

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2024年5月21日提出
【発行者名】	りそなアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役 西山 明宏
【本店の所在の場所】	東京都江東区木場一丁目5番6号
【事務連絡者氏名】	塚田 光子
【電話番号】	03-6704-3821
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG（以下「ファンド」といいます。）

・愛称として「SaitamaDGs」、「SaitamaDGs（サイタマディーゼズ）」という名称を用いることがあります。

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

・追加型証券投資信託受益権です。（以下「受益権」といいます。）

・信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付、または信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

・基準価額につきましては、販売会社または「（８）申込取扱場所」の照会先にお問い合わせください。

（５）【申込手数料】

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

・販売会社における申込手数料率は2.2%（税抜2.0%）が上限となっております。

（６）【申込単位】

販売会社にお問い合わせください。

（７）【申込期間】

2024年5月22日から2024年11月20日までとします。

・上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

（８）【申込取扱場所】

販売会社につきましては、委託会社の照会先にお問い合わせください。

委託会社の照会先

りそなアセットマネジメント株式会社

電話番号：0120-223351

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時）

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

（９）【払込期日】

・取得申込者は、申込金額を販売会社が指定する期日までに販売会社に支払うものとします。

・申込期間における各取得申込受付日の発行価額の総額（設定総額）は、販売会社によって、追加設定が行なわれる日に委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

（１０）【払込取扱場所】

申込金額は、販売会社にお支払いいただきます。

(1 1) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、株式会社証券保管振替機構とします。

(1 2) 【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的
安定した収益の確保と信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
ファンドの基本的性格

1) 商品分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

2) 属性区分

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (含む日本)		
	年2回	日本		
	年4回	北米	ファミリーファンド	あり (部分ヘッジ)
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		
	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(資産複合(債券、株式、不動産投信)資産配分変更型))		アフリカ		
		中近東 (中東)		
		エマージング		
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

< 商品分類の定義 >

1. 単位型投信・追加型投信の区分
 - (1) 単位型投信：当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われずファンドをいう。
 - (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 の「発行体」による区分のほか、特にクレジットに対して明確な記載があるものについては、上記 から に掲げる区分に加え「高格付債」「低格付債」等を併記することも可とする。
 - (3) 不動産投信

これ以上の詳細な分類は行わないものとする。
 - (4) その他資産

組入れている資産を記載するものとする。
 - (5) 資産複合

以下の小分類に該当する場合には当該小分類を併記することができる。
 資産配分固定型：目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。
 資産配分変更型：目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。
2. 決算頻度による属性区分

年1回：目論見書又は投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。
 年2回：目論見書又は投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいう。
 年4回：目論見書又は投資信託約款において、年4回決算する旨の記載があるものをいう。
 年6回(隔月)：目論見書又は投資信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいう。
 年12回(毎月)：目論見書又は投資信託約款において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるものをいう。
 日々：目論見書又は投資信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいう。
 その他：上記属性にあてはまらない全てのものをいう。
3. 投資対象地域による属性区分(重複使用可能)

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

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

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

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

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

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

4. 投資形態による属性区分

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

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

5. 為替ヘッジによる属性区分

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

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

6. インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分

日経225

TOPIX

その他の指数：前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

7. 特殊型

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

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

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

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

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

ファンドの特色

1

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

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

※ 2024年2月29日現在、上記の組入比率は、以下の通りです。

	組入比率
①特にESG/SDGsを重視した運用を行うマザーファンド	69.1%
②埼玉に関連した運用を行うマザーファンド	15.6%
①と②の合計	84.7%

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

- 先進国債券、国内株式および先進国株式に投資を行う4つのマザーファンドにおいて、特にESG/SDGsを重視した運用*1を行います。
 - ◆ RM米ドル建SDGs債券マザーファンド(為替ヘッジあり)およびRMユーロ建SDGs債券マザーファンド(為替ヘッジあり)は、残存期間が10年程度までのSDGs債*2および先進国(日本を除く)の国債を、各残存期間の投資金額がほぼ同程度となるように組み入れることにより、金利変動に対するリスク分散効果や、利息収入の平準化を図り、安定した収益の確保を目指します。
 - ◆ RM国内株式ESGマザーファンドおよびRM先進国株式ESGマザーファンドは、ESG関連インデックス*3に連動する投資成果を目指します。
- 国内債券に投資を行うマザーファンドにおいて、埼玉に関連した運用を行い、埼玉県が発行する公募地方債も主要投資対象とします*4。
 - ◆ RM国内債券マザーファンド(埼玉重視型)は、投資するわが国の国債および埼玉県が発行する公募地方債の残存年限を幅広く分散させることにより、金利変動に対するリスク分散効果や、利息収入の平準化を図り、安定した収益の確保を目指します。

*1 ESG/SDGsを重視した運用の詳細は、「ESG/SDGsを重視した運用について」をご参照ください。

*2 マザーファンドにおける投資対象としてのSDGs債の詳細は、「ESG/SDGsを重視した運用について」をご参照ください。SDGs債の発行状況や市況状況および純資産総額の水準等により、SDGs債への投資比率が低位となる場合があります。

*3 ESG関連インデックスとは、MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数(配当込み)およびMSCI-KOKUSAI ESG リーダーズ指数(配当込み、円換算ベース)をいいます。詳細は、「ESG/SDGsを重視した運用について」をご参照ください。

*4 埼玉県が発行する公募地方債の発行状況や市況状況および純資産総額の水準等により、当該地方債に投資を行わない、もしくは投資比率が低位となる場合があります。

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

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

■ 特にESG/SDGsを重視した運用を行うマザーファンド ■ 埼玉に関連した運用を行うマザーファンド

* 発行国が先進国以外の場合があります。

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

ESGとは

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

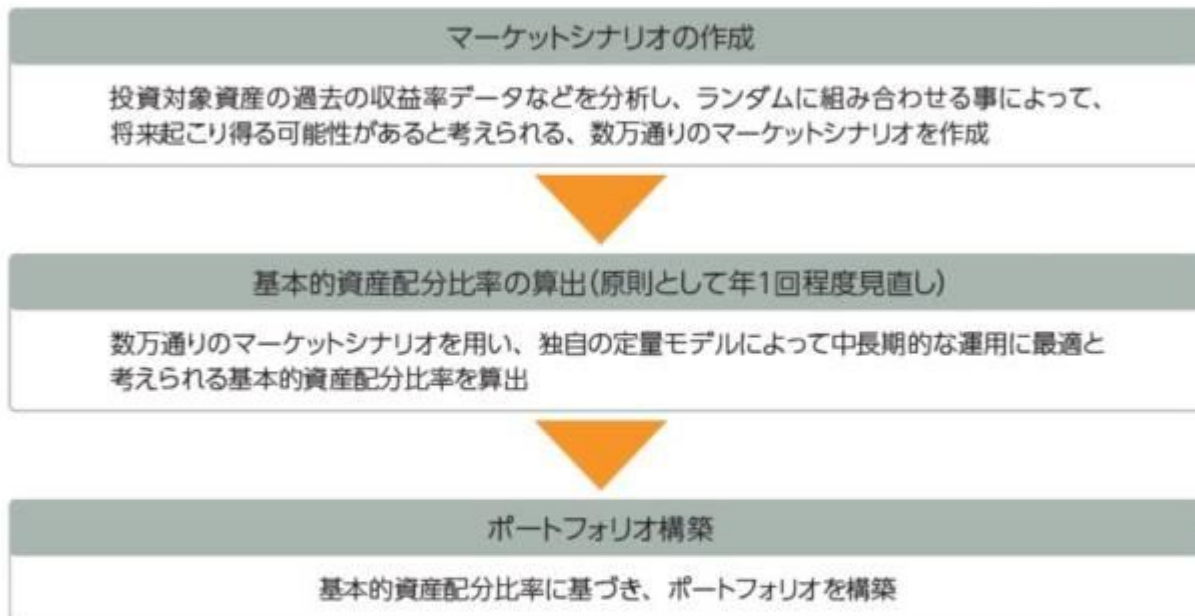
SDGsとは

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

2 中長期的な運用に理想的なポートフォリオ構築を目指します。

- 独自の定量モデルを用いて算出した基本的資産配分比率に基づき、ポートフォリオを構築します。基本的資産配分比率は、原則として年1回程度見直します。
当ファンドでは、過去に起きていなかった事象も今後起こり得ると考え、過去のデータをランダムに組み合わせ、将来起こり得る可能性のある数万通りのシナリオを作成します。このように作成されたマーケット・シナリオを用いてシミュレーションを行い、中長期的な運用に最適と考えられるポートフォリオを構築します。

運用プロセスのイメージ



※ 上記の運用プロセスおよびイメージ図は、今後変更になる場合があります。

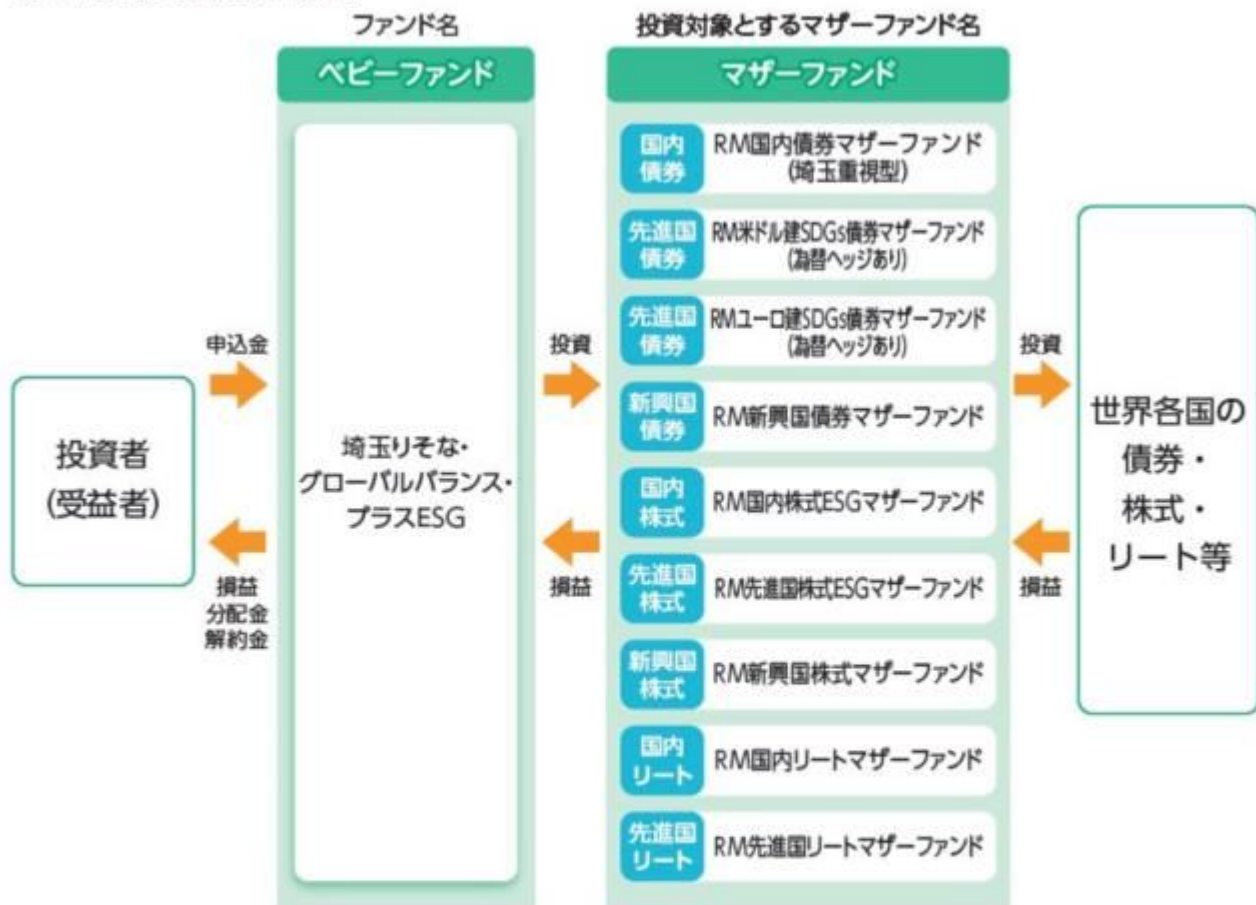
3 実質組入外貨建資産の一部について、対円での為替ヘッジを行います。

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

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

■ ファンドの仕組み

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



■ 主な投資制限

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

分配方針

原則、毎年8月20日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、以下の収益分配方針に基づいて分配を行います。

