

【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5月15日提出
【計算期間】	第2期(自 2023年2月16日至 2024年2月15日)
【ファンド名】	S m a r t - i S e l e c t 全世界株式インデックス
【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】

ファンドの目的
M S C I オール・カンントリー・ワールド・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

ファンドの基本的性格

1) 商品分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

2) 属性区分

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (含む日本)			
	年2回	日本			
	年4回	北米	ファミリーファンド	あり	日経225
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年6回 (隔月)	欧州			
	年12回 (毎月)	アジア			TOPIX
	日々	オセアニア			
不動産投信	その他 ()	中南米	ファンド・オブ・ファンズ	なし	
その他資産 (投資信託証券(株式一般))		アフリカ			その他 (MSCI オール・ カンントリー・ワ ールド・インデ ックス(配当込 み、円換算ベ ース))
		中近東 (中東)			
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型		エマージング			

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用されます。このため、組入れている資産を示す属性区分上の投資対象資産(その他資産(投資信託証券(株式一般)))と収益の源泉となる資産を示す商品分類上の投資対象資産(株式)とが異なります。

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

2. 投資対象地域による区分

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

3. 投資対象資産による区分

- (1) 株式：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (2) 債券：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (3) 不動産投信(リート)：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券及び不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (4) その他資産：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に上記(1)から(3)に掲げる資産以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、その他資産と併記して具体的な収益の源泉となる資産の名称記載も可とする。
- (5) 資産複合：目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(4)に掲げる資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

4. 独立した区分

- (1) MMF(マネー・マネージメント・ファンド)：「MMF等の運営に関する規則」に定めるMMFをいう。
- (2) MRF(マネー・リザーブ・ファンド)：「MMF等の運営に関する規則」に定めるMRFをいう。
- (3) ETF：投資信託及び投資法人に関する法律施行令(平成12年政令480号)第12条第1号及び第2号に規定する証券投資信託並びに租税特別措置法(昭和32年法律第26号)第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいう。

<補足として使用する商品分類>

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

<属性区分の定義>

1. 投資対象資産による属性区分

(1) 株式

- 一般：次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。
- 大型株：目論見書又は投資信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいう。
- 中小型株：目論見書又は投資信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいう。

(2) 債券

- 一般：次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。
- 公債：目論見書又は投資信託約款において、日本国又は各国の政府の発行する国債(地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含む。以下同じ。)に主として投資する旨の記載があるものをいう。
- 社債：目論見書又は投資信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいう。
- その他債券：目論見書又は投資信託約款において、公債又は社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいう。
- 格付等クレジットによる属性：目論見書又は投資信託約款において、上記から「発行体」による区分のほか、特にクレジットに対して明確な記載があるものについては、上記からに掲げる区分に加え「高格付債」「低格付債」等を併記することも可とする。

(3) 不動産投信

これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4) その他資産

組入れている資産を記載するものとする。

(5) 資産複合

以下の小分類に該当する場合には当該小分類を併記することができる。

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

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

2. 決算頻度による属性区分

- 年1回：目論見書又は投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。
- 年2回：目論見書又は投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいう。
- 年4回：目論見書又は投資信託約款において、年4回決算する旨の記載があるものをいう。
- 年6回(隔月)：目論見書又は投資信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいう。
- 年12回(毎月)：目論見書又は投資信託約款において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるものをいう。
- 日々：目論見書又は投資信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいう。
- その他：上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

3. 投資対象地域による属性区分(重複使用可能)

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

- アジア：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- オセアニア：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- 中南米：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- アフリカ：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- 中近東(中東)：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- エマージング：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域(新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
4. 投資形態による属性区分
- ファミリーファンド：目論見書又は投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいう。
- ファンド・オブ・ファンズ：「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいう。
5. 為替ヘッジによる属性区分
- 為替ヘッジあり：目論見書又は投資信託約款において、為替のフルヘッジ又は一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいう。
- 為替ヘッジなし：目論見書又は投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。
6. インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分
- 日経225
TOPIX
その他の指数：前記指数にあてはまらない全てのものをいう。
7. 特殊型
- ブル・ベア型：目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- 条件付運用型：目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- ロング・ショート型/絶対収益追求型：目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨若しくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。
- その他型：目論見書又は投資信託約款において、上記 から に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

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

ファンドの特色

1

日本を含む先進国および新興国の株式を実質的な主要投資対象とし、MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス(配当込み、円換算ベース)*の動きに連動する投資成果を目指します。

*MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス(配当込み、円換算ベース)は、MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス(配当込み、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 オール・カンントリー・ワールド・インデックス(配当込み、米ドルベース)は、MSCI Inc.が開発した、日本を含む世界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。MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス(配当込み、米ドルベース)は、日本を含む先進国および新興国の大型株、中型株から構成されています。

2

各マザーファンドを通じて、金融商品取引所に上場、または店頭登録されている*¹日本を含む世界の株式*²への投資を行います。

- 各マザーファンド受益証券の組入比率は、MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス(配当込み、円換算ベース)における日本、日本を除く先進国および新興国の構成比率に合わせて決定します。
- MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス(配当込み、円換算ベース)への連動性を高めるため、日本を含む先進国および新興国の株式の指数を対象指数としたETF(上場投資信託証券)、国内または海外の金融商品取引所に上場されている株価指数先物取引を活用することがあります。

*¹ 上場予定、店頭登録予定を含みます。

*² DR(預託証券)もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。

投資対象資産	マザーファンド	対象インデックス
国内株式	RM MSCI ジャパン・インデックスマザーファンド	MSCI ジャパン・インデックス(配当込み)
先進国株式(除く日本)	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)

3

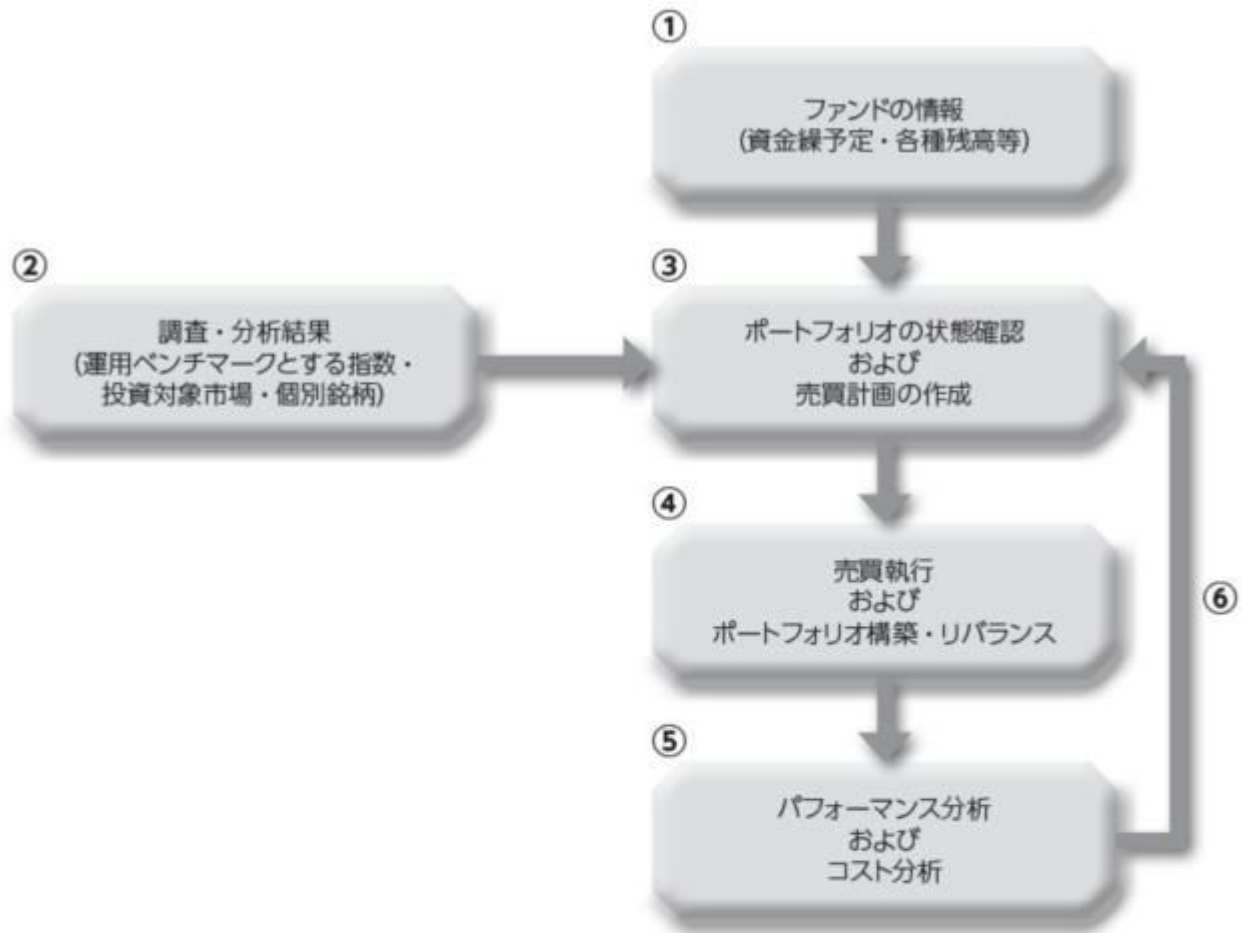
実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

4

購入時手数料のないノーロード型のファンドです。

- 換金時手数料、信託財産留保額もかかりません。

■ 運用プロセスのイメージ



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

※上記の運用プロセスおよびイメージ図は、今後変更になる場合があります。

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

■ ファンドの仕組み

当ファンドは各マザーファンドを通じて投資するファミリーファンド方式で運用をします。



■ 主な投資制限

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

■ 分配方針

原則、毎年2月15日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、以下の収益分配方針に基づいて分配を行います。

- ① 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等とします。
- ② 原則として、基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。
- ③ 留保金は、運用の基本方針に基づいて運用します。

★将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

■ 当ファンドが対象とするインデックスの著作権等について

MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス(配当込み、円換算ベース)は、MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス(配当込み、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 オール・カンントリー・ワールド・インデックス(配当込み、米ドルベース)は、MSCI Inc.が開発した、日本を含む世界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。

信託金限度額

- ・ 5,000億円を限度として信託金を追加することができます。
- ・ 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。

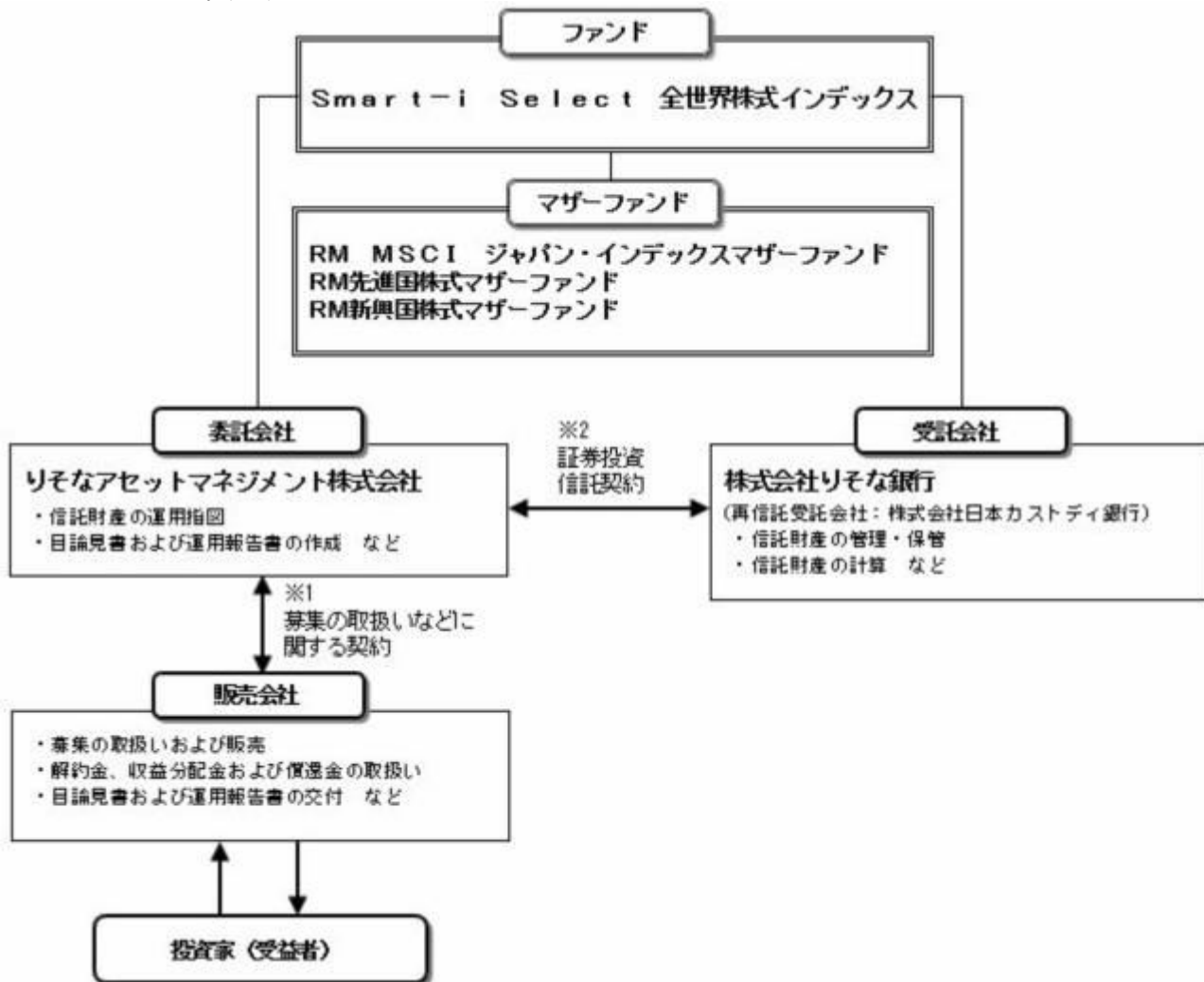
(2) 【ファンドの沿革】

2022年4月27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】

ファンドの仕組み



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

委託会社の概況（2024年2月末現在）

- 資本金
1,000百万円
- 沿革
2015年8月3日： りそなアセットマネジメント株式会社設立
2020年1月1日： 株式会社りそな銀行の資産運用事業に関する権利義務の一部を承継
- 大株主の状況

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

2 【投資方針】

(1) 【投資方針】

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およびRM MSCI ジャパン・インデックスマザーファンド（以下、各々を「マザーファンド」といいます。）の各受益証券を主要投資対象とします。

主として、各マザーファンド受益証券への投資を通じ、実質的に日本を含む先進国および新興国の金融商品取引所に上場または店頭登録されている株式^{*}に投資し、MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス（配当込み、円

換算ベース）への連動性を高めるため、日本を含む先進国および新興国の株式の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）、国内外の金融商品取引所に上場されている株価指数先物取引を活用することがあります。

* 上場予定、店頭登録予定を含みます。

* DR（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書を含みます。

各マザーファンド受益証券の組入比率は、MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス（配当込み、円換算ベース）における日本、日本を除く先進国および新興国の構成比率に合わせて決定し、各マザーファンド受益証券の組入比率の合計は、原則として高位を保ちます。

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

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

（２）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

有価証券の指図範囲

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

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

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

金融商品の指図範囲

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

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

6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの

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

その他の投資対象と指図範囲

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

《参考情報》

投資対象とするマザーファンドの概要

< R M M S C I ジャパン・インデックスマザーファンド >

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、M S C I ジャパン・インデックス（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
主な投資対象	M S C I ジャパン・インデックス（配当込み）に採用されている株式を主要投資対象とします。
投資方針	主として、国内の金融商品取引所上場株式（上場予定を含みます。）のうち、M S C I ジャパン・インデックス（配当込み）に採用されている株式に投資し、M S C I ジャパン・インデックス（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、M S C I ジャパン・インデックス（配当込み）への連動性を高めるため、国内株式の指数を対象指数としたE T F（上場投資信託証券）、国内株式を対象とした株価指数先物取引を活用することがあります。株式（E T F（上場投資信託証券）、株価指数先物取引を含みます。）の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。非株式割合（株式以外の資産への投資割合）は、原則として信託財産総額の50%以下を基本とします。資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	株式への投資割合には、制限を設けません。新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。外貨建資産への投資は行いません。デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入る有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
決算日	毎年2月15日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

< R M先進国株式マザーファンド >

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

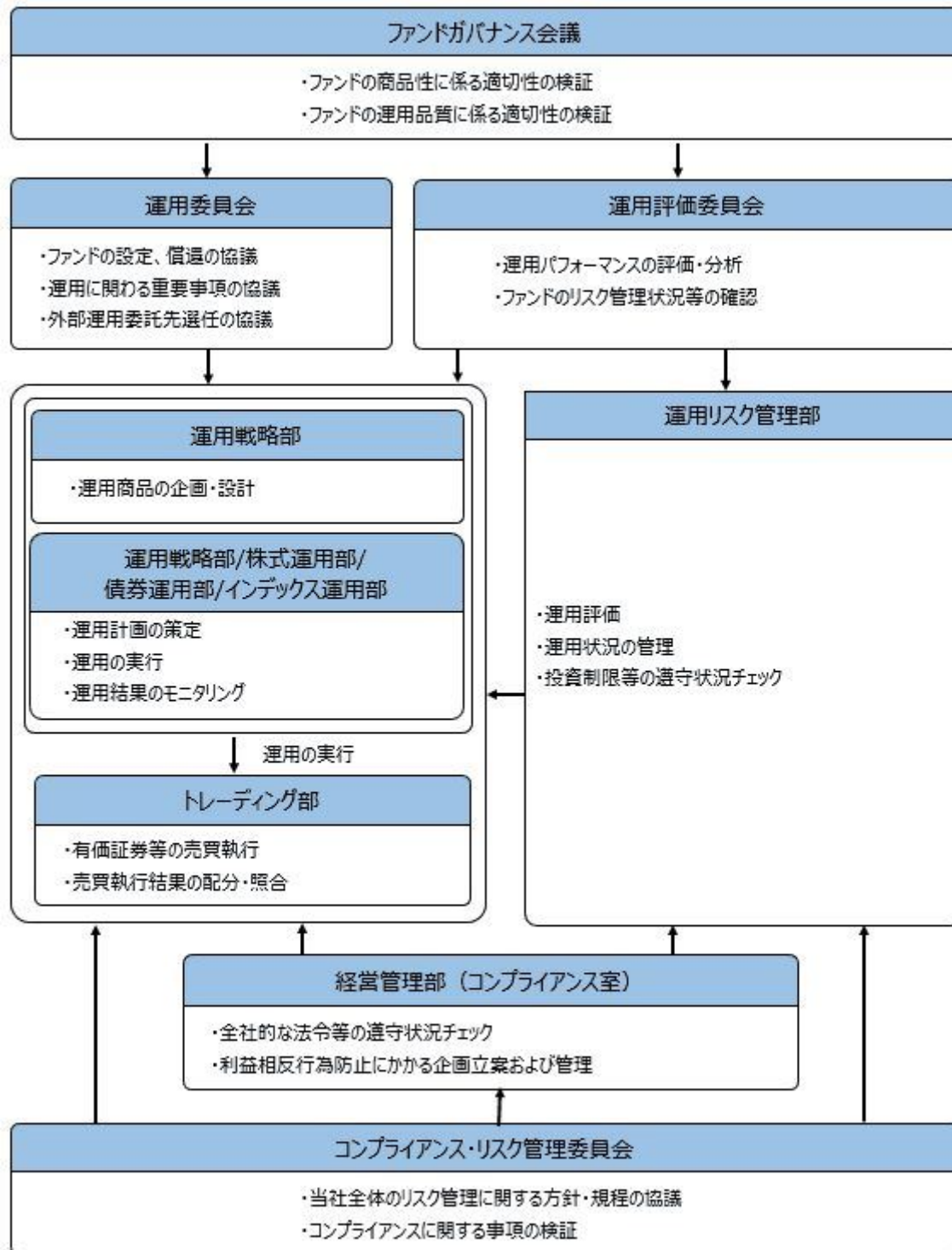
< R M新興国株式マザーファンド >

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、M S C I エマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
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（*） （*）D R（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。 ・新興国株式の指数を対象指数としたE T F（上場投資信託証券）

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

（3）【運用体制】

ファンドの運用体制は以下のとおりです。



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

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

ファンドの関係法人に対する管理体制

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

上記の運用体制は、2024年2月末現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

(4) 【分配方針】

収益分配方針

原則として毎決算時に以下の収益分配方針に基づいて分配を行います。

- 1) 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。
- 2) 原則として、基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が

少額の場合には、分配を行わないことがあります。

- 3) 留保金は、運用の基本方針に基づいて運用します。
委託会社の判断により分配を行わない場合もあります。また、将来の分配金の支払いおよびその金額について示唆、保証するものではありません。
- 収益分配金の支払い
< 分配金再投資コース（自動けいぞく投資コース）>
原則として、収益分配金は税金を差し引いた後、無手数料で自動的に再投資されます。
- < 分配金受取りコース（一般コース）>
毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して5営業日まで）から収益分配金を支払います。支払いは販売会社において行なわれます。

(5) 【投資制限】

約款に定める投資制限

- 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者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- 8) 投資する株式等の範囲
 1. 委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
 2. 前記1.の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとします。
- 9) 信用取引の指図範囲
 1. 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡または買戻しにより行うことの指図をすることができます。
 2. 前記1.の信用取引の指図は、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
 - イ) 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
 - ロ) 株式分割により取得する株券
 - ハ) 有償増資により取得する株券
 - ニ) 売出しにより取得する株券
 - ホ) 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限り、）の行使により取得可能な株券
 - ヘ) 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債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るときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- 12) 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図
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るときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- 13) 直物為替先渡取引の運用指図
1. 委託者は、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るときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- 14) 有価証券の貸付けの指図および範囲
1. 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式、公社債および投資信託証券を次の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。
 - イ) 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 - ロ) 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
 - ハ) 投資信託証券の貸付けは、貸付時点において、貸付投資信託証券の時価合計額が、信託財産で保有する投資信託証券の時価合計額を超えないものとします。
 2. 前記1.に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかにその超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
 3. 委託者は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。
- 15) 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限
外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。
- 16) 外国為替予約取引の指図および範囲
委託者は、信託財産に属する外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。
- 17) 資金の借入れ
1. 委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
 2. 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から、信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間、または解約代金の入金日までの間、もしくは償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。
 3. 収益分配金の再投資にかかる借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
 4. 借入金の利息は信託財産中から支弁します。
- 法令による投資制限
同一法人の発行する株式(投資信託及び投資法人に関する法律)
同一法人の発行する株式について、委託会社が運用の指図を行なう投資信託全体で、当該株式の議決権の過半数を保有することとなる取引は行ないません。

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

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

市場リスク

・株価変動リスク

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

・為替変動リスク

為替相場は、各国の経済状況、金利動向、政治情勢等のさまざまな要因により変動します。当ファンドは、実質的に外貨建資産に投資を行いますので、投資先の通貨に対して円高となった場合に

は、基準価額の下落要因となります。

信用リスク

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

流動性リスク

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

カントリーリスク

投資対象国・地域（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）

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

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

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

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

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

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

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

（2）リスク管理体制

委託会社における投資リスクに対する管理体制

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

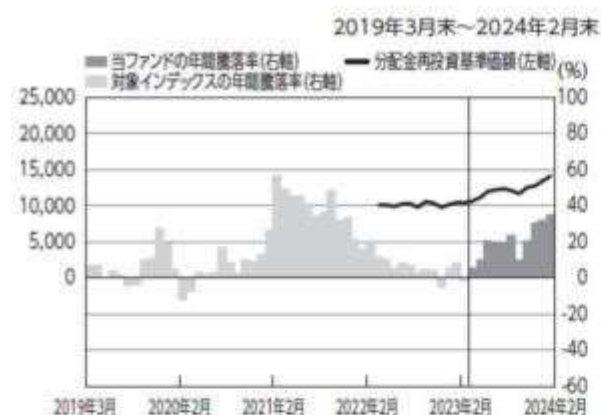
運用評価委員会は、運用実績、流動性リスクを含む運用リスクの状況、主な投資制限等の遵守状況および運用事務状況等を確認することを通じ、信託財産の適切な運用に寄与することを目的に運用部門に対する管理・指導、改善提案等を行います。なお、流動性リスクについては、緊急時対応策の有効性検証結果や流動性リスク管理プロセスの見直し結果についても確認を行います。

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

上記体制は2024年2月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

【参考情報】

ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

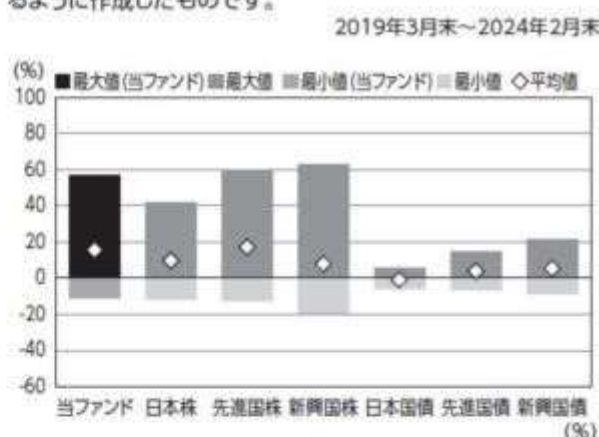


- ◆ 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- ◆ 年間騰落率は、2019年3月から2024年2月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。なお、2023年3月までは、対象インデックスの騰落率を表示しております。

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

ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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



(%)	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	56.8	42.1	59.8	62.7	5.4	14.8	21.5
最小値	△11.4	△11.4	△12.4	△19.4	△5.5	△6.1	△8.8
平均値	15.6	9.9	17.3	8.0	△0.7	4.1	5.6

- ◆ 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3月から2024年2月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。なお、当ファンドの設定日以前の年間騰落率につきましては、当ファンドの対象インデックスを用いて算出しております。
- ◆ 決算日に対応した数値とは異なります。
- ◆ 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

各資産クラスの指数

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

○代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

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

東証株価指数(TOPIX、配当込み)

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

MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み、円ベース)

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

MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)

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

NOMURA-BPI国債

NOMURA-BPI国債は、野村フィデュシャリー・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、野村フィデュシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

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

JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(円ベース)

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金(解約)手数料】

換金手数料

ありません。
信託財産留保額
ありません。

(3) 【信託報酬等】

信託報酬

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年0.1144%（税抜0.104%）の率を乗じて得た額とします。

信託報酬の配分

信託報酬の配分（年率）は、以下の通りとします。

信託報酬 = 日々の純資産総額 × 信託報酬率		
委託会社	販売会社	受託会社
0.042%	0.042%	0.020%

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

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

支払時期

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

(4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

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

少額投資非課税制度「愛称：NISA(ニーサ)」をご利用の場合

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。

法人受益者の場合

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

2) 益金不算入制度の適用
益金不算入制度は適用されません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

個別元本

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

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

普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

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

2) 受益者が収益分配金を受け取る際

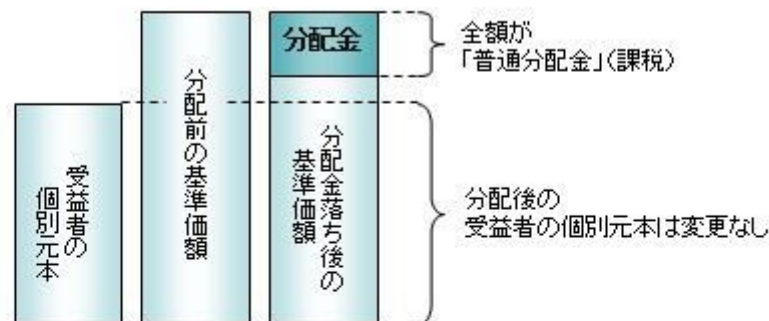
イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分が元本払戻金(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。

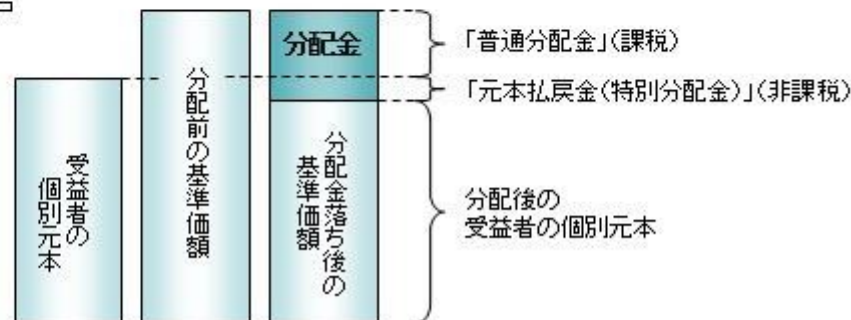
ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

<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2月末現在のもので、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	②
	運用管理費用の比率	その他費用の比率
0.17%	0.12%	0.05%

※対象期間は2023年2月16日～2024年2月15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】

【Smart-i Select 全世界株式インデックス】

以下の運用状況は2024年 2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	2,545,288,435	99.83
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		4,298,549	0.17
合計(純資産総額)		2,549,586,984	100.00

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	RM先進国株式マザーファンド	726,771,893	2.9103	2,115,153,517	2.9609	2,151,898,897	84.40
日本	親投資信託受益証券	RM新興国株式マザーファンド	135,295,739	1.8425	249,295,904	1.8769	253,936,572	9.96
日本	親投資信託受益証券	RM M S C I ジャパン・インデックスマザーファンド	95,008,153	1.4249	135,377,714	1.4678	139,452,966	5.47

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.83
合計	99.83

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3)【運用実績】

【純資産の推移】

期別	純資産総額(百万円)		1口当たり純資産額(円)	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き

第1計算期間末 (2023年 2月15日)	413	413	1.0526	1.0526
第2計算期間末 (2024年 2月15日)	2,175	2,175	1.3862	1.3862
2023年 2月末日	420		1.0449	
3月末日	520		1.0414	
4月末日	496		1.0656	
5月末日	560		1.1149	
6月末日	691		1.2001	
7月末日	763		1.2201	
8月末日	888		1.2360	
9月末日	926		1.2084	
10月末日	972		1.1691	
11月末日	1,126		1.2560	
12月末日	1,290		1.2748	
2024年 1月末日	1,931		1.3457	
2月末日	2,549		1.4126	

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2022年 4月27日～2023年 2月15日	0.0000
第2期	2023年 2月16日～2024年 2月15日	0.0000

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1期	2022年 4月27日～2023年 2月15日	5.26
第2期	2023年 2月16日～2024年 2月15日	31.69

(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	2022年 4月27日～2023年 2月15日	497,264,368	104,525,604
第2期	2023年 2月16日～2024年 2月15日	1,460,615,787	283,693,962

(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 MSCI ジャパン・インデックスマザーファンド

以下の運用状況は2024年 2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	1,132,175,020	96.19
投資証券	日本	9,050,100	0.77
コール・ローン等・その他資産（負債控除後）		35,773,129	3.04

合計(純資産総額)	1,176,998,249	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	34,853,000	2.96

