコン	9,800	1,327.00	13,004,600	
日本ケミコン	4,000	1,303.00	5,212,000	
ＫＯＡ	5,700	1,524.00	8,686,800	
市光工業	6,700	538.00	3,604,600	
小糸製作所	40,400	2,253.00	91,021,200	
ミツバ	7,000	942.00	6,594,000	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	12,800	11,720.00	150,016,000	
キヤノン電子	4,100	2,023.00	8,294,300	
キヤノン	186,300	3,681.00	685,770,300	
リコー	93,700	1,069.50	100,212,150	
象印マホービン	10,100	1,521.00	15,362,100	
ＭＵＴＯＨホールディングス	300	1,916.00	574,800	
東京エレクトロン	79,100	25,255.00	1,997,670,500	
イノテック	2,500	1,596.00	3,990,000	
トヨタ紡織	15,700	2,263.50	35,536,950	
芦森工業	400	2,069.00	827,600	
ユニプレス	6,700	947.00	6,344,900	
豊田自動織機	31,900	11,655.00	371,794,500	
モリタホールディングス	6,600	1,500.00	9,900,000	

三櫻工業	5,700	780.00	4,446,000	
デンソー	308,200	2,136.00	658,315,200	
東海理化電機製作所	10,500	2,220.00	23,310,000	
川崎重工業	30,500	3,064.00	93,452,000	
名村造船所	8,100	1,277.00	10,343,700	
日本車輌製造	1,200	2,065.00	2,478,000	
三菱ロジスネクスト	6,000	1,371.00	8,226,000	
近畿車輛	300	1,757.00	527,100	
日産自動車	530,700	579.30	307,434,510	
いすゞ自動車	108,600	1,829.00	198,629,400	
トヨタ自動車	2,051,500	2,644.00	5,424,166,000	
日野自動車	56,200	455.30	25,587,860	
三菱自動車工業	145,700	444.40	64,749,080	
エフテック	1,400	628.00	879,200	
レシップホールディングス	900	585.00	526,500	
ＧＭＢ	400	1,186.00	474,400	
ファルテック	400	531.00	212,400	
武蔵精密工業	9,100	1,426.00	12,976,600	
日産車体	4,400	920.00	4,048,000	
新明和工業	10,800	1,129.00	12,193,200	
極東開発工業	6,200	1,917.00	11,885,400	
トピー工業	3,000	2,530.00	7,590,000	
ティラド	800	3,045.00	2,436,000	
曙ブレーキ工業	22,800	108.00	2,462,400	
タチエス	6,900	1,691.00	11,667,900	
ＮＯＫ	14,500	1,856.00	26,912,000	
フタバ産業	10,000	797.00	7,970,000	
カヤバ	3,600	4,815.00	17,334,000	
大同メタル工業	7,300	544.00	3,971,200	
プレス工業	14,900	583.00	8,686,700	
ミクニ	2,600	443.00	1,151,800	
太平洋工業	8,600	1,297.00	11,154,200	
河西工業	3,300	193.00	636,900	
アイシン	28,800	5,011.00	144,316,800	
マツダ	123,600	1,598.00	197,512,800	
今仙電機製作所	1,300	641.00	833,300	
本田技研工業	911,100	1,485.50	1,353,439,050	
スズキ	68,600	5,773.00	396,027,800	
ＳＵＢＡＲＵ	118,200	2,655.00	313,821,000	
安永	900	642.00	577,800	
ヤマハ発動機	53,800	3,906.00	210,142,800	
ＴＢＫ	2,300	371.00	853,300	
エクセディ	6,100	2,452.00	14,957,200	

豊田合成	10,900	2,663.00	29,026,700	
愛三工業	6,200	1,156.00	7,167,200	
盟和産業	300	981.00	294,300	
日本プラスト	1,800	520.00	936,000	
ヨロズ	3,500	852.00	2,982,000	
エフ・シー・シー	6,600	1,730.00	11,418,000	
シマノ	15,200	22,070.00	335,464,000	
テイ・エス　テック	13,300	1,687.00	22,437,100	
ジャムコ	1,600	1,498.00	2,396,800	
テルモ	104,500	4,737.00	495,016,500	
クリエートメディック	700	906.00	634,200	
日機装	8,700	965.00	8,395,500	
日本エム・ディ・エム	3,000	749.00	2,247,000	
島津製作所	49,600	3,956.00	196,217,600	
ＪＭＳ	3,500	499.00	1,746,500	
クボテック	600	277.00	166,200	
長野計器	2,700	1,986.00	5,362,200	
ブイ・テクノロジー	2,000	2,659.00	5,318,000	
東京計器	2,900	1,693.00	4,909,700	
愛知時計電機	1,600	2,298.00	3,676,800	
インターアクション	1,800	944.00	1,699,200	
オーバル	1,800	469.00	844,200	
東京精密	7,600	8,532.00	64,843,200	
マニー	14,900	2,173.00	32,377,700	
ニコン	54,000	1,396.00	75,384,000	
トプコン	18,200	1,500.00	27,300,000	
オリンパス	230,000	2,121.50	487,945,000	
理研計器	2,600	7,030.00	18,278,000	
タムロン	2,300	5,120.00	11,776,000	
ＨＯＹＡ	74,200	17,255.00	1,280,321,000	
シード	1,000	793.00	793,000	
ノーリツ鋼機	3,500	2,959.00	10,356,500	
Ａ＆Ｄホロンホールディングス	5,400	1,790.00	9,666,000	
朝日インテック	41,700	2,850.00	118,845,000	
シチズン時計	34,400	841.00	28,930,400	
リズム	500	3,065.00	1,532,500	
大研医器	1,800	493.00	887,400	
メニコン	12,800	2,378.00	30,438,400	
シンシア	200	559.00	111,800	
松風	1,700	2,690.00	4,573,000	
セイコーグループ	5,200	2,627.00	13,660,400	
ニプロ	31,100	1,097.50	34,132,250	
ＫＹＯＲＩＴＳＵ	3,000	174.00	522,000	

中本パックス	700	1,628.00	1,139,600	
スノーピーク	5,300	936.00	4,960,800	
パラマウントベッドホールディングス	7,800	2,732.00	21,309,600	
トランザクション	2,500	2,147.00	5,367,500	
粧美堂	600	642.00	385,200	
ニホンフラッシュ	3,500	898.00	3,143,000	
前田工繊	3,200	3,030.00	9,696,000	
永大産業	2,400	224.00	537,600	
アートネイチャー	3,400	782.00	2,658,800	
バンダイナムコホールディングス	102,400	2,830.50	289,843,200	
アイフィスジャパン	600	636.00	381,600	
ＳＨＯＥＩ	8,400	1,848.00	15,523,200	
フランスベッドホールディングス	4,800	1,299.00	6,235,200	
パイロットコーポレーション	5,300	4,219.00	22,360,700	
萩原工業	2,500	1,428.00	3,570,000	
フジシールインターナショナル	7,600	1,677.00	12,745,200	
タカラトミー	17,000	2,241.00	38,097,000	
広済堂ホールディングス	8,400	767.00	6,442,800	
エステールホールディングス	500	628.00	314,000	
タカノ	800	899.00	719,200	
プロネクサス	3,900	1,261.00	4,917,900	
ホクシン	1,500	110.00	165,000	
ウッドワン	800	1,024.00	819,200	
ＴＯＰＰＡＮホールディングス	45,900	4,043.00	185,573,700	
大日本印刷	40,800	4,270.00	174,216,000	
共同印刷	1,100	3,200.00	3,520,000	
ＮＩＳＳＨＡ	6,400	1,455.00	9,312,000	
光村印刷	200	1,347.00	269,400	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	2,400	2,550.00	6,120,000	
アシックス	31,800	4,861.00	154,579,800	
ツツミ	900	2,310.00	2,079,000	
ローランド	2,800	4,365.00	12,222,000	
小松ウオール工業	1,500	2,852.00	4,278,000	
ヤマハ	23,600	3,261.00	76,959,600	
河合楽器製作所	1,100	3,770.00	4,147,000	
クリナップ	3,700	666.00	2,464,200	
ピジョン	23,800	1,637.50	38,972,500	
キングジム	3,300	863.00	2,847,900	
リンテック	7,500	2,709.00	20,317,500	
イトーキ	7,700	1,299.00	10,002,300	
任天堂	235,900	6,965.00	1,643,043,500	
三菱鉛筆	5,300	2,083.00	11,039,900	
タカラスタンダード	7,900	1,666.00	13,161,400	

コクヨ	15,300	2,277.50	34,845,750	
ナカバヤシ	4,000	540.00	2,160,000	
グローブライド	3,400	1,935.00	6,579,000	
オカムラ	11,200	2,030.00	22,736,000	
美津濃	3,700	3,910.00	14,467,000	
東京電力ホールディングス	336,800	725.80	244,449,440	
中部電力	137,700	1,792.00	246,758,400	
関西電力	144,300	1,815.00	261,904,500	
中国電力	64,900	978.30	63,491,670	
北陸電力	38,200	710.00	27,122,000	
東北電力	98,400	931.80	91,689,120	
四国電力	34,800	989.00	34,417,200	
九州電力	86,100	985.60	84,860,160	
北海道電力	36,100	612.10	22,096,810	
沖縄電力	9,500	1,079.00	10,250,500	
電源開発	30,700	2,237.50	68,691,250	
エフオン	2,400	451.00	1,082,400	
イーレックス	6,600	746.00	4,923,600	
レノバ	10,000	1,079.00	10,790,000	
東京瓦斯	79,000	3,346.00	264,334,000	
大阪瓦斯	75,700	2,921.00	221,119,700	
東邦瓦斯	16,200	2,699.50	43,731,900	
北海道瓦斯	2,200	2,178.00	4,791,600	
広島ガス	7,900	370.00	2,923,000	
西部ガスホールディングス	3,900	1,885.00	7,351,500	
静岡ガス	7,500	1,000.00	7,500,000	
メタウォーター	4,500	2,044.00	9,198,000	
ＳＢＳホールディングス	3,300	2,449.00	8,081,700	
東武鉄道	41,000	3,719.00	152,479,000	
相鉄ホールディングス	13,400	2,696.50	36,133,100	
東急	104,800	1,680.00	176,064,000	
京浜急行電鉄	46,200	1,261.00	58,258,200	
小田急電鉄	61,800	2,158.00	133,364,400	
京王電鉄	18,000	4,263.00	76,734,000	
京成電鉄	24,100	6,512.00	156,939,200	
富士急行	4,600	4,125.00	18,975,000	
東日本旅客鉄道	68,600	8,003.00	549,005,800	
西日本旅客鉄道	44,300	5,746.00	254,547,800	
東海旅客鉄道	143,900	3,544.00	509,981,600	
西武ホールディングス	45,200	1,910.00	86,332,000	
鴻池運輸	6,400	1,884.00	12,057,600	
西日本鉄道	10,000	2,368.00	23,680,000	
ハマキョウレックス	3,200	4,010.00	12,832,000	

サカイ引越センター	4,100	2,687.00	11,016,700	
近鉄グループホールディングス	37,300	4,337.00	161,770,100	
阪急阪神ホールディングス	49,700	4,454.00	221,363,800	
南海電気鉄道	16,600	2,808.00	46,612,800	
京阪ホールディングス	20,600	3,641.00	75,004,600	
神戸電鉄	1,000	2,867.00	2,867,000	
名古屋鉄道	38,500	2,194.50	84,488,250	
山陽電気鉄道	2,800	2,119.00	5,933,200	
アルプス物流	3,000	1,625.00	4,875,000	
ヤマトホールディングス	47,800	2,649.00	126,622,200	
山九	9,500	5,061.00	48,079,500	
丸運	1,200	264.00	316,800	
丸全昭和運輸	2,300	3,790.00	8,717,000	
センコーグループホールディングス	19,800	1,099.00	21,760,200	
トナミホールディングス	800	4,695.00	3,756,000	
ニッコンホールディングス	11,900	2,991.00	35,592,900	
日本石油輸送	200	2,886.00	577,200	
福山通運	4,300	3,870.00	16,641,000	
セイノーホールディングス	21,000	2,090.00	43,890,000	
エスライングループ本社	600	867.00	520,200	
神奈川中央交通	1,100	2,978.00	3,275,800	
ＡＺ－ＣＯＭ丸和ホールディングス	9,500	1,481.00	14,069,500	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	3,600	1,451.00	5,223,600	
九州旅客鉄道	26,400	3,081.00	81,338,400	
ＳＧホールディングス	62,600	2,018.50	126,358,100	
ＮＩＰＰＯＮ　ＥＸＰＲＥＳＳホールディングス	12,700	7,912.00	100,482,400	
日本郵船	106,900	4,333.00	463,197,700	
商船三井	80,900	4,493.00	363,483,700	
川崎汽船	31,500	6,115.00	192,622,500	
ＮＳユナイテッド海運	2,000	4,920.00	9,840,000	
明海グループ	2,300	734.00	1,688,200	
飯野海運	13,700	1,240.00	16,988,000	
共栄タンカー	400	821.00	328,400	
乾汽船	4,400	1,104.00	4,857,600	
日本航空	91,600	2,765.00	253,274,000	
ＡＮＡホールディングス	101,500	3,054.00	309,981,000	
パスコ	400	1,686.00	674,400	
トランコム	1,100	7,340.00	8,074,000	
日新	2,800	2,445.00	6,846,000	
三菱倉庫	9,200	4,275.00	39,330,000	
三井倉庫ホールディングス	3,500	4,665.00	16,327,500	
住友倉庫	10,100	2,424.00	24,482,400	
澁澤倉庫	1,700	2,838.00	4,824,600	

東陽倉庫	500	1,523.00	761,500	
日本トランスシティ	7,500	612.00	4,590,000	
ケイヒン	400	1,756.00	702,400	
中央倉庫	2,000	1,094.00	2,188,000	
川西倉庫	400	1,114.00	445,600	
安田倉庫	2,500	1,116.00	2,790,000	
ファイズホールディングス	300	1,120.00	336,000	
東洋埠頭	600	1,384.00	830,400	
上組	17,900	3,278.00	58,676,200	
サンリツ	500	738.00	369,000	
キムラユニティー	1,000	1,330.00	1,330,000	
キユーソー流通システム	1,500	890.00	1,335,000	
東海運	1,200	283.00	339,600	
エーアイテイー	2,300	1,661.00	3,820,300	
内外トランスライン	1,500	2,484.00	3,726,000	
日本コンセプト	1,400	1,647.00	2,305,800	
ＮＥＣネッツエスアイ	14,600	2,260.00	32,996,000	
クロスキャット	2,400	1,064.00	2,553,600	
システナ	56,700	305.00	17,293,500	
デジタルアーツ	2,400	4,930.00	11,832,000	
日鉄ソリューションズ	6,400	4,575.00	29,280,000	
キューブシステム	2,000	1,085.00	2,170,000	
コア	1,700	1,729.00	2,939,300	
手間いらず	600	2,935.00	1,761,000	
ラクーンホールディングス	3,100	627.00	1,943,700	
ソリトンシステムズ	1,900	1,402.00	2,663,800	
ソフトクリエイトホールディングス	3,100	1,689.00	5,235,900	
ＴＩＳ	41,000	3,036.00	124,476,000	
テクミラホールディングス	1,000	459.00	459,000	
グリー	10,000	553.00	5,530,000	
GMOペパボ	500	1,183.00	591,500	
コーエーテクモホールディングス	23,500	1,669.50	39,233,250	
三菱総合研究所	1,800	4,660.00	8,388,000	
ボルテージ	600	258.00	154,800	
電算	200	1,501.00	300,200	
ＡＧＳ	900	798.00	718,200	
ファインデックス	3,000	1,011.00	3,033,000	
ブレインパッド	2,800	1,049.00	2,937,200	
ＫＬａｂ	6,900	298.00	2,056,200	
ポールトゥウィンホールディングス	6,400	443.00	2,835,200	
ネクソン	83,700	2,964.50	248,128,650	
アイスタイル	11,100	428.00	4,750,800	
エムアップホールディングス	4,600	1,042.00	4,793,200	

エイチーム	2,200	563.00	1,238,600	
エニグモ	4,800	340.00	1,632,000	
テクノスジャパン	1,900	628.00	1,193,200	
ｅｎｉｓｈ	1,900	167.00	317,300	
コロプラ	14,500	571.00	8,279,500	
オルトプラス	1,700	145.00	246,500	
ブロードリーフ	17,800	565.00	10,057,000	
クロス・マーケティンググループ	1,300	550.00	715,000	
デジタルハーツホールディングス	2,300	955.00	2,196,500	
システム情報	1,000	929.00	929,000	
メディアドゥ	1,700	1,439.00	2,446,300	
じげん	10,900	532.00	5,798,800	
ブイキューブ	4,500	318.00	1,431,000	
エンカレッジ・テクノロジ	500	523.00	261,500	
サイバーリンクス	800	721.00	576,800	
ディー・エル・イー	1,400	206.00	288,400	
フィックスターズ	4,200	1,301.00	5,464,200	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	1,800	1,335.00	2,403,000	
オプティム	3,900	784.00	3,057,600	
セレス	1,500	1,134.00	1,701,000	
ＳＨＩＦＴ	2,500	35,280.00	88,200,000	
ティーガイア	3,900	1,871.00	7,296,900	
セック	400	4,680.00	1,872,000	
テクマトリックス	6,800	1,711.00	11,634,800	
プロシップ	1,800	1,344.00	2,419,200	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	9,800	2,323.50	22,770,300	
GMOペイメントゲートウェイ	7,500	9,255.00	69,412,500	
ザッパラス	600	476.00	285,600	
システムリサーチ	1,300	2,968.00	3,858,400	
インターネットイニシアティブ	17,900	2,767.50	49,538,250	
さくらインターネット	4,200	1,953.00	8,202,600	
ヴィンクス	500	2,017.00	1,008,500	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	1,100	2,591.00	2,850,100	
ＳＲＡホールディングス	1,900	3,495.00	6,640,500	
システムインテグレータ	600	390.00	234,000	
朝日ネット	4,000	606.00	2,424,000	
ｅＢＡＳＥ	5,300	748.00	3,964,400	
アバントグループ	4,700	1,369.00	6,434,300	
アドソル日進	1,600	1,544.00	2,470,400	
ＯＤＫソリューションズ	400	584.00	233,600	
フリービット	2,000	1,394.00	2,788,000	
コムチュア	5,400	1,783.00	9,628,200	
サイバーコム	300	1,902.00	570,600	

アステリア	2,900	651.00	1,887,900	
アイル	1,700	3,230.00	5,491,000	
マークラインズ	2,000	2,716.00	5,432,000	
メディカル・データ・ビジョン	4,500	608.00	2,736,000	
ｇｕｍｉ	5,500	376.00	2,068,000	
ショーケース	500	335.00	167,500	
モバイルファクトリー	400	606.00	242,400	
テラスカイ	1,600	1,574.00	2,518,400	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	2,200	1,605.00	3,531,000	
ＰＣＩホールディングス	800	1,028.00	822,400	
アイビーシー	300	456.00	136,800	
ネオジャパン	1,300	1,015.00	1,319,500	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	800	1,766.00	1,412,800	
ラクス	17,700	2,552.00	45,170,400	
ランドコンピュータ	1,000	874.00	874,000	
ダブルスタンダード	1,100	1,481.00	1,629,100	
オープンドア	2,200	753.00	1,656,600	
マイネット	600	282.00	169,200	
アカツキ	1,800	2,096.00	3,772,800	
ベネフィットジャパン	100	1,244.00	124,400	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	1,200	1,589.00	1,906,800	
カナミックネットワーク	4,000	390.00	1,560,000	
ノムラシステムコーポレーション	2,200	114.00	250,800	
チェンジホールディングス	8,200	1,432.00	11,742,400	
シンクロ・フード	1,300	721.00	937,300	
オークネット	1,500	1,808.00	2,712,000	
キャピタル・アセット・プランニング	400	683.00	273,200	
セグエグループ	700	939.00	657,300	
エイトレッド	300	1,394.00	418,200	
マクロミル	7,400	789.00	5,838,600	
ビーグリー	400	1,215.00	486,000	
オロ	1,400	2,831.00	3,963,400	
ユーザーローカル	1,400	1,851.00	2,591,400	
テモナ	500	221.00	110,500	
ニーズウェル	1,100	751.00	826,100	
マネーフォワード	8,300	4,181.00	34,702,300	
サインポスト	800	371.00	296,800	
Ｓｕｎ　Ａｓｔｅｒｉｓｋ	2,700	904.00	2,440,800	
プラスアルファ・コンサルティング	2,200	2,820.00	6,204,000	
電算システムホールディングス	1,700	2,715.00	4,615,500	
Ａｐｐｉｅｒ　Ｇｒｏｕｐ	12,800	1,692.00	21,657,600	
ソルクシーズ	1,700	408.00	693,600	
フェイス	600	479.00	287,400	

プロトコーポレーション	4,100	1,345.00	5,514,500	
ハイマックス	1,200	1,390.00	1,668,000	
野村総合研究所	83,000	4,068.00	337,644,000	
サイバネットシステム	2,600	1,091.00	2,836,600	
ＣＥホールディングス	1,100	629.00	691,900	
日本システム技術	1,200	2,848.00	3,417,600	
インテージホールディングス	4,200	1,570.00	6,594,000	
東邦システムサイエンス	1,200	1,230.00	1,476,000	
ソースネクスト	17,100	163.00	2,787,300	
インフォコム	4,800	2,337.00	11,217,600	
シンプレクス・ホールディングス	5,600	2,566.00	14,369,600	
ＨＥＲＯＺ	1,300	1,843.00	2,395,900	
ラクスル	9,000	1,224.00	11,016,000	
メルカリ	22,700	2,659.50	60,370,650	
ＩＰＳ	1,000	1,928.00	1,928,000	
ＦＩＧ	2,400	345.00	828,000	
システムサポート	1,500	1,877.00	2,815,500	
イーソル	2,700	555.00	1,498,500	
東海ソフト	300	1,122.00	336,600	
ウイングアーク１ｓｔ	3,900	3,015.00	11,758,500	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	1,000	1,222.00	1,222,000	
サーバーワークス	800	3,190.00	2,552,000	
東名	200	1,781.00	356,200	
ヴィッツ	200	889.00	177,800	
トビラシステムズ	600	870.00	522,000	
Ｓａｎｓａｎ	12,300	1,616.00	19,876,800	
Ｌｉｎｋ－Ｕ	500	720.00	360,000	
ギフティ	3,300	1,813.00	5,982,900	
メドレー	5,000	4,705.00	23,525,000	
ベース	1,300	3,505.00	4,556,500	
ＪＭＤＣ	6,400	4,199.00	26,873,600	
フォーカスシステムズ	2,500	979.00	2,447,500	
クレスコ	3,100	1,832.00	5,679,200	
フジ・メディア・ホールディングス	36,000	1,655.00	59,580,000	
オービック	12,500	23,470.00	293,375,000	
ジャストシステム	5,400	3,005.00	16,227,000	
ＴＤＣソフト	3,500	2,062.00	7,217,000	
ＬＩＮＥヤフー	533,400	478.30	255,125,220	
トレンドマイクロ	17,700	8,102.00	143,405,400	
ＩＤホールディングス	2,500	1,671.00	4,177,500	
日本オラクル	7,200	11,530.00	83,016,000	
アルファシステムズ	1,000	2,941.00	2,941,000	
フューチャー	8,000	1,679.00	13,432,000	

ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	2,000	1,758.00	3,516,000	
ＳＢテクノロジー	1,600	2,465.00	3,944,000	
トーセ	600	693.00	415,800	
オービックビジネスコンサルタント	5,300	6,467.00	34,275,100	
アイティフォー	4,800	1,179.00	5,659,200	
東計電算	500	7,120.00	3,560,000	
エックスネット	300	1,080.00	324,000	
大塚商会	18,600	5,957.00	110,800,200	
サイボウズ	5,200	2,147.00	11,164,400	
電通国際情報サービス	4,600	5,640.00	25,944,000	
ＡＣＣＥＳＳ	3,900	777.00	3,030,300	
デジタルガレージ	6,000	3,640.00	21,840,000	
ＥＭシステムズ	6,200	686.00	4,253,200	
ウェザーニューズ	1,200	5,460.00	6,552,000	
ＣＩＪ	6,200	644.00	3,992,800	
ビジネスエンジニアリング	600	4,255.00	2,553,000	
日本エンタープライズ	2,100	119.00	249,900	
WOWOW	2,800	1,044.00	2,923,200	
スカラ	3,500	758.00	2,653,000	
インテリジェント　ウェイブ	1,100	1,052.00	1,157,200	
ＡＮＹＣＯＬＯＲ	1,300	3,295.00	4,283,500	
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	3,800	643.00	2,443,400	
ネットワンシステムズ	15,100	2,367.50	35,749,250	
システムソフト	12,800	62.00	793,600	
アルゴグラフィックス	3,400	3,550.00	12,070,000	
マーベラス	6,100	692.00	4,221,200	
エイベックス	6,400	1,354.00	8,665,600	
ＢＩＰＲＯＧＹ	12,300	4,234.00	52,078,200	
都築電気	2,000	2,171.00	4,342,000	
ＴＢＳホールディングス	19,200	2,990.00	57,408,000	
日本テレビホールディングス	33,200	1,515.00	50,298,000	
朝日放送グループホールディングス	3,500	649.00	2,271,500	
テレビ朝日ホールディングス	9,100	1,632.00	14,851,200	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	29,100	653.00	19,002,300	
テレビ東京ホールディングス	2,700	3,000.00	8,100,000	
日本ＢＳ放送	700	888.00	621,600	
ビジョン	5,600	1,203.00	6,736,800	
スマートバリュー	500	429.00	214,500	
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	4,200	3,755.00	15,771,000	
ワイヤレスゲート	900	241.00	216,900	
日本通信	36,800	228.00	8,390,400	
クロップス	300	1,046.00	313,800	
日本電信電話	11,145,800	169.30	1,886,983,940	

ＫＤＤＩ	289,500	4,434.00	1,283,643,000	
ソフトバンク	602,900	1,715.50	1,034,274,950	
光通信	3,800	23,410.00	88,958,000	
エムティーアイ	2,600	619.00	1,609,400	
ＧＭＯインターネットグループ	13,800	2,469.50	34,079,100	
ファイバーゲート	2,000	903.00	1,806,000	
アイドママーケティングコミュニケーション	500	225.00	112,500	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	19,800	2,795.50	55,350,900	
学研ホールディングス	6,200	979.00	6,069,800	
ゼンリン	6,400	856.00	5,478,400	
昭文社ホールディングス	900	360.00	324,000	
インプレスホールディングス	2,000	178.00	356,000	
アイネット	2,300	1,701.00	3,912,300	
松竹	1,900	9,247.00	17,569,300	
東宝	20,800	4,788.00	99,590,400	
東映	1,200	20,800.00	24,960,000	
ＮＴＴデータグループ	98,000	1,937.50	189,875,000	
ピー・シー・エー	2,200	1,069.00	2,351,800	
ビジネスブレイン太田昭和	1,500	2,124.00	3,186,000	
ＤＴＳ	8,000	3,455.00	27,640,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	17,100	4,760.00	81,396,000	
シーイーシー	4,700	1,595.00	7,496,500	
カプコン	33,500	4,595.00	153,932,500	
アイ・エス・ビー	1,900	1,524.00	2,895,600	
ジャステック	2,300	1,420.00	3,266,000	
ＳＣＳＫ	26,200	2,736.50	71,696,300	
ＮＳＷ	1,700	2,787.00	4,737,900	
アイネス	2,900	1,600.00	4,640,000	
ＴＫＣ	5,900	3,565.00	21,033,500	
富士ソフト	7,500	5,750.00	43,125,000	
ＮＳＤ	13,400	2,664.00	35,697,600	
コナミグループ	14,000	7,468.00	104,552,000	
福井コンピュータホールディングス	2,300	2,551.00	5,867,300	
ＪＢＣＣホールディングス	2,500	3,570.00	8,925,000	
ミロク情報サービス	3,400	1,648.00	5,603,200	
ソフトバンクグループ	184,800	6,073.00	1,122,290,400	
高千穂交易	1,100	3,470.00	3,817,000	
オルバヘルスケアホールディングス	300	1,746.00	523,800	
伊藤忠食品	900	7,870.00	7,083,000	
エレマテック	3,500	1,710.00	5,985,000	
あらた	3,000	6,190.00	18,570,000	
トーメンデバイス	600	4,965.00	2,979,000	
東京エレクトロン　デバイス	3,900	5,300.00	20,670,000	

円谷フィールズホールディングス	6,800	1,219.00	8,289,200	
双日	44,000	3,211.00	141,284,000	
アルフレッサ　ホールディングス	39,700	2,400.50	95,299,850	
横浜冷凍	10,800	1,053.00	11,372,400	
神栄	300	1,882.00	564,600	
ラサ商事	1,400	1,481.00	2,073,400	
アルコニックス	5,200	1,286.00	6,687,200	
神戸物産	30,600	4,059.00	124,205,400	
ハイパー	500	321.00	160,500	
あい　ホールディングス	6,300	2,354.00	14,830,200	
ディーブイエックス	600	1,043.00	625,800	
ダイワボウホールディングス	17,500	2,985.00	52,237,500	
マクニカホールディングス	9,400	7,770.00	73,038,000	
ラクト・ジャパン	1,500	1,906.00	2,859,000	
グリムス	1,700	1,972.00	3,352,400	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	6,000	1,045.00	6,270,000	
八洲電機	3,200	1,252.00	4,006,400	
メディアスホールディングス	2,500	773.00	1,932,500	
レスターホールディングス	3,400	2,733.00	9,292,200	
ジオリーブグループ	500	1,273.00	636,500	
大光	900	670.00	603,000	
ＯＣＨＩホールディングス	500	1,412.00	706,000	
ＴＯＫＡＩホールディングス	21,500	945.00	20,317,500	
黒谷	600	583.00	349,800	
Ｃｏｍｉｎｉｘ	400	778.00	311,200	
三洋貿易	4,500	1,200.00	5,400,000	
ビューティガレージ	1,200	2,037.00	2,444,400	
ウイン・パートナーズ	2,600	1,130.00	2,938,000	
ミタチ産業	600	1,100.00	660,000	
シップヘルスケアホールディングス	14,200	2,222.00	31,552,400	
明治電機工業	1,500	1,389.00	2,083,500	
デリカフーズホールディングス	900	582.00	523,800	
スターティアホールディングス	600	1,325.00	795,000	
コメダホールディングス	9,700	2,690.00	26,093,000	
ピーバンドットコム	300	360.00	108,000	
アセンテック	1,500	501.00	751,500	
富士興産	600	1,803.00	1,081,800	
協栄産業	200	2,475.00	495,000	
フルサト・マルカホールディングス	3,500	2,546.00	8,911,000	
ヤマエグループホールディングス	2,200	3,915.00	8,613,000	
小野建	3,900	1,666.00	6,497,400	
南陽	500	2,048.00	1,024,000	
佐鳥電機	1,900	1,899.00	3,608,100	

エコートレーディング	400	1,598.00	639,200	
伯東	2,300	5,390.00	12,397,000	
コンドーテック	3,000	1,140.00	3,420,000	
中山福	1,200	360.00	432,000	
ナガイレーベン	5,000	2,333.00	11,665,000	
三菱食品	3,600	4,765.00	17,154,000	
松田産業	3,000	2,385.00	7,155,000	
第一興商	15,300	2,064.00	31,579,200	
メディパルホールディングス	40,900	2,258.00	92,352,200	
ＳＰＫ	1,800	1,838.00	3,308,400	
萩原電気ホールディングス	1,700	4,660.00	7,922,000	
アズワン	6,200	5,373.00	33,312,600	
スズデン	1,400	2,266.00	3,172,400	
尾家産業	500	1,865.00	932,500	
シモジマ	2,700	1,261.00	3,404,700	
ドウシシャ	3,700	2,010.00	7,437,000	
小津産業	500	1,566.00	783,000	
高速	2,300	2,032.00	4,673,600	
たけびし	1,500	1,846.00	2,769,000	
リックス	700	3,260.00	2,282,000	
丸文	3,500	1,561.00	5,463,500	
ハピネット	3,400	2,640.00	8,976,000	
橋本総業ホールディングス	1,600	1,279.00	2,046,400	
日本ライフライン	11,600	1,208.00	14,012,800	
タカショー	3,400	503.00	1,710,200	
ＩＤＯＭ	10,500	938.00	9,849,000	
進和	2,400	2,330.00	5,592,000	
エスケイジャパン	500	804.00	402,000	
ダイトロン	1,600	2,815.00	4,504,000	
シークス	5,600	1,430.00	8,008,000	
田中商事	600	742.00	445,200	
オーハシテクニカ	2,100	1,792.00	3,763,200	
白銅	1,100	2,231.00	2,454,100	
ダイコー通産	200	1,192.00	238,400	
伊藤忠商事	265,700	5,834.00	1,550,093,800	
丸紅	329,600	2,249.50	741,435,200	
高島	1,500	1,119.00	1,678,500	
長瀬産業	18,100	2,247.00	40,670,700	
蝶理	2,500	2,781.00	6,952,500	
豊田通商	34,600	8,604.00	297,698,400	
三共生興	5,500	715.00	3,932,500	
兼松	16,500	2,054.00	33,891,000	
ツカモトコーポレーション	300	1,163.00	348,900	

三井物産	297,800	5,195.00	1,547,071,000	
日本紙パルプ商事	1,900	4,930.00	9,367,000	
カメイ	4,200	1,698.00	7,131,600	
東都水産	100	7,350.00	735,000	
ＯＵＧホールディングス	300	2,396.00	718,800	
スターゼン	2,700	2,465.00	6,655,500	
山善	12,000	1,200.00	14,400,000	
椿本興業	800	6,550.00	5,240,000	
住友商事	239,200	3,061.00	732,191,200	
内田洋行	1,600	6,900.00	11,040,000	
三菱商事	261,100	6,713.00	1,752,764,300	
第一実業	3,700	1,866.00	6,904,200	
キヤノンマーケティングジャパン	9,200	4,046.00	37,223,200	
西華産業	1,500	2,848.00	4,272,000	
佐藤商事	2,700	1,445.00	3,901,500	
菱洋エレクトロ	3,700	3,590.00	13,283,000	
東京産業	3,600	816.00	2,937,600	
ユアサ商事	3,100	4,600.00	14,260,000	
神鋼商事	1,000	5,800.00	5,800,000	
トルク	1,100	259.00	284,900	
阪和興業	7,100	4,795.00	34,044,500	
正栄食品工業	2,600	4,830.00	12,558,000	
カナデン	3,000	1,551.00	4,653,000	
ＲＹＯＤＥＮ	3,200	2,482.00	7,942,400	
岩谷産業	9,000	6,363.00	57,267,000	
ナイス	700	1,562.00	1,093,400	
ニチモウ	300	3,910.00	1,173,000	
極東貿易	2,400	1,877.00	4,504,800	
アステナホールディングス	7,400	472.00	3,492,800	
三愛オブリ	9,500	1,627.00	15,456,500	
稲畑産業	7,800	3,085.00	24,063,000	
ＧＳＩクレオス	2,100	2,142.00	4,498,200	
明和産業	4,700	633.00	2,975,100	
クワザワホールディングス	800	686.00	548,800	
ワキタ	6,500	1,593.00	10,354,500	
東邦ホールディングス	10,900	3,260.00	35,534,000	
サンゲツ	9,100	3,030.00	27,573,000	
ミツウロコグループホールディングス	5,000	1,542.00	7,710,000	
シナネンホールディングス	1,100	4,130.00	4,543,000	
伊藤忠エネクス	9,800	1,568.00	15,366,400	
サンリオ	11,200	5,600.00	62,720,000	
サンワテクノス	2,000	2,180.00	4,360,000	
リョーサン	2,800	4,880.00	13,664,000	

新光商事	5,300	1,133.00	6,004,900	
トーホー	1,500	2,694.00	4,041,000	
三信電気	1,600	2,126.00	3,401,600	
東陽テクニカ	4,000	1,335.00	5,340,000	
モスフードサービス	5,800	3,225.00	18,705,000	
加賀電子	3,600	6,270.00	22,572,000	
ソーダニッカ	2,900	1,061.00	3,076,900	
立花エレテック	2,600	2,764.00	7,186,400	
フォーバル	1,500	1,393.00	2,089,500	
ＰＡＬＴＡＣ	5,300	4,485.00	23,770,500	
三谷産業	6,900	324.00	2,235,600	
太平洋興発	800	786.00	628,800	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	1,000	5,890.00	5,890,000	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	200	2,144.00	428,800	
コーア商事ホールディングス	2,200	708.00	1,557,600	
ＫＰＰグループホールディングス	10,200	695.00	7,089,000	
ヤマタネ	1,700	2,368.00	4,025,600	
丸紅建材リース	200	2,563.00	512,600	
泉州電業	2,000	3,525.00	7,050,000	
トラスコ中山	8,300	2,421.00	20,094,300	
オートバックスセブン	13,800	1,541.50	21,272,700	
モリト	2,800	1,274.00	3,567,200	
加藤産業	4,900	4,510.00	22,099,000	
北恵	600	813.00	487,800	
イエローハット	6,300	1,752.00	11,037,600	
ＪＫホールディングス	3,000	1,012.00	3,036,000	
日伝	2,700	2,851.00	7,697,700	
北沢産業	1,300	276.00	358,800	
杉本商事	1,900	2,184.00	4,149,600	
因幡電機産業	10,200	3,385.00	34,527,000	
東テク	1,300	4,770.00	6,201,000	
ミスミグループ本社	59,700	2,164.00	129,190,800	
アルテック	1,100	230.00	253,000	
タキヒヨー	500	981.00	490,500	
蔵王産業	400	2,409.00	963,600	
スズケン	15,000	4,830.00	72,450,000	
ジェコス	2,400	1,032.00	2,476,800	
グローセル	4,000	688.00	2,752,000	
ローソン	8,400	7,121.00	59,816,400	
サンエー	3,000	4,535.00	13,605,000	
カワチ薬品	3,100	2,495.00	7,734,500	
エービーシー・マート	17,300	2,534.50	43,846,850	
ハードオフコーポレーション	1,200	1,571.00	1,885,200	