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

★将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

各マザーファンドが対象とする指数の著作権等について

●RM新興国債券マザーファンド

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

●RM国内株式ESGマザーファンド

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

●RM先進国株式ESGマザーファンド

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

●RM新興国株式マザーファンド

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

●RM国内リートマザーファンド

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

●RM先進国リートマザーファンド

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

ESG/SDGsを重視した運用について

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

ー先進国債券の投資についてー

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

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

※SDGs債券マザーファンドそれぞれにおけるSDGs債の組入比率は合計90%以上とすることを目標としています。

※SDGs債の発行状況や市況状況および純資産総額の水準等により、SDGs債への投資比率が低位となる場合があります。

〈 代表的なSDGs債の種類と特徴 〉

代表的なSDGs債の種類	概要	特徴
グリーン・ボンド	温暖化問題、再生可能エネルギー等、環境プロジェクトに充当するために発行する債券です。	<ul style="list-style-type: none"> ● 以下の4要素の観点から、それぞれの債券の要件が設定されています。 <ul style="list-style-type: none"> ・資金調達の使途 ・プロジェクトの評価と選定のプロセス ・調達資金の管理 ・レポーティング ● 要件のほか、発行体に対する推奨項目も設定されています。 <ul style="list-style-type: none"> ・フレームワーク等によって、原則やガイドラインへの適合性等を説明すること ・外部評価機関を用いて、原則やガイドラインへの適合性を評価したり、資金管理の検証等を行うこと <p style="text-align: right;">など</p>
ソーシャル・ボンド	貧困問題、女性活躍の機会増進など、社会的課題解決のためのプロジェクトに充当するために発行する債券です。	
サステナブル・ボンド	グリーンとソーシャル両方のプロジェクト、両方の性格を持つプロジェクトに充当するために発行する債券です。	

※上記の記載内容については、今後変更される可能性があります。

ー国内株式および先進国株式の投資についてー

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

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

- ・ MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数（配当込み）は、MSCI Inc.が開発し、国内株式を対象とした株価指数であるMSCI ジャパン IMI指数*1の構成銘柄から、相対的にESG評価の高い銘柄を選定することで構築される指数で、配当を考慮したものです。
- ・ MSCI-KOKUSAI ESG リーダーズ指数（配当込み、円換算ベース）は、MSCI Inc.が開発したMSCI-KOKUSAI ESG リーダーズ指数（米ドルベース）をもとに委託会社が円換算して計算したものです。MSCI-KOKUSAI ESG リーダーズ指数（米ドルベース）は、日本を除く世界の先進国の株式から、相対的にESG評価の高い銘柄を選定することで構築される指数で、配当を考慮したものです。

〈両指数の特徴〉

- ① MSCI Inc.独自のESG評価モデルを用います。当該モデルは、評価対象企業に対し、当該企業が属する業種が直面するESG上のリスクや機会が何か、当該企業にとってそれらがどの程度大きく、どの程度マネジメントを行っているかを測定・分析し、同業種他社と比較することを目的としています。
- ② 企業に対するESG評価は最終的にAAA～CCCの7段階のESG格付で表され、格付がBB以上（7段階のうち上位5段階目まで）の企業が選別されます。
- ③ E/S/Gそれぞれの要素に負の影響を与える可能性がある不祥事について分析し、11段階のうち上位8段階目までの企業が選別されます。
- ④ MSCI ジャパン IMI指数*1を構成する銘柄、またはMSCI-KOKUSAI指数*2を構成する日本を除く先進国の銘柄の中から、業種分類（GICS:Global Industry Classification Standard）ごとに時価総額50%を目標として、指数を構成する企業が選別されます。
- ⑤ MSCI-KOKUSAI ESG リーダーズ指数においては、非人道的兵器や核兵器製造などに関与する企業、アルコールやギャンブルなどから一定以上の収益を得ている企業は指数の構成銘柄から除外されます。

*1 MSCI ジャパン IMI指数は、MSCI Inc.が開発した、日本の上場株式を対象として算出した指数です。

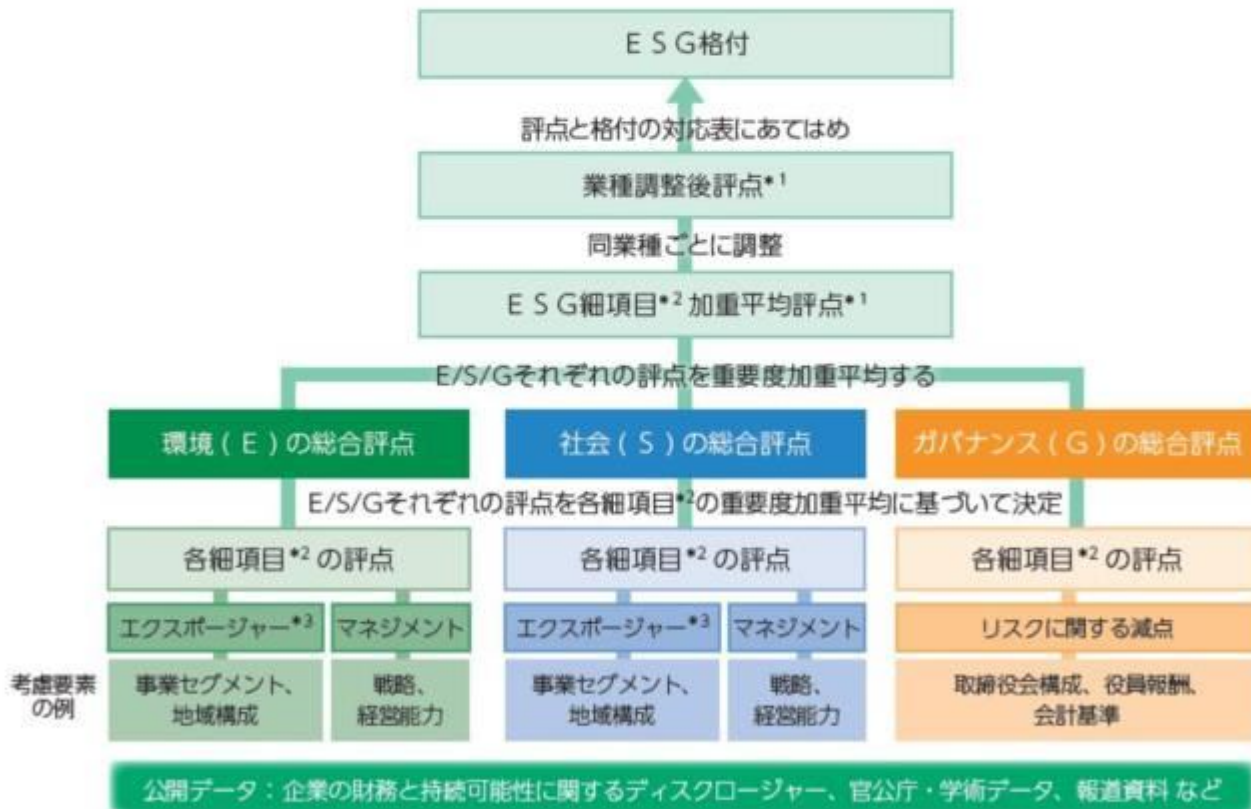
*2 MSCI-KOKUSAI指数は、MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数です。

※ MSCI Inc.の資料に基づき、りそなアセットマネジメントが作成。

※ 上記の記載内容については、今後変更される可能性があります。

〈ESG格付決定プロセス〉

1. 業種別に、MSCI Inc.が独自にE/S/Gそれぞれに設定している細項目(Key Issue)のうち関連が深いものを選定し、それがリスクまたは機会として顕在化するまでの時間の長短および環境・社会に与える影響の大小の2軸をもとにウエイト配分を決定する。
2. E/S/Gそれぞれに選定された細項目をもとに、E/Sに対しては、エクスポージャー（経済的なリスクの程度）の大きさとそれに対するマネジメントがどの程度なされているかを、Gに対しては、企業統治上のリスクに関する評価を減点方式で勘案し、E/S/Gそれぞれに0～10の点数を付与する。
3. 上記1.で決定したウエイト配分をもとに、上記2.でE/S/Gそれぞれに付与した点数を、加重平均したうえで同業種他社との比較を踏まえ調整を行い、0～10の点数を算出する。
4. 算出された点数を格付表にあてはめ、格付を決定する。



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

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

〈MSCI Inc.のESG細項目(Key Issue)の例〉(ご参考)