(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	20,800	3,392.33	70,560,664	3,621.00	75,316,800	6.40
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	21,800	1,406.53	30,662,392	1,542.00	33,615,600	2.86
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	900	35,210.00	31,689,000	36,870.00	33,183,000	2.82
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	2,500	13,679.39	34,198,487	12,945.00	32,362,500	2.75
日本	株式	キーエンス	電気機器	400	67,170.00	26,868,000	70,040.00	28,016,000	2.38
日本	株式	日立製作所	電気機器	1,800	12,159.71	21,887,487	12,665.00	22,797,000	1.94
日本	株式	信越化学工業	化学	3,500	6,145.11	21,507,894	6,387.00	22,354,500	1.90
日本	株式	三菱商事	卸売業	6,800	2,970.80	20,201,491	3,205.00	21,794,000	1.85
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	2,500	7,792.95	19,482,392	8,344.00	20,860,000	1.77
日本	株式	第一三共	医薬品	3,600	4,794.13	17,258,895	4,974.00	17,906,400	1.52
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	2,000	8,516.39	17,032,791	8,790.00	17,580,000	1.49
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	2,800	5,973.60	16,726,094	6,044.00	16,923,200	1.44
日本	株式	任天堂	その他製品	2,000	8,950.00	17,900,000	8,400.00	16,800,000	1.43
日本	株式	三井物産	卸売業	2,500	6,072.03	15,180,093	6,553.00	16,382,500	1.39
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	9,100	1,724.15	15,689,842	1,782.00	16,216,200	1.38
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	3,500	4,367.25	15,285,396	4,376.00	15,316,000	1.30
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	2,300	6,629.82	15,248,593	6,516.00	14,986,800	1.27
日本	株式	HOYA	精密機器	700	18,325.00	12,827,500	19,485.00	13,639,500	1.16
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	3,100	4,317.32	13,383,696	4,387.00	13,599,700	1.16
日本	株式	KDDI	情報・通信業	2,900	4,511.51	13,083,394	4,554.00	13,206,600	1.12
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	4,700	2,670.78	12,552,694	2,801.00	13,164,700	1.12
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	300	41,630.00	12,489,000	43,260.00	12,978,000	1.10
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	2,100	5,301.09	11,132,295	5,363.00	11,262,300	0.96
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	5,600	1,946.94	10,902,896	1,972.50	11,046,000	0.94
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	58,600	181.05	10,609,850	182.30	10,682,780	0.91
日本	株式	ダイキン工業	機械	500	21,500.00	10,750,000	21,175.00	10,587,500	0.90
日本	株式	アドバンテスト	電気機器	1,500	7,035.99	10,553,993	6,910.00	10,365,000	0.88
日本	株式	村田製作所	電気機器	3,400	3,019.23	10,265,394	3,023.00	10,278,200	0.87
日本	株式	デンソー	輸送用機器	3,700	2,621.67	9,700,197	2,754.00	10,189,800	0.87

日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	4,400	2,068.36	9,100,796	2,230.00	9,812,000	0.83
----	----	-----------------	-----	-------	----------	-----------	----------	-----------	------

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率 (%)
株式	国内	鉱業	0.32
		建設業	1.32
		食料品	2.68
		繊維製品	0.16
		化学	5.00
		医薬品	5.10
		石油・石炭製品	0.46
		ゴム製品	0.60
		ガラス・土石製品	0.29
		鉄鋼	0.77
		非鉄金属	0.43
		金属製品	0.14
		機械	4.60
		電気機器	20.15
		輸送用機器	11.12
		精密機器	2.52
		その他製品	2.11
		電気・ガス業	1.01
		陸運業	2.28
		海運業	0.85
		空運業	0.15
		情報・通信業	6.85
		卸売業	6.25
		小売業	3.44
		銀行業	7.10
		証券、商品先物取引業	0.84
保険業	3.09		
その他金融業	1.09		
不動産業	1.61		
サービス業	3.87		
投資証券			0.77
合計			96.96

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率 (%)
-------	-----	----	----	----	----	---------	--------	-------------

株価指数先物取引	大阪取引所	ミニTOPIX先物	買建	13日本円	34,091,770	34,853,000	2.96
----------	-------	-----------	----	-------	------------	------------	------

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

R M先進国株式マザーファンド

以下の運用状況は2024年 2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	180,347,612,349	68.11
	カナダ	8,331,355,337	3.15
	パナマ	67,919,072	0.03
	ドイツ	6,047,737,414	2.28
	イタリア	1,373,458,890	0.52
	フランス	7,808,438,915	2.95
	オランダ	5,128,342,088	1.94
	スペイン	1,743,429,797	0.66
	ベルギー	538,144,374	0.20
	オーストリア	119,806,289	0.05
	ルクセンブルク	128,244,821	0.05
	フィンランド	725,835,602	0.27
	アイルランド	4,828,547,502	1.82
	ポルトガル	115,959,955	0.04
	イギリス	9,265,829,834	3.50
	スイス	7,643,283,926	2.89
	スウェーデン	2,226,232,839	0.84
	ノルウェー	421,255,341	0.16
	デンマーク	2,538,588,158	0.96
	ケイマン	337,262,396	0.13
	リベリア	128,417,591	0.05
	オーストラリア	4,651,904,424	1.76
	バミューダ	320,019,734	0.12
	ニュージーランド	191,084,574	0.07
	香港	1,076,545,692	0.41
	シンガポール	726,222,869	0.27
	イスラエル	516,981,294	0.20
キュラソー	293,799,003	0.11	
ジャージー	762,193,308	0.29	
マン島	29,479,894	0.01	
小計		248,433,933,282	93.82
新株予約権証券	カナダ	0	0.00
投資証券	アメリカ	4,204,816,889	1.59
	カナダ	15,720,550	0.01

	フランス	92,054,089	0.03
	ベルギー	16,664,109	0.01
	イギリス	80,844,489	0.03
	オーストラリア	310,351,777	0.12
	香港	59,084,025	0.02
	シンガポール	94,421,096	0.04
	小計	4,873,957,024	1.84
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		11,481,009,733	4.34
合計(純資産総額)		264,788,900,039	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	9,339,762,090	3.53
	買建	ドイツ	2,094,868,886	0.79

(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		336,919,444	0.13
	売建		276,299,894	0.10

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	200,291	60,653.71	12,148,393,271	61,431.17	12,304,110,951	4.65
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	443,671	29,305.31	13,001,918,411	27,334.55	12,127,547,754	4.58
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	70,093	92,454.12	6,480,387,011	117,014.84	8,201,921,327	3.10
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	263,558	23,635.60	6,229,352,229	26,090.01	6,876,232,753	2.60
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	63,104	58,866.76	3,714,728,591	72,927.29	4,602,003,923	1.74
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	168,448	22,404.62	3,774,014,946	20,548.37	3,461,332,605	1.31
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	148,242	22,653.23	3,358,160,789	20,706.57	3,069,584,551	1.16
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	22,910	95,479.57	2,187,437,155	114,153.61	2,615,259,407	0.99
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	81,128	31,313.74	2,540,421,594	30,441.36	2,469,647,206	0.93
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	12,597	188,920.59	2,379,832,709	194,276.91	2,447,306,253	0.92

アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	37,149	56,740.81	2,107,864,548	62,097.13	2,306,846,424	0.87
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	82,493	25,689.23	2,119,182,063	27,780.53	2,291,699,641	0.87
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア 機器・サービス	26,306	77,328.36	2,034,199,946	75,075.84	1,974,945,247	0.75
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	45,636	40,929.50	1,867,858,913	43,035.87	1,963,985,059	0.74
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	113,749	15,006.73	1,707,000,758	15,717.89	1,787,894,770	0.68
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	金融サービス	23,901	66,098.92	1,579,830,502	72,148.32	1,724,417,223	0.65
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	92,752	15,877.50	1,472,669,880	18,266.78	1,694,281,306	0.64
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	68,386	23,950.50	1,637,879,112	24,340.73	1,664,565,743	0.63
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	11,453	126,649.34	1,450,515,005	141,929.54	1,625,519,136	0.61
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	一般消費財・サービス流通・小売り	28,411	52,323.17	1,486,553,609	56,894.49	1,616,429,603	0.61
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	66,925	22,919.92	1,533,915,672	24,114.73	1,613,878,539	0.61
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	12,583	103,436.46	1,301,540,998	112,695.13	1,418,042,861	0.54
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	72,083	17,911.64	1,291,125,438	19,314.38	1,392,238,980	0.53
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	50,142	24,743.02	1,240,664,880	26,819.26	1,344,771,335	0.51
アメリカ	株式	SALESFORCE INC	ソフトウェア・サービス	27,641	41,717.50	1,153,113,683	45,166.34	1,248,442,967	0.47
アメリカ	株式	ADVANCED MICRO DEVICES	半導体・半導体製造装置	45,878	26,862.95	1,232,418,617	26,599.28	1,220,321,850	0.46
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	75,907	16,344.52	1,240,663,510	15,783.81	1,198,101,931	0.45
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	51,533	21,835.09	1,125,228,023	22,953.06	1,182,840,443	0.45
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需品流通・小売り	126,273	8,060.84	1,017,867,080	8,982.94	1,134,303,464	0.43
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	12,605	82,095.56	1,034,814,570	89,871.64	1,132,832,042	0.43

口. 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	4.28
		素材	3.57
		資本財	6.67
		商業・専門サービス	1.56
		運輸	1.73

	自動車・自動車部品	1.71
	耐久消費財・アパレル	1.51
	消費者サービス	1.99
	メディア・娯楽	5.97
	一般消費財・サービス流通・小売り	4.68
	生活必需品流通・小売り	1.69
	食品・飲料・タバコ	3.16
	家庭用品・パーソナル用品	1.54
	ヘルスケア機器・サービス	4.15
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.77
	銀行	5.12
	金融サービス	6.52
	保険	2.99
	ソフトウェア・サービス	9.95
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.96
	電気通信サービス	1.08
	公益事業	2.35
	半導体・半導体製造装置	7.56
	不動産管理・開発	0.31
新株予約権証券		
投資証券		1.84
合計		95.66

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	244	米ドル	60,647,212.5	9,137,715,514	61,988,200	9,339,762,090	3.53
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	STX E6002403	買建	519	ユーロ	12,620,155	2,060,240,302	12,832,275	2,094,868,886	0.79

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

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	買建	1,770,000.00	266,554,566	266,643,243	0.10
	カナダドル	買建	140,000.00	15,607,438	15,522,374	0.01
	ユーロ	買建	170,000.00	27,771,540	27,749,151	0.01
	スイスフラン	買建	70,000.00	11,975,320	12,002,221	0.00
	スウェーデンクローナ	買建	410,000.00	6,002,974	5,977,103	0.00
	デンマーククローネ	買建	210,000.00	4,602,318	4,598,496	0.00
	香港ドル	買建	230,000.00	4,428,052	4,426,856	0.00

米ドル	売建	1,290,000.00	194,080,500	194,333,211	0.07
カナダドル	売建	60,000.00	6,672,960	6,652,446	0.00
ユーロ	売建	260,000.00	42,420,340	42,432,810	0.02
英ポンド	売建	80,000.00	15,262,800	15,257,656	0.01
スイスフラン	売建	40,000.00	6,846,400	6,858,412	0.00
オーストラリアドル	売建	110,000.00	10,836,540	10,765,359	0.00

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

R M新興国株式マザーファンド

以下の運用状況は2024年 2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	113,471,745	0.33
	メキシコ	797,525,968	2.34
	ブラジル	1,771,029,521	5.19
	チリ	151,681,501	0.44
	コロンビア	36,617,961	0.11
	ペルー	15,802,972	0.05
	オランダ	18,832,871	0.06
	ルクセンブルク	36,719,208	0.11
	ギリシャ	165,085,331	0.48
	イギリス	33,881,348	0.10
	トルコ	226,053,237	0.66
	チェコ	44,864,327	0.13
	キプロス	0	0.00
	ハンガリー	86,645,723	0.25
	ポーランド	296,052,375	0.87
	ロシア	0	0.00
	ケイマン	4,617,929,083	13.53
	バミューダ	139,357,964	0.41
	香港	282,541,490	0.83
	シンガポール	6,687,354	0.02
	マレーシア	432,790,761	1.27
	タイ	522,193,928	1.53
	フィリピン	208,625,563	0.61
	インドネシア	621,636,110	1.82
韓国	4,020,478,581	11.78	
台湾	5,218,403,608	15.29	
中国	3,338,781,437	9.78	
インド	5,684,132,757	16.65	
カザフスタン	0	0.00	
カタール	281,836,511	0.83	

	エジプト	34,261,990	0.10
	南アフリカ	801,041,232	2.35
	英ヴァージン諸島	0	0.00
	アラブ首長国連邦	403,644,575	1.18
	クウェート	271,097,404	0.79
	サウジアラビア	1,410,896,413	4.13
	小計	32,090,600,849	94.03
投資証券	メキシコ	43,406,102	0.13
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		1,994,971,458	5.85
合計(純資産総額)		34,128,978,409	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	1,991,224,567	5.83

(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(%)
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	746,000	2,987.65	2,228,790,630	3,325.97	2,481,173,620	7.27
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	144,760	8,362.00	1,210,483,120	8,271.60	1,197,396,816	3.51
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	202,000	5,424.65	1,095,779,300	5,332.25	1,077,114,500	3.16
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	一般消費財・サービス流通・小売り	493,240	1,397.54	689,327,561	1,429.31	704,994,097	2.07
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	92,326	4,918.58	454,113,048	5,327.58	491,874,844	1.44
ケイマン	株式	PDD HOLDINGS INC	一般消費財・サービス流通・小売り	18,115	21,771.81	394,396,429	18,835.25	341,200,675	1.00
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	100,802	3,065.98	309,057,118	3,058.38	308,291,577	0.90
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	157,276	1,828.53	287,584,828	1,914.54	301,112,137	0.88
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	16,574	15,989.50	265,009,973	17,854.00	295,912,196	0.87
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	2,912,000	88.16	256,736,480	93.74	272,992,720	0.80
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	45,800	4,460.04	204,269,832	5,312.97	243,334,255	0.71
ケイマン	株式	MEITUAN	消費者サービス	153,810	1,353.27	208,147,228	1,508.23	231,982,010	0.68
インド	株式	HDFC BANK LIMITED	銀行	85,145	2,664.29	226,851,568	2,579.20	219,606,154	0.64
サウジアラビア	株式	AL RAJHI BANK	銀行	59,527	3,537.09	210,552,714	3,581.36	213,187,617	0.62

インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	27,802	7,030.49	195,461,795	7,537.67	209,562,538	0.61
ブラジル	株式	VALE SA	素材	103,404	2,117.43	218,950,915	2,021.70	209,052,705	0.61
ケイマン	株式	NETEASE INC	メディア・娯楽	58,600	2,999.15	175,750,190	3,401.47	199,326,435	0.58
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	378,800	478.88	181,400,691	493.17	186,815,637	0.55
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	エネルギー	144,500	1,147.47	165,809,751	1,224.71	176,971,706	0.52
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	25,017	6,847.79	171,311,412	6,938.19	173,572,949	0.51
インドネシア	株式	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	銀行	1,682,000	91.44	153,802,080	96.00	161,472,000	0.47
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	銀行	147,100	981.47	144,374,313	1,054.17	155,068,707	0.45
中国	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	1,971,000	71.99	141,902,145	78.15	154,043,505	0.45
サウジアラビア	株式	THE SAUDI NATIONAL BANK	銀行	89,368	1,736.35	155,174,663	1,704.16	152,297,728	0.45
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	2,405,000	56.59	136,110,975	59.48	143,055,413	0.42
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	エネルギー	113,000	1,188.66	134,319,693	1,260.15	142,398,044	0.42
インド	株式	BHARTI AIRTEL LTD	電気通信サービス	68,294	2,177.60	148,717,595	2,065.61	141,068,940	0.41
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	5,667	24,913.89	141,187,071	24,736.22	140,180,173	0.41
ケイマン	株式	BAIDU INC-CLASS A	メディア・娯楽	68,280	2,023.17	138,142,389	2,052.05	140,113,974	0.41
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	203,000	635.25	128,955,751	684.33	138,920,513	0.41

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率 (%)
株式	国外	エネルギー	5.23
		素材	6.67
		資本財	4.55
		商業・専門サービス	0.06
		運輸	1.87
		自動車・自動車部品	3.75
		耐久消費財・アパレル	1.12
		消費者サービス	2.22
		メディア・娯楽	5.45
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.89
		生活必需品流通・小売り	1.37
		食品・飲料・タバコ	3.34
		家庭用品・パーソナル用品	0.73
		ヘルスケア機器・サービス	1.01
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.46
		銀行	16.34
金融サービス	2.66		

	保険	2.42
	ソフトウェア・サービス	2.64
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8.10
	電気通信サービス	2.66
	公益事業	2.65
	半導体・半導体製造装置	10.49
	不動産管理・開発	1.36
投資証券		0.13
合 計		94.15

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	260	米ドル	12,921,955	1,946,950,950	13,215,800	1,991,224,567	5.83

(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。

参考情報

運用実績

2024年2月29日現在

基準価額・純資産の推移



※基準価額は1万口当たり、運用管理費用(信託報酬)控除後の価額です。
※分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を再投資したも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2月15日	0円
2024年2月15日	0円
-	-
-	-
-	-
設定来累計	0円

主要な資産の状況

■ポートフォリオの状況

資産	組入比率
国内株式	5.5%
先物指株式	84.4%
新興国株式	10.0%
現金等	0.2%
合計	100.0%

※各資産を主な投資対象とするマザー・ファンドの組入比率です。

■国・地域別配分

国・地域	組入比率
アメリカ	62.4%
日本	5.3%
中国	2.6%
カナダ	2.6%
イギリス	2.4%
その他	24.7%
合計	100.0%

※国・地域は発行国もしくは投資国を表示しています。

※先物の組入比率は「その他」に含みます。

■組入上位銘柄

	銘柄名	国・地域	業種	組入比率
1	MICROSOFT CORP	アメリカ	ソフトウェア・サービス	3.9%
2	APPLE INC	アメリカ	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.9%
3	NVIDIA CORP	アメリカ	半導体・半導体製造装置	2.6%
4	AMAZON.COM INC	アメリカ	一般消費財・サービス流通・小売り	2.2%
5	META PLATFORMS INC-CLASS A	アメリカ	メディア・娯楽	1.5%
6	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	メディア・娯楽	1.1%
7	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	メディア・娯楽	1.0%
8	ELI LILLY & CO	アメリカ	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	0.8%
9	TESLA INC	アメリカ	自動車・自動車部品	0.8%
10	BROADCOM INC	アメリカ	半導体・半導体製造装置	0.8%

※国・地域は発行国もしくは投資国を表示しています。

※海外株式の業種は世界産業分類基準(GICS)の分類を基準としています。

※国内株式の業種は東証33業種の分類を基準としています。

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

年間収益率の推移(暦年ベース)



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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

(1) 申込方法

販売会社所定の方法でお申し込みください。

- (2) コースの選択
収益分配金の受取方法によって、<分配金再投資コース（自動けいぞく投資コース）>と<分配金受取りコース（一般コース）>の2通りがあります。ただし、販売会社によって取扱コースは異なります。
<分配金再投資コース（自動けいぞく投資コース）>
収益分配金を自動的に再投資するコースです。
<分配金受取りコース（一般コース）>
収益分配金を再投資せず、その都度受け取るコースです。
- (3) 申込みの受付
販売会社の営業日に受け付けます。
- (4) 取扱時間
原則として、午後3時^{*}までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の取扱いとなります。
^{*}2024年11月5日以降は原則として、午後3時30分までとする予定です。
販売会社によっては異なる場合がありますので、詳しくは販売会社にお問い合わせください。
- (5) 取得申込不可日
販売会社の営業日であっても、取得申込日が下記のいずれかに該当する場合は、取得の申込みの受付は行ないません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
・ニューヨークの銀行の休業日
・ニューヨーク証券取引所の休業日
・ロンドンの銀行の休業日
・ロンドン証券取引所の休業日
・香港の銀行の休業日
・香港証券取引所の休業日
- (6) 申込金額
取得申込受付日の翌営業日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額です。
- (7) 申込単位
販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。
- (8) 申込代金の支払い
取得申込者は、申込金額を販売会社が指定する日までに販売会社へお支払いください。
- (9) 受付の中止および取消
委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得の申込みの受付を中止すること、および既に受け付けた取得の申込みの受付を取り消すことができます。
金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場をいいます。

2【換金（解約）手続等】

- (1) 解約の受付
販売会社の営業日に受け付けます。
- (2) 取扱時間
原則として、午後3時^{*}までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の取扱いとなります。
^{*}2024年11月5日以降は原則として、午後3時30分までとする予定です。
販売会社によっては異なる場合がありますので、詳しくは販売会社にお問い合わせください。
- (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
・香港の銀行の休業日
・香港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6営業日目からお支払いします。
- (9) 受付の中止および取消
・委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止すること、および既に受け付けた解約請求の受付を取り消すことができます。
・解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日（この計算日が解約請求を受け付けない日であるときは、この計算日以降の最初の解約請求を受け付けることができる日とします。）に解約請求を受け付けたものとして取り扱います。

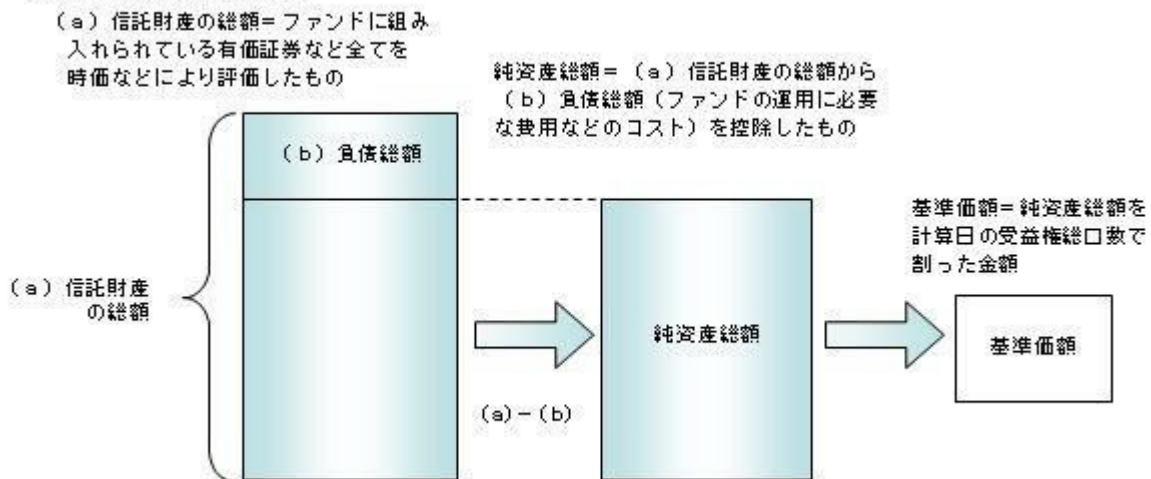
3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額の算出

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

<基準価額算出の流れ>



有価証券などの評価基準

- ・信託財産に属する資産については、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価します。
 - <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。
 - ・外貨建資産（外国通貨表示の有価証券、預金その他の資産をいいます。）の円換算については、原則としてわが国における計算日の対顧客相場の仲値によって計算します。
- 基準価額の照会方法
販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

委託会社の照会先

りそなアセットマネジメント株式会社

電話番号：0120-223351

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時）

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

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

無期限とします(2022年4月27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2月16日から翌年2月15日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

(5)【その他】

信託の終了(繰上償還)

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

償還金について

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

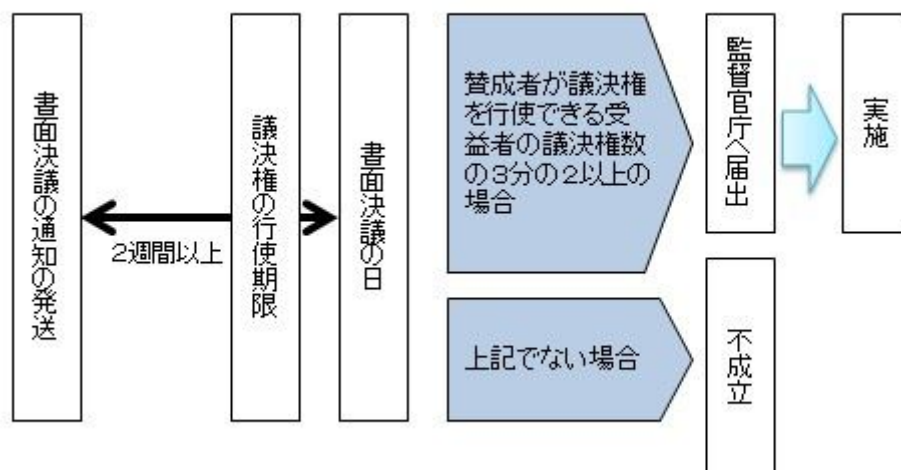
信託約款の変更など

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

書面決議

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

＜書面決議の主な流れ＞



公告

公告は電子公告により行ない、委託会社のホームページに掲載します。

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

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

運用報告書の作成

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

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

関係法人との契約について

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

他の受益者の氏名などの開示の請求の制限

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

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金・償還金受領権

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

(2) 解約請求権

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

(3) 帳簿閲覧権

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

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期計算期間(2023年 2月16日から2024年 2月15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】

【Smart-i Select 全世界株式インデックス】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 2023年 2月15日現在	第2期 2024年 2月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,226,693	7,667,018
親投資信託受益証券	412,678,855	2,172,039,435
流動資産合計	413,905,548	2,179,706,453
資産合計	413,905,548	2,179,706,453
負債の部		
流動負債		
未払解約金	377,236	3,125,199
未払受託者報酬	21,988	131,957
未払委託者報酬	92,308	554,166
未払利息	3	20
その他未払費用	6,654	40,155
流動負債合計	498,189	3,851,497
負債合計	498,189	3,851,497
純資産の部		
元本等		
元本	392,738,764	1,569,660,589
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	20,668,595	606,194,367
（分配準備積立金）	15,537,581	279,566,267
元本等合計	413,407,359	2,175,854,956
純資産合計	413,407,359	2,175,854,956
負債純資産合計	413,905,548	2,179,706,453

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期		第2期	
	自	2022年 4月27日	自	2023年 2月16日
	至	2023年 2月15日	至	2024年 2月15日
営業収益				
有価証券売買等損益		17,155,035		296,328,480
営業収益合計		17,155,035		296,328,480
営業費用				
支払利息		1,053		4,560
受託者報酬		36,973		194,372
委託者報酬		155,153		816,248
その他費用		11,153		59,364
営業費用合計		204,332		1,074,544
営業利益又は営業損失（ ）		16,950,703		295,253,936
経常利益又は経常損失（ ）		16,950,703		295,253,936
当期純利益又は当期純損失（ ）		16,950,703		295,253,936
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（ ）		1,413,122		25,854,818
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		-		20,668,595
剰余金増加額又は欠損金減少額		5,458,258		344,944,580
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		5,458,258		344,944,580
剰余金減少額又は欠損金増加額		327,244		28,817,926
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		327,244		28,817,926
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		20,668,595		606,194,367

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

第1期 2023年 2月15日現在	第2期 2024年 2月15日現在
1. 投資信託財産に係る元本の状況	1. 投資信託財産に係る元本の状況
期首元本額 1,000,000円	期首元本額 392,738,764円
期中追加設定元本額 496,264,368円	期中追加設定元本額 1,460,615,787円
期中一部解約元本額 104,525,604円	期中一部解約元本額 283,693,962円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 392,738,764口	2. 計算期間の末日における受益権の総数 1,569,660,589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 1.0526円	3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1.3862円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,526円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (13,862円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 2022年 4月27日 至 2023年 2月15日	第2期 自 2023年 2月16日 至 2024年 2月15日
分配金の計算過程	分配金の計算過程
A 費用控除後の配当等収益額 3,004,593円	A 費用控除後の配当等収益額 16,409,252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 12,532,988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 252,989,866円
C 収益調整金額 5,131,014円	C 収益調整金額 326,628,100円
D 分配準備積立金額 0円	D 分配準備積立金額 10,167,149円
E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D) 20,668,595円	E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D) 606,194,367円
F 当ファンドの期末残存口数 392,738,764口	F 当ファンドの期末残存口数 1,569,660,589口
G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000) 526円	G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000) 3,861円
H 10,000口当たり分配金額 0円	H 10,000口当たり分配金額 0円
I 収益分配金金額 (I=F×H/10,000) 0円	I 収益分配金金額 (I=F×H/10,000) 0円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

第1期 自 2022年 4月27日 至 2023年 2月15日	第2期 自 2023年 2月16日 至 2024年 2月15日
1. 金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	1. 金融商品に対する取組方針 同左
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、株価変動リスク、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。	2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制 運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。	3. 金融商品に係るリスク管理体制 同左

金融商品の時価等に関する事項

第1期 2023年 2月15日現在	第2期 2024年 2月15日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左
2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券	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。	同左
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。	3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明 同左

（関連当事者との取引に関する注記）

第1期 自 2022年 4月27日 至 2023年 2月15日	第2期 自 2023年 2月16日 至 2024年 2月15日
該当事項はありません。	同左

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	第1期 自 2022年 4月27日 至 2023年 2月15日	第2期 自 2023年 2月16日 至 2024年 2月15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	14,979,674	292,819,982
合計	14,979,674	292,819,982

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 M S C I ジャパン・インデックスマザーファンド	82,848,857	117,844,214	
	RM先進国株式マザーファンド	631,868,864	1,837,664,217	
	RM新興国株式マザーファンド	117,750,288	216,531,004	
合計		832,468,009	2,172,039,435	

(注) 券面総額欄の数値は口数を表しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは「RM M S C I ジャパン・インデックスマザーファンド」、「RM先進国株式マザーファンド」および「RM新興国株式マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同親投資信託の受益証券です。
なお、以下に記載した状況は監査意見の対象外となっております。

R M M S C I ジャパン・インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2024年 2月15日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	43,015,073
株式	1,060,883,660
投資証券	9,601,600
派生商品評価勘定	1,499,130
未収配当金	1,433,140
差入委託証拠金	2,100,044
流動資産合計	1,118,532,647
資産合計	1,118,532,647
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	8,580
前受金	1,475,500
未払利息	116
流動負債合計	1,484,196
負債合計	1,484,196
純資産の部	
元本等	
元本	785,320,946
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	331,727,505
元本等合計	1,117,048,451
純資産合計	1,117,048,451
負債純資産合計	1,118,532,647

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2024年 2月15日現在

1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 2月16日
期首元本額	720,693,613円
期中追加設定元本額	72,606,946円
期中一部解約元本額	7,979,613円
期末元本額	785,320,946円
期末元本の内訳	
Smart-i Select 全世界株式インデックス	82,848,857円
Smart-i DC 全世界株式インデックス	4,634,401円

M S C I ジャパン・インデックスファンド(適格機関投資家専用)	697,837,688円
2. 計算日における受益権の総数	785,320,946口
3. 計算日における1単位当たりの純資産の額	1.4224円
1口当たり純資産額	(14,224円)
(10,000口当たり純資産額)	

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2024年 2月15日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、株価変動リスク、リートの価格変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

金融商品の時価等に関する事項

2024年 2月15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
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)

2024年 2月15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	2024年 2月15日現在	
	損益に含まれた評価差額(円)	
株式	249,323,726	
投資証券	576,398	
合計	248,747,328	

(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)

(2024年 2月15日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等	時価		評価損益
			うち1年超		

市場取引	株価指数先物取引 買建	50,299,450	-	51,790,000	1,490,550
合計		50,299,450	-	51,790,000	1,490,550

(注) 時価の算定方法

先物取引

国内先物取引について

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

(単位：円)