アスクル	8,200	2,266.00	18,581,200	
ゲオホールディングス	4,400	2,132.00	9,380,800	
アダストリア	4,800	3,625.00	17,400,000	
ジーフット	1,800	287.00	516,600	
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	300	675.00	202,500	
くら寿司	4,600	3,310.00	15,226,000	
キャンドゥ	1,400	2,617.00	3,663,800	
ＩＫホールディングス	700	329.00	230,300	
パルグループホールディングス	7,800	2,498.00	19,484,400	
エディオン	15,600	1,504.00	23,462,400	
サーラコーポレーション	8,300	711.00	5,901,300	
ワッツ	1,100	588.00	646,800	
ハローズ	1,800	4,045.00	7,281,000	
フジオフードグループ本社	4,400	1,418.00	6,239,200	
あみやき亭	1,000	3,705.00	3,705,000	
ひらまつ	5,200	249.00	1,294,800	
大黒天物産	1,200	7,150.00	8,580,000	
ハニーズホールディングス	3,100	1,784.00	5,530,400	
ファーマライズホールディングス	500	636.00	318,000	
アルペン	3,300	1,968.00	6,494,400	
ハブ	700	712.00	498,400	
クオールホールディングス	5,400	1,672.00	9,028,800	
ジンズホールディングス	2,300	4,660.00	10,718,000	
ビックカメラ	21,000	1,319.00	27,699,000	
ＤＣＭホールディングス	20,900	1,330.00	27,797,000	
ペッパーフードサービス	8,900	93.00	827,700	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	56,000	1,542.50	86,380,000	
東京一番フーズ	500	505.00	252,500	
ＤＤグループ	1,400	1,291.00	1,807,400	
きちりホールディングス	500	1,108.00	554,000	
Ｊ．フロント　リテイリング	45,400	1,306.00	59,292,400	
ドトール・日レスホールディングス	7,000	2,131.00	14,917,000	
マツキヨココカラ＆カンパニー	71,900	2,466.00	177,305,400	
ブロンコビリー	2,300	3,155.00	7,256,500	
ＺＯＺＯ	26,100	3,181.00	83,024,100	
トレジャー・ファクトリー	1,900	1,329.00	2,525,100	
物語コーポレーション	6,600	4,355.00	28,743,000	
三越伊勢丹ホールディングス	66,600	1,520.50	101,265,300	
Ｈａｍｅｅ	1,400	894.00	1,251,600	
マーケットエンタープライズ	200	1,026.00	205,200	
ウエルシアホールディングス	20,500	2,325.50	47,672,750	
クリエイトＳＤホールディングス	6,500	3,020.00	19,630,000	
丸善ＣＨＩホールディングス	2,600	328.00	852,800	

ミサワ	400	657.00	262,800	
ティーライフ	300	1,375.00	412,500	
エー・ピーホールディングス	500	900.00	450,000	
チムニー	700	1,424.00	996,800	
シュッピン	3,600	1,173.00	4,222,800	
オイシックス・ラ・大地	5,300	1,341.00	7,107,300	
ネクステージ	9,000	2,550.00	22,950,000	
ジョイフル本田	11,500	1,804.00	20,746,000	
鳥貴族ホールディングス	1,500	3,230.00	4,845,000	
ホットランド	3,000	1,929.00	5,787,000	
すかいらーくホールディングス	54,000	2,057.50	111,105,000	
ＳＦＰホールディングス	2,200	2,097.00	4,613,400	
綿半ホールディングス	3,100	1,373.00	4,256,300	
ヨシックスホールディングス	700	2,685.00	1,879,500	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	11,000	1,004.00	11,044,000	
ゴルフダイジェスト・オンライン	1,800	688.00	1,238,400	
ＢＥＥＮＯＳ	1,600	1,406.00	2,249,600	
あさひ	3,700	1,282.00	4,743,400	
日本調剤	2,700	1,333.00	3,599,100	
コスモス薬品	3,900	15,665.00	61,093,500	
トーエル	1,000	733.00	733,000	
セブン＆アイ・ホールディングス	136,200	5,490.00	747,738,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	26,800	1,057.00	28,327,600	
ツルハホールディングス	8,300	12,470.00	103,501,000	
サンマルクホールディングス	3,200	2,004.00	6,412,800	
フェリシモ	500	923.00	461,500	
トリドールホールディングス	11,100	4,099.00	45,498,900	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	4,700	279.00	1,311,300	
ウイルプラスホールディングス	400	989.00	395,600	
ＪＭホールディングス	3,000	2,216.00	6,648,000	
サツドラホールディングス	1,000	798.00	798,000	
アレンザホールディングス	3,000	1,031.00	3,093,000	
串カツ田中ホールディングス	1,100	1,583.00	1,741,300	
バロックジャパンリミテッド	3,100	818.00	2,535,800	
クスリのアオキホールディングス	10,600	3,331.00	35,308,600	
力の源ホールディングス	1,800	1,456.00	2,620,800	
ＦＯＯＤ　＆　ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮＩＥＳ	21,100	2,890.00	60,979,000	
メディカルシステムネットワーク	4,300	649.00	2,790,700	
一家ホールディングス	500	662.00	331,000	
ジャパンクラフトホールディングス	1,200	169.00	202,800	
はるやまホールディングス	1,000	590.00	590,000	
ノジマ	11,500	1,711.00	19,676,500	

カッパ・クリエイト	6,200	1,625.00	10,075,000	
ライトオン	1,700	446.00	758,200	
良品計画	43,200	2,341.00	101,131,200	
パリミキホールディングス	2,700	483.00	1,304,100	
アドヴァングループ	3,800	1,055.00	4,009,000	
アルビス	1,300	2,561.00	3,329,300	
コナカ	2,400	392.00	940,800	
ハウス　オブ　ローゼ	300	1,600.00	480,000	
Ｇ－７ホールディングス	4,300	1,154.00	4,962,200	
イオン北海道	11,700	907.00	10,611,900	
コジマ	6,500	751.00	4,881,500	
ヒマラヤ	700	923.00	646,100	
コーナン商事	4,800	3,860.00	18,528,000	
エコス	1,500	2,320.00	3,480,000	
ワタミ	4,200	1,024.00	4,300,800	
マルシェ	700	252.00	176,400	
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	79,800	3,356.00	267,808,800	
西松屋チェーン	7,800	2,120.00	16,536,000	
ゼンショーホールディングス	20,100	7,261.00	145,946,100	
幸楽苑ホールディングス	2,900	1,186.00	3,439,400	
ハークスレイ	800	834.00	667,200	
サイゼリヤ	5,800	4,970.00	28,826,000	
ＶＴホールディングス	15,000	507.00	7,605,000	
魚力	1,400	2,261.00	3,165,400	
ポプラ	600	189.00	113,400	
フジ・コーポレーション	1,900	1,612.00	3,062,800	
ユナイテッドアローズ	4,600	1,933.00	8,891,800	
ハイデイ日高	5,900	2,732.00	16,118,800	
ＹＵ－ＷＡ　Ｃｒｅａｔｉｏｎ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	1,200	151.00	181,200	
コロワイド	17,000	2,170.00	36,890,000	
壱番屋	3,100	5,170.00	16,027,000	
トップカルチャー	700	162.00	113,400	
ＰＬＡＮＴ	500	1,382.00	691,000	
スギホールディングス	8,000	6,128.00	49,024,000	
薬王堂ホールディングス	1,900	2,646.00	5,027,400	
ヴィア・ホールディングス	3,200	212.00	678,400	
スクロール	5,900	962.00	5,675,800	
ヨンドシーホールディングス	3,700	1,990.00	7,363,000	
木曽路	6,000	2,498.00	14,988,000	
ＳＲＳホールディングス	6,500	1,055.00	6,857,500	
千趣会	7,300	394.00	2,876,200	
タカキュー	1,400	79.00	110,600	

リテールパートナーズ	5,900	1,610.00	9,499,000	
上新電機	3,900	2,378.00	9,274,200	
日本瓦斯	20,900	2,277.50	47,599,750	
ロイヤルホールディングス	7,000	2,524.00	17,668,000	
東天紅	200	824.00	164,800	
いなげや	3,800	1,218.00	4,628,400	
チヨダ	3,800	840.00	3,192,000	
ライフコーポレーション	4,100	3,350.00	13,735,000	
リンガーハット	5,100	2,334.00	11,903,400	
ＭｒＭａｘＨＤ	5,000	612.00	3,060,000	
テンアライド	2,900	302.00	875,800	
ＡＯＫＩホールディングス	8,500	1,131.00	9,613,500	
オークワ	5,700	807.00	4,599,900	
コメリ	6,100	3,100.00	18,910,000	
青山商事	8,400	1,507.00	12,658,800	
しまむら	4,600	15,950.00	73,370,000	
はせがわ	1,000	358.00	358,000	
高島屋	27,300	1,925.00	52,552,500	
松屋	6,700	926.00	6,204,200	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	17,500	1,543.00	27,002,500	
近鉄百貨店	1,700	2,647.00	4,499,900	
丸井グループ	26,200	2,373.00	62,172,600	
アクシアル　リテイリング	2,700	4,135.00	11,164,500	
井筒屋	1,000	351.00	351,000	
イオン	134,000	3,143.00	421,162,000	
イズミ	7,000	3,579.00	25,053,000	
平和堂	6,600	2,201.00	14,526,600	
フジ	6,100	1,887.00	11,510,700	
ヤオコー	4,500	8,077.00	36,346,500	
ゼビオホールディングス	5,400	941.00	5,081,400	
ケーズホールディングス	27,900	1,317.00	36,744,300	
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	1,000	521.00	521,000	
日産東京販売ホールディングス	3,300	439.00	1,448,700	
シルバーライフ	800	1,013.00	810,400	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	1,700	5,140.00	8,738,000	
ナルミヤ・インターナショナル	400	1,144.00	457,600	
ブックオフグループホールディングス	2,000	1,139.00	2,278,000	
ギフトホールディングス	1,700	2,289.00	3,891,300	
アインホールディングス	5,400	4,454.00	24,051,600	
元気寿司	2,200	3,150.00	6,930,000	
ヤマダホールディングス	121,600	428.10	52,056,960	
アークランズ	11,800	1,683.00	19,859,400	
ニトリホールディングス	14,400	18,345.00	264,168,000	

グルメ杵屋	3,200	1,050.00	3,360,000	
愛眼	1,600	175.00	280,000	
ケーユーホールディングス	1,800	1,073.00	1,931,400	
吉野家ホールディングス	14,600	3,134.00	45,756,400	
松屋フーズホールディングス	1,900	5,120.00	9,728,000	
サガミホールディングス	5,900	1,378.00	8,130,200	
関西フードマーケット	2,700	1,373.00	3,707,100	
王将フードサービス	2,900	7,910.00	22,939,000	
ミニストップ	2,900	1,500.00	4,350,000	
アークス	7,200	2,718.00	19,569,600	
バローホールディングス	7,500	2,335.00	17,512,500	
ベルク	2,000	6,180.00	12,360,000	
大庄	1,700	1,199.00	2,038,300	
ファーストリテイリング	17,800	37,340.00	664,652,000	
サンドラッグ	13,300	4,341.00	57,735,300	
サックスバー　ホールディングス	3,300	812.00	2,679,600	
ヤマザワ	500	1,250.00	625,000	
やまや	500	3,030.00	1,515,000	
ベルーナ	9,500	598.00	5,681,000	
いよぎんホールディングス	43,800	903.70	39,582,060	
しずおかフィナンシャルグループ	81,700	1,136.50	92,852,050	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	31,000	985.00	30,535,000	
楽天銀行	12,800	2,057.00	26,329,600	
京都フィナンシャルグループ	11,700	8,600.00	100,620,000	
島根銀行	600	505.00	303,000	
じもとホールディングス	1,800	554.00	997,200	
めぶきフィナンシャルグループ	182,600	428.50	78,244,100	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	4,700	3,975.00	18,682,500	
九州フィナンシャルグループ	71,200	765.10	54,475,120	
ゆうちょ銀行	404,300	1,407.50	569,052,250	
富山第一銀行	11,700	758.00	8,868,600	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	197,400	636.90	125,724,060	
西日本フィナンシャルホールディングス	20,800	1,576.00	32,780,800	
三十三フィナンシャルグループ	3,300	1,792.00	5,913,600	
第四北越フィナンシャルグループ	5,800	3,865.00	22,417,000	
ひろぎんホールディングス	52,400	886.40	46,447,360	
おきなわフィナンシャルグループ	3,100	2,274.00	7,049,400	
十六フィナンシャルグループ	4,800	3,670.00	17,616,000	
北國フィナンシャルホールディングス	3,900	4,540.00	17,706,000	
プロクレアホールディングス	4,200	1,811.00	7,606,200	
あいちフィナンシャルグループ	5,700	2,250.00	12,825,000	
あおぞら銀行	26,400	3,086.00	81,470,400	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	2,304,400	1,187.50	2,736,475,000	

りそなホールディングス	428,500	708.40	303,549,400	
三井住友トラスト・ホールディングス	66,100	5,256.00	347,421,600	
三井住友フィナンシャルグループ	261,600	6,703.00	1,753,504,800	
千葉銀行	102,500	1,006.00	103,115,000	
群馬銀行	71,400	682.40	48,723,360	
武蔵野銀行	5,100	2,651.00	13,520,100	
千葉興業銀行	6,100	773.00	4,715,300	
筑波銀行	16,100	245.00	3,944,500	
七十七銀行	10,700	3,360.00	35,952,000	
秋田銀行	2,500	1,888.00	4,720,000	
山形銀行	4,100	1,057.00	4,333,700	
岩手銀行	2,300	2,363.00	5,434,900	
東邦銀行	29,100	291.00	8,468,100	
東北銀行	1,000	1,165.00	1,165,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	32,000	3,209.00	102,688,000	
スルガ銀行	32,400	780.00	25,272,000	
八十二銀行	79,000	769.60	60,798,400	
山梨中央銀行	4,100	1,685.00	6,908,500	
大垣共立銀行	7,000	1,812.00	12,684,000	
福井銀行	3,300	1,572.00	5,187,600	
清水銀行	1,500	1,476.00	2,214,000	
富山銀行	300	1,696.00	508,800	
滋賀銀行	6,100	3,390.00	20,679,000	
南都銀行	5,500	2,399.00	13,194,500	
百五銀行	34,600	527.00	18,234,200	
紀陽銀行	13,200	1,510.00	19,932,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	22,800	1,521.00	34,678,800	
山陰合同銀行	23,000	976.00	22,448,000	
鳥取銀行	700	1,338.00	936,600	
百十四銀行	3,600	2,330.00	8,388,000	
四国銀行	5,400	941.00	5,081,400	
阿波銀行	5,200	2,310.00	12,012,000	
大分銀行	2,200	2,444.00	5,376,800	
宮崎銀行	2,200	2,475.00	5,445,000	
佐賀銀行	2,200	1,788.00	3,933,600	
琉球銀行	7,800	1,077.00	8,400,600	
セブン銀行	115,300	292.90	33,771,370	
みずほフィナンシャルグループ	496,700	2,350.00	1,167,245,000	
高知銀行	700	910.00	637,000	
山口フィナンシャルグループ	36,100	1,242.50	44,854,250	
名古屋銀行	2,400	5,520.00	13,248,000	
北洋銀行	55,700	351.00	19,550,700	
大光銀行	700	1,253.00	877,100	

愛媛銀行	5,000	950.00	4,750,000	
トマト銀行	700	1,131.00	791,700	
京葉銀行	15,400	676.00	10,410,400	
栃木銀行	18,400	303.00	5,575,200	
北日本銀行	1,200	2,033.00	2,439,600	
東和銀行	6,800	585.00	3,978,000	
福島銀行	2,100	232.00	487,200	
大東銀行	900	751.00	675,900	
トモニホールディングス	29,700	386.00	11,464,200	
フィデアホールディングス	3,800	1,462.00	5,555,600	
池田泉州ホールディングス	51,000	317.00	16,167,000	
ＦＰＧ	12,400	1,675.00	20,770,000	
ジャパンインベストメントアドバイザー	3,000	1,530.00	4,590,000	
マーキュリアホールディングス	1,100	736.00	809,600	
ＳＢＩホールディングス	53,800	3,066.00	164,950,800	
日本アジア投資	1,500	238.00	357,000	
ジャフコ　グループ	11,000	1,678.50	18,463,500	
大和証券グループ本社	285,000	966.80	275,538,000	
野村ホールディングス	618,800	645.40	399,373,520	
岡三証券グループ	32,300	706.00	22,803,800	
丸三証券	12,200	834.00	10,174,800	
東洋証券	9,700	295.00	2,861,500	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	43,700	525.00	22,942,500	
光世証券	500	480.00	240,000	
水戸証券	10,900	421.00	4,588,900	
いちよし証券	6,900	700.00	4,830,000	
松井証券	18,100	714.00	12,923,400	
マネックスグループ	36,000	684.00	24,624,000	
極東証券	5,000	954.00	4,770,000	
岩井コスモホールディングス	4,200	1,769.00	7,429,800	
アイザワ証券グループ	5,300	1,195.00	6,333,500	
マネーパートナーズグループ	2,100	288.00	604,800	
スパークス・グループ	4,100	1,550.00	6,355,000	
小林洋行	800	237.00	189,600	
かんぽ生命保険	37,500	2,437.00	91,387,500	
ＦＰパートナー	700	5,310.00	3,717,000	
ＳＯＭＰＯホールディングス	58,300	6,831.00	398,247,300	
アニコム　ホールディングス	12,500	524.00	6,550,000	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	82,400	5,440.00	448,256,000	
第一生命ホールディングス	179,800	2,939.50	528,522,100	
東京海上ホールディングス	363,700	3,521.00	1,280,587,700	
Ｔ＆Ｄホールディングス	107,000	2,180.00	233,260,000	
アドバンスクリエイト	2,100	975.00	2,047,500	

全国保証	9,600	5,212.00	50,035,200	
あんしん保証	800	243.00	194,400	
ジェイリース	1,000	2,094.00	2,094,000	
イントラスト	800	799.00	639,200	
日本モーゲージサービス	1,100	500.00	550,000	
Ｃａｓａ	800	871.00	696,800	
アルヒ	3,500	800.00	2,800,000	
プレミアグループ	6,200	1,735.00	10,757,000	
ネットプロテクションズホールディングス	12,100	180.00	2,178,000	
クレディセゾン	23,300	2,535.00	59,065,500	
芙蓉総合リース	3,400	11,810.00	40,154,000	
みずほリース	6,200	4,765.00	29,543,000	
東京センチュリー	6,900	6,033.00	41,627,700	
日本証券金融	13,500	1,487.00	20,074,500	
アイフル	54,200	373.00	20,216,600	
リコーリース	3,500	4,700.00	16,450,000	
イオンフィナンシャルサービス	21,100	1,229.50	25,942,450	
アコム	65,700	344.50	22,633,650	
ジャックス	3,900	5,100.00	19,890,000	
オリエントコーポレーション	12,000	1,056.00	12,672,000	
オリックス	224,300	2,678.00	600,675,400	
三菱ＨＣキャピタル	164,000	937.20	153,700,800	
九州リースサービス	800	1,070.00	856,000	
日本取引所グループ	96,000	2,993.00	287,328,000	
イー・ギャランティ	6,000	1,888.00	11,328,000	
アサックス	900	696.00	626,400	
ＮＥＣキャピタルソリューション	1,800	3,255.00	5,859,000	
Ｒｏｂｏｔ　Ｈｏｍｅ	10,100	172.00	1,737,200	
大東建託	13,500	15,995.00	215,932,500	
いちご	42,400	335.00	14,204,000	
日本駐車場開発	38,900	196.00	7,624,400	
スター・マイカ・ホールディングス	4,300	608.00	2,614,400	
ＳＲＥホールディングス	1,600	2,802.00	4,483,200	
ＡＤワークスグループ	5,100	231.00	1,178,100	
ヒューリック	85,800	1,481.50	127,112,700	
野村不動産ホールディングス	20,500	3,669.00	75,214,500	
三重交通グループホールディングス	7,900	564.00	4,455,600	
サムティ	5,900	2,372.00	13,994,800	
ディア・ライフ	6,300	864.00	5,443,200	
コーセーアールイー	700	980.00	686,000	
地主	2,800	2,235.00	6,258,000	
プレサンスコーポレーション	5,800	1,570.00	9,106,000	
ＴＨＥグローバル社	1,200	374.00	448,800	

ハウスコム	300	886.00	265,800	
ＪＰＭＣ	2,100	1,131.00	2,375,100	
サンセイランディック	600	1,029.00	617,400	
エストラスト	200	637.00	127,400	
フージャースホールディングス	5,700	1,029.00	5,865,300	
オープンハウスグループ	13,500	4,178.00	56,403,000	
東急不動産ホールディングス	110,600	908.90	100,524,340	
飯田グループホールディングス	35,300	2,152.00	75,965,600	
イーグランド	300	1,479.00	443,700	
ムゲンエステート	1,400	1,197.00	1,675,800	
ビーロット	1,400	972.00	1,360,800	
ファーストブラザーズ	400	947.00	378,800	
Ａｎｄ　Ｄｏホールディングス	2,200	1,013.00	2,228,600	
シーアールイー	2,000	1,325.00	2,650,000	
ケイアイスター不動産	1,800	3,135.00	5,643,000	
アグレ都市デザイン	400	1,492.00	596,800	
グッドコムアセット	3,400	662.00	2,250,800	
ジェイ・エス・ビー	1,800	2,567.00	4,620,600	
ロードスターキャピタル	2,400	2,082.00	4,996,800	
テンポイノベーション	600	1,041.00	624,600	
グローバル・リンク・マネジメント	400	2,302.00	920,800	
フェイスネットワーク	600	1,369.00	821,400	
霞ヶ関キャピタル	900	8,800.00	7,920,000	
パーク２４	23,900	1,871.00	44,716,900	
パラカ	1,300	1,877.00	2,440,100	
ミガロホールディングス	300	1,483.00	444,900	
宮越ホールディングス	1,700	1,117.00	1,898,900	
三井不動産	170,200	3,491.00	594,168,200	
三菱地所	240,500	1,984.00	477,152,000	
平和不動産	6,000	3,745.00	22,470,000	
東京建物	32,100	2,065.50	66,302,550	
京阪神ビルディング	6,900	1,400.00	9,660,000	
住友不動産	53,200	4,341.00	230,941,200	
テーオーシー	6,600	685.00	4,521,000	
東京楽天地	600	6,780.00	4,068,000	
レオパレス２１	36,800	422.00	15,529,600	
スターツコーポレーション	5,300	2,796.00	14,818,800	
フジ住宅	4,600	692.00	3,183,200	
空港施設	5,200	577.00	3,000,400	
明和地所	1,800	1,219.00	2,194,200	
ゴールドクレスト	3,000	2,147.00	6,441,000	
エスリード	1,700	3,235.00	5,499,500	
日神グループホールディングス	5,900	488.00	2,879,200	

日本エスコン	6,900	923.00	6,368,700	
ＭＩＲＡＲＴＨホールディングス	16,900	451.00	7,621,900	
ＡＶＡＮＴＩＡ	1,100	851.00	936,100	
イオンモール	19,100	1,738.00	33,195,800	
毎日コムネット	800	740.00	592,000	
ファースト住建	800	1,017.00	813,600	
ランド	201,300	8.00	1,610,400	
カチタス	9,900	2,149.00	21,275,100	
トーセイ	6,100	1,836.00	11,199,600	
穴吹興産	400	1,992.00	796,800	
サンフロンティア不動産	5,400	1,577.00	8,515,800	
ＦＪネクストホールディングス	3,900	1,085.00	4,231,500	
インテリックス	500	473.00	236,500	
ランドビジネス	700	269.00	188,300	
サンネクスタグループ	600	955.00	573,000	
グランディハウス	2,400	595.00	1,428,000	
日本空港ビルデング	13,000	6,231.00	81,003,000	
明豊ファシリティワークス	1,100	803.00	883,300	
ＬＩＦＵＬＬ	13,100	176.00	2,305,600	
ＭＩＸＩ	8,200	2,330.00	19,106,000	
ジェイエイシーリクルートメント	3,500	2,674.00	9,359,000	
日本M＆Aセンターホールディングス	61,200	751.20	45,973,440	
メンバーズ	1,300	917.00	1,192,100	
中広	300	407.00	122,100	
ＵＴグループ	4,900	2,287.00	11,206,300	
アイティメディア	1,500	936.00	1,404,000	
Ｅ・Ｊホールディングス	2,200	1,571.00	3,456,200	
オープンアップグループ	11,500	2,276.00	26,174,000	
コシダカホールディングス	11,500	1,055.00	12,132,500	
アルトナー	900	2,089.00	1,880,100	
パソナグループ	4,700	2,643.00	12,422,100	
ＣＤＳ	500	1,717.00	858,500	
リンクアンドモチベーション	11,100	566.00	6,282,600	
エス・エム・エス	13,500	2,782.00	37,557,000	
サニーサイドアップグループ	600	589.00	353,400	
パーソルホールディングス	391,000	230.40	90,086,400	
リニカル	1,400	507.00	709,800	
クックパッド	10,500	117.00	1,228,500	
エスクリ	800	286.00	228,800	
アイ・ケイ・ケイホールディングス	1,000	636.00	636,000	
学情	2,000	1,718.00	3,436,000	
スタジオアリス	1,900	2,078.00	3,948,200	
シミックホールディングス	1,800	2,646.00	4,762,800	

エプコ	600	864.00	518,400	
ＮＪＳ	800	2,791.00	2,232,800	
綜合警備保障	64,200	800.30	51,379,260	
カカクコム	25,400	1,701.00	43,205,400	
アイロムグループ	1,600	1,976.00	3,161,600	
セントケア・ホールディング	2,800	926.00	2,592,800	
サイネックス	400	754.00	301,600	
ルネサンス	3,000	854.00	2,562,000	
ディップ	5,900	3,140.00	18,526,000	
デジタルホールディングス	2,000	1,260.00	2,520,000	
新日本科学	3,500	1,722.00	6,027,000	
キャリアデザインセンター	400	2,068.00	827,200	
ベネフィット・ワン	13,300	1,995.50	26,540,150	
エムスリー	75,900	2,291.00	173,886,900	
ツカダ・グローバルホールディング	1,400	385.00	539,000	
ブラス	200	657.00	131,400	
アウトソーシング	24,400	1,753.00	42,773,200	
ウェルネット	1,600	552.00	883,200	
ワールドホールディングス	1,700	2,769.00	4,707,300	
ディー・エヌ・エー	13,700	1,379.00	18,892,300	
博報堂ＤＹホールディングス	49,000	1,068.00	52,332,000	
ぐるなび	7,100	273.00	1,938,300	
タカミヤ	5,200	498.00	2,589,600	
ジャパンベストレスキューシステム	1,800	999.00	1,798,200	
ファンコミュニケーションズ	5,400	414.00	2,235,600	
ライク	1,400	1,425.00	1,995,000	
Ａｏｂａ－ＢＢＴ	800	406.00	324,800	
エスプール	11,000	422.00	4,642,000	
ＷＤＢホールディングス	2,000	2,202.00	4,404,000	
ティア	1,300	454.00	590,200	
ＣＤＧ	200	1,188.00	237,600	
アドウェイズ	5,300	536.00	2,840,800	
バリューコマース	3,400	1,436.00	4,882,400	
インフォマート	39,900	435.00	17,356,500	
ＪＰホールディングス	9,800	449.00	4,400,200	
エコナックホールディングス	1,800	136.00	244,800	
ＣＬホールディングス	900	849.00	764,100	
プレステージ・インターナショナル	18,000	586.00	10,548,000	
アミューズ	2,300	1,468.00	3,376,400	
ドリームインキュベータ	1,300	2,885.00	3,750,500	
クイック	2,700	2,412.00	6,512,400	
ＴＡＣ	1,000	199.00	199,000	
電通グループ	37,700	3,684.00	138,886,800	

テイクアンドギヴ・ニーズ	1,300	1,159.00	1,506,700	
ぴあ	1,300	3,360.00	4,368,000	
イオンファンタジー	1,400	2,454.00	3,435,600	
シーティーエス	4,900	632.00	3,096,800	
ネクシィーズグループ	700	712.00	498,400	
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	11,200	2,622.00	29,366,400	
アルプス技研	3,600	2,730.00	9,828,000	
サニックス	6,100	337.00	2,055,700	
日本空調サービス	4,100	788.00	3,230,800	
オリエンタルランド	203,200	5,309.00	1,078,788,800	
ダスキン	8,500	3,313.00	28,160,500	
明光ネットワークジャパン	4,700	727.00	3,416,900	
ファルコホールディングス	1,700	2,088.00	3,549,600	
秀英予備校	500	301.00	150,500	
田谷	400	403.00	161,200	
ラウンドワン	36,100	569.00	20,540,900	
リゾートトラスト	16,700	2,407.50	40,205,250	
ビー・エム・エル	4,700	2,962.00	13,921,400	
リソー教育	19,600	215.00	4,214,000	
早稲田アカデミー	2,100	1,817.00	3,815,700	
ユー・エス・エス	43,100	2,796.50	120,529,150	
東京個別指導学院	4,600	440.00	2,024,000	
サイバーエージェント	84,900	864.50	73,396,050	
楽天グループ	329,000	576.60	189,701,400	
クリーク・アンド・リバー社	1,900	2,046.00	3,887,400	
ＳＢＩグローバルアセットマネジメント	7,500	585.00	4,387,500	
テー・オー・ダブリュー	7,500	324.00	2,430,000	
山田コンサルティンググループ	1,700	1,776.00	3,019,200	
セントラルスポーツ	1,400	2,417.00	3,383,800	
フルキャストホールディングス	3,700	1,788.00	6,615,600	
エン・ジャパン	6,300	2,588.00	16,304,400	
リソルホールディングス	200	5,500.00	1,100,000	
テクノプロ・ホールディングス	22,500	3,658.00	82,305,000	
アトラグループ	600	197.00	118,200	
アイ・アールジャパンホールディングス	2,000	1,499.00	2,998,000	
ＫｅｅＰｅｒ技研	2,400	7,020.00	16,848,000	
ファーストロジック	500	502.00	251,000	
三機サービス	300	1,137.00	341,100	
Ｇｕｎｏｓｙ	3,000	715.00	2,145,000	
デザインワン・ジャパン	600	132.00	79,200	
イー・ガーディアン	1,500	1,580.00	2,370,000	
リブセンス	1,000	262.00	262,000	
ジャパンマテリアル	11,800	2,430.00	28,674,000	

ベクトル	4,700	1,098.00	5,160,600	
ウチヤマホールディングス	900	365.00	328,500	
チャーム・ケア・コーポレーション	3,200	1,189.00	3,804,800	
キャリアリンク	1,400	2,258.00	3,161,200	
ＩＢＪ	2,900	713.00	2,067,700	
アサンテ	1,900	1,636.00	3,108,400	
バリューＨＲ	3,400	1,563.00	5,314,200	
Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ	3,100	2,371.00	7,350,100	
ライドオンエクスプレスホールディングス	1,500	1,014.00	1,521,000	
ＥＲＩホールディングス	500	1,642.00	821,000	
アビスト	300	2,971.00	891,300	
シグマクシス・ホールディングス	5,200	1,366.00	7,103,200	
ウィルグループ	3,200	1,105.00	3,536,000	
エスクロー・エージェント・ジャパン	2,500	138.00	345,000	
メドピア	3,400	723.00	2,458,200	
レアジョブ	400	884.00	353,600	
リクルートホールディングス	284,300	5,919.00	1,682,771,700	
エラン	5,100	1,112.00	5,671,200	
土木管理総合試験所	1,000	326.00	326,000	
日本郵政	451,300	1,256.50	567,058,450	
ベルシステム２４ホールディングス	4,100	1,685.00	6,908,500	
鎌倉新書	3,300	536.00	1,768,800	
ＳＭＮ	400	275.00	110,000	
一蔵	300	575.00	172,500	
グローバルキッズＣＯＭＰＡＮＹ	400	631.00	252,400	
エアトリ	2,800	1,783.00	4,992,400	
アトラエ	2,300	640.00	1,472,000	
ストライク	1,600	4,375.00	7,000,000	
ソラスト	10,600	575.00	6,095,000	
セラク	1,200	1,251.00	1,501,200	
インソース	8,300	860.00	7,138,000	
ベイカレント・コンサルティング	28,200	4,941.00	139,336,200	
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	800	1,023.00	818,400	
アイモバイル	5,100	445.00	2,269,500	
キャリアインデックス	700	207.00	144,900	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	1,200	1,103.00	1,323,600	
船場	400	909.00	363,600	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	12,400	2,325.00	28,830,000	
フルテック	300	1,226.00	367,800	
グリーンズ	800	1,788.00	1,430,400	
ツナググループ・ホールディングス	600	870.00	522,000	
ＧａｍｅＷｉｔｈ	600	299.00	179,400	
ＭＳ＆Ｃｏｎｓｕｌｔｉｎｇ	300	672.00	201,600	

ウェルビー	1,900	795.00	1,510,500	
エル・ティー・エス	400	2,901.00	1,160,400	
ミダックホールディングス	2,300	1,945.00	4,473,500	
キュービーネットホールディングス	1,800	1,448.00	2,606,400	
ＲＰＡホールディングス	5,200	269.00	1,398,800	
スプリックス	600	814.00	488,400	
マネジメントソリューションズ	1,600	3,215.00	5,144,000	
プロレド・パートナーズ	900	355.00	319,500	
ａｎｄ　ｆａｃｔｏｒｙ	600	330.00	198,000	
テノ．ホールディングス	300	523.00	156,900	
フロンティア・マネジメント	1,000	1,598.00	1,598,000	
ピアラ	400	300.00	120,000	
コプロ・ホールディングス	700	1,503.00	1,052,100	
ギークス	300	481.00	144,300	
アンビスホールディングス	4,100	3,170.00	12,997,000	
カーブスホールディングス	10,500	624.00	6,552,000	
フォーラムエンジニアリング	5,200	843.00	4,383,600	
Ｆａｓｔ　Ｆｉｔｎｅｓｓ　Ｊａｐａｎ	1,300	1,057.00	1,374,100	
ダイレクトマーケティングミックス	4,000	426.00	1,704,000	
ポピンズ	600	1,112.00	667,200	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	3,000	2,048.00	6,144,000	
コンフィデンス・インターワークス	200	1,530.00	306,000	
アドバンテッジリスクマネジメント	1,100	499.00	548,900	
リログループ	19,200	1,571.50	30,172,800	
東祥	2,700	780.00	2,106,000	
ＩＤ＆Ｅホールディングス	2,300	3,275.00	7,532,500	
ビーウィズ	1,000	2,104.00	2,104,000	
ＴＲＥホールディングス	7,400	1,040.00	7,696,000	
人・夢・技術グループ	1,400	1,700.00	2,380,000	
ＮＩＳＳＯホールディングス	3,300	761.00	2,511,300	
大栄環境	7,000	2,318.00	16,226,000	
日本管財ホールディングス	4,000	2,497.00	9,988,000	
Ｍ＆Ａ総研ホールディングス	1,800	4,400.00	7,920,000	
エイチ・アイ・エス	11,200	1,896.00	21,235,200	
ラックランド	1,700	2,565.00	4,360,500	
共立メンテナンス	6,000	5,565.00	33,390,000	
イチネンホールディングス	4,100	1,538.00	6,305,800	
建設技術研究所	2,000	5,070.00	10,140,000	
スペース	2,500	969.00	2,422,500	
燦ホールディングス	3,600	1,096.00	3,945,600	
スバル興業	200	13,270.00	2,654,000	
東京テアトル	800	1,087.00	869,600	
タナベコンサルティンググループ	1,200	1,000.00	1,200,000	

ナガワ	1,200	6,890.00	8,268,000	
東京都競馬	3,200	4,435.00	14,192,000	
常磐興産	800	1,225.00	980,000	
カナモト	6,000	2,808.00	16,848,000	
ニシオホールディングス	3,600	3,790.00	13,644,000	
アゴーラ　ホスピタリティー　グループ	13,300	23.00	305,900	
トランス・コスモス	4,800	2,988.00	14,342,400	
乃村工藝社	16,800	842.00	14,145,600	
藤田観光	1,500	4,895.00	7,342,500	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	2,300	1,284.00	2,953,200	
トーカイ	3,400	2,053.00	6,980,200	
白洋舎	300	2,577.00	773,100	
セコム	39,100	10,190.00	398,429,000	
セントラル警備保障	2,100	2,465.00	5,176,500	
丹青社	7,400	830.00	6,142,000	
メイテックグループホールディングス	13,800	2,829.50	39,047,100	
応用地質	3,600	2,007.00	7,225,200	
船井総研ホールディングス	8,000	2,533.00	20,264,000	
進学会ホールディングス	500	251.00	125,500	
オオバ	1,300	895.00	1,163,500	
いであ	600	1,744.00	1,046,400	
学究社	1,500	1,959.00	2,938,500	
ベネッセホールディングス	12,500	2,630.00	32,875,000	
イオンディライト	4,100	3,565.00	14,616,500	
ナック	1,600	977.00	1,563,200	
ダイセキ	7,800	3,900.00	30,420,000	
ステップ	1,400	1,864.00	2,609,600	
合　計	56,709,700		124,714,639,070	

(2)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

ＲＭ先進国株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2023年12月20日現在
資産の部	
流動資産	
預金	7,773,728,338
金銭信託	167,020,111
株式	212,617,553,531

	2023年12月20日現在
投資証券	4,488,940,905
派生商品評価勘定	278,210,941
未収入金	324,107,503
未収配当金	211,380,945
差入委託証拠金	4,171,410,420
流動資産合計	230,032,352,694
資産合計	230,032,352,694
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	13,284,575
未払解約金	1,301,020,100
その他未払費用	1,968
流動負債合計	1,314,306,643
負債合計	1,314,306,643
純資産の部	
元本等	
元本	85,138,244,252
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	143,579,801,799
元本等合計	228,718,046,051
純資産合計	228,718,046,051
負債純資産合計	230,032,352,694

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

（貸借対照表に関する注記）

2023年12月20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	32,950,806,565円
期中一部解約元本額	26,986,345,162円