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

※ MSCI Inc.の資料に基づき、りそなアセットマネジメントが作成。

※ 上記の記載内容については、今後変更される可能性があります。

信託金限度額

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

(2) 【ファンドの沿革】

2020年9月25日

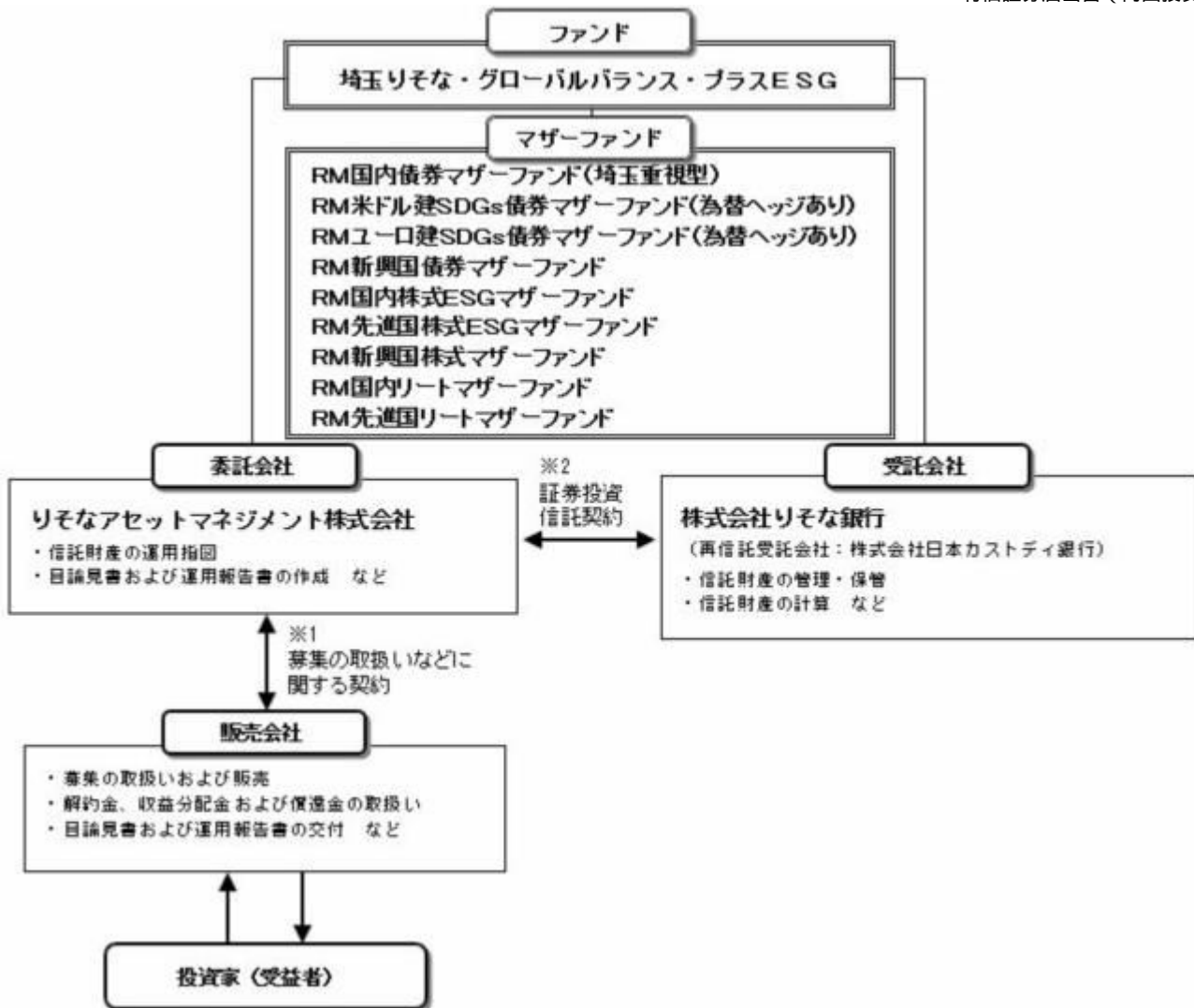
- ・ファンドの信託契約締結、運用開始

2023年3月23日

- ・投資対象に「RM米ドル建SDGs債券マザーファンド（為替ヘッジあり）」および「RMユーロ建SDGs債券マザーファンド（為替ヘッジあり）」を追加し、「RM先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）」および「RM先進国債券マザーファンド」を投資対象から削除する旨の約款変更を実施
- ・信託期間を無期限に変更

(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を。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を。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国内債券マザーファンド(埼玉重視型)、RM米ドル建SDGs債券マザーファンド(為替ヘッジあり)、RMユーロ建SDGs債券マザーファンド(為替ヘッジあり)、RM新興国債券マザーファンド、RM国内株式ESGマザーファンド、RM先進国株式ESGマザーファンド、RM新興国株式マザーファンド、RM国内リートマザーファンド、RM先進国リートマザーファンド(以下、各々を「マザーファンド」といいます。)の各受益証券を主要投資対象とします。

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

各マザーファンド受益証券への投資比率は、信託財産の中長期的な成長を目的に独自の定量モデル

にて算出した基本的資産配分比率に基づき決定します。また、基本的資産配分比率は原則として年1回程度見直します。
 実質組入外貨建資産については、一部為替ヘッジを行います。
 各マザーファンド受益証券への投資比率の合計は、原則として高位を保ちますが、市場環境等を勘案して、投資比率を引き下げる場合があります。
 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す。)

ハ) 約束手形(イ)に掲げるものに該当するものを除きます。)

ニ) 金銭債権(イ)、ロ)およびハ)に掲げるものに該当するものを除きます。)

2) 次に掲げる特定資産以外の資産

イ) 為替手形

有価証券の指図範囲

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

1) 株券または新株引受権証券

2) 国債証券

3) 地方債証券

4) 特別の法律により法人の発行する債券

5) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)

6) 特定目的会社にかかる特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)

7) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)

8) 協同組織金融機関にかかる優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)

9) 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)

10) コマーシャル・ペーパー

11) 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。))および新株予約権証券

12) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1)から11)までの証券または証書の性質を有するもの

13) 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)

14) 投資証券、新投資口予約権証券、投資法人債券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)

15) 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)

16) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。)

17) 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)

18) 外国法人が発行する譲渡性預金証書

19) 受益証券発行信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。)

20) 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)

21) 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって19)の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

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

金融商品の指図範囲

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

1) 預金

2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)

3) コール・ローン

4) 手形割引市場において売買される手形

5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの

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

その他の投資対象と指図範囲

信用取引の運用指図、先物取引等の運用指図、スワップ取引の運用指図、金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図、直物為替先渡取引の運用指図、有価証券の貸付けの指図、外国為替予約取引の指図、資金の借入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国内債券マザーファンド（埼玉重視型） >

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。
主な投資対象	わが国の国債および埼玉県が発行する公募地方債を主要投資対象とします。
投資方針	主として、わが国の国債および埼玉県が発行する公募地方債に投資を行い、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長を目指します。なお、国内債券を対象とした債券先物取引を活用することがあります。投資する債券の残存年限を幅広く分散させることにより、金利変動に対するリスク分散効果や、利息収入の平準化を図り、安定した収益の確保を目指します。債券の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。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（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。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8月20日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

< R M米ドル建SDGs債券マザーファンド（為替ヘッジあり） >

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

投資方針	<p>主として、米ドル建のSDGs債および先進国（日本を除く）の国債に投資し、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。なお、先進国債券（除く日本）を対象とした債券先物取引を活用することがあります。</p> <p>米ドル建のSDGs債は、発行体の信用力・ESG評価および当該債券の流動性等を勘案して投資を行います。</p> <p>ポートフォリオの構築は、残存期間が10年程度までの米ドル建のSDGs債および先進国（日本を除く）の国債を、各残存期間の投資金額がほぼ同程度となるように組み入れることにより、金利変動に対するリスク分散効果や、利息収入の平準化を図り、安定した収益の確保を目指します。</p> <p>債券の組入比率は、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>組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行います。</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（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</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	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
決算日	毎年5月10日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

< R Mユーロ建SDGs債マザーファンド（為替ヘッジあり） >

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。
主な投資対象	ユーロ建のSDGs債および先進国（日本を除く）の国債を主要投資対象とします。
投資方針	<p>主として、ユーロ建のSDGs債および先進国（日本を除く）の国債に投資し、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。なお、先進国債券（除く日本）を対象とした債券先物取引を活用することがあります。</p> <p>ユーロ建のSDGs債は、発行体の信用力・ESG評価および当該債券の流動性等を勘案して投資を行います。</p> <p>ポートフォリオの構築は、残存期間が10年程度までのユーロ建のSDGs債および先進国（日本を除く）の国債を、各残存期間の投資金額がほぼ同程度となるように組み入れることにより、金利変動に対するリスク分散効果や、利息収入の平準化を図り、安定した収益の確保を目指します。</p> <p>債券の組入比率は、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>組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行います。</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（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</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	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5月10日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

< R M新興国債券マザーファンド >

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、J PモルガンG B I E Mグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	<p>次の有価証券を主要投資対象とします。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・ J PモルガンG B I E Mグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）に採用されている新興国の債券 ・ 新興国債券の指数を対象指数としたE T F（上場投資信託証券）
投資方針	<p>主として、J PモルガンG B I E Mグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）に採用されている新興国の現地通貨建て債券または新興国債券の指数を対象指数としたE T F（上場投資信託証券）に投資し、J PモルガンG B I E Mグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、J PモルガンG B I E Mグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の債券先物取引を活用することがあります。</p> <p>債券またはE T F（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。</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>株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り。）の行使等により取得したものに限り ます。</p> <p>株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財 産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 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	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国内株式 E S G マザーファンド >

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
主な投資対象	国内の金融商品取引所上場株式（上場予定を含みます。）のうち、MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数（配当込み）に採用されている株式を主要投資対象とします。
投資方針	<p>主として、国内の金融商品取引所上場株式（上場予定を含みます。）のうち、MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数（配当込み）に採用されている株式に投資し、MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数（配当込み）への連動性を高めるため、国内株式の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）、国内株式を対象とした株価指数先物取引を活用することがあります。</p> <p>株式（ETF（上場投資信託証券）、株価指数先物取引を含みます。）の組入比率は、通常の状態を高位に維持することを基本とします。</p> <p>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。</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は行いません。</p> <p>デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
収益分配	収益分配は行いません。
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11月25日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

< R M先進国株式 E S G マザーファンド >

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、MSCI - KOKUSAI ESG リーダーズ指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
主な投資対象	<p>金融商品取引所上場または店頭登録（上場予定および店頭登録予定を含みます。）されている日本を除く先進国の株式[*]のうち、MSCI - KOKUSAI ESG リーダーズ指数（配当込み、円換算ベース）に採用されている株式を主要投資対象とします。</p> <p>[*] 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。</p>
投資方針	<p>主として、金融商品取引所に上場または店頭登録（上場予定および店頭登録予定を含みます。）されている日本を除く先進国の株式のうち、MSCI - KOKUSAI ESG リーダーズ指数（配当込み、円換算ベース）に採用されている株式に投資し、MSCI - KOKUSAI ESG リーダーズ指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、MSCI - KOKUSAI ESG リーダーズ指数（配当込み、円換算ベース）への連動性を高めるため、先進国株式の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）、海外の金融商品取引所に上場されている株価指数先物取引を活用することがあります。</p> <p>株式（ETF（上場投資信託証券）、株価指数先物取引を含みます。）の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。</p> <p>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。</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	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11月25日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

< 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、MSCIEマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	<p>次の有価証券を主要投資対象とします。</p> <ul style="list-style-type: none"> 金融商品取引所に上場されているまたは店頭登録されている（上場予定および店頭登録予定を含みます。）新興国株式（*） （*）DR（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。 新興国株式の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）
投資方針	<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	組入の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国内リートマザーファンド >

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	次の有価証券を主要投資対象とします。 ・東証REIT指数（配当込み）に採用されている不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に規定する不動産投資信託証券をいいます。）
投資方針	主として、東証REIT指数（配当込み）に採用されている不動産投資信託証券に投資し、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。なお、東証REIT指数（配当込み）への連動性を高めるため、東証REIT指数（配当込み）を対象指数としたETF（上場投資信託証券）または不動産投信指数先物取引を活用することがあります。 不動産投資信託証券またはETF（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。 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	不動産投資信託証券および株式への投資割合には、制限を設けません。 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	組入の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