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
INPEX	1,800	1,933.00	3,479,400	
大成建設	300	4,695.00	1,408,500	
大林組	1,200	1,371.00	1,645,200	
清水建設	1,000	871.80	871,800	
鹿島建設	800	2,671.50	2,137,200	
大和ハウス工業	1,100	4,299.00	4,728,900	
積水ハウス	1,100	3,261.00	3,587,100	
ヤクルト本社	500	3,043.00	1,521,500	
明治ホールディングス	400	3,400.00	1,360,000	
アサヒグループホールディングス	900	5,315.00	4,783,500	
キリンホールディングス	1,500	2,104.50	3,156,750	
サントリー食品インターナショナル	300	4,716.00	1,414,800	
キッコーマン	300	9,402.00	2,820,600	
味の素	800	5,667.00	4,533,600	
日清食品ホールディングス	400	4,357.00	1,742,800	
日本たばこ産業	2,300	3,880.00	8,924,000	
東レ	2,600	676.00	1,757,600	
王子ホールディングス	1,600	551.40	882,240	
旭化成	2,400	1,010.00	2,424,000	
住友化学	2,600	298.80	776,880	
日産化学	200	6,177.00	1,235,400	
東ソー	500	1,948.50	974,250	
信越化学工業	3,400	6,138.00	20,869,200	
日本酸素ホールディングス	300	4,057.00	1,217,100	
三井化学	300	3,965.00	1,189,500	
J S R	300	4,045.00	1,213,500	
三菱ケミカルグループ	2,400	838.40	2,012,160	
積水化学工業	700	2,087.50	1,461,250	
花王	900	5,462.00	4,915,800	

日本ペイントホールディングス	1,800	1,110.50	1,998,900
富士フイルムホールディングス	700	9,279.00	6,495,300
資生堂	800	3,902.00	3,121,600
コーセー	100	8,056.00	805,600
日東電工	300	13,940.00	4,182,000
ユニ・チャーム	800	5,111.00	4,088,800
協和キリン	500	2,800.00	1,400,000
武田薬品工業	3,000	4,315.00	12,945,000
アステラス製薬	3,400	1,652.50	5,618,500
塩野義製薬	500	6,995.00	3,497,500
中外製薬	1,300	5,705.00	7,416,500
エーザイ	500	6,300.00	3,150,000
小野薬品工業	700	2,382.50	1,667,750
第一三共	3,500	4,789.00	16,761,500
大塚ホールディングス	800	5,428.00	4,342,400
出光興産	2,000	880.40	1,760,800
E N E O Sホールディングス	5,400	629.20	3,397,680
ブリヂストン	1,100	6,482.00	7,130,200
A G C	400	5,290.00	2,116,000
T O T O	200	3,658.00	731,600
日本製鉄	1,600	3,428.00	5,484,800
J F Eホールディングス	1,100	2,248.50	2,473,350
住友金属鉱山	500	3,974.00	1,987,000
住友電気工業	1,300	2,099.50	2,729,350
S U M C O	700	2,363.50	1,654,450
ディスコ	200	45,530.00	9,106,000
S M C	100	82,680.00	8,268,000
小松製作所	1,700	4,288.00	7,289,600
日立建機	200	4,167.00	833,400
クボタ	1,900	2,267.00	4,307,300
ダイキン工業	500	21,500.00	10,750,000
ダイフク	600	3,333.00	1,999,800
ホシザキ	200	5,215.00	1,043,000
マキタ	400	3,787.00	1,514,800
三菱重工業	600	10,905.00	6,543,000
イビデン	200	7,337.00	1,467,400
ブラザー工業	400	2,524.00	1,009,600
ミネベアミツミ	700	3,047.00	2,132,900
日立製作所	1,700	12,130.00	20,621,000
三菱電機	3,600	2,201.00	7,923,600
富士電機	200	8,789.00	1,757,800
安川電機	500	5,369.00	2,684,500
ニデック	800	5,622.00	4,497,600

オムロン	300	5,351.00	1,605,300
日本電気	500	9,635.00	4,817,500
富士通	300	23,070.00	6,921,000
ルネサスエレクトロニクス	2,800	2,536.00	7,100,800
セイコーエプソン	500	2,412.00	1,206,000
パナソニック ホールディングス	4,100	1,391.50	5,705,150
シャープ	500	806.10	403,050
ソニーグループ	2,400	13,710.00	32,904,000
T D K	700	7,825.00	5,477,500
ヒロセ電機	100	16,120.00	1,612,000
横河電機	400	3,128.00	1,251,200
アズビル	200	4,684.00	936,800
アドバンテスト	1,400	7,045.00	9,863,000
キーエンス	400	67,170.00	26,868,000
シスメックス	300	8,196.00	2,458,800
レーザーテック	100	42,210.00	4,221,000
ファナック	1,800	3,974.00	7,153,200
ローム	600	2,551.00	1,530,600
浜松ホトニクス	300	5,415.00	1,624,500
京セラ	2,400	2,199.00	5,277,600
村田製作所	3,200	3,019.00	9,660,800
小糸製作所	400	1,939.50	775,800
キヤノン	1,900	4,130.00	7,847,000
リコー	1,000	1,260.50	1,260,500
東京エレクトロン	900	35,210.00	31,689,000
豊田自動織機	300	14,170.00	4,251,000
デンソー	3,600	2,618.00	9,424,800
日産自動車	4,400	550.10	2,420,440
いすゞ自動車	1,100	2,080.50	2,288,550
トヨタ自動車	19,900	3,382.00	67,301,800
アイシン	300	5,192.00	1,557,600
マツダ	1,100	1,716.50	1,888,150
本田技研工業	8,700	1,721.50	14,977,050
スズキ	700	6,605.00	4,623,500
S U B A R U	1,200	3,339.00	4,006,800
ヤマハ発動機	1,700	1,380.00	2,346,000
シマノ	100	20,375.00	2,037,500
テルモ	1,300	5,432.00	7,061,600
島津製作所	400	3,831.00	1,532,400
オリンパス	2,300	2,055.00	4,726,500
H O Y A	700	18,325.00	12,827,500
朝日インテック	400	2,993.00	1,197,200
バンダイナムコホールディングス	1,100	2,647.00	2,911,700

TOPPANホールディングス	500	3,599.00	1,799,500
大日本印刷	400	4,547.00	1,818,800
ヤマハ	200	3,220.00	644,000
任天堂	2,000	8,950.00	17,900,000
東京電力ホールディングス	2,900	757.70	2,197,330
中部電力	1,200	1,822.50	2,187,000
関西電力	1,300	1,921.00	2,497,300
東京瓦斯	700	3,122.00	2,185,400
大阪瓦斯	700	3,006.00	2,104,200
東武鉄道	400	3,786.00	1,514,400
東急	900	1,705.50	1,534,950
小田急電鉄	600	2,066.50	1,239,900
京成電鉄	200	7,141.00	1,428,200
東日本旅客鉄道	600	8,818.00	5,290,800
西日本旅客鉄道	400	6,146.00	2,458,400
東海旅客鉄道	1,400	3,670.00	5,138,000
近鉄グループホールディングス	300	4,363.00	1,308,900
阪急阪神ホールディングス	400	4,277.00	1,710,800
ヤマトホールディングス	500	2,400.00	1,200,000
S Gホールディングス	600	1,866.50	1,119,900
NIPPON EXPRESSホールディングス	100	8,196.00	819,600
日本郵船	900	4,775.00	4,297,500
商船三井	600	5,215.00	3,129,000
川崎汽船	300	6,910.00	2,073,000
日本航空	300	2,753.00	825,900
ANAホールディングス	300	3,217.00	965,100
T I S	400	3,410.00	1,364,000
コーエーテクモホールディングス	200	1,819.00	363,800
ネクソン	600	2,490.00	1,494,000
野村総合研究所	700	4,128.00	2,889,600
オービック	100	22,060.00	2,206,000
L I N Eヤフー	5,000	417.60	2,088,000
トレンドマイクロ	300	8,721.00	2,616,300
日本オラクル	100	11,690.00	1,169,000
大塚商会	200	6,015.00	1,203,000
日本電信電話	56,100	181.00	10,154,100
K D D I	2,800	4,510.00	12,628,000
ソフトバンク	5,400	1,946.00	10,508,400
光通信	100	24,605.00	2,460,500
東宝	200	4,679.00	935,800
N T Tデータグループ	1,200	2,300.00	2,760,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	200	6,666.00	1,333,200
カブコン	300	5,961.00	1,788,300

SCSK	300	2,672.50	801,750
コナミグループ	200	9,842.00	1,968,400
ソフトバンクグループ	1,900	8,502.00	16,153,800
神戸物産	300	3,657.00	1,097,100
伊藤忠商事	2,200	6,635.00	14,597,000
丸紅	2,700	2,382.00	6,431,400
豊田通商	400	9,217.00	3,686,800
三井物産	2,400	6,052.00	14,524,800
住友商事	2,000	3,455.00	6,910,000
三菱商事	6,500	2,960.00	19,240,000
ミスミグループ本社	500	2,121.50	1,060,750
日本マクドナルドホールディングス	200	6,920.00	1,384,000
MonotaRO	500	1,483.00	741,500
マツキヨココカラ&カンパニー	600	2,572.00	1,543,200
ZOZO	300	3,426.00	1,027,800
セブン&アイ・ホールディングス	1,400	6,182.00	8,654,800
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	700	3,510.00	2,457,000
ゼンショーホールディングス	200	6,454.00	1,290,800
イオン	1,200	3,566.00	4,279,200
ニトリホールディングス	200	21,270.00	4,254,000
ファーストリテイリング	300	41,630.00	12,489,000
しずおかフィナンシャルグループ	900	1,394.00	1,254,600
ゆうちょ銀行	2,700	1,488.50	4,018,950
コンコルディア・フィナンシャルグループ	2,000	691.00	1,382,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	21,400	1,404.00	30,045,600
りそなホールディングス	4,000	797.60	3,190,400
三井住友トラスト・ホールディングス	1,200	2,873.00	3,447,600
三井住友フィナンシャルグループ	2,400	7,770.00	18,648,000
千葉銀行	1,000	1,093.00	1,093,000
みずほフィナンシャルグループ	4,500	2,665.00	11,992,500
SBIホールディングス	500	3,878.00	1,939,000
大和証券グループ本社	2,500	1,035.50	2,588,750
野村ホールディングス	5,600	808.70	4,528,720
かんぽ生命保険	400	2,609.50	1,043,800
SOMPOホールディングス	600	8,627.00	5,176,200
MS&ADインシュアランスグループホール ディングス	800	7,477.00	5,981,600
第一生命ホールディングス	1,800	3,200.00	5,760,000
東京海上ホールディングス	3,400	4,367.00	14,847,800
T&Dホールディングス	900	2,364.50	2,128,050
オリックス	2,200	2,986.50	6,570,300
三菱HCキャピタル	1,500	1,019.00	1,528,500
日本取引所グループ	900	3,750.00	3,375,000

大東建託	100	16,995.00	1,699,500	
ヒューリック	700	1,535.00	1,074,500	
野村不動産ホールディングス	200	3,675.00	735,000	
オープンハウスグループ	100	4,802.00	480,200	
飯田グループホールディングス	300	1,876.00	562,800	
三井不動産	1,700	3,923.00	6,669,100	
三菱地所	2,100	2,018.50	4,238,850	
住友不動産	500	4,521.00	2,260,500	
エムスリー	800	2,012.00	1,609,600	
電通グループ	400	4,170.00	1,668,000	
オリエンタルランド	2,000	5,298.00	10,596,000	
ユー・エス・エス	400	2,620.50	1,048,200	
楽天グループ	2,800	731.20	2,047,360	
リクルートホールディングス	2,700	5,971.00	16,121,700	
日本郵政	3,900	1,398.00	5,452,200	
ペイカレント・コンサルティング	200	3,081.00	616,200	
セコム	400	10,550.00	4,220,000	
合 計	355,300		1,060,883,660	

(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	G L P 投資法人	9	1,143,900	
	日本プロロジスリート投資法人	4	1,037,200	
	野村不動産マスターファンド投資法人	8	1,218,400	
	日本ビルファンド投資法人	3	1,734,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	2	1,078,000	
	日本都市ファンド投資法人	13	1,233,700	
	K D X 不動産投資法人	8	1,180,000	
	大和ハウスリート投資法人	4	976,400	
合 計		51	9,601,600	

(注) 券面総額欄の数値は口数を表しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

R M先進国株式マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2024年 2月15日現在

資産の部	
流動資産	
預金	5,664,279,236

2024年 2月15日現在

コール・ローン	1,292,452,461
株式	244,211,215,290
投資証券	4,764,149,825
派生商品評価勘定	129,385,756
未収入金	322,336
未収配当金	193,354,044
差入委託証拠金	2,540,794,121
流動資産合計	258,795,953,069
資産合計	258,795,953,069
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	6,284,656
未払解約金	84,732,500
未払利息	3,505
流動負債合計	91,020,661
負債合計	91,020,661
純資産の部	
元本等	
元本	88,954,514,385
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	169,750,418,023
元本等合計	258,704,932,408
純資産合計	258,704,932,408
負債純資産合計	258,795,953,069

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)

2024年 2月15日現在

1. 投資信託財産に係る元本の状況 期首	2023年 2月16日
-------------------------	-------------

期首元本額	79,508,210,722円
期中追加設定元本額	47,150,665,800円
期中一部解約元本額	37,704,362,137円
期末元本額	88,954,514,385円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	1,407,730,004円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	7,667,600,528円
りそなラップ型ファンド(成長型)	7,135,662,468円
DCりそな グローバルバランス	41,751,619円
つみたてバランスファンド	3,143,853,312円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	1,990,276,653円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	1,517,455,287円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	1,049,804,076円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	553,262,271円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	376,696,466円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	214,260,278円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	505,616,216円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定型)	47,806,514円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定成長型)	153,053,484円
りそな つみたてラップ型ファンド(成長型)	147,320,135円
りそな つみたてリスクコントロールファンド	29,447,845円
ターゲットリターンバランスファンド(目標2%)	1,340,126円
ターゲットリターンバランスファンド(目標3%)	1,357,517円
ターゲットリターンバランスファンド(目標4%)	8,286,356円
ターゲットリターンバランスファンド(目標5%)	3,745,789円
ターゲットリターンバランスファンド(目標6%)	8,907,406円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2065	1,473,443円
FWりそな先進国株式アクティブファンド	27,815,849円
FWりそな先進国+新興国株式アクティブファンド	48,856,934円
FWりそな先進国株式インデックスファンド	31,741,825,067円
Smart-i 先進国株式インデックス	21,614,743,490円
Smart-i 8資産バランス 安定型	498,313,822円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	1,706,867,198円
Smart-i 8資産バランス 成長型	2,362,610,694円
Smart-i Select 全世界株式インデックス	631,868,864円
Smart-i Select 全世界株式インデックス(除く日本)	235,301,791円
Smart-i DC 全世界株式インデックス	35,376,776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)	579,963,790円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	112,735,356円
りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	1,209,457,097円
りそなVE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)	6,548,148円
りそなVE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)	30,252,248円
りそなVE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)	248,032,552円
りそなFT パッシブバランス(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)	68,700,824円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	141,822,638円
りそなDAAファンド202205(適格機関投資家専用)	229,767,875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	88,954,514,385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	2.9083円
(10,000口当たり純資産額)	(29,083円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2024年 2月15日現在

1. 金融商品に対する取組方針

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

2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

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

金融商品の時価等に関する事項

2024年 2月15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）

2024年 2月15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	2024年 2月15日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式	5,990,352,657	
投資証券	44,159,947	
合計	5,946,192,710	

（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）

（2024年 2月15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	9,569,314,300			9,692,844,870	123,530,570
	買建					
合計		9,569,314,300	-	-	9,692,844,870	123,530,570

（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）

（2024年 2月15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	1,220,035,437	-	1,219,605,967	429,470
	米ドル	915,392,412	-	914,836,928	555,484
	カナダドル	41,088,420	-	41,115,917	27,497
	ユーロ	116,166,528	-	116,281,008	114,480
	英ポンド	51,212,800	-	51,063,598	149,202
	スイスフラン	37,387,920	-	37,381,904	6,016
	スウェーデンクローナ	8,974,980	-	9,020,529	45,549
	デンマーククローネ	15,373,573	-	15,382,832	9,259
	オーストラリアドル	27,238,794	-	27,326,196	87,402
	香港ドル	3,853,000	-	3,849,520	3,480
	シンガポールドル	3,347,010	-	3,347,535	525
	合計	1,220,035,437	-	1,219,605,967	429,470

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	APA CORP	9,204	29.80	274,279.20	
	BAKER HUGHES COMPANY	28,904	28.85	833,880.40	
	CHENIERE ENERGY INC	6,876	155.59	1,069,836.84	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	3,035	75.85	230,204.75	
	CHEVRON CORP	51,533	151.01	7,781,998.33	
	CONOCOPHILLIPS	34,050	110.12	3,749,586.00	
	COTERRA ENERGY INC	20,285	23.91	485,014.35	
	DEVON ENERGY CORP	18,371	41.84	768,642.64	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	4,616	169.86	784,073.76	
	EOG RESOURCES INC	16,592	111.01	1,841,877.92	
	EQT CORP	10,599	32.96	349,343.04	
	EXXON MOBIL CORP	113,749	100.84	11,470,449.16	
	HALLIBURTON CO	25,732	34.20	880,034.40	

HESS CORP	7,898	142.73	1,127,281.54
HF SINCLAIR CORP	4,810	59.52	286,291.20
KINDER MORGAN INC	57,348	16.57	950,256.36
MARATHON OIL CORP	16,626	22.39	372,256.14
MARATHON PETROLEUM CORP	11,397	169.88	1,936,122.36
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	18,967	57.30	1,086,809.10
ONEOK INC	16,641	69.11	1,150,059.51
OVINTIV INC	7,033	42.40	298,199.20
PHILLIPS 66	12,696	145.21	1,843,586.16
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	6,656	225.35	1,499,929.60
SCHLUMBERGER LTD	40,489	47.75	1,933,349.75
TARGA RESOURCES CORP	6,127	88.34	541,259.18
TEXAS PACIFIC LAND CORP	184	1,436.68	264,349.12
VALERO ENERGY CORP	10,082	141.04	1,421,965.28
WILLIAMS COS INC	34,746	33.05	1,148,355.30
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	6,339	217.01	1,375,626.39
ALBEMARLE CORP	3,181	114.39	363,874.59
AMCOR PLC	41,849	8.95	374,548.55
AVERY DENNISON CORP	2,331	206.39	481,095.09
BALL CORP	9,110	62.00	564,820.00
CELANESE CORP	2,671	148.15	395,708.65
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	5,582	77.58	433,051.56
CLEVELAND-CLIFFS INC	14,637	19.53	285,860.61
CORTEVA INC	19,337	54.08	1,045,744.96
CROWN HOLDINGS INC	3,413	73.47	250,753.11
DOW INC	20,126	53.58	1,078,351.08
DUPONT DE NEMOURS INC	12,505	67.65	845,963.25
EASTMAN CHEMICAL CO	3,561	82.12	292,429.32
ECOLAB INC	7,326	216.97	1,589,522.22
FMC CORP	3,105	51.13	158,758.65
FREEPORT-MCMORAN INC	40,921	37.20	1,522,261.20
INTERNATIONAL PAPER CO	9,874	34.53	340,949.22
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	6,933	79.38	550,341.54
LINDE PLC	13,868	418.40	5,802,371.20
LYONDELLBASELL INDU-CL A	7,041	94.64	666,360.24
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,773	539.46	956,462.58
MOSAIC CO/THE	8,511	29.55	251,500.05
NEWMONT CORP	32,969	32.12	1,058,964.28
NUCOR CORP	7,112	181.06	1,287,698.72
PACKAGING CORP OF AMERICA	2,403	165.40	397,456.20
PPG INDUSTRIES INC	6,417	140.10	899,021.70
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	1,573	294.65	463,484.45
RPM INTERNATIONAL INC	3,503	108.14	378,814.42

SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,962	311.03	2,165,390.86
STEEL DYNAMICS INC	4,203	119.74	503,267.22
VULCAN MATERIALS CO	3,812	241.10	919,073.20
WESTLAKE CORP	1,041	141.19	146,978.79
WESTROCK CO	7,139	42.62	304,264.18
3M CO	15,776	92.42	1,458,017.92
AECOM	3,727	89.84	334,833.68
AERCAP HOLDINGS NV	5,527	77.06	425,910.62
ALLEGION PLC	2,487	131.18	326,244.66
AMETEK INC	6,622	173.41	1,148,321.02
AXON ENTERPRISE INC	2,064	270.84	559,013.76
BOEING CO/THE	16,319	203.38	3,318,958.22
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	3,334	186.73	622,557.82
CARLISLE COS INC	1,453	347.42	504,801.26
CARRIER GLOBAL CORP	23,987	55.00	1,319,285.00
CATERPILLAR INC	14,518	316.71	4,597,995.78
CNH INDUSTRIAL NV	25,382	12.55	318,544.10
CUMMINS INC	4,071	260.47	1,060,373.37
DEERE & CO	7,795	384.78	2,999,360.10
DOVER CORP	3,781	160.89	608,325.09
EATON CORP PLC	11,372	275.62	3,134,350.64
EMERSON ELECTRIC CO	16,347	106.24	1,736,705.28
FASTENAL CO	16,402	70.13	1,150,272.26
FERGUSON PLC	5,853	193.55	1,132,848.15
FORTIVE CORP	9,516	83.58	795,347.28
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS I	3,833	79.54	304,876.82
GENERAL DYNAMICS CORP	6,634	269.10	1,785,209.40
GENERAL ELECTRIC CO	30,977	146.50	4,538,130.50
GRACO INC	4,552	88.34	402,123.68
HEICO CORP	1,073	193.37	207,486.01
HEICO CORP-CLASS A	1,964	154.86	304,145.04
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	18,900	194.87	3,683,043.00
HOWMET AEROSPACE INC	10,616	63.38	672,842.08
HUBBELL INC	1,422	359.69	511,479.18
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,111	280.31	311,424.41
IDEX CORP	2,200	227.02	499,444.00
ILLINOIS TOOL WORKS	8,628	254.12	2,192,547.36
INGERSOLL-RAND INC	11,631	86.49	1,005,965.19
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	4,700	42.04	197,588.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	19,527	57.07	1,114,405.89
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	5,426	210.18	1,140,436.68
LENNOX INTERNATIONAL INC	876	446.94	391,519.44
LOCKHEED MARTIN CORP	6,362	418.19	2,660,524.78

MASCO CORP	5,980	73.47	439,350.60
NORDSON CORP	1,493	263.72	393,733.96
NORTHROP GRUMMAN CORP	4,104	446.37	1,831,902.48
OTIS WORLDWIDE CORP	11,825	90.83	1,074,064.75
OWENS CORNING	2,541	143.03	363,439.23
PACCAR INC	14,963	106.67	1,596,103.21
PARKER HANNIFIN CORP	3,671	521.91	1,915,931.61
PENTAIR PLC	4,364	74.98	327,212.72
QUANTA SERVICES INC	4,180	212.64	888,835.20
ROCKWELL AUTOMATION INC	3,300	279.93	923,769.00
RTX CORP	41,441	91.39	3,787,292.99
SMITH (A.O.) CORP	3,305	81.17	268,266.85
SNAP-ON INC	1,540	263.14	405,235.60
STANLEY BLACK & DECKER INC	4,061	88.65	360,007.65
TEXTRON INC	5,445	86.32	470,012.40
TORO CO	2,938	95.26	279,873.88
TRANE TECHNOLOGIES PLC	6,530	272.81	1,781,449.30
TRANSDIGM GROUP INC	1,577	1,147.13	1,809,024.01
UNITED RENTALS INC	1,959	654.04	1,281,264.36
VERTIV HOLDINGS CO	9,385	64.97	609,743.45
WABTEC CORP	4,863	135.09	656,942.67
WATSCO INC	883	387.76	342,392.08
WW GRAINGER INC	1,291	944.40	1,219,220.40
XYLEM INC	6,944	124.16	862,167.04
AUTOMATIC DATA PROCESSING	11,731	250.90	2,943,307.90
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	3,796	145.13	550,913.48
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	3,189	196.47	626,542.83
CERIDIAN HCM HOLDING INC	4,446	72.30	321,445.80
CINTAS CORP	2,618	612.67	1,603,970.06
COPART INC	24,655	49.22	1,213,519.10
EQUIFAX INC	3,523	250.34	881,947.82
JACOBS SOLUTIONS INC	3,361	144.29	484,958.69
LEIDOS HOLDINGS INC	3,453	121.50	419,539.50
PAYCHEX INC	9,307	122.22	1,137,501.54
PAYCOM SOFTWARE INC	1,637	189.25	309,802.25
PAYLOCITY HOLDING CORP	1,263	172.00	217,236.00
REPUBLIC SERVICES INC	6,342	178.74	1,133,569.08
ROBERT HALF INC	2,833	80.60	228,339.80
ROLLINS INC	7,960	44.25	352,230.00
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	5,673	63.07	357,796.11
TRANSUNION	5,814	77.53	450,759.42
VERALTO CORP	6,200	84.22	522,164.00
VERISK ANALYTICS INC	4,157	246.14	1,023,203.98

WASTE CONNECTIONS INC	7,378	164.12	1,210,877.36
WASTE MANAGEMENT INC	11,548	199.16	2,299,899.68
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	3,329	73.84	245,813.36
CSX CORP	57,271	37.00	2,119,027.00
DELTA AIR LINES INC	3,957	40.84	161,603.88
EXPEDITORS INTL WASH INC	4,290	125.74	539,424.60
FEDEX CORP	6,826	236.83	1,616,601.58
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	46,934	3.41	160,044.94
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	2,293	217.56	498,865.08
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	4,870	59.11	287,865.70
NORFOLK SOUTHERN CORP	6,494	252.26	1,638,176.44
OLD DOMINION FREIGHT LINE	2,822	431.13	1,216,648.86
SOUTHWEST AIRLINES CO	3,155	33.75	106,481.25
U-HAUL HOLDING CO	2,277	63.68	144,999.36
UBER TECHNOLOGIES INC	52,372	79.15	4,145,243.80
UNION PACIFIC CORP	17,343	250.11	4,337,657.73
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	20,599	144.22	2,970,787.78
APTIV PLC	7,761	79.14	614,205.54
BORGWARNER INC	6,496	31.14	202,285.44
FORD MOTOR CO	113,010	12.56	1,419,405.60
GENERAL MOTORS CO	39,510	38.37	1,515,998.70
LEAR CORP	1,641	134.89	221,354.49
LUCID GROUP INC	24,463	3.45	84,397.35
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	17,047	15.54	264,910.38
TESLA INC	81,128	188.71	15,309,664.88
DECKERS OUTDOOR CORP	699	848.10	592,821.90
DR HORTON INC	8,734	145.50	1,270,797.00
GARMIN LTD	4,463	122.83	548,190.29
HASBRO INC	3,664	52.69	193,056.16
LENNAR CORP-A	7,195	153.87	1,107,094.65
LULULEMON ATHLETICA INC	3,304	460.71	1,522,185.84
NIKE INC -CL B	34,873	106.33	3,708,046.09
NVR INC	88	7,501.73	660,152.24
PULTEGROUP INC	6,015	103.82	624,477.30
VF CORP	8,818	17.20	151,669.60
AIRBNB INC-CLASS A	12,166	148.20	1,803,001.20
BOOKING HOLDINGS INC	1,015	3,738.31	3,794,384.65
CAESARS ENTERTAINMENT INC	6,097	42.73	260,524.81
CARNIVAL CORP	29,139	15.27	444,952.53
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	787	2,620.19	2,062,089.53
DARDEN RESTAURANTS INC	3,473	161.15	559,673.95
DOMINO'S PIZZA INC	1,009	424.48	428,300.32
DOORDASH INC - A	7,356	120.01	882,793.56

DRAFTKINGS INC-CL A	10,834	43.88	475,395.92
EXPEDIA GROUP INC	3,721	134.82	501,665.22
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	7,471	192.70	1,439,661.70
HYATT HOTELS CORP - CL A	1,264	129.07	163,144.48
LAS VEGAS SANDS CORP	10,956	54.48	596,882.88
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	7,234	235.39	1,702,811.26
MCDONALD'S CORP	20,709	288.17	5,967,712.53
MGM RESORTS INTERNATIONAL	7,436	42.80	318,260.80
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	6,981	116.63	814,194.03
STARBUCKS CORP	32,600	94.07	3,066,682.00
VAIL RESORTS INC	1,148	224.20	257,381.60
WYNN RESORTS LTD	2,915	105.21	306,687.15
YUM! BRANDS INC	8,023	134.01	1,075,162.23
ALPHABET INC-CL A	168,448	145.94	24,583,301.12
ALPHABET INC-CL C	148,242	147.14	21,812,327.88
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	2,803	287.28	805,245.84
COMCAST CORP-CLASS A	117,138	42.02	4,922,138.76
ELECTRONIC ARTS INC	7,415	143.08	1,060,938.20
FOX CORP - CLASS A	7,650	30.25	231,412.50
FOX CORP- CLASS B	2,680	27.74	74,343.20
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	11,702	31.72	371,187.44
LIBERTY BROADBAND-C	3,126	59.62	186,372.12
LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	5,771	66.79	385,445.09
LIBERTY MEDIA CORP-LIBER-NEW	3,736	30.00	112,080.00
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	4,305	89.40	384,867.00
MATCH GROUP INC	8,454	36.35	307,302.90
META PLATFORMS INC-CLASS A	63,104	473.28	29,865,861.12
NETFLIX INC	12,605	579.33	7,302,454.65
NEWS CORP - CLASS A	9,625	26.01	250,346.25
OMNICOM GROUP	5,781	85.79	495,951.99
PARAMOUNT GLOBAL	13,751	13.19	181,375.69
PINTEREST INC- CLASS A	16,150	35.82	578,493.00
ROBLOX CORP -CLASS A	11,628	44.14	513,259.92
ROKU INC	3,276	91.24	298,902.24
SEA LTD-ADR	10,890	42.69	464,894.10
SIRIUS XM HOLDINGS INC	18,628	4.81	89,600.68
SNAP INC - A	28,084	11.40	320,157.60
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	4,914	155.72	765,208.08
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	12,897	74.31	958,376.07
WALT DISNEY CO/THE	52,087	111.56	5,810,825.72
WARNER BROS DISCOVERY INC	62,552	9.73	608,630.96
AMAZON.COM INC	263,558	170.98	45,063,146.84
AUTOZONE INC	511	2,726.87	1,393,430.57

BATH & BODY WORKS INC	5,832	43.88	255,908.16
BEST BUY CO INC	5,706	74.60	425,667.60
BURLINGTON STORES INC	1,834	195.21	358,015.14
CARMAX INC	4,798	72.76	349,102.48
DICK'S SPORTING GOODS INC	1,663	166.93	277,604.59
EBAY INC	15,410	42.18	649,993.80
ETSY INC	3,342	76.19	254,626.98
GENUINE PARTS CO	3,804	144.04	547,928.16
GLOBAL-E ONLINE LTD	2,458	40.93	100,605.94
HOME DEPOT INC	28,411	358.23	10,177,672.53
LKQ CORP	7,165	48.85	350,010.25
LOWE'S COS INC	16,433	226.93	3,729,140.69
MERCADOLIBRE INC	1,287	1,746.37	2,247,578.19
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	1,722	1,049.30	1,806,894.60
POOL CORP	1,138	382.78	435,603.64
ROSS STORES INC	9,702	144.49	1,401,841.98
TJX COMPANIES INC	32,596	97.17	3,167,353.32
TRACTOR SUPPLY COMPANY	2,960	235.49	697,050.40
ULTA BEAUTY INC	1,348	526.59	709,843.32
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	10,094	21.21	214,093.74
COSTCO WHOLESALE CORP	12,583	722.18	9,087,190.94
DOLLAR GENERAL CORP	6,331	132.00	835,692.00
DOLLAR TREE INC	6,035	139.88	844,175.80
KROGER CO	19,694	45.69	899,818.86
SYSCO CORP	14,497	79.00	1,145,263.00
TARGET CORP	13,200	145.03	1,914,396.00
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	19,846	21.54	427,482.84
WALMART INC	42,091	168.60	7,096,542.60
ALTRIA GROUP INC	50,686	40.40	2,047,714.40
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	15,409	53.27	820,837.43
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	9,052	57.35	519,132.20
BUNGE GLOBAL SA	3,961	89.52	354,588.72
CAMPBELL SOUP CO	5,192	40.92	212,456.64
CELSIUS HOLDINGS INC	4,118	62.56	257,622.08
COCA-COLA CO/THE	116,789	59.29	6,924,419.81
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	5,522	66.17	365,390.74
CONAGRA BRANDS INC	12,600	26.73	336,798.00
CONSTELLATION BRANDS INC-A	4,744	243.60	1,155,638.40
DARLING INGREDIENTS INC	4,506	41.82	188,440.92
GENERAL MILLS INC	16,709	62.37	1,042,140.33
HERSHEY CO/THE	4,323	191.25	826,773.75
HORMEL FOODS CORP	7,411	28.80	213,436.80
JM SMUCKER CO/THE	3,098	125.25	388,024.50