期末元本額	85,138,244,252円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド（安定型）	1,522,089,142円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	7,801,116,544円
りそなラップ型ファンド（成長型）	6,965,679,027円
ＤＣりそな　グローバルバランス	44,289,421円
つみたてバランスファンド	3,094,254,151円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	1,988,336,465円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	1,490,183,669円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	1,028,556,427円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	554,113,686円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	374,110,669円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	211,529,132円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	467,987,715円
りそな　つみたてラップ型ファンド（安定型）	42,310,552円
りそな　つみたてラップ型ファンド（安定成長型）	141,479,102円
りそな　つみたてラップ型ファンド（成長型）	133,522,060円
りそな　つみたてリスクコントロールファンド	27,687,778円
ターゲットリターンバランスファンド（目標２％）	770,165円
ターゲットリターンバランスファンド（目標３％）	886,662円
ターゲットリターンバランスファンド（目標４％）	4,443,211円
ターゲットリターンバランスファンド（目標５％）	2,171,619円
ターゲットリターンバランスファンド（目標６％）	4,479,015円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６５	236,688円
ＦＷりそな先進国株式アクティブファンド	137,228,598円
ＦＷりそな先進国＋新興国株式アクティブファンド	79,589,117円
ＦＷりそな先進国株式インデックスファンド	31,327,367,997円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　先進国株式インデックス	18,743,767,658円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	497,890,936円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	1,686,065,801円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	2,274,116,633円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　Ｓｅｌｅｃｔ　全世界株式インデックス	395,076,667円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　Ｓｅｌｅｃｔ　全世界株式インデックス（除く日本）	190,137,891円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　ＤＣ　全世界株式インデックス	332,526円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　ＤＣ　全世界株式インデックス（除く日本）	352,513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）	248,473,705円
りそなＤＡＡファンド（適格機関投資家専用）	116,201,398円
りそなＦＴ　ＲＣバランスファンド（適格機関投資家専用）	1,242,725,151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）	8,120,619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）	34,746,385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）	259,338,004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）	416,665円
りそなＦＴ　パッシブバランスＩ（適格機関投資家専用）	446,721,842円
りそなマルチアセットファンド（適格機関投資家専用）	71,190,487円
りそなＤＡＡファンドⅡ（適格機関投資家専用）	146,813,151円
りそなＤＡＡファンド２０２２０５（適格機関投資家専用）	243,383,444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	85,138,244,252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	2.6864円
(10,000口当たり純資産額)	(26,864円)

（注）※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

2023年12月20日現在

１.金融商品に対する取組方針

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

２.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

3．金融商品に係るリスク管理体制
運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。
また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

2023年12月20日現在

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

（関連当事者との取引に関する注記）

2023年12月20日現在

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1　有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2023年12月20日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
株式	26,521,988,003
投資証券	58,029,978
合計	26,580,017,981

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

2　デリバティブ取引に関する注記

(株式関連)

（2023年12月20日現在）　（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	11,334,745,662	－	11,606,143,860	271,398,198
合計		11,334,745,662	－	11,606,143,860	271,398,198

（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12月20日現在）　（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	434,329,807	－	441,140,749	6,810,942

	米ドル	227,776,040	—	230,404,420	2,628,380
	カナダドル	8,499,480	—	8,633,912	134,432
	ユーロ	74,364,864	—	75,864,000	1,499,136
	英ポンド	21,631,524	—	21,990,036	358,512
	スイスフラン	34,298,691	—	35,151,774	853,083
	スウェーデンクローナ	13,420,920	—	13,743,154	322,234
	デンマーククローネ	12,679,826	—	12,930,536	250,710
	オーストラリアドル	29,556,671	—	30,146,663	589,992
	香港ドル	7,833,439	—	7,940,810	107,371
	シンガポールドル	4,268,352	—	4,335,444	67,092
	売建	1,220,313,590	—	1,233,596,364	△13,282,774
	米ドル	924,307,200	—	933,157,584	△8,850,384
	カナダドル	41,539,680	—	42,090,321	△550,641
	ユーロ	112,128,480	—	113,796,000	△1,667,520
	英ポンド	54,148,800	—	54,975,090	△826,290
	スイスフラン	34,541,430	—	35,151,774	△610,344
	スウェーデンクローナ	10,882,560	—	11,051,196	△168,636
	デンマーククローネ	11,698,960	—	11,870,656	△171,696
	オーストラリアドル	22,026,640	—	22,366,879	△340,239
	香港ドル	4,758,000	—	4,801,420	△43,420
	シンガポールドル	4,281,840	—	4,335,444	△53,604
合計		1,654,643,397	—	1,674,737,113	△6,471,832

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

通 貨	銘　柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	APA CORP	7,486	36.01	269,570.86	
	BAKER HUGHES COMPANY	26,015	34.07	886,331.05	
	CHENIERE ENERGY INC	6,240	173.38	1,081,891.20	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	3,035	76.92	233,452.20	
	CHEVRON CORP	48,573	151.64	7,365,609.72	
	CONOCOPHILLIPS	32,117	116.49	3,741,309.33	

COTERRA ENERGY INC	20,285	25.66	520,513.10	
DEVON ENERGY CORP	17,167	45.68	784,188.56	
DIAMONDBACK ENERGY INC	4,616	157.15	725,404.40	
EOG RESOURCES INC	15,557	122.53	1,906,199.21	
EQT CORP	10,599	38.84	411,665.16	
EXXON MOBIL CORP	107,205	102.99	11,041,042.95	
HALLIBURTON CO	24,120	36.82	888,098.40	
HESS CORP	7,377	147.08	1,085,009.16	
HF SINCLAIR CORP	3,758	57.70	216,836.60	
KINDER MORGAN INC	53,962	17.64	951,889.68	
MARATHON OIL CORP	16,626	24.84	412,989.84	
MARATHON PETROLEUM CORP	10,747	153.77	1,652,566.19	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	17,681	60.30	1,066,164.30	
ONEOK INC	15,437	69.14	1,067,314.18	
OVINTIV INC	7,033	44.14	310,436.62	
PHILLIPS 66	12,231	133.80	1,636,507.80	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	6,228	231.48	1,441,657.44	
SCHLUMBERGER LTD	37,897	52.98	2,007,783.06	
TARGA RESOURCES CORP	5,417	86.27	467,324.59	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	151	1,627.37	245,732.87	
VALERO ENERGY CORP	9,643	133.60	1,288,304.80	
WILLIAMS COS INC	32,530	35.07	1,140,827.10	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	5,932	272.52	1,616,588.64	
ALBEMARLE CORP	3,181	148.93	473,746.33	
AMCOR PLC	36,707	9.74	357,526.18	
AVERY DENNISON CORP	2,036	200.48	408,177.28	
BALL CORP	7,893	57.39	452,979.27	
CELANESE CORP	2,671	151.98	405,938.58	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	4,912	78.31	384,658.72	
CLEVELAND-CLIFFS INC	14,637	21.15	309,572.55	
CORTEVA INC	19,337	47.86	925,468.82	
CROWN HOLDINGS INC	3,413	92.54	315,839.02	
DOW INC	18,281	54.92	1,003,992.52	
DUPONT DE NEMOURS INC	12,505	74.12	926,870.60	
EASTMAN CHEMICAL CO	2,948	88.82	261,841.36	
ECOLAB INC	6,867	196.84	1,351,700.28	
FMC CORP	3,105	60.98	189,342.90	
FREEPORT-MCMORAN INC	38,316	42.18	1,616,168.88	
INTERNATIONAL PAPER CO	7,868	36.86	290,014.48	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	6,933	79.99	554,570.67	
LINDE PLC	13,003	412.09	5,358,406.27	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	7,041	96.94	682,554.54	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,675	492.85	825,523.75	

MOSAIC CO/THE	8,511	38.15	324,694.65	
NEWMONT CORP	31,246	41.77	1,305,145.42	
NUCOR CORP	6,739	177.86	1,198,598.54	
PACKAGING CORP OF AMERICA	2,403	164.43	395,125.29	
PPG INDUSTRIES INC	6,417	149.51	959,405.67	
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	1,573	277.13	435,925.49	
RPM INTERNATIONAL INC	3,503	112.77	395,033.31	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,542	307.21	2,009,767.82	
STEEL DYNAMICS INC	4,203	123.32	518,313.96	
VULCAN MATERIALS CO	3,454	224.69	776,079.26	
WESTLAKE CORP	1,041	142.51	148,352.91	
WESTROCK CO	7,139	43.28	308,975.92	
3M CO	14,719	106.25	1,563,893.75	
AECOM	3,727	93.45	348,288.15	
AERCAP HOLDINGS NV	5,527	73.20	404,576.40	
ALLEGION PLC	2,487	119.52	297,246.24	
AMETEK INC	6,262	163.39	1,023,148.18	
AXON ENTERPRISE INC	1,836	255.92	469,869.12	
BOEING CO/THE	15,388	263.51	4,054,891.88	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	3,334	164.68	549,043.12	
CARLISLE COS INC	1,273	313.08	398,550.84	
CARRIER GLOBAL CORP	22,317	56.99	1,271,845.83	
CATERPILLAR INC	13,688	292.96	4,010,036.48	
CNH INDUSTRIAL NV	25,382	11.91	302,299.62	
CUMMINS INC	3,851	244.52	941,646.52	
DEERE & CO	7,404	393.94	2,916,731.76	
DOVER CORP	3,781	153.30	579,627.30	
EATON CORP PLC	10,606	238.15	2,525,818.90	
EMERSON ELECTRIC CO	15,254	95.74	1,460,417.96	
FASTENAL CO	15,511	64.69	1,003,406.59	
FERGUSON PLC	5,490	189.13	1,038,323.70	
FORTIVE CORP	9,516	72.79	692,669.64	
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS I	3,093	78.78	243,666.54	
GENERAL DYNAMICS CORP	6,228	253.89	1,581,226.92	
GENERAL ELECTRIC CO	28,940	125.94	3,644,703.60	
GRACO INC	4,552	85.63	389,787.76	
HEICO CORP	1,073	183.85	197,271.05	
HEICO CORP-CLASS A	1,964	145.28	285,329.92	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	17,690	204.60	3,619,374.00	
HOWMET AEROSPACE INC	10,616	53.65	569,548.40	
HUBBELL INC	1,422	323.69	460,287.18	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,111	257.01	285,538.11	
IDEX CORP	1,857	213.44	396,358.08	

ILLINOIS TOOL WORKS	8,096	258.59	2,093,544.64	
INGERSOLL-RAND INC	10,886	76.33	830,928.38	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	4,700	39.78	186,966.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	17,690	54.12	957,382.80	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	5,086	210.12	1,068,670.32	
LENNOX INTERNATIONAL INC	876	440.81	386,149.56	
LOCKHEED MARTIN CORP	6,062	447.79	2,714,502.98	
MASCO CORP	5,980	68.10	407,238.00	
NORDSON CORP	1,267	255.72	323,997.24	
NORTHROP GRUMMAN CORP	3,848	464.16	1,786,087.68	
OTIS WORLDWIDE CORP	10,672	89.82	958,559.04	
OWENS CORNING	2,541	149.93	380,972.13	
PACCAR INC	13,983	96.76	1,352,995.08	
PARKER HANNIFIN CORP	3,426	460.26	1,576,850.76	
PENTAIR PLC	4,364	71.28	311,065.92	
QUANTA SERVICES INC	3,901	217.71	849,286.71	
ROCKWELL AUTOMATION INC	2,965	310.48	920,573.20	
RTX CORP	38,829	82.62	3,208,051.98	
SMITH (A.O.) CORP	3,305	80.90	267,374.50	
SNAP-ON INC	1,311	288.55	378,289.05	
STANLEY BLACK & DECKER INC	4,061	97.10	394,323.10	
TEXTRON INC	5,445	80.01	435,654.45	
TORO CO	2,938	89.23	262,157.74	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	6,098	241.79	1,474,435.42	
TRANSDIGM GROUP INC	1,468	998.39	1,465,636.52	
UNITED RENTALS INC	1,845	574.20	1,059,399.00	
VERTIV HOLDINGS CO	9,385	49.22	461,929.70	
WABTEC CORP	4,863	125.87	612,105.81	
WATSCO INC	883	423.30	373,773.90	
WW GRAINGER INC	1,213	830.19	1,007,020.47	
XYLEM INC	6,460	111.58	720,806.80	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	10,987	233.70	2,567,661.90	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	3,274	125.77	411,770.98	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	3,189	197.02	628,296.78	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	3,672	67.63	248,337.36	
CINTAS CORP	2,449	560.29	1,372,150.21	
COPART INC	23,024	48.56	1,118,045.44	
EQUIFAX INC	3,307	246.44	814,977.08	
JACOBS SOLUTIONS INC	3,361	128.74	432,695.14	
LEIDOS HOLDINGS INC	3,453	107.71	371,922.63	
PAYCHEX INC	8,692	128.79	1,119,442.68	
PAYCOM SOFTWARE INC	1,316	207.98	273,701.68	
PAYLOCITY HOLDING CORP	1,263	166.86	210,744.18	

REPUBLIC SERVICES INC	5,946	162.80	968,008.80	
ROBERT HALF INC	2,833	87.37	247,519.21	
ROLLINS INC	7,960	42.52	338,459.20	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	5,673	60.61	343,840.53	
TRANSUNION	5,124	68.67	351,865.08	
VERALTO CORP	6,200	83.44	517,328.00	
VERISK ANALYTICS INC	3,933	234.45	922,111.51	
WASTE CONNECTIONS INC	6,988	147.34	1,029,611.92	
WASTE MANAGEMENT INC	10,849	176.78	1,917,886.22	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	3,329	85.06	283,164.74	
CSX CORP	54,859	34.58	1,897,024.22	
DELTA AIR LINES INC	3,957	41.15	162,830.55	
EXPEDITORS INTL WASH INC	3,825	126.49	483,824.25	
FEDEX CORP	6,395	280.00	1,790,600.00	
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	46,934	3.25	152,535.50	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	2,293	198.86	455,985.98	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	3,939	58.42	230,116.38	
NORFOLK SOUTHERN CORP	6,120	233.62	1,429,754.40	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	2,657	401.07	1,065,642.99	
SOUTHWEST AIRLINES CO	3,155	29.52	93,135.60	
U-HAUL HOLDING CO	2,277	66.46	151,329.42	
UBER TECHNOLOGIES INC	49,559	62.12	3,078,605.08	
UNION PACIFIC CORP	16,230	242.65	3,938,209.50	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	19,304	161.62	3,119,912.48	
APTIV PLC	7,761	88.84	689,487.24	
BORGWARNER INC	6,496	35.36	229,698.56	
FORD MOTOR CO	104,802	12.02	1,259,720.04	
GENERAL MOTORS CO	37,078	35.87	1,329,987.86	
LEAR CORP	1,641	140.46	230,494.86	
LUCID GROUP INC	24,463	4.72	115,465.36	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	17,047	24.35	415,094.45	
TESLA INC	76,455	257.22	19,665,755.10	
DECKERS OUTDOOR CORP	699	714.93	499,736.07	
DR HORTON INC	8,215	150.24	1,234,221.60	
GARMIN LTD	3,824	127.04	485,800.96	
HASBRO INC	3,664	51.38	188,256.32	
LENNAR CORP-A	6,773	148.65	1,006,806.45	
LULULEMON ATHLETICA INC	3,092	506.86	1,567,211.12	
NIKE INC -CL B	32,723	122.64	4,013,148.72	
NVR INC	88	6,936.65	610,425.20	
PULTEGROUP INC	6,015	102.94	619,184.10	
VF CORP	8,818	18.74	165,249.32	
AIRBNB INC-CLASS A	11,518	146.91	1,692,109.38	

BOOKING HOLDINGS INC	959	3,515.29	3,371,163.11	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	6,097	49.16	299,728.52	
CARNIVAL CORP	25,264	18.71	472,689.44	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	739	2,327.03	1,719,675.17	
DARDEN RESTAURANTS INC	3,060	165.46	506,307.60	
DOMINO'S PIZZA INC	878	406.55	356,950.90	
DOORDASH INC - A	6,877	101.46	697,740.42	
DRAFTKINGS INC-CL A	10,834	35.75	387,315.50	
EXPEDIA GROUP INC	3,721	151.52	563,805.92	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	7,113	179.74	1,278,490.62	
HYATT HOTELS CORP - CL A	1,264	130.53	164,989.92	
LAS VEGAS SANDS CORP	8,597	49.26	423,488.22	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	6,906	221.39	1,528,919.34	
MCDONALD'S CORP	19,541	290.73	5,681,154.93	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	7,436	45.02	334,768.72	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	6,254	123.88	774,745.52	
STARBUCKS CORP	30,518	97.72	2,982,218.96	
VAIL RESORTS INC	1,148	229.74	263,741.52	
WYNN RESORTS LTD	2,915	91.72	267,363.80	
YUM! BRANDS INC	7,611	130.24	991,256.64	
ALPHABET INC-CL A	158,747	136.65	21,692,777.55	
ALPHABET INC-CL C	139,705	138.10	19,293,260.50	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	2,628	386.36	1,015,354.08	
COMCAST CORP-CLASS A	110,467	44.70	4,937,874.90	
ELECTRONIC ARTS INC	6,761	138.55	936,736.55	
FOX CORP - CLASS A	7,650	29.95	229,117.50	
FOX CORP- CLASS B	2,680	27.90	74,772.00	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	9,761	32.98	321,917.78	
LIBERTY BROADBAND-C	3,126	78.56	245,578.56	
LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	4,896	65.92	322,744.32	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBER-NEW	3,736	28.33	105,840.88	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	4,305	94.91	408,587.55	
MATCH GROUP INC	7,064	34.68	244,979.52	
META PLATFORMS INC-CLASS A	59,472	350.36	20,836,609.92	
NETFLIX INC	11,804	495.02	5,843,216.08	
NEWS CORP - CLASS A	9,625	23.74	228,497.50	
OMNICOM GROUP	5,185	86.68	449,435.80	
PARAMOUNT GLOBAL	13,751	15.82	217,540.82	
PINTEREST INC- CLASS A	16,150	38.04	614,346.00	
ROBLOX CORP -CLASS A	11,628	44.73	520,120.44	
ROKU INC	3,276	94.42	309,319.92	
SEA LTD-ADR	9,530	36.94	352,038.20	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	18,628	5.45	101,522.60	

SNAP INC - A	28,084	17.18	482,483.12	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	4,589	159.40	731,486.60	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	12,123	77.65	941,350.95	
WALT DISNEY CO/THE	49,069	93.93	4,609,051.17	
WARNER BROS DISCOVERY INC	62,552	12.36	773,142.72	
AMAZON.COM INC	248,406	153.79	38,202,358.74	
AUTOZONE INC	486	2,649.32	1,287,569.52	
BATH & BODY WORKS INC	5,832	42.49	247,801.68	
BEST BUY CO INC	4,752	77.44	367,994.88	
BURLINGTON STORES INC	1,834	186.64	342,297.76	
CARMAX INC	4,066	76.64	311,618.24	
DICK'S SPORTING GOODS INC	1,663	145.93	242,681.59	
EBAY INC	13,552	43.67	591,815.84	
ETSY INC	3,342	87.03	290,854.26	
GENUINE PARTS CO	3,804	138.95	528,565.80	
GLOBAL-E ONLINE LTD	2,458	40.34	99,155.72	
HOME DEPOT INC	26,660	352.07	9,386,186.20	
LKQ CORP	7,165	47.75	342,128.75	
LOWE'S COS INC	15,571	225.42	3,510,014.82	
MERCADOLIBRE INC	1,205	1,629.99	1,964,137.95	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	1,625	964.26	1,566,922.50	
POOL CORP	967	391.53	378,609.51	
ROSS STORES INC	9,164	135.87	1,245,112.68	
TJX COMPANIES INC	30,569	91.28	2,790,338.32	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	2,960	216.14	639,774.40	
ULTA BEAUTY INC	1,348	489.43	659,751.64	
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	7,590	22.62	171,685.80	
COSTCO WHOLESALE CORP	11,864	677.74	8,040,707.36	
DOLLAR GENERAL CORP	5,649	130.02	734,482.98	
DOLLAR TREE INC	5,419	133.60	723,978.40	
KROGER CO	18,323	45.07	825,817.61	
SYSCO CORP	13,692	73.30	1,003,623.60	
TARGET CORP	12,318	139.58	1,719,346.44	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	19,846	26.03	516,591.38	
WALMART INC	39,681	155.53	6,171,585.93	
ALTRIA GROUP INC	47,518	42.44	2,016,663.92	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	14,562	73.94	1,076,714.28	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	7,800	59.09	460,902.00	
BUNGE GLOBAL SA	3,961	105.27	416,974.47	
CAMPBELL SOUP CO	5,192	43.68	226,786.56	
CELSIUS HOLDINGS INC	4,118	50.99	209,976.82	
COCA-COLA CO/THE	110,119	58.83	6,478,300.77	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	5,522	65.17	359,868.74	

CONAGRA BRANDS INC	12,600	29.40	370,440.00	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	4,411	241.09	1,063,447.99	
DARLING INGREDIENTS INC	4,506	50.54	227,733.24	
GENERAL MILLS INC	15,789	66.71	1,053,284.19	
HERSHEY CO/THE	3,952	182.55	721,437.60	
HORMEL FOODS CORP	7,411	31.73	235,151.03	
JM SMUCKER CO/THE	2,684	124.32	333,674.88	
KELLANOVA	7,243	53.64	388,514.52	
KEURIG DR PEPPER INC	28,502	32.54	927,455.08	
KRAFT HEINZ CO/THE	23,439	36.49	855,289.11	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	3,850	105.92	407,792.00	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	6,780	68.21	462,463.80	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	5,126	62.33	319,503.58	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	36,220	71.05	2,573,431.00	
MONSTER BEVERAGE CORP	20,986	55.58	1,166,401.88	
PEPSICO INC	36,857	167.95	6,190,133.15	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	41,676	95.27	3,970,472.52	
TYSON FOODS INC-CL A	7,546	51.77	390,656.42	
CHURCH & DWIGHT CO INC	6,583	92.72	610,375.76	
CLOROX COMPANY	3,403	142.52	484,995.56	
COLGATE-PALMOLIVE CO	21,018	78.13	1,642,136.34	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	6,208	149.02	925,116.16	
KENVUE INC	46,830	21.47	1,005,440.10	
KIMBERLY-CLARK CORP	9,020	120.77	1,089,345.40	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	63,123	146.17	9,226,688.91	
ABBOTT LABORATORIES	46,162	108.42	5,004,884.04	
ALIGN TECHNOLOGY INC	1,957	268.31	525,082.67	
BAXTER INTERNATIONAL INC	13,900	38.69	537,791.00	
BECTON DICKINSON AND CO	7,821	240.62	1,881,889.02	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	39,427	55.82	2,200,815.14	
CARDINAL HEALTH INC	6,878	101.15	695,709.70	
CENCORA INC	4,621	201.88	932,887.48	
CENTENE CORP	14,685	74.53	1,094,473.05	
CIGNA GROUP/THE	7,877	294.32	2,318,358.64	
COOPER COS INC/THE	1,338	365.40	488,905.20	
CVS HEALTH CORP	34,127	76.26	2,602,525.02	
DAVITA INC	1,175	106.43	125,055.25	
DEXCOM INC	10,505	123.29	1,295,161.45	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	16,208	75.31	1,220,624.48	
ELEVANCE HEALTH INC	6,303	465.78	2,935,811.34	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES I	11,010	75.69	833,346.90	
HCA HEALTHCARE INC	5,508	269.18	1,482,643.44	
HENRY SCHEIN INC	3,593	74.12	266,313.16	

HOLOGIC INC	6,146	71.15	437,287.90	
HUMANA INC	3,334	463.58	1,545,575.72	
IDEXX LABORATORIES INC	2,252	545.70	1,228,916.40	
INSULET CORP	1,978	214.61	424,498.58	
INTUITIVE SURGICAL INC	9,316	335.72	3,127,567.52	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	2,351	224.05	526,741.55	
MCKESSON CORP	3,617	448.03	1,620,524.51	
MEDTRONIC PLC	35,375	82.07	2,903,226.25	
MOLINA HEALTHCARE INC	1,538	359.25	552,526.50	
QUEST DIAGNOSTICS INC	2,872	136.45	391,884.40	
RESMED INC	3,967	173.58	688,591.86	
STERIS PLC	2,665	219.05	583,768.25	
STRYKER CORP	9,088	291.98	2,653,514.24	
TELEFLEX INC	1,243	253.83	315,510.69	
UNITEDHEALTH GROUP INC	24,798	524.04	12,995,143.92	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	1,578	150.89	238,104.42	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	4,169	183.40	764,594.60	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	5,629	119.97	675,311.13	
ABBVIE INC	47,324	153.60	7,268,966.40	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	7,964	139.79	1,113,287.56	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	3,348	187.50	627,750.00	
AMGEN INC	14,370	278.44	4,001,182.80	
AVANTOR INC	17,912	23.08	413,408.96	
BIO-RAD LABORATORIES-A	545	315.17	171,767.65	
BIO-TECHNE CORP	3,857	77.42	298,608.94	
BIOGEN INC	3,949	251.69	993,923.81	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	4,978	96.54	480,576.12	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	55,794	52.11	2,907,425.34	
CATALENT INC	4,393	44.64	196,103.52	
CHARLES RIVER LABORATORIES	1,351	235.65	318,363.15	
DANAHER CORP	18,836	229.14	4,316,081.04	
ELI LILLY & CO	21,606	579.81	12,527,374.86	
EXACT SCIENCES CORP	4,549	69.43	315,837.07	
GILEAD SCIENCES INC	33,163	79.49	2,636,126.87	
ILLUMINA INC	4,250	139.53	593,002.50	
INCYTE CORP	4,649	61.90	287,773.10	
IQVIA HOLDINGS INC	4,980	228.86	1,139,722.80	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	1,672	122.15	204,234.80	
JOHNSON & JOHNSON	64,507	156.46	10,092,765.22	
MERCK & CO. INC.	68,027	106.49	7,244,195.23	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	591	1,201.77	710,246.07	
MODERNA INC	8,672	89.09	772,588.48	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	2,714	121.50	329,751.00	

PFIZER INC	151,557	28.16	4,267,845.12	
REGENERON PHARMACEUTICALS	2,869	848.39	2,434,030.91	
REPLIGEN CORP	1,261	182.10	229,628.10	
REVVITY INC	3,104	104.73	325,081.92	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	9,995	27.78	277,661.10	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	29,745	10.63	316,189.35	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	10,356	528.14	5,469,417.84	
UNITED THERAPEUTICS CORP	1,321	240.26	317,383.46	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	6,849	403.14	2,761,105.86	
VIATRIS INC	29,814	10.39	309,767.46	
WATERS CORP	1,566	328.97	515,167.02	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	1,991	358.31	713,395.21	
ZOETIS INC	12,289	198.08	2,434,205.12	
BANK OF AMERICA CORP	190,341	33.51	6,378,326.91	
CITIGROUP INC	51,846	50.93	2,640,516.78	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	12,086	33.55	405,485.30	
FIFTH THIRD BANCORP	17,207	35.12	604,309.84	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	293	1,441.34	422,312.62	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	38,289	12.78	489,333.42	
JPMORGAN CHASE & CO	77,808	168.45	13,106,757.60	
KEYCORP	25,737	14.36	369,583.32	
M & T BANK CORP	4,275	139.36	595,764.00	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	10,670	154.60	1,649,582.00	
REGIONS FINANCIAL CORP	24,798	19.36	480,089.28	
TRUIST FINANCIAL CORP	35,673	36.72	1,309,912.56	
US BANCORP	40,928	44.21	1,809,426.88	
WELLS FARGO & CO	97,412	50.09	4,879,367.08	
ALLY FINANCIAL INC	6,439	34.75	223,755.25	
AMERICAN EXPRESS CO	16,830	185.75	3,126,172.50	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	2,806	381.62	1,070,825.72	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	10,700	94.76	1,013,932.00	
ARES MANAGEMENT CORP - A	4,230	117.20	495,756.00	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	20,982	51.71	1,084,979.22	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	35,007	361.80	12,665,532.60	
BLACKROCK INC	3,989	801.38	3,196,704.82	
BLACKSTONE INC	18,847	128.29	2,417,881.63	
BLOCK INC	14,865	77.31	1,149,213.15	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	10,270	131.52	1,350,710.40	
CARLYLE GROUP INC/THE	4,906	41.47	203,451.82	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	2,873	176.99	508,492.27	
CME GROUP INC	9,605	212.95	2,045,384.75	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	4,412	161.16	711,037.92	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	6,902	108.96	752,041.92	

EQUITABLE HOLDINGS INC	9,273	34.00	315,282.00	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,023	448.65	458,968.95	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	15,313	59.92	917,554.96	
FISERV INC	16,479	134.18	2,211,152.22	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	1,761	278.60	490,614.60	
FRANKLIN RESOURCES INC	7,382	29.72	219,393.04	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	1,496	52.83	79,033.68	
GLOBAL PAYMENTS INC	7,065	128.42	907,287.30	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	8,853	382.45	3,385,829.85	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	15,181	123.77	1,878,952.37	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	2,076	165.25	343,059.00	
KKR & CO INC	15,594	84.69	1,320,655.86	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	2,100	222.60	467,460.00	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	905	281.90	255,119.50	
MASTERCARD INC-CLASS A	22,447	425.47	9,550,525.09	
MOODY'S CORP	4,421	390.53	1,726,533.13	
MORGAN STANLEY	33,359	91.92	3,066,359.28	
MSCI INC	2,150	542.53	1,166,439.50	
NASDAQ INC	9,140	55.76	509,646.40	
NORTHERN TRUST CORP	5,559	85.86	477,295.74	
PAYPAL HOLDINGS INC	28,321	63.01	1,784,506.21	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	5,484	113.67	623,366.28	
ROBINHOOD MARKETS INC - A	11,055	13.17	145,594.35	
S&P GLOBAL INC	8,726	436.66	3,810,295.16	
SCHWAB (CHARLES) CORP	40,091	69.74	2,795,946.34	
SEI INVESTMENTS COMPANY	2,972	63.66	189,197.52	
STATE STREET CORP	9,083	77.68	705,567.44	
SYNCHRONY FINANCIAL	11,238	38.23	429,628.74	
T ROWE PRICE GROUP INC	6,092	108.22	659,276.24	
TOAST INC-CLASS A	8,567	18.17	155,662.39	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	2,965	90.41	268,065.65	
VISA INC-CLASS A SHARES	42,915	259.99	11,157,470.85	
AFLAC INC	15,371	82.10	1,261,959.10	
ALLSTATE CORP	7,079	138.25	978,671.75	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	1,681	120.61	202,745.41	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	19,381	67.44	1,307,054.64	
AON PLC	5,447	313.01	1,704,965.47	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	10,029	74.83	750,470.07	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	5,729	224.59	1,286,676.11	
ASSURANT INC	1,479	167.40	247,584.60	
BROWN & BROWN INC	6,060	70.93	429,835.80	
CHUBB LTD	11,030	221.81	2,446,564.30	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	4,189	102.33	428,660.37	

ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	663	328.21	217,603.23	
EVEREST GROUP LTD	1,143	364.99	417,183.57	
FNF GROUP	6,744	49.61	334,569.84	
GLOBE LIFE INC	2,275	123.50	280,962.50	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	8,392	81.04	680,087.68	
LOEWS CORP	4,757	68.90	327,757.30	
MARKEL GROUP INC	332	1,410.25	468,203.00	
MARSH & MCLENNAN COS	13,165	187.76	2,471,860.40	
METLIFE INC	17,436	66.40	1,157,750.40	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	6,160	79.48	489,596.80	
PROGRESSIVE CORP	15,593	157.68	2,458,704.24	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	9,882	104.34	1,031,087.88	
TRAVELERS COS INC/THE	6,216	186.18	1,157,294.88	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	2,715	238.47	647,446.05	
WR BERKLEY CORP	5,648	70.15	396,207.20	
ACCENTURE PLC-CL A	16,740	341.51	5,716,877.40	
ADOBE INC	12,195	604.64	7,373,584.80	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	3,929	120.18	472,187.22	
ANSYS INC	2,333	298.44	696,260.52	
ASPEN TECHNOLOGY INC	677	214.90	145,487.30	
ATLASSIAN CORP-CL A	4,081	233.07	951,158.67	
AUTODESK INC	5,715	238.16	1,361,084.40	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	5,957	51.12	304,521.84	
BILL HOLDINGS INC	2,332	83.56	194,861.92	
CADENCE DESIGN SYS INC	7,270	274.33	1,994,379.10	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	2,485	150.60	374,241.00	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	7,252	85.51	620,118.52	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	13,609	75.43	1,026,526.87	
CONFLUENT INC-CLASS A	4,264	24.82	105,832.48	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	6,104	258.33	1,576,846.32	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,262	214.20	270,320.40	
DATADOG INC - CLASS A	6,793	122.41	831,531.13	
DOCUSIGN INC	5,725	62.43	357,411.75	
DROPBOX INC-CLASS A	6,720	30.11	202,339.20	
DYNATRACE INC	6,741	55.18	371,968.38	
EPAM SYSTEMS INC	1,534	295.40	453,143.60	
FAIR ISAAC CORP	675	1,152.51	777,944.25	
FORTINET INC	18,080	57.76	1,044,300.80	
GARTNER INC	2,128	450.48	958,621.44	
GEN DIGITAL INC	16,224	23.29	377,856.96	
GODADDY INC - CLASS A	4,144	107.41	445,107.04	
HUBSPOT INC	1,271	567.35	721,101.85	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	24,440	161.56	3,948,526.40	

INTUIT INC	7,516	621.46	4,670,893.36	
MANHATTAN ASSOCIATES INC	1,676	221.93	371,954.68	
MICROSOFT CORP	188,773	373.26	70,461,409.98	
MONDAY.COM LTD	726	194.36	141,105.36	
MONGODB INC	1,838	409.78	753,175.64	
OKTA INC	4,195	86.68	363,622.60	
ORACLE CORP	44,057	106.25	4,681,056.25	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	50,000	17.95	897,500.00	
PALO ALTO NETWORKS INC	8,148	308.61	2,514,554.28	
PTC INC	3,246	171.98	558,247.08	
ROPER TECHNOLOGIES INC	2,847	541.56	1,541,821.32	
SALESFORCE INC	26,073	264.34	6,892,136.82	
SERVICENOW INC	5,481	707.71	3,878,958.51	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	7,566	199.02	1,505,785.32	
SPLUNK INC	4,362	151.97	662,893.14	
SYNOPSYS INC	4,055	558.65	2,265,325.75	
TWILIO INC - A	4,478	77.85	348,612.30	
TYLER TECHNOLOGIES INC	1,045	414.59	433,246.55	
UIPATH INC - CLASS A	9,453	26.26	248,235.78	
UNITY SOFTWARE INC	5,673	40.94	232,252.62	
VERISIGN INC	2,384	205.14	489,053.76	
WIX.COM LTD	1,473	118.79	174,977.67	
WORKDAY INC-CLASS A	5,504	273.98	1,507,985.92	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	6,246	72.42	452,335.32	
ZSCALER INC	2,316	224.04	518,876.64	
AMPHENOL CORP-CL A	15,937	98.55	1,570,591.35	
APPLE INC	418,175	196.94	82,355,384.50	
ARISTA NETWORKS INC	7,016	236.70	1,660,687.20	
CDW CORP/DE	3,641	223.95	815,401.95	
CISCO SYSTEMS INC	108,168	50.18	5,427,870.24	
CORNING INC	21,859	30.38	664,076.42	
DELL TECHNOLOGIES -C	6,963	73.53	511,989.39	
F5 INC	1,530	178.94	273,778.20	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	35,054	16.83	589,958.82	
HP INC	23,098	30.28	699,407.44	
JABIL INC	3,427	131.23	449,725.21	
JUNIPER NETWORKS INC	7,685	29.42	226,092.70	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	4,836	159.20	769,891.20	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	4,495	312.97	1,406,800.15	
NETAPP INC	5,397	90.63	489,130.11	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	5,475	83.90	459,352.50	
SUPER MICRO COMPUTER INC	1,237	315.94	390,817.78	
TE CONNECTIVITY LTD	8,558	141.12	1,207,704.96	

TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	1,279	428.82	548,460.78	
TRIMBLE INC	6,056	52.44	317,576.64	
WESTERN DIGITAL CORP	8,076	50.94	411,391.44	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	1,301	269.42	350,515.42	
AT&T INC	190,393	16.61	3,162,427.73	
LIBERTY GLOBAL LTD-C	6,233	17.05	106,272.65	
T-MOBILE US INC	14,413	155.87	2,246,554.31	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	112,933	37.57	4,242,892.81	
AES CORP	17,804	19.36	344,685.44	
ALLIANT ENERGY CORP	6,232	51.24	319,327.68	
AMEREN CORPORATION	7,154	72.35	517,591.90	
AMERICAN ELECTRIC POWER	13,962	82.13	1,146,699.06	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	5,062	132.62	671,322.44	
ATMOS ENERGY CORP	3,846	115.15	442,866.90	
CENTERPOINT ENERGY INC	17,191	28.97	498,023.27	
CMS ENERGY CORP	7,946	58.04	461,185.84	
CONSOLIDATED EDISON INC	9,364	90.31	845,662.84	
CONSTELLATION ENERGY	8,406	120.81	1,015,528.86	
DOMINION ENERGY INC	22,686	48.01	1,089,154.86	
DTE ENERGY COMPANY	5,615	110.79	622,085.85	
DUKE ENERGY CORP	20,594	96.81	1,993,705.14	
EDISON INTERNATIONAL	9,964	70.01	697,579.64	
ENTERGY CORP	5,760	101.55	584,928.00	
ESSENTIAL UTILITIES INC	6,186	36.76	227,397.36	
EVERGY INC	5,701	51.85	295,596.85	
EVERSOURCE ENERGY	9,502	61.60	585,323.20	
EXELON CORP	26,985	35.41	955,538.85	
FIRSTENERGY CORP	14,826	36.92	547,375.92	
NEXTERA ENERGY INC	55,099	61.57	3,392,445.43	
NISOURCE INC	11,765	26.54	312,243.10	
NRG ENERGY INC	6,483	50.04	324,409.32	
P G & E CORP	55,006	17.62	969,205.72	
PPL CORP	20,210	26.88	543,244.80	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	12,950	62.17	805,101.50	
SEMPRA	16,899	75.00	1,267,425.00	
SOUTHERN CO/THE	29,118	71.26	2,074,948.68	
VISTRA CORP	8,462	37.72	319,186.64	
WEC ENERGY GROUP INC	8,206	83.26	683,231.56	
XCEL ENERGY INC	14,989	62.12	931,116.68	
ADVANCED MICRO DEVICES	43,293	140.15	6,067,513.95	
ANALOG DEVICES INC	13,311	197.83	2,633,315.13	
APPLIED MATERIALS INC	22,275	162.33	3,615,900.75	
BROADCOM INC	11,878	1,139.58	13,535,931.24	