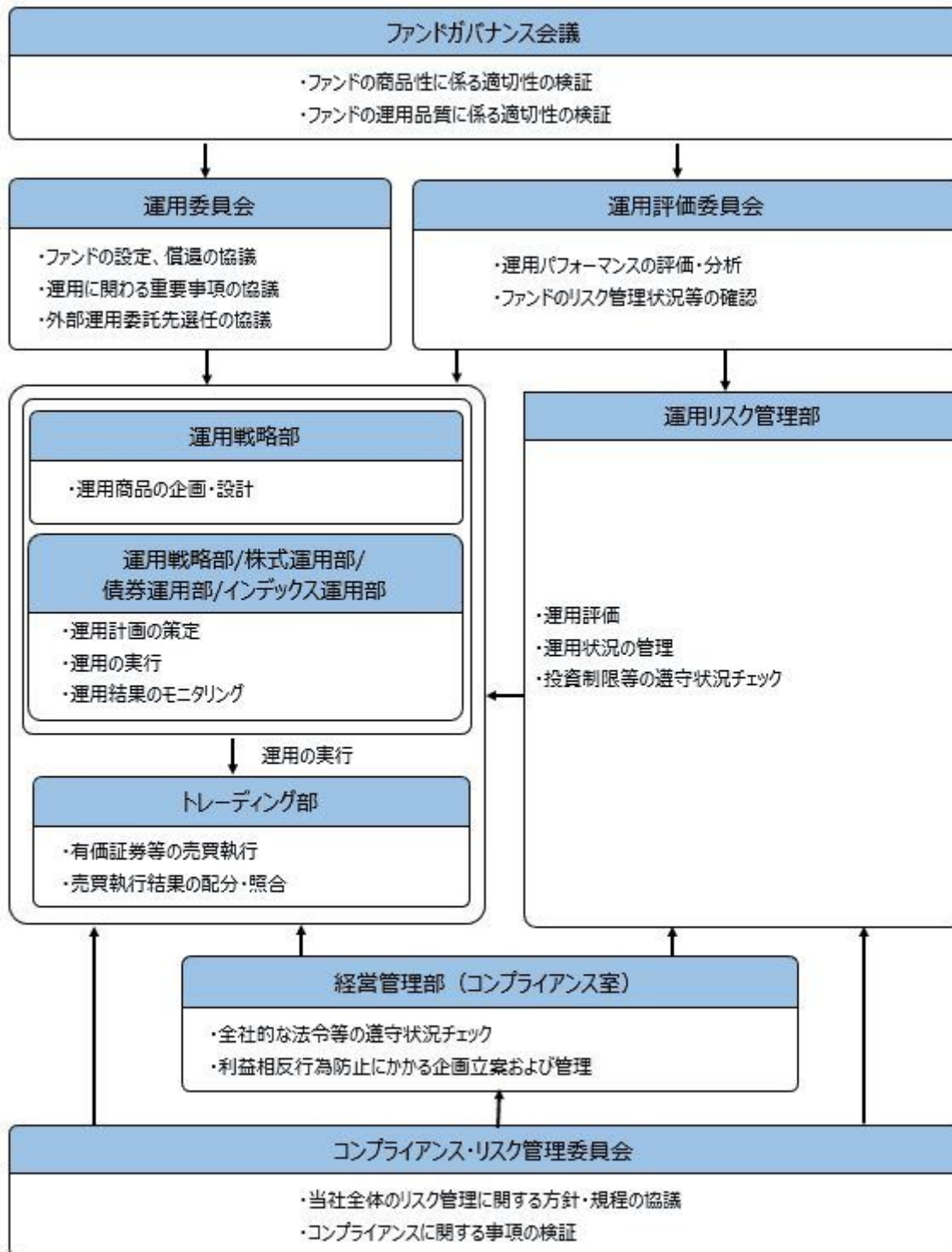
< R M先進国リートマザーファンド >

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

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

（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。

・金利(債券価格)変動リスク

金利(債券価格)は、金融・財政政策、市場の需給、それらに関する外部評価の変化等を反映して変動します。債券価格は、一般に金利が上昇(低下)した場合は値下がり(値上がり)します。債

券価格が値下がりした場合は、基準価額の下落要因となります。

- ・ リートの価格変動リスク
リートの価格は、不動産市況（不動産価格、賃貸料等）、金利・景気動向、社会情勢の変化、関係法令・各種規制等の変更、災害等の要因により変動します。リートの価格および分配金がその影響を受け下落した場合は、基準価額の下落要因となります。
- ・ 為替変動リスク
為替相場は、各国の経済状況、金利動向、政治情勢等のさまざまな要因により変動します。当ファンドは、実質的に外貨建資産に投資を行いますので、投資先の通貨に対して円高となった場合には、基準価額の下落要因となります。また当ファンドは原則として為替ヘッジにより為替変動リスクの一部低減を図ることをしていますが、当該部分の為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。なお、為替ヘッジを行う通貨の短期金利より円短期金利が低い場合には、その金利差相当分のコストがかかります。
- ・ 資産配分リスク
複数資産（国内・外の株式、債券、リート等）への投資を行うため、投資割合が高い資産の価格が下落した場合、当ファンドの基準価額はより大きく影響を受け損失を被ることがあります。
- ・ 信用リスク
実質的に組み入れている有価証券等の発行体が倒産した場合、発行体の財務状況が悪化した場合またはそれらが予想された場合等には、当該有価証券等の価格が下落することやその価値がなくなることにより、基準価額の下落要因となります。
- ・ 流動性リスク
時価総額や取引量が少ない市場で流動性が低い場合、市場の混乱・取引規制等の理由から流動性が低下している場合、急激かつ多量の売買により市場が大きな影響を受けた場合等、市場実勢から期待できる価格よりも大幅に不利な価格で売買せざるを得ないことがあり、この場合、基準価額が下落する要因となります。
- ・ カントリーリスク
投資対象国・地域（特に新興国）において、政治や経済、社会情勢等の変化または金融取引等に関する規制の新設や変更により、実質的に組み入れている有価証券等の価格が大きく変動することがあります。そのため基準価額が予想以上に下落することや、投資方針に沿った運用が困難となることがあります。

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）

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

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

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

（2）リスク管理体制

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、2021年9月から2024年2月の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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



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

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	14.1	42.1	59.8	62.7	5.4	14.8	21.5
最小値	△10.4	△11.4	△12.4	△19.4	△5.5	△6.1	△8.8
平均値	2.0	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年間の当ファンドは2021年9月から2024年2月の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。

* 決算日に対応した数値とは異なります。

* 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

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

各資産クラスの指数

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

○代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

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

東証株価指数 (TOPIX, 配当込み)

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

MSCI-KOKUSAIインデックス (配当込み, 円ベース)

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

MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み, 円ベース)

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

NOMURA-BPI国債

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

FTSE世界国債インデックス (除く日本, 円ベース)

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

JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド (円ベース)

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

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

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

- ・販売会社における申込手数料率は2.2%（税抜2.0%）が上限となっております。
- ・申込手数料の額（1口当たり）は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に申込手数料率を乗じて得た額とします。
- ・＜分配金再投資コース（自動けいぞく投資コース）＞の場合、収益分配金の再投資により取得する口数については、申込手数料はかかりません。

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

(2) 【換金（解約）手数料】

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0.88%（税抜0.80%）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
0.385%	0.385%	0.030%

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

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

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翌営業日）および毎計算期末または信託終了のときに、信託財産から支払います。

(4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

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

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

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

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

・公募株式投資信託は税法上、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）」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

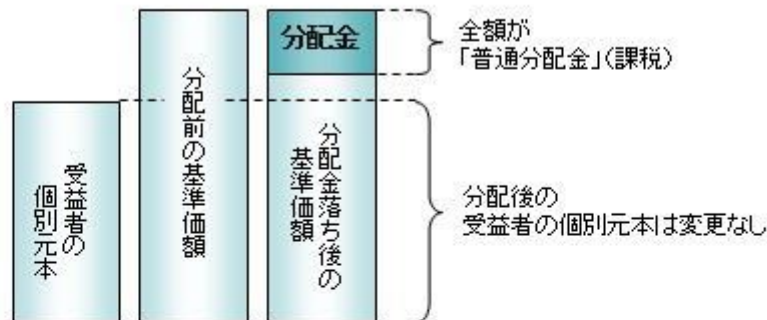
イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

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の額が元本払戻金（特別分配金）となり、収益分配金から元本払戻金（特別分配金）を控除した金額が普通分配金となります。

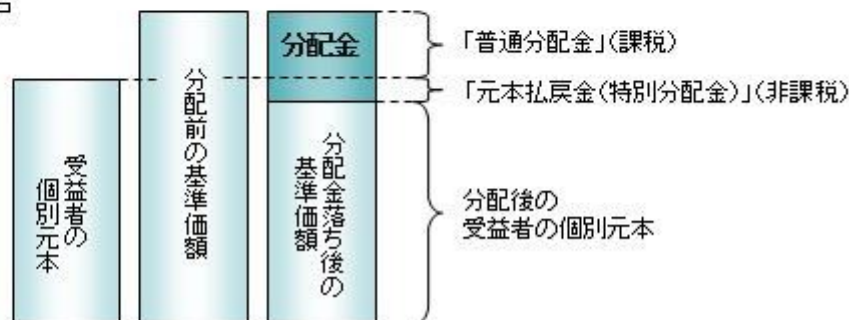
ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

<分配金に関するイメージ図>

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



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

上記は2024年2月末現在のものですので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧め

します。

【参考情報】ファンドの総経費率

総経費率(①+②)	①	②
	運用管理費用の比率	その他費用の比率
0.92%	0.87%	0.05%

※対象期間は2022年8月23日～2023年8月21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】

【埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG】

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	6,210,848,087	99.73
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		16,770,140	0.27
合計(純資産総額)		6,227,618,227	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ESGマザーファンド	672,635,403	1.8470	1,242,357,590	2.2270	1,497,959,042	24.05
日本	親投資信託受益証券	RM米ドル建SDGs債券マザーファンド(為替ヘッジあり)	1,553,090,213	0.8613	1,337,676,601	0.8573	1,331,464,239	21.38
日本	親投資信託受益証券	RM国内債券マザーファンド(埼玉重視型)	987,265,548	0.9796	967,125,331	0.9828	970,284,580	15.58
日本	親投資信託受益証券	RMユーロ建SDGs債券マザーファンド(為替ヘッジあり)	1,026,497,758	0.8658	888,741,759	0.8736	896,748,441	14.40
日本	親投資信託受益証券	RM国内株式ESGマザーファンド	323,234,647	1.4809	478,678,189	1.7930	579,559,722	9.31
日本	親投資信託受益証券	RM先進国リートマザーファンド	230,215,166	1.4803	340,787,511	1.6458	378,888,120	6.08
日本	親投資信託受益証券	RM新興国株式マザーファンド	134,210,571	1.7042	228,721,656	1.8769	251,899,820	4.04
日本	親投資信託受益証券	RM国内リートマザーファンド	131,268,307	1.4325	188,041,850	1.3575	178,196,726	2.86
日本	親投資信託受益証券	RM新興国債券マザーファンド	91,074,973	1.2979	118,206,208	1.3818	125,847,397	2.02

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.73
合計	99.73

【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 (2021年 8月20日)	6,158	6,158	1.1133	1.1133
第2計算期間末 (2022年 8月22日)	6,960	6,960	1.0949	1.0949
第3計算期間末 (2023年 8月21日)	6,448	6,448	1.1040	1.1040
2023年 2月末日	6,500		1.0442	
3月末日	6,546		1.0540	
4月末日	6,568		1.0655	
5月末日	6,604		1.0842	
6月末日	6,581		1.1162	
7月末日	6,533		1.1210	
8月末日	6,576		1.1265	
9月末日	6,359		1.1045	
10月末日	6,207		1.0837	
11月末日	6,390		1.1317	
12月末日	6,286		1.1467	
2024年 1月末日	6,262		1.1687	
2月末日	6,227		1.1834	

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2020年 9月25日～2021年 8月20日	0.0000
第2期	2021年 8月21日～2022年 8月22日	0.0000
第3期	2022年 8月23日～2023年 8月21日	0.0000
当中間期	2023年 8月22日～2024年 2月21日	

【収益率の推移】

期	期間	収益率（%）
第1期	2020年 9月25日～2021年 8月20日	11.33
第2期	2021年 8月21日～2022年 8月22日	1.65
第3期	2022年 8月23日～2023年 8月21日	0.83
当中間期	2023年 8月22日～2024年 2月21日	6.57

(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	2020年 9月25日～2021年 8月20日	6,141,844,751	609,918,666
第2期	2021年 8月21日～2022年 8月22日	1,649,743,586	823,970,233
第3期	2022年 8月23日～2023年 8月21日	456,220,480	972,413,153
当中間期	2023年 8月22日～2024年 2月21日	211,839,102	784,367,458