KELLANOVA	7,243	53.99	391,049.57
KEURIG DR PEPPER INC	30,163	31.10	938,069.30
KRAFT HEINZ CO/THE	24,756	34.16	845,664.96
LAMB WESTON HOLDINGS INC	3,850	102.85	395,972.50
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	6,780	64.99	440,632.20
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	5,126	61.44	314,941.44
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	38,786	71.41	2,769,708.26
MONSTER BEVERAGE CORP	22,530	55.87	1,258,751.10
PEPSICO INC	39,091	167.52	6,548,524.32
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	44,191	89.22	3,942,721.02
TYSON FOODS INC-CL A	7,546	51.98	392,241.08
CHURCH & DWIGHT CO INC	6,583	97.00	638,551.00
CLOROX COMPANY	3,403	152.21	517,970.63
COLGATE-PALMOLIVE CO	22,379	83.71	1,873,346.09
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	6,647	142.65	948,194.55
KENVUE INC	49,270	19.09	940,564.30
KIMBERLY-CLARK CORP	9,659	118.40	1,143,625.60
PROCTER & GAMBLE CO/THE	66,925	155.63	10,415,537.75
ABBOTT LABORATORIES	49,345	112.06	5,529,600.70
ALIGN TECHNOLOGY INC	1,957	302.75	592,481.75
BAXTER INTERNATIONAL INC	13,900	39.64	550,996.00
BECTON DICKINSON AND CO	8,283	238.61	1,976,406.63
BOSTON SCIENTIFIC CORP	41,744	65.95	2,753,016.80
CARDINAL HEALTH INC	6,878	103.55	712,216.90
CENCORA INC	4,900	231.58	1,134,742.00
CENTENE CORP	15,519	77.49	1,202,567.31
CIGNA GROUP/THE	8,437	338.61	2,856,852.57
COOPER COS INC/THE	1,338	372.49	498,391.62
CVS HEALTH CORP	36,601	76.41	2,796,682.41
DAVITA INC	1,655	123.41	204,243.55
DEXCOM INC	11,102	116.75	1,296,158.50
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	17,413	86.04	1,498,214.52
ELEVANCE HEALTH INC	6,712	506.11	3,397,010.32
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES I	11,782	83.17	979,908.94
HCA HEALTHCARE INC	5,832	305.43	1,781,267.76
HENRY SCHEIN INC	3,593	73.68	264,732.24
HOLOGIC INC	7,116	73.15	520,535.40
HUMANA INC	3,543	362.29	1,283,593.47
IDEXX LABORATORIES INC	2,379	560.56	1,333,572.24
INSULET CORP	1,978	188.79	373,426.62
INTUITIVE SURGICAL INC	10,003	381.76	3,818,745.28
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	2,566	228.11	585,330.26
MCKESSON CORP	3,853	501.20	1,931,123.60

MEDTRONIC PLC	37,893	83.68	3,170,886.24
MOLINA HEALTHCARE INC	1,686	399.96	674,332.56
QUEST DIAGNOSTICS INC	3,266	127.72	417,133.52
RESMED INC	4,245	180.55	766,434.75
STERIS PLC	2,665	227.61	606,580.65
STRYKER CORP	9,737	349.42	3,402,302.54
TELEFLEX INC	1,243	249.07	309,594.01
UNITEDHEALTH GROUP INC	26,306	516.94	13,598,623.64
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	1,578	161.71	255,178.38
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	4,169	220.67	919,973.23
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	6,028	121.84	734,451.52
ABBVIE INC	50,142	174.42	8,745,767.64
AGILENT TECHNOLOGIES INC	8,380	132.24	1,108,171.20
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	3,600	164.15	590,940.00
AMGEN INC	15,210	290.07	4,411,964.70
AVANTOR INC	17,912	24.40	437,052.80
BIO-RAD LABORATORIES-A	545	327.91	178,710.95
BIO-TECHNE CORP	4,760	70.12	333,771.20
BIOGEN INC	4,150	220.74	916,071.00
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	4,978	86.01	428,157.78
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	59,475	48.89	2,907,732.75
CATALENT INC	5,423	56.94	308,785.62
CHARLES RIVER LABORATORIES	1,351	245.12	331,157.12
DANAHER CORP	19,947	247.99	4,946,656.53
ELI LILLY & CO	22,910	757.31	17,349,972.10
EXACT SCIENCES CORP	5,434	62.09	337,397.06
GILEAD SCIENCES INC	35,469	73.04	2,590,655.76
ILLUMINA INC	4,250	140.74	598,145.00
INCYTE CORP	5,518	57.89	319,437.02
IQVIA HOLDINGS INC	5,243	243.47	1,276,513.21
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	1,672	122.24	204,385.28
JOHNSON & JOHNSON	68,386	155.74	10,650,435.64
MERCK & CO. INC.	72,083	125.82	9,069,483.06
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	591	1,181.18	698,077.38
MODERNA INC	9,278	85.95	797,444.10
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	2,714	131.77	357,623.78
PFIZER INC	160,550	27.11	4,352,510.50
REGENERON PHARMACEUTICALS	3,039	947.82	2,880,424.98
REPLIGEN CORP	1,593	206.04	328,221.72
REVVITY INC	3,596	103.56	372,401.76
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	9,995	29.30	292,853.50
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	29,745	13.17	391,741.65
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	10,969	548.27	6,013,973.63

UNITED THERAPEUTICS CORP	1,321	214.43	283,262.03
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	7,346	417.88	3,069,746.48
VIATRIS INC	34,753	12.07	419,468.71
WATERS CORP	1,566	317.52	497,236.32
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	1,991	408.19	812,706.29
ZOETIS INC	13,113	184.08	2,413,841.04
BANK OF AMERICA CORP	203,118	33.13	6,729,299.34
CITIGROUP INC	54,762	53.98	2,956,052.76
CITIZENS FINANCIAL GROUP	13,580	31.31	425,189.80
FIFTH THIRD BANCORP	19,507	33.51	653,679.57
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	293	1,492.94	437,431.42
HUNTINGTON BANCSHARES INC	38,289	12.72	487,036.08
JPMORGAN CHASE & CO	82,493	176.03	14,521,242.79
KEYCORP	25,737	13.86	356,714.82
M & T BANK CORP	4,757	136.16	647,713.12
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	11,342	147.87	1,677,141.54
REGIONS FINANCIAL CORP	24,798	18.29	453,555.42
TRUIST FINANCIAL CORP	37,970	35.41	1,344,517.70
US BANCORP	43,651	40.50	1,767,865.50
WELLS FARGO & CO	103,948	48.53	5,044,596.44
ALLY FINANCIAL INC	8,203	36.04	295,636.12
AMERICAN EXPRESS CO	17,830	210.90	3,760,347.00
AMERIPRISE FINANCIAL INC	2,945	391.36	1,152,555.20
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	11,387	112.57	1,281,834.59
ARES MANAGEMENT CORP - A	4,738	136.71	647,731.98
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	22,321	54.48	1,216,048.08
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	37,149	398.68	14,810,563.32
BLACKROCK INC	4,252	785.40	3,339,520.80
BLACKSTONE INC	20,243	127.95	2,590,091.85
BLOCK INC	15,782	67.41	1,063,864.62
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	10,920	135.11	1,475,401.20
CARLYLE GROUP INC/THE	6,287	44.03	276,816.61
CBOE GLOBAL MARKETS INC	2,873	184.76	530,815.48
CME GROUP INC	10,268	215.18	2,209,468.24
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	4,943	160.38	792,758.34
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	6,902	109.11	753,077.22
EQUITABLE HOLDINGS INC	9,273	33.79	313,334.67
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,023	461.78	472,400.94
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	17,016	62.64	1,065,882.24
FISERV INC	17,386	144.98	2,520,622.28
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	2,038	272.38	555,110.44
FRANKLIN RESOURCES INC	7,382	26.77	197,616.14
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	1,496	49.97	74,755.12

GLOBAL PAYMENTS INC	7,473	138.98	1,038,597.54
GOLDMAN SACHS GROUP INC	9,387	378.04	3,548,661.48
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	16,335	136.66	2,232,341.10
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	2,076	175.26	363,839.76
KKR & CO INC	16,466	95.95	1,579,912.70
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	2,100	255.00	535,500.00
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,139	216.21	246,263.19
MASTERCARD INC-CLASS A	23,901	465.19	11,118,506.19
MOODY'S CORP	4,718	366.48	1,729,052.64
MORGAN STANLEY	35,406	84.00	2,974,104.00
MSCI INC	2,267	572.80	1,298,537.60
NASDAQ INC	9,140	55.81	510,103.40
NORTHERN TRUST CORP	5,559	79.04	439,383.36
PAYPAL HOLDINGS INC	29,803	58.87	1,754,502.61
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	5,484	116.69	639,927.96
ROBINHOOD MARKETS INC - A	11,055	13.38	147,915.90
S&P GLOBAL INC	9,261	421.21	3,900,825.81
SCHWAB (CHARLES) CORP	42,887	63.03	2,703,167.61
SEI INVESTMENTS COMPANY	2,972	65.86	195,735.92
STATE STREET CORP	9,083	71.50	649,434.50
SYNCHRONY FINANCIAL	11,238	39.33	441,990.54
T ROWE PRICE GROUP INC	6,092	106.36	647,945.12
TOAST INC-CLASS A	8,567	20.15	172,625.05
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	2,965	102.55	304,060.75
VISA INC-CLASS A SHARES	45,636	277.56	12,666,728.16
AFLAC INC	16,142	78.92	1,273,926.64
ALLSTATE CORP	7,492	161.39	1,209,133.88
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	2,173	122.99	267,257.27
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	20,359	69.17	1,408,232.03
AON PLC	5,791	308.47	1,786,349.77
ARCH CAPITAL GROUP LTD	10,718	84.87	909,636.66
ARTHUR J GALLAGHER & CO	6,160	238.68	1,470,268.80
ASSURANT INC	1,479	171.78	254,062.62
BROWN & BROWN INC	6,984	82.20	574,084.80
CHUBB LTD	11,701	248.12	2,903,252.12
CINCINNATI FINANCIAL CORP	4,189	110.94	464,727.66
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	663	351.82	233,256.66
EVEREST GROUP LTD	1,143	371.04	424,098.72
FNF GROUP	6,744	52.01	350,755.44
GLOBE LIFE INC	2,856	125.35	357,999.60
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	8,392	91.46	767,532.32
LOEWS CORP	5,561	73.52	408,844.72
MARKEL GROUP INC	332	1,468.97	487,698.04

MARSH & MCLENNAN COS	14,070	197.72	2,781,920.40
METLIFE INC	18,295	68.35	1,250,463.25
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	6,997	78.69	550,593.93
PROGRESSIVE CORP	16,671	187.95	3,133,314.45
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	10,404	106.40	1,106,985.60
TRAVELERS COS INC/THE	6,550	216.62	1,418,861.00
WILLIS TOWERS WATSON PLC	3,017	275.16	830,157.72
WR BERKLEY CORP	5,648	81.92	462,684.16
ACCENTURE PLC-CL A	17,833	370.98	6,615,686.34
ADOBE INC	12,934	604.66	7,820,672.44
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	4,382	114.80	503,053.60
ANSYS INC	2,490	330.00	821,700.00
ASPEN TECHNOLOGY INC	677	180.37	122,110.49
ATLASSIAN CORP-CL A	4,441	215.89	958,767.49
AUTODESK INC	6,103	262.17	1,600,023.51
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	5,957	51.56	307,142.92
BILL HOLDINGS INC	2,332	64.76	151,020.32
CADENCE DESIGN SYS INC	7,745	300.74	2,329,231.30
CHECK POINT SOFTWARE TECH	2,485	165.29	410,745.65
CLOUDFLARE INC - CLASS A	8,004	104.37	835,377.48
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	14,450	76.74	1,108,893.00
CONFLUENT INC-CLASS A	4,264	33.89	144,506.96
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	6,447	334.55	2,156,843.85
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,262	263.71	332,802.02
DATADOG INC - CLASS A	7,285	136.15	991,852.75
DOCUSIGN INC	5,725	51.09	292,490.25
DROPBOX INC-CLASS A	6,720	32.41	217,795.20
DYNATRACE INC	6,741	52.76	355,655.16
EPAM SYSTEMS INC	1,534	278.14	426,666.76
FAIR ISAAC CORP	675	1,293.84	873,342.00
FORTINET INC	19,090	70.88	1,353,099.20
GARTNER INC	2,257	449.86	1,015,334.02
GEN DIGITAL INC	16,224	21.32	345,895.68
GODADDY INC - CLASS A	4,144	111.57	462,346.08
HUBSPOT INC	1,364	629.64	858,828.96
INTL BUSINESS MACHINES CORP	25,903	183.57	4,755,013.71
INTUIT INC	7,967	657.13	5,235,354.71
MANHATTAN ASSOCIATES INC	1,676	248.80	416,988.80
MICROSOFT CORP	200,291	409.49	82,017,161.59
MONDAY.COM LTD	726	219.95	159,683.70
MONGODB INC	2,047	486.51	995,885.97
OKTA INC	4,195	87.60	367,482.00
ORACLE CORP	46,721	114.26	5,338,341.46

PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	52,921	25.19	1,333,079.99
PALO ALTO NETWORKS INC	8,783	368.33	3,235,042.39
PTC INC	3,246	180.75	586,714.50
ROPER TECHNOLOGIES INC	3,045	541.71	1,649,506.95
SALESFORCE INC	27,641	289.15	7,992,395.15
SERVICENOW INC	5,809	792.00	4,600,728.00
SNOWFLAKE INC-CLASS A	8,000	236.00	1,888,000.00
SPLUNK INC	4,362	154.50	673,929.00
SYNOPSYS INC	4,333	562.73	2,438,309.09
TWILIO INC - A	5,166	72.27	373,346.82
TYLER TECHNOLOGIES INC	1,216	440.13	535,198.08
UIPATH INC - CLASS A	9,453	26.01	245,872.53
UNITY SOFTWARE INC	7,208	34.91	251,631.28
VERISIGN INC	2,679	195.33	523,289.07
WIX.COM LTD	1,473	129.60	190,900.80
WORKDAY INC-CLASS A	5,906	302.24	1,785,029.44
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	6,246	64.14	400,618.44
ZSCALER INC	2,546	253.27	644,825.42
AMPHENOL CORP-CL A	17,066	104.11	1,776,741.26
APPLE INC	443,671	184.15	81,702,014.65
ARISTA NETWORKS INC	7,521	265.67	1,998,104.07
CDW CORP/DE	3,865	239.48	925,590.20
CISCO SYSTEMS INC	115,198	50.28	5,792,155.44
CORNING INC	23,448	31.75	744,474.00
DELL TECHNOLOGIES -C	6,963	86.04	599,096.52
F5 INC	1,530	184.26	281,917.80
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	35,054	15.23	533,872.42
HP INC	25,711	28.58	734,820.38
JABIL INC	3,820	141.32	539,842.40
JUNIPER NETWORKS INC	9,736	37.03	360,524.08
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	4,836	154.89	749,048.04
MOTOROLA SOLUTIONS INC	4,782	319.39	1,527,322.98
NETAPP INC	6,083	87.76	533,844.08
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	5,475	86.81	475,284.75
SUPER MICRO COMPUTER INC	1,390	880.55	1,223,964.50
TE CONNECTIVITY LTD	9,013	142.80	1,287,056.40
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	1,279	427.53	546,810.87
TRIMBLE INC	7,523	58.21	437,913.83
WESTERN DIGITAL CORP	9,457	56.08	530,348.56
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	1,301	252.96	329,100.96
AT&T INC	203,535	16.91	3,441,776.85
LIBERTY GLOBAL LTD-C	6,233	19.64	122,416.12
T-MOBILE US INC	15,090	161.42	2,435,827.80

VERIZON COMMUNICATIONS INC	119,576	40.15	4,800,976.40
AES CORP	17,804	16.14	287,356.56
ALLIANT ENERGY CORP	7,358	47.63	350,461.54
AMEREN CORPORATION	7,154	68.61	490,835.94
AMERICAN ELECTRIC POWER	14,773	78.80	1,164,112.40
AMERICAN WATER WORKS CO INC	5,620	120.48	677,097.60
ATMOS ENERGY CORP	4,322	112.98	488,299.56
CENTERPOINT ENERGY INC	17,191	27.35	470,173.85
CMS ENERGY CORP	7,946	56.42	448,313.32
CONSOLIDATED EDISON INC	9,924	86.84	861,800.16
CONSTELLATION ENERGY	9,236	128.67	1,188,396.12
DOMINION ENERGY INC	24,011	44.86	1,077,133.46
DTE ENERGY COMPANY	5,615	105.33	591,427.95
DUKE ENERGY CORP	21,996	91.34	2,009,114.64
EDISON INTERNATIONAL	11,054	65.03	718,841.62
ENERGY CORP	5,760	98.08	564,940.80
ESSENTIAL UTILITIES INC	7,595	35.43	269,090.85
EVERGY INC	6,943	49.19	341,526.17
EVERSOURCE ENERGY	9,502	57.06	542,184.12
EXELON CORP	28,586	34.12	975,354.32
FIRSTENERGY CORP	14,826	36.93	547,524.18
NEXTERA ENERGY INC	58,408	56.01	3,271,432.08
NISOURCE INC	11,765	25.38	298,595.70
NRG ENERGY INC	6,483	52.06	337,504.98
P G & E CORP	58,233	16.35	952,109.55
PPL CORP	20,210	26.05	526,470.50
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	14,372	58.77	844,642.44
SEMPRA	18,024	69.46	1,251,947.04
SOUTHERN CO/THE	31,121	67.81	2,110,315.01
VISTRA CORP	8,462	44.27	374,612.74
WEC ENERGY GROUP INC	9,103	76.65	697,744.95
XCEL ENERGY INC	15,855	58.68	930,371.40
ADVANCED MICRO DEVICES	45,878	178.70	8,198,398.60
ANALOG DEVICES INC	14,170	186.32	2,640,154.40
APPLIED MATERIALS INC	23,773	186.19	4,426,294.87
BROADCOM INC	12,597	1,262.22	15,900,185.34
ENPHASE ENERGY INC	3,595	131.62	473,173.90
ENTEGRIS INC	4,091	131.17	536,616.47
FIRST SOLAR INC	2,665	158.24	421,709.60
INTEL CORP	118,953	44.19	5,256,533.07
KLA CORP	3,878	653.84	2,535,591.52
LAM RESEARCH CORP	3,759	915.70	3,442,116.30
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	3,791	76.26	289,101.66

	MARVELL TECHNOLOGY INC	24,569	68.96	1,694,278.24
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	15,514	80.58	1,250,118.12
	MICRON TECHNOLOGY INC	31,224	81.83	2,555,059.92
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	1,298	745.18	967,243.64
	NVIDIA CORP	70,093	739.00	51,798,727.00
	NXP SEMICONDUCTORS NV	7,343	233.96	1,717,968.28
	ON SEMICONDUCTOR CORP	12,324	81.67	1,006,501.08
	QORVO INC	2,616	113.59	297,151.44
	QUALCOMM INC	31,706	153.94	4,880,821.64
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	4,344	105.83	459,725.52
	TERADYNE INC	4,423	101.57	449,244.11
	TEXAS INSTRUMENTS INC	25,798	157.87	4,072,730.26
	CBRE GROUP INC - A	8,543	86.89	742,301.27
	COSTAR GROUP INC	11,909	82.32	980,348.88
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	20,100	3.19	64,119.00
	ZILLOW GROUP INC - C	4,581	58.06	265,972.86
	米ドル 小計	9,580,973		1,228,311,080.48 (184,848,534,501)
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	16,999	21.38	363,438.62
	CAMECO CORP	12,478	57.24	714,240.72
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	31,083	81.40	2,530,156.20
	CENOVUS ENERGY INC	38,211	21.97	839,495.67
	ENBRIDGE INC	60,553	45.14	2,733,362.42
	IMPERIAL OIL LTD	5,025	79.88	401,397.00
	KEYERA CORP	7,989	31.89	254,769.21
	MEG ENERGY CORP	8,433	24.70	208,295.10
	PARKLAND CORP	4,484	45.37	203,439.08
	PEMBINA PIPELINE CORP	14,460	45.34	655,616.40
	SUNCOR ENERGY INC	37,176	42.70	1,587,415.20
	TC ENERGY CORP	29,422	50.84	1,495,814.48
	TOURMALINE OIL CORP	8,465	53.99	457,025.35
	AGNICO EAGLE MINES LTD	14,250	61.34	874,095.00
	BARRICK GOLD CORP	50,465	19.04	960,853.60
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	4,929	57.56	283,713.24
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	14,762	11.71	172,863.02
	FRANCO-NEVADA CORP	5,544	144.00	798,336.00
	IVANHOE MINES LTD-CL A	20,246	14.18	287,088.28
	KINROSS GOLD CORP	35,977	6.76	243,204.52
	LUNDIN MINING CORP	18,302	10.99	201,138.98
	NUTRIEN LTD	14,240	66.16	942,118.40
	PAN AMERICAN SILVER CORP	12,800	16.78	214,784.00
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	12,339	51.02	629,535.78
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	1,908	106.55	203,297.40

WHEATON PRECIOUS METALS CORP	12,264	58.55	718,057.20
CAE INC	8,986	25.60	230,041.60
STANTEC INC	3,137	111.59	350,057.83
TOROMONT INDUSTRIES LTD	2,701	123.70	334,113.70
WSP GLOBAL INC	3,459	203.37	703,456.83
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	10,091	22.53	227,350.23
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	6,180	48.67	300,780.60
RB GLOBAL INC	5,059	93.05	470,739.95
THOMSON REUTERS CORP	4,276	212.56	908,906.56
AIR CANADA	5,799	18.98	110,065.02
CANADIAN NATL RAILWAY CO	15,915	174.53	2,777,644.95
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	26,597	114.76	3,052,271.72
TFI INTERNATIONAL INC	2,185	196.35	429,024.75
MAGNA INTERNATIONAL INC	7,184	73.33	526,802.72
BRP INC/CA- SUB VOTING	766	88.82	68,036.12
GILDAN ACTIVEWEAR INC	5,096	46.52	237,065.92
RESTAURANT BRANDS INTERN	8,009	103.67	830,293.03
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	1,869	140.88	263,304.72
DOLLARAMA INC	7,647	102.83	786,341.01
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	22,187	84.29	1,870,142.23
EMPIRE CO LTD 'A'	3,510	33.66	118,146.60
LOBLAW COMPANIES LTD	4,129	135.94	561,296.26
METRO INC	6,425	70.02	449,878.50
WESTON (GEORGE) LTD	1,755	171.34	300,701.70
SAPUTO INC	6,950	27.81	193,279.50
BANK OF MONTREAL	20,531	125.36	2,573,766.16
BANK OF NOVA SCOTIA	34,357	63.38	2,177,546.66
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	26,384	60.83	1,604,938.72
NATIONAL BANK OF CANADA	9,078	102.31	928,770.18
ROYAL BANK OF CANADA	39,662	131.05	5,197,705.10
TORONTO-DOMINION BANK	51,739	79.47	4,111,698.33
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	9,424	54.44	513,042.56
BROOKFIELD CORP	39,864	53.71	2,141,095.44
IGM FINANCIAL INC	1,623	35.84	58,168.32
ONEX CORPORATION	2,236	102.98	230,263.28
TMX GROUP LTD	9,244	34.61	319,934.84
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	618	1,354.29	836,951.22
GREAT-WEST LIFECO INC	7,067	41.55	293,633.85
IA FINANCIAL CORP INC	3,354	92.16	309,104.64
INTACT FINANCIAL CORP	5,126	223.46	1,145,455.96
MANULIFE FINANCIAL CORP	52,123	30.67	1,598,612.41
POWER CORP OF CANADA	15,664	37.98	594,918.72
SUN LIFE FINANCIAL INC	16,885	71.23	1,202,718.55

	CGI INC	5,691	153.80	875,275.80
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	575	3,719.40	2,138,655.00
	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	2,753	118.83	327,138.99
	OPEN TEXT CORP	7,726	54.56	421,530.56
	SHOPIFY INC - CLASS A	34,263	109.27	3,743,918.01
	BCE INC	1,259	50.14	63,126.26
	QUEBECOR INC -CL B	4,795	31.48	150,946.60
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	9,507	61.00	579,927.00
	TELUS CORP	14,385	23.40	336,609.00
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	20,954	7.96	166,793.84
	ALTAGAS LTD	7,887	27.29	215,236.23
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	3,622	34.11	123,546.42
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	4,470	29.89	133,608.30
	EMERA INC	7,779	46.82	364,212.78
	FORTIS INC	13,157	52.62	692,321.34
	HYDRO ONE LTD	9,349	40.16	375,455.84
	NORTHLAND POWER INC	9,030	23.83	215,184.90
	FIRSTSERVICE CORP	1,231	223.97	275,707.07
	カナダドル 小計	1,166,128		72,110,811.80 (8,014,395,623)
ユーロ	ENI SPA	67,710	14.50	981,930.42
	GALP ENERGIA SGPS SA	15,142	14.13	213,956.46
	NESTE OYJ	10,953	27.42	300,331.26
	OMV AG	4,120	40.05	165,006.00
	REPSOL SA	33,572	13.88	465,979.36
	TENARIS SA	14,065	14.74	207,318.10
	TOTALENERGIES SE	65,169	60.42	3,937,510.98
	AIR LIQUIDE SA	14,917	169.86	2,533,801.62
	AKZO NOBEL	4,402	67.46	296,958.92
	ARCELORMITTAL	13,149	25.16	330,894.58
	ARKEMA	1,842	96.90	178,489.80
	BASF SE	25,680	45.57	1,170,237.60
	COVESTRO AG	5,325	48.75	259,593.75
	DSM-FIRMENICH AG	5,414	93.10	504,043.40
	EVONIK INDUSTRIES AG	5,594	17.10	95,657.40
	HEIDELBERG MATERIALS AG	4,145	82.36	341,382.20
	OCI NV	1,927	27.17	52,356.59
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	7,200	37.20	267,840.00
	STORA ENSO OYJ-R SHS	16,656	10.77	179,468.40
	SYENSQO SA	2,583	82.61	213,381.63
	SYMRISE AG	3,729	97.34	362,980.86
	UMICORE	6,087	20.66	125,757.42
	UPM-KYMMENE OYJ	15,435	28.36	437,736.60

VOESTALPINE AG	3,524	25.18	88,734.32
WACKER CHEMIE AG	498	96.68	48,146.64
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	5,784	36.51	211,173.84
AIRBUS SE	16,905	150.26	2,540,145.30
ALSTOM	7,670	11.38	87,284.60
BOUYGUES SA	5,825	33.40	194,555.00
BRENTAG SE	4,188	79.30	332,108.40
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	13,134	67.95	892,455.30
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	14,911	34.58	515,622.38
DASSAULT AVIATION SA	468	177.00	82,836.00
EIFFAGE	2,234	96.06	214,598.04
FERROVIAL SE	13,882	35.36	490,867.52
GEA GROUP AG	5,204	37.47	194,993.88
IMCD NV	1,562	139.35	217,664.70
KINGSPAN GROUP PLC	4,208	81.10	341,268.80
KNORR-BREMSE AG	2,028	56.44	114,460.32
KONE OYJ-B	9,939	45.56	452,820.84
LEGRAND SA	7,224	90.98	657,239.52
LEONARDO SPA	11,946	18.29	218,492.34
METSO CORPORATION	20,109	9.37	188,501.76
MTU AERO ENGINES AG	1,567	220.30	345,210.10
PRYSMIAN SPA	7,461	41.00	305,901.00
RATIONAL AG	150	748.50	112,275.00
RHEINMETALL AG	1,200	364.40	437,280.00
SAFRAN SA	9,773	175.92	1,719,266.16
SCHNEIDER ELECTRIC SE	15,512	195.40	3,031,044.80
SIEMENS AG-REG	21,677	165.04	3,577,572.08
SIEMENS ENERGY AG	13,258	14.08	186,672.64
THALES SA	3,072	137.85	423,475.20
VINCI SA	14,513	115.24	1,672,478.12
WARTSILA OYJ ABP	15,672	13.95	218,624.40
BUREAU VERITAS SA	9,548	24.84	237,172.32
RANDSTAD NV	3,070	52.94	162,525.80
TELEPERFORMANCE	1,798	134.75	242,280.50
WOLTERS KLUWER	7,147	142.55	1,018,804.85
ADP	1,006	118.90	119,613.40
AENA SME SA	2,200	165.95	365,090.00
DEUTSCHE GROUP AG	28,530	42.15	1,202,539.50
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	15,976	7.39	118,206.42
GETLINK	10,511	15.30	160,818.30
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	9,285	101.16	939,270.60
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	1,607	95.45	153,388.15
CONTINENTAL AG	2,802	76.14	213,344.28

DR ING HC F PORSCHE AG	3,475	79.72	277,027.00
FERRARI NV	3,632	355.50	1,291,176.00
MERCEDES-BENZ GROUP AG	23,136	65.53	1,516,102.08
MICHELIN(CGDE)	19,791	33.51	663,196.41
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	3,959	45.98	182,034.82
RENAULT SA	5,408	37.69	203,827.52
STELLANTIS NV	63,669	22.57	1,437,327.67
VOLKSWAGEN AG	591	133.00	78,603.00
VOLKSWAGEN AG-PREF	6,053	117.78	712,922.34
ADIDAS AG	4,718	174.86	824,989.48
HERMES INTERNATIONAL	907	2,144.50	1,945,061.50
KERING	2,155	416.10	896,695.50
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	7,857	802.60	6,306,028.20
MONCLER SPA	5,451	59.70	325,424.70
PUMA SE	2,836	41.67	118,176.12
SEB SA	417	110.90	46,245.30
ACCOR SA	6,007	37.24	223,700.68
AMADEUS IT GROUP SA	12,929	62.02	801,856.58
DELIVERY HERO SE	4,095	22.30	91,318.50
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	2,283	38.64	88,215.12
SODEXO	2,449	77.62	190,091.38
BOLLORE SE	14,850	6.24	92,664.00
PUBLICIS GROUPE	6,295	97.06	610,992.70
SCOUT24 SE	2,465	65.00	160,225.00
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	22,291	27.25	607,429.75
VIVENDI	20,767	10.35	215,042.28
D'IETEREN GROUP	470	175.40	82,438.00
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	31,272	39.21	1,226,175.12
PROSUS NV	42,105	29.10	1,225,255.50
ZALANDO SE	5,907	19.55	115,511.38
CARREFOUR SA	15,170	14.97	227,094.90
HELLOFRESH SE	5,039	12.37	62,357.62
JERONIMO MARTINS	6,820	21.54	146,902.80
KESKO OYJ-B SHS	7,834	17.21	134,823.14
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N.V.	27,899	26.64	743,229.36
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	25,087	57.92	1,453,039.04
DANONE	18,495	60.72	1,123,016.40
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	20,931	9.74	203,951.66
HEINEKEN HOLDING NV	3,344	72.10	241,102.40
HEINEKEN NV	8,349	87.14	727,531.86
JDE PEET'S BV	3,184	22.44	71,448.96
KERRY GROUP PLC-A	4,388	81.98	359,728.24
LOTUS BAKERIES	11	8,990.00	98,890.00