	ENPHASE ENERGY INC	3,595	135.32	486,475.40	
	ENTEGRIS INC	4,091	119.23	487,769.93	
	FIRST SOLAR INC	2,665	172.66	460,138.90	
	INTEL CORP	112,238	46.66	5,237,025.08	
	KLA CORP	3,645	578.11	2,107,210.95	
	LAM RESEARCH CORP	3,566	781.01	2,785,081.66	
	LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	3,791	70.96	269,009.36	
	MARVELL TECHNOLOGY INC	22,878	59.66	1,364,901.48	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	14,488	91.39	1,324,058.32	
	MICRON TECHNOLOGY INC	29,089	82.17	2,390,243.13	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	1,205	635.26	765,488.30	
	NVIDIA CORP	66,071	496.04	32,773,858.84	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	6,907	229.38	1,584,327.66	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	11,497	84.74	974,255.78	
	QORVO INC	2,616	111.49	291,657.84	
	QUALCOMM INC	29,928	143.23	4,286,587.44	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	4,344	111.61	484,833.84	
	TERADYNE INC	3,798	105.88	402,132.24	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	24,351	168.50	4,103,143.50	
	CBRE GROUP INC - A	8,543	90.41	772,372.63	
	COSTAR GROUP INC	11,080	88.02	975,261.60	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	20,100	3.33	66,933.00	
	ZILLOW GROUP INC - C	3,663	57.85	211,904.55	
米ドル 小計		9,045,061		1,101,533,639.29 (158,653,890,066)	
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	16,999	19.72	335,220.28	
	CAMECO CORP	11,404	58.37	665,651.48	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	29,411	85.76	2,522,287.36	
	CENOVUS ENERGY INC	38,211	22.48	858,983.28	
	ENBRIDGE INC	56,465	47.90	2,704,673.50	
	IMPERIAL OIL LTD	5,025	76.41	383,960.25	
	KEYERA CORP	5,128	31.49	161,480.72	
	MEG ENERGY CORP	8,433	24.19	203,994.27	
	PARKLAND CORP	4,484	43.36	194,426.24	
	PEMBINA PIPELINE CORP	14,460	44.86	648,675.60	
	SUNCOR ENERGY INC	35,094	42.85	1,503,777.90	
	TC ENERGY CORP	27,120	52.55	1,425,156.00	
	TOURMALINE OIL CORP	8,465	60.00	507,900.00	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	13,272	73.93	981,198.96	
	BARRICK GOLD CORP	47,200	24.12	1,138,464.00	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	3,584	59.73	214,072.32	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	14,762	10.83	159,872.46	
	FRANCO-NEVADA CORP	4,989	148.92	742,961.88	

IVANHOE MINES LTD-CL A	14,737	13.15	193,791.55	
KINROSS GOLD CORP	35,977	8.24	296,450.48	
LUNDIN MINING CORP	18,302	10.97	200,772.94	
NUTRIEN LTD	12,942	76.02	983,850.84	
PAN AMERICAN SILVER CORP	9,012	21.54	194,118.48	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	12,339	56.61	698,510.79	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	1,240	113.53	140,777.20	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	12,264	66.63	817,150.32	
CAE INC	8,986	28.58	256,819.88	
STANTEC INC	3,137	103.05	323,267.85	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	1,967	115.67	227,522.89	
WSP GLOBAL INC	3,459	187.06	647,040.54	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	6,180	43.89	271,240.20	
RB GLOBAL INC	5,059	86.36	436,895.24	
THOMSON REUTERS CORP	4,276	188.23	804,871.48	
AIR CANADA	5,799	18.66	108,209.34	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	15,044	163.89	2,465,561.16	
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	24,843	103.66	2,575,225.38	
TFI INTERNATIONAL INC	2,185	162.55	355,171.75	
MAGNA INTERNATIONAL INC	7,184	77.56	557,191.04	
BRP INC/CA- SUB VOTING	766	87.27	66,848.82	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	5,096	46.03	234,568.88	
RESTAURANT BRANDS INTERN	8,009	102.48	820,762.32	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	1,212	144.11	174,661.32	
DOLLARAMA INC	7,647	93.14	712,241.58	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	20,978	76.04	1,595,167.12	
EMPIRE CO LTD 'A'	3,510	33.47	117,479.70	
LOBLAW COMPANIES LTD	4,129	122.24	504,728.96	
METRO INC	6,425	66.44	426,877.00	
WESTON (GEORGE) LTD	1,755	159.37	279,694.35	
SAPUTO INC	6,950	26.65	185,217.50	
BANK OF MONTREAL	18,989	128.17	2,433,820.13	
BANK OF NOVA SCOTIA	31,744	62.99	1,999,554.56	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	25,184	62.12	1,564,430.08	
NATIONAL BANK OF CANADA	9,078	100.97	916,605.66	
ROYAL BANK OF CANADA	37,519	133.38	5,004,284.22	
TORONTO-DOMINION BANK	48,826	84.62	4,131,656.12	
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	9,424	52.16	491,555.84	
BROOKFIELD CORP	37,659	52.46	1,975,591.14	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	10,091	21.27	214,635.57	
IGM FINANCIAL INC	1,623	35.90	58,265.70	
ONEX CORPORATION	2,236	91.89	205,466.04	
TMX GROUP LTD	7,110	30.98	220,267.80	

	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	545	1,187.44	647,154.80	
	GREAT-WEST LIFECO INC	7,067	43.28	305,859.76	
	IA FINANCIAL CORP INC	2,549	92.71	236,317.79	
	INTACT FINANCIAL CORP	4,706	203.45	957,435.70	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	49,628	28.95	1,436,730.60	
	POWER CORP OF CANADA	15,664	37.68	590,219.52	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	15,727	68.26	1,073,525.02	
	CGI INC	5,691	144.55	822,634.05	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	545	3,153.39	1,718,597.55	
	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	2,169	110.16	238,937.04	
	OPEN TEXT CORP	7,726	54.96	424,620.96	
	SHOPIFY INC - CLASS A	31,893	104.50	3,332,818.50	
	BCE INC	1,259	51.35	64,649.65	
	QUEBECOR INC -CL B	4,795	30.64	146,918.80	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	9,507	61.07	580,592.49	
	TELUS CORP	9,885	23.75	234,768.75	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	20,954	8.65	181,252.10	
	ALTAGAS LTD	7,887	27.18	214,368.66	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	3,622	38.62	139,881.64	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	2,375	31.57	74,978.75	
	EMERA INC	7,779	49.79	387,316.41	
	FORTIS INC	13,157	54.51	717,188.07	
	HYDRO ONE LTD	9,349	39.23	366,761.27	
	NORTHLAND POWER INC	5,997	24.13	144,707.61	
	FIRSTSERVICE CORP	1,231	219.96	270,770.76	
カナダドル 小計		1,097,105		67,550,582.51 (7,291,409,876)	
ユーロ	ENI SPA	63,503	15.02	954,196.07	
	GALP ENERGIA SGPS SA	15,142	13.48	204,114.16	
	NESTE OYJ	10,953	33.54	367,363.62	
	OMV AG	4,120	39.76	163,811.20	
	REPSOL SA	33,572	13.57	455,572.04	
	TENARIS SA	10,411	15.92	165,795.17	
	TOTALENERGIES SE	61,453	61.99	3,809,471.47	
	AIR LIQUIDE SA	13,972	176.52	2,466,337.44	
	AKZO NOBEL	4,402	74.88	329,621.76	
	ARCELORMITTAL	13,149	26.18	344,240.82	
	ARKEMA	1,842	101.90	187,699.80	
	BASF SE	24,030	48.56	1,167,016.95	
	COVESTRO AG	5,325	53.74	286,165.50	
	DSM-FIRMENICH AG	4,851	90.81	440,519.31	
	EVONIK INDUSTRIES AG	5,594	18.34	102,621.93	
	HEIDELBERG MATERIALS AG	3,445	81.38	280,354.10	

OCI NV	1,927	25.25	48,656.75	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	7,200	36.70	264,240.00	
STORA ENSO OYJ-R SHS	16,656	12.59	209,782.32	
SYENSQO SA	1,924	97.15	186,916.60	
SYMRISE AG	3,729	99.30	370,289.70	
UMICORE	6,087	24.92	151,688.04	
UPM-KYMMENE OYJ	14,037	34.09	478,521.33	
VOESTALPINE AG	3,524	28.92	101,914.08	
WACKER CHEMIE AG	498	114.30	56,921.40	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	5,784	39.35	227,600.40	
AIRBUS SE	15,803	139.88	2,210,523.64	
ALSTOM	7,670	12.22	93,765.75	
BOUYGUES SA	5,825	34.21	199,273.25	
BRENNTAG SE	4,188	82.12	343,918.56	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	12,202	65.62	800,695.24	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	14,911	34.00	506,974.00	
DASSAULT AVIATION SA	468	178.90	83,725.20	
EIFFAGE	2,234	95.30	212,900.20	
FERROVIAL SE	13,882	32.50	451,165.00	
GEA GROUP AG	3,741	35.67	133,441.47	
IMCD NV	1,562	154.70	241,641.40	
KINGSPAN GROUP PLC	4,208	78.72	331,253.76	
KNORR-BREMSE AG	1,728	58.38	100,880.64	
KONE OYJ-B	8,387	43.02	360,808.74	
LEGRAND SA	7,224	94.50	682,668.00	
LEONARDO SPA	11,946	14.70	175,665.93	
METSO CORPORATION	20,109	9.30	187,094.13	
MTU AERO ENGINES AG	1,567	191.15	299,532.05	
PRYSMIAN SPA	7,461	40.65	303,289.65	
RATIONAL AG	130	684.00	88,920.00	
RHEINMETALL AG	1,200	285.00	342,000.00	
SAFRAN SA	9,149	160.20	1,465,669.80	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	14,501	180.44	2,616,560.44	
SIEMENS AG-REG	20,224	167.98	3,397,227.52	
SIEMENS ENERGY AG	13,258	11.09	147,031.22	
THALES SA	2,680	134.80	361,264.00	
VINCI SA	13,723	113.30	1,554,815.90	
WARTSILA OYJ ABP	11,668	13.17	153,667.56	
BUREAU VERITAS SA	7,102	22.34	158,658.68	
RANDSTAD NV	3,070	57.24	175,726.80	
TELEPERFORMANCE	1,798	129.00	231,942.00	
WOLTERS KLUWER	6,604	129.90	857,859.60	
ADP	1,006	117.40	118,104.40	

AENA SME SA	1,862	164.30	305,926.60	
DEUTSCHE GROUP AG	26,734	45.75	1,223,214.17	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	15,976	8.10	129,501.45	
GETLINK	10,511	16.90	177,635.90	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	8,737	100.88	881,388.56	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	1,607	90.05	144,710.35	
CONTINENTAL AG	2,802	76.02	213,008.04	
DR ING HC F PORSCHE AG	2,745	80.44	220,807.80	
FERRARI NV	3,360	317.00	1,065,120.00	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	21,792	63.21	1,377,472.32	
MICHELIN(CGDE)	18,353	32.16	590,232.48	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	3,959	47.62	188,527.58	
RENAULT SA	5,408	39.16	211,804.32	
STELLANTIS NV	58,954	21.28	1,254,835.89	
VOLKSWAGEN AG	591	123.15	72,781.65	
VOLKSWAGEN AG-PREF	5,562	114.16	634,957.92	
ADIDAS AG	4,407	193.40	852,313.80	
HERMES INTERNATIONAL	845	1,996.60	1,687,127.00	
KERING	2,021	405.95	820,424.95	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	7,402	745.50	5,518,191.00	
MONCLER SPA	5,451	55.16	300,677.16	
PUMA SE	2,836	53.92	152,917.12	
SEB SA	417	111.90	46,662.30	
ACCOR SA	6,007	34.80	209,043.60	
AMADEUS IT GROUP SA	11,620	65.74	763,898.80	
DELIVERY HERO SE	4,095	29.73	121,744.35	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	4,587	160.95	738,277.65	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	2,283	33.10	75,567.30	
SODEXO	2,449	98.08	240,197.92	
BOLLORE SE	14,850	5.61	83,308.50	
PUBLICIS GROUPE	6,295	83.46	525,380.70	
SCOUT24 SE	1,621	61.98	100,469.58	
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	22,291	26.09	581,572.19	
VIVENDI	20,767	9.60	199,363.20	
D'IETEREN GROUP	470	173.40	81,498.00	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	29,233	38.94	1,138,333.02	
PROSUS NV	39,536	30.07	1,189,045.20	
ZALANDO SE	5,907	23.15	136,747.05	
CARREFOUR SA	15,170	16.54	250,911.80	
HELLOFRESH SE	5,039	14.63	73,720.57	
JERONIMO MARTINS	6,820	22.98	156,723.60	
KESKO OYJ-B SHS	7,834	17.60	137,917.57	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N.V.	26,102	26.12	681,914.75	

ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	23,616	57.76	1,364,060.16	
DANONE	17,515	57.88	1,013,768.20	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	12,123	10.15	123,048.45	
HEINEKEN HOLDING NV	3,344	75.80	253,475.20	
HEINEKEN NV	7,397	91.38	675,937.86	
JDE PEET'S BV	3,184	24.62	78,390.08	
KERRY GROUP PLC-A	4,388	74.78	328,134.64	
LOTUS BAKERIES	11	8,110.00	89,210.00	
PERNOD RICARD SA	5,491	162.10	890,091.10	
REMY COINTREAU	644	112.75	72,611.00	
BEIERSDORF AG	2,823	134.25	378,987.75	
HENKEL AG & CO KGAA	2,848	64.12	182,613.76	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	4,445	72.52	322,351.40	
L'OREAL	6,419	450.75	2,893,364.25	
AMPLIFON SPA	3,038	31.65	96,152.70	
BIOMERIEUX	820	100.90	82,738.00	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	869	100.80	87,595.20	
DIASORIN ITALIA SPA	614	91.32	56,070.48	
ESSILORLUXOTTICA	7,889	183.18	1,445,107.02	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	5,474	37.46	205,056.04	
FRESENIUS SE & CO KGAA	11,575	27.79	321,669.25	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	21,802	21.41	466,780.82	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	7,641	53.74	410,627.34	
ARGENX SE	1,592	415.10	660,839.20	
BAYER AG-REG	26,253	32.19	845,215.33	
EUROFINS SCIENTIFIC	3,415	58.60	200,119.00	
GRIFOLS SA	8,799	14.39	126,617.61	
IPSEN	693	106.00	73,458.00	
MERCK KGAA	3,494	142.55	498,069.70	
ORION OYJ-CLASS B	2,913	37.95	110,548.35	
QIAGEN N.V.	6,261	38.90	243,552.90	
RECORDATI SPA	3,050	47.99	146,369.50	
SANOFI	30,211	88.93	2,686,664.23	
SARTORIUS AG-VORZUG	611	349.30	213,422.30	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	663	239.60	158,854.80	
UCB SA	3,287	76.28	250,732.36	
ABN AMRO BANK NV-CVA	10,185	13.49	137,446.57	
AIB GROUP PLC	38,239	3.81	145,767.06	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	159,631	8.26	1,318,871.32	
BANCO BPM SPA	35,886	4.81	172,755.20	
BANCO SANTANDER SA	431,952	3.79	1,638,177.96	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	30,522	8.30	253,332.60	
BNP PARIBAS	28,394	62.29	1,768,662.26	

CAIXABANK S.A	104,486	3.73	389,732.78	
COMMERZBANK AG	29,203	10.54	307,945.63	
CREDIT AGRICOLE SA	29,943	12.77	382,551.76	
ERSTE GROUP BANK AG	9,433	36.24	341,851.92	
FINECOBANK SPA	17,182	13.42	230,582.44	
ING GROEP NV-CVA	96,702	13.66	1,321,722.93	
INTESA SANPAOLO	415,346	2.65	1,101,497.59	
KBC GROEP NV	7,180	57.24	410,983.20	
MEDIOBANCA SPA	14,388	11.12	160,066.50	
NORDEA BANK ABP	85,043	11.12	945,678.16	
SOCIETE GENERALE SA	18,766	23.96	449,727.19	
UNICREDIT SPA	43,391	24.33	1,055,703.03	
ADYEN NV	594	1,185.60	704,246.40	
AMUNDI SA	1,142	61.30	70,004.60	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	53,160	12.04	640,152.72	
DEUTSCHE BOERSE AG	5,163	181.25	935,793.75	
EDENRED	6,289	54.20	340,863.80	
EURAZEO	846	72.55	61,377.30	
EURONEXT NV	2,215	78.50	173,877.50	
EXOR NV	2,777	92.32	256,372.64	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	2,398	71.80	172,176.40	
NEXI SPA	14,056	7.39	103,930.06	
SOFINA	272	224.40	61,036.80	
WORLDLINE SA	6,107	16.46	100,551.75	
AEGON LTD	41,151	5.25	216,207.35	
AGEAS	4,697	39.56	185,813.32	
ALLIANZ SE-REG	10,745	242.50	2,605,662.50	
ASR NEDERLAND NV	4,312	42.78	184,467.36	
ASSICURAZIONI GENERALI	27,355	19.19	524,942.45	
AXA SA	49,135	29.33	1,441,129.55	
HANNOVER RUECK SE	1,645	215.60	354,662.00	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	3,654	379.80	1,387,789.20	
NN GROUP NV	6,780	35.47	240,486.60	
POSTE ITALIANE SPA	12,729	10.18	129,581.22	
SAMPO OYJ-A SHS	11,968	39.74	475,608.32	
TALANX AG	1,722	65.75	113,221.50	
BECHTLE AG	2,142	45.01	96,411.42	
CAPGEMINI SA	4,451	191.00	850,141.00	
DASSAULT SYSTEMES SE	18,138	44.39	805,145.82	
NEMETSCHEK SE	1,486	80.08	118,998.88	
SAP SE	27,760	141.26	3,921,377.60	
NOKIA OYJ	146,126	3.03	444,149.97	
CELLNEX TELECOM SA	15,557	35.75	556,162.75	

	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	86,707	21.48	1,862,466.36	
	ELISA OYJ	4,366	40.97	178,875.02	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	9,768	11.31	110,476.08	
	KONINKLIJKE KPN NV	85,923	3.09	266,189.45	
	ORANGE	51,043	10.38	529,826.34	
	TELECOM ITALIA SPA	282,105	0.27	78,961.18	
	TELEFONICA SA	141,116	3.56	503,078.54	
	ACCIONA SA	678	133.00	90,174.00	
	CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVA	1,625	27.88	45,305.00	
	E.ON SE	58,651	12.27	719,647.77	
	EDP RENOVAVEIS SA	7,288	17.80	129,726.40	
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	76,676	4.54	348,645.77	
	ELIA GROUP SA/NV	575	111.50	64,112.50	
	ENAGAS SA	6,843	16.67	114,072.81	
	ENDESA SA	8,910	19.44	173,254.95	
	ENEL SPA	217,500	6.70	1,457,250.00	
	ENGIE	47,962	16.04	769,694.17	
	FORTUM OYJ	10,734	13.01	139,649.34	
	IBERDROLA SA	162,679	11.82	1,923,679.17	
	NATURGY ENERGY GROUP SA	3,070	27.00	82,890.00	
	REDEIA CORP SA	10,476	15.01	157,297.14	
	RWE AG	17,380	40.62	705,975.60	
	SNAM SPA	53,892	4.65	250,813.36	
	TERNA SPA	38,984	7.58	295,810.59	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	18,656	29.28	546,247.68	
	VERBUND AG	1,686	86.35	145,586.10	
	ASM INTERNATIONAL NV	1,255	479.70	602,023.50	
	ASML HOLDING NV	10,796	676.80	7,306,732.80	
	BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	2,064	137.75	284,316.00	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	34,836	38.06	1,326,032.34	
	STMICROELECTRONICS NV	18,303	45.82	838,643.46	
	LEG IMMOBILIEN SE	2,018	78.60	158,614.80	
	VONOVIA SE	19,712	28.01	552,133.12	
ユーロ 小計		4,865,600		130,381,874.15 (20,609,462,846)	
英ポンド	BP PLC	460,998	4.63	2,137,417.22	
	SHELL PLC-NEW	177,842	25.42	4,521,632.85	
	ANGLO AMERICAN PLC	33,033	18.91	624,852.22	
	ANTOFAGASTA PLC	9,832	16.85	165,669.20	
	CRH PLC	18,912	53.26	1,007,253.12	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	3,481	50.42	175,512.02	
	ENDEAVOUR MINING PLC	5,026	18.17	91,322.42	
	GLENCORE PLC	281,724	4.67	1,317,904.87	

MONDI PLC	11,896	15.28	181,830.36	
RIO TINTO PLC	30,058	57.86	1,739,155.88	
ASHTEAD GROUP PLC	11,790	54.28	639,961.20	
BAE SYSTEMS PLC	82,245	10.65	875,909.25	
BUNZL PLC	9,080	31.61	287,018.80	
DCC PLC	2,603	56.90	148,110.70	
MELROSE INDUSTRIES PLC	37,196	5.58	207,851.24	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	227,390	2.95	670,800.50	
SMITHS GROUP PLC	8,753	17.32	151,645.72	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	1,807	103.40	186,843.80	
EXPERIAN PLC	24,727	32.03	792,005.81	
INTERTEK GROUP PLC	3,767	40.99	154,409.33	
RELX PLC	50,529	30.70	1,551,240.30	
RENTOKIL INITIAL PLC	68,450	4.36	298,442.00	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	27,219	5.56	151,392.07	
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	2,907	47.77	138,867.39	
BURBERRY GROUP PLC	10,857	14.83	161,063.59	
PERSIMMON PLC	8,500	13.59	115,557.50	
TAYLOR WIMPEY PLC	102,300	1.44	147,414.30	
COMPASS GROUP PLC	46,547	20.84	970,039.48	
ENTAIN PLC	16,920	10.12	171,230.40	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	4,209	70.96	298,670.64	
PEARSON PLC	18,520	9.48	175,680.72	
WHITBREAD PLC	4,984	36.01	179,473.84	
AUTO TRADER GROUP PLC	22,112	7.10	157,172.09	
INFORMA PLC	36,756	7.70	283,241.73	
WPP PLC	31,267	7.49	234,252.36	
JD SPORTS FASHION PLC	67,369	1.72	116,211.52	
KINGFISHER PLC	48,904	2.41	118,200.96	
NEXT PLC	3,213	81.06	260,445.78	
OCADO GROUP PLC	16,747	7.66	128,415.99	
SAINSBURY (J) PLC	39,265	2.94	115,792.48	
TESCO PLC	193,731	2.86	554,264.39	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	8,443	23.79	200,858.97	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	56,614	23.21	1,314,294.01	
COCA-COLA HBC AG-DI	5,331	22.84	121,760.04	
DIAGEO PLC	59,793	28.38	1,697,224.30	
IMPERIAL BRANDS PLC	23,388	18.05	422,153.40	
HALEON PLC	144,556	3.20	462,940.59	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	19,159	54.32	1,040,716.88	
UNILEVER PLC	66,824	37.62	2,514,253.00	
NMC HEALTH PLC	438	0.00	0.00	
SMITH & NEPHEW PLC	25,100	10.48	263,173.50	

	ASTRAZENECA PLC	41,570	103.46	4,300,832.20	
	GSK PLC	109,043	14.32	1,562,368.10	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	4,453	17.65	78,595.45	
	BARCLAYS PLC	397,261	1.47	586,595.59	
	HSBC HOLDINGS PLC	525,161	6.13	3,219,762.09	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,729,799	0.46	808,248.58	
	NATWEST GROUP PLC	158,355	2.19	346,797.45	
	STANDARD CHARTERED PLC	61,177	6.58	402,544.66	
	3I GROUP PLC	24,778	23.84	590,707.52	
	ABRDN PLC	51,021	1.82	93,164.34	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	5,595	7.20	40,317.57	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	11,242	92.46	1,039,435.32	
	M&G PLC	53,635	2.19	117,675.19	
	SCHRODERS PLC	19,357	4.35	84,222.30	
	ST JAMES'S PLACE PLC	12,910	6.73	86,987.58	
	WISE PLC - A	16,616	8.61	143,096.99	
	ADMIRAL GROUP PLC	7,507	26.80	201,187.60	
	AVIVA PLC	69,482	4.27	296,827.10	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	163,168	2.45	400,903.77	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	16,924	5.23	88,580.21	
	PRUDENTIAL PLC	74,924	8.63	647,043.66	
	SAGE GROUP PLC/THE	27,848	11.72	326,378.56	
	HALMA PLC	10,535	22.92	241,462.20	
	BT GROUP PLC	167,081	1.23	206,428.57	
	VODAFONE GROUP PLC	609,610	0.66	407,524.28	
	CENTRICA PLC	162,387	1.41	229,534.02	
	NATIONAL GRID PLC	98,878	10.54	1,042,668.51	
	SEVERN TRENT PLC	6,844	26.41	180,750.04	
	SSE PLC	29,718	18.40	546,959.79	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	18,553	10.92	202,598.76	
英ポンド 小計		7,358,544		48,961,748.73 (8,973,709,307)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	4,450	12.67	56,381.50	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	185	688.00	127,280.00	
	GIVAUDAN-REG	249	3,483.00	867,267.00	
	HOLCIM LTD	13,620	67.00	912,540.00	
	SIG GROUP AG	8,857	19.24	170,408.68	
	SIKA AG-REG	4,153	270.50	1,123,386.50	
	ABB LTD-REG	42,636	37.57	1,601,834.52	
	GEBERIT AG-REG	891	538.80	480,070.80	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	620	196.50	121,830.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,097	208.00	228,176.00	
	VAT GROUP AG	716	415.70	297,641.20	

	ADECCO SA-REG	4,419	42.23	186,614.37	
	SGS SA-REG	4,000	73.58	294,320.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	1,539	286.60	441,077.40	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	13,882	119.00	1,651,958.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	667	231.80	154,610.60	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	959	44.50	42,675.50	
	AVOLTA AG	3,059	32.69	99,998.71	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	90	1,407.00	126,630.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	24	10,760.00	258,240.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	3	107,200.00	321,600.00	
	NESTLE SA-REG	71,570	96.57	6,911,514.90	
	ALCON INC	13,356	65.26	871,612.56	
	SONOVA HOLDING AG-REG	1,404	275.30	386,521.20	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	2,819	135.75	382,679.25	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	580	62.50	36,250.00	
	LONZA GROUP AG-REG	1,987	350.70	696,840.90	
	NOVARTIS AG-REG	55,032	84.62	4,656,807.84	
	ROCHE HOLDING AG-BR	863	260.00	224,380.00	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	18,867	244.05	4,604,491.35	
	SANDOZ GROUP AG	10,872	27.04	293,978.88	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	737	106.30	78,343.10	
	JULIUS BAER GROUP LTD	5,378	47.12	253,411.36	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	614	1,230.50	755,527.00	
	UBS GROUP AG-REG	87,639	26.20	2,296,141.80	
	BALOISE HOLDING AG - REG	1,130	132.00	149,160.00	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	1,070	116.20	124,334.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	766	586.20	449,029.20	
	SWISS RE AG	8,102	95.96	777,467.92	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	4,008	443.40	1,777,147.20	
	TEMENOS GROUP AG-REG	1,696	77.34	131,168.64	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	4,494	81.14	364,643.16	
	SWISSCOM AG-REG	661	507.40	335,391.40	
	BKW AG	522	153.90	80,335.80	
	SWISS PRIME SITE-REG	2,082	90.15	187,692.30	
スイスフラン 小計		402,365		36,389,410.54 (6,091,587,324)	
スウェーデンクローナ	BOLIDEN AB	6,682	321.85	2,150,601.70	
	HOLMEN AB-B SHARES	2,814	435.00	1,224,090.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	17,171	154.50	2,652,919.50	
	ALFA LAVAL AB	7,597	401.10	3,047,156.70	
	ASSA ABLOY AB-B	27,113	283.20	7,678,401.60	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	71,074	171.35	12,178,529.90	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	40,380	146.30	5,907,594.00	

	BEIJER REF AB	10,131	133.70	1,354,514.70	
	EPIROC AB-A	17,281	203.10	3,509,771.10	
	EPIROC AB-B	10,209	176.00	1,796,784.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	8,099	85.42	691,816.58	
	INDUTRADE AB	7,147	264.90	1,893,240.30	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	2,737	262.60	718,736.20	
	LIFCO AB-B SHS	4,582	252.10	1,155,122.20	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	42,668	74.18	3,165,112.24	
	SAAB AB-B	2,409	584.40	1,407,819.60	
	SANDVIK AB	29,539	219.90	6,495,626.10	
	SKANSKA AB-B SHS	8,250	179.80	1,483,350.00	
	SKF AB-B SHARES	9,296	206.60	1,920,553.60	
	VOLVO AB-A SHS	5,298	265.20	1,405,029.60	
	VOLVO AB-B SHS	40,214	259.70	10,443,575.80	
	SECURITAS AB-B SHS	12,044	97.88	1,178,866.72	
	VOLVO CAR AB-B	10,746	33.81	363,322.26	
	EVOLUTION AB	4,992	1,202.00	6,000,384.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	18,218	182.00	3,315,676.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	15,619	253.50	3,959,416.50	
	GETINGE AB-B SHS	6,454	224.80	1,450,859.20	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	5,811	258.40	1,501,562.40	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	42,139	136.25	5,741,438.75	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	37,765	107.95	4,076,731.75	
	SWEDBANK AB - A SHARES	23,817	200.40	4,772,926.80	
	EQT AB	10,109	286.10	2,892,184.90	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	3,567	329.50	1,175,326.50	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	3,625	329.90	1,195,887.50	
	INVESTOR AB-B SHS	47,462	231.85	11,004,064.70	
	LUNDBERGS AB-B SHS	1,611	552.00	889,272.00	
	ERICSSON LM-B SHS	76,779	61.60	4,729,586.40	
	HEXAGON AB-B SHS	57,185	120.05	6,865,059.25	
	TELE2 AB-B SHS	13,442	84.70	1,138,537.40	
	TELIA CO AB	75,050	25.33	1,901,016.50	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	17,865	69.62	1,243,761.30	
	SAGAX AB-B	5,246	276.30	1,449,469.80	
スウェーデンクローナ 小計		860,237		139,125,696.05 (1,971,411,113)	
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	8,475	295.10	2,500,972.50	
	EQUINOR ASA	24,419	324.40	7,921,523.60	
	NORSK HYDRO ASA	39,706	67.24	2,669,831.44	
	YARA INTERNATIONAL ASA	4,955	366.60	1,816,503.00	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	1,670	463.40	773,878.00	
	ADEVINTA ASA	9,112	112.60	1,026,011.20	

	MOWI ASA	12,181	184.40	2,246,176.40	
	ORKLA ASA	18,647	78.00	1,454,466.00	
	SALMAR ASA	2,244	571.00	1,281,324.00	
	DNB BANK ASA	24,205	210.90	5,104,834.50	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	4,317	182.60	788,284.20	
	TELENOR ASA	17,808	116.80	2,079,974.40	
ノルウェークローネ 小計		167,739		29,663,779.24 (415,589,547)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	3,077	554.00	1,704,658.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	5,223	363.00	1,895,949.00	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	229	1,973.00	451,817.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	26,648	193.14	5,146,794.72	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	78	11,590.00	904,020.00	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-B	122	11,755.00	1,434,110.00	
	DSV A/S	4,863	1,170.50	5,692,141.50	
	PANDORA A/S	2,289	940.20	2,152,117.80	
	CARLSBERG AS-B	2,655	837.60	2,223,828.00	
	COLOPLAST-B	3,785	760.80	2,879,628.00	
	DEMANT A/S	1,941	299.30	580,941.30	
	GENMAB A/S	1,795	2,131.00	3,825,145.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	87,470	682.30	59,680,781.00	
	DANSKE BANK A/S	19,131	178.85	3,421,579.35	
	TRYG A/S	10,027	146.25	1,466,448.75	
	ORSTED A/S	4,796	360.10	1,727,039.60	
デンマーククローネ 小計		174,129		95,186,999.02 (2,017,964,379)	
オーストラリアドル	AMPOL LTD	6,343	35.53	225,366.79	
	SANTOS LTD	85,587	7.63	653,028.81	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	50,241	31.01	1,557,973.41	
	BHP GROUP LTD	136,083	49.62	6,752,438.46	
	BLUESCOPE STEEL LTD	13,389	23.06	308,750.34	
	FORTESCUE LTD	45,201	28.09	1,269,696.09	
	IGO LTD	16,726	8.88	148,526.88	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	12,919	52.73	681,218.87	
	MINERAL RESOURCES LTD	4,720	67.94	320,676.80	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	32,470	13.40	435,098.00	
	ORICA LTD	13,514	16.63	224,737.82	
	PILBARA MINERALS LTD	79,307	3.85	305,331.95	
	RIO TINTO LTD	9,891	134.24	1,327,767.84	
	SOUTH32 LTD	133,593	3.25	434,177.25	
	REECE LTD	5,105	22.04	112,514.20	
	BRAMBLES LTD	38,743	13.18	510,632.74	
	COMPUTERSHARE LTD	15,873	23.83	378,253.59	

	AURIZON HOLDINGS LTD	45,292	3.73	168,939.16	
	QANTAS AIRWAYS LTD	17,415	5.37	93,518.55	
	TRANSURBAN GROUP	82,542	13.87	1,144,857.54	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	14,554	41.80	608,357.20	
	IDP EDUCATION LTD	6,171	20.50	126,505.50	
	LOTTERY CORP LTD/THE	59,224	4.80	284,275.20	
	CAR GROUP LTD	10,658	30.99	330,291.42	
	REA GROUP LTD	1,458	175.46	255,820.68	
	SEEK LTD	10,021	25.75	258,040.75	
	WESFARMERS LTD	30,113	55.53	1,672,174.89	
	COLES GROUP LTD	34,879	15.93	555,622.47	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	40,049	5.09	203,849.41	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	32,344	36.51	1,180,879.44	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	19,494	10.62	207,026.28	
	COCHLEAR LTD	1,833	299.19	548,415.27	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	4,302	51.04	219,574.08	
	SONIC HEALTHCARE LTD	12,546	31.37	393,568.02	
	CSL LTD	12,771	281.09	3,589,800.39	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	79,705	25.63	2,042,839.15	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	45,050	110.60	4,982,530.00	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	83,242	30.35	2,526,394.70	
	WESTPAC BANKING CORP	93,066	22.65	2,107,944.90	
	ASX LTD	5,710	62.46	356,646.60	
	MACQUARIE GROUP LTD	9,775	181.35	1,772,696.25	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	6,799	33.20	225,726.80	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	67,809	5.65	383,120.85	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	64,169	3.56	228,441.64	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	39,069	14.66	572,751.54	
	SUNCORP GROUP LTD	35,184	13.76	484,131.84	
	WISETECH GLOBAL LTD	3,650	74.39	271,523.50	
	XERO LTD	3,659	111.86	409,295.74	
	TELSTRA GROUP LTD	101,989	3.89	396,737.21	
	APA GROUP	37,178	8.73	324,563.94	
	ORIGIN ENERGY LTD	48,740	8.28	403,567.20	
オーストラリアドル 小計		1,860,165		44,976,617.95 (4,374,425,861)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	33,815	8.60	290,809.00	
	EBOS GROUP LTD	4,341	36.10	156,710.10	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	14,964	24.10	360,632.40	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	46,094	5.13	236,462.22	
	MERCURY NZ LTD	18,009	6.60	118,859.40	
	MERIDIAN ENERGY LTD	33,959	5.34	181,341.06	
		151,182		1,344,814.18	

ニュージーランドドル 小計				(121,369,479)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	70,000	40.95	2,866,500.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	38,500	91.75	3,532,375.00	
	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	52,000	8.26	429,520.00	
	MTR CORP	44,500	29.30	1,303,850.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	24,000	13.52	324,480.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	62,000	42.10	2,610,200.00	
	SANDS CHINA LTD	70,200	21.45	1,505,790.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	45,800	14.00	641,200.00	
	WH GROUP LTD	210,000	5.01	1,052,100.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	94,500	20.25	1,913,625.00	
	HANG SENG BANK LTD	22,500	86.85	1,954,125.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	32,600	256.60	8,365,160.00	
	AIA GROUP LTD	308,600	66.45	20,506,470.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	69,000	9.11	628,590.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD (CKI)	11,900	43.15	513,485.00	
	CLP HOLDINGS LTD	43,500	63.30	2,753,550.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	311,717	5.69	1,773,669.73	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	37,500	44.00	1,650,000.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	55,500	37.15	2,061,825.00	
	ESR GROUP LTD	70,200	10.02	703,404.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	45,000	10.58	476,100.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	32,916	23.10	760,359.60	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	38,000	11.66	443,080.00	
	SINO LAND CO	106,000	8.07	855,420.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	39,700	82.15	3,261,355.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	13,700	62.65	858,305.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	21,400	15.36	328,704.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	32,000	23.80	761,600.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	40,000	23.45	938,000.00	
香港ドル 小計		2,043,233		65,772,842.33 (1,214,824,397)	
シンガポールドル	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	2,400	28.45	68,280.00	
	KEPPEL CORP LTD	47,000	6.81	320,070.00	
	SEATRIUM LTD	1,253,142	0.10	135,339.33	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	33,900	3.72	126,108.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	37,300	6.37	237,601.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	178,600	0.98	175,028.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	45,400	3.46	157,084.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	47,800	31.66	1,513,348.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	89,300	12.48	1,114,464.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	34,800	27.68	963,264.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	24,000	9.52	228,480.00	