(注)第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

（参考）

R M国内債券マザーファンド（埼玉重視型）

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（％）
国債証券	日本	127,360,200	13.13
地方債証券	日本	837,696,500	86.34
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		5,221,210	0.54
合計（純資産総額）		970,277,910	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	地方債証券	平成27年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	100.73	100,735,000	100.43	100,433,000	0.505	2025/9/29	10.35
日本	地方債証券	令和5年度第2回埼玉県公募公債	100,000,000	100.01	100,012,000	100.07	100,070,000	0.782	2033/8/29	10.31
日本	地方債証券	令和3年度第2回埼玉県公募公債（5年）	100,000,000	99.56	99,564,000	99.42	99,427,000	0.010	2026/4/15	10.25
日本	地方債証券	令和4年度第2回埼玉県公募公債（5年）	100,000,000	99.39	99,397,000	99.28	99,280,000	0.075	2027/4/26	10.23
日本	地方債証券	平成29年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	99.36	99,365,000	99.19	99,197,000	0.200	2028/3/27	10.22
日本	地方債証券	令和2年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	96.39	96,390,000	97.18	97,182,000	0.140	2031/2/18	10.02
日本	地方債証券	令和4年度第3回埼玉県公募公債（10年）	100,000,000	96.45	96,452,000	97.13	97,130,000	0.304	2032/5/24	10.01
日本	地方債証券	令和3年度第8回埼玉県公募公債	100,000,000	95.55	95,550,000	96.27	96,276,000	0.125	2031/10/27	9.92
日本	国債証券	第368回日本国債（10年）	80,000,000	96.59	77,277,600	96.74	77,395,200	0.200	2032/9/20	7.98
日本	国債証券	第448回利付国債（2年）	50,000,000	100.00	50,002,200	99.93	49,965,000	0.005	2025/5/1	5.15
日本	地方債証券	令和2年度第7回埼玉県公募公債	50,000,000	96.67	48,336,000	97.40	48,701,500	0.125	2030/10/16	5.02

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	13.13
地方債証券	86.34
合 計	99.46

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

R M米ドル建S D G s 債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

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（％）
国債証券	アメリカ	30,994,081	1.34
特殊債券	ドイツ	137,787,005	5.97
	国際機関	2,068,611,496	89.68
	小計	2,206,398,501	95.65
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		69,334,528	3.01
合計（純資産総額）		2,306,727,110	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	売建		2,214,590,398	96.01

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000	15,609.71	156,097,134	15,457.47	154,574,764	4.750	2033/11/14	6.70
国際機関	特殊債券	EUROPEAN BK RECON & DEV	1,000,000	14,488.69	144,886,949	14,750.93	147,509,380	1.625	2024/9/27	6.39
国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000	14,729.04	147,290,441	14,680.49	146,804,933	2.875	2025/6/13	6.36
国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000	15,030.11	150,301,147	14,501.00	145,010,023	3.625	2029/9/21	6.29
国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000	14,756.53	147,565,336	14,450.34	144,503,488	3.125	2027/6/15	6.26
国際機関	特殊債券	INTER-AMERICAN DEVEL BK	1,000,000	14,919.19	149,191,995	14,396.27	143,962,795	3.500	2029/9/14	6.24
国際機関	特殊債券	INTL FINANCE CORP	1,000,000	14,367.06	143,670,661	14,305.96	143,059,688	2.125	2026/4/7	6.20
国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000	13,873.98	138,739,828	14,032.76	140,327,662	0.500	2025/10/28	6.08
国際機関	特殊債券	INTER-AMERICAN DEVEL BK	1,000,000	14,750.78	147,507,874	14,007.97	140,079,721	3.500	2033/4/12	6.07

ドイツ	特殊債券	KFW	1,000,000	13,773.24	137,732,483	13,778.70	137,787,005	1.000	2026/10/1	5.97
国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000	13,538.15	135,381,553	13,334.60	133,346,057	1.375	2028/4/20	5.78
国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000	13,719.74	137,197,453	13,142.85	131,428,501	2.500	2032/3/29	5.70
国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000	13,233.52	132,335,271	13,053.55	130,535,516	1.125	2028/9/13	5.66
国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000	12,826.40	128,264,090	12,366.71	123,667,136	1.625	2031/11/3	5.36
国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000	12,565.85	125,658,581	12,220.77	122,207,711	0.875	2030/5/17	5.30
国際機関	特殊債券	INTER-AMERICAN DEVEL BK	1,000,000	12,562.33	125,623,368	12,159.41	121,594,121	1.125	2031/1/13	5.27
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	210,000	12,525.19	26,302,914	12,615.37	26,492,288	1.625	2031/5/15	1.15
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,000	15,515.99	1,551,599	15,323.60	1,532,360	4.500	2033/11/15	0.07
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,000	15,088.09	1,508,809	14,886.30	1,488,630	4.125	2032/11/15	0.06
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,000	14,984.13	1,498,413	14,808.03	1,480,803	3.875	2027/12/31	0.06

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	1.34
特殊債券	95.65
合計	96.99

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（％）
為替予約取引	米ドル	売建	14,893,800.00	2,207,249,244	2,214,590,398	96.01

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

R Mユーロ建SDGs債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

以下の運用状況は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（％）
国債証券	フランス	49,408,441	3.18
特殊債券	ドイツ	143,686,610	9.25
	国際機関	1,338,582,539	86.21
	小計	1,482,269,149	95.46
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		21,101,464	1.36
合計（純資産総額）		1,552,779,054	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	売建		1,516,109,330	97.64

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000	16,085.78	160,857,898	16,264.90	162,649,077	2.900	2033/1/19	10.47
国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000	16,239.62	162,396,202	16,017.77	160,177,798	2.750	2034/1/16	10.32
国際機関	特殊債券	ASIAN DEVELOPMENT BANK	1,000,000	15,362.88	153,628,862	15,665.11	156,651,109	0.350	2025/7/16	10.09
国際機関	特殊債券	EUROPEAN UNION	1,000,000	15,211.22	152,112,269	15,499.78	154,997,812	0.000	2025/11/4	9.98
国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000	14,669.07	146,690,736	15,013.00	150,130,087	0.000	2027/1/15	9.67
国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000	14,405.24	144,052,453	14,714.08	147,140,816	0.000	2027/11/15	9.48
ドイツ	特殊債券	KFW	1,000,000	14,082.32	140,823,205	14,368.66	143,686,610	0.000	2028/9/15	9.25
国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000	13,623.45	136,234,542	13,955.47	139,554,778	0.050	2029/11/15	8.99
国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000	13,148.48	131,484,815	13,535.33	135,353,350	0.010	2030/11/15	8.72
国際機関	特殊債券	INTL DEVELOPMENT ASSOC	1,000,000	12,779.69	127,796,997	13,192.77	131,927,712	0.000	2031/7/15	8.50
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	160,000	16,190.21	25,904,347	16,262.81	26,020,509	2.250	2024/5/25	1.68
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	100,000	16,058.39	16,058,391	16,103.19	16,103,195	1.750	2024/11/25	1.04
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	10,000	17,270.21	1,727,021	17,102.18	1,710,218	3.500	2033/11/25	0.11
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	10,000	14,891.66	1,489,166	15,030.23	1,503,023	0.750	2028/5/25	0.10
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	10,000	14,666.38	1,466,638	14,555.83	1,455,583	0.500	2029/5/25	0.09
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	10,000	12,891.85	1,289,185	13,183.27	1,318,327	0.000	2031/11/25	0.08
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	10,000	13,187.34	1,318,734	12,975.86	1,297,586	0.000	2032/5/25	0.08

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	3.18
特殊債券	95.46
合計	98.64

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等 (円)	評価額 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	ユーロ	売建	9,378,400.00	1,502,430,934	1,516,109,330	97.64

(注) 為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

R M新興国債券マザーファンド

以下の運用状況は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 (%)
-------	------	----------	----------

投資信託受益証券	アメリカ	2,355,275,995	18.60
	アイルランド	10,271,090,331	81.13
	小計	12,626,366,326	99.74
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		33,331,013	0.26
合計（純資産総額）		12,659,697,339	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アイルランド	投資信託受益証券	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	1,547,547	6,674.40	10,328,948,286	6,637.01	10,271,090,331	81.13
アメリカ	投資信託受益証券	VANECK J.P.MORGAN EM LOCAL	630,832	3,768.25	2,377,136,910	3,733.60	2,355,275,995	18.60

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	99.74
合計	99.74

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

RM国内株式ESGマザーファンド

以下の運用状況は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	4,685,802,960	95.55
投資証券	日本	33,498,900	0.68
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		184,812,495	3.77
合計（純資産総額）		4,904,114,355	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	187,670,000	3.83

(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 (%)
------	----	-----	----	--------------	-----------------	-----------------	-----------------	-----------------	-----------------

日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	130,800	2,838.15	371,231,218	3,621.00	473,626,800	9.66
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	5,800	24,993.84	144,964,302	36,870.00	213,846,000	4.36
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	15,600	13,057.14	203,691,396	12,945.00	201,942,000	4.12
日本	株式	日立製作所	電気機器	11,400	10,619.86	121,066,448	12,665.00	144,381,000	2.94
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	15,700	7,523.96	118,126,262	8,344.00	131,000,800	2.67
日本	株式	第一三共	医薬品	22,800	4,094.04	93,344,260	4,974.00	113,407,200	2.31
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	17,800	5,575.28	99,240,058	6,044.00	107,583,200	2.19
日本	株式	任天堂	その他製品	12,800	7,089.70	90,748,247	8,400.00	107,520,000	2.19
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	22,200	3,758.89	83,447,533	4,376.00	97,147,200	1.98
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	14,700	6,035.06	88,715,458	6,516.00	95,785,200	1.95
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	2,200	37,686.70	82,910,756	43,260.00	95,172,000	1.94
日本	株式	KDDI	情報・通信業	18,500	4,666.61	86,332,455	4,554.00	84,249,000	1.72
日本	株式	HOYA	精密機器	4,300	16,797.57	72,229,581	19,485.00	83,785,500	1.71
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	29,800	2,590.30	77,191,196	2,801.00	83,469,800	1.70
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	13,500	5,124.53	69,181,163	5,363.00	72,400,500	1.48
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	35,500	1,808.91	64,216,442	1,972.50	70,023,750	1.43
日本	株式	ダイキン工業	機械	3,300	22,830.68	75,341,258	21,175.00	69,877,500	1.42
日本	株式	アドバンテスト	電気機器	9,400	4,788.78	45,014,572	6,910.00	64,954,000	1.32
日本	株式	村田製作所	電気機器	21,300	2,926.56	62,335,921	3,023.00	64,389,900	1.31
日本	株式	ファナック	電気機器	11,800	4,171.72	49,226,408	4,372.00	51,589,600	1.05
日本	株式	富士通	電気機器	2,200	21,324.94	46,914,877	23,385.00	51,447,000	1.05
日本	株式	小松製作所	機械	11,400	3,859.20	43,994,919	4,346.00	49,544,400	1.01
日本	株式	三菱重工業	機械	4,000	8,722.26	34,889,076	11,825.00	47,300,000	0.96
日本	株式	オリックス	その他金融業	14,500	2,767.46	40,128,222	3,137.00	45,486,500	0.93
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	7,000	6,062.81	42,439,671	6,446.00	45,122,000	0.92
日本	株式	三井不動産	不動産業	11,000	3,528.45	38,813,022	4,061.00	44,671,000	0.91
日本	株式	ルネサスエレクトロニクス	電気機器	18,100	2,564.54	46,418,331	2,454.50	44,426,450	0.91
日本	株式	富士フイルムホールディングス	化学	4,600	8,728.70	40,152,020	9,523.00	43,805,800	0.89
日本	株式	丸紅	卸売業	17,700	2,359.25	41,758,736	2,472.00	43,754,400	0.89
日本	株式	MS&ADインシュアランスグループホールディングス	保険業	5,300	5,638.78	29,885,586	7,410.00	39,273,000	0.80

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率 (%)
株式	国内	鉱業	0.49
		建設業	1.57
		食料品	2.94
		繊維製品	0.32
		化学	5.45
		医薬品	4.34
		石油・石炭製品	0.47
		ゴム製品	0.93

	ガラス・土石製品	0.46
	鉄鋼	1.33
	非鉄金属	0.50
	金属製品	0.14
	機械	5.36
	電気機器	22.03
	輸送用機器	10.12
	精密機器	2.07
	その他製品	2.91
	電気・ガス業	1.00
	陸運業	2.10
	海運業	0.55
	空運業	0.13
	倉庫・運輸関連業	0.01
	情報・通信業	4.49
	卸売業	3.19
	小売業	4.05
	銀行業	5.31
	証券、商品先物取引業	1.01
	保険業	3.76
	その他金融業	0.98
	不動産業	2.38
	サービス業	5.11
投資証券		0.68
合計		96.23