PERNOD RICARD SA	5,898	154.75	912,715.50
REMY COINTREAU	644	97.46	62,764.24
BEIERSDORF AG	2,823	137.25	387,456.75
HENKEL AG & CO KGAA	2,848	62.98	179,367.04
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	4,445	70.20	312,039.00
L'OREAL	6,864	431.30	2,960,443.20
AMPLIFON SPA	3,038	31.14	94,603.32
BIOMERIEUX	820	101.35	83,107.00
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	869	110.75	96,241.75
DIASORIN ITALIA SPA	614	86.78	53,282.92
ESSILORLUXOTTICA	8,437	190.72	1,609,104.64
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	5,474	39.39	215,620.86
FRESENIUS SE & CO KGAA	11,575	26.08	301,876.00
KONINKLIJKE PHILIPS NV	21,802	18.61	405,822.42
SIEMENS HEALTHINEERS AG	7,641	53.72	410,474.52
ARGENX SE	1,740	361.30	628,662.00
BAYER AG-REG	28,356	28.07	795,952.92
EUROFINS SCIENTIFIC	4,329	55.14	238,701.06
GRIFOLS SA	8,799	10.61	93,401.38
IPSEN	693	103.30	71,586.90
MERCK KGAA	3,494	154.00	538,076.00
ORION OYJ-CLASS B	2,913	39.62	115,413.06
QIAGEN N.V.	6,073	39.80	241,705.40
RECORDATI SPA	3,050	50.48	153,964.00
SANOFI	32,407	85.73	2,778,252.11
SARTORIUS AG-VORZUG	784	329.40	258,249.60
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	663	240.90	159,716.70
UCB SA	3,855	94.06	362,601.30
ABN AMRO BANK NV-CVA	13,957	14.32	199,934.02
AIB GROUP PLC	51,212	4.06	208,023.14
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	170,067	9.18	1,562,235.46
BANCO BPM SPA	35,886	5.10	183,233.91
BANCO SANTANDER SA	460,979	3.66	1,691,331.95
BANK OF IRELAND GROUP PLC	30,522	8.26	252,233.80
BNP PARIBAS	29,923	53.92	1,613,448.16
CAIXABANK S.A	118,777	3.99	474,039.00
COMMERZBANK AG	29,203	10.48	306,047.44
CREDIT AGRICOLE SA	29,943	12.20	365,364.48
ERSTE GROUP BANK AG	9,433	39.44	372,037.52
FINECOBANK SPA	17,182	12.92	222,077.35
ING GROEP NV-CVA	103,461	12.28	1,271,121.84
INTESA SANPAOLO	443,944	2.81	1,249,924.33
KBC GROEP NV	7,180	63.10	453,058.00

MEDIOBANCA SPA	14,388	11.48	165,246.18
NORDEA BANK ABP	91,496	10.74	982,667.04
SOCIETE GENERALE SA	21,270	21.63	460,070.10
UNICREDIT SPA	45,891	29.76	1,365,945.61
ADYEN NV	594	1,447.60	859,874.40
AMUNDI SA	1,142	59.95	68,462.90
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	53,160	11.93	634,198.80
DEUTSCHE BOERSE AG	5,487	187.05	1,026,343.35
EDENRED	7,302	55.38	404,384.76
EURAZEO	846	76.95	65,099.70
EURONEXT NV	2,215	79.25	175,538.75
EXOR NV	2,777	96.18	267,091.86
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	2,398	69.80	167,380.40
NEXI SPA	14,056	7.35	103,424.04
SOFINA	272	219.80	59,785.60
WORLDLINE SA	6,107	12.00	73,284.00
AEGON LTD	50,940	5.38	274,464.72
AGEAS	4,697	38.46	180,646.62
ALLIANZ SE-REG	11,511	244.60	2,815,590.60
ASR NEDERLAND NV	4,312	42.99	185,372.88
ASSICURAZIONI GENERALI	27,355	20.54	561,871.70
AXA SA	51,563	30.63	1,579,632.50
HANNOVER RUECK SE	1,645	231.30	380,488.50
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	3,914	409.90	1,604,348.60
NN GROUP NV	8,494	37.46	318,185.24
POSTE ITALIANE SPA	12,729	9.95	126,653.55
SAMPO OYJ-A SHS	13,100	40.55	531,270.50
TALANX AG	1,722	67.35	115,976.70
BECHTLE AG	2,142	49.63	106,307.46
CAPGEMINI SA	4,451	220.00	979,220.00
DASSAULT SYSTEMES SE	19,170	42.85	821,530.35
NEMETSCHEK SE	1,486	87.00	129,282.00
SAP SE	29,733	164.88	4,902,377.04
NOKIA OYJ	146,126	3.24	474,763.37
CELLNEX TELECOM SA	15,557	32.96	512,758.72
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	92,722	22.10	2,049,156.20
ELISA OYJ	4,366	41.19	179,835.54
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	9,768	10.72	104,712.96
KONINKLIJKE KPN NV	99,734	3.20	319,647.47
ORANGE	51,043	10.63	542,689.17
TELECOM ITALIA SPA	282,105	0.27	77,578.87
TELEFONICA SA	141,116	3.57	504,489.70
ACCIONA SA	678	110.10	74,647.80

	CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVA	1,625	21.12	34,320.00
	E.ON SE	65,153	11.77	766,850.81
	EDP RENOVAVEIS SA	7,288	13.94	101,631.16
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	92,757	3.75	348,302.53
	ELIA GROUP SA/NV	575	105.00	60,375.00
	ENAGAS SA	6,843	14.33	98,094.40
	ENDESA SA	8,910	16.90	150,623.55
	ENEL SPA	232,853	5.91	1,377,092.64
	ENGIE	52,643	14.37	756,795.76
	FORTUM OYJ	10,734	10.90	117,000.60
	IBERDROLA SA	175,180	10.78	1,889,316.30
	NATURGY ENERGY GROUP SA	3,070	23.26	71,408.20
	REDEIA CORP SA	13,475	14.47	194,983.25
	RWE AG	17,380	31.84	553,379.20
	SNAM SPA	53,892	4.34	234,322.41
	TERNA SPA	38,984	7.37	287,390.04
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	18,656	29.48	549,978.88
	VERBUND AG	1,686	62.60	105,543.60
	ASM INTERNATIONAL NV	1,352	558.60	755,227.20
	ASML HOLDING NV	11,453	853.40	9,773,990.20
	BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	2,064	154.65	319,197.60
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	37,425	32.99	1,234,837.87
	STMICROELECTRONICS NV	19,563	41.69	815,679.28
	LEG IMMOBILIEN SE	2,018	69.48	140,210.64
	VONOVIA SE	21,981	25.77	566,450.37
	ユーロ 小計	5,159,942		140,398,916.21 (22,677,232,946)
英ボンド	BP PLC	486,185	4.76	2,316,671.52
	SHELL PLC-NEW	188,121	24.97	4,698,321.97
	ANGLO AMERICAN PLC	36,619	17.47	639,807.16
	ANTOFAGASTA PLC	9,832	16.76	164,833.48
	CRH PLC	20,260	58.82	1,191,693.20
	CRODA INTERNATIONAL PLC	4,351	48.65	211,676.15
	ENDEAVOUR MINING PLC	5,026	12.69	63,779.94
	GLENCORE PLC	299,354	3.91	1,171,821.23
	MONDI PLC	10,814	13.52	146,259.35
	RIO TINTO PLC	32,132	53.09	1,705,887.88
	ASHTREAD GROUP PLC	12,678	51.70	655,452.60
	BAE SYSTEMS PLC	87,291	12.30	1,073,679.30
	BUNZL PLC	9,080	31.88	289,470.40
	DCC PLC	2,603	56.20	146,288.60
	MELROSE INDUSTRIES PLC	37,196	6.02	224,068.70
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	242,892	3.12	758,308.82

SMITHS GROUP PLC	8,753	15.99	139,960.47
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	2,317	101.60	235,407.20
EXPERIAN PLC	26,424	33.59	887,582.16
INTERTEK GROUP PLC	5,038	43.79	220,614.02
RELX PLC	53,930	33.36	1,799,104.80
RENTOKIL INITIAL PLC	68,450	4.07	278,933.75
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	27,219	4.73	128,909.18
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	2,907	46.32	134,652.24
BURBERRY GROUP PLC	10,857	12.96	140,761.00
PERSIMMON PLC	8,500	14.03	119,297.50
TAYLOR WIMPEY PLC	102,300	1.43	147,158.55
COMPASS GROUP PLC	49,083	21.86	1,072,954.38
ENTAIN PLC	16,920	9.33	157,931.28
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	5,088	166.05	844,862.40
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	4,829	76.40	368,935.60
PEARSON PLC	18,520	9.46	175,199.20
WHITBREAD PLC	6,021	34.45	207,423.45
AUTO TRADER GROUP PLC	29,003	7.12	206,733.38
INFORMA PLC	36,756	7.98	293,533.41
WPP PLC	31,267	7.65	239,317.61
JD SPORTS FASHION PLC	67,369	1.08	72,926.94
KINGFISHER PLC	48,904	2.18	106,855.24
NEXT PLC	3,213	82.96	266,550.48
OCADO GROUP PLC	16,747	5.32	89,228.01
SAINSBURY (J) PLC	52,374	2.50	131,353.99
TESCO PLC	193,731	2.77	537,022.33
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	10,301	22.66	233,420.66
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	60,854	23.99	1,459,887.46
COCA-COLA HBC AG-DI	5,331	23.82	126,984.42
DIAGEO PLC	64,265	28.68	1,843,441.52
IMPERIAL BRANDS PLC	23,388	18.92	442,500.96
HALEON PLC	159,842	3.16	505,420.40
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	20,515	56.92	1,167,713.80
UNILEVER PLC	71,176	39.86	2,837,075.36
NMC HEALTH PLC	438	0.00	0.00
SMITH & NEPHEW PLC	25,100	10.97	275,472.50
ASTRAZENECA PLC	44,076	97.24	4,285,950.24
GSK PLC	116,851	16.68	1,949,074.68
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	4,453	19.65	87,501.45
BARCLAYS PLC	433,957	1.42	616,305.73
HSBC HOLDINGS PLC	554,151	6.20	3,439,615.25
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,820,815	0.41	754,545.73
NATWEST GROUP PLC	158,355	2.09	330,961.95

	STANDARD CHARTERED PLC	61,177	5.76	352,379.52
	3I GROUP PLC	28,145	23.88	672,102.60
	ABRDN PLC	51,021	1.61	82,194.83
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	11,463	8.30	95,234.60
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	11,950	88.62	1,059,009.00
	M&G PLC	53,635	2.19	117,836.09
	SCHRODERS PLC	19,357	3.98	77,137.64
	ST JAMES'S PLACE PLC	12,910	6.22	80,326.02
	WISE PLC - A	16,616	8.32	138,311.58
	ADMIRAL GROUP PLC	7,507	25.48	191,278.36
	AVIVA PLC	80,281	4.25	341,595.65
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	163,168	2.35	383,771.13
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	16,924	4.95	83,841.49
	PRUDENTIAL PLC	74,924	7.90	592,199.29
	SAGE GROUP PLC/THE	27,848	11.67	324,986.16
	HALMA PLC	10,535	21.90	230,716.50
	BT GROUP PLC	167,081	1.04	175,100.88
	VODAFONE GROUP PLC	670,239	0.65	438,135.23
	CENTRICA PLC	162,387	1.34	218,248.12
	NATIONAL GRID PLC	105,833	10.02	1,060,446.66
	SEVERN TRENT PLC	8,461	24.97	211,271.17
	SSE PLC	29,718	15.70	466,572.60
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	18,553	10.23	189,797.19
	英債券 小計	7,764,555		52,399,593.29 (9,912,431,062)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	4,450	10.95	48,727.50
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	185	626.00	115,810.00
	GIVAUDAN-REG	265	3,675.00	973,875.00
	HOLCIM LTD	14,961	66.54	995,504.94
	SIG GROUP AG	8,857	17.96	159,071.72
	SIKA AG-REG	4,372	244.90	1,070,702.80
	ABB LTD-REG	45,761	38.92	1,781,018.12
	GEBERIT AG-REG	976	504.80	492,684.80
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	620	217.20	134,664.00
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,097	226.80	248,799.60
	VAT GROUP AG	716	424.30	303,798.80
	ADECCO SA-REG	4,419	36.48	161,205.12
	SGS SA-REG	4,000	83.12	332,480.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	1,539	285.30	439,076.70
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	14,958	134.25	2,008,111.50
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	867	209.30	181,463.10
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	959	40.40	38,743.60
	AVOLTA AG	3,059	35.16	107,554.44

BARRY CALLEBAUT AG-REG	90	1,298.00	116,820.00	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	27	11,320.00	305,640.00	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	3	112,400.00	337,200.00	
NESTLE SA-REG	75,907	96.83	7,350,074.81	
ALCON INC	14,379	67.96	977,196.84	
SONOVA HOLDING AG-REG	1,404	284.90	399,999.60	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	3,272	139.20	455,462.40	
BACHEM HOLDING AG-REG B	580	63.15	36,627.00	
LONZA GROUP AG-REG	2,145	462.60	992,277.00	
NOVARTIS AG-REG	58,281	87.80	5,117,071.80	
ROCHE HOLDING AG-BR	863	239.80	206,947.40	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	19,981	227.20	4,539,683.20	
SANDOZ GROUP AG	10,872	28.45	309,308.40	
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	737	105.70	77,900.90	
JULIUS BAER GROUP LTD	6,477	47.35	306,685.95	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	656	1,213.50	796,056.00	
UBS GROUP AG-REG	93,856	24.25	2,276,008.00	
BALOISE HOLDING AG - REG	1,130	142.20	160,686.00	
HELVETIA HOLDING AG-REG	1,070	122.20	130,754.00	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	858	622.80	534,362.40	
SWISS RE AG	8,683	102.50	890,007.50	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	4,181	437.40	1,828,769.40	
TEMENOS GROUP AG-REG	1,696	88.48	150,062.08	
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	4,494	76.54	343,970.76	
SWISSCOM AG-REG	760	503.20	382,432.00	
BKW AG	522	131.80	68,799.60	
SWISS PRIME SITE-REG	2,082	85.35	177,698.70	
スイスフラン 小計	427,067		38,861,793.48 (6,603,784,566)	
スウェーデンク ローナ				
BOLIDEN AB	8,974	267.35	2,399,198.90	
HOLMEN AB-B SHARES	2,814	396.80	1,116,595.20	
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	17,171	136.35	2,341,265.85	
ALFA LAVAL AB	7,597	380.10	2,887,619.70	
ASSA ABLOY AB-B	29,041	283.80	8,241,835.80	
ATLAS COPCO AB-A SHS	77,243	168.55	13,019,307.65	
ATLAS COPCO AB-B SHS	45,487	146.40	6,659,296.80	
BEIJER REF AB	10,131	145.90	1,478,112.90	
EPIROC AB-A	17,281	186.90	3,229,818.90	
EPIROC AB-B	10,209	164.40	1,678,359.60	
HUSQVARNA AB-B SHS	8,099	76.72	621,355.28	
INDUTRADE AB	7,147	273.30	1,953,275.10	
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	2,737	260.00	711,620.00	
LIFCO AB-B SHS	8,063	268.10	2,161,690.30	

	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	42,668	65.68	2,802,434.24	
	SAAB AB-B	2,409	775.80	1,868,902.20	
	SANDVIK AB	29,539	217.00	6,409,963.00	
	SKANSKA AB-B SHS	8,250	186.80	1,541,100.00	
	SKF AB-B SHARES	9,296	212.60	1,976,329.60	
	VOLVO AB-A SHS	5,298	272.40	1,443,175.20	
	VOLVO AB-B SHS	43,501	265.85	11,564,740.85	
	SECURITAS AB-B SHS	17,598	106.35	1,871,547.30	
	VOLVO CAR AB-B	10,746	37.08	398,461.68	
	EVOLUTION AB	4,992	1,311.20	6,545,510.40	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	18,218	141.10	2,570,559.80	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	17,758	238.00	4,226,404.00	
	GETINGE AB-B SHS	6,454	198.35	1,280,150.90	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	5,811	250.40	1,455,074.40	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	45,806	148.80	6,815,932.80	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	42,388	121.60	5,154,380.80	
	SWEDBANK AB - A SHARES	23,817	213.90	5,094,456.30	
	EQT AB	10,109	274.10	2,770,876.90	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	3,567	333.30	1,188,881.10	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	3,625	333.30	1,208,212.50	
	INVESTOR AB-B SHS	49,865	250.80	12,506,142.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	1,611	548.20	883,150.20	
	ERICSSON LM-B SHS	85,986	55.25	4,750,726.50	
	HEXAGON AB-B SHS	57,185	115.05	6,579,134.25	
	TELE2 AB-B SHS	19,254	83.36	1,605,013.44	
	TELIA CO AB	75,050	24.38	1,829,719.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	17,865	63.82	1,140,144.30	
	SAGAX AB-B	5,246	251.00	1,316,746.00	
	スウェーデンクローナ 小計	915,906		147,297,221.64 (2,109,296,213)	
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	8,475	261.60	2,217,060.00	
	EQUINOR ASA	26,070	264.00	6,882,480.00	
	NORSK HYDRO ASA	39,706	56.28	2,234,653.68	
	YARA INTERNATIONAL ASA	4,955	360.30	1,785,286.50	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	1,670	650.50	1,086,335.00	
	ADEVINTA ASA	9,112	113.10	1,030,567.20	
	MOWI ASA	15,441	197.60	3,051,141.60	
	ORKLA ASA	18,647	75.84	1,414,188.48	
	SALMAR ASA	2,244	590.20	1,324,408.80	
	DNB BANK ASA	26,921	204.80	5,513,420.80	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	4,317	171.30	739,502.10	
	TELENOR ASA	17,808	114.80	2,044,358.40	
		175,366		29,323,402.56	

ノルウェークローネ 小計				(417,272,018)
デンマーククローネ	NOVOZYMES A/S-B SHARES	9,938	366.10	3,638,301.80
	ROCKWOOL A/S-B SHS	229	2,164.00	495,556.00
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	29,352	188.38	5,529,329.76
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	78	10,620.00	828,360.00
	AP MOELLER-MAERSK A/S-B	146	10,815.00	1,578,990.00
	DSV A/S	5,385	1,137.00	6,122,745.00
	PANDORA A/S	2,489	1,104.00	2,747,856.00
	CARLSBERG AS-B	2,655	930.00	2,469,150.00
	COLOPLAST-B	3,785	878.60	3,325,501.00
	DEMANT A/S	3,200	357.70	1,144,640.00
	GENMAB A/S	1,795	1,877.50	3,370,112.50
	NOVO NORDISK A/S-B	92,752	846.90	78,551,668.80
	DANSKE BANK A/S	19,131	194.35	3,718,109.85
	TRYG A/S	10,027	143.70	1,440,879.90
	ORSTED A/S	5,698	402.50	2,293,445.00
デンマーククローネ 小計		186,660		117,254,645.61 (2,540,908,170)
オーストラリアドル	AMPOL LTD	6,343	36.69	232,724.67
	SANTOS LTD	85,587	7.39	632,487.93
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	53,976	31.18	1,682,971.68
	BHP GROUP LTD	143,932	45.95	6,613,675.40
	BLUESCOPE STEEL LTD	13,389	21.67	290,139.63
	FORTESCUE LTD	48,247	27.69	1,335,959.43
	IGO LTD	16,726	6.95	116,245.70
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	12,919	55.42	715,970.98
	MINERAL RESOURCES LTD	4,720	56.84	268,284.80
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	32,470	12.87	417,888.90
	ORICA LTD	13,514	16.24	219,467.36
	PILBARA MINERALS LTD	79,307	3.50	277,574.50
	RIO TINTO LTD	10,575	128.26	1,356,349.50
	SOUTH32 LTD	133,593	3.08	411,466.44
	REECE LTD	5,105	23.09	117,874.45
	BRAMBLES LTD	38,743	15.00	581,145.00
	COMPUTERSHARE LTD	15,873	26.29	417,301.17
	AURIZON HOLDINGS LTD	45,292	3.94	178,450.48
	QANTAS AIRWAYS LTD	17,415	5.71	99,439.65
	TRANSURBAN GROUP	88,302	12.76	1,126,733.52
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	16,691	43.70	729,396.70
	IDP EDUCATION LTD	6,171	21.92	135,268.32
	LOTTERY CORP LTD/THE	59,224	4.92	291,382.08
CAR GROUP LTD	10,658	33.37	355,657.46	
REA GROUP LTD	1,458	181.80	265,064.40	

	SEEK LTD	10,021	24.28	243,309.88
	WESFARMERS LTD	32,373	58.94	1,908,064.62
	COLES GROUP LTD	34,879	16.00	558,064.00
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	40,049	5.39	215,864.11
	WOOLWORTHS GROUP LTD	35,019	35.48	1,242,474.12
	TREASURY WINE ESTATES LTD	27,686	11.07	306,484.02
	COCHLEAR LTD	1,833	329.07	603,185.31
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	5,971	51.44	307,148.24
	SONIC HEALTHCARE LTD	12,546	32.15	403,353.90
	CSL LTD	13,728	280.19	3,846,448.32
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	85,299	27.81	2,372,165.19
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	47,565	114.07	5,425,739.55
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	88,803	32.51	2,886,985.53
	WESTPAC BANKING CORP	99,597	24.12	2,402,279.64
	ASX LTD	5,710	66.78	381,313.80
	MACQUARIE GROUP LTD	10,472	185.92	1,946,954.24
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	6,799	33.57	228,242.43
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	67,809	6.33	429,230.97
	MEDIBANK PRIVATE LTD	87,487	3.78	330,700.86
	QBE INSURANCE GROUP LTD	39,069	16.46	643,075.74
	SUNCORP GROUP LTD	35,184	14.44	508,056.96
	WISETECH GLOBAL LTD	4,798	74.99	359,802.02
	XERO LTD	4,386	111.58	489,389.88
	TELSTRA GROUP LTD	101,989	3.99	406,936.11
	APA GROUP	37,178	8.05	299,282.90
	ORIGIN ENERGY LTD	48,740	8.57	417,701.80
	オーストラリアドル 小計	1,945,220		48,031,174.29 (4,688,322,922)
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	38,815	8.15	316,342.25
	EBOS GROUP LTD	4,341	36.91	160,226.31
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	16,964	23.80	403,743.20
	SPARK NEW ZEALAND LTD	52,094	5.12	266,721.28
	MERCURY NZ LTD	18,009	6.77	121,920.93
	MERIDIAN ENERGY LTD	33,959	5.66	192,207.94
	ニュージーランドドル 小計	164,182		1,461,161.91 (133,915,489)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	82,500	41.15	3,394,875.00
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	38,500	84.60	3,257,100.00
	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	52,000	6.62	344,240.00
	MTR CORP	44,500	25.15	1,119,175.00
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	24,000	13.34	320,160.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	62,000	44.35	2,749,700.00
	SANDS CHINA LTD	70,200	23.20	1,628,640.00

	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	45,800	12.90	590,820.00	
	WH GROUP LTD	210,000	4.59	963,900.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	94,500	19.10	1,804,950.00	
	HANG SENG BANK LTD	22,500	81.00	1,822,500.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	35,300	243.60	8,599,080.00	
	AIA GROUP LTD	329,600	62.70	20,665,920.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	69,000	9.30	641,700.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD (CKI)	11,900	44.85	533,715.00	
	CLP HOLDINGS LTD	51,000	64.45	3,286,950.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	311,717	5.69	1,773,669.73	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	42,500	45.50	1,933,750.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	55,500	35.30	1,959,150.00	
	ESR GROUP LTD	70,200	9.41	660,582.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	45,000	8.21	369,450.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	32,916	20.90	687,944.40	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	38,000	9.38	356,440.00	
	SINO LAND CO	106,000	7.96	843,760.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	45,700	71.40	3,262,980.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	13,700	61.00	835,700.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	21,400	14.90	318,860.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	32,000	25.65	820,800.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	40,000	24.45	978,000.00	
	香港ドル 小計	2,097,933		66,524,511.13 (1,280,596,839)	
シンガポールドル	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	2,400	26.77	64,248.00	
	KEPPEL LTD	47,000	7.17	336,990.00	
	SEATRIM LTD	1,253,142	0.08	107,770.21	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	33,900	3.83	129,837.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	37,300	7.14	266,322.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	178,600	1.02	182,172.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	45,400	3.15	143,010.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	51,700	32.57	1,683,869.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	97,000	12.95	1,256,150.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	34,800	28.32	985,536.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	24,000	9.15	219,600.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	241,800	2.35	568,230.00	
	SEMBICORP INDUSTRIES LTD	25,700	5.56	142,892.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	82,600	2.83	233,758.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	20,000	5.89	117,800.00	
	UOL GROUP LTD	9,400	5.90	55,460.00	
	シンガポールドル 小計	2,184,742		6,493,644.21 (725,015,376)	
イスラエルシュ	ICL GROUP LTD	24,131	17.17	414,329.27	

ケル	ELBIT SYSTEMS LTD	724	756.50	547,706.00
	BANK HAPOLIM BM	35,677	31.71	1,131,317.67
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	46,176	27.50	1,269,840.00
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	34,303	17.56	602,360.68
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	4,617	134.30	620,063.10
	NICE SYSTEMS LTD	1,914	802.40	1,535,793.60
	AZRIELI GROUP	723	236.70	171,134.10
イスラエルシュケル 小計		148,265		6,292,544.42 (259,509,565)
合 計		31,916,939		244,211,215,290 (244,211,215,290)

(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	509,009.94	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	8,191	278,739.73	
		AMERICAN TOWER CORP	13,280	2,503,147.20	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	14,925	274,023.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	3,860	668,590.60	
		BOSTON PROPERTIES INC	3,897	246,368.34	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	2,862	268,570.08	
		CROWN CASTLE INC	12,406	1,312,554.80	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	8,670	1,233,134.10	
		EQUINIX INC	2,669	2,222,769.89	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	5,137	339,966.66	
		EQUITY RESIDENTIAL	9,814	575,591.10	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,729	392,932.54	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	6,069	847,232.40	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	7,625	343,963.75	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	15,625	263,437.50	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	20,316	394,536.72	
		INVITATION HOMES INC	17,695	572,079.35	
		IRON MOUNTAIN INC	7,969	538,305.95	
		KIMCO REALTY CORP	19,501	379,684.47	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	3,188	398,786.92			
PROLOGIS INC	26,300	3,432,150.00			
PUBLIC STORAGE	4,527	1,269,732.96			

	REALTY INCOME CORP	24,697	1,269,178.83
	REGENCY CENTERS CORP	4,747	285,721.93
	SBA COMMUNICATIONS CORP	2,950	616,756.50
	SIMON PROPERTY GROUP INC	9,361	1,337,312.46
	SUN COMMUNITIES INC	3,399	431,197.14
	UDR INC	9,434	328,963.58
	VENTAS INC	10,931	498,562.91
	VICI PROPERTIES INC	29,114	850,128.80
	WELLTOWER INC	14,841	1,385,704.17
	WEYERHAEUSER CO	21,072	696,008.16
	WP CAREY INC	5,737	320,296.71
	米ドル 小計	357,029	27,285,139.19 (4,106,140,596)
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	1,821	89,738.88
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	2,998	55,283.12
	カナダドル 小計	4,819	145,022.00 (16,117,745)
ユーロ	COVIVIO	968	39,959.04
	GECINA SA	1,560	149,292.00
	KLEPIERRE	7,298	165,591.62
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	3,132	216,170.64
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	4,126	104,552.84
	ユーロ 小計	17,084	675,566.14 (109,117,442)
英ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	22,154	140,677.90
	SEGRO PLC	34,080	277,683.84
	英ポンド 小計	56,234	418,361.74 (79,141,490)
オーストラリアドル	DEXUS/AU	33,935	265,032.35
	GOODMAN GROUP	48,821	1,298,638.60
	GPT GROUP	65,528	290,944.32
	MIRVAC GROUP	109,547	245,385.28
	SCENTRE GROUP	149,154	459,394.32
	STOCKLAND	75,930	342,444.30
	VICINITY CENTRES	97,692	199,291.68
	オーストラリアドル 小計	580,607	3,101,130.85 (302,701,382)
香港ドル	LINK REIT	78,700	2,939,445.00
	香港ドル 小計	78,700	2,939,445.00 (56,584,316)
シンガポールドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	106,100	288,592.00
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	151,663	289,676.33
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	110,100	166,251.00

	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA	73,900	100,504.00
	シンガポールドル 小計	441,763	845,023.33 (94,346,854)
	投資証券合計		4,764,149,825 (4,764,149,825)
	合計		4,764,149,825 (4,764,149,825)

(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	97.8%			74.3%
	投資証券 34銘柄			2.2%	1.6%
カナダドル	株式 86銘柄	99.8%			3.2%
	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 220銘柄	99.5%			9.2%
	投資証券 5銘柄			0.5%	0.0%
英ポンド	株式 82銘柄	99.2%			4.0%
	投資証券 2銘柄			0.8%	0.0%
スイスフラン	株式 45銘柄	100.0%			2.7%
スウェーデンクローナ	株式 42銘柄	100.0%			0.8%
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 15銘柄	100.0%			1.0%
オーストラリアドル	株式 51銘柄	93.9%			1.9%
	投資証券 7銘柄			6.1%	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%			0.5%
	投資証券 1銘柄			4.2%	0.0%
シンガポールドル	株式 16銘柄	88.5%			0.3%
	投資証券 4銘柄			11.5%	0.0%
イスラエルシェケル	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。

R M新興国株式マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2024年 2月15日現在

資産の部	
流動資産	
預金	1,188,037,334
コール・ローン	28,142,318
株式	31,429,406,130
投資証券	42,988,304
派生商品評価勘定	37,416,329
未収配当金	23,780,904
差入委託証拠金	670,283,474
流動資産合計	33,420,054,793
資産合計	
33,420,054,793	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,251,637
未払金	5,517,638
未払解約金	4,120,000
未払利息	76
流動負債合計	10,889,351
負債合計	
10,889,351	
純資産の部	
元本等	
元本	18,168,252,173
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	15,240,913,269
元本等合計	33,409,165,442
純資産合計	
33,409,165,442	
負債純資産合計	
33,420,054,793	

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2024年 2月15日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況 期首	2023年 2月16日