	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	214,800	2.42	519,816.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	25,700	5.09	130,813.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	62,600	2.95	184,670.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	20,000	6.38	127,600.00	
	UOL GROUP LTD	9,400	6.13	57,622.00	
シンガポールドル 小計		2,126,142		6,059,587.33 (656,859,266)	
イスラエルシュケル	ICL GROUP LTD	24,131	18.33	442,321.23	
	ELBIT SYSTEMS LTD	724	786.40	569,353.60	
	BANK HAPOALIM BM	35,677	31.85	1,136,312.45	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	37,127	28.32	1,051,436.64	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	34,303	17.94	615,395.82	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	4,617	135.30	624,680.10	
	NICE SYSTEMS LTD	1,508	731.40	1,102,951.20	
	AZRIELI GROUP	723	227.50	164,482.50	
イスラエルシュケル 小計		138,810		5,706,933.54 (225,050,070)	
合　計		30,290,312		212,617,553,531 (212,617,553,531)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。

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

(2)株式以外の有価証券

種　類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
新株予約権証券	カナダドル	(WRT)CONSTELLATION SOFTWARE INC	497.00	0.00	
		カナダドル 小計	497.00	0.00 (0)	
		新株予約権証券合計		0 (0)	
投資証券	米ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	4,491	581,764.14	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	8,191	296,104.65	
		AMERICAN TOWER CORP	12,440	2,624,840.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	12,077	243,834.63	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	3,860	731,856.00	
		BOSTON PROPERTIES INC	3,897	278,245.80	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	2,862	281,821.14	
		CROWN CASTLE INC	11,727	1,336,760.73	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	8,196	1,102,689.84	
		EQUINIX INC	2,500	2,023,725.00	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	4,429	318,622.26	
		EQUITY RESIDENTIAL	9,814	603,364.72	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,729	425,057.36	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	5,734	880,685.06	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	6,429	311,227.89	

	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	15,625	309,687.50	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	20,316	390,676.68	
	INVITATION HOMES INC	16,133	557,717.81	
	IRON MOUNTAIN INC	7,969	547,709.37	
	KIMCO REALTY CORP	15,495	342,439.50	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	3,188	429,646.76	
	PROLOGIS INC	24,600	3,290,250.00	
	PUBLIC STORAGE	4,286	1,263,769.96	
	REALTY INCOME CORP	19,211	1,097,332.32	
	REGENCY CENTERS CORP	4,747	315,105.86	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	2,950	733,901.00	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	8,864	1,286,698.24	
	SUN COMMUNITIES INC	3,399	457,607.37	
	UDR INC	7,646	287,642.52	
	VENTAS INC	10,931	544,035.87	
	VICI PROPERTIES INC	26,214	833,605.20	
	WELLTOWER INC	14,026	1,266,407.54	
	WEYERHAEUSER CO	18,644	642,285.80	
	WP CAREY INC	5,737	370,151.24	
	米ドル 小計	328,357	27,007,269.76 (3,889,857,063)	
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	1,821	90,194.13	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	2,998	55,822.76	
	カナダドル 小計	4,819	146,016.89 (15,761,063)	
ユーロ	COVIVIO	968	46,425.28	
	GECINA SA	1,087	119,787.40	
	KLEPIERRE	5,091	125,238.60	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	3,132	212,537.52	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	4,126	117,343.44	
	ユーロ 小計	14,404	621,332.24 (98,213,987)	
英ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	14,625	103,574.25	
	SEGRO PLC	34,080	299,699.52	
	英ポンド 小計	48,705	403,273.77 (73,912,016)	
オーストラリアドル	DEXUS/AU	33,935	258,584.70	
	GOODMAN GROUP	44,620	1,098,098.20	
	GPT GROUP	46,863	210,883.50	
	MIRVAC GROUP	109,547	227,857.76	
	SCENTRE GROUP	149,154	437,021.22	
	STOCKLAND	56,253	247,513.20	
	VICINITY CENTRES	97,692	196,360.92	

	オーストラリアドル 小計		538,064	2,676,319.50 (260,298,834)	
	香港ドル	LINK REIT	67,000	2,850,850.00	
	香港ドル 小計		67,000	2,850,850.00 (52,655,199)	
	シンガポールドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	106,100	310,873.00	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	151,663	301,809.37	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	110,100	182,766.00	
		MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA	73,900	110,850.00	
	シンガポールドル 小計		441,763	906,298.37 (98,242,743)	
投資証券合計				4,488,940,905 (4,488,940,905)	
合計				4,488,940,905 (4,488,940,905)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。
(注2)合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。
(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数		組入株式 時価比率	組入新株予約権証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式	588銘柄	97.6%	—	—	73.2%
	投資証券	34銘柄	—	—	2.4%	1.8%
カナダドル	株式	86銘柄	99.8%	—	—	3.4%
	新株予約権証券	1銘柄	—	—	—	—
	投資証券	2銘柄	—	—	0.2%	0.0%
ユーロ	株式	221銘柄	99.5%	—	—	9.5%
	投資証券	5銘柄	—	—	0.5%	0.0%
英ポンド	株式	81銘柄	99.2%	—	—	4.1%
	投資証券	2銘柄	—	—	0.8%	0.0%
スイスフラン	株式	45銘柄	100.0%	—	—	2.8%
スウェーデンクローナ	株式	42銘柄	100.0%	—	—	0.9%
ノルウェークローネ	株式	12銘柄	100.0%	—	—	0.2%
デンマーククローネ	株式	16銘柄	100.0%	—	—	0.9%
オーストラリアドル	株式	51銘柄	94.4%	—	—	2.0%
	投資証券	7銘柄	—	—	5.6%	0.1%
ニュージーランドドル	株式	6銘柄	100.0%	—	—	0.1%
香港ドル	株式	29銘柄	95.8%	—	—	0.6%
	投資証券	1銘柄	—	—	4.2%	0.0%
シンガポールドル	株式	16銘柄	87.0%	—	—	0.3%
	投資証券	4銘柄	—	—	13.0%	0.0%
イスラエルシュケル	株式	8銘柄	100.0%	—	—	0.1%

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

ＲＭ新興国株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2023年12月20日現在
資産の部	
流動資産	
預金	929,346,833
金銭信託	13,479,495
株式	28,212,814,408
投資証券	43,352,506
派生商品評価勘定	40,500,516
未収入金	257,300
未収配当金	29,865,273
差入委託証拠金	662,522,016
流動資産合計	29,932,138,347
資産合計	29,932,138,347
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	720
未払金	3,156,571
未払解約金	14,339,000
その他未払費用	965
流動負債合計	17,497,256
負債合計	17,497,256
純資産の部	
元本等	
元本	17,018,218,864
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	12,896,422,227
元本等合計	29,914,641,091
純資産合計	29,914,641,091
負債純資産合計	29,932,138,347

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

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

（貸借対照表に関する注記）

2023年12月20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	4,953,671,880円
期中一部解約元本額	1,595,457,911円
期末元本額	17,018,218,864円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド（安定型）	565,213,930円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	2,516,483,641円
りそなラップ型ファンド（成長型）	2,326,707,453円
ＤＣりそな　グローバルバランス	16,335,514円
つみたてバランスファンド	1,157,622,824円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	501,872,223円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	376,958,792円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	259,914,418円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	140,885,520円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	95,135,946円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	53,787,828円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	117,924,191円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスＥＳＧ	141,112,436円
九州ＳＤＧｓ・グローバルバランス	71,949,928円
ラップ型ファンド・プラスＥＳＧ（安定型）	3,710,756円
ラップ型ファンド・プラスＥＳＧ（安定成長型）	89,668,073円
ラップ型ファンド・プラスＥＳＧ（成長型）	171,043,887円
りそな　つみたてラップ型ファンド（安定型）	17,002,187円
りそな　つみたてラップ型ファンド（安定成長型）	45,780,579円
りそな　つみたてラップ型ファンド（成長型）	48,788,639円
りそな　つみたてリスクコントロールファンド	2,240,541円
ターゲットリターンバランスファンド（目標２％）	229,674円
ターゲットリターンバランスファンド（目標３％）	218,035円
ターゲットリターンバランスファンド（目標４％）	1,252,176円
ターゲットリターンバランスファンド（目標５％）	655,487円
ターゲットリターンバランスファンド（目標６％）	1,494,987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	103,140,330円
ＦＷりそな新興国株式インデックスファンド	3,970,193,392円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　新興国株式インデックス	2,854,732,077円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	124,835,624円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	424,990,100円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	576,665,560円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　Ｓｅｌｅｃｔ　全世界株式インデックス	73,506,557円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　Ｓｅｌｅｃｔ　全世界株式インデックス（除く日本）	35,299,036円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　ＤＣ　全世界株式インデックス	61,873円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　ＤＣ　全世界株式インデックス（除く日本）	65,301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）	2,213,341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）	10,341,888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）	92,804,192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）	96,602円
２．　計算日における受益権の総数	
	17,018,218,864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	1.7578円
(10,000口当たり純資産額)	(17,578円)

（注）※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

2023年12月20日現在
1．金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2．金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、株価変動リスク、リートの価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。 3．金融商品に係るリスク管理体制 運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

2023年12月20日現在
1．貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 2．時価の算定方法 株式、投資証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 デリバティブ取引 （その他の注記）の2　デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。 3．金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

2023年12月20日現在
該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1　有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2023年12月20日現在 損益に含まれた評価差額（円）
株式	△117,607,158
投資証券	4,757,377
合計	△112,849,781

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

2　デリバティブ取引に関する注記

(株式関連)

（2023年12月20日現在）　　（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 買建	1,622,194,766	－	1,662,694,562	40,499,796
合計		1,622,194,766	－	1,662,694,562	40,499,796

（注）時価の算定方法

先物取引

外国先物取引について

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

通 貨	銘 柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	29,100	1.55	45,134.10	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	1,600	0.00	0.00	
	SURGUTNEFTEGAS-SP ADR	13,769	0.00	0.00	
	TATNEFT PAO-SPONSORED ADR	4,090	0.00	0.00	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	5,573	13.94	77,687.62	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	11,117	0.00	0.00	
	NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR	2,773	0.00	0.00	
	PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	2,330	0.00	0.00	
	PHOSAGRO PJSC(BLOCKED)-GDR	15	0.00	0.00	
	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	5,948	0.00	0.00	
	POLYUS PJSC-REG S-GDR	1,288	0.00	0.00	
	SEVERSTAL - GDR REG S	3,862	0.00	0.00	
	SOUTHERN COPPER CORP	2,307	84.96	196,002.72	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	12,159	19.94	242,450.46	
	NIO INC - ADR	39,910	8.82	352,006.20	
	H WORLD GROUP LTD	5,970	34.65	206,860.50	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	12,989	12.45	161,713.05	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	11,763	41.33	486,164.79	
	AUTOHOME INC-ADR	2,118	27.46	58,160.28	
	IQIYI INC-ADR	13,465	4.70	63,285.50	
	JOYY INC	1,406	39.88	56,071.28	
	KANZHUN LTD	6,267	16.01	100,334.67	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	20,718	8.77	181,696.86	
	VK CO LTD	2,211	0.00	0.00	
	WEIBO CORP-SPON ADR	2,566	10.23	26,250.18	
	PDD HOLDINGS INC	16,997	150.09	2,551,079.73	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	9,598	16.63	159,614.74	
	X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	2,296	0.00	0.00	
	LEGEND BIOTECH CORP-ADR	2,140	61.76	132,166.40	
	COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	142,276	1.37	194,918.12	
	CREDICORP LTD	2,005	153.97	308,709.85	
	TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	2,188	0.00	0.00	
	LUFAX HOLDING LTD-ADR	7,328	3.00	21,984.00	
	QIFU TECHNOLOGY INC	3,164	14.57	46,099.48	
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	14,388	1.89	27,322.81	

	DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	1,554	24.32	37,793.28	
	KE HOLDINGS INC	18,894	15.67	296,068.98	
米ドル 小計		438,142		6,029,575.60 (868,439,773)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-CPO	419,000	13.60	5,698,400.00	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	90,000	90.41	8,136,900.00	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	5,350	247.30	1,323,055.00	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	27,700	38.61	1,069,497.00	
	ALFA S.A.B.-A	87,800	13.97	1,226,566.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	14,500	179.07	2,596,515.00	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	11,960	304.87	3,646,245.20	
	GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	5,295	507.41	2,686,735.95	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL CENT	8,600	182.83	1,572,338.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	5,980	183.51	1,097,389.80	
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	150,100	71.51	10,733,651.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	13,400	188.35	2,523,890.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	14,350	168.31	2,415,248.50	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	55,800	225.97	12,609,126.00	
	GRUMA S.A.B.-B	5,455	314.15	1,713,688.25	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	37,700	87.39	3,294,603.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	40,200	37.03	1,488,606.00	
	BANCO DEL BAJIO SA	22,200	56.47	1,253,634.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	74,300	174.03	12,930,429.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	54,000	45.55	2,459,700.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	520,700	15.91	8,284,337.00	
メキシコペソ 小計		1,664,390		88,760,554.70 (749,005,940)	
ブラジルレアル	COSAN SA	34,500	18.74	646,530.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	106,300	38.04	4,043,652.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	135,900	36.25	4,926,375.00	
	PRIO SA	22,200	46.71	1,036,962.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	20,900	26.03	544,027.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	17,000	18.70	317,900.00	
	GERDAU SA-PREF	31,695	22.96	727,717.20	
	KLABIN SA - UNIT	22,300	21.28	474,544.00	
	SUZANO SA	21,307	52.97	1,128,631.79	
	VALE SA	97,104	74.73	7,256,581.92	
	WEG SA	48,300	36.42	1,759,086.00	
	CCR SA	26,700	14.53	387,951.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	26,510	64.35	1,705,918.50	
	RUMO SA	36,000	22.40	806,400.00	
	LOJAS RENNER S.A.	30,720	17.34	532,684.80	
	MAGAZINE LUIZA SA	86,300	2.16	186,408.00	

	VIBRA ENERGIA SA	33,500	21.82	730,970.00	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	19,100	12.00	229,200.00	
	RAIA DROGASIL SA	37,676	29.33	1,105,037.08	
	SENDAS DISTRIBUIDORA SA	41,700	13.40	558,780.00	
	AMBEV SA	136,000	14.70	1,999,200.00	
	JBS SA	21,300	24.22	515,886.00	
	NATURA &CO HOLDING SA	28,800	16.60	478,080.00	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	150,892	4.46	672,978.32	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	14,200	28.21	400,582.00	
	HYPERA SA	9,800	36.37	356,426.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	42,615	15.69	668,629.35	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	151,936	17.55	2,666,476.80	
	BANCO DO BRASIL S.A.	23,900	54.85	1,310,915.00	
	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	8,100	31.92	258,552.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	138,200	32.91	4,548,162.00	
	ITAUSA SA	162,928	10.12	1,648,831.36	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	168,300	14.55	2,448,765.00	
	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	32,400	37.06	1,200,744.00	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	18,600	33.37	620,682.00	
	TOTVS SA	16,400	34.45	564,980.00	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	11,000	53.57	589,270.00	
	TIM SA	24,000	18.16	435,840.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	7,100	46.64	331,144.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	33,300	41.90	1,395,270.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	44,134	11.69	515,926.46	
	CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	28,200	10.03	282,846.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	10,300	72.78	749,634.00	
	CPFL ENERGIA SA	7,200	38.68	278,496.00	
	ENERGISA SA-UNITS	6,100	52.15	318,115.00	
	ENEVA SA	22,700	13.53	307,131.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	6,275	44.10	276,727.50	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	28,200	34.78	980,796.00	
ブラジルレアル 小計		2,248,592		55,926,442.08 (1,654,986,459)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	12,153	6,305.30	76,628,310.90	
	EMPRESAS CMPC SA	33,869	1,667.80	56,486,718.20	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	3,822	49,812.00	190,381,464.00	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES	466,759	54.50	25,438,365.50	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	5,527,400	8.86	49,016,983.20	
	FALABELLA SA	29,867	2,269.00	67,768,223.00	
	CENCOSUD SA	35,890	1,670.00	59,936,300.00	
	BANCO DE CHILE	1,244,596	99.40	123,712,842.40	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	2,535	23,430.00	59,395,050.00	

	BANCO SANTANDER CHILE	1,641,012	42.63	69,956,341.56	
	ENEL AMERICAS SA	517,290	96.50	49,918,485.00	
	ENEL CHILE SA	827,632	58.55	48,457,853.60	
チリペソ 小計		10,342,825		877,096,937.36 (146,333,098)	
コロンビアペソ	BANCOLOMBIA SA	6,380	31,980.00	204,032,400.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	13,694	28,860.00	395,208,840.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	12,989	15,160.00	196,913,240.00	
コロンビアペソ 小計		33,063		796,154,480.00 (29,132,088)	
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	2,267	24.58	55,722.86	
	MYTILINEOS S.A.	3,099	36.90	114,353.10	
	OPAP SA	4,870	15.25	74,267.50	
	JUMBO SA	2,974	24.50	72,863.00	
	ALPHA SERVICES AND HOLDINGS	65,690	1.55	101,918.03	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	74,565	1.66	123,777.90	
	NATIONAL BANK OF GREECE	21,028	6.46	135,840.88	
	PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS S	20,288	3.30	66,950.40	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	6,206	12.80	79,436.80	
	PUBLIC POWER CORP	5,654	11.22	63,437.88	
ユーロ 小計		206,641		888,568.35 (140,455,999)	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	27,711	147.30	4,081,830.30	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	34,746	43.26	1,503,111.96	
	HEKTAS TICARET T.A.S	35,672	22.46	801,193.12	
	KOZA ALTIN ISLETMELERI AS	25,931	20.40	528,992.40	
	SASA POLYESTER SANAYI	43,418	40.46	1,756,692.28	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	45,551	48.40	2,204,668.40	
	KOC HOLDING AS	21,761	143.50	3,122,703.50	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	37,427	47.42	1,774,788.34	
	PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS	1,253	666.50	835,124.50	
	TURK HAVA YOLLARI AO	16,774	245.30	4,114,662.20	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	1,780	769.00	1,368,820.00	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	3,208	220.00	705,760.00	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	13,195	305.25	4,027,773.75	
	AKBANK T.A.S.	83,796	38.88	3,257,988.48	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	30,648	63.55	1,947,680.40	
	TURKIYE IS BANKASI-C	90,125	23.82	2,146,777.50	
	YAPI VE KREDI BANKASI	92,810	20.64	1,915,598.40	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	31,132	54.50	1,696,694.00	
トルコリラ 小計		636,938		37,790,859.53 (187,181,906)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	2,117	705.00	1,492,485.00	

	MONETA MONEY BANK AS	12,265	91.40	1,121,021.00	
	CEZ AS	4,323	925.00	3,998,775.00	
チェココルナ 小計		18,705		6,612,281.00 (42,599,620)	
ハンガリーフォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	11,609	2,830.00	32,853,470.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	3,960	8,800.00	34,848,000.00	
	OTP BANK PLC	6,919	15,990.00	110,634,810.00	
ハンガリーフォリント 小計		22,488		178,336,280.00 (73,273,562)	
ポーランドズロチ	ORLEN SA	15,983	63.14	1,009,166.62	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	3,988	126.10	502,886.80	
	BUDIMEX	397	615.00	244,155.00	
	LPP SA	32	16,530.00	528,960.00	
	CD PROJEKT SA	1,602	116.50	186,633.00	
	CYFROWY POLSAT SA	8,679	12.96	112,479.84	
	ALLEGRO.EU SA	15,711	33.66	528,910.81	
	PEPCO GROUP NV	5,086	26.84	136,508.24	
	DINO POLSKA SA	1,364	463.70	632,486.80	
	BANK PEKAO SA	5,176	150.85	780,799.60	
	MBANK SA	464	550.80	255,571.20	
	PKO BANK POLSKI SA	25,162	50.78	1,277,726.36	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	977	503.00	491,431.00	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	17,639	47.11	830,973.29	
	PGE SA	29,021	8.67	251,612.07	
ポーランドズロチ 小計		131,281		7,770,300.63 (283,880,940)	
ロシアルーブル	GAZPROM PJSC	209,472	0.00	0.00	
	LUKOIL PJSC	7,345	0.00	0.00	
	ROSNEFT OIL CO PJSC	20,180	0.00	0.00	
	SURGUTNEFTEGAS-PREFERENCE	131,600	0.00	0.00	
	ALROSA PJSC	46,260	0.00	0.00	
	UNITED CO RUSAL INTERNATIONA	55,000	0.00	0.00	
	YANDEX NV-A	5,354	0.00	0.00	
	OZON HOLDINGS PLC - ADR	920	0.00	0.00	
	MAGNIT PJSC	1,334	0.00	0.00	
	SBERBANK OF RUSSIA PJSC	190,680	0.00	0.00	
	VTB BANK PJSC	65,736,000	0.00	0.00	
	MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ	22,980	0.00	0.00	
	MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JO	16,768	0.00	0.00	
	INTER RAO UES PJSC	725,000	0.00	0.00	
ロシアルーブル 小計		67,168,893		0.00 (0)	
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO-H	58,000	6.64	385,120.00	

CHINA OILFIELD SERVICES-H	50,000	7.83	391,500.00	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	704,000	3.90	2,745,600.00	
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	96,000	25.10	2,409,600.00	
COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	38,000	7.17	272,460.00	
PETROCHINA CO LTD-H	600,000	4.89	2,934,000.00	
YANKUANG ENERGY GROUP CO-H	63,000	14.46	910,980.00	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	110,000	3.51	386,100.00	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	34,500	17.12	590,640.00	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	64,500	5.98	385,710.00	
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	126,000	3.13	394,380.00	
CMOC GROUP LTD-H	105,000	3.88	407,400.00	
GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD-H	11,440	27.05	309,452.00	
JIANGXI COPPER CO LTD-H	31,000	10.24	317,440.00	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	42,000	3.82	160,440.00	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	20,500	14.20	291,100.00	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	39,000	9.04	352,560.00	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	152,000	11.94	1,814,880.00	
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	83,000	3.22	267,260.00	
BOC AVIATION LTD	6,100	58.85	358,985.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	68,000	3.20	217,600.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	113,000	3.26	368,380.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	58,000	8.57	497,060.00	
CITIC LTD	165,000	7.38	1,217,700.00	
CRRC CORP LTD - H	118,000	3.26	384,680.00	
FOSUN INTERNATIONAL LTD	72,500	4.32	313,200.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	17,000	17.82	302,940.00	
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	37,000	7.10	262,700.00	
SINOTRUK HONG KONG LTD	22,500	14.30	321,750.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	55,000	12.98	713,900.00	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	13,800	21.15	291,870.00	
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL LIMITED	122,000	2.38	290,360.00	
AIR CHINA LTD-H	42,000	4.79	201,180.00	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	40,000	10.14	405,600.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	46,000	3.19	146,740.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	83,700	7.63	638,631.00	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	46,000	5.46	251,160.00	
JD LOGISTICS INC	52,200	9.10	475,020.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	42,000	6.90	289,800.00	
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	3,500	106.60	373,100.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	58,000	5.16	299,280.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	84,000	3.91	328,440.00	
BYD CO LTD-H	29,500	201.80	5,953,100.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	70,000	3.64	254,800.00	

FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	16,400	36.95	605,980.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	175,000	7.90	1,382,500.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	64,000	9.95	636,800.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	92,000	3.37	310,040.00	
LI AUTO INC-CLASS A	32,688	135.40	4,425,955.20	
MINTH GROUP LTD	22,000	15.08	331,760.00	
XPENG INC-CLASS A SHARES	30,664	56.90	1,744,781.60	
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	38,000	13.56	515,280.00	
ZHEJIANG LEAPMOTOR TECHNOLOG	14,000	37.00	518,000.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	36,200	73.00	2,642,600.00	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	110,000	3.43	377,300.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	66,600	20.85	1,388,610.00	
LI NING CO LTD	69,000	18.88	1,302,720.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	23,500	83.85	1,970,475.00	
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	41,500	4.34	180,110.00	
EAST BUY HOLDING LTD	14,500	31.80	461,100.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	49,000	13.82	677,180.00	
MEITUAN	144,210	78.45	11,313,274.50	
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	41,510	59.60	2,473,996.00	
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LT	34,800	14.26	496,248.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	25,000	12.82	320,500.00	
TRIP.COM GROUP LTD	15,610	264.60	4,130,406.00	
BAIDU INC-CLASS A	63,980	109.30	6,993,014.00	
BILIBILI INC-CLASS Z	5,877	88.90	522,465.30	
CHINA LITERATURE LTD	12,200	28.70	350,140.00	
CHINA RUYI HOLDINGS LIMITED	180,000	1.81	325,800.00	
KINGSOFT CORP LTD	27,200	24.40	663,680.00	
KUAISHOU TECHNOLOGY	66,100	54.80	3,622,280.00	
NETEASE INC	54,900	161.50	8,866,350.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	189,500	311.80	59,086,100.00	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	462,740	71.65	33,155,321.00	
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-H	3,200	68.85	220,320.00	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	57,400	10.94	627,956.00	
JD.COM INC - CL A	66,760	102.70	6,856,252.00	
MINISO GROUP HOLDING LTD	10,892	37.85	412,262.20	
POP MART INTERNATIONAL GROUP	15,000	19.98	299,700.00	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	50,000	5.92	296,000.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	23,000	16.96	390,080.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	150,000	4.14	621,000.00	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	31,500	37.80	1,190,700.00	
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	15,000	17.40	261,000.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	3,100	111.00	344,100.00	
CHINA FEIHE LTD	115,000	4.17	479,550.00	

CHINA MENGNIU DAIRY CO	91,000	20.45	1,860,950.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	46,000	33.00	1,518,000.00	
NONGFU SPRING CO LTD-H	57,400	45.00	2,583,000.00	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	60,000	6.38	382,800.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	60,000	8.97	538,200.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	18,000	48.40	871,200.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	47,000	5.31	249,570.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	143,000	4.65	664,950.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	17,500	28.25	494,375.00	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	9,000	22.85	205,650.00	
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	10,800	35.85	387,180.00	
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	24,200	7.98	193,116.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	77,200	7.26	560,472.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	21,500	10.56	227,040.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	36,800	18.62	685,216.00	
3SBIO INC	52,500	6.94	364,350.00	
AKESO INC	15,000	44.45	666,750.00	
BEIGENE LTD	19,696	108.60	2,138,985.60	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	40,000	13.62	544,800.00	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	43,500	4.71	204,885.00	
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	90,000	3.95	355,500.00	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	258,000	6.90	1,780,200.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	36,000	20.25	729,000.00	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	32,000	15.02	480,640.00	
INNOVENT BIOLOGICS INC	35,000	40.60	1,421,000.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	14,000	16.18	226,520.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	307,250	3.12	958,620.00	
WUXI APPTEC CO LTD-H	10,168	77.20	784,969.60	
WUXI BIOLOGICS (CAYMAN) INC.	109,000	28.40	3,095,600.00	
ZAI LAB LTD	27,130	23.45	636,198.50	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	772,000	2.91	2,246,520.00	
BANK OF CHINA LTD-H	2,256,000	2.89	6,519,840.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	232,000	4.63	1,074,160.00	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	245,000	3.53	864,850.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	2,732,000	4.49	12,266,680.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	69,000	2.22	153,180.00	
CHINA MERCHANTS BANK-H	110,500	25.25	2,790,125.00	
CHINA MINSHENG BANKING-H	171,600	2.57	441,012.00	
IND & COMM BK OF CHINA-H	1,849,000	3.67	6,785,830.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	214,000	3.59	768,260.00	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	250,000	0.74	185,000.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	101,000	3.94	397,940.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	38,800	10.58	410,504.00	

CITIC SECURITIES CO LTD-H	53,000	15.46	819,380.00	
FAR EAST HORIZON LTD	64,000	6.15	393,600.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	26,800	9.08	243,344.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	65,200	4.04	263,408.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	35,800	9.68	346,544.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	212,000	9.65	2,045,800.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	71,200	14.52	1,033,824.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	43,000	6.34	272,620.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	25,800	14.22	366,876.00	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	224,000	2.33	521,920.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	198,000	8.82	1,746,360.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	190,500	33.05	6,296,025.00	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	19,800	17.36	343,728.00	
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	80,000	6.05	484,000.00	
GDS HOLDINGS LTD-CL A	25,524	8.30	211,849.20	
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	78,000	10.12	789,360.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	22,500	24.00	540,000.00	
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	22,000	32.80	721,600.00	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	19,000	18.32	348,080.00	
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	24,000	6.74	161,760.00	
LENOVO GROUP LTD	208,000	10.26	2,134,080.00	
SUNNY OPTICAL TECH	20,800	71.45	1,486,160.00	
XIAOMI CORP-CLASS B	436,600	16.14	7,046,724.00	
ZTE CORP-H	18,800	16.64	312,832.00	
CHINA TOWER CORP LTD-H	1,178,000	0.82	965,960.00	
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	14,500	25.85	374,825.00	
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	122,000	1.58	192,760.00	
CGN POWER CO LTD-H	285,000	1.94	552,900.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	78,000	7.09	553,020.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	88,000	5.78	508,640.00	
CHINA POWER INTERNATIONAL	158,000	2.78	439,240.00	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	28,200	24.10	679,620.00	
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	52,000	15.10	785,200.00	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	23,000	52.90	1,216,700.00	
GUANGDONG INVESTMENT LTD	92,000	5.28	485,760.00	
HUANENG POWER INTL INC-H	114,000	4.03	459,420.00	
KUNLUN ENERGY CO LTD	118,000	6.65	784,700.00	
FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	11,000	10.88	119,680.00	
GCL TECHNOLOGY HOLDINGS LTD	658,000	1.08	710,640.00	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	16,000	17.80	284,800.00	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	150,000	4.08	612,000.00	
C&D INTERNATIONAL INVESTMENT	26,000	15.38	399,880.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	111,500	13.40	1,494,100.00	

	CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	40,000	5.60	224,000.00	
	CHINA RESOURCES LAND LTD	96,000	26.90	2,582,400.00	
	CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	18,800	25.45	478,460.00	
	CHINA VANKE CO LTD-H	76,300	6.98	532,574.00	
	LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	66,000	12.10	798,600.00	
	YUEXIU PROPERTY CO LTD	50,800	6.26	318,008.00	
香港ドル 小計		23,357,239		300,871,684.70 (5,557,100,016)	
マレーシアリンギット	DIALOG GROUP BHD	95,700	1.98	189,486.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	10,900	22.12	241,108.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	79,900	7.09	566,491.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	102,800	4.88	501,664.00	
	GAMUDA BHD	49,000	4.61	225,890.00	
	SIME DARBY BERHAD	99,700	2.43	242,271.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	28,000	7.44	208,320.00	
	MISC BHD	36,800	7.30	268,640.00	
	GENTING BHD	57,900	4.64	268,656.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	91,400	2.70	246,780.00	
	MR DIY GROUP M BHD	92,550	1.48	136,974.00	
	IOI CORP BHD	69,200	3.97	274,724.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	16,500	21.50	354,750.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	1,800	119.90	215,820.00	
	PPB GROUP BERHAD	16,120	14.58	235,029.60	
	QL RESOURCES BHD	30,350	5.78	175,423.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	63,000	4.50	283,500.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	59,200	5.99	354,608.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	64,100	4.07	260,887.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	172,800	5.96	1,029,888.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	16,200	19.48	315,576.00	
	MALAYAN BANKING BHD	156,700	8.98	1,407,166.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	419,100	4.34	1,818,894.00	
	RHB BANK BHD	39,200	5.53	216,776.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	72,600	2.41	174,966.00	
	CELCOMDIGI BHD	90,500	4.12	372,860.00	
	MAXIS BHD	64,700	3.86	249,742.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	36,600	5.44	199,104.00	
	PETRONAS GAS BHD	22,900	17.62	403,498.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	71,400	10.00	714,000.00	
	INARI AMERTRON BHD	74,800	2.98	222,904.00	
マレーシアリンギット 小計		2,302,420		12,376,395.60 (382,461,565)	
タイバーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	303,700	6.40	1,943,680.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	37,900	147.50	5,590,250.00	

	PTT PCL-NVDR	289,900	35.75	10,363,925.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	31,600	53.25	1,682,700.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	53,800	26.00	1,398,800.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	75,500	39.75	3,001,125.00	
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	32,200	36.50	1,175,300.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	21,700	296.00	6,423,200.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	115,700	60.25	6,970,925.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	234,600	8.05	1,888,530.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	207,000	7.10	1,469,700.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	190,600	3.56	678,536.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	95,600	27.00	2,581,200.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	45,225	39.75	1,797,693.75	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	204,100	11.70	2,387,970.00	
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	85,300	20.00	1,706,000.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	36,100	25.00	902,500.00	
	CP ALL PCL-NVDR	157,200	54.25	8,528,100.00	
	CP AXTRA PCL-NVDR	59,000	25.50	1,504,500.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	132,600	18.40	2,439,840.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	31,400	21.50	675,100.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	307,300	25.75	7,912,975.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	16,900	218.00	3,684,200.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	19,100	130.50	2,492,550.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	84,100	18.40	1,547,440.00	
	SCB X PCL-NVDR	21,200	102.50	2,173,000.00	
	TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR	685,400	1.57	1,076,078.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	38,400	46.00	1,766,400.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	16,300	43.50	709,050.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	84,500	90.25	7,626,125.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	33,100	219.00	7,248,900.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	28,600	71.25	2,037,750.00	
	TRUE CORP PCL/NEW-NVDR	327,315	5.05	1,652,940.75	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	48,000	44.25	2,124,000.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	21,300	48.25	1,027,725.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	81,400	45.25	3,683,350.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	57,400	66.75	3,831,450.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	298,900	7.70	2,301,530.00	
タイバーツ 小計		4,609,940		118,005,038.50 (486,180,758)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	51,250	49.10	2,516,375.00	
	AYALA CORPORATION	7,910	715.00	5,655,650.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	72,731	41.45	3,014,699.95	
	SM INVESTMENTS CORP	6,870	903.50	6,207,045.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	32,380	246.00	7,965,480.00	

	JOLLIBEE FOODS CORP	11,290	247.80	2,797,662.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	24,530	118.00	2,894,540.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	54,578	104.00	5,676,112.00	
	BDO UNIBANK INC	65,396	131.00	8,566,876.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	45,472	50.95	2,316,798.40	
	PLDT INC	2,745	1,285.00	3,527,325.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	7,490	383.00	2,868,670.00	
	AYALA LAND INC	181,100	34.35	6,220,785.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	301,900	33.90	10,234,410.00	
フィリピンペソ 小計		865,642		70,462,428.35 (181,328,013)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY TBK PT	355,100	2,600.00	923,260,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	45,500	21,825.00	993,037,500.00	
	AMMAN MINERAL INTERNASIONAL	187,400	6,475.00	1,213,415,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK	175,600	1,640.00	287,984,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	909,184	1,570.00	1,427,418,880.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	89,700	7,925.00	710,872,500.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	292,209	2,290.00	669,158,610.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	101,289	6,175.00	625,459,575.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	564,100	5,625.00	3,173,062,500.00	
	GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT	22,100,000	87.00	1,922,700,000.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	556,700	2,820.00	1,569,894,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESI PT	181,300	5,075.00	920,097,500.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	75,400	10,575.00	797,355,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	117,600	6,325.00	743,820,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	202,200	3,430.00	693,546,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	526,300	1,660.00	873,658,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	1,578,700	9,250.00	14,602,975,000.00	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	1,064,300	5,975.00	6,359,192,500.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	414,600	5,200.00	2,155,920,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	1,941,845	5,550.00	10,777,239,750.00	
	SARANA MENARA NUSANTARA PT	685,000	970.00	664,450,000.00	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	1,418,100	3,970.00	5,629,857,000.00	
インドネシアルピア 小計		33,582,127		57,734,373,315.00 (536,929,671)	
韓国ウォン	HD HYUNDAI	1,185	61,900.00	73,351,500.00	
	S-OIL CORP	1,463	69,300.00	101,385,900.00	
	SK INNOVATION CO LTD	1,664	138,800.00	230,963,200.00	
	ECOPRO CO LTD	583	733,000.00	427,339,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORP	2,898	34,650.00	100,415,700.00	
	HYUNDAI STEEL CO	2,249	34,700.00	78,040,300.00	
	KOREA ZINC CO LTD	231	495,500.00	114,460,500.00	
	KUM YANG CO LTD	942	115,900.00	109,177,800.00	

KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	458	138,100.00	63,249,800.00	
LG CHEM LTD	1,429	502,000.00	717,358,000.00	
LG CHEM LTD-PREFERENCE	197	318,500.00	62,744,500.00	
LOTTE CHEMICAL CORP	484	156,100.00	75,552,400.00	
POSCO HOLDINGS INC	2,056	496,000.00	1,019,776,000.00	
SK IE TECHNOLOGY CO LTD	775	80,700.00	62,542,500.00	
SKC CO LTD	602	91,000.00	54,782,000.00	
DOOSAN BOBCAT INC	1,487	46,300.00	68,848,100.00	
DOOSAN ENERBILITY	13,577	15,680.00	212,887,360.00	
ECOPRO BM CO LTD	1,314	318,000.00	417,852,000.00	
GS HOLDINGS	1,411	41,950.00	59,191,450.00	
HANWHA AEROSPACE CO LTD	957	125,900.00	120,486,300.00	
HANWHA OCEAN CO LTD	1,265	25,500.00	32,257,500.00	
HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	607	120,000.00	72,840,000.00	
HD KOREA SHIPBUILDING & OFFS	1,242	110,700.00	137,489,400.00	
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	2,000	34,700.00	69,400,000.00	
HYUNDAI MIPO DOCKYARD	517	78,100.00	40,377,700.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	1,854	48,100.00	89,177,400.00	
LG CORP	2,799	86,000.00	240,714,000.00	
LG ENERGY SOLUTION	1,342	426,000.00	571,692,000.00	
POSCO FUTURE M CO LTD	857	360,500.00	308,948,500.00	
POSCO INTERNATIONAL CORP	1,476	59,400.00	87,674,400.00	
SAMSUNG C&T CORP	2,417	128,300.00	310,101,100.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	4,565	27,200.00	124,168,000.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	19,155	7,560.00	144,811,800.00	
SK	1,030	175,700.00	180,971,000.00	
SK SQUARE CO LTD	3,018	49,850.00	150,447,300.00	
HMM CO LTD	6,429	18,430.00	118,486,470.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	524	179,800.00	94,215,200.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	4,956	23,450.00	116,218,200.00	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	1,948	46,100.00	89,802,800.00	
HANON SYSTEMS	6,426	6,970.00	44,789,220.00	
HYUNDAI MOBIS CO LTD	1,766	223,500.00	394,701,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	3,938	192,200.00	756,883,600.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	870	111,700.00	97,179,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	533	110,300.00	58,789,900.00	
KIA CORP	7,494	89,300.00	669,214,200.00	
COWAY CO LTD	1,442	56,000.00	80,752,000.00	
F&F CO LTD / NEW	518	89,100.00	46,153,800.00	
LG ELECTRONICS INC	2,914	98,300.00	286,446,200.00	
KANGWON LAND INC	3,072	16,500.00	50,688,000.00	
HYBE CO LTD	525	239,000.00	125,475,000.00	
JYP ENTERTAINMENT CORP	810	104,400.00	84,564,000.00	