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物	買建	4	日本円	106,992,200	107,240,000	2.19
	大阪取引所	ミニトピア先物	買建	30	日本円	78,756,550	80,430,000	1.64

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

RM先進国株式ESGマザーファンド

以下の運用状況は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	6,926,915,585	64.11
	カナダ	320,130,292	2.96
	ドイツ	131,211,461	1.21

	イタリア	45,050,704	0.42
	フランス	350,315,991	3.24
	オランダ	234,857,046	2.17
	スペイン	44,268,945	0.41
	ベルギー	7,416,937	0.07
	オーストリア	3,851,427	0.04
	ルクセンブルク	2,867,243	0.03
	フィンランド	26,689,058	0.25
	アイルランド	292,002,607	2.70
	ポルトガル	4,367,987	0.04
	イギリス	339,798,350	3.14
	スイス	244,420,884	2.26
	スウェーデン	82,830,810	0.77
	ノルウェー	27,246,300	0.25
	デンマーク	177,578,278	1.64
	ケイマン	2,892,555	0.03
	オーストラリア	127,997,586	1.18
	バミューダ	12,051,682	0.11
	ニュージーランド	9,076,676	0.08
	香港	44,197,245	0.41
	シンガポール	15,588,237	0.14
	イスラエル	4,389,623	0.04
	キュラソー	22,305,765	0.21
	ジャージー	28,516,530	0.26
	小計	9,528,835,804	88.19
投資証券	アメリカ	172,505,587	1.60
	カナダ	1,199,425	0.01
	フランス	3,378,151	0.03
	イギリス	4,042,488	0.04
	オーストラリア	23,771,545	0.22
	シンガポール	2,338,262	0.02
	小計	207,235,458	1.92
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		1,068,908,124	9.89
合計（純資産総額）		10,804,979,386	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	895,698,483	8.29
	買建	ドイツ	197,781,447	1.83

(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。

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		262,841,702	2.43

(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	15,200	57,060.42	867,318,517	61,431.17	933,753,820	8.64
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	5,319	72,975.79	388,158,261	117,014.84	622,401,945	5.76
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	12,776	20,666.53	264,035,701	20,548.37	262,526,034	2.43
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	11,249	20,903.12	235,139,260	20,706.57	232,928,297	2.16
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	1,738	90,771.17	157,760,296	114,153.61	198,398,989	1.84
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	6,158	35,285.99	217,291,165	30,441.36	187,457,937	1.73
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	3,463	38,467.93	133,214,446	43,035.87	149,033,225	1.38
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	金融サービス	1,814	62,369.34	113,137,983	72,148.32	130,877,070	1.21
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	7,033	15,704.47	110,449,571	18,266.78	128,470,334	1.19
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	5,187	23,065.41	119,640,294	24,340.73	126,255,411	1.17
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	868	103,704.58	90,015,584	141,929.54	123,194,849	1.14
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	一般消費財・サービス流通・小売り	2,155	47,273.46	101,874,312	56,894.49	122,607,645	1.13
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	5,078	22,783.39	115,694,075	24,114.73	122,454,617	1.13
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	5,466	15,497.99	84,712,045	19,314.38	105,572,441	0.98
アメリカ	株式	SALESFORCE INC	ソフトウェア・サービス	2,096	34,391.78	72,085,187	45,166.34	94,668,661	0.88
フランス	株式	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	耐久消費財・アパレル	595	114,968.53	68,406,279	138,387.02	82,340,280	0.76
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	981	93,231.10	91,459,714	83,142.71	81,563,008	0.75
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	8,865	8,835.26	78,324,635	9,100.46	80,675,649	0.75
アイルランド	株式	ACCENTURE PLC-CL A	ソフトウェア・サービス	1,352	50,583.50	68,388,901	56,957.78	77,006,919	0.71

アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	2,967	25,483.94	75,610,851	25,166.41	74,668,739	0.69
アイルランド	株式	LINDE PLC	素材	1,052	62,350.40	65,592,631	67,982.30	71,517,384	0.66
アメリカ	株式	MCDONALD'S CORP	消費者サービス	1,571	42,721.39	67,115,308	44,476.27	69,872,232	0.65
スイス	株式	NOVARTIS AG-REG	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	4,417	14,943.99	66,007,606	15,432.29	68,164,469	0.63
アメリカ	株式	WALT DISNEY CO/THE	メディア・娯楽	3,950	14,434.19	57,015,060	16,694.23	65,942,232	0.61
イギリス	株式	ASTRAZENECA PLC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	3,341	19,459.15	65,013,026	19,418.34	64,876,707	0.60
アメリカ	株式	INTUIT INC	ソフトウェア・サービス	604	85,511.09	51,648,701	99,315.63	59,986,645	0.56
アメリカ	株式	DANAHER CORP	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1,511	33,449.24	50,541,813	38,527.82	58,215,545	0.54
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	9,019	6,662.28	60,087,142	6,326.63	57,059,906	0.53
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア・娯楽	8,883	6,420.59	57,034,146	6,350.74	56,413,628	0.52
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	9,077	5,656.78	51,346,667	6,041.86	54,842,027	0.51

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	2.66
		素材	3.55
		資本財	5.64
		商業・専門サービス	1.70
		運輸	2.18
		自動車・自動車部品	2.12
		耐久消費財・アパレル	2.19
		消費者サービス	1.47
		メディア・娯楽	6.27
		一般消費財・サービス流通・小売り	3.06
		生活必需品流通・小売り	0.81
		食品・飲料・タバコ	2.39
		家庭用品・パーソナル用品	2.60
		ヘルスケア機器・サービス	2.31
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.13
		銀行	3.02
		金融サービス	6.91
		保険	3.21
		ソフトウェア・サービス	14.59
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	0.53

		電気通信サービス	0.95
		公益事業	1.46
		半導体・半導体製造装置	9.19
		不動産管理・開発	0.23
投資証券			1.92
合計			90.11

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	13	米ドル	3,243,487.5	488,696,262	3,302,650	497,610,271	4.61
	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP500MIC2403	買建	104	米ドル	2,585,903.75	389,618,119	2,642,120	398,088,212	3.68
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	STX E6002403	買建	49	ユーロ	1,195,010	195,085,383	1,211,525	197,781,447	1.83

(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。

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	1,356,000.00	203,989,925	204,193,189	1.89
	カナダドル	買建	70,000.00	7,781,858	7,757,862	0.07
	ユーロ	買建	170,000.00	27,736,644	27,740,905	0.26
	英ポンド	買建	60,000.00	11,444,469	11,438,847	0.11
	スイスフラン	買建	30,000.00	5,132,280	5,143,809	0.05
	デンマーククローネ	買建	300,000.00	6,565,350	6,567,090	0.06

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

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。

RM国内リートマザーファンド

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(%)
投資証券	日本	49,592,029,100	98.21
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		905,173,587	1.79
合計(純資産総額)		50,497,202,687	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
不動産投信指数先物取引	買建	日本	922,557,000	1.83

(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	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	5,954	590,693.93	3,516,991,670	577,000	3,435,458,000	6.80
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	5,242	561,194.59	2,941,782,086	540,000	2,830,680,000	5.61
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	16,503	159,685.19	2,635,284,845	148,900	2,457,296,700	4.87
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	8,890	271,445.05	2,413,146,508	250,600	2,227,834,000	4.41
日本	投資証券	KDX不動産投資法人	14,687	163,062.38	2,394,897,283	149,900	2,201,581,300	4.36
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	24,462	99,609.02	2,436,635,947	88,300	2,159,994,600	4.28
日本	投資証券	GLP投資法人	17,239	133,090.12	2,294,340,750	118,900	2,049,717,100	4.06
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	7,693	253,476.18	1,949,992,312	244,400	1,880,169,200	3.72
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	11,416	149,778.01	1,709,865,842	141,500	1,615,364,000	3.20
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	10,169	168,768.22	1,716,204,031	158,100	1,607,718,900	3.18
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	5,007	327,717.38	1,640,880,930	306,000	1,532,142,000	3.03
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	24,710	61,144.05	1,510,869,602	61,500	1,519,665,000	3.01
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	17,084	75,255.99	1,285,673,454	72,600	1,240,298,400	2.46
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	9,296	136,732.15	1,271,062,123	126,000	1,171,296,000	2.32
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	3,490	350,734.43	1,224,063,179	328,500	1,146,465,000	2.27
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	15,335	77,866.38	1,194,081,060	74,100	1,136,323,500	2.25
日本	投資証券	アクティビア・プロパティーズ投資法人	2,677	407,154.03	1,089,951,348	389,500	1,042,691,500	2.06
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	1,762	608,147.58	1,071,556,048	568,000	1,000,816,000	1.98
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	6,524	149,015.84	972,179,361	140,900	919,231,600	1.82
日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	2,123	460,540.29	977,727,041	424,500	901,213,500	1.78
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	3,257	280,959.6	915,085,436	255,900	833,466,300	1.65
日本	投資証券	イオンリート投資法人	6,260	141,125.44	883,445,290	131,500	823,190,000	1.63
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	1,894	438,254.72	830,054,440	429,500	813,473,000	1.61
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	6,001	139,132.5	834,934,187	131,100	786,731,100	1.56
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	7,515	106,420.08	799,746,944	100,800	757,512,000	1.50
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	2,510	315,487.06	791,872,537	286,700	719,617,000	1.43
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	4,775	156,364.45	746,640,266	146,400	699,060,000	1.38
日本	投資証券	森トラストリート投資法人	9,837	73,899.99	726,954,214	69,700	685,638,900	1.36
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	1,057	617,247.08	652,430,165	583,000	616,231,000	1.22
日本	投資証券	三菱地所物流リート投資法人	1,762	375,053.94	660,845,058	349,500	615,819,000	1.22

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
投資証券	98.21
合計	98.21

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（％）
不動産投信指数先物取引	大阪取引所	東証REIT指数先物	買建	543	日本円	960,405,300	922,557,000	1.83

(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。

RM先進国リートマザーファンド

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	481,260,995	0.70
	オーストラリア	39,970,590	0.06
	小計	521,231,585	0.76
投資証券	アメリカ	52,615,516,988	77.03
	カナダ	1,019,283,167	1.49
	ドイツ	26,129,847	0.04
	イタリア	4,181,432	0.01
	フランス	1,170,898,700	1.71
	オランダ	117,075,191	0.17
	スペイン	262,604,023	0.38
	ベルギー	704,966,020	1.03
	アイルランド	23,543,598	0.03
	イギリス	3,030,589,337	4.44
	オーストラリア	4,766,519,227	6.98
	ニュージーランド	194,730,119	0.29
	香港	714,479,535	1.05
	シンガポール	2,237,134,723	3.28
	韓国	122,934,171	0.18
	イスラエル	87,652,270	0.13
ガーナ	192,239,328	0.28	
小計	67,290,477,676	98.51	
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		496,793,988	0.73
合計（純資産総額）		68,308,503,249	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（％）
為替予約取引	買建		125,461,267	0.18
	売建		32,911,365	0.05