期首元本額	13,158,730,221円
期中追加設定元本額	6,815,321,853円
期中一部解約元本額	1,805,799,901円
期末元本額	18,168,252,173円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	569,845,466円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	2,536,302,109円
りそなラップ型ファンド(成長型)	2,525,714,329円
DCりそな グローバルバランス	16,572,450円
つみたてバランスファンド	1,226,436,537円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	506,268,455円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	393,997,871円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	274,983,302円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	144,442,806円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	98,210,394円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	56,335,983円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	133,754,799円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	135,736,620円
九州SDGs・グローバルバランス	71,299,628円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定型)	4,445,928円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定成長型)	113,809,594円
ラップ型ファンド・プラスESG(成長型)	239,192,986円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定型)	19,880,287円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定成長型)	51,817,991円
りそな つみたてラップ型ファンド(成長型)	56,666,289円
りそな つみたてリスクコントロールファンド	2,493,242円
ターゲットリターンバランスファンド(目標2%)	415,479円
ターゲットリターンバランスファンド(目標3%)	352,126円
ターゲットリターンバランスファンド(目標4%)	2,461,488円
ターゲットリターンバランスファンド(目標5%)	1,192,123円
ターゲットリターンバランスファンド(目標6%)	3,140,978円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2065	387,939円
FWりそな先進国+新興国株式アクティブファンド	131,656,643円
FWりそな新興国株式インデックスファンド	4,422,215,264円
Smart-i 新興国株式インデックス	2,972,682,368円
Smart-i 8資産バランス 安定型	127,390,658円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	435,061,223円
Smart-i 8資産バランス 成長型	618,738,203円
Smart-i Select 全世界株式インデックス	117,750,288円
Smart-i Select 全世界株式インデックス(除く日本)	43,751,879円
Smart-i DC 全世界株式インデックス	6,594,033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)	1,874,872円
りそなVIグローバル・バランスファンド(安定成長型)(適格機関投資家専用)	9,394,266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)	94,919,976円
2. 計算日における受益権の総数	18,168,252,173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	1.8389円
(10,000口当たり純資産額)	(18,389円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2024年 2月15日現在

1. 金融商品に対する取組方針

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

2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

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

金融商品の時価等に関する事項

2024年 2月15日現在

- 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。
- 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。
- 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)

2024年 2月15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	2024年 2月15日現在	
	損益に含まれた評価差額(円)	
株式	572,062,518	
投資証券	173,874	
合計	572,236,392	

(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)

(2024年 2月15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	1,906,158,259	-	-	1,942,348,094	36,189,835
	買建					
合計		1,906,158,259	-	-	1,942,348,094	36,189,835

(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)

(2024年 2月15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	21,842,800	-	-	21,817,657	25,143
	買建					

	米ドル	21,842,800	-	21,817,657	25,143
	合計	21,842,800	-	21,817,657	25,143

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	36,100	1.88	67,904.10	
	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	6,983	15.32	106,979.56	
	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	2,576	80.12	206,389.12	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	12,920	17.92	231,526.40	
	NIO INC - ADR	41,980	6.00	251,880.00	
	H WORLD GROUP LTD	6,391	33.47	213,906.77	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	12,989	15.24	197,952.36	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	12,569	40.38	507,536.22	
	AUTOHOME INC-ADR	2,118	26.70	56,550.60	
	IQIYI INC-ADR	13,465	3.50	47,127.50	
	JOYY INC	1,406	33.10	46,538.60	
	KANZHUN LTD	7,094	14.73	104,494.62	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	22,683	10.18	230,912.94	
	VK CO LTD	2,211	0.00	0.00	
	WEIBO CORP-SPON ADR	2,566	9.29	23,838.14	
	PDD HOLDINGS INC	18,115	132.01	2,391,361.15	

	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	10,746	16.89	181,499.94
	X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	2,296	0.00	0.00
	LEGEND BIOTECH CORP-ADR	2,140	57.83	123,756.20
	COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	165,020	1.16	192,083.28
	CREDICORP LTD	2,005	162.48	325,772.40
	TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	2,188	0.00	0.00
	LUFAX HOLDING LTD-ADR	7,328	2.42	17,733.76
	QIFU TECHNOLOGY INC	3,999	15.31	61,224.69
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	20,088	2.04	41,160.31
	DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	2,051	19.04	39,051.04
	KE HOLDINGS INC	20,341	13.78	280,298.98
	米ドル 小計	487,160		5,947,478.68 (895,036,066)
メキシコペソ	CEMEX SAB-CPO	470,100	13.02	6,120,702.00
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	95,400	85.75	8,180,550.00
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	5,350	216.81	1,159,933.50
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	27,700	32.91	911,607.00
	ALFA S.A.B. -A	87,800	13.04	1,144,912.00
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	17,700	153.21	2,711,817.00
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	11,960	266.56	3,188,057.60
	GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	6,130	508.61	3,117,779.30
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL CENT	8,600	156.41	1,345,126.00
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	5,980	178.55	1,067,729.00
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	159,700	70.74	11,297,178.00
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	16,100	191.91	3,089,751.00
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	14,350	167.69	2,406,351.50
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	59,300	243.27	14,425,911.00
	GRUMA S.A.B. -B	5,455	314.37	1,714,888.35
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	37,700	77.54	2,923,258.00
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	51,200	37.74	1,932,288.00
	BANCO DEL BAJIO SA	22,200	67.17	1,491,174.00
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	79,000	184.30	14,559,700.00
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	54,000	55.28	2,985,120.00
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	574,400	15.01	8,621,744.00
	メキシコペソ 小計	1,810,125		94,395,577.25 (831,209,695)
ブラジルリアル	COSAN SA	34,500	18.23	628,935.00
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	113,000	42.31	4,781,030.00
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	144,500	40.99	5,923,055.00
	PRIO SA	24,800	42.55	1,055,240.00
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	20,900	29.24	611,116.00
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	23,200	17.87	414,584.00
	GERDAU SA-PREF	36,695	20.74	761,054.30

KLABIN SA - UNIT	22,300	21.21	472,983.00	
SUZANO SA	24,507	52.25	1,280,490.75	
VALE SA	103,404	65.72	6,795,710.88	
WEG SA	51,500	33.53	1,726,795.00	
CCR SA	26,700	13.73	366,591.00	
LOCALIZA RENT A CAR	26,510	52.00	1,378,520.00	
RUMO SA	40,700	23.83	969,881.00	
LOJAS RENNER S.A.	30,720	14.60	448,512.00	
MAGAZINE LUIZA SA	86,300	2.02	174,326.00	
VIBRA ENERGIA SA	33,500	23.86	799,310.00	
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	19,100	11.54	220,414.00	
RAIA DROGASIL SA	37,676	25.30	953,202.80	
SENDAS DISTRIBUIDORA SA	41,700	13.16	548,772.00	
AMBEV SA	144,700	12.92	1,869,524.00	
JBS SA	21,300	22.54	480,102.00	
NATURA &CO HOLDING SA	28,800	16.70	480,960.00	
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	150,892	3.42	516,050.64	
REDE D'OR SAO LUIZ SA	18,200	26.35	479,570.00	
HYPERA SA	13,100	30.85	404,135.00	
BANCO BRADESCO S.A.	42,615	12.24	521,607.60	
BANCO BRADESCO SA-PREF	161,636	13.37	2,161,073.32	
BANCO DO BRASIL S.A.	26,200	58.35	1,528,770.00	
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	11,700	28.24	330,408.00	
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	147,100	34.29	5,044,059.00	
ITAUSA SA	162,928	10.36	1,687,934.08	
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	178,000	12.86	2,289,080.00	
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	36,400	37.02	1,347,528.00	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	22,000	32.93	724,460.00	
TOTVS SA	16,400	29.99	491,836.00	
TELEFONICA BRASIL S.A.	11,000	54.49	599,390.00	
TIM SA	24,000	18.38	441,120.00	
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	7,100	47.48	337,108.00	
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	37,200	42.99	1,599,228.00	
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	44,134	11.29	498,272.86	
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	10,300	78.99	813,597.00	
COMPANHIA PARANAENSE DE ENER	28,200	10.24	288,768.00	
CPFL ENERGIA SA	7,200	35.56	256,032.00	
ENERGISA SA-UNITS	6,100	50.31	306,891.00	
ENEVA SA	22,700	12.34	280,118.00	
ENGIE BRASIL ENERGIA SA	6,275	40.40	253,510.00	
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	32,200	33.59	1,081,598.00	
ブラジルリアル 小計	2,360,592		57,423,253.23 (1,735,893,460)	

チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	12,153	5,950.00	72,310,350.00
	EMPRESAS CMPC SA	33,869	1,555.00	52,666,295.00
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	4,419	38,860.00	171,722,340.00
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES	466,759	62.50	29,172,437.50
	LATAM AIRLINES GROUP SA	5,527,400	11.47	63,399,278.00
	FALABELLA SA	29,867	2,264.90	67,645,768.30
	CENCOSUD SA	35,890	1,644.00	59,003,160.00
	BANCO DE CHILE	1,244,596	110.00	136,905,560.00
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	2,535	26,490.00	67,152,150.00
	BANCO SANTANDER CHILE	2,112,585	45.24	95,573,345.40
	ENEL AMERICAS SA	715,157	98.50	70,442,964.50
	ENEL CHILE SA	827,632	55.00	45,519,760.00
チリペソ 小計		11,012,862		931,513,408.70 (146,215,002)
コロンビアペソ	BANCOLOMBIA SA	8,656	32,700.00	283,051,200.00
	BANCOLOMBIA SA-PREF	13,694	30,880.00	422,870,720.00
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	12,989	16,600.00	215,617,400.00
コロンビアペソ 小計		35,339		921,539,320.00 (35,386,188)
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	2,267	27.34	61,979.78
	MYTILINEOS S.A.	3,099	37.30	115,592.70
	OPAP SA	4,870	16.31	79,429.70
	JUMBO SA	3,761	27.30	102,675.30
	ALPHA SERVICES AND HOLDINGS	65,690	1.72	113,512.32
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	74,565	1.93	144,245.99
	NATIONAL BANK OF GREECE	24,364	7.25	176,639.00
	PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS S	20,288	3.93	79,731.84
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	6,206	13.18	81,795.08
	PUBLIC POWER CORP	5,654	11.78	66,604.12
ユーロ 小計		210,764		1,022,205.83 (165,106,685)
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	27,711	164.60	4,561,230.60
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	51,409	46.60	2,395,659.40
	HEKTAS TICARET T.A.S	35,672	19.65	700,954.80
	KOZA ALTIN ISLETMELERI AS	25,931	22.70	588,633.70
	SASA POLYESTER SANAYI	43,418	40.16	1,743,666.88
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	45,551	54.90	2,500,749.90
	KOC HOLDING AS	21,761	171.50	3,732,011.50
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	50,028	52.45	2,623,968.60
	PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS	1,253	813.00	1,018,689.00
	TURK HAVA YOLLARI AO	16,774	282.50	4,738,655.00
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	1,780	970.00	1,726,600.00
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	3,208	250.00	802,000.00

	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	13,195	381.00	5,027,295.00	
	AKBANK T.A.S.	102,391	41.00	4,198,031.00	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	30,648	79.80	2,445,710.40	
	TURKIYE IS BANKASI-C	114,805	27.82	3,193,875.10	
	YAPI VE KREDI BANKASI	92,810	23.52	2,182,891.20	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	41,740	67.50	2,817,450.00	
	トルコリラ 小計	720,085		46,998,072.08 (230,158,958)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	2,117	825.00	1,746,525.00	
	MONETA MONEY BANK AS	12,265	100.60	1,233,859.00	
	CEZ AS	4,830	822.00	3,970,260.00	
	チェココルナ 小計	19,212		6,950,644.00 (44,212,351)	
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	14,869	2,916.00	43,358,004.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	3,960	9,610.00	38,055,600.00	
	OTP BANK PLC	7,341	17,040.00	125,090,640.00	
	ハンガリーフォリント 小計	26,170		206,504,244.00 (85,848,563)	
ポーランドズロ チ	ORLEN SA	17,899	66.90	1,197,443.10	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	3,988	110.10	439,078.80	
	BUDIMEX	397	684.00	271,548.00	
	LPP SA	32	15,720.00	503,040.00	
	CD PROJEKT SA	1,602	110.30	176,700.60	
	CYFROWY POLSAT SA	8,679	10.97	95,208.63	
	ALLEGRO.EU SA	15,711	32.04	503,458.99	
	PEPCO GROUP NV	5,086	21.34	108,535.24	
	DINO POLSKA SA	1,568	439.50	689,136.00	
	BANK PEKAO SA	5,778	163.00	941,814.00	
	MBANK SA	464	595.80	276,451.20	
	PKO BANK POLSKI SA	26,887	53.48	1,437,916.76	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	977	495.40	484,005.80	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	17,639	48.34	852,669.26	
	PGE SA	29,021	8.42	244,356.82	
	ポーランドズロチ 小計	135,728		8,221,363.20 (305,916,102)	
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	
	SURGUTNEFTGAS-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
	ロシアグループ 小計	67,168,893		0.00 (0)
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO-H	58,000	8.54	495,320.00
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	50,000	6.55	327,500.00
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	748,000	4.08	3,051,840.00
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	102,000	29.75	3,034,500.00
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	38,000	6.24	237,120.00
	PETROCHINA CO LTD-H	638,000	5.61	3,579,180.00
	YANKUANG ENERGY GROUP CO-H	69,000	15.66	1,080,540.00
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	110,000	3.71	408,100.00
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	34,500	15.90	548,550.00
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	82,500	5.61	462,825.00
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	126,000	2.71	341,460.00
	CMOC GROUP LTD-H	105,000	4.30	451,500.00
	GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD-H	11,440	19.62	224,452.80
	JIANGXI COPPER CO LTD-H	39,000	10.60	413,400.00
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	69,000	3.37	232,530.00
	SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	20,500	11.24	230,420.00
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	39,000	7.40	288,600.00
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	166,000	11.40	1,892,400.00
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	83,000	3.07	254,810.00
	BOC AVIATION LTD	6,100	58.90	359,290.00
	CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	68,000	3.21	218,280.00
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	113,000	3.53	398,890.00
	CHINA STATE CONSTRUCTION INT	68,000	8.26	561,680.00
	CITIC LTD	178,000	7.73	1,375,940.00
	CRRG CORP LTD - H	118,000	3.74	441,320.00
	FOSUN INTERNATIONAL LTD	72,500	4.46	323,350.00
	HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	23,000	18.50	425,500.00
	SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	37,000	5.40	199,800.00
	SINOTRUK HONG KONG LTD	22,500	18.14	408,150.00
	WEICHAJ POWER CO LTD-H	55,000	13.94	766,700.00
	ZHUZHOU CRRG TIMES ELECTRI-H	13,800	19.80	273,240.00
	CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL LIMITED	122,000	2.71	330,620.00
	AIR CHINA LTD-H	42,000	4.19	175,980.00
	CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	48,000	9.16	439,680.00
	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	46,000	2.93	134,780.00

COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	83,700	7.94	664,578.00
COSCO SHIPPING PORTS LTD	46,000	4.55	209,300.00
JD LOGISTICS INC	63,100	7.29	459,999.00
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	42,000	7.60	319,200.00
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	3,500	109.50	383,250.00
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	58,000	5.67	328,860.00
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	104,000	4.14	430,560.00
BYD CO LTD-H	31,500	182.90	5,761,350.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	70,000	2.98	208,600.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	18,800	35.80	673,040.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	186,000	8.00	1,488,000.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	64,000	8.41	538,240.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	92,000	3.16	290,720.00
LI AUTO INC-CLASS A	34,788	119.60	4,160,644.80
MINTH GROUP LTD	22,000	10.88	239,360.00
XPENG INC-CLASS A SHARES	33,164	34.80	1,154,107.20
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	38,000	11.82	449,160.00
ZHEJIANG LEAPMOTOR TECHNOLOG	17,100	21.25	363,375.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	38,800	72.40	2,809,120.00
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	110,000	3.65	401,500.00
HAIER SMART HOME CO LTD-H	74,000	23.60	1,746,400.00
LI NING CO LTD	75,500	19.18	1,448,090.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	25,200	66.25	1,669,500.00
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	41,500	3.97	164,755.00
EAST BUY HOLDING LTD	14,500	24.95	361,775.00
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	49,000	13.28	650,720.00
MEITUAN	153,810	71.10	10,935,891.00
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	45,610	69.85	3,185,858.50
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LT	41,200	16.82	692,984.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	34,000	8.00	272,000.00
TRIP.COM GROUP LTD	16,660	317.20	5,284,552.00
BAIDU INC-CLASS A	68,280	102.60	7,005,528.00
BILIBILI INC-CLASS Z	5,877	76.90	451,941.30
CHINA LITERATURE LTD	12,200	22.20	270,840.00
CHINA RUYI HOLDINGS LIMITED	180,000	1.75	315,000.00
KINGSOFT CORP LTD	31,200	20.20	630,240.00
KUAISHOU TECHNOLOGY	70,600	43.60	3,078,160.00
NETEASE INC	58,600	167.10	9,792,060.00
TENCENT HOLDINGS LTD	202,000	290.00	58,580,000.00
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	493,240	70.80	34,921,392.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-H	3,200	78.70	251,840.00
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	57,400	11.54	662,396.00
JD.COM INC - CL A	71,160	89.10	6,340,356.00

MINISO GROUP HOLDING LTD	10,892	32.85	357,802.20
POP MART INTERNATIONAL GROUP	15,000	18.16	272,400.00
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	66,000	5.30	349,800.00
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	29,000	13.44	389,760.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	180,000	3.16	568,800.00
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	31,500	28.25	889,875.00
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	20,400	11.26	229,704.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	3,100	100.04	310,124.00
CHINA FEIHE LTD	115,000	3.58	411,700.00
CHINA MENGNIU DAIRY CO	97,000	18.00	1,746,000.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	50,000	29.10	1,455,000.00
NONGFU SPRING CO LTD-H	61,200	43.45	2,659,140.00
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	60,000	5.09	305,400.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	60,000	7.65	459,000.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	18,000	47.65	857,700.00
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	47,000	4.43	208,210.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	143,000	4.38	626,340.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	21,500	24.20	520,300.00
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	9,000	23.20	208,800.00
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	10,800	26.35	284,580.00
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	24,200	5.89	142,538.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	77,200	4.70	362,840.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	21,500	11.74	252,410.00
SINOPHARM GROUP CO-H	41,600	20.70	861,120.00
3SBIO INC	52,500	5.26	276,150.00
AKESO INC	15,000	41.60	624,000.00
BEIGENE LTD	20,996	86.65	1,819,303.40
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	40,000	11.46	458,400.00
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	43,500	4.87	211,845.00
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	90,000	3.43	308,700.00
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	276,000	5.99	1,653,240.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	36,000	13.16	473,760.00
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	38,000	12.86	488,680.00
INNOVENT BIOLOGICS INC	37,500	36.45	1,366,875.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	14,000	12.76	178,640.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	307,250	2.93	900,242.50
WUXI APPTec CO LTD-H	10,168	38.45	390,959.60
WUXI BIOLOGICS (CAYMAN) INC.	116,500	15.72	1,831,380.00
ZAI LAB LTD	27,130	14.82	402,066.60
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	836,000	3.10	2,591,600.00
BANK OF CHINA LTD-H	2,405,000	2.96	7,118,800.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	264,000	4.74	1,251,360.00
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	269,000	3.96	1,065,240.00

CHINA CONSTRUCTION BANK-H	2,912,000	4.66	13,569,920.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	69,000	2.30	158,700.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	118,000	30.25	3,569,500.00
CHINA MINSHENG BANKING-H	171,600	2.62	449,592.00
IND & COMM BK OF CHINA-H	1,971,000	3.86	7,608,060.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	239,000	3.99	953,610.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	382,000	0.73	278,860.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	101,000	3.81	384,810.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	47,600	8.87	422,212.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	53,000	14.34	760,020.00
FAR EAST HORIZON LTD	64,000	5.96	381,440.00
GF SECURITIES CO LTD-H	26,800	7.65	205,020.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	86,400	3.57	308,448.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	35,800	9.00	322,200.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	225,000	9.33	2,099,250.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	79,800	15.20	1,212,960.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	43,000	6.22	267,460.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	25,800	14.12	364,296.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	264,000	2.47	652,080.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	208,000	9.51	1,978,080.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	203,000	33.45	6,790,350.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	19,800	12.16	240,768.00
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	80,000	4.54	363,200.00
GDS HOLDINGS LTD-CL A	25,524	5.75	146,763.00
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	90,000	7.68	691,200.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	22,500	17.46	392,850.00
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	24,500	29.00	710,500.00
KINGBOARD HOLDINGS LTD	19,000	14.90	283,100.00
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	24,000	4.73	113,520.00
LENOVO GROUP LTD	220,000	8.16	1,795,200.00
SUNNY OPTICAL TECH	20,800	49.25	1,024,400.00
XIAOMI CORP-CLASS B	464,800	12.56	5,837,888.00
ZTE CORP-H	18,800	14.16	266,208.00
CHINA TOWER CORP LTD-H	1,336,000	0.88	1,175,680.00
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	14,500	27.45	398,025.00
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	122,000	1.71	208,620.00
CGN POWER CO LTD-H	324,000	2.21	716,040.00
CHINA GAS HOLDINGS LTD	90,400	6.50	587,600.00
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	88,000	4.60	404,800.00
CHINA POWER INTERNATIONAL	158,000	2.99	472,420.00
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	28,200	21.25	599,250.00
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	60,000	15.26	915,600.00
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	24,500	53.90	1,320,550.00

	GUANGDONG INVESTMENT LTD	92,000	4.28	393,760.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	114,000	4.01	457,140.00	
	KUNLUN ENERGY CO LTD	118,000	6.74	795,320.00	
	FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	11,000	14.34	157,740.00	
	GCL TECHNOLOGY HOLDINGS LTD	658,000	0.96	631,680.00	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	21,000	15.16	318,360.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	150,000	3.82	573,000.00	
	C&D INTERNATIONAL INVESTMENT	26,000	12.10	314,600.00	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	119,000	11.36	1,351,840.00	
	CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	40,000	5.37	214,800.00	
	CHINA RESOURCES LAND LTD	96,000	23.60	2,265,600.00	
	CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	24,400	21.75	530,700.00	
	CHINA VANKE CO LTD-H	76,300	6.04	460,852.00	
	LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	66,000	8.35	551,100.00	
	YUEXIU PROPERTY CO LTD	50,800	5.14	261,112.00	
	香港ドル 小計	24,978,089		303,252,729.90 (5,837,615,050)	
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	95,700	1.79	171,303.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	10,900	22.26	242,634.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	79,900	6.77	540,923.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	102,800	4.60	472,880.00	
	GAMUDA BHD	68,500	5.21	356,885.00	
	SIME DARBY BERHAD	99,700	2.47	246,259.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	28,000	7.99	223,720.00	
	MISC BHD	36,800	7.45	274,160.00	
	GENTING BHD	57,900	4.89	283,131.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	91,400	2.85	260,490.00	
	MR DIY GROUP M BHD	92,550	1.46	135,123.00	
	IOI CORP BHD	69,200	4.02	278,184.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	16,500	22.54	371,910.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	2,600	121.60	316,160.00	
	PPB GROUP BERHAD	23,120	14.98	346,337.60	
	QL RESOURCES BHD	30,350	5.74	174,209.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	63,000	4.48	282,240.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	59,200	6.14	363,488.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	64,100	4.34	278,194.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	198,700	6.37	1,265,719.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	16,200	19.38	313,956.00	
	MALAYAN BANKING BHD	156,700	9.40	1,472,980.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	444,600	4.40	1,956,240.00	
	RHB BANK BHD	39,200	5.64	221,088.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	72,600	2.77	201,102.00	
	CELCOMDIGI BHD	113,500	4.26	483,510.00	

	MAXIS BHD	64,700	3.78	244,566.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	36,600	5.88	215,208.00	
	PETRONAS GAS BHD	22,900	17.84	408,536.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	82,400	11.06	911,344.00	
	INARI AMERTRON BHD	74,800	3.17	237,116.00	
	マレーシアリングット 小計	2,415,120		13,549,595.60 (426,501,975)	
タイパーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	303,700	5.85	1,776,645.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	42,700	153.50	6,554,450.00	
	PTT PCL-NVDR	289,900	34.75	10,074,025.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	31,600	56.50	1,785,400.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	53,800	24.40	1,312,720.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	75,500	37.00	2,793,500.00	
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	32,200	31.00	998,200.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	24,600	265.00	6,519,000.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	131,800	63.25	8,336,350.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	234,600	7.60	1,782,960.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	207,000	6.00	1,242,000.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	190,600	4.08	777,648.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	95,600	30.75	2,939,700.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	64,225	34.75	2,231,818.75	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	204,100	10.90	2,224,690.00	
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	85,300	18.10	1,543,930.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	36,100	24.60	888,060.00	
	CP ALL PCL-NVDR	179,200	53.50	9,587,200.00	
	CP AXTRA PCL-NVDR	59,000	30.00	1,770,000.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	132,600	17.90	2,373,540.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	31,400	20.70	649,980.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	344,000	28.00	9,632,000.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	16,900	244.00	4,123,600.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	19,100	120.50	2,301,550.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	123,600	15.90	1,965,240.00	
	SCB X PCL-NVDR	21,200	102.50	2,173,000.00	
	TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR	685,400	1.81	1,240,574.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	38,400	43.25	1,660,800.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	16,300	43.50	709,050.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	96,000	79.00	7,584,000.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	36,500	213.00	7,774,500.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	28,600	72.25	2,066,350.00	
	TRUE CORP PCL/NEW-NVDR	327,315	6.40	2,094,816.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	48,000	39.00	1,872,000.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	21,300	51.50	1,096,950.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	81,400	43.50	3,540,900.00	

	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	57,400	63.25	3,630,550.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	298,900	7.60	2,271,640.00	
	タイパーツ 小計	4,765,840		123,899,336.75 (515,421,240)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	51,250	46.05	2,360,062.50	
	AYALA CORPORATION	7,910	708.00	5,600,280.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	72,731	39.50	2,872,874.50	
	SM INVESTMENTS CORP	6,870	915.00	6,286,050.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	32,380	270.00	8,742,600.00	
	JOLLIBEE FOODS CORP	15,800	255.00	4,029,000.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	24,530	115.90	2,843,027.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	54,578	114.50	6,249,181.00	
	BDO UNIBANK INC	74,086	152.60	11,305,523.60	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	45,472	59.50	2,705,584.00	
	PLDT INC	2,745	1,296.00	3,557,520.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	7,490	361.80	2,709,882.00	
	AYALA LAND INC	222,200	34.90	7,754,780.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	301,900	34.20	10,324,980.00	
	フィリピンペソ 小計	919,942		77,341,344.60 (207,414,017)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY TBK PT	481,600	2,480.00	1,194,368,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	45,500	23,150.00	1,053,325,000.00	
	AMMAN MINERAL INTERNASIONAL	187,400	7,600.00	1,424,240,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK	175,600	1,545.00	271,302,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	909,184	975.00	886,454,400.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	89,700	7,950.00	713,115,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	292,209	2,410.00	704,223,690.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	101,289	6,150.00	622,927,350.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	564,100	5,200.00	2,933,320,000.00	
	GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT	26,963,000	86.00	2,318,818,000.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	556,700	2,610.00	1,452,987,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	254,200	4,760.00	1,209,992,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	75,400	11,375.00	857,675,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	117,600	6,350.00	746,760,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	202,200	2,800.00	566,160,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	730,700	1,480.00	1,081,436,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	1,682,000	9,725.00	16,357,450,000.00	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	1,133,100	7,025.00	7,960,027,500.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	414,600	5,875.00	2,435,775,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	2,068,445	6,000.00	12,410,670,000.00	
SARANA MENARA NUSANTARA PT	685,000	880.00	602,800,000.00		
TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	1,503,900	3,980.00	5,985,522,000.00		
		39,233,427		63,789,347,940.00	

	インドネシアルピア 小計			(618,756,675)
韓国ウォン	HD HYUNDAI	1,185	69,800.00	82,713,000.00
	S-OIL CORP	1,463	71,400.00	104,458,200.00
	SK INNOVATION CO LTD	1,895	122,100.00	231,379,500.00
	HANWHA SOLUTIONS CORP	3,826	32,000.00	122,432,000.00
	HYUNDAI STEEL CO	3,107	35,800.00	111,230,600.00
	KOREA ZINC CO LTD	231	460,500.00	106,375,500.00
	KUM YANG CO LTD	942	84,000.00	79,128,000.00
	KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	458	136,100.00	62,333,800.00
	LG CHEM LTD	1,534	461,000.00	707,174,000.00
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	197	291,500.00	57,425,500.00
	LOTTE CHEMICAL CORP	705	132,200.00	93,201,000.00
	POSCO HOLDINGS INC	2,193	433,000.00	949,569,000.00
	SK IE TECHNOLOGY CO LTD	775	67,600.00	52,390,000.00
	SKC CO LTD	602	81,600.00	49,123,200.00
	DOOSAN BOBCAT INC	1,487	46,900.00	69,740,300.00
	DOOSAN ENERBILITY	13,577	15,360.00	208,542,720.00
	ECOPRO BM CO LTD	1,505	243,500.00	366,467,500.00
	ECOPRO CO LTD	583	622,000.00	362,626,000.00
	GS HOLDINGS	1,411	49,800.00	70,267,800.00
	HANWHA AEROSPACE CO LTD	1,187	146,300.00	173,658,100.00
	HANWHA OCEAN CO LTD	1,265	23,100.00	29,221,500.00
	HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	607	109,600.00	66,527,200.00
	HD KOREA SHIPBUILDING & OFFS	1,242	114,300.00	141,960,600.00
	HYUNDAI ENGINEERING & CONST	2,829	33,400.00	94,488,600.00
	HYUNDAI MIPO DOCKYARD	938	62,900.00	59,000,200.00
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	2,505	52,300.00	131,011,500.00
	L&F CO LTD	821	144,700.00	118,798,700.00
	LG CORP	2,799	92,000.00	257,508,000.00
	LG ENERGY SOLUTION	1,435	388,000.00	556,780,000.00
	POSCO FUTURE M CO LTD	962	285,500.00	274,651,000.00
	POSCO INTERNATIONAL CORP	1,476	55,200.00	81,475,200.00
	SAMSUNG C&T CORP	2,417	152,400.00	368,350,800.00
	SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	4,565	23,550.00	107,505,750.00
	SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	19,155	7,220.00	138,299,100.00
SK	1,030	188,700.00	194,361,000.00	
SK SQUARE CO LTD	3,018	63,400.00	191,341,200.00	
HMM CO LTD	7,839	17,750.00	139,142,250.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	524	176,600.00	92,538,400.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	6,186	23,300.00	144,133,800.00	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	1,948	54,400.00	105,971,200.00	
HANON SYSTEMS	6,426	6,320.00	40,612,320.00	
HYUNDAI MOBIS CO LTD	1,766	228,500.00	403,531,000.00	

HYUNDAI MOTOR CO	4,192	245,500.00	1,029,136,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	1,138	160,500.00	182,649,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	533	155,600.00	82,934,800.00
KIA CORP	7,972	117,600.00	937,507,200.00
COWAY CO LTD	1,947	57,900.00	112,731,300.00
F&F CO LTD / NEW	518	69,000.00	35,742,000.00
LG ELECTRONICS INC	3,336	99,000.00	330,264,000.00
KANGWON LAND INC	3,072	16,790.00	51,578,880.00
HYBE CO LTD	687	218,500.00	150,109,500.00
JYP ENTERTAINMENT CORP	810	77,100.00	62,451,000.00
KAKAO CORP	9,494	54,900.00	521,220,600.00
KRAFTON INC	872	239,500.00	208,844,000.00
NAVER CORP	3,994	202,500.00	808,785,000.00
NCSOFT CORP	383	207,000.00	79,281,000.00
NETMARBLE CORPORATION	904	62,500.00	56,500,000.00
PEARL ABYSS CORP	960	33,800.00	32,448,000.00
HOTEL SHILLA CO LTD	885	59,100.00	52,303,500.00
CJ CHEILJEDANG CORP	221	297,000.00	65,637,000.00
KT&G CORP	3,047	89,200.00	271,792,400.00
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	591	94,800.00	56,026,800.00
AMOREPACIFIC CORP	788	123,500.00	97,318,000.00
LG H&H	260	308,000.00	80,080,000.00
HLB INC	3,798	70,300.00	266,999,400.00
CELLTRION INC	4,583	184,200.00	844,188,600.00
CELLTRION PHARM INC	718	104,500.00	75,031,000.00
HANMI PHARM CO LTD	218	336,000.00	73,248,000.00
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	514	828,000.00	425,592,000.00
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	1,117	86,200.00	96,285,400.00
SK BIOSCIENCE CO LTD	710	64,700.00	45,937,000.00
YUHAN CORP	1,602	62,000.00	99,324,000.00
HANA FINANCIAL GROUP	9,043	53,400.00	482,896,200.00
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	8,613	13,260.00	114,208,380.00
KAKAOBANK CORP	5,191	29,800.00	154,691,800.00
KB FINANCIAL GROUP INC	11,689	67,300.00	786,669,700.00
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	13,377	43,800.00	585,912,600.00
WOORI FINANCIAL GROUP INC	17,430	14,020.00	244,368,600.00
KAKAOPAY CORP	730	48,200.00	35,186,000.00
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	1,162	67,200.00	78,086,400.00
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	3,040	72,000.00	218,880,000.00
MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	9,715	8,440.00	81,994,600.00
NH INVESTMENT & SECURITIES C	5,547	11,290.00	62,625,630.00
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	1,943	38,550.00	74,902,650.00
DB INSURANCE CO LTD	1,260	95,200.00	119,952,000.00