KAKAO CORP	8,983	53,800.00	483,285,400.00	
KRAFTON INC	872	209,000.00	182,248,000.00	
NAVER CORP	3,743	222,500.00	832,817,500.00	
NCSOFT CORP	383	241,500.00	92,494,500.00	
NETMARBLE CORPORATION	904	54,900.00	49,629,600.00	
PEARL ABYSS CORP	960	39,500.00	37,920,000.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	885	65,700.00	58,144,500.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	221	316,500.00	69,946,500.00	
KT&G CORP	3,047	91,200.00	277,886,400.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	591	110,700.00	65,423,700.00	
AMOREPACIFIC CORP	788	135,400.00	106,695,200.00	
LG H&H	260	358,500.00	93,210,000.00	
HLB INC	3,131	49,200.00	154,045,200.00	
CELLTRION INC	4,583	180,700.00	828,148,100.00	
CELLTRION PHARM INC	355	90,900.00	32,269,500.00	
HANMI PHARM CO LTD	214	330,000.00	70,620,000.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	514	704,000.00	361,856,000.00	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	783	91,100.00	71,331,300.00	
SK BIOSCIENCE CO LTD	710	69,000.00	48,990,000.00	
YUHAN CORP	1,526	65,400.00	99,800,400.00	
HANA FINANCIAL GROUP	7,972	42,200.00	336,418,400.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	8,613	11,750.00	101,202,750.00	
KAKAOBANK CORP	5,191	26,250.00	136,263,750.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	10,975	52,000.00	570,700,000.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	12,152	38,450.00	467,244,400.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	17,430	12,900.00	224,847,000.00	
KAKAOPAY CORP	730	47,650.00	34,784,500.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	1,162	62,700.00	72,857,400.00	
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	3,040	57,000.00	173,280,000.00	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	5,653	7,410.00	41,888,730.00	
NH INVESTMENT & SECURITIES C	5,547	10,220.00	56,690,340.00	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	1,943	40,050.00	77,817,150.00	
DB INSURANCE CO LTD	1,260	81,600.00	102,816,000.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	856	252,000.00	215,712,000.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	2,205	70,400.00	155,232,000.00	
POSCO DX CO LTD	1,565	51,700.00	80,910,500.00	
SAMSUNG SDS CO LTD	1,032	166,700.00	172,034,400.00	
COSMOAM&T CO LTD	779	153,500.00	119,576,500.00	
L&F CO LTD	821	190,700.00	156,564,700.00	
LG DISPLAY CO LTD	5,817	11,830.00	68,815,110.00	
LG INNOTEK CO LTD	384	237,000.00	91,008,000.00	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	1,693	149,800.00	253,611,400.00	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	135,822	73,400.00	9,969,334,800.00	

	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	23,505	58,600.00	1,377,393,000.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	1,579	450,500.00	711,339,500.00	
	KT CORP	1,598	35,650.00	56,968,700.00	
	LG UPLUS CORP	6,485	10,290.00	66,730,650.00	
	SK TELECOM	1,621	49,900.00	80,887,900.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	7,197	18,630.00	134,080,110.00	
	HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD	1,237	58,900.00	72,859,300.00	
	SK HYNIX INC	15,560	138,200.00	2,150,392,000.00	
韓国ウォン 小計		449,148		32,192,855,790.00 (3,566,968,421)	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	31,000	82.50	2,557,500.00	
	ASIA CEMENT CORP	69,000	40.80	2,815,200.00	
	CHINA STEEL CORP	344,000	26.65	9,167,600.00	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	98,000	62.80	6,154,400.00	
	FORMOSA PLASTICS CORP	110,000	79.80	8,778,000.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	137,000	66.60	9,124,200.00	
	TAIWAN CEMENT	201,917	34.35	6,935,848.95	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	4,200	988.00	4,149,600.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	92,000	31.45	2,893,400.00	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	2,000	1,630.00	3,260,000.00	
	WALSIN LIHWA CORP	74,000	39.20	2,900,800.00	
	CHINA AIRLINES LTD	75,000	20.70	1,552,500.00	
	EVA AIRWAYS CORP	86,000	30.15	2,592,900.00	
	EVERGREEN MARINE CORP LTD	27,420	147.00	4,030,740.00	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	55,000	30.15	1,658,250.00	
	WAN HAI LINES LTD	18,650	52.30	975,395.00	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	57,000	49.30	2,810,100.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	53,000	46.25	2,451,250.00	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	5,420	572.00	3,100,240.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	15,289	178.00	2,721,442.00	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	5,000	361.50	1,807,500.00	
	POU CHEN	61,000	31.90	1,945,900.00	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	8,160	700.00	5,712,000.00	
	MOMO.COM INC	2,200	508.00	1,117,600.00	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	16,000	267.50	4,280,000.00	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	140,000	73.80	10,332,000.00	
	PHARMAESSENTIA CORP	7,000	331.50	2,320,500.00	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	155,046	17.60	2,728,809.60	
	CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	503,000	28.25	14,209,750.00	
	E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	407,197	25.50	10,383,523.50	
	FIRST FINANCIAL HOLDING CO	315,723	27.20	8,587,665.60	
	HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	259,430	22.20	5,759,346.00	
	MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	321,502	39.15	12,586,803.30	

SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	282,350	19.50	5,505,825.00	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	333,055	17.75	5,911,726.25	
TAIWAN BUSINESS BANK	176,128	13.65	2,404,147.20	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	284,978	26.70	7,608,912.60	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	106,000	45.40	4,812,400.00	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	42,009	186.50	7,834,678.50	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	282,208	26.70	7,534,953.60	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	274,000	44.90	12,302,600.00	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	479,000	12.35	5,915,650.00	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	223,766	63.90	14,298,647.40	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	366,835	8.68	3,184,127.80	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	14,000	512.00	7,168,000.00	
ACER INC	78,000	40.70	3,174,600.00	
ADVANTECH CO LTD	12,427	360.50	4,479,933.50	
ASUSTEK COMPUTER INC	20,000	424.50	8,490,000.00	
AUO CORP	176,200	16.00	2,819,200.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	16,000	190.00	3,040,000.00	
COMPAL ELECTRONICS	121,000	34.00	4,114,000.00	
DELTA ELECTRONICS INC	56,000	302.50	16,940,000.00	
E INK HOLDINGS INC	24,000	177.00	4,248,000.00	
GIGABYTE TECHNOLOGY CO LTD	14,000	260.00	3,640,000.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	355,800	102.50	36,469,500.00	
INNOLUX CORP	241,751	12.30	2,973,537.30	
INVENTEC CORP	73,000	45.05	3,288,650.00	
LARGAN PRECISION CO LTD	2,900	2,690.00	7,801,000.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	56,000	112.50	6,300,000.00	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	21,000	181.50	3,811,500.00	
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	6,000	244.50	1,467,000.00	
PEGATRON CORP	56,000	85.00	4,760,000.00	
QUANTA COMPUTER INC	77,000	203.50	15,669,500.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	34,000	68.70	2,335,800.00	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	41,000	174.50	7,154,500.00	
WISTRON CORP	73,000	92.00	6,716,000.00	
WIWYNN CORP	2,500	1,690.00	4,225,000.00	
WPG HOLDINGS LTD	47,960	81.20	3,894,352.00	
YAGEO CORPORATION	10,524	616.00	6,482,784.00	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	18,000	107.50	1,935,000.00	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	109,000	118.50	12,916,500.00	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	44,000	80.40	3,537,600.00	
TAIWAN MOBILE CO LTD	47,000	98.00	4,606,000.00	
ALCHIP TECHNOLOGIES LTD	2,000	3,310.00	6,620,000.00	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	88,000	131.50	11,572,000.00	
EMEMORY TECHNOLOGY INC	1,800	2,355.00	4,239,000.00	

	GLOBAL UNICHIP CORP	2,300	1,705.00	3,921,500.00	
	GLOBALWAFERS CO LTD	6,000	615.00	3,690,000.00	
	MEDIATEK INC	42,800	992.00	42,457,600.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	39,000	73.10	2,850,900.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS COR	16,000	510.00	8,160,000.00	
	PARADE TECHNOLOGIES LTD	2,000	1,175.00	2,350,000.00	
	POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU	96,000	28.80	2,764,800.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	14,000	474.00	6,636,000.00	
	SILERGY CORP	8,640	403.50	3,486,240.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	700,000	585.00	409,500,000.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	322,000	50.00	16,100,000.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	29,000	77.20	2,238,800.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	99,000	27.85	2,757,150.00	
	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	44,647	36.45	1,627,383.15	
新台湾ドル 小計		9,968,732		965,143,762.25 (4,428,465,638)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	19,660	449.75	8,842,085.00	
	COAL INDIA LTD	42,402	366.95	15,559,413.90	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	14,851	380.60	5,652,290.60	
	INDIAN OIL CORP LTD	70,217	124.70	8,756,059.90	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	90,913	200.30	18,209,873.90	
	PETRONET LNG LTD	18,996	216.10	4,105,035.60	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	86,649	2,558.10	221,656,806.90	
	AMBUJA CEMENTS LTD	17,208	522.35	8,988,598.80	
	APL APOLLO TUBES LTD	4,859	1,599.15	7,770,269.85	
	ASIAN PAINTS LTD	11,022	3,336.05	36,769,943.10	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	7,891	593.25	4,681,335.75	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	7,281	2,118.25	15,422,978.25	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	36,283	564.85	20,494,452.55	
	JINDAL STEEL & POWER LTD	10,594	729.40	7,727,263.60	
	JSW STEEL LTD	17,850	858.70	15,327,795.00	
	PI INDUSTRIES LTD	2,601	3,393.95	8,827,663.95	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	4,189	2,648.75	11,095,613.75	
	SHREE CEMENT LTD	251	28,585.95	7,175,073.45	
	SRF LTD	4,133	2,430.15	10,043,809.95	
	SUPREME INDUSTRIES LTD	1,757	4,431.60	7,786,321.20	
	TATA STEEL LTD	211,331	135.40	28,614,217.40	
	ULTRATECH CEMENT LTD	3,324	10,017.10	33,296,840.40	
	UPL LTD	13,811	598.75	8,269,336.25	
	VEDANTA LTD	29,237	262.10	7,663,017.70	
	ABB INDIA LTD	1,585	4,838.95	7,669,735.75	
	ADANI ENTERPRISES LTD	4,823	2,941.25	14,185,648.75	
	ASHOK LEYLAND LTD	43,004	175.30	7,538,601.20	

ASTRAL LTD	3,580	1,908.85	6,833,683.00	
BHARAT ELECTRONICS LTD	102,464	173.05	17,731,395.20	
CG POWER AND INDUSTRIAL SOLU	15,444	455.80	7,039,375.20	
CUMMINS INDIA LTD	4,109	1,976.65	8,122,054.85	
HAVELLS INDIA LTD	7,120	1,372.40	9,771,488.00	
HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	5,829	2,787.45	16,248,046.05	
LARSEN & TOUBRO LTD	19,235	3,498.95	67,302,303.25	
POLYCAB INDIA LTD	1,305	5,610.90	7,322,224.50	
SIEMENS LTD	2,310	4,019.60	9,285,276.00	
SUZLON ENERGY LTD	270,753	37.50	10,153,237.50	
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	6,472	882.10	5,708,951.20	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	14,130	1,074.00	15,175,620.00	
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	7,859	860.40	6,761,883.60	
INTERGLOBE AVIATION LTD	3,501	2,984.65	10,449,259.65	
BAJAJ AUTO LTD	1,903	6,419.00	12,215,357.00	
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	2,334	2,509.60	5,857,406.40	
BHARAT FORGE LTD	8,017	1,220.90	9,787,955.30	
EICHER MOTORS LTD	3,761	4,039.65	15,193,123.65	
HERO MOTOCORP LTD	2,952	3,821.85	11,282,101.20	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	26,712	1,699.35	45,393,037.20	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	3,894	10,233.60	39,849,638.40	
MRF LTD	54	118,784.60	6,414,368.40	
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN	71,452	96.35	6,884,400.20	
SONA BLW PRECISION FORGINGS	10,800	560.35	6,051,780.00	
TATA MOTORS LTD	47,673	728.95	34,751,233.35	
TATA MOTORS LTD-A-DVR	13,696	488.30	6,687,756.80	
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LT	2,841	3,599.05	10,224,901.05	
TVS MOTOR CO LTD	7,088	1,968.70	13,954,145.60	
PAGE INDUSTRIES LTD	196	37,756.05	7,400,185.80	
TITAN CO LTD	10,189	3,610.45	36,786,875.05	
INDIAN HOTELS CO LTD	22,920	444.55	10,189,086.00	
JUBILANT FOODWORKS LTD	10,195	564.95	5,759,665.25	
ZOMATO LTD	151,450	130.25	19,726,362.50	
INFO EDGE INDIA LTD	1,911	5,206.85	9,950,290.35	
TRENT LTD	5,397	3,000.80	16,195,317.60	
AVENUE SUPERMARTS LTD	4,536	4,021.35	18,240,843.60	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	3,003	4,911.25	14,748,483.75	
ITC LTD	85,915	456.10	39,185,831.50	
MARICO LTD	15,967	547.85	8,747,520.95	
NESTLE INDIA LTD	940	25,489.70	23,960,318.00	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	15,548	966.15	15,021,700.20	
UNITED SPIRITS LTD	7,422	1,086.25	8,062,147.50	
VARUN BEVERAGES LTD	11,762	1,171.65	13,780,947.30	

COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	4,259	2,420.60	10,309,335.40	
DABUR INDIA LTD	17,113	548.20	9,381,346.60	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	11,134	1,050.35	11,694,596.90	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	23,519	2,560.70	60,225,103.30	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	2,793	5,555.50	15,516,511.50	
MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	23,433	664.00	15,559,512.00	
AUROBINDO PHARMA LTD	7,383	1,032.85	7,625,531.55	
CIPLA LTD	15,439	1,237.10	19,099,586.90	
DIVI'S LABORATORIES LTD	3,145	3,723.90	11,711,665.50	
DR. REDDY'S LABORATORIES	2,966	5,637.45	16,720,676.70	
LUPIN LTD	6,138	1,270.20	7,796,487.60	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	27,557	1,244.95	34,307,087.15	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	2,579	2,170.55	5,597,848.45	
AU SMALL FINANCE BANK LTD	5,313	731.30	3,885,396.90	
AXIS BANK LTD	65,042	1,120.25	72,863,300.50	
BANDHAN BANK LTD	19,777	248.55	4,915,573.35	
BANK OF BARODA	27,026	226.10	6,110,578.60	
HDFC BANK LIMITED	79,876	1,652.90	132,027,040.40	
ICICI BANK LTD	147,555	1,015.45	149,834,724.75	
IDFC FIRST BANK LTD	94,716	90.15	8,538,647.40	
INDUSIND BANK LTD	8,222	1,566.55	12,880,174.10	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	31,199	1,846.55	57,610,513.45	
STATE BANK OF INDIA	51,136	655.40	33,514,534.40	
YES BANK LTD	387,272	22.15	8,578,074.80	
BAJAJ FINANCE LTD	7,798	7,632.65	59,519,404.70	
BAJAJ FINSERV LTD	11,093	1,709.75	18,966,256.75	
BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMEN	806	7,827.35	6,308,844.10	
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	11,638	1,249.65	14,543,426.70	
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	2,370	3,122.05	7,399,258.50	
JIO FINANCIAL SERVICES LTD	91,822	238.30	21,881,182.60	
MUTHOOT FINANCE LTD	3,756	1,485.70	5,580,289.20	
ONE 97 COMMUNICATIONS LTD	6,527	622.70	4,064,362.90	
POWER FINANCE CORPORATION	44,201	408.75	18,067,158.75	
REC LTD	34,683	435.15	15,092,307.45	
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	7,713	776.80	5,991,458.40	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	8,326	2,059.55	17,147,813.30	
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	26,979	666.05	17,969,362.95	
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	6,992	1,442.05	10,082,813.60	
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	8,896	519.95	4,625,475.20	
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	13,078	1,424.55	18,630,264.90	
HCL TECHNOLOGIES LTD	27,166	1,488.30	40,431,157.80	
INFOSYS LTD	94,576	1,558.30	147,377,780.80	
LTIMINDTREE LTD	2,579	6,112.75	15,764,782.25	

	MPHASIS LTD	1,924	2,674.55	5,145,834.20	
	PERSISTENT SYSTEMS LTD	1,445	7,064.30	10,207,913.50	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	26,086	3,816.20	99,549,393.20	
	TATA ELXSI LTD	1,069	8,900.75	9,514,901.75	
	TECH MAHINDRA LTD	14,666	1,281.45	18,793,745.70	
	WIPRO LTD	37,402	438.70	16,408,257.40	
	BHARTI AIRTEL LTD	64,202	988.45	63,460,466.90	
	TATA COMMUNICATIONS LTD	3,349	1,791.85	6,000,905.65	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	8,848	1,531.80	13,553,366.40	
	ADANI POWER LTD	20,741	535.45	11,105,768.45	
	GAIL INDIA LTD	58,140	144.40	8,395,416.00	
	INDRAPRASTHA GAS LTD	7,746	407.35	3,155,333.10	
	NTPC LTD	125,238	309.65	38,779,946.70	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	133,666	233.55	31,217,694.30	
	TATA POWER CO LTD	39,023	335.90	13,107,825.70	
	DLF LTD	15,745	698.05	10,990,797.25	
	GODREJ PROPERTIES LTD	3,754	1,976.60	7,420,156.40	
	MACROTECH DEVELOPERS LTD	7,189	920.90	6,620,350.10	
インドルピー 小計		3,837,185		2,761,512,982.10 (4,805,032,588)	
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	16,008	15.70	251,325.60	
	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	68,061	3.23	219,973.15	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	157,972	1.61	255,124.78	
	INDUSTRIES QATAR	41,380	12.72	526,353.60	
	COMMERCIAL BANK PQSC	89,506	5.52	494,520.65	
	DUKHAN BANK	47,311	3.98	188,534.33	
	MASRAF AL RAYAN	156,266	2.45	382,851.70	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	26,217	10.30	270,035.10	
	QATAR ISLAMIC BANK	46,127	19.62	905,011.74	
	QATAR NATIONAL BANK	132,855	15.40	2,045,967.00	
	OOREDOO QPSC	24,164	10.33	249,614.12	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	11,535	17.26	199,094.10	
	BARWA REAL ESTATE CO	60,279	2.78	167,575.62	
カタールリアル 小計		877,681		6,155,981.49 (243,592,187)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	7,793	192.40	1,499,373.20	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	1,807	919.94	1,662,331.58	
	ANGLOGOLD ASHANTI PLC	12,308	344.98	4,246,013.84	
	GOLD FIELDS LTD	25,887	300.71	7,784,479.77	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	15,256	117.60	1,794,105.60	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	28,030	85.94	2,408,898.20	
	KUMBA IRON ORE LTD	1,694	590.67	1,000,594.98	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	9,656	136.28	1,315,919.68	

	SASOL LTD	15,929	180.00	2,867,220.00	
	SIBANYE STILLWATER LTD	72,813	25.33	1,844,353.29	
	BIDVEST GROUP LTD	8,221	243.02	1,997,867.42	
	NASPERS LTD-N SHS	5,336	3,327.01	17,752,925.36	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	52,043	19.30	1,004,429.90	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	27,276	69.46	1,894,590.96	
	BID CORP LTD	9,440	405.29	3,825,937.60	
	CLICKS GROUP LTD	6,931	309.30	2,143,758.30	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	14,682	257.82	3,785,313.24	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	11,723	195.04	2,286,453.92	
	ABSA GROUP LTD	22,911	154.80	3,546,622.80	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	2,424	1,897.34	4,599,152.16	
	NEDBANK GROUP LTD	12,732	203.94	2,596,564.08	
	STANDARD BANK GROUP LTD	38,290	194.15	7,434,003.50	
	FIRSTRAND LTD	144,428	68.76	9,930,869.28	
	REINET INVESTMENTS SCA	3,701	441.52	1,634,065.52	
	REMGRO LTD	14,915	151.30	2,256,639.50	
	DISCOVERY LTD	16,635	136.82	2,276,000.70	
	OLD MUTUAL LTD	121,527	12.02	1,460,754.54	
	OUTSURANCE GROUP LTD	22,382	41.96	939,148.72	
	SANLAM LTD	49,120	68.10	3,345,072.00	
	MTN GROUP LTD	49,438	111.10	5,492,561.80	
	VODACOM GROUP LTD	15,613	103.14	1,610,324.82	
	NEPI ROCKCASTLE N.V.	14,368	121.85	1,750,740.80	
南アフリカランド 小計		855,309		109,987,087.06 (863,398,633)	
アラブディルハム	MULTIPLY GROUP	109,599	3.19	349,620.81	
	AMERICANA RESTAURANTS INTERN	70,134	3.01	211,103.34	
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	88,102	3.62	318,929.24	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	81,152	8.50	689,792.00	
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	44,112	10.04	442,884.48	
	DUBAI ISLAMIC BANK	80,564	5.66	455,992.24	
	EMIRATES NBD PJSC	52,222	17.05	890,385.10	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	126,779	13.50	1,711,516.50	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	99,955	19.38	1,937,127.90	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	106,834	5.34	570,493.56	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	191,913	7.59	1,456,619.67	
アラブディルハム 小計		1,051,366		9,034,464.84 (354,873,778)	
クウェートディナール	AGILITY	45,725	0.51	23,731.27	
	BOUBYAN BANK K.S.C	38,661	0.59	23,080.61	
	GULF BANK	55,027	0.27	15,077.39	
	KUWAIT FINANCE HOUSE	231,391	0.71	165,675.95	

	NATIONAL BANK OF KUWAIT	214,587	0.90	194,630.40	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	52,466	0.49	25,760.80	
	MABANEE CO KPSC	20,333	0.81	16,510.39	
クウェートディナール 小計		658,190		464,466.81 (217,904,603)	
オフショア人民元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	18,900	5.88	111,132.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	66,700	5.29	352,843.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	11,500	30.80	354,200.00	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-A	8,100	12.49	101,169.00	
	GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	9,700	6.91	67,027.00	
	INNER MONGOLIA DIAN TOU EN-A	2,700	14.25	38,475.00	
	JIZHONG ENERGY RESOURCES-A	4,900	7.10	34,790.00	
	OFFSHORE OIL ENGINEERING-A	10,500	5.76	60,480.00	
	PETROCHINA CO LTD-A	46,600	6.77	315,482.00	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	15,700	19.66	308,662.00	
	SHAN XI HUA YANG GROUP NEW-A	5,100	8.79	44,829.00	
	SHANXI COKING COAL ENERGY-A	12,420	9.93	123,330.60	
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	6,500	22.50	146,250.00	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO-A	6,736	20.11	135,460.96	
	YANTAI JEREH OILFIELD-A	900	26.25	23,625.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	23,100	5.09	117,579.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	6,200	21.47	133,114.00	
	ANHUI HONGLU STEEL CONSTRU-A	650	20.90	13,585.00	
	ASIA-POTASH INTERNATIONAL-A	1,500	27.25	40,875.00	
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	50,000	6.00	300,000.00	
	CANMAX TECHNOLOGIES CO LTD-A	1,040	23.80	24,752.00	
	CHENGXIN LITHIUM GROUP CO-A	1,400	21.72	30,408.00	
	CHINA JUSHI CO LTD -A	7,414	9.74	72,212.36	
	CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	5,700	17.89	101,973.00	
	CHINA RARE EARTH RESOURCES-A	1,900	26.25	49,875.00	
	CMOC GROUP LTD-A	28,400	4.68	132,912.00	
	CNGR ADVANCED MATERIAL CO -A	600	44.30	26,580.00	
	DO-FLUORIDE NEW MATERIALS -A	2,100	14.09	29,589.00	
	GANFENG LITHIUM GROUP CO L-A	2,740	39.13	107,216.20	
	GEM CO LTD-A	10,800	5.24	56,592.00	
	GUANGDONG HEC TECHNOLOGY H-A	6,300	6.81	42,903.00	
	GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	4,180	21.74	90,873.20	
	HANGZHOU OXYGEN PLANT GROU-A	2,000	29.24	58,480.00	
	HENAN SHENHUO COAL & POWER-A	3,500	15.23	53,305.00	
	HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	14,520	12.91	187,453.20	
	HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	1,950	6.70	13,065.00	
	HESTEEL CO LTD-A	1,500	2.13	3,195.00	
	HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A	1,400	45.88	64,232.00	

HUAFON CHEMICAL CO LTD -A	4,600	6.58	30,268.00	
HUAIBEI MINING HOLDINGS CO-A	3,700	16.41	60,717.00	
HUBEI FEILIHUA QUARTZ GLAS-A	1,000	35.46	35,460.00	
HUBEI XINGFA CHEMICALS GRP-A	1,900	17.41	33,079.00	
HUNAN VALIN STEEL CO LTD -A	14,600	5.19	75,774.00	
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	73,300	1.42	104,086.00	
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	15,700	3.75	58,875.00	
INNER MONGOLIA YUAN XING-A	5,900	5.80	34,220.00	
JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	13,900	8.73	121,347.00	
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	390	59.69	23,279.10	
JIANGSU YOKE TECHNOLOGY-A	500	55.73	27,865.00	
JIANGXI COPPER CO LTD-A	2,000	16.92	33,840.00	
JINDUICHENG MOLYBDENUM CO -A	6,700	9.04	60,568.00	
LB GROUP CO LTD-A	4,500	16.31	73,395.00	
LUXI CHEMICAL GROUP CO LT-A	1,900	9.80	18,620.00	
NINGBO SHANSHAN CO LTD-A	2,300	12.22	28,106.00	
NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	11,900	14.32	170,408.00	
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	18,100	3.17	57,377.00	
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY-A	8,400	15.04	126,336.00	
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	15,750	10.09	158,917.50	
SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A	8,090	14.79	119,651.10	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	6,368	21.85	139,140.80	
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	3,520	26.98	94,969.60	
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	10,000	2.77	27,700.00	
SHANDONG SUN PAPER INDUSTR-A	2,200	11.88	26,136.00	
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	4,408	19.59	86,352.72	
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	3,700	6.88	25,456.00	
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	4,800	3.71	17,808.00	
SHENGHE RESOURCES HOLDINGS-A	1,700	9.53	16,201.00	
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	1,080	46.26	49,960.80	
SHENZHEN DYNANONIC CO LTD-A	320	55.00	17,600.00	
SHENZHEN SENIOR TECHNOLOGY-A	1,798	14.12	25,387.76	
SHENZHEN YUTO PACKAGING TE-A	1,700	25.58	43,486.00	
SICHUAN HEBANG BIOTECHNOL- A	14,200	2.31	32,802.00	
SINOMA SCIENCE&TECHNOLOGY -A	2,200	15.35	33,770.00	
SINOMINE RESOURCE GROUP CO-A	980	35.21	34,505.80	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A	600	2.85	1,710.00	
SKSHU PAINT CO LTD-A	784	47.10	36,926.40	
SUNRESIN NEW MATERIALS CO -A	1,200	51.63	61,956.00	
TANGSHAN JIDONG CEMENT INV-A	3,700	6.56	24,272.00	
TIANQI LITHIUM CORP-A	2,300	52.49	120,727.00	
TIANSHAN ALUMINUM GROUP CO-A	7,500	5.62	42,150.00	
TONGKUN GROUP CO LTD-A	1,500	14.35	21,525.00	

TONGLING NONFERROUS METALS-A	10,400	2.90	30,160.00	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	5,500	75.80	416,900.00	
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	640	24.41	15,622.40	
WESTERN MINING CO -A	3,300	12.62	41,646.00	
WESTERN SUPERCONDUCTING TE-A	560	50.80	28,448.00	
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD-A	1,200	16.32	19,584.00	
YINTAI GOLD CO LTD-A	2,380	14.47	34,438.60	
YONGXING SPECIAL MATERIALS-A	910	45.33	41,250.30	
YUNNAN ALUMINIUM CO LTD-A	7,300	11.15	81,395.00	
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	1,400	51.25	71,750.00	
YUNNAN TIN CO LTD-A	3,500	13.44	47,040.00	
YUNNAN YUNTIANHUA CO-A	1,500	14.22	21,330.00	
ZANGGE MINING CO LTD-A	3,300	24.29	80,157.00	
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	2,708	29.70	80,427.60	
ZHEJIANG JUHUA CO-A	5,700	16.51	94,107.00	
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	6,700	8.52	57,084.00	
ZHONGJIN GOLD CORP-A	10,000	9.71	97,100.00	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	36,000	11.80	424,800.00	
AECC AERO-ENGINE CONTROL-A	1,000	18.67	18,670.00	
AECC AVIATION POWER CO-A	4,600	33.96	156,216.00	
AVICOPTER PLC-A	500	37.60	18,800.00	
BEIJING EASPRING MATERIAL-A	700	36.13	25,291.00	
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	3,700	22.80	84,360.00	
BEIJING UNITED INFORMATION-A	841	33.37	28,064.17	
CHINA BAOAN GROUP-A	4,500	11.67	52,515.00	
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	6,900	29.65	204,585.00	
CHINA ENERGY ENGINEERING COR	52,300	2.09	109,307.00	
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	9,700	6.15	59,655.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	47,100	5.42	255,282.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	73,200	4.68	342,576.00	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	7,860	149.00	1,171,140.00	
COSCO SHIPPING DEVELOPMENT CO	18,400	2.43	44,712.00	
CRRC CORP LTD-A	54,700	5.08	277,876.00	
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	4,400	13.41	59,004.00	
EVE ENERGY CO LTD-A	3,020	38.62	116,632.40	
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	417	5.44	2,268.48	
FAW JIEFANG GROUP CO LTD-A	3,200	8.79	28,128.00	
GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A	600	59.52	35,712.00	
GOLDWIND SCIENCE &TECHNOL-A	3,400	7.60	25,840.00	
GONGNIU GROUP CO LTD-A	800	94.08	75,264.00	
GOODWE TECHNOLOGIES CO LTD-A	280	100.20	28,056.00	
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	3,900	20.12	78,468.00	
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	1,680	25.66	43,108.80	

HOYMILES POWER ELECTRONICS-A	298	205.80	61,328.40	
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	2,436	50.77	123,675.72	
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	5,300	11.66	61,798.00	
JIANGXI SPECIAL ELECTRIC -A	2,500	12.20	30,500.00	
KEDA INDUSTRIAL GROUP CO LTD	2,800	9.96	27,888.00	
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A	2,200	13.85	30,470.00	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	39,700	2.97	117,909.00	
MING YANG SMART ENERGY GRO-A	4,300	11.88	51,084.00	
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	14,782	21.14	312,491.48	
NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO -A	540	60.91	32,891.40	
NINGBO ORIENT WIRES & CABL-A	1,000	41.41	41,410.00	
NINGBO RONBAY NEW ENERGY T-A	450	36.75	16,537.50	
NORTH INDUSTRIES GROUP RED-A	2,400	13.83	33,192.00	
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	26,400	4.75	125,400.00	
PYLON TECHNOLOGIES CO LTD-A	200	93.94	18,788.00	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	19,400	12.76	247,544.00	
SHANGHAI CONSTRUCTION GROU-A	5,600	2.47	13,832.00	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	24,000	4.09	98,160.00	
SHANXI COAL INTERNATIONAL -A	4,500	18.21	81,945.00	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	2,400	59.58	142,992.00	
SICHUAN ROAD&BRIDGE GROUP-A	13,860	7.25	100,485.00	
SIEYUAN ELECTRIC CO LTD-A	1,500	49.91	74,865.00	
SINOMA INTERNATIONAL ENGIN-A	5,500	9.04	49,720.00	
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	3,300	79.45	262,185.00	
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	1,300	14.05	18,265.00	
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	409	101.10	41,349.90	
TBEA CO LTD-A	10,920	12.92	141,086.40	
TITAN WIND ENERGY SUZHOU-A	2,800	11.38	31,864.00	
WEICHAI POWER CO LTD-A	16,100	13.56	218,316.00	
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	20,700	5.03	104,121.00	
XIAMEN C & D INC-A	4,400	9.63	42,372.00	
ZHEFU HOLDING GROUP CO LTD-A	5,300	3.40	18,020.00	
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	4,100	20.25	83,025.00	
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	420	48.69	20,449.80	
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	3,800	29.44	111,872.00	
ZHEJIANG WEIXING NEW BUILD-A	1,300	14.33	18,629.00	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-A	800	33.97	27,176.00	
ZHUZHOU KIBING GROUP CO LT-A	4,000	6.70	26,800.00	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	15,500	6.31	97,805.00	
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	1,800	36.98	66,564.00	
ZHEJIANG WEIMING ENVIRONME-A	2,340	16.77	39,241.80	
AIR CHINA LTD-A	23,900	7.39	176,621.00	
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	98,800	4.88	482,144.00	

CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	24,800	3.86	95,728.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	17,600	5.76	101,376.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	20,770	10.59	219,954.30	
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	24,100	7.20	173,520.00	
HAINAN AIRLINES HOLDING CO-A	81,700	1.38	112,746.00	
JUNEYAO AIRLINES CO LTD-A	3,500	12.25	42,875.00	
LIAONING PORT CO LTD-A	21,900	1.48	32,412.00	
S F HOLDING CO LTD-A	8,600	39.81	342,366.00	
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	2,100	32.21	67,641.00	
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	8,900	5.05	44,945.00	
SPRING AIRLINES CO LTD-A	1,900	49.86	94,734.00	
YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	7,400	11.88	87,912.00	
YUNDA HOLDING CO LTD-A	4,870	7.78	37,888.60	
BETHEL AUTOMOTIVE SAFETY S-A	900	67.90	61,110.00	
BYD CO LTD -A	3,100	188.00	582,800.00	
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	700	136.30	95,410.00	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	17,126	17.54	300,390.04	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	3,400	36.93	125,562.00	
GREAT WALL MOTOR CO LTD-A	6,400	25.42	162,688.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A	6,900	8.67	59,823.00	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	7,100	16.28	115,588.00	
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	1,000	125.59	125,590.00	
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	1,200	18.09	21,708.00	
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	1,900	74.83	142,177.00	
SAIC MOTOR CORP LTD-A	12,410	13.45	166,914.50	
SAILUN GROUP CO LTD-A	3,100	11.24	34,844.00	
SERES GROUP CO L-A	3,100	89.93	278,783.00	
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	1,300	17.95	23,335.00	
SHENZHEN KEDALI INDUSTRY C-A	400	79.48	31,792.00	
BEIJING ROBOROCK TECHNOLOG-A	280	268.50	75,180.00	
ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A	600	38.30	22,980.00	
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	4,600	33.15	152,490.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-A	14,000	20.42	285,880.00	
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	1,000	21.45	21,450.00	
JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	1,040	34.77	36,160.80	
OPPEIN HOME GROUP INC-A	1,040	66.71	69,378.40	
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	300	53.02	15,906.00	
BTG HOTELS GROUP CO LTD-A	1,600	16.10	25,760.00	
OFFCN EDUCATION TECHNOLOGY-A	10,200	4.28	43,656.00	
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	1,700	29.36	49,912.00	
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	5,080	10.03	50,952.40	
37 INTERACTIVE ENTERTAINME-A	3,900	23.41	91,299.00	
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	1,300	8.40	10,920.00	

FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	23,800	6.18	147,084.00	
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY XI	100	272.40	27,240.00	
GIANT NETWORK GROUP CO LTD-A	4,100	13.93	57,113.00	
KUNLUN TECH CO LTD-A	2,500	39.94	99,850.00	
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	3,110	28.65	89,101.50	
PEOPLE.CN CO LTD-A	2,000	32.23	64,460.00	
PERFECT WORLD CO LTD-A	4,450	13.50	60,075.00	
WANDA FILM HOLDING CO LTD-A	4,500	13.40	60,300.00	
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	17,100	5.66	96,786.00	
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	3,400	76.89	261,426.00	
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	5,000	6.31	31,550.00	
WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A	6,000	4.52	27,120.00	
ZHEJIANG CHINA COMMODITIES-A	13,000	7.57	98,410.00	
DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	1,036	24.91	25,806.76	
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	2,164	36.51	79,007.64	
YONGHUI SUPERSTORES COMPANY LIMITED	20,400	2.93	59,772.00	
ANGEL YEAST CO LTD-A	700	36.12	25,284.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	800	224.13	179,304.00	
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	500	43.60	21,800.00	
ANHUI YINGJIA DISTILLERY C-A	1,600	65.07	104,112.00	
ANJOY FOODS GROUP CO LTD	400	98.54	39,416.00	
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	6,600	5.95	39,270.00	
BEIJING YANJING BREWERY CO-A	3,900	9.09	35,451.00	
CHONGQING BREWERY CO-A	800	62.35	49,880.00	
EASTROC BEVERAGE GROUP CO -A	500	182.00	91,000.00	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	8,170	34.34	280,557.80	
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	900	16.79	15,111.00	
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	2,800	41.90	117,320.00	
HEBEI YANGYUAN ZHIHUI BEVERA	2,600	20.04	52,104.00	
HEILONGJIANG AGRICULTURE-A	2,500	11.93	29,825.00	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	7,400	25.47	188,478.00	
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	11,500	25.45	292,675.00	
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	2,000	45.73	91,460.00	
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	2,700	107.31	289,737.00	
JIUGUI LIQUOR CO LTD-A	400	65.55	26,220.00	
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	300	26.35	7,905.00	
JUEWEI FOOD CO LTD-A	300	26.60	7,980.00	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	2,200	1,675.00	3,685,000.00	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	2,500	172.06	430,150.00	
MEIHUA HOLDINGS GROUP CO -A	5,400	9.43	50,922.00	
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	9,416	39.81	374,850.96	
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	7,600	9.10	69,160.00	
SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT-A	1,372	23.35	32,036.20	

SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	2,120	218.70	463,644.00	
SHEDE SPIRITS CO LTD-A	700	87.75	61,425.00	
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	400	56.55	22,620.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-A	1,500	69.10	103,650.00	
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	15,260	19.21	293,144.60	
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	7,100	133.33	946,643.00	
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	2,200	32.51	71,522.00	
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	1,100	14.74	16,214.00	
BY-HEALTH CO LTD-A	1,300	16.83	21,879.00	
YUNNAN BOTANEE BIO-TECHNOL-A	400	64.99	25,996.00	
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	17,368	15.98	277,540.64	
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD-A	1,000	54.92	54,920.00	
CHINA MEHECO CO LTD -A	2,240	11.22	25,132.80	
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	3,300	28.48	93,984.00	
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	700	62.68	43,876.00	
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	2,940	39.90	117,306.00	
IRAY TECHNOLOGY CO LTD-A	280	265.60	74,368.00	
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A	500	33.40	16,700.00	
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	8,344	7.11	59,325.84	
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	1,900	16.04	30,476.00	
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	8,380	5.91	49,525.80	
OVCTEK CHINA INC-A	920	22.40	20,608.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	4,400	16.52	72,688.00	
SHANGHAI UNITED IMAGING HE-A	1,800	134.46	242,028.00	
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	2,300	289.08	664,884.00	
SHENZHEN NEW INDUSTRIES BI-A	2,400	74.85	179,640.00	
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	300	72.76	21,828.00	
APELOA PHARMACEUTICAL CO-A	900	15.04	13,536.00	
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	680	119.00	80,920.00	
BEIJING TIANTAN BIOLOGICAL-A	3,300	30.68	101,244.00	
BEIJING TONGRENTANG CO-A	2,300	51.25	117,875.00	
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	1,015	57.62	58,484.30	
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	300	52.85	15,855.00	
BGI GENOMICS CO LTD-A	300	47.93	14,379.00	
BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY COR-A	800	64.22	51,376.00	
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	700	140.72	98,504.00	
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	1,500	48.48	72,720.00	
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	4,050	58.81	238,180.50	
CSPC INNOVATION PHARMACEUT-A	2,900	36.54	105,966.00	
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	1,200	48.79	58,548.00	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	300	53.02	15,906.00	
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	4,680	22.37	104,691.60	
HUBEI JUMPCAN PHARMACEUT-A	1,300	31.59	41,067.00	

HUMANWELL HEALTHCARE GROUP-A	3,800	25.80	98,040.00	
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	600	273.80	164,280.00	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	11,016	44.78	493,296.48	
JOINCARE PHARMACEUTICAL GR-A	1,600	12.36	19,776.00	
LIVZON PHARMACEUTICAL GROU-A	500	34.34	17,170.00	
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	1,098	15.62	17,150.76	
PHARMARON BEIJING CO LTD-A	3,675	29.30	107,677.50	
SHANDONG BUCHANG PHARMACEU-A	260	17.08	4,440.80	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	3,600	24.57	88,452.00	
SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCE-A	835	42.68	35,637.80	
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	10,500	8.12	85,260.00	
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	960	28.29	27,158.40	
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	1,700	31.83	54,111.00	
SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A	2,600	23.46	60,996.00	
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	2,400	29.10	69,840.00	
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	3,000	21.82	65,460.00	
WUXI APPTEC CO LTD-A	4,728	72.91	344,718.48	
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	2,960	46.79	138,498.40	
ZHANGZHOU PIENTZEHUANG PHA-A	1,100	232.22	255,442.00	
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	1,210	14.56	17,617.60	
ZHEJIANG JIUZHOU PHARMACEU-A	1,300	24.80	32,240.00	
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	5,463	17.05	93,144.15	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	149,700	3.64	544,908.00	
BANK OF BEIJING CO LTD -A	32,600	4.47	145,722.00	
BANK OF CHANGSHA CO LTD-A	7,500	6.60	49,500.00	
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	5,400	10.90	58,860.00	
BANK OF CHINA LTD-A	75,900	3.97	301,323.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	77,900	5.79	451,041.00	
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	13,000	9.65	125,450.00	
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	40,100	6.51	261,051.00	
BANK OF NANJING CO LTD -A	15,500	7.11	110,205.00	
BANK OF NINGBO CO LTD -A	13,900	19.91	276,749.00	
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	24,610	5.88	144,706.80	
BANK OF SUZHOU CO LTD-A	5,100	6.36	32,436.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	20,400	6.44	131,376.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	78,400	2.85	223,440.00	
CHINA MERCHANTS BANK-A	37,400	27.29	1,020,646.00	
CHINA MINSHENG BANKING-A	67,800	3.79	256,962.00	
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	60,270	2.50	150,675.00	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-A	8,500	4.15	35,275.00	
CNPC CAPITAL CO LTD-A	10,900	5.36	58,424.00	
HUAXIA BANK CO LTD-A	24,300	5.78	140,454.00	
IND & COMM BK OF CHINA-A	110,700	4.79	530,253.00	

INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	35,300	14.40	508,320.00	
PING AN BANK CO LTD-A	34,400	9.10	313,040.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	63,800	4.29	273,702.00	
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	59,300	6.56	389,008.00	
SHANGHAI RURAL COMMERCIAL -A	13,500	5.67	76,545.00	
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A	13,900	3.16	43,924.00	
BOC INTERNATIONAL CHINA CO-A	3,000	10.54	31,620.00	
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	8,800	8.11	71,368.00	
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	6,800	5.49	37,332.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-A	8,000	12.50	100,000.00	
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	3,000	8.17	24,510.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPTAL-A	6,000	38.63	231,780.00	
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	11,900	13.86	164,934.00	
CITIC SECURITIES CO-A	21,500	20.64	443,760.00	
CSC FINANCIAL CO LTD-A	7,500	24.04	180,300.00	
DONGXING SECURITIES CO LT-A	6,200	8.58	53,196.00	
EAST MONEY INFORMATION CO-A	27,812	14.17	394,096.04	
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	6,600	15.48	102,168.00	
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	500	5.97	2,985.00	
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	17,000	9.10	154,700.00	
GF SECURITIES CO LTD-A	9,500	14.14	134,330.00	
GUANGZHOU YUEXIU CAPITAL H-A	4,374	6.12	26,768.88	
GUOLIAN SECURITIES CO LTD-A	2,200	11.86	26,092.00	
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	11,300	8.79	99,327.00	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	12,000	15.00	180,000.00	
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	9,500	6.90	65,550.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	18,700	9.46	176,902.00	
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	1,000	158.99	158,990.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	13,100	14.12	184,972.00	
HUAXI SECURITIES CO LTD-A	300	7.88	2,364.00	
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	16,300	5.90	96,170.00	
NANJING SECURITIES CO LTD	7,600	8.09	61,484.00	
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	10,800	8.46	91,368.00	
SDIC CAPITAL CO LTD-A	11,000	6.77	74,470.00	
SHANXI SECURITIES CO LTD-A	400	5.48	2,192.00	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	45,600	4.46	203,376.00	
SINOLINK SECURITIES CO LTD-A	7,700	9.42	72,534.00	
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	9,700	7.51	72,847.00	
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	3,800	4.05	15,390.00	
WESTERN SECURITIES CO LTD-A	10,000	6.52	65,200.00	
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	6,000	10.78	64,680.00	
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD-A	10,500	6.94	72,870.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	4,500	27.88	125,460.00	

CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	11,100	23.20	257,520.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	3,800	29.85	113,430.00	
PICC HOLDING CO-A	15,500	4.76	73,780.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	18,300	38.71	708,393.00	
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	11,700	8.93	104,481.00	
BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	800	325.16	260,128.00	
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	4,674	10.15	47,441.10	
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	1,170	37.91	44,354.70	
DHC SOFTWARE CO LTD -A	400	6.37	2,548.00	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	3,073	28.66	88,072.18	
IFLYTEK CO LTD - A	3,600	48.18	173,448.00	
NAVINFO CO LTD-A	4,800	9.43	45,264.00	
QI AN XIN TECHNOLOGY GROUP-A	1,252	40.38	50,555.76	
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	900	74.00	66,600.00	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	2,995	47.44	142,082.80	
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	900	81.80	73,620.00	
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	5,908	17.73	104,748.84	
AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A	2,300	20.90	48,070.00	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	83,900	3.72	312,108.00	
CETC CYBERSPACE SECURITY T-A	1,300	23.00	29,900.00	
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	4,500	28.93	130,185.00	
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	6,700	10.78	72,226.00	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-A	11,000	4.26	46,860.00	
CHINA ZHENHUA GROUP SCIENC-A	1,200	57.86	69,432.00	
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	27,800	15.17	421,726.00	
GOERTEK INC -A	6,100	18.89	115,229.00	
GRG BANKING EQUIPMENT CO -A	2,200	12.66	27,852.00	
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	22,300	6.63	147,849.00	
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICAT-A	300	11.72	3,516.00	
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	1,500	43.83	65,745.00	
HENGDIAN GROUP DMEGC -A	2,700	12.56	33,912.00	
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO-A	3,700	11.57	42,809.00	
HUAGONG TECH CO LTD-A	2,700	30.68	82,836.00	
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	2,400	34.70	83,280.00	
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	9,600	12.75	122,400.00	
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	12,833	32.50	417,072.50	
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	1,576	141.71	223,334.96	
NINESTAR CORP-A	1,800	24.18	43,524.00	
RAYTRON TECHNOLOGY CO LTD-A	700	46.28	32,396.00	
SHANGHAI BOCHU ELECTRONIC-A	280	251.57	70,439.60	
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	2,300	18.36	42,228.00	
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	780	70.04	54,631.20	
SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY-A	3,500	16.12	56,420.00	

SHENZHEN SUNLORD ELECTRONI-A	800	26.43	21,144.00	
SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	1,794	125.64	225,398.16	
SUPCON TECHNOLOGY CO LTD-A	870	46.70	40,629.00	
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	3,300	17.55	57,915.00	
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	31,790	3.91	124,298.90	
TIANJIN712 COMMUNICATION &-A	700	28.93	20,251.00	
TIANMA MICROELECTRONICS-A	2,400	10.26	24,624.00	
UNISPLENDOUR CORP LTD-A	4,876	19.96	97,324.96	
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	2,700	42.98	116,046.00	
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	3,464	7.06	24,455.84	
WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHA-A	1,760	21.66	38,121.60	
XIAMEN FARATRONIC CO LTD-A	400	84.13	33,652.00	
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	2,240	29.50	66,080.00	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	6,300	18.77	118,251.00	
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	1,700	113.19	192,423.00	
ZTE CORP-A	6,400	25.94	166,016.00	
CHINA UNITED NETWORK-A	59,700	4.33	258,501.00	
CECEP SOLAR ENERGY CO LT-A	6,500	5.32	34,580.00	
CECEP WIND POWER CORP-A	7,900	2.98	23,542.00	
CGN POWER CO LTD-A	40,600	3.10	125,860.00	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	32,500	7.32	237,900.00	
CHINA THREE GORGES RENEWAB-A	64,100	4.41	282,681.00	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	44,900	23.05	1,034,945.00	
DATANG INTL POWER GEN CO-A	20,000	2.41	48,200.00	
ENN NATURAL GAS CO LTD-A	4,800	15.95	76,560.00	
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	31,000	4.15	128,650.00	
HUADIAN POWER INTL CORP-A	12,500	5.09	63,625.00	
HUANENG POWER INTL INC-A	18,200	7.52	136,864.00	
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	13,800	12.76	176,088.00	
SHANGHAI ELECTRIC POWER CO-A	7,100	8.45	59,995.00	
SHENERGY COMPANY LIMITED	9,900	6.26	61,974.00	
SHENZHEN ENERGY GROUP CO L-A	11,600	6.08	70,528.00	
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A	12,900	14.55	187,695.00	
ZHEJIANG ZHENENG ELECTRIC-A	21,300	4.64	98,832.00	
3PEAK INC-A	200	150.23	30,046.00	
ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	943	153.30	144,561.90	
AMLOGIC SHANGHAI INC-A	600	61.71	37,026.00	
CAMBRICON TECHNOLOGIES-A	800	148.78	119,024.00	
CHINA RESOURCES MICROELECT-A	2,200	44.96	98,912.00	
FLAT GLASS GROUP CO LTD-A	2,300	23.23	53,429.00	
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR I-A	1,356	93.88	127,301.28	
HANGZHOU CHANG CHUAN TECHN-A	1,300	41.80	54,340.00	
HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	2,352	21.40	50,332.80	

	HANGZHOU LION ELECTRONICS -A	1,000	26.87	26,870.00	
	HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	2,000	22.66	45,320.00	
	HOYUAN GREEN ENERGY CO LTD	978	30.30	29,633.40	
	HYGON INFORMATION TECHNOLO-A	4,200	76.10	319,620.00	
	INGENIC SEMICONDUCTOR CO -A	1,200	65.90	79,080.00	
	JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	9,612	18.11	174,073.32	
	JCET GROUP CO LTD-A	3,800	29.20	110,960.00	
	JIANGSU PACIFIC QUARTZ CO -A	700	72.90	51,030.00	
	JINKO SOLAR CO LTD-A	13,400	8.16	109,344.00	
	LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	12,936	20.37	263,506.32	
	MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A	3,314	59.79	198,144.06	
	NATIONAL SILICON INDUSTRY -A	5,600	17.01	95,256.00	
	NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	900	229.10	206,190.00	
	PIOTECH INC-A	296	244.40	72,342.40	
	RISEN ENERGY CO LTD-A	2,400	15.57	37,368.00	
	SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	9,900	13.43	132,957.00	
	SG MICRO CORP-A	1,007	86.28	86,883.96	
	SHANGHAI AIKO SOLAR ENERGY-A	3,220	14.96	48,171.20	
	SHANGHAI FUDAN MICROELE-DO-A	800	38.99	31,192.00	
	SHENZHEN SC NEW ENERGY TEC-A	300	63.83	19,149.00	
	STARPOWER SEMICONDUCTOR LT-A	200	167.95	33,590.00	
	TCL ZHONGHUAN RENEWABLE EN-A	8,075	14.66	118,379.50	
	TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	1,900	8.43	16,017.00	
	TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	3,200	22.69	72,608.00	
	TONGWEI CO LTD-A	10,500	22.68	238,140.00	
	TRINA SOLAR CO LTD-A	3,200	25.18	80,576.00	
	UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	1,819	64.66	117,616.54	
	VERISILICON MICROELECTRONI-A	1,000	51.46	51,460.00	
	WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	2,185	108.28	236,591.80	
	WUXI AUTOWELL TECHNOLOGY C-A	580	83.01	48,145.80	
	XINJIANG DAQO NEW ENERGY C-A	3,600	27.83	100,188.00	
	YANGZHOU YANGJIE ELECTRONI-A	700	35.31	24,717.00	
	ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	1,800	40.71	73,278.00	
	CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	19,800	9.42	186,516.00	
	CHINA VANKE CO LTD -A	16,400	10.38	170,232.00	
	HAINAN AIRPORT INFRASTRUCT-A	21,800	3.70	80,660.00	
	HANGZHOU BINJIANG REAL EST-A	5,600	7.45	41,720.00	
	POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	26,600	10.10	268,660.00	
	SHANGHAI LINGANG HOLDINGS-A	7,280	10.51	76,512.80	
	SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	24,900	3.14	78,186.00	
	YOUNGOR GROUP CO-A	14,000	6.55	91,700.00	
オフショア人民元 小計		4,760,859		60,950,455.50 (1,231,406,432)	

サウジアラビアリアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	14,462	10.58	153,007.96	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	76,259	33.05	2,520,359.95	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	3,568	37.90	135,227.20	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	8,294	12.06	100,025.64	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	6,803	138.40	941,535.20	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	10,211	32.95	336,452.45	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	37,325	42.65	1,591,911.25	
	SAUDI ARAMCO BASE OIL CO	1,374	140.20	192,634.80	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	25,875	82.80	2,142,450.00	
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	9,618	21.38	205,632.84	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	18,931	10.78	204,076.18	
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	7,669	38.10	292,188.90	
	SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	1,076	161.40	173,666.40	
	JARIR MARKETING CO	19,801	15.16	300,183.16	
	NAHDI MEDICAL CO	871	130.20	113,404.20	
	ALMARAI CO	6,924	56.60	391,898.40	
	SAVOLA	8,665	36.55	316,705.75	
	DALLAH HEALTHCARE CO	835	172.60	144,121.00	
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	2,355	273.80	644,799.00	
	MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	2,644	108.00	285,552.00	
	AL RAJHI BANK	55,929	83.70	4,681,257.30	
	ALINMA BANK	27,278	37.80	1,031,108.40	
	ARAB NATIONAL BANK	19,226	25.25	485,456.50	
	BANK AL-JAZIRA	11,133	18.88	210,191.04	
	BANK ALBILAD	13,423	42.10	565,108.30	
	BANQUE SAUDI FRANSI	16,111	39.85	642,023.35	
	RIYAD BANK	42,415	28.80	1,221,552.00	
	SAUDI AWWAL BANK	29,111	36.60	1,065,462.60	
	SAUDI INVESTMENT BANK/THE	13,432	15.80	212,225.60	
	THE SAUDI NATIONAL BANK	84,055	38.80	3,261,334.00	
	SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING	1,363	181.40	247,248.20	
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	2,528	209.80	530,374.40	
	CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	1,885	126.80	239,018.00	
	ARABIAN INTERNET & COMMUNICA	788	322.80	254,366.40	
	ELM CO	642	821.60	527,467.20	
	ETIHAD ETISALAT CO	10,475	47.95	502,276.25	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	13,459	13.96	187,887.64	
	SAUDI TELECOM CO	57,413	39.35	2,259,201.55	
	ACWA POWER CO	2,657	255.60	679,129.20	
	POWER & WATER UTILITY CO FOR	2,042	60.70	123,949.40	
	SAUDI ELECTRICITY CO	21,376	18.96	405,288.96	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	14,772	14.38	212,421.36	
		705,073		30,730,179.93	

サウジアラビアリアル 小計			(1,181,882,720)	
合　計	170,792,869		28,212,814,408 (28,212,814,408)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。
(注2)合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

(2)株式以外の有価証券

種　類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	89,800	2,697,592.00	
		OPERADORA DE SITES MEX- A-1	33,000	780,450.00	
		PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA	20,800	1,659,424.00	
	メキシコペソ 小計		143,600	5,137,466.00 (43,352,506)	
合計				43,352,506 (43,352,506)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。
(注2)合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。
(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数		組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式	37銘柄	100.0%	—	3.1%
メキシコペソ	株式	21銘柄	94.5%	—	2.7%
	投資証券	3銘柄	—	5.5%	0.2%
ブラジルレアル	株式	48銘柄	100.0%	—	5.8%
チリペソ	株式	12銘柄	100.0%	—	0.5%
コロンビアペソ	株式	3銘柄	100.0%	—	0.1%
ユーロ	株式	10銘柄	100.0%	—	0.5%
トルコリラ	株式	18銘柄	100.0%	—	0.7%
チェココルナ	株式	3銘柄	100.0%	—	0.2%
ハンガリーフォリント	株式	3銘柄	100.0%	—	0.3%
ポーランドズロチ	株式	15銘柄	100.0%	—	1.0%
ロシアルーブル	株式	14銘柄	—	—	—
香港ドル	株式	179銘柄	100.0%	—	19.6%
マレーシアリンギット	株式	31銘柄	100.0%	—	1.4%
タイバーツ	株式	38銘柄	100.0%	—	1.7%
フィリピンペソ	株式	14銘柄	100.0%	—	0.6%
インドネシアルピア	株式	22銘柄	100.0%	—	1.9%
韓国ウォン	株式	102銘柄	100.0%	—	12.5%
新台湾ドル	株式	90銘柄	100.0%	—	15.6%
インドルピー	株式	131銘柄	100.0%	—	16.9%
カタールリアル	株式	13銘柄	100.0%	—	0.9%
南アフリカランド	株式	32銘柄	100.0%	—	3.1%
アラブディルハム	株式	11銘柄	100.0%	—	1.3%
クウェートディナール	株式	7銘柄	100.0%	—	0.8%
オフショア人民元	株式	509銘柄	100.0%	—	4.4%
サウジアラビアリアル	株式	42銘柄	100.0%	—	4.2%

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

ＲＭ国内リートマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2023年12月20日現在
資産の部	
流動資産	
金銭信託	428,149,974
投資証券	45,606,607,400
未収入金	77,283,400
未収配当金	225,786,224
前払金	6,460,500
差入委託証拠金	23,566,731
流動資産合計	46,367,854,229
資産合計	46,367,854,229
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,421,730
未払金	259,693,300
未払解約金	29,300,000
その他未払費用	929
流動負債合計	293,415,959
負債合計	293,415,959
純資産の部	
元本等	
元本	32,572,311,608
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	13,502,126,662
元本等合計	46,074,438,270
純資産合計	46,074,438,270
負債純資産合計	46,367,854,229

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12月20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	19,209,910,973円

期中一部解約元本額	9,894,849,214円
期末元本額	32,572,311,608円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド（安定型）	854,284,312円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	1,283,313,747円
りそなラップ型ファンド（成長型）	1,683,469,599円
ＤＣりそな　グローバルバランス	29,973,637円
つみたてバランスファンド	2,852,624,811円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	295,410,662円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	222,545,755円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	153,318,307円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	83,696,208円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	56,513,235円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	31,935,776円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	71,408,665円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスＥＳＧ	131,485,087円
九州ＳＤＧｓ・グローバルバランス	54,996,260円
りそな国内リートインデックス（ラップ専用）	2,379,872,479円
ラップ型ファンド・プラスＥＳＧ（安定型）	5,542,091円
ラップ型ファンド・プラスＥＳＧ（安定成長型）	72,200,743円
ラップ型ファンド・プラスＥＳＧ（成長型）	69,041,910円
りそな　つみたてラップ型ファンド（安定型）	25,078,010円
りそな　つみたてラップ型ファンド（安定成長型）	45,740,782円
りそな　つみたてラップ型ファンド（成長型）	48,299,887円
りそな　つみたてリスクコントロールファンド	7,426,031円
ターゲットリターンバランスファンド（目標２％）	282,588円
ターゲットリターンバランスファンド（目標３％）	146,271円
ターゲットリターンバランスファンド（目標４％）	829,660円
ターゲットリターンバランスファンド（目標５％）	435,437円
ターゲットリターンバランスファンド（目標６％）	1,298,394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）	671,633円
りそなＪリートインデックス（年４回決算型）	2,015,647円
ＦＷりそな国内リートインデックスオープン	7,099,745,120円
ＦＷりそな国内リートインデックスファンド	6,401,156,499円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　Ｊリートインデックス	3,419,968,680円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	73,869,386円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	250,536,343円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	341,063,674円
Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド（適格機関投資家専用）	2,996,124,932円
りそなＤＡＡファンド（適格機関投資家専用）	191,985,169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）	3,284,921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）	11,752,798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）	24,037,934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）	28,185円
りそなマルチアセットファンド（適格機関投資家専用）	14,421,104円
りそなＤＡＡファンドⅡ（適格機関投資家専用）	17,773,450円
Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド２０２１０２（適格機関投資家専用）	133,840,674円
りそなＤＡＡファンド２０２２０５（適格機関投資家専用）	402,111,914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
りそなマルチアセットファンド２０２３１０（適格機関投資家専用）	250,869,839円
２．　計算日における受益権の総数	32,572,311,608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	1.4145円
(10,000口当たり純資産額)	(14,145円)

（注）※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

2023年12月20日現在
１.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 ２.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。
これらは、リートの価格変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。
デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。

3.金融商品に係るリスク管理体制
運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。
また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

II金融商品の時価等に関する事項

2023年12月20日現在

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

2.時価の算定方法
投資証券
（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。
デリバティブ取引
（その他の注記）の2　デリバティブ取引に関する注記に記載しております。
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務
これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

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

（関連当事者との取引に関する注記）

2023年12月20日現在

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）
該当事項はありません。

（その他の注記）
1　有価証券に関する注記
売買目的有価証券

種類	2023年12月20日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	△983,252,354
合計	△983,252,354

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

2　デリバティブ取引に関する注記
(投資証券関連)
（2023年12月20日現在）　（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	不動産投信指数先物取引				
	買建	434,774,730	－	430,353,000	△4,421,730
合計		434,774,730	－	430,353,000	△4,421,730

（注）時価の算定方法
先物取引
国内先物取引について
先物取引の評価においては、原則として計算日の取引所の発表する清算値段で評価しております。
※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表
(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種　類	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	905	104,437,000	
	サンケイリアルエステート投資法人	1,426	129,195,600	
	ＳＯＳｉＬＡ物流リート投資法人	2,221	266,742,100	
	東海道リート投資法人	662	81,889,400	
	日本アコモデーションファンド投資法人	1,537	932,959,000	
	森ヒルズリート投資法人	5,235	724,524,000	
	産業ファンド投資法人	6,793	925,206,600	
	アドバンス・レジデンス投資法人	4,368	1,399,944,000	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	2,336	908,704,000	
	ＧＬＰ投資法人	15,038	2,061,709,800	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	2,189	703,763,500	
	日本プロロジスリート投資法人	7,756	2,046,032,800	
	星野リゾート・リート投資法人	821	468,791,000	
	Ｏｎｅリート投資法人	777	204,040,200	
	イオンリート投資法人	5,461	757,986,800	
	ヒューリックリート投資法人	4,165	616,836,500	
	日本リート投資法人	1,446	489,471,000	
	積水ハウス・リート投資法人	13,378	1,076,929,000	
	トーセイ・リート投資法人	937	126,682,400	
	ヘルスケア＆メディカル投資法人	1,098	152,622,000	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	1,213	133,066,100	
	野村不動産マスターファンド投資法人	14,397	2,345,271,300	
	いちごホテルリート投資法人	738	80,368,200	
	ラサールロジポート投資法人	5,691	858,771,900	
	スターアジア不動産投資法人	6,861	397,251,900	
	マリモ地方創生リート投資法人	686	85,475,600	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	1,852	832,474,000	
	大江戸温泉リート投資法人	681	49,032,000	
	投資法人みらい	6,110	263,035,500	
	三菱地所物流リート投資法人	1,537	565,616,000	
	ＣＲＥロジスティクスファンド投資法人	1,917	300,010,500	
	ザイマックス・リート投資法人	722	83,896,400	
	タカラレーベン不動産投資法人	2,111	208,144,600	
	アドバンス・ロジスティクス投資法人	1,951	248,752,500	
	日本ビルファンド投資法人	5,194	3,168,340,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	4,573	2,634,048,000	
	日本都市ファンド投資法人	21,340	2,129,732,000	
	オリックス不動産投資法人	8,871	1,473,473,100	
	日本プライムリアルティ投資法人	3,045	1,114,470,000	

	ＮＴＴ都市開発リート投資法人	4,514	570,118,200	
	東急リアル・エステート投資法人	2,985	504,465,000	
	グローバル・ワン不動産投資法人	3,287	356,968,200	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	9,959	1,420,153,400	
	森トラストリート投資法人	8,581	623,838,700	
	インヴィンシブル投資法人	21,555	1,317,010,500	
	フロンティア不動産投資法人	1,652	715,316,000	
	平和不動産リート投資法人	3,326	444,021,000	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	2,852	793,711,600	
	福岡リート投資法人	2,302	384,434,000	
	ＫＤＸ不動産投資法人	12,812	2,057,607,200	
	いちごオフィスリート投資法人	3,648	301,689,600	
	大和証券オフィス投資法人	922	613,130,000	
	阪急阪神リート投資法人	2,123	292,549,400	
	スターツプロシード投資法人	772	152,701,600	
	大和ハウスリート投資法人	6,711	1,695,869,700	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	14,903	1,032,777,900	
	大和証券リビング投資法人	6,556	690,346,800	
	ジャパンエクセレント投資法人	3,869	490,202,300	
合計		281,368	45,606,607,400	

(注)券面総額欄の数値は口数を表しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

ＲＭ先進国リートマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2023年12月20日現在
資産の部	
流動資産	
預金	178,766,638
金銭信託	49,224,617
株式	578,363,775
投資証券	65,353,253,994
未収入金	2,314,685,005
未収配当金	223,646,965
流動資産合計	68,697,940,994
資産合計	68,697,940,994
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	24,441,476
未払金	42,500,158
未払解約金	2,351,604,000
その他未払費用	237
流動負債合計	2,418,545,871

	2023年12月20日現在
負債合計	2,418,545,871
純資産の部	
元本等	
元本	40,826,830,658
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	25,452,564,465
元本等合計	66,279,395,123
純資産合計	66,279,395,123
負債純資産合計	68,697,940,994

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

	2023年12月20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	27,734,286,278円
期中一部解約元本額	10,955,161,477円
期末元本額	40,826,830,658円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド（安定型）	1,161,533,579円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	1,958,662,875円
りそなラップ型ファンド（成長型）	2,803,825,319円
ＤＣりそな　グローバルバランス	29,385,473円
つみたてバランスファンド	1,347,561,591円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	568,043,508円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	421,802,207円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	295,526,675円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	154,395,644円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	105,642,390円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	59,724,639円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	129,827,495円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスＥＳＧ	246,068,526円
九州ＳＤＧｓ・グローバルバランス	99,306,663円
ラップ型ファンド・プラスＥＳＧ（安定型）	7,401,100円
ラップ型ファンド・プラスＥＳＧ（安定成長型）	108,929,229円
ラップ型ファンド・プラスＥＳＧ（成長型）	98,347,265円
りそな　つみたてラップ型ファンド（安定型）	32,951,055円
りそな　つみたてラップ型ファンド（安定成長型）	67,680,953円

りそな　つみたてラップ型ファンド（成長型）	77,887,709円
りそな　つみたてリスクコントロールファンド	2,431,400円
ターゲットリターンバランスファンド（目標２％）	503,697円
ターゲットリターンバランスファンド（目標３％）	260,659円
ターゲットリターンバランスファンド（目標４％）	1,474,136円
ターゲットリターンバランスファンド（目標５％）	772,740円
ターゲットリターンバランスファンド（目標６％）	2,343,946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	14,148,103,676円
ＦＷりそな先進国リートインデックスファンド	11,807,243,312円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　先進国リートインデックス	2,949,080,141円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	139,681,921円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	484,431,682円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	653,027,949円
りそなＤＡＡファンド（適格機関投資家専用）	154,312,137円
りそなＶＩグローバル・バランスファンド（安定型）（適格機関投資家専用）	4,419,136円
りそなＶＩグローバル・バランスファンド（安定成長型）（適格機関投資家専用）	8,881,775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）	133,950,629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）	103,041円
りそなマルチアセットファンド（適格機関投資家専用）	13,464,055円
りそなＤＡＡファンドⅡ（適格機関投資家専用）	31,521,867円
りそなＤＡＡファンド２０２２０５（適格機関投資家専用）	323,205,959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）	193,048,239円
２．　計算日における受益権の総数	40,826,830,658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	1.6234円
(10,000口当たり純資産額)	(16,234円)

（注）※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

2023年12月20日現在

１.金融商品に対する取組方針

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

２.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

３.金融商品に係るリスク管理体制

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

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

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

2023年12月20日現在

１.貸借対照表計上額、時価及び差額

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

２.時価の算定方法

株式、投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

デリバティブ取引

（その他の注記）の2　デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

３.金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

2023年12月20日現在

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）
該当事項はありません。

（その他の注記）
1　有価証券に関する注記
売買目的有価証券

種類	2023年12月20日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
株式	9,480,372
投資証券	2,942,377,059
合計	2,951,857,431

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

2　デリバティブ取引に関する注記
(通貨関連)
（2023年12月20日現在）　（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	2,296,937,380	－	2,321,378,856	△24,441,476
	米ドル	1,787,564,480	－	1,804,680,685	△17,116,205
	カナダドル	37,279,200	－	37,773,365	△494,165
	ユーロ	85,653,700	－	86,927,500	△1,273,800
	英ポンド	117,322,400	－	119,112,695	△1,790,295
	オーストラリアドル	153,228,800	－	155,595,680	△2,366,880
	ニュージーランドドル	5,321,580	－	5,414,112	△92,532
	香港ドル	25,620,000	－	25,853,800	△233,800
	シンガポールドル	80,284,500	－	81,289,575	△1,005,075
	イスラエルシュケル	4,662,720	－	4,731,444	△68,724
合計		2,296,937,380	－	2,321,378,856	△24,441,476

（注）時価の算定方法
為替予約取引
1)計算日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については以下のように評価しております。
①計算日において為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。
②計算日において当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
・計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
・計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。
2)計算日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については計算日の対顧客相場の仲値で評価しております。
※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表
(1)株式

通 貨	銘　柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	AMERICOLD REALTY TRUST INC	88,862	29.69	2,638,312.78	

	BROADSTONE NET LEASE INC-A	62,226	17.26	1,074,020.76	
米ドル 小計		151,088		3,712,333.54 (534,687,399)	
オーストラリアドル	CENTURIA CAPITAL GROUP	262,613	1.71	449,068.23	
オーストラリアドル 小計		262,613		449,068.23 (43,676,376)	
合　計		413,701		578,363,775 (578,363,775)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。
(注2)合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

(2)株式以外の有価証券

種　類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	ACADIA REALTY TRUST	32,484	546,705.72	
		AGREE REALTY CORP	33,472	2,077,272.32	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	23,955	450,833.10	
		ALEXANDER'S INC	738	151,290.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	52,146	6,754,992.84	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	4,715	80,579.35	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	16,085	364,646.95	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	106,056	3,833,924.40	
		APARTMENT INCOME REIT CO	48,963	1,644,177.54	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	46,456	356,782.08	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	70,622	1,197,749.12	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	23,558	304,369.36	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	12,741	23,698.26	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	47,379	8,983,058.40	
		BOSTON PROPERTIES INC	48,096	3,434,054.40	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	21,236	49,904.60	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	59,950	314,737.50	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	100,124	2,337,895.40	
		BRT APARTMENTS CORP	3,225	60,726.75	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	35,601	3,505,630.47	
		CARETRUST REIT INC	39,521	905,426.11	
		CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	8,439	201,692.10	
		CENTERSPACE	5,278	310,610.30	
		CHATHAM LODGING TRUST	17,055	180,441.90	
		CITY OFFICE REIT INC	14,501	90,196.22	
		CLIPPER REALTY INC	2,188	11,727.68	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	8,866	239,382.00	
		COPT DEFENSE PROPERTIES	37,307	936,778.77	
		COUSINS PROPERTIES INC	50,467	1,212,722.01	
		CTO REALTY GROWTH INC	6,920	119,024.00	

CUBESMART	74,996	3,373,320.08	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	71,328	662,637.12	
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	235,700	149,669.50	
DIGITAL REALTY TRUST INC	101,040	13,593,921.60	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	71,250	247,950.00	
DOUGLAS EMMETT INC	55,224	833,330.16	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	82,000	0.00	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	31,734	433,803.78	
EASTGROUP PROPERTIES INC	15,449	2,846,632.74	
ELME COMMUNITIES	30,466	449,373.50	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	45,064	433,966.32	
EPR PROPERTIES	25,068	1,213,541.88	
EQUINIX INC	31,327	25,358,893.23	
EQUITY COMMONWEALTH	35,279	674,181.69	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	62,162	4,471,934.28	
EQUITY RESIDENTIAL	115,271	7,086,861.08	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	51,892	1,331,548.72	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	21,408	5,262,942.72	
EXTRA SPACE STORAGE INC	70,497	10,827,634.23	
FARMLAND PARTNERS INC	15,087	194,924.04	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	24,473	2,554,981.20	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	44,099	2,335,924.03	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	30,941	772,906.18	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	33,544	83,524.56	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	89,042	4,310,523.22	
GETTY REALTY CORP	16,148	476,043.04	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	13,837	183,893.73	
GLADSTONE LAND CORP	11,212	161,228.56	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	21,276	236,801.88	
GLOBAL NET LEASE INC	66,358	625,755.94	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	126,810	2,163,378.60	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	182,314	3,613,463.48	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	35,002	809,246.24	
HOST HOTELS & RESORTS INC	235,079	4,520,569.17	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	41,582	365,505.78	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	74,790	1,159,992.90	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	17,584	80,710.56	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	9,333	935,726.58	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	23,060	597,715.20	
INVITATION HOMES INC	191,886	6,633,499.02	
IRON MOUNTAIN INC	97,416	6,695,401.68	
JBG SMITH PROPERTIES	29,625	509,846.25	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	274,900	93,466.00	

KILROY REALTY CORP	35,448	1,450,886.64	
KIMCO REALTY CORP	206,669	4,567,384.90	
KITE REALTY GROUP TRUST	73,017	1,672,819.47	
LTC PROPERTIES INC	14,151	469,105.65	
LXP INDUSTRIAL TRUST	97,198	939,904.66	
MACERICH CO/THE	71,615	1,120,774.75	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	635,700	50,856.00	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	198,881	1,006,337.86	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	38,920	5,245,248.40	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	25,731	1,030,011.93	
NATL HEALTH INVESTORS INC	14,395	824,977.45	
NET LEASE OFFICE PROPERTY	5,087	87,750.75	
NETSTREIT CORP	23,671	408,088.04	
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES	11,560	91,439.60	
NEXPOINT RESIDENTIAL	7,918	275,150.50	
NNN REIT INC	60,778	2,597,651.72	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	17,029	118,521.84	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	81,595	2,535,156.65	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	5,669	126,815.53	
ORION OFFICE REIT INC	19,499	117,578.97	
PARAMOUNT GROUP INC	57,462	307,996.32	
PARK HOTELS & RESORTS INC	69,666	1,143,915.72	
PEAKSTONE REALTY TRUST	11,731	235,441.17	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	40,961	627,112.91	
PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	39,791	1,481,418.93	
PHYSICIANS REALTY TRUST	79,196	1,053,306.80	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	40,404	290,908.80	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	12,803	316,746.22	
POSTAL REALTY TRUST INC- A	6,456	93,741.12	
PRIME US REIT	183,100	40,282.00	
PROLOGIS INC	308,347	41,241,411.25	
PUBLIC STORAGE	52,807	15,570,672.02	
REALTY INCOME CORP	241,521	13,795,679.52	
REGENCY CENTERS CORP	54,757	3,634,769.66	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	43,016	596,631.92	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	70,408	3,975,235.68	
RLJ LODGING TRUST	51,426	600,655.68	
RPT REALTY	25,974	347,012.64	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	19,865	2,176,012.10	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	76,804	1,102,905.44	
SAFEHOLD INC	15,004	340,440.76	
SAUL CENTERS INC	4,442	179,590.06	
SERVICE PROPERTIES TRUST	56,152	473,922.88	