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	314,871	18,905.07	5,952,659,902	20,188.27	6,356,701,802	9.31
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	31,993	119,866.66	3,834,894,354	134,378.05	4,299,157,046	6.29
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	188,649	13,128.99	2,476,771,891	13,840.54	2,611,005,200	3.82
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	111,212	21,316.17	2,370,614,739	22,579.40	2,511,100,922	3.68
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	53,941	43,497.74	2,346,311,885	42,231.29	2,277,998,246	3.33
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	283,492	8,285.61	2,348,905,556	7,837.85	2,221,968,736	3.25
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	103,218	20,787.83	2,145,679,094	21,505.12	2,219,716,415	3.25
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	589,360	2,424.45	1,428,875,532	2,820.90	1,662,526,567	2.43
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	352,778	4,572.06	1,612,925,504	4,453.80	1,571,204,491	2.30
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	72,029	22,134.11	1,594,298,402	20,836.15	1,500,807,358	2.20
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	48,423	26,524.65	1,284,403,378	26,573.66	1,286,776,721	1.88
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	99,578	10,098.62	1,005,600,611	11,354.49	1,130,657,525	1.66
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	117,842	8,855.67	1,043,570,631	8,998.01	1,060,343,777	1.55
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	196,190	4,990.54	979,094,314	5,070.04	994,692,227	1.46
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	53,357	18,198.23	971,003,165	18,291.33	975,970,922	1.43
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	137,235	7,164.02	983,155,612	6,400.46	878,367,348	1.29
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	42,452	18,789.08	797,634,241	19,784.47	839,890,647	1.23
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	21,897	35,359.40	774,264,860	34,598.35	757,600,116	1.11
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	39,809	20,192.21	803,831,726	18,958.80	754,731,112	1.10
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	240,697	2,931.99	705,723,308	3,108.32	748,163,805	1.10
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	419,158	1,621.31	679,589,237	1,611.83	675,614,583	0.99
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	226,972	3,045.38	691,216,978	2,957.65	671,304,212	0.98
香港	投資証券	LINK REIT	874,700	762.37	666,853,379	750.75	656,681,025	0.96
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	63,603	9,880.59	628,435,311	9,941.20	632,290,563	0.93
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	74,613	9,598.13	716,145,737	8,381.77	625,389,162	0.92
アメリカ	投資証券	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	91,172	6,916.36	630,578,670	6,858.49	625,303,016	0.92
アメリカ	投資証券	AMERICAN HOMES 4 RENT- A	108,549	5,280.23	573,164,588	5,452.74	591,890,267	0.87
アメリカ	投資証券	UDR INC	103,285	5,530.87	571,256,824	5,335.22	551,048,683	0.81
アメリカ	投資証券	REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	72,067	8,069.29	581,530,110	7,641.98	550,734,746	0.81
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	1,772,984	285.90	506,908,529	300.49	532,766,799	0.78

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国外	エクイティ不動産投資信託 (REIT)	0.76
投資証券			98.51
合計			99.27

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（％）
為替予約取引	米ドル	買建	683,000.00	102,846,171	102,873,471	0.15
	ユーロ	買建	80,000.00	13,059,588	13,055,280	0.02
	英ポンド	買建	50,000.00	9,536,303	9,532,516	0.01
	米ドル	売建	160,000.00	24,072,000	24,103,344	0.04
	オーストラリアドル	売建	90,000.00	8,866,260	8,808,021	0.01

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

参考情報

運用実績

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（西託報酬）控除後の価額です。
※分配金再投資基準価額は、分配金（税引前）を再投資したものと計算しております。

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

2021年8月20日	0円
2022年8月22日	0円
2023年8月21日	0円
-	-
-	-
設定来累計	0円

主要な資産の状況

■資産の組入比率

資産	比率(%)
RM国内債券マザーファンド(埼玉重視型)	15.6
RMドル建SDGs債券マザーファンド(為替ヘッジあり)	21.4
RMユーロ建SDGs債券マザーファンド(為替ヘッジあり)	14.4
RM新興国債券マザーファンド	2.0
RM国内株式ESGマザーファンド	9.3
RM先進国株式ESGマザーファンド	24.1
RM新興国株式マザーファンド	4.0
RM国内リートマザーファンド	2.6
RM先進国リートマザーファンド	6.1
その他	0.3
合計	100.0

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

※その他には未収・未払項目が含まれるためマイナスとなる場合があります。

■通貨別組入比率

通貨	比率(%)
日本円	63.8
米ドル	23.7
ユーロ	2.6
英ポンド	1.1
香港ドル	0.9
その他	8.0
合計	100.0

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

※上記通貨別組入比率は、各マザーファンドが実質的に保有している株式・債券等の通貨を基準に算出しています。

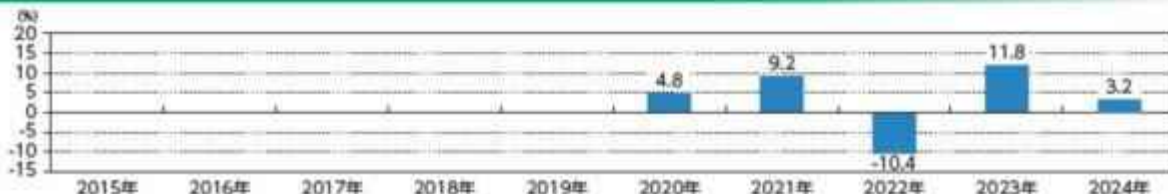
※為替ヘッジをかけている外貨建て資産については、日本円に含まれています。

■各マザーファンドにおける組入上位銘柄

	国・地域	銘柄名	償還期限	比率(%)
国内債券 (埼玉重視型)	日本	平成27年度第6回埼玉県公債	2025/9/29	10.35
	日本	令和5年度第2回埼玉県公債	2033/8/29	10.31
	日本	令和3年度第2回埼玉県公債(5年)	2026/4/15	10.25
米ドル建 SDGs債券	国際機関	INTL BK RECON & DEVELOP	2033/11/14	6.70
	国際機関	EUROPEAN BK RECON & DEV	2024/9/27	6.39
為替ヘッジあり	国際機関	EUROPEAN INVESTMENT BANK	2025/6/13	6.36
	国際機関	INTL BK RECON & DEVELOP	2033/1/19	10.47
ユーロ建 SDGs債券	国際機関	EUROPEAN INVESTMENT BANK	2034/1/16	10.32
	国際機関	ASIAN DEVELOPMENT BANK	2025/7/16	10.09
新興国債券	アイルランド	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	-	81.13
	アメリカ	VANECK J.P.MORGAN EM LOCAL	-	18.60
日本	トヨタ自動車	-	-	9.66
	東京エレクトロン	-	-	4.36
国内株式ESG	日本	ソニーグループ	-	4.12
	アメリカ	MICROSOFT CORP	-	8.64
先進国株式ESG	アメリカ	NVIDIA CORP	-	5.76
	アメリカ	ALPHABET INC-CL A	-	2.43
新興国株式	台湾	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	-	7.27
	韓国	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	-	3.51
ケイマン	ケイマン	TENCENT HOLDINGS LTD	-	3.16
	日本	日本ビルファンド投資法人	-	6.80
国内リート	日本	ジャパハリリアルエステイト投資法人	-	5.61
	日本	野村不動産マスターファンド投資法人	-	4.87
アメリカ	アメリカ	PROLOGIS INC	-	9.31
	アメリカ	EQUINIX INC	-	6.29
先進国リート	アメリカ	EQUINIX INC	-	6.29
	アメリカ	WELLTOWER INC	-	3.82

※比率は、各マザーファンドの純資産総額に対する組入比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)



※ファンド内にベンチマークはありません。

※2020年9月25日が設定日のため、2019年以前の実績はありません。2020年は9月25日から12月までの騰落率です、2024年は2月末までの騰落率です。

※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※運用実績は過去のものであり、将来の運用成果を約束するものではありません。

※運用実績については、別途、委託会社のホームページで開示しています。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

- (1) 申込方法
販売会社所定の方法でお申し込みください。
- (2) コースの選択
収益分配金の受取方法によって、<分配金再投資コース（自動けいぞく投資コース）>と<分配金受取りコース（一般コース）>の2通りがあります。ただし、販売会社によって取扱コースは異なります。
<分配金再投資コース（自動けいぞく投資コース）>
収益分配金を自動的に再投資するコースです。
<分配金受取りコース（一般コース）>
収益分配金を再投資せず、その都度受け取るコースです。
- (3) 申込みの受付
販売会社の営業日に受け付けます。
- (4) 取扱時間
原則として、午後3時^{*}までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の取扱いとなります。
^{*}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
- (6) 申込金額
取得申込受付日の翌営業日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額に、申込手数料と当該手数料に係る消費税等相当額を加算した額です。
- (7) 申込単位
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
- (4) 解約制限
ファンドの規模および商品性格などに基づき、運用上の支障をきたさないようするため、大口の解約には受付時間制限および金額制限を行なう場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
- (5) 解約価額
解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。
 - ・基準価額につきましては、販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

委託会社の照会先

りそなアセットマネジメント株式会社

電話番号：0120-223351

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時）

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

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

販売会社が定める単位とします。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

- (8) 解約代金の支払い
原則として、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。
- (9) 受付の中止および取消
・委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止すること、および既に受け付けた解約請求の受付を取り消すことができます。
・解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日（この計算日が解約請求を受け付けない日であるときは、この計算日以降の最初の解約請求を受け付けることができる日とします。）に解約請求を受け付けたものとして取り扱います。

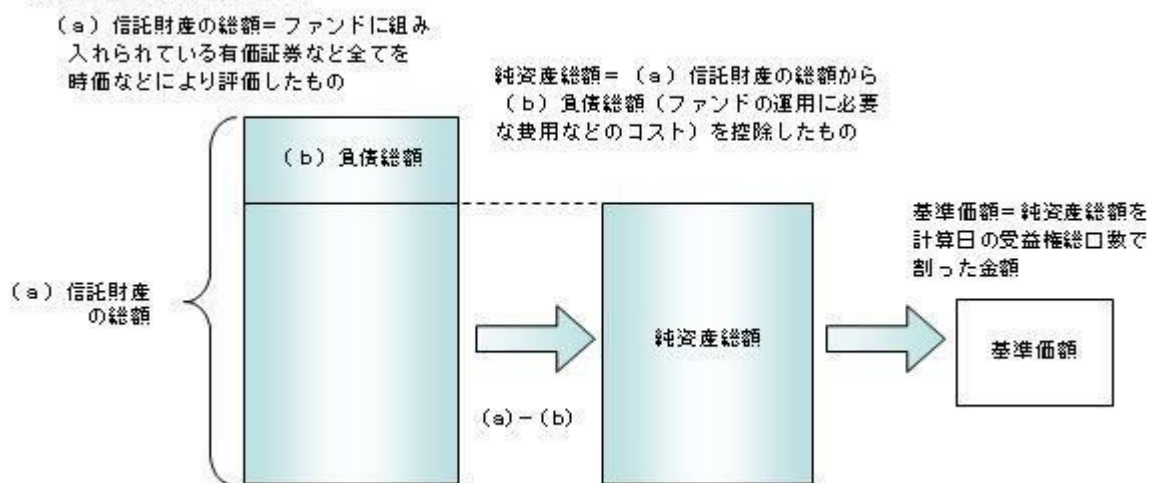
3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額の算出

- ・基準価額は委託会社の営業日において日々算出されます。
- ・基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）を評価して得た信託財産の総額から負債総額を控除した金額（純資産総額）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。なお、ファンドは1万口当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。
 - 公社債（国内・外国）
原則として、基準価額計算日^{*}における以下のいずれかの価額で評価します。
 - ・日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）
 - ・金融商品取引業者（第一種金融商品取引業者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。）、銀行などの提示する価額（売気配相場を除きます。）
 - ・価格情報会社の提供する価額
残存期間1年以内の公社債などについては、一部償却原価法により評価することができます。
- ^{*} 外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。
- 国内上場不動産投信
原則として、基準価額計算日におけるわが国の金融商品取引所の最終相場で評価します。
 - 海外上場不動産投信
原則として、基準価額計算日に知りうる直近の日における外国金融商品市場の最終相場で評価します。
- ・外貨建資産（外国通貨表示の有価証券、預金その他の資産をいいます。）の円換算については、原則としてわが国における計算日の対顧客相場の仲値によって計算します。
- 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（2020年9月25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8月21日から翌年8月20日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