	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	967	295,500.00	285,748,500.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	2,205	80,800.00	178,164,000.00	
	POSCO DX CO LTD	1,565	58,000.00	90,770,000.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	1,229	150,500.00	184,964,500.00	
	COSMOAM&T CO LTD	779	164,400.00	128,067,600.00	
	LG DISPLAY CO LTD	5,817	11,800.00	68,640,600.00	
	LG INNOTEK CO LTD	384	197,500.00	75,840,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	1,693	137,500.00	232,787,500.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	144,760	74,000.00	10,712,240,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	25,017	63,000.00	1,576,071,000.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	1,680	386,500.00	649,320,000.00	
	KT CORP	1,598	37,850.00	60,484,300.00	
	LG UPLUS CORP	6,485	10,080.00	65,368,800.00	
	SK TELECOM	1,621	51,500.00	83,481,500.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	7,197	21,100.00	151,856,700.00	
	HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD	1,237	79,000.00	97,723,000.00	
	SK HYNIX INC	16,574	148,700.00	2,464,553,800.00	
	韓国ウォン 小計	480,028		35,175,846,780.00 (3,981,905,855)	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	31,000	74.30	2,303,300.00	
	ASIA CEMENT CORP	69,000	39.45	2,722,050.00	
	CHINA STEEL CORP	344,000	24.85	8,548,400.00	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	110,000	57.10	6,281,000.00	
	FORMOSA PLASTICS CORP	110,000	72.40	7,964,000.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	137,000	61.00	8,357,000.00	
	TAIWAN CEMENT	201,917	32.15	6,491,631.55	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	4,200	1,015.00	4,263,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	92,000	30.65	2,819,800.00	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	2,000	1,335.00	2,670,000.00	
	WALSIN LIHWA CORP	95,000	34.80	3,306,000.00	
	CHINA AIRLINES LTD	75,000	20.50	1,537,500.00	
	EVA AIRWAYS CORP	86,000	32.25	2,773,500.00	
	EVERGREEN MARINE CORP LTD	31,420	152.00	4,775,840.00	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	55,000	29.75	1,636,250.00	
	WAN HAI LINES LTD	18,650	47.75	890,537.50	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	57,000	47.30	2,696,100.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	53,000	45.45	2,408,850.00	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	5,420	556.00	3,013,520.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	15,289	164.00	2,507,396.00	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	5,000	338.50	1,692,500.00	
	POU CHEN	61,000	31.15	1,900,150.00	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	9,160	637.00	5,834,920.00	
	MOMO.COM INC	2,200	421.50	927,300.00	

PRESIDENT CHAIN STORE CORP	16,000	267.00	4,272,000.00
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	149,000	73.10	10,891,900.00
PHARMAESSENTIA CORP	7,000	309.50	2,166,500.00
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	155,046	17.45	2,705,552.70
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	536,000	28.15	15,088,400.00
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	433,197	24.50	10,613,326.50
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	315,723	26.80	8,461,376.40
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	259,430	21.75	5,642,602.50
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	349,502	37.60	13,141,275.20
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	332,350	19.10	6,347,885.00
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	333,055	17.10	5,695,240.50
TAIWAN BUSINESS BANK	176,128	13.35	2,351,308.80
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	317,978	25.60	8,140,236.80
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	122,000	44.20	5,392,400.00
CHAILEASE HOLDING CO LTD	48,009	174.00	8,353,566.00
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	316,208	27.00	8,537,616.00
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	290,000	43.90	12,731,000.00
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	479,000	12.10	5,795,900.00
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	237,766	64.70	15,383,460.20
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	366,835	8.41	3,085,082.35
ACCTON TECHNOLOGY CORP	16,000	548.00	8,768,000.00
ACER INC	94,000	46.30	4,352,200.00
ADVANTECH CO LTD	14,427	370.50	5,345,203.50
ASUSTEK COMPUTER INC	22,000	452.00	9,944,000.00
AUO CORP	214,200	18.05	3,866,310.00
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	16,000	193.50	3,096,000.00
COMPAL ELECTRONICS	121,000	35.90	4,343,900.00
DELTA ELECTRONICS INC	59,000	287.50	16,962,500.00
E INK HOLDINGS INC	27,000	217.00	5,859,000.00
GIGABYTE TECHNOLOGY CO LTD	17,000	337.00	5,729,000.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	378,800	101.50	38,448,200.00
INNOLUX CORP	241,751	16.25	3,928,453.75
INVENTEC CORP	87,000	56.50	4,915,500.00
LARGAN PRECISION CO LTD	2,900	2,355.00	6,829,500.00
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	63,000	113.00	7,119,000.00
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	21,000	191.00	4,011,000.00
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	6,000	225.50	1,353,000.00
PEGATRON CORP	64,000	84.50	5,408,000.00
QUANTA COMPUTER INC	82,000	255.00	20,910,000.00
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	34,000	71.50	2,431,000.00
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	41,000	176.50	7,236,500.00
WISTRON CORP	73,000	124.50	9,088,500.00
WIWYNN CORP	3,000	2,265.00	6,795,000.00

	WPG HOLDINGS LTD	47,960	87.60	4,201,296.00
	YAGEO CORPORATION	10,524	550.00	5,788,200.00
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	18,000	98.50	1,773,000.00
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	116,000	121.50	14,094,000.00
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	55,000	79.40	4,367,000.00
	TAIWAN MOBILE CO LTD	54,000	98.50	5,319,000.00
	ALCHIP TECHNOLOGIES LTD	2,300	4,105.00	9,441,500.00
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	93,000	130.00	12,090,000.00
	EEMORY TECHNOLOGY INC	1,800	2,955.00	5,319,000.00
	GLOBAL UNICHIP CORP	2,800	1,435.00	4,018,000.00
	GLOBALWAFERS CO LTD	6,000	579.00	3,474,000.00
	MEDIATEK INC	45,800	937.00	42,914,600.00
	NANYA TECHNOLOGY CORP	39,000	68.20	2,659,800.00
	NOVATEK MICROELECTRONICS COR	18,000	506.00	9,108,000.00
	PARADE TECHNOLOGIES LTD	2,600	1,155.00	3,003,000.00
	POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU	96,000	26.80	2,572,800.00
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	14,000	463.50	6,489,000.00
	SILERGY CORP	10,640	387.00	4,117,680.00
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	746,000	646.00	481,916,000.00
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	342,000	48.10	16,450,200.00
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	29,000	73.50	2,131,500.00
	WINBOND ELECTRONICS CORP	99,000	27.10	2,682,900.00
	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	44,647	35.75	1,596,130.25
	新台湾ドル 小計	10,502,632		1,075,383,547.50 (5,156,571,648)
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	24,027	623.65	14,984,438.55
	COAL INDIA LTD	47,308	466.35	22,062,085.80
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	18,914	543.30	10,275,976.20
	INDIAN OIL CORP LTD	87,227	183.55	16,010,515.85
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	90,913	268.85	24,441,960.05
	PETRONET LNG LTD	18,996	272.15	5,169,761.40
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	92,326	2,962.75	273,538,856.50
	AMBUJA CEMENTS LTD	17,208	570.90	9,824,047.20
	APL APOLLO TUBES LTD	4,859	1,388.55	6,746,964.45
	ASIAN PAINTS LTD	11,749	2,976.40	34,969,723.60
	BERGER PAINTS INDIA LTD	7,891	560.85	4,425,667.35
	GRASIM INDUSTRIES LTD	8,176	2,079.80	17,004,444.80
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	36,283	507.80	18,424,507.40
	JINDAL STEEL & POWER LTD	10,594	758.15	8,031,841.10
	JSW STEEL LTD	17,850	813.25	14,516,512.50
	PI INDUSTRIES LTD	2,601	3,418.15	8,890,608.15
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	4,189	2,663.20	11,156,144.80
	SHREE CEMENT LTD	251	26,898.45	6,751,510.95

SRF LTD	4,133	2,358.15	9,746,233.95
SUPREME INDUSTRIES LTD	1,757	3,796.80	6,670,977.60
TATA STEEL LTD	225,245	141.20	31,804,594.00
ULTRATECH CEMENT LTD	3,540	9,787.80	34,648,812.00
UPL LTD	13,811	481.40	6,648,615.40
VEDANTA LTD	29,237	279.65	8,176,127.05
ABB INDIA LTD	1,585	4,558.40	7,225,064.00
ADANI ENTERPRISES LTD	4,823	3,207.20	15,468,325.60
ASHOK LEYLAND LTD	43,004	173.65	7,467,644.60
ASTRAL LTD	3,580	1,950.35	6,982,253.00
BHARAT ELECTRONICS LTD	113,007	181.60	20,522,071.20
CG POWER AND INDUSTRIAL SOLU	19,948	437.45	8,726,252.60
CUMMINS INDIA LTD	4,109	2,563.10	10,531,777.90
HAVELLS INDIA LTD	7,120	1,380.75	9,830,940.00
HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	5,829	2,957.10	17,236,935.90
LARSEN & TOUBRO LTD	20,521	3,309.00	67,903,989.00
POLYCAB INDIA LTD	1,305	4,355.45	5,683,862.25
SIEMENS LTD	2,800	4,379.40	12,262,320.00
SUZLON ENERGY LTD	270,753	46.05	12,468,175.65
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	6,472	929.20	6,013,782.40
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	16,262	1,267.85	20,617,776.70
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	7,859	939.65	7,384,709.35
INTERGLOBE AVIATION LTD	4,271	3,094.30	13,215,755.30
BAJAJ AUTO LTD	1,903	8,083.30	15,382,519.90
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	2,334	2,351.05	5,487,350.70
BHARAT FORGE LTD	8,017	1,105.10	8,859,586.70
EICHER MOTORS LTD	4,293	3,901.55	16,749,354.15
HERO MOTOCORP LTD	3,456	4,814.05	16,637,356.80
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	28,446	1,657.05	47,136,444.30
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	4,149	11,027.95	45,754,964.55
MRF LTD	54	147,284.50	7,953,363.00
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN	71,452	114.05	8,149,100.60
SONA BLW PRECISION FORGINGS	13,869	606.30	8,408,774.70
TATA MOTORS LTD	50,705	918.30	46,562,401.50
TATA MOTORS LTD-A-DVR	13,696	607.60	8,321,689.60
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LT	3,365	3,497.10	11,767,741.50
TVS MOTOR CO LTD	7,088	2,087.95	14,799,389.60
PAGE INDUSTRIES LTD	196	36,064.85	7,068,710.60
TITAN CO LTD	10,865	3,585.55	38,957,000.75
INDIAN HOTELS CO LTD	27,730	527.70	14,633,121.00
JUBILANT FOODWORKS LTD	13,667	479.35	6,551,276.45
ZOMATO LTD	151,450	152.25	23,058,262.50
INFO EDGE INDIA LTD	2,245	5,112.55	11,477,674.75

TRENT LTD	5,397	3,921.00	21,161,637.00
AVENUE SUPERMARTS LTD	5,012	3,722.40	18,656,668.80
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	3,364	5,010.65	16,855,826.60
ITC LTD	91,548	411.55	37,676,579.40
MARICO LTD	15,967	527.00	8,414,609.00
NESTLE INDIA LTD	10,383	2,487.00	25,822,521.00
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	17,891	1,135.60	20,317,019.60
UNITED SPIRITS LTD	9,408	1,129.10	10,622,572.80
VARUN BEVERAGES LTD	14,101	1,430.70	20,174,300.70
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	4,259	2,594.80	11,051,253.20
DABUR INDIA LTD	17,113	544.30	9,314,605.90
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	12,732	1,200.60	15,286,039.20
HINDUSTAN UNILEVER LTD	25,059	2,387.95	59,839,639.05
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	3,128	6,754.10	21,126,824.80
MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	23,433	879.70	20,614,010.10
AUROBINDO PHARMA LTD	7,383	996.10	7,354,206.30
CIPLA LTD	15,439	1,425.35	22,005,978.65
DIVI'S LABORATORIES LTD	3,794	3,719.65	14,112,352.10
DR. REDDY'S LABORATORIES	3,399	6,258.35	21,272,131.65
LUPIN LTD	6,138	1,611.75	9,892,921.50
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	29,388	1,520.40	44,681,515.20
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	3,339	2,604.25	8,695,590.75
AU SMALL FINANCE BANK LTD	5,313	590.75	3,138,654.75
AXIS BANK LTD	69,317	1,096.85	76,030,351.45
BANDHAN BANK LTD	19,777	198.25	3,920,790.25
BANK OF BARODA	27,026	267.80	7,237,562.80
HDFC BANK LIMITED	85,145	1,384.05	117,844,937.25
ICICI BANK LTD	157,276	1,022.70	160,846,165.20
IDFC FIRST BANK LTD	94,716	80.85	7,657,788.60
INDUSIND BANK LTD	8,222	1,481.50	12,180,893.00
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	33,252	1,748.95	58,156,085.40
STATE BANK OF INDIA	54,459	743.40	40,484,820.60
YES BANK LTD	387,272	28.70	11,114,706.40
BAJAJ FINANCE LTD	8,323	6,646.50	55,318,819.50
BAJAJ FINSERV LTD	11,093	1,579.70	17,523,612.10
BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMEN	806	8,764.40	7,064,106.40
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	13,260	1,125.20	14,920,152.00
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	2,370	3,778.25	8,954,452.50
JIO FINANCIAL SERVICES LTD	91,822	273.00	25,067,406.00
MUTHOOT FINANCE LTD	3,756	1,379.25	5,180,463.00
ONE 97 COMMUNICATIONS LTD	6,527	342.15	2,233,213.05
POWER FINANCE CORPORATION	44,201	434.60	19,209,754.60
REC LTD	41,530	481.60	20,000,848.00

	SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	7,713	719.15	5,546,803.95	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	8,326	2,393.30	19,926,615.80	
	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	29,778	585.35	17,430,552.30	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	6,992	1,639.60	11,464,083.20	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	8,896	508.80	4,526,284.80	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	13,078	1,453.70	19,011,488.60	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	28,927	1,671.50	48,351,480.50	
	INFOSYS LTD	100,802	1,666.20	167,956,292.40	
	LTIMINDTREE LTD	2,579	5,505.15	14,197,781.85	
	MPHASIS LTD	2,620	2,559.85	6,706,807.00	
	PERSISTENT SYSTEMS LTD	1,445	8,617.05	12,451,637.25	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	27,802	4,100.10	113,990,980.20	
	TATA ELXSI LTD	1,069	7,429.55	7,942,188.95	
	TECH MAHINDRA LTD	16,514	1,292.90	21,350,950.60	
	WIPRO LTD	37,402	514.50	19,243,329.00	
	BHARTI AIRTEL LTD	68,294	1,115.85	76,205,859.90	
	TATA COMMUNICATIONS LTD	3,349	1,752.70	5,869,792.30	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	8,848	1,852.25	16,388,708.00	
	ADANI POWER LTD	24,069	563.90	13,572,509.10	
	GAIL INDIA LTD	73,428	176.25	12,941,685.00	
	INDRAPRASTHA GAS LTD	11,620	436.90	5,076,778.00	
	NTPC LTD	133,376	328.00	43,747,328.00	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	142,410	273.65	38,970,496.50	
	TATA POWER CO LTD	45,307	373.70	16,931,225.90	
	DLF LTD	19,595	843.80	16,534,261.00	
	GODREJ PROPERTIES LTD	3,754	2,314.15	8,687,319.10	
	MACROTECH DEVELOPERS LTD	7,189	1,095.50	7,875,549.50	
	インドルピー 小計	4,059,633		3,090,111,820.60 (5,624,003,513)	
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	16,008	15.98	255,807.84	
	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	68,061	3.92	267,139.42	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	157,972	1.73	274,397.36	
	INDUSTRIES QATAR	47,498	12.18	578,525.64	
	COMMERCIAL BANK PQSC	104,492	4.88	510,025.45	
	DUKHAN BANK	47,311	3.93	186,216.09	
	MASRAF AL RAYAN	156,266	2.42	378,945.05	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	33,084	10.78	356,645.52	
	QATAR ISLAMIC BANK	51,255	20.71	1,061,491.05	
	QATAR NATIONAL BANK	140,685	14.65	2,061,035.25	
	OOREDOO QPSC	24,164	10.78	260,487.92	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	15,660	17.23	269,821.80	
	BARWA REAL ESTATE CO	60,279	2.93	176,617.47	
		922,735		6,637,155.86	

カタールリアル 小計				(274,380,023)
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	7,793	179.05	1,395,336.65
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	1,807	703.18	1,270,646.26
	ANGLOGOLD ASHANTI PLC	12,308	317.00	3,901,636.00
	GOLD FIELDS LTD	27,631	247.43	6,836,738.33
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	15,256	105.56	1,610,423.36
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	28,030	64.44	1,806,253.20
	KUMBA IRON ORE LTD	1,694	551.77	934,698.38
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	9,656	108.78	1,050,379.68
	SASOL LTD	18,654	151.42	2,824,588.68
	SIBANYE STILLWATER LTD	95,224	20.48	1,950,187.52
	BIDVEST GROUP LTD	8,221	232.15	1,908,505.15
	NASPERS LTD-N SHS	5,667	3,300.08	18,701,553.36
	PEPKOR HOLDINGS LTD	52,043	19.66	1,023,165.38
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	27,276	67.14	1,831,310.64
	BID CORP LTD	10,565	443.50	4,685,577.50
	CLICKS GROUP LTD	6,931	293.56	2,034,664.36
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	14,682	260.44	3,823,780.08
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	11,723	195.46	2,291,377.58
	ABSA GROUP LTD	26,797	162.84	4,363,623.48
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	2,686	2,004.99	5,385,403.14
	NEDBANK GROUP LTD	12,732	219.88	2,799,512.16
	STANDARD BANK GROUP LTD	40,822	202.79	8,278,293.38
	FIRSTRAND LTD	154,303	64.55	9,960,258.65
	REINET INVESTMENTS SCA	4,626	479.00	2,215,854.00
REMGRO LTD	14,915	152.73	2,277,967.95	
DISCOVERY LTD	16,635	134.96	2,245,059.60	
OLD MUTUAL LTD	159,908	11.96	1,912,499.68	
OUTSURANCE GROUP LTD	22,382	40.67	910,275.94	
SANLAM LTD	54,894	72.52	3,980,912.88	
MTN GROUP LTD	49,438	92.90	4,592,790.20	
VODACOM GROUP LTD	19,783	93.39	1,847,534.37	
NEPI ROCKCASTLE N.V.	14,368	127.14	1,826,747.52	
南アフリカランド 小計		949,450		112,477,555.06 (887,447,909)
アラブディールハム	MULTIPLY GROUP	109,599	2.50	273,997.50
	AMERICANA RESTAURANTS INTERN	70,134	2.96	207,596.64
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	88,102	3.71	326,858.42
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	90,397	8.66	782,838.02
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	44,112	11.14	491,407.68
	DUBAI ISLAMIC BANK	80,564	6.48	522,054.72
	EMIRATES NBD PJSC	58,262	17.90	1,042,889.80
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	134,879	14.40	1,942,257.60

	EMIRATES TELECOM GROUP CO	106,140	19.08	2,025,151.20	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	125,204	5.06	633,532.24	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	205,154	8.00	1,641,232.00	
	アラブディールハム 小計	1,112,547		9,889,815.82 (405,976,939)	
クウェートディ ナール	AGILITY	45,725	0.60	27,709.35	
	BOUBYAN BANK K.S.C	38,661	0.62	23,969.82	
	GULF BANK	55,027	0.29	15,957.83	
	KUWAIT FINANCE HOUSE	261,588	0.78	206,392.93	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	229,239	0.97	223,737.26	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	64,626	0.51	33,153.13	
	MABANEE CO KPSC	20,333	0.82	16,754.39	
	クウェートディナール 小計	715,199		547,674.71 (267,073,572)	
オフショア人民 元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	18,900	6.70	126,630.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	66,700	5.99	399,533.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	11,500	38.07	437,805.00	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-A	8,100	13.04	105,624.00	
	GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	9,700	6.75	65,475.00	
	INNER MONGOLIA DIAN TOU EN-A	2,700	15.61	42,147.00	
	JIZHONG ENERGY RESOURCES-A	4,900	7.54	36,946.00	
	OFFSHORE OIL ENGINEERING-A	10,500	6.02	63,210.00	
	PETROCHINA CO LTD-A	46,600	8.28	385,848.00	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	19,600	24.19	474,124.00	
	SHAN XI HUA YANG GROUP NEW-A	5,100	9.91	50,541.00	
	SHANXI COKING COAL ENERGY-A	12,420	10.93	135,750.60	
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	6,500	23.61	153,465.00	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO-A	6,736	22.84	153,850.24	
	YANTAI JEREH OILFIELD-A	900	28.35	25,515.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	23,100	5.70	131,670.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	9,900	24.23	239,877.00	
	ANHUI HONGLU STEEL CONSTRU-A	650	16.92	10,998.00	
	ASIA-POTASH INTERNATIONAL-A	1,500	24.00	36,000.00	
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	50,000	6.31	315,500.00	
	CANMAX TECHNOLOGIES CO LTD-A	1,040	21.11	21,954.40	
	CHENGXIN LITHIUM GROUP CO-A	1,400	20.22	28,308.00	
	CHINA JUSHI CO LTD -A	7,414	9.74	72,212.36	
	CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	5,700	18.70	106,590.00	
	CHINA RARE EARTH RESOURCES-A	1,900	27.56	52,364.00	
	CMOC GROUP LTD-A	28,400	5.68	161,312.00	
CNGR ADVANCED MATERIAL CO -A	600	46.14	27,684.00		
DO-FLUORIDE NEW MATERIALS -A	2,100	13.13	27,573.00		
GANFENG LITHIUM GROUP CO L-A	2,740	34.87	95,543.80		

GEM CO LTD-A	10,800	5.15	55,620.00
GUANGDONG HEC TECHNOLOGY H-A	6,300	7.88	49,644.00
GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	4,180	18.43	77,037.40
HANGZHOU OXYGEN PLANT GROU-A	2,000	27.70	55,400.00
HENAN SHENHUO COAL & POWER-A	3,500	17.98	62,930.00
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	14,520	12.38	179,757.60
HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	1,950	7.49	14,605.50
HESTEEL CO LTD-A	1,500	2.19	3,285.00
HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A	1,400	47.06	65,884.00
HUAFON CHEMICAL CO LTD -A	15,600	6.96	108,576.00
HUAIBEI MINING HOLDINGS CO-A	3,700	18.30	67,710.00
HUBEI FEILIHUA QUARTZ GLAS-A	1,000	28.49	28,490.00
HUBEI XINGFA CHEMICALS GRP-A	1,900	17.51	33,269.00
HUNAN VALIN STEEL CO LTD -A	14,600	5.72	83,512.00
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	73,300	1.52	111,416.00
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	15,700	3.92	61,544.00
INNER MONGOLIA YUAN XING-A	5,900	6.00	35,400.00
JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	13,900	10.46	145,394.00
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	390	54.39	21,212.10
JIANGSU YOKE TECHNOLOGY-A	500	43.45	21,725.00
JIANGXI COPPER CO LTD-A	6,500	18.26	118,690.00
JINDUICHENG MOLYBDENUM CO -A	6,700	9.77	65,459.00
LB GROUP CO LTD-A	4,500	17.76	79,920.00
LUXI CHEMICAL GROUP CO LT-A	1,900	10.32	19,608.00
NINGBO SHANSHAN CO LTD-A	2,300	11.85	27,255.00
NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	11,900	14.11	167,909.00
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	18,100	3.05	55,205.00
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY-A	15,300	15.00	229,500.00
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	24,750	10.11	250,222.50
SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A	8,090	14.95	120,945.50
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	6,368	21.80	138,822.40
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	3,520	26.45	93,104.00
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	36,900	2.93	108,117.00
SHANDONG SUN PAPER INDUSTR-A	8,800	13.34	117,392.00
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	4,408	16.72	73,701.76
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	3,700	6.03	22,311.00
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	4,800	3.87	18,576.00
SHENGHE RESOURCES HOLDINGS-A	1,700	9.43	16,031.00
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	1,080	43.57	47,055.60
SHENZHEN DYNANONIC CO LTD-A	320	37.30	11,936.00
SHENZHEN SENIOR TECHNOLOGY-A	1,798	12.46	22,403.08
SHENZHEN YUTO PACKAGING TE-A	1,700	27.22	46,274.00
SICHUAN HEBANG BIOTECHNOL- A	14,200	2.51	35,642.00

SINOMA SCIENCE&TECHNOLOGY -A	2,200	14.99	32,978.00
SINOMINE RESOURCE GROUP CO-A	980	31.58	30,948.40
SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A	600	2.80	1,680.00
SKSHU PAINT CO LTD-A	784	36.93	28,953.12
SUNRESIN NEW MATERIALS CO -A	1,200	50.00	60,000.00
TANGSHAN JIDONG CEMENT INV-A	3,700	6.22	23,014.00
TIANQI LITHIUM CORP-A	4,100	45.86	188,026.00
TIANSHAN ALUMINUM GROUP CO-A	7,500	5.83	43,725.00
TONGKUN GROUP CO LTD-A	7,600	13.11	99,636.00
TONGLING NONFERROUS METALS-A	39,900	3.24	129,276.00
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	5,500	74.54	409,970.00
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	640	26.78	17,139.20
WESTERN MINING CO -A	3,300	15.14	49,962.00
WESTERN SUPERCONDUCTING TE-A	560	41.88	23,452.80
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD-A	1,200	16.47	19,764.00
YINTAI GOLD CO LTD-A	8,780	14.89	130,734.20
YONGXING SPECIAL MATERIALS-A	910	47.50	43,225.00
YUNNAN ALUMINIUM CO LTD-A	7,300	11.06	80,738.00
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	1,400	42.65	59,710.00
YUNNAN TIN CO LTD-A	3,500	12.81	44,835.00
YUNNAN YUNTIANHUA CO-A	1,500	16.95	25,425.00
ZANGGE MINING CO LTD-A	3,300	26.10	86,130.00
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	2,708	25.67	69,514.36
ZHEJIANG JUHUA CO-A	5,700	17.85	101,745.00
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	6,700	8.73	58,491.00
ZHONGJIN GOLD CORP-A	10,000	9.77	97,700.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	36,000	12.50	450,000.00
AECC AERO-ENGINE CONTROL-A	1,000	16.45	16,450.00
AECC AVIATION POWER CO-A	4,600	33.18	152,628.00
AVICOPTER PLC-A	500	35.85	17,925.00
BEIJING EASPRING MATERIAL-A	700	34.23	23,961.00
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	3,700	28.89	106,893.00
BEIJING UNITED INFORMATION-A	841	16.97	14,271.77
CHINA BAOAN GROUP-A	4,500	12.02	54,090.00
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	10,300	31.40	323,420.00
CHINA ENERGY ENGINEERING COR	52,300	2.15	112,445.00
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	9,700	6.40	62,080.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	47,100	6.33	298,143.00
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	73,200	5.12	374,784.00
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	7,860	162.84	1,279,922.40
COSCO SHIPPING DEVELOPMENT CO	18,400	2.46	45,264.00
CRRC CORP LTD-A	54,700	5.89	322,183.00
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	4,400	14.67	64,548.00

EVE ENERGY CO LTD-A	5,820	35.20	204,864.00
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	417	4.95	2,064.15
FAW JIEFANG GROUP CO LTD-A	3,200	8.16	26,112.00
GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A	600	60.11	36,066.00
GOLDWIND SCIENCE &TECHNOL-A	3,400	7.34	24,956.00
GONEO GROUP CO LTD	800	98.75	79,000.00
GOODWE TECHNOLOGIES CO LTD-A	280	111.50	31,220.00
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	3,900	18.62	72,618.00
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	1,680	26.08	43,814.40
HOYMILES POWER ELECTRONICS-A	298	222.70	66,364.60
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	2,436	54.50	132,762.00
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	5,300	12.04	63,812.00
JIANGXI SPECIAL ELECTRIC -A	2,500	9.21	23,025.00
KEDA INDUSTRIAL GROUP CO LTD	2,800	11.80	33,040.00
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A	2,200	13.86	30,492.00
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	39,700	3.21	127,437.00
MING YANG SMART ENERGY GRO-A	4,300	9.07	39,001.00
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	14,782	22.47	332,151.54
NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO -A	540	73.67	39,781.80
NINGBO ORIENT WIRES & CABL-A	1,000	39.88	39,880.00
NINGBO RONBAY NEW ENERGY T-A	450	31.71	14,269.50
NORTH INDUSTRIES GROUP RED-A	2,400	12.40	29,760.00
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	49,100	4.96	243,536.00
PYLON TECHNOLOGIES CO LTD-A	200	82.00	16,400.00
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	19,400	14.17	274,898.00
SHANGHAI CONSTRUCTION GROU-A	5,600	2.47	13,832.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	24,000	4.04	96,960.00
SHANXI COAL INTERNATIONAL -A	4,500	17.83	80,235.00
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	2,400	62.05	148,920.00
SICHUAN ROAD&BRIDGE GROUP-A	13,860	7.95	110,187.00
SIEYUAN ELECTRIC CO LTD-A	1,500	57.32	85,980.00
SINOMA INTERNATIONAL ENGIN-A	5,500	11.25	61,875.00
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	3,300	85.53	282,249.00
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	1,300	13.56	17,628.00
TBEA CO LTD-A	10,920	14.63	159,759.60
TITAN WIND ENERGY SUZHOU-A	2,800	9.88	27,664.00
WEICHAI POWER CO LTD-A	16,100	15.72	253,092.00
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	20,700	6.08	125,856.00
XIAMEN C & D INC-A	4,400	10.13	44,572.00
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	4,100	19.57	80,237.00
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	420	59.24	24,880.80
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	3,800	23.40	88,920.00
ZHEJIANG WEIXING NEW BUILD-A	1,300	15.01	19,513.00