		SIMON PROPERTY GROUP INC	108,847	15,800,230.52	
		SITE CENTERS CORP	59,750	831,122.50	
		SL GREEN REALTY CORP	21,360	978,715.20	
		SPIRIT REALTY CAPITAL INC	47,062	2,062,727.46	
		STAG INDUSTRIAL INC	60,534	2,349,929.88	
		SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	37,687	248,357.33	
		SUN COMMUNITIES INC	41,508	5,588,222.04	
		SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	67,930	726,851.00	
		TANGER INC	34,991	990,245.30	
		TERRENO REALTY CORP	27,965	1,764,032.20	
		UDR INC	100,909	3,796,196.58	
		UMH PROPERTIES INC	20,336	309,513.92	
		UNITI GROUP INC	79,038	444,193.56	
		UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	4,387	191,229.33	
		URBAN EDGE PROPERTIES	40,189	740,281.38	
		VENTAS INC	134,185	6,678,387.45	
		VERIS RESIDENTIAL INC	26,566	413,366.96	
		VICI PROPERTIES INC	345,155	10,975,929.00	
		VORNADO REALTY TRUST	53,146	1,599,694.60	
		WELLTOWER INC	184,657	16,672,680.53	
		WHITESTONE REIT	15,983	198,828.52	
		WP CAREY INC	72,910	4,704,153.20	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	34,876	463,502.04	
	米ドル 小計		8,737,292	352,938,861.53 (50,833,784,226)	
	カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	20,012	402,641.44	
		ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	20,272	131,362.56	
		BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	7,276	505,172.68	
		BSR REAL ESTATE INVESTMENT T	6,564	103,054.80	
		BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	14,969	42,961.03	
		CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	27,117	1,343,105.01	
		CHOICE PROPERTIES REIT	52,438	718,924.98	
		CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	18,269	250,285.30	
		CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	16,751	244,899.62	
		DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	43,378	597,748.84	
		DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	5,350	52,162.50	
		FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	34,831	529,431.20	
		GRANITE REAL ESTATE INVESTME	10,967	833,821.01	
		H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	42,332	411,043.72	
		INTERRENT REAL ESTATE INVEST	23,103	295,718.40	
		KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	18,513	331,752.96	
		MINTO APARTMENT REAL ESTATE	5,378	86,101.78	
		MORGUARD NORTH AMERICAN	6,979	101,544.45	

		RESIDENTIAL REIT			
		NEXUS INDUSTRIAL REIT	12,242	97,813.58	
		NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	41,452	199,384.12	
		PRIMARIS REIT	16,980	229,739.40	
		PRO REAL ESTATE INVESTMENT T	8,626	40,542.20	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	48,177	897,055.74	
		SLATE GROCERY REIT	10,423	119,656.04	
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	23,797	583,026.50	
		TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	2,814	28,055.58	
		カナダドル 小計	539,010	9,177,005.44 (990,565,967)	
	ユーロ	AEDIFICA	15,731	998,918.50	
		ALTAREA	1,602	119,028.60	
		CARE PROPERTY INVEST	12,957	185,025.96	
		CARMILA	18,403	285,614.56	
		COFINIMMO	12,155	852,673.25	
		COVIVIO	16,136	773,882.56	
		CROMWELL REIT EUR	114,140	162,078.80	
		EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	13,979	312,850.02	
		GECINA SA	17,114	1,885,962.80	
		HAMBORNER REIT AG	22,308	153,479.04	
		ICADE	10,496	369,249.28	
		IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	14,471	32,993.88	
		INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	97,997	638,940.44	
		INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	9,013	186,569.10	
		IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	152,670	161,524.86	
		KLEPIERRE	65,008	1,599,196.80	
		LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	16,228	99,802.20	
		MERCIALYS	31,308	299,461.02	
		MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	111,073	1,109,063.90	
		MONTEA NV	5,217	440,836.50	
		NSI NV	6,467	119,251.48	
		RETAIL ESTATES	4,274	273,108.60	
		SHURGARD SELF STORAGE LTD	10,255	445,989.95	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	33,840	2,296,382.40	
		VASTNED RETAIL NV	6,207	126,002.10	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	53,743	1,528,450.92	
		WERELDHAVE NV	12,895	187,880.15	
		XIOR STUDENT HOUSING NV	9,682	298,205.60	
		ユーロ 小計	895,369	15,942,423.27 (2,520,018,846)	
	英ポンド	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	141,815	71,616.57	
		AEW UK REIT PLC	60,678	61,891.56	
		ASSURA PLC	1,013,478	471,469.96	

		BALANCED COMM PROPERTY TRUST	225,374	161,367.78	
		BIG YELLOW GROUP PLC	65,070	784,093.50	
		BRITISH LAND CO PLC	311,582	1,263,776.59	
		CLS HOLDINGS PLC	43,072	41,865.98	
		CUSTODIAN PROPERTY INCOME REIT PLC	153,661	132,455.78	
		DERWENT LONDON PLC	37,126	860,580.68	
		EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	212,261	195,280.12	
		GREAT PORTLAND ESTATES PLC	86,340	352,785.24	
		HAMMERSON PLC	1,312,434	369,581.41	
		HELICAL PLC	33,175	72,653.25	
		HOME REIT PLC	147,401	56,086.08	
		IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	142,814	126,676.01	
		INTU PROPERTIES PLC	117,549	0.00	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	249,905	1,769,827.21	
		LIFE SCIENCE REIT PLC	113,860	70,365.48	
		LONDONMETRIC PROPERTY PLC	360,234	677,960.38	
		LXI REIT PLC	565,429	580,695.58	
		NEWRIVER REIT PLC	107,134	87,421.34	
		PICTON PROPERTY INCOME LTD	190,871	131,700.99	
		PRIMARY HEALTH PROPERTIES	456,771	465,906.42	
		PRS REIT PLC/THE	171,235	140,755.17	
		REGIONAL REIT LTD	151,551	50,845.36	
		SAFESTORE HOLDINGS PLC	72,191	617,954.96	
		SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	158,292	71,468.83	
		SEGRO PLC	409,108	3,597,695.75	
		SHAFTESBURY CAPITAL PLC	646,778	869,269.63	
		SUPERMARKET INCOME REIT PLC	424,781	362,338.19	
		TARGET HEALTHCARE REIT PLC	198,609	166,632.95	
		TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	106,966	67,495.54	
		TRITAX BIG BOX REIT PLC	632,240	1,046,989.44	
		UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	271,335	159,002.31	
		UNITE GROUP PLC	131,800	1,360,176.00	
		URBAN LOGISTICS REIT PLC	164,014	205,345.52	
		WAREHOUSE REIT PLC	145,941	128,574.02	
		WORKSPACE GROUP PLC	46,189	262,122.57	
		英ポンド 小計	9,879,064	17,912,724.15 (3,283,044,082)	
	オーストラリアドル	ABACUS GROUP	160,679	192,011.40	
		ABACUS STORAGE KING	177,394	199,568.25	
		ARENA REIT	117,618	432,834.24	
		BWP TRUST	162,956	578,493.80	
		CENTURIA INDUSTRIAL REIT	174,961	573,872.08	

		CENTURIA OFFICE REIT	150,261	201,349.74	
		CHARTER HALL GROUP	157,034	1,917,385.14	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	219,331	822,491.25	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	169,907	625,257.76	
		CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	118,297	352,525.06	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	523,878	214,789.98	
		DEXUS INDUSTRIA REIT	71,835	201,856.35	
		DEXUS/AU	357,266	2,722,366.92	
		GDI PROPERTY GROUP	181,458	109,782.09	
		GOODMAN GROUP	576,494	14,187,517.34	
		GPT GROUP	637,126	2,867,067.00	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	88,398	216,575.10	
		HEALTHCO REIT	164,038	247,697.38	
		HMC CAPITAL LTD	84,841	509,046.00	
		HOMECO DAILY NEEDS REIT	585,741	723,390.13	
		HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	67,652	192,808.20	
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	127,067	533,681.40	
		MIRVAC GROUP	1,312,088	2,729,143.04	
		NATIONAL STORAGE REIT	427,576	987,700.56	
		REGION RE LTD	383,362	874,065.36	
		RURAL FUNDS GROUP	133,000	276,640.00	
		SCENTRE GROUP	1,728,758	5,065,260.94	
		STOCKLAND	794,880	3,497,472.00	
		VICINITY CENTRES	1,286,414	2,585,692.14	
		WAYPOINT REIT	220,148	550,370.00	
	オーストラリアドル 小計		11,360,458	45,188,710.65 (4,395,053,997)	
	ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	285,348	315,309.54	
		GOODMAN PROPERTY TRUST	356,452	778,847.62	
		KIWI PROPERTY GROUP LTD	506,175	440,372.25	
		PRECINCT PROPERTIES GROUP	457,549	569,648.50	
	ニュージーランドドル 小計		1,605,524	2,104,177.91 (189,902,056)	
	香港ドル	CHAMPION REIT	589,000	1,431,270.00	
		FORTUNE REIT	496,000	2,420,480.00	
		LINK REIT	853,100	36,299,405.00	
		PROSPERITY REIT	431,000	581,850.00	
		SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	345,000	731,400.00	
		YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	795,000	938,100.00	
	香港ドル 小計		3,509,100	42,402,505.00 (783,174,267)	
	シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LT	230,600	299,780.00	
		CAPITALAND ASCENDAS REIT	1,182,800	3,465,604.00	
			847,296	821,877.12	

		CAPITALAND ASCOTT TRUST			
		CAPITALAND CHINA TRUST	409,000	359,920.00	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	1,681,832	3,346,845.68	
		CDL HOSPITALITY TRUSTS	210,600	231,660.00	
		EC WORLD REIT	50,000	14,000.00	
		ESR-LOGOS REIT	1,970,050	600,865.25	
		FAR EAST HOSPITALITY TRUST	366,500	245,555.00	
		FRASERS CENTREPOINT TRUST	365,700	808,197.00	
		FRASERS LOGISTICS & COMMERCI	966,679	1,092,347.27	
		KEPPEL DC REIT	457,800	837,774.00	
		KEPPEL REIT	757,100	692,746.50	
		LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	556,500	356,160.00	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	686,700	1,661,814.00	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,103,700	1,832,142.00	
		MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA	762,900	1,144,350.00	
		PARKWAYLIFE REAL ESTATE	131,100	466,716.00	
		SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	188,100	129,789.00	
		SPH REIT	401,800	345,548.00	
		STARHILL GLOBAL REIT	497,800	256,367.00	
		SUNTEC REIT	732,500	879,000.00	
	シンガポールドル 小計		14,557,057	19,889,057.82 (2,155,973,867)	
	韓国ウォン	D&D PLATFORM REIT CO LTD	15,215	47,090,425.00	
		ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	57,259	207,277,580.00	
		JR REIT XXVII	50,547	213,561,075.00	
		KORAMCO LIFE INFRA REIT	14,612	73,790,600.00	
		LOTTE REIT CO LTD	44,180	140,934,200.00	
		NH ALL-ONE REIT CO LTD	11,869	40,829,360.00	
		SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	26,417	169,861,310.00	
		SK REITS CO LTD	44,397	171,372,420.00	
	韓国ウォン 小計		264,496	1,064,716,970.00 (117,970,640)	
	イスラエルシュケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	237,765	406,340.38	
		REIT 1 LTD	62,291	1,065,176.10	
		SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	75,019	652,665.30	
	イスラエルシュケル 小計		375,075	2,124,181.78 (83,766,046)	
合計				65,353,253,994 (65,353,253,994)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。
(注2)合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。
(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数		組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式	2銘柄	1.0%	―	0.8%
	投資証券	139銘柄	―	99.0%	77.0%
カナダドル	投資証券	26銘柄	―	100.0%	1.5%
ユーロ	投資証券	28銘柄	―	100.0%	3.8%
英ポンド	投資証券	38銘柄	―	100.0%	5.0%
オーストラリアドル	株式	1銘柄	1.0%	―	0.1%
	投資証券	30銘柄	―	99.0%	6.7%
ニュージーランドドル	投資証券	4銘柄	―	100.0%	0.3%
香港ドル	投資証券	6銘柄	―	100.0%	1.2%
シンガポールドル	投資証券	22銘柄	―	100.0%	3.3%
韓国ウォン	投資証券	8銘柄	―	100.0%	0.2%
イスラエルシュケル	投資証券	3銘柄	―	100.0%	0.1%

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

２【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2023年12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】

Ⅰ　資産総額	21,415,224円
Ⅱ　負債総額	95,244円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	21,319,980円
Ⅳ　発行済口数	20,338,977口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0482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】

Ⅰ　資産総額	10,989,556円
Ⅱ　負債総額	2,080円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	10,987,476円
Ⅳ　発行済口数	10,142,199口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0833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】

Ⅰ　資産総額	41,591,384円
Ⅱ　負債総額	7,687円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	41,583,697円
Ⅳ　発行済口数	37,103,521口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.1207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】

Ⅰ　資産総額	16,411,917円
Ⅱ　負債総額	74,877円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	16,337,040円
Ⅳ　発行済口数	14,118,641口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.1571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】

Ⅰ　資産総額	32,120,896円
Ⅱ　負債総額	279,632円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	31,841,264円

Ⅳ　発行済口数	26,664,721口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.1941円

（参考）

RM国内債券マザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	203,278,135,322円
Ⅱ　負債総額	74,293,504円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	203,203,841,818円
Ⅳ　発行済口数	202,961,464,326口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0012円

RM先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	127,435,949,797円
Ⅱ　負債総額	104,083,639円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	127,331,866,158円
Ⅳ　発行済口数	146,516,525,703口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.8691円

RM先進国債券マザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	57,943,303,992円
Ⅱ　負債総額	474,615,934円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	57,468,688,058円
Ⅳ　発行済口数	47,616,870,773口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2069円

RM新興国債券マザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	11,304,633,894円
Ⅱ　負債総額	89,956,375円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	11,214,677,519円
Ⅳ　発行済口数	8,433,312,126口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3298円

RM国内株式マザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	128,065,455,006円
Ⅱ　負債総額	361,749,632円

Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	127,703,705,374円
Ⅳ　発行済口数	70,066,396,599口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.8226円

ＲＭ先進国株式マザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	227,712,172,983円
Ⅱ　負債総額	6,022,482円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	227,706,150,501円
Ⅳ　発行済口数	85,553,606,582口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.6616円

ＲＭ新興国株式マザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	30,468,827,914円
Ⅱ　負債総額	2,057,482円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	30,466,770,432円
Ⅳ　発行済口数	17,184,343,305口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.7729円

ＲＭ国内リートマザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	47,645,780,736円
Ⅱ　負債総額	228,525,471円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	47,417,255,265円
Ⅳ　発行済口数	33,207,932,336口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.4279円

ＲＭ先進国リートマザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	66,550,305,707円
Ⅱ　負債総額	96,720,203円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	66,453,585,504円
Ⅳ　発行済口数	40,748,179,783口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.6308円

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

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

（２）受益者に対する特典
該当事項はありません。

（３）譲渡制限の内容

① 譲渡制限はありません。
② 受益権の譲渡
・受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。
・前述の申請のある場合には、振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社債、株式等の振替に関する法律の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。
・前述の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合などにおいて、委託会社が必要と認めたときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。
③ 受益権の譲渡の対抗要件
受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

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

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

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

第二部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

（１）資本金の額

2023年12月末現在	資本金の額	1,000,000,000円
	発行可能株式総数	3,960,000株
	発行済株式総数	3,960,000株

●過去５年間における主な資本金の増減
該当事項はありません。

（２）委託会社の機構（2023年12月末現在）

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

②　投資運用の意思決定機構
委託会社では、以下P.D.C.Aサイクルにて投資運用の意思決定を行っています。
○PLAN：計画
・運用戦略部は、運用基本方針や主な投資制限などを策定し、運用委員会にて協議します。
○DO：実行
・運用部門のファンドマネージャーは、決定された運用基本方針等に基づいて運用計画を策定し、ファンドマネージャーが所属する部の部長が承認します。
・ファンドマネージャーは、決定された運用計画に沿って運用指図を行いポートフォリオを構築し、ファンドの運用状況を管理します。
・運用部門の各部長は、ファンドの運用が運用計画に沿って行われていることを確認します。
・売買発注の執行は、運用計画の策定等から組織的に分離されたトレーディング部が、発注先証券会社等の選定ルール等に基づく最良執行を行うよう努めます。
○CHECK：検証→ACTION：改善
・法令等や主な投資制限の遵守状況等については、運用部門から独立した運用リスク管理部がモニタリングを行います。その結果は、運用評価委員会に報告するとともにすみやかに運用部門にフィードバックされ、ファンドの運用に反映されます。
・運用実績等については運用評価委員会が統括し、運用部門に対する管理・指導を行います。

２【事業の内容及び営業の概況】

当社は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社として、証券投資信託の設定を行うとともに、「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者として、その運用（投資運用業）を行っています。また、「金融商品取引法」に定める投資助言・代理業および第二種金融商品取引業を行っています。
2023年12月末現在、委託会社が運用する証券投資信託は以下のとおりです（ただし、親投資信託を除きます。）。

ファンドの種類	本数	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	163	1,659,921
単位型株式投資信託	6	27,661
単位型公社債投資信託	12	23,457
合計	181	1,711,040

３【委託会社等の経理状況】

（１）委託会社であるりそなアセットマネジメント株式会社（以下、「当社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第２条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。
また、中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。
（２）財務諸表及び中間財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。
（３）当社は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づき、第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、第９期事業年度に係る中間会計期間（自　2023年４月１日　至　2023年９月30日）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツにより中間監査を受けております。

（１）【貸借対照表】

（単位：千円）

		前事業年度 （2022年３月31日）	当事業年度 （2023年３月31日）
資産の部			
流動資産			
預金		7,480,501	9,745,910
前払費用		270,287	323,722
未収入金		247	314
未収委託者報酬		972,599	948,037
未収運用受託報酬		3,009,122	2,750,484
未収投資助言報酬		507,363	479,787
流動資産計		12,240,121	14,248,255
固定資産			
有形固定資産			
建物	※１	8,415	11,556
器具備品	※１	15,450	17,947
有形固定資産計		23,866	29,503
無形固定資産			
ソフトウェア		3,919	11,002
ソフトウェア仮勘定		3,100	―
無形固定資産計		7,019	11,002
投資その他の資産			
投資有価証券		37,596	60,103
繰延税金資産		118,572	117,863
投資その他の資産計		156,168	177,967
固定資産計		187,054	218,474
資産合計		12,427,176	14,466,729

（単位：千円）

		前事業年度 （2022年３月31日）	当事業年度 （2023年３月31日）
負債の部			
流動負債			
未払金			
未払手数料		274,374	252,008
その他未払金	※２	1,568,028	263,623
未払費用		105,943	111,825
未払法人税等		250,779	607,485
未払消費税等		276,917	99,188
預り金		2,465	2,245
賞与引当金		253,537	265,505
流動負債計		2,732,047	1,601,882
負債合計		2,732,047	1,601,882
純資産の部			

株主資本		
資本金	1,000,000	1,000,000
資本剰余金		
資本準備金	490,000	490,000
資本剰余金計	490,000	490,000
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	8,203,810	11,375,212
利益剰余金計	8,203,810	11,375,212
株主資本計	9,693,810	12,865,212
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	1,318	△364
評価・換算差額等計	1,318	△364
純資産合計	9,695,129	12,864,847
負債・純資産合計	12,427,176	14,466,729

（２）【損益計算書】

（単位：千円）

	前事業年度 （自　2021年４月１日 至　2022年３月31日）	当事業年度 （自　2022年４月１日 至　2023年３月31日）
営業収益		
委託者報酬	4,788,765	4,696,038
運用受託報酬	5,438,177	5,142,361
投資助言報酬	982,472	952,145
営業収益計	11,209,415	10,790,545
営業費用		
支払手数料	1,460,131	1,210,415
広告宣伝費	49,322	68,988
調査費		
調査費	1,502,951	1,772,867
委託調査費	137,291	148,470
委託計算費	269,116	300,448
事務委託費	23,751	26,903
営業雑経費		
印刷費	95,519	114,901
協会費	12,887	13,978
販売促進費	2,277	836
その他	64,110	70,972
営業費用計	3,617,359	3,728,783
一般管理費		
給料		
役員報酬	127,995	124,995
給料・手当	1,260,284	1,361,136
賞与	169,303	192,845
賞与引当金繰入額	253,537	265,505
旅費交通費	6,944	20,681
租税公課	92,204	85,343
不動産賃借料	99,813	113,302
固定資産減価償却費	15,365	13,938
諸経費	270,995	267,977
一般管理費計	2,296,443	2,445,724
営業利益	5,295,612	4,616,037
営業外収益		
受取利息	―	5,137

受取配当金		506	64
投資有価証券売却益		866	564
雑収入		3,244	2,431
営業外収益計		4,617	8,198
営業外費用			
投資有価証券売却損		―	290
為替差損		170	64,517
雑損失		1,455	22
営業外費用計		1,625	64,829
経常利益		5,298,604	4,559,406
特別損失			
固定資産除去損		―	2,368
特別損失計		―	2,368
税引前当期純利益		5,298,604	4,557,038
法人税、住民税及び事業税	※1	1,632,846	1,384,185
法人税等調整額		10,297	1,450
法人税等計		1,643,143	1,385,636
当期純利益		3,655,460	3,171,401

（３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自　2021年４月１日　　至　2022年３月31日）

（単位：千円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計	その他利益剰余金 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					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計	
当期首残高	1,000,000	490,000	490,000	8,203,810	8,203,810	9,693,810
当期変動額						
当期純利益	―	―	―	3,171,401	3,171,401	3,171,401

株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	―	―	―	―	―	―
当期変動額合計	―	―	―	3,171,401	3,171,401	3,171,401
当期末残高	1,000,000	490,000	490,000	11,375,212	11,375,212	12,865,212

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

（重要な会計方針）
１．有価証券の評価基準及び評価方法
その他有価証券
市場価格のない株式等以外のもの
時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）を採用しております。

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

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

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

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

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

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

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

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

注記事項
（貸借対照表関係）
※１　有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 （2022年３月31日）	当事業年度 （2023年３月31日）
建物	2,073千円	2,865千円
器具備品	32,416千円	40,455千円

※２　関係会社に対する資産及び負債

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

（注）当該金額は、連結納税親会社と受払いする金額であります。

（損益計算書関係）
※１　関係会社に対する主な取引

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

（株主資本等変動計算書関係）
前事業年度（自　2021年４月１日　至　2022年３月31日）
１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

２．配当に関する事項
該当事項はありません。

当事業年度（自　2022年４月１日　至　2023年３月31日）
１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

２．配当に関する事項
該当事項はありません。

（金融商品関係）
１．金融商品の状況に関する事項
（１）金融商品に対する取組方針
資金運用については、短期的な預金等に限定しております。

（２）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制
当社の営業債権である未収委託者報酬は、投資信託約款に基づき、信託財産から委託者に支払われる信託報酬の未払金額であります。当該信託財産は、受託者である信託銀行により適切に分別管理され、信託法により受託者の倒産の影響を受けません。そのため、当該金銭債権に関する信用リスクはありません。
未収運用受託報酬は、顧客の信用リスクに晒されており、運用受託先毎に期日管理および残高管理を行うとともに、四半期毎に回収可能性を把握する体制としております。
未収投資助言報酬は、顧客の信用リスクに晒されており、投資助言先毎に期日管理および残高管理を行うとともに、四半期毎に回収可能性を把握する体制としております。

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

前事業年度（自　2021年４月１日　至　2022年３月31日）
（単位：千円）

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

（注）金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

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

当事業年度（自　2022年４月１日　至　2023年３月31日）

（単位：千円）

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

（注）金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

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

３．金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項
金融商品の時価を、時価の算定に用いたインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の３つのレベルに分類しております。
レベル１の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産または負債に関する相場価格により算定した時価
レベル２の時価：観察可能な時価に係るインプットのうち、レベル１のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価
レベル３の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価
時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

前事業年度（自　2021年４月１日　至　2022年３月31日）

（単位：千円）

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

当事業年度（自　2022年４月１日　至　2023年３月31日）

（単位：千円）

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

（有価証券関係）
１．その他有価証券

前事業年度（自　2021年４月１日　至　2022年３月31日）

（単位：千円）

	種類	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	(1)株式	－	－	－
	(2)債券	－	－	－
	(3)その他	17,169	14,100	3,069
	小計	17,169	14,100	3,069

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

当事業年度（自　2022年４月１日　至　2023年３月31日）

（単位：千円）

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

２．事業年度中に売却したその他有価証券
前事業年度（自　2021年４月１日　至　2022年３月31日）

（単位：千円）

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

当事業年度（自　2022年４月１日　至　2023年３月31日）

（単位：千円）

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

（税効果会計関係）
１．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

２．法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主要な項目別の内訳
前事業年度（自　2021年４月１日　至　2022年３月31日）

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

当事業年度（自　2022年４月１日　至　2023年３月31日）

法定実効税率	30.61%
（調整）	

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

（収益認識関係）
１．顧客との契約から生じる収益を分解した情報
収益認識に関する注記における開示目的に照らし、定量面・定性面の両面において収益の分解情報を記載する重要性が乏しいため、記載を省略しております。

２．収益を理解するための基礎となる情報
（重要な会計方針）の「４．収益および費用の計上基準」に記載のとおりであります。

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

（セグメント情報等）
前事業年度（自　2021年４月１日　至　2022年３月31日）
１．セグメント情報
当社は、「資産運用業」の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

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

（単位：千円）

顧客の名称又は氏名	営業収益額
株式会社りそな銀行	5,964,710

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

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

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

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

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

（単位：千円）

顧客の名称又は氏名	営業収益額
株式会社りそな銀行	5,545,681

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

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

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

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

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

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

（２）兄弟会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)（注４）
親会社の子会社	株式会社りそな銀行	大阪市中央区	279,928	銀行業務及び信託業務	－	投資信託の販売委託 投資助言 投資一任	運用受託報酬（注１）	5,202,291	未収運用受託報酬	2,880,437
							投資助言報酬（注２）	762,418	未収投資助言報酬	432,666
							支払手数料（注３）	922,420	未払手数料	175,773

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

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

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

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

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

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

（１株当たり情報）

	前事業年度（自　2021年４月１日　至　2022年３月31日）	当事業年度（自　2022年４月１日　至　2023年３月31日）
１株当たり純資産額	2,448円26銭	3,248円70銭

１株当たり当期純利益金額又は １株当たり当期純損失（△）	923円09銭	800円86銭

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

（注）１株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は以下のとおりであります。

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

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

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

(1)中間貸借対照表

（単位：千円）

		第９期中間会計期間 （2023年９月30日現在）
資産の部		
流動資産		
預金		11,392,118
前払費用		291,608
未収入金		251
未収委託者報酬		1,022,391
未収運用受託報酬		3,062,606
未収投資助言報酬		512,845
流動資産計		16,281,821
固定資産		
有形固定資産		
建物	※１	10,888
器具備品	※１	33,344
有形固定資産計		44,233
無形固定資産		
ソフトウェア		9,869
無形固定資産計		9,869
投資その他の資産		
投資有価証券		89,922
繰延税金資産		118,642
投資その他の資産計		208,565
固定資産計		262,668
資産合計		16,544,489

（単位：千円）

		第９期中間会計期間 （2023年９月30日現在）
負債の部		
流動負債		
未払金		
未払手数料		280,368
その他未払金		289,518
未払費用		119,676
未払法人税等		826,250
未払事業所税		2,948
未払消費税等	※２	154,937
賞与引当金		237,686
預り金		3,663
流動負債計		1,915,050
負債合計		1,915,050
純資産の部		
株主資本		
資本金		1,000,000
資本剰余金		
資本準備金		490,000
資本剰余金計		490,000
利益剰余金		
その他利益剰余金		

繰越利益剰余金	13,139,895
利益剰余金計	13,139,895
株主資本計	14,629,895
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	△457
評価・換算差額等計	△457
純資産合計	14,629,438
負債・純資産合計	16,544,489

(2)中間損益計算書

（単位：千円）

		第９期中間会計期間 （自　2023年４月１日 至　2023年９月30日）
営業収益		
委託者報酬		2,518,468
運用受託報酬		2,815,890
投資助言報酬		496,965
営業収益計		5,831,324
営業費用		
支払手数料		674,254
広告宣伝費		43,924
調査費		
調査費		951,111
委託調査費		58,686
委託計算費		156,106
事務委託費		15,858
営業雑経費		
印刷費		49,541
協会費		11,299
販売促進費		3,106
その他		41,911
営業費用計		2,005,801
一般管理費		
給料		
役員報酬		65,850
給料・手当		721,614
賞与		38,705
賞与引当金繰入額		237,686
旅費交通費		17,917
租税公課		48,115
不動産賃借料		61,403
固定資産減価償却費	※１	7,832
諸経費		142,791
一般管理費計		1,341,918
営業利益		2,483,604
営業外収益		
受取利息		5,080
受取配当金		58
投資有価証券売却益		2,000
為替差益		55,163
雑収入		1,103
営業外収益計		63,405
営業外費用		
投資有価証券売却損		15
雑損失		0
営業外費用計		15
経常利益		2,546,994
税引前中間純利益		2,546,994
法人税、住民税及び事業税		783,049
法人税等調整額		△738
法人税等計		782,311
中間純利益		1,764,683

(3)中間株主資本等変動計算書
第９期中間会計期間（自　2023年４月１日　　至　2023年９月30日）

（単位：千円）

	株主資本					
		資本剰余金		利益剰余金		
	資本金		資本剰余金	その他 利益剰余金	利益剰余金	株主資本

		資本準備金	合計	繰越利益剰余金	合計	合計
当期首残高	1,000,000	490,000	490,000	11,375,212	11,375,212	12,865,212
当中間期変動額	-	-	-	-	-	-
当中間純利益	-	-	-	1,764,683	1,764,683	1,764,683
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)	-	-	-	-	-	-
当中間期変動額合計	-	-	-	1,764,683	1,764,683	1,764,683
当中間期末残高	1,000,000	490,000	490,000	13,139,895	13,139,895	14,629,895

	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	△364	△364	12,864,847
当中間期変動額	-	-	-
当中間純利益	-	-	1,764,683
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)	△92	△92	△92
当中間期変動額合計	△92	△92	1,764,590
当中間期末残高	△457	△457	14,629,438

（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、当中間会計期間に帰属する額を計上しております。

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

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

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

注記事項
（中間貸借対照表関係）
※１　有形固定資産の減価償却累計額

	第９期中間会計期間（2023年９月30日）
建物	3,533千円
器具備品	45,605千円

※２　消費税等の取扱い
仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。

（中間損益計算書関係）
※１　減価償却実施額は、次のとおりであります。

	第９期中間会計期間 （2023年９月30日）
有形固定資産	5,817千円
無形固定資産	2,015千円

（中間株主資本等変動計算書関係）
第９期中間会計期間（自　2023年４月１日　至　2023年９月30日）
１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当中間会計期間末
普通株式（株）	3,960,000	-	-	3,960,000

２．配当に関する事項
該当事項はありません。

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

第９期中間会計期間（2023年９月30日現在）

（単位：千円）

	中間貸借対照表 計上額	時価	差額
投資有価証券	89,922	89,922	―
資産計	89,922	89,922	―

２．金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項
金融商品の時価を、時価の算定に用いたインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の３つのレベルに分類しております。
レベル１の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産または負債に関する相場価格により算定した時価
レベル２の時価：観察可能な時価に係るインプットのうち、レベル１のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価
レベル３の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価
時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

（単位：千円）

区分	時価			
	レベル１	レベル２	レベル３	合計
投資有価証券 投資信託	―	89,922	―	89,922
資産計	―	89,922	―	89,922

（有価証券関係）
１．その他有価証券
第９期中間会計期間（2023年９月30日現在）

（単位：千円）

	種類	中間貸借対照表 計上額	取得原価	差額
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	(1)株式	―	―	―
	(2)債券	―	―	―
	(3)その他	26,571	23,986	2,585
	小計	26,571	23,986	2,585
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	(1)株式	―	―	―
	(2)債券	―	―	―
	(3)その他	63,350	66,595	△3,244
	小計	63,350	66,595	△3,244
資産計		89,922	90,581	△658

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

（セグメント情報等）
第９期中間会計期間（自　2023年４月１日　至　2023年９月30日）
１．セグメント情報
当社は、「資産運用業」の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

２．関連情報
（１）製品及びサービスごとの情報

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

（２）地域ごとの情報

① 営業収益

本邦の外部顧客への営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。なお、営業収益の地域区分は、契約相手方の所在地（ファンドの場合は組成地）を基礎として分類しております。

② 有形固定資産

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

（３）主要な顧客ごとの情報

（単位：千円）

顧客の名称又は氏名	営業収益額
株式会社りそな銀行	3,013,395

３．報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

４．報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

５．報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

（１株当たり情報）

	第９期中間会計期間 （自　2023年４月１日 至　2023年９月30日）
１株当たり純資産額	3,694円30銭
１株当たり中間純利益金額	445円63銭

（注）１株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は以下のとおりであります。

	第９期中間会計期間 （自　2023年４月１日 至　2023年９月30日）
中間純利益（千円）	1,764,683
普通株主に帰属しない金額（千円）	―
普通株式に係る中間純利益（千円）	1,764,683
普通株式の期中平均株式数（株）	3,960,000

（重要な後発事象）

第９期中間会計期間（自　2023年４月１日　至　2023年９月30日）

該当事項はありません。

４【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

（１）自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

（２）運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

（３）通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下（４）、（５）において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または金融デリバティブ取引を行なうこと。

（４）委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。

（５）上記（３）、（４）に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

５【その他】

（１）定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

該当事項はありません。

（２）訴訟事件その他の重要事項

委託会社に重要な影響を与えた事実、または与えると予想される訴訟事件などは発生していません。

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

（１）受託会社

名　　称	資本金の額 （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。

２【関係業務の概要】

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

３【資本関係】

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

第３【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2023年12月15日	有価証券届出書の訂正届出書
2023年12月15日	半期報告書

独立監査人の監査報告書

2023年5月22日

りそなアセットマネジメント株式会社
取　締　役　会　　御　中

有限責任監査法人ト　ー　マ　ツ
東　京　事　務　所

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

監査意見

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

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

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

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

2.ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

2024年3月4日

りそなアセットマネジメント株式会社
取　締　役　会　　御　中

有限責任監査法人ト　ー　マ　ツ
東　京　事　務　所

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　松　崎　　雅　則

監査意見
当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている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12月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ターゲットリターンバランスファンド（目標２％）の2023年12月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

その他の記載内容
その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。
当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。
財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。
当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。
その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任
経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。
財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任
監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。
監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。
・　不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
・　財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
・　経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
・　経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
・　財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。
監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

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

以　上

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

独立監査人の監査報告書

2024年3月4日

りそなアセットマネジメント株式会社
取　締　役　会　　御　中

有限責任監査法人ト　ー　マ　ツ
東　京　事　務　所

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　松　崎　　雅　則

監査意見
当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている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12月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ターゲットリターンバランスファンド（目標３％）の2023年12月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

その他の記載内容
その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。
当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。
財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。
当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。
その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任
経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。
財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任
監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。
監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。
・　不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
・　財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
・　経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
・　経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
・　財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。
監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

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

以　上

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

独立監査人の監査報告書

2024年3月4日

りそなアセットマネジメント株式会社
取　締　役　会　　御　中

有限責任監査法人ト　ー　マ　ツ
東　京　事　務　所

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　松　崎　　雅　則

監査意見
当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている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12月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ターゲットリターンバランスファンド（目標４％）の2023年12月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

その他の記載内容
その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。
当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。
財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。
当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。
その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任
経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。
財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任
監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。
監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。
・　不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
・　財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
・　経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
・　経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
・　財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。
監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

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

以　上

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

独立監査人の監査報告書

2024年3月4日

りそなアセットマネジメント株式会社
取　締　役　会　　御　中

有限責任監査法人ト　ー　マ　ツ
東　京　事　務　所

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　松　崎　　雅　則

監査意見
当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている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12月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ターゲットリターンバランスファンド（目標５％）の2023年12月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

その他の記載内容
その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。
当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。
財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。
当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。
その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任
経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。
財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任
監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。
監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。
・　不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
・　財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
・　経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
・　経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
・　財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。
監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

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

以　上

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

独立監査人の監査報告書

2024年3月4日

りそなアセットマネジメント株式会社
取　締　役　会　　御　中

有限責任監査法人ト　ー　マ　ツ
東　京　事　務　所

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　松　崎　　雅　則

監査意見
当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている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12月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ターゲットリターンバランスファンド（目標６％）の2023年12月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

その他の記載内容
その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。
当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。
財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。
当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。
その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任
経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。
財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任
監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。
監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。
・　不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
・　財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
・　経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
・　経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
・　財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。
監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

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

以　上

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

独立監査人の中間監査報告書

2023年11月24日

りそなアセットマネジメント株式会社
取　締　役　会　　御　中

有限責任監査法人ト　ー　マ　ツ
東　京　事　務　所

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

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているりそなアセットマネジメント株式会社の2023年4月1日から2024年3月31日までの第9期事業年度の中間会計期間（2023年4月1日から2023年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、りそなアセットマネジメント株式会社の2023年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2023年4月1日から2023年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

監査人は、監査等委員会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去するための対応策を講じている場合又は阻害要因を許容可能な水準にまで軽減するためのセーフガードを適用している場合はその内容について報告を行う。

利害関係

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

以　上

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

2.ＸＢＲＬデータは中間監査の対象には含まれておりません。