ZHUZHOU CRRG TIMES ELECTRI-A	800	35.50	28,400.00
ZHUZHOU KIBING GROUP CO LT-A	4,000	6.45	25,800.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	15,500	7.74	119,970.00
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	1,800	33.75	60,750.00
ZHEFU HOLDING GROUP CO LTD-A	5,300	3.50	18,550.00
ZHEJIANG WEIMING ENVIRONME-A	2,340	17.71	41,441.40
AIR CHINA LTD-A	23,900	7.37	176,143.00
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	98,800	5.03	496,964.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	46,700	3.78	176,526.00
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	17,600	5.78	101,728.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	28,670	10.06	288,420.20
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	34,900	7.43	259,307.00
HAINAN AIRLINES HOLDING CO-A	81,700	1.41	115,197.00
JUNEYAO AIRLINES CO LTD-A	3,500	13.55	47,425.00
LIAONING PORT CO LTD-A	21,900	1.49	32,631.00
S F HOLDING CO LTD-A	8,600	37.55	322,930.00
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	2,100	35.30	74,130.00
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	8,900	5.30	47,170.00
SPRING AIRLINES CO LTD-A	1,900	55.18	104,842.00
YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	7,400	12.21	90,354.00
YUNDA HOLDING CO LTD-A	4,870	6.88	33,505.60
BETHEL AUTOMOTIVE SAFETY S-A	900	59.29	53,361.00
BYD CO LTD -A	3,600	181.17	652,212.00
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	700	137.94	96,558.00
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	17,126	13.58	232,571.08
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	3,400	41.17	139,978.00
GREAT WALL MOTOR CO LTD-A	6,400	22.18	141,952.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A	6,900	8.63	59,547.00
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	7,100	16.76	118,996.00
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	1,000	90.64	90,640.00
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	1,200	15.85	19,020.00
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	1,900	52.31	99,389.00
SAIC MOTOR CORP LTD-A	18,010	14.58	262,585.80
SAILUN GROUP CO LTD-A	9,500	13.45	127,775.00
SERES GROUP CO L-A	3,100	71.70	222,270.00
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	1,300	21.34	27,742.00
SHENZHEN KEDALI INDUSTRY C-A	400	69.93	27,972.00
BEIJING ROBOROCK TECHNOLOG-A	280	324.91	90,974.80
ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A	600	33.00	19,800.00
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	4,600	36.14	166,244.00
HAIER SMART HOME CO LTD-A	14,000	23.95	335,300.00
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	1,000	23.29	23,290.00
JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	1,040	37.81	39,322.40

OPPEIN HOME GROUP INC-A	1,040	65.24	67,849.60
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	1,700	58.32	99,144.00
BTG HOTELS GROUP CO LTD-A	1,600	15.45	24,720.00
OFFCN EDUCATION TECHNOLOGY-A	10,200	3.13	31,926.00
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	1,700	26.28	44,676.00
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	5,080	10.30	52,324.00
37 INTERACTIVE ENTERTAINME-A	3,900	17.70	69,030.00
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	1,300	7.60	9,880.00
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	23,800	6.01	143,038.00
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY XI	100	195.14	19,514.00
GIANT NETWORK GROUP CO LTD-A	4,100	9.65	39,565.00
KUNLUN TECH CO LTD-A	2,500	32.88	82,200.00
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	3,110	23.52	73,147.20
PEOPLE.CN CO LTD-A	2,000	21.73	43,460.00
PERFECT WORLD CO LTD-A	4,450	10.53	46,858.50
WANDA FILM HOLDING CO LTD-A	4,500	11.98	53,910.00
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	17,100	4.29	73,359.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	3,400	84.45	287,130.00
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	5,000	6.83	34,150.00
WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A	6,000	4.61	27,660.00
ZHEJIANG CHINA COMMODITIES-A	13,000	8.02	104,260.00
DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	1,036	25.33	26,241.88
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	2,164	42.63	92,251.32
YONGHUI SUPERSTORES COMPANY LIMITED	20,400	2.66	54,264.00
ANGEL YEAST CO LTD-A	700	33.92	23,744.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	800	220.00	176,000.00
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	500	42.84	21,420.00
ANHUI YINGJIA DISTILLERY C-A	1,600	55.69	89,104.00
ANJOY FOODS GROUP CO LTD	400	76.56	30,624.00
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	6,600	5.25	34,650.00
BEIJING YANJING BREWERY CO-A	3,900	8.87	34,593.00
CHONGQING BREWERY CO-A	800	57.84	46,272.00
EASTROC BEVERAGE GROUP CO -A	500	173.99	86,995.00
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	8,170	37.36	305,231.20
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	900	16.55	14,895.00
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	2,800	41.42	115,976.00
HEBEI YANGYUAN ZHIHUI BEVERA	2,600	25.43	66,118.00
HEILONGJIANG AGRICULTURE-A	2,500	12.30	30,750.00
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	7,400	28.57	211,418.00
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	11,500	28.18	324,070.00
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	2,000	51.35	102,700.00
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	2,700	98.50	265,950.00
JIUGUI LIQUOR CO LTD-A	400	56.68	22,672.00

JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	300	24.69	7,407.00
JUEWEI FOOD CO LTD-A	300	21.41	6,423.00
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	2,300	1,706.00	3,923,800.00
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	3,100	153.66	476,346.00
MEIHUA HOLDINGS GROUP CO -A	5,400	10.69	57,726.00
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	9,416	37.81	356,018.96
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	7,600	8.56	65,056.00
SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT-A	1,372	22.20	30,458.40
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	2,120	225.20	477,424.00
SHEDE SPIRITS CO LTD-A	700	75.71	52,997.00
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	400	46.82	18,728.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-A	1,500	78.12	117,180.00
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	15,260	19.69	300,469.40
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	7,100	133.59	948,489.00
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	2,200	31.98	70,356.00
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	1,100	13.83	15,213.00
BY-HEALTH CO LTD-A	1,300	16.91	21,983.00
YUNNAN BOTANEE BIO-TECHNOL-A	400	61.45	24,580.00
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	17,368	14.12	245,236.16
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD-A	1,000	54.40	54,400.00
CHINA MEHECO CO LTD -A	2,240	11.26	25,222.40
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	3,300	29.08	95,964.00
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	700	61.08	42,756.00
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	2,940	31.68	93,139.20
IRAY TECHNOLOGY CO LTD-A	280	265.98	74,474.40
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A	3,000	36.22	108,660.00
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	8,344	8.16	68,087.04
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	1,900	14.99	28,481.00
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	8,380	5.41	45,335.80
OVCTEK CHINA INC-A	920	20.06	18,455.20
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	4,400	17.60	77,440.00
SHANGHAI UNITED IMAGING HE-A	1,800	144.78	260,604.00
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	2,300	297.38	683,974.00
SHENZHEN NEW INDUSTRIES BI-A	2,400	73.34	176,016.00
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	300	61.22	18,366.00
APELOA PHARMACEUTICAL CO-A	900	13.50	12,150.00
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	680	91.60	62,288.00
BEIJING TIAN TAN BIOLOGICAL-A	3,300	29.50	97,350.00
BEIJING TONGRENTANG CO-A	2,300	43.77	100,671.00
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	2,415	62.76	151,565.40
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	300	42.62	12,786.00
BGI GENOMICS CO LTD-A	300	44.98	13,494.00
BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY COR-A	800	62.18	49,744.00

CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	700	120.13	84,091.00
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	1,500	56.11	84,165.00
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	4,050	51.40	208,170.00
CSPC INNOVATION PHARMACEUT-A	2,900	28.31	82,099.00
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	1,200	57.80	69,360.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	300	42.80	12,840.00
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	4,680	18.98	88,826.40
HUBEI JUMPCAN PHARMACEUT-A	1,300	34.27	44,551.00
HUMANWELL HEALTHCARE GROUP-A	3,800	21.89	83,182.00
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	600	318.35	191,010.00
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	13,116	41.87	549,166.92
JOINCARE PHARMACEUTICAL GR-A	1,600	12.03	19,248.00
LIVZON PHARMACEUTICAL GROU-A	500	36.98	18,490.00
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	1,098	13.91	15,273.18
PHARMARON BEIJING CO LTD-A	3,675	21.07	77,432.25
SHANDONG BUCHANG PHARMACEU-A	260	16.85	4,381.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	3,600	23.95	86,220.00
SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCE-A	835	32.69	27,296.15
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	10,500	6.89	72,345.00
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	960	23.59	22,646.40
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	1,700	30.94	52,598.00
SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A	2,600	20.75	53,950.00
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	2,400	26.17	62,808.00
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	3,000	17.61	52,830.00
WUXI APPTec CO LTD-A	4,728	53.12	251,151.36
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	2,960	49.42	146,283.20
ZHANGZHOU PIENZEHUANG PHA-A	1,100	215.98	237,578.00
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	1,210	13.45	16,274.50
ZHEJIANG JIUZHOU PHARMACEU-A	1,300	20.07	26,091.00
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	5,463	16.90	92,324.70
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	149,700	3.96	592,812.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	52,200	4.99	260,478.00
BANK OF CHANGSHA CO LTD-A	7,500	7.75	58,125.00
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	5,400	12.35	66,690.00
BANK OF CHINA LTD-A	75,900	4.31	327,129.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	77,900	6.01	468,179.00
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	13,000	10.70	139,100.00
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	40,100	7.28	291,928.00
BANK OF NANJING CO LTD -A	27,300	8.17	223,041.00
BANK OF NINGBO CO LTD -A	13,900	20.79	288,981.00
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	24,610	6.33	155,781.30
BANK OF SUZHOU CO LTD-A	5,100	7.25	36,975.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	20,400	6.80	138,720.00

CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	78,400	3.15	246,960.00
CHINA MERCHANTS BANK-A	37,400	31.40	1,174,360.00
CHINA MINSHENG BANKING-A	67,800	3.95	267,810.00
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	60,270	2.69	162,126.30
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-A	26,300	4.37	114,931.00
CNPC CAPITAL CO LTD-A	10,900	5.80	63,220.00
HUAXIA BANK CO LTD-A	24,300	5.97	145,071.00
IND & COMM BK OF CHINA-A	110,700	5.16	571,212.00
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	40,800	16.05	654,840.00
PING AN BANK CO LTD-A	34,400	9.67	332,648.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	63,800	4.69	299,222.00
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	59,300	6.96	412,728.00
SHANGHAI RURAL COMMERCIAL -A	28,600	6.10	174,460.00
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A	13,900	3.06	42,534.00
BOC INTERNATIONAL CHINA CO-A	3,000	10.34	31,020.00
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	8,800	7.89	69,432.00
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	6,800	5.34	36,312.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-A	8,000	11.56	92,480.00
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	12,900	7.62	98,298.00
CHINA INTERNATIONAL CAPTAL-A	6,000	34.54	207,240.00
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	11,900	13.94	165,886.00
CITIC SECURITIES CO-A	21,500	21.25	456,875.00
CSC FINANCIAL CO LTD-A	7,500	22.91	171,825.00
DONGXING SECURITIES CO LT-A	6,200	8.14	50,468.00
EAST MONEY INFORMATION CO-A	27,812	13.27	369,065.24
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	6,600	16.00	105,600.00
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	500	5.58	2,790.00
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	17,000	6.88	116,960.00
GF SECURITIES CO LTD-A	9,500	13.96	132,620.00
GUANGZHOU YUEXIU CAPITAL H-A	4,374	6.08	26,593.92
GUOLIAN SECURITIES CO LTD-A	2,200	10.31	22,682.00
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	11,300	8.20	92,660.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	18,000	14.86	267,480.00
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	9,500	6.71	63,745.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	18,700	9.06	169,422.00
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	1,000	125.29	125,290.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	13,100	14.21	186,151.00
HUAXI SECURITIES CO LTD-A	300	7.64	2,292.00
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	16,300	5.64	91,932.00
NANJING SECURITIES CO LTD	7,600	7.94	60,344.00
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	21,600	8.61	185,976.00
SDIC CAPITAL CO LTD-A	11,000	6.70	73,700.00
SHANXI SECURITIES CO LTD-A	400	5.22	2,088.00

SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	45,600	4.48	204,288.00
SINOLINK SECURITIES CO LTD-A	7,700	8.93	68,761.00
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	9,700	7.10	68,870.00
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	3,800	3.96	15,048.00
WESTERN SECURITIES CO LTD-A	10,000	6.43	64,300.00
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	6,000	9.82	58,920.00
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD-A	10,500	6.72	70,560.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	4,500	30.79	138,555.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	14,700	26.02	382,494.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	3,800	30.59	116,242.00
PICC HOLDING CO-A	15,500	5.11	79,205.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	20,900	42.78	894,102.00
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	11,700	7.17	83,889.00
BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	800	235.38	188,304.00
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	4,674	7.27	33,979.98
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	1,170	27.80	32,526.00
DHC SOFTWARE CO LTD -A	400	5.39	2,156.00
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	3,073	21.75	66,837.75
IFLYTEK CO LTD - A	6,100	43.55	265,655.00
NAVINFO CO LTD-A	4,800	6.82	32,736.00
QI AN XIN TECHNOLOGY GROUP-A	1,252	31.71	39,700.92
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	900	58.23	52,407.00
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	2,995	42.62	127,646.90
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	900	52.79	47,511.00
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	5,908	11.39	67,292.12
AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A	2,300	19.05	43,815.00
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	83,900	3.88	325,532.00
CETC CYBERSPACE SECURITY T-A	1,300	18.73	24,349.00
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	4,500	24.22	108,990.00
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	6,700	9.18	61,506.00
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-A	11,000	4.61	50,710.00
CHINA ZHENHUA GROUP SCIENC-A	1,200	47.10	56,520.00
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	27,800	15.70	436,460.00
GOERTEK INC -A	6,100	16.20	98,820.00
GRG BANKING EQUIPMENT CO -A	2,200	10.65	23,430.00
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	22,300	5.26	117,298.00
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICAT-A	7,600	10.78	81,928.00
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	1,500	36.10	54,150.00
HENGDIAN GROUP DMEGC -A	2,700	13.43	36,261.00
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO-A	3,700	11.72	43,364.00
HUAGONG TECH CO LTD-A	2,700	27.82	75,114.00
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	2,400	30.38	72,912.00
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	9,600	11.44	109,824.00

LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	12,833	28.94	371,387.02
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	1,576	98.03	154,495.28
NINESTAR CORP-A	1,800	19.70	35,460.00
RAYTRON TECHNOLOGY CO LTD-A	700	38.94	27,258.00
SHANGHAI BOCHU ELECTRONIC-A	280	274.88	76,966.40
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	7,200	15.00	108,000.00
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	780	55.68	43,430.40
SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY-A	3,500	12.51	43,785.00
SHENZHEN SUNLORD ELECTRONI-A	800	26.04	20,832.00
SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	1,794	148.00	265,512.00
SUPCON TECHNOLOGY CO LTD-A	870	40.14	34,921.80
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	3,300	13.77	45,441.00
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	31,790	4.16	132,246.40
TIANJIN712 COMMUNICATION &-A	700	28.00	19,600.00
TIANMA MICROELECTRONICS-A	2,400	9.18	22,032.00
UNISPLENDOR CORP LTD-A	4,876	16.73	81,575.48
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	2,700	34.61	93,447.00
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	3,464	6.15	21,303.60
WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHA-A	5,860	24.99	146,441.40
XIAMEN FARATRONIC CO LTD-A	400	104.85	41,940.00
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	2,240	27.01	60,502.40
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	6,300	17.50	110,250.00
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	1,700	127.00	215,900.00
ZTE CORP-A	6,400	24.00	153,600.00
CHINA UNITED NETWORK-A	59,700	4.56	272,232.00
CECEP SOLAR ENERGY CO LT-A	6,500	5.49	35,685.00
CECEP WIND POWER CORP-A	7,900	3.06	24,174.00
CGN POWER CO LTD-A	40,600	3.75	152,250.00
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	32,500	8.22	267,150.00
CHINA THREE GORGES RENEWAB-A	64,100	4.58	293,578.00
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	44,900	24.64	1,106,336.00
DATANG INTL POWER GEN CO-A	20,000	2.51	50,200.00
ENN NATURAL GAS CO LTD-A	4,800	17.55	84,240.00
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	31,000	4.42	137,020.00
HUADIAN POWER INTL CORP-A	12,500	5.99	74,875.00
HUANENG POWER INTL INC-A	18,200	8.74	159,068.00
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	13,800	14.06	194,028.00
SHANGHAI ELECTRIC POWER CO-A	7,100	8.31	59,001.00
SHENERGY COMPANY LIMITED	9,900	7.42	73,458.00
SHENZHEN ENERGY GROUP CO L-A	11,600	6.57	76,212.00
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A	12,900	15.40	198,660.00
ZHEJIANG ZHENENG ELECTRIC-A	21,300	5.40	115,020.00
3PEAK INC-A	200	111.37	22,274.00

ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	1,543	122.77	189,434.11
AMLOGIC SHANGHAI INC-A	600	53.32	31,992.00
CAMBRICON TECHNOLOGIES-A	800	115.40	92,320.00
CHINA RESOURCES MICROELECT-A	2,200	40.78	89,716.00
FLAT GLASS GROUP CO LTD-A	2,300	19.48	44,804.00
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR I-A	1,356	68.53	92,926.68
HANGZHOU CHANG CHUAN TECHN-A	1,300	25.90	33,670.00
HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	5,652	23.60	133,387.20
HANGZHOU LION ELECTRONICS -A	1,000	22.27	22,270.00
HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	2,000	18.66	37,320.00
HOYUAN GREEN ENERGY CO LTD	978	26.50	25,917.00
HYGON INFORMATION TECHNOLO-A	4,200	76.72	322,224.00
INGENIC SEMICONDUCTOR CO -A	1,200	50.00	60,000.00
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	9,612	17.61	169,267.32
JCET GROUP CO LTD-A	3,800	23.98	91,124.00
JIANGSU PACIFIC QUARTZ CO -A	700	74.58	52,206.00
JINKO SOLAR CO LTD-A	13,400	8.27	110,818.00
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	12,936	20.21	261,436.56
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A	3,314	49.90	165,368.60
NATIONAL SILICON INDUSTRY -A	5,600	14.88	83,328.00
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	900	250.30	225,270.00
PIOTECH INC-A	296	190.24	56,311.04
RISEN ENERGY CO LTD-A	2,400	15.15	36,360.00
SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	9,900	11.86	117,414.00
SG MICRO CORP-A	1,007	70.77	71,265.39
SHANGHAI AIKO SOLAR ENERGY-A	3,220	14.02	45,144.40
SHANGHAI FUDAN MICROELE-DO-A	800	29.77	23,816.00
SHENZHEN SC NEW ENERGY TEC-A	300	61.50	18,450.00
STARPOWER SEMICONDUCTOR LT-A	200	138.85	27,770.00
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	409	116.17	47,513.53
TCL ZHONGHUAN RENEWABLE EN-A	8,075	12.07	97,465.25
TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	1,900	7.79	14,801.00
TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	3,200	21.56	68,992.00
TONGWEI CO LTD-A	10,500	25.98	272,790.00
TRINA SOLAR CO LTD-A	3,200	24.05	76,960.00
UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	1,819	54.99	100,026.81
VERISILICON MICROELECTRONI-A	1,000	37.01	37,010.00
WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	2,185	87.19	190,510.15
WUXI AUTOWELL TECHNOLOGY C-A	580	82.10	47,618.00
XINJIANG DAQO NEW ENERGY C-A	3,600	28.14	101,304.00
YANGZHOU YANGJIE ELECTRONI-A	700	39.46	27,622.00
ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	3,900	34.29	133,731.00
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	19,800	9.12	180,576.00

	CHINA VANKE CO LTD -A	16,400	10.06	164,984.00	
	HAINAN AIRPORT INFRASTRUCT-A	21,800	3.79	82,622.00	
	HANGZHOU BINJIANG REAL EST-A	5,600	7.55	42,280.00	
	POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	26,600	9.97	265,202.00	
	SHANGHAI LINGANG HOLDINGS-A	7,280	11.26	81,972.80	
	SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	24,900	3.04	75,696.00	
	YOUNGOR FASHION CO LTD	14,000	7.50	105,000.00	
	オフショア人民元 小計	5,094,759		65,189,482.33 (1,357,864,322)	
サウジアラビア リアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	14,462	8.84	127,844.08	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	81,049	31.95	2,589,515.55	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	3,568	38.50	137,368.00	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	8,294	12.40	102,845.60	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	6,803	126.20	858,538.60	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	10,211	31.30	319,604.30	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	39,602	51.00	2,019,702.00	
	SAUDI ARAMCO BASE OIL CO	1,374	160.40	220,389.60	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	27,526	78.60	2,163,543.60	
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	13,346	21.08	281,333.68	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	26,793	9.14	244,888.02	
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	7,669	37.85	290,271.65	
	SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	1,076	234.40	252,214.40	
	JARIR MARKETING CO	19,801	15.30	302,955.30	
	NAHDI MEDICAL CO	1,469	138.80	203,897.20	
	ALMARAI CO	6,924	58.70	406,438.80	
	SAVOLA	8,665	53.00	459,245.00	
	DALLAH HEALTHCARE CO	835	183.00	152,805.00	
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	2,693	315.00	848,295.00	
	MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	2,644	124.20	328,384.80	
	AL RAJHI BANK	59,527	90.10	5,363,382.70	
	ALINMA BANK	29,985	43.55	1,305,846.75	
	ARAB NATIONAL BANK	19,226	25.30	486,417.80	
	BANK AL-JAZIRA	11,133	19.70	219,320.10	
	BANK ALBILAD	15,360	47.35	727,296.00	
	BANQUE SAUDI FRANSI	18,465	38.10	703,516.50	
	RIYAD BANK	44,963	30.40	1,366,875.20	
	SAUDI AWWAL BANK	29,111	37.80	1,100,395.80	
	SAUDI INVESTMENT BANK/THE	13,432	16.26	218,404.32	
	THE SAUDI NATIONAL BANK	89,368	41.80	3,735,582.40	
SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING	1,363	225.60	307,492.80		
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	2,528	229.00	578,912.00		
CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	2,529	146.00	369,234.00		
ARABIAN INTERNET & COMMUNICA	788	383.00	301,804.00		

ELM CO	746	1,029.80	768,230.80
ETIHAD ETISALAT CO	10,475	55.20	578,220.00
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	13,459	13.66	183,849.94
SAUDI TELECOM CO	60,898	41.35	2,518,132.30
ACWA POWER CO	2,657	250.40	665,312.80
POWER & WATER UTILITY CO FOR	2,042	73.70	150,495.40
SAUDI ELECTRICITY CO	26,234	20.00	524,680.00
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	14,772	12.80	189,081.60
サウジアラビアリアル 小計	753,865		34,672,563.39 (1,393,490,322)
合計	180,890,196		31,429,406,130 (31,429,406,130)

(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	2,698,490.00	
		OPERADORA DE SITES MEX- A-1	33,000	657,030.00	
		PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA	21,206	1,526,407.88	
		メキシコペソ 小計	144,006	4,881,927.88 (42,988,304)	
	合計		42,988,304 (42,988,304)		

(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%		2.8%
メキシコペソ	株式 21銘柄	95.1%		2.6%
	投資証券 3銘柄		4.9%	0.1%
ブラジルリアル	株式 48銘柄	100.0%		5.5%
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%		0.1%
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%		18.6%
マレーシアリングgit	株式 31銘柄	100.0%		1.4%
タイバーツ	株式 38銘柄	100.0%		1.6%
フィリピンペソ	株式 14銘柄	100.0%		0.7%

インドネシアルピア	株式	22銘柄	100.0%		2.0%
韓国ウォン	株式	102銘柄	100.0%		12.7%
新台幣ドル	株式	90銘柄	100.0%		16.4%
インドルピー	株式	131銘柄	100.0%		17.9%
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%		2.8%
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%		4.3%
サウジアラビアリアル	株式	42銘柄	100.0%		4.4%

(注) 時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2024年 2月29日現在です。

【Smart - i Select 全世界株式インデックス】

【純資産額計算書】

資産総額	2,555,044,041円
負債総額	5,457,057円
純資産総額（ - ）	2,549,586,984円
発行済口数	1,804,943,217口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4126円

（参考）

R M M S C I ジャパン・インデックスマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	1,220,106,698円
負債総額	43,108,449円
純資産総額（ - ）	1,176,998,249円
発行済口数	801,863,250口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4678円

R M先進国株式マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	265,143,816,303円
負債総額	354,916,264円
純資産総額（ - ）	264,788,900,039円
発行済口数	89,427,887,103口
1口当たり純資産額（ / ）	2.9609円

R M新興国株式マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	34,221,431,565円
負債総額	92,453,156円
純資産総額（ - ）	34,128,978,409円
発行済口数	18,183,238,235口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8769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、

(2) 受益者に対する特典

- 該当事項はありません。
- (3) 譲渡制限の内容
譲渡制限はありません。
受益権の譲渡
- ・受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。
 - ・前述の申請のある場合には、振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社債、株式等の振替に関する法律の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。
 - ・前述の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合などにおいて、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。
- 受益権の譲渡の対抗要件
受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。
- (4) 受益証券の再発行
受益者は、委託会社がやむを得ない事情などにより受益証券を発行する場合を除き、受益証券の再発行の請求を行なわないものとします。
- (5) 受益権の再分割
委託会社は、受託会社と協議のうえ、社債、株式等の振替に関する法律に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。
- (6) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて
振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、解約請求の受付、解約金および償還金の支払いなどについては、約款の規定によるほか、民法その他の法令などにしたがって取り扱われます。

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

2024年2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（2024年2月末現在）

会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は取締役会の決議をもって決定します。

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

取締役会は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役社長がこれを招集し、議長となります。

取締役社長に事故または欠員があるときは、取締役会においてあらかじめ定めた順序に従い、他の取締役が取締役会を招集し、議長となります。

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

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

監査等委員である取締役の任期は、選任後2年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までです。

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

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

投資運用の意思決定機構

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

PLAN：計画

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

DO：実行

・運用部門のファンドマネージャーは、決定された運用基本方針等に基づいて運用計画を策定し、ファンドマネージャーが所属する部の部長が承認します。

・ファンドマネージャーは、決定された運用計画に沿って運用指図を行いポートフォリオを構築し、ファンドの運用状況を管理します。

・運用部門の各部長は、ファンドの運用が運用計画に沿って行われていることを確認します。

・売買発注の執行は、運用計画の策定等から組織的に分離されたトレーディング部が、発注先証券会社等の選定ルール等に基づく最良執行を行うよう努めます。

CHECK：検証 ACTION：改善

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

・運用実績等については運用評価委員会が統括し、運用部門に対する管理・指導を行います。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2024年2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	164	1,760,291
単位型株式投資信託	6	28,208
単位型公社債投資信託	12	18,365
合計	182	1,806,866

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

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本					株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他 利益剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	1,000,000	490,000	490,000	4,548,350	4,548,350	6,038,350
当期変動額						
当期純利益	-	-	-	3,655,460	3,655,460	3,655,460
株主資本以外の項目 の当期変動額(純額)	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	3,655,460	3,655,460	3,655,460
当期末残高	1,000,000	490,000	490,000	8,203,810	8,203,810	9,693,810

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

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：千円）

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

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

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

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

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

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

2016年4月1日以降に取得した建物附属設備につきましては、定額法を採用しております。

その他の有形固定資産につきましては、定率法を採用しております。

なお、主な耐用年数は次のとおりであります。

建物	5～15年
器具備品	3～20年

(2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

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

3. 引当金の計上基準

賞与引当金

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

4. 収益および費用の計上基準

当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行義務の内容及び当該履行義務を充足する通常の時点(収益を認識する通常の時点)は以下のとおりであります。

投資運用業(投資信託委託業)

投資信託約款に基づき、信託財産の運用指図等を行っております。

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

投資運用業(投資一任業)

投資一任契約に基づき、顧客資産を一任して運用指図等を行っております。

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

投資助言・代理業

投資助言契約に基づき、運用に関する投資判断の助言等を行っております。

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

5. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い

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

(会計方針の変更)

(時価の算定に関する会計基準等の適用)

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日。以下

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

注記事項

（貸借対照表関係）

1 有形固定資産の減価償却累計額

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

2 関係会社に対する資産及び負債

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

(注) 当該金額は、連結納税親会社と受払いする金額であります。

（損益計算書関係）

1 関係会社に対する主な取引

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

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 配当に関する事項

該当事項はありません。

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 配当に関する事項

該当事項はありません。

（金融商品関係）

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

資金運用については、短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

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

2 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：千円）

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

(注) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

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

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

(単位:千円)

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

(注) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

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

3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

前事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

(単位:千円)

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

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

(単位:千円)

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

(有価証券関係)

1. その他有価証券

前事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

(単位:千円)

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

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

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

(単位:千円)

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

2. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

(単位:千円)

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

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

(単位:千円)

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

前事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

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

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

法定実効税率	30.61%
(調整)	

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

(収益認識関係)

1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

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

2. 収益を理解するための基礎となる情報

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

3. 当事業年度及び翌事業年度以降の収益の金額を理解するための情報

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(セグメント情報等)

前事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1. セグメント情報

当社は、「資産運用業」の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

(単位：千円)

顧客の名称又は氏名	営業収益額
株式会社りそな銀行	5,964,710

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

1. セグメント情報

当社は、「資産運用業」の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

(単位：千円)

顧客の名称又は氏名	営業収益額
株式会社りそな銀行	5,545,681

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報
該当事項はありません。
4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報
該当事項はありません。
5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報
該当事項はありません。

（関連当事者情報）

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

1. 関連当事者との取引

（1）親会社及び主要株主（会社等に限る）等

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 連結納税制度に基づく連結法人税の支払予定額であります。

（2）兄弟会社等

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 投資一任の収益については、一般取引条件を勘案した個別契約に基づき決定しております。

(注2) 投資助言の収益については、一般取引条件を勘案した個別契約に基づき決定しております。

(注3) 投資信託の販売委託については、一般取引条件を基に、協議のうえ決定しております。

(注4) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には消費税等が含まれております。

2. 親会社に関する注記

親会社情報

株式会社りそなホールディングス（東京証券取引所に上場）

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

1. 関連当事者との取引

（1）兄弟会社等

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 投資一任の収益については、一般取引条件を勘案した個別契約に基づき決定しております。

(注2) 投資助言の収益については、一般取引条件を勘案した個別契約に基づき決定しております。

(注3) 投資信託の販売委託については、一般取引条件を基に、協議のうえ決定しております。

(注4) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には消費税等が含まれております。

2. 親会社に関する注記

親会社情報

株式会社りそなホールディングス（東京証券取引所に上場）

（1株当たり情報）

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

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

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

(注) 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は以下のとおりであります。

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

(重要な後発事象)

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

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

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

		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。

投資運用業(投資信託委託業)

投資信託約款に基づき、信託財産の運用指図等を行っております。

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

投資運用業(投資一任業)

投資一任契約に基づき、顧客資産を一任して運用指図等を行っております。

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

投資助言・代理業

投資助言契約に基づき、運用に関する投資判断の助言等を行っております。

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

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			合計
	レベル1	レベル2	レベル3	
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

営業収益

本邦の外部顧客への営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。なお、営業収益の地域区分は、契約相手方の所在地（ファンドの場合は組成地）を基礎として分類しております。

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

(単位：千円)

顧客の名称又は氏名	営業収益額
株式会社りそな銀行	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
岩井コスモ証券株式会社	13,500百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
auカブコム証券株式会社	7,196百万円	
株式会社SBI証券	48,323百万円	
松井証券株式会社	11,945百万円	
マネックス証券株式会社	12,200百万円	
株式会社関西みらい銀行	38,971百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社埼玉りそな銀行	70,000百万円	
株式会社十六銀行	36,839百万円	
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 5月15日	有価証券届出書
2023年 5月15日	有価証券報告書
2023年11月15日	有価証券届出書
2023年11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。

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

独立監査人の監査報告書

2024年4月30日

りそなアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 松崎 雅則
業務執行社員

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Smart-i Select 全世界株式インデックスの2023年2月16日から2024年2月15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、Smart-i Select 全世界株式インデックスの2024年2月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうかを検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうかを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。
- 経営者が継続企業の前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の中間監査報告書

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. X B R L データは中間監査の対象には含まれておりません。