(5) 【その他】

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10億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。

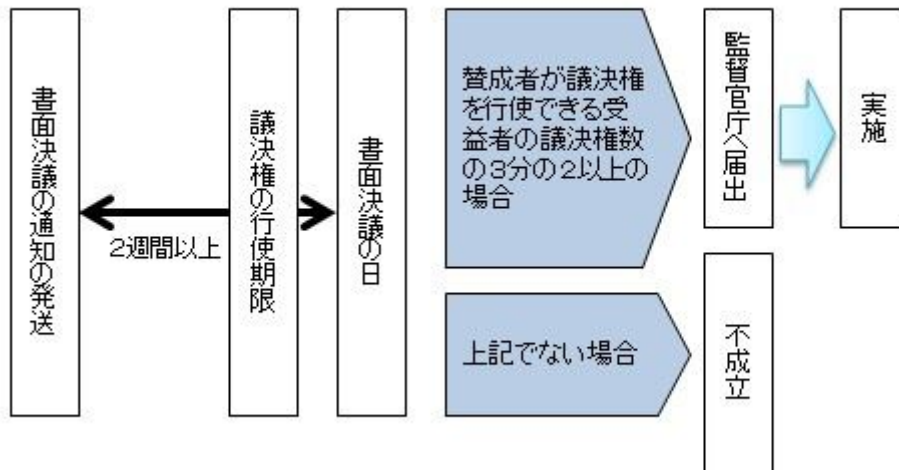
信託約款の変更など

 - 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3期計算期間(2022年 8月23日から2023年 8月21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】

【埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 2022年 8月22日現在	第3期 2023年 8月21日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	55,206,048	47,574,497
親投資信託受益証券	6,947,198,732	6,430,052,956
流動資産合計	7,002,404,780	6,477,627,453
資産合計	7,002,404,780	6,477,627,453
負債の部		
流動負債		
未払解約金	11,319,584	99,169
未払受託者報酬	1,124,913	1,066,040
未払委託者報酬	28,872,551	27,361,491
未払利息	149	129
その他未払費用	292,378	216,674
流動負債合計	41,609,575	28,743,503
負債合計	41,609,575	28,743,503
純資産の部		
元本等		
元本	6,357,699,438	5,841,506,765
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	603,095,767	607,377,185
（分配準備積立金）	397,068,373	401,780,775
元本等合計	6,960,795,205	6,448,883,950
純資産合計	6,960,795,205	6,448,883,950
負債純資産合計	7,002,404,780	6,477,627,453

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第2期		第3期	
	自 至	2021年 8月21日 2022年 8月22日	自 至	2022年 8月23日 2023年 8月21日
営業収益				
有価証券売買等損益		59,064,318		107,856,326
営業収益合計		59,064,318		107,856,326
営業費用				
支払利息		54,199		34,353
受託者報酬		2,243,414		2,160,633
委託者報酬		57,580,795		55,456,028
その他費用		584,915		440,296
営業費用合計		60,463,323		58,091,310
営業利益又は営業損失()		119,527,641		49,765,016
経常利益又は経常損失()		119,527,641		49,765,016
当期純利益又は当期純損失()		119,527,641		49,765,016
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()		2,342,253		13,775,895
期首剰余金又は期首欠損金()		626,932,234		603,095,767
剰余金増加額又は欠損金減少額		187,598,957		31,535,864
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		187,598,957		31,535,864
剰余金減少額又は欠損金増加額		94,250,036		90,795,357
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		94,250,036		90,795,357
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金()		603,095,767		607,377,185

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	当ファンドの計算期間は原則として、毎年8月21日から翌年8月20日までとなっております。ただし、前計算期間末日及び当計算期間末日が休業日のため、当計算期間は2022年8月23日から2023年8月21日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第2期 2022年8月22日現在		第3期 2023年8月21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	5,531,926,085円	期首元本額	6,357,699,438円
期中追加設定元本額	1,649,743,586円	期中追加設定元本額	456,220,480円
期中一部解約元本額	823,970,233円	期中一部解約元本額	972,413,153円
2. 計算期間の末日における受益権の総数	6,357,699,438口	2. 計算期間の末日における受益権の総数	5,841,506,765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	1.0949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	1.1040円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額)	(10,949円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額)	(11,040円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第2期 自 2021年8月21日 至 2022年8月22日		第3期 自 2022年8月23日 至 2023年8月21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	50,207,956円	A 費用控除後の配当等収益額	63,139,279円
B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等増益額	0円	B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等増益額	0円
C 収益調整金額	206,027,394円	C 収益調整金額	205,596,410円
D 分配準備積立金額	346,860,417円	D 分配準備積立金額	338,641,496円
E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D)	603,095,767円	E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D)	607,377,185円
F 当ファンドの期末残存口数	6,357,699,438口	F 当ファンドの期末残存口数	5,841,506,765口
G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000)	948円	G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000)	1,039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2期 自 2021年8月21日 至 2022年8月22日		第3期 自 2022年8月23日 至 2023年8月21日	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	1. 金融商品に対する取組方針	同左
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、株価変動リスク、金利変動リスク、リートの価格変動リスク、投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。	2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。	3. 金融商品に係るリスク管理体制	同左

金融商品の時価等に関する事項

第2期 2022年8月22日現在		第3期 2023年8月21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

<p>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。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> <p>3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>	<p>2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 同左</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左</p> <p>3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 同左</p>
---	---

（関連当事者との取引に関する注記）

第2期 自 2021年 8月21日 至 2022年 8月22日	第3期 自 2022年 8月23日 至 2023年 8月21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2期 自 2021年 8月21日 至 2022年 8月22日	第3期 自 2022年 8月23日 至 2023年 8月21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	81,944,250	221,376,226
合計	81,944,250	221,376,226

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	R M国内債券マザーファンド（埼玉重視型）	1,015,082,191	994,476,022	
	R M米ドル建SDGs債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	1,615,392,938	1,391,499,476	
	R Mユーロ建SDGs債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	1,073,823,609	929,823,863	
	R M新興国債券マザーファンド	108,539,663	140,873,628	
	R M国内株式ESGマザーファンド	398,525,153	590,175,899	
	R M先進国株式ESGマザーファンド	827,169,759	1,527,120,809	
	R M新興国株式マザーファンド	152,927,309	260,618,719	
	R M国内リートマザーファンド	141,797,159	203,096,070	
	R M先進国リートマザーファンド	265,185,503	392,368,470	
合計		5,598,443,284	6,430,052,956	

(注) 券面総額欄の数値は口数を表しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

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

（参考）

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

なお、以下に記載した状況は監査意見の対象外となっております。

R M国内債券マザーファンド（埼玉重視型）

貸借対照表

（単位：円）

2023年 8月21日現在	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	11,249,387
国債証券	147,329,600
地方債証券	835,801,000
未収入金	99,539,000
未収利息	529,829
前払費用	143
流動資産合計	1,094,448,959
資産合計	1,094,448,959
負債の部	
流動負債	
未払金	100,000,000
未払利息	30
流動負債合計	100,000,030
負債合計	100,000,030
純資産の部	
元本等	
元本	1,015,082,191
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	20,633,262
元本等合計	994,448,929
純資産合計	994,448,929
負債純資産合計	1,094,448,959

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

2023年 8月21日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 8月23日
期首元本額	1,188,701,069円
期中追加設定元本額	0円
期中一部解約元本額	173,618,878円
期末元本額	1,015,082,191円
期末元本の内訳	
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	1,015,082,191円
2. 計算日における受益権の総数	1,015,082,191口
3. 元本の欠損	

純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	20,633,262円
4. 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	0.9797円
(10,000口当たり純資産額)	(9,797円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2023年 8月21日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

金融商品の時価等に関する事項

2023年 8月21日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ
	ん。
2. 時価の算定方法	国債証券、地方債証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(関連当事者との取引に関する注記)

2023年 8月21日現在	
該当事項はありません。	

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2023年 8月21日現在	
	損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		2,456,000
地方債証券		11,537,000
合計		13,993,000

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

2 デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第448回利付国債(2年)	30,000,000	30,002,400	

	第139回利付国債（5年）	40,000,000	40,049,600
	第368回日本国債（10年）	80,000,000	77,277,600
	国債証券合計	150,000,000	147,329,600
地方債証券	平成27年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	100,735,000
	平成29年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	99,365,000
	令和2年度第7回埼玉県公募公債	50,000,000	48,336,000
	令和2年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	96,390,000
	令和3年度第2回埼玉県公募公債（5年）	100,000,000	99,564,000
	令和3年度第8回埼玉県公募公債	100,000,000	95,550,000
	令和4年度第2回埼玉県公募公債（5年）	100,000,000	99,397,000
	令和4年度第3回埼玉県公募公債（10年）	100,000,000	96,452,000
	令和5年度第2回埼玉県公募公債	100,000,000	100,012,000
	地方債証券合計	850,000,000	835,801,000
	合計		983,130,600

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

R M米ドル建SDGs債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

貸借対照表

（単位：円）

2023年 8月21日現在	
資産の部	
流動資産	
預金	4,708,400
コール・ローン	118,316,266
国債証券	128,327,354
特殊債券	2,218,931,213
未収利息	16,682,644
前払費用	903,929
流動資産合計	2,487,869,806
資産合計	2,487,869,806
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,489,364
未払金	189,864,385
未払解約金	176,000
未払利息	320
流動負債合計	191,530,069
負債合計	191,530,069
純資産の部	
元本等	
元本	2,665,691,042
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	369,351,305
元本等合計	2,296,339,737
純資産合計	2,296,339,737
負債純資産合計	2,487,869,806

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

2023年 8月21日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 8月23日
期首元本額	843,926,988円
期中追加設定元本額	2,052,681,679円
期中一部解約元本額	230,917,625円
期末元本額	2,665,691,042円
期末元本の内訳	
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	1,615,392,938円
九州SDGs・グローバルバランス	384,797,650円
ラップ型ファンド・プラスESG（安定型）	66,556,592円
ラップ型ファンド・プラスESG（安定成長型）	272,057,482円
ラップ型ファンド・プラスESG（成長型）	27,867,519円
りそな米ドル建SDGs債券ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	299,018,861円
2. 計算日における受益権の総数	2,665,691,042口
3. 元本の欠損	
純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	369,351,305円
4. 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	0.8614円
(10,000口当たり純資産額)	(8,614円)

（注） は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

2023年 8月21日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

金融商品の時価等に関する事項

2023年 8月21日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	国債証券、特殊債券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 デリバティブ取引 （その他の注記）の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

(関連当事者との取引に関する注記)

2023年 8月21日現在

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2023年 8月21日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
国債証券		4,541,908
特殊債券		67,892,600
合計		72,434,508

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

2 デリバティブ取引に関する注記

(通貨関連)

(2023年 8月21日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	2,324,097,940	-	2,325,587,304	1,489,364
	米ドル	2,324,097,940	-	2,325,587,304	1,489,364
	合計	2,324,097,940	-	2,325,587,304	1,489,364

(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

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY N/B	170,000.00	169,516.42	
		US TREASURY N/B	420,000.00	347,927.34	

		US TREASURY N/B	370,000.00	365,562.88
		米ドル 小計	960,000.00	883,006.64 (128,327,354)
		国債証券合計		128,327,354 (128,327,354)
特殊債券	米ドル	EUROPEAN BK RECON & DEV	1,000,000.00	959,081.18
		EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000.00	962,623.59
		EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000.00	855,098.45
		EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000.00	795,865.63
		INTER-AMERICAN DEVEL BK	1,000,000.00	950,580.46
		INTER-AMERICAN DEVEL BK	1,000,000.00	792,089.30
		INTER-AMERICAN DEVEL BK	1,000,000.00	928,061.93
		INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000.00	979,961.59
		INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000.00	909,977.28
		INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000.00	948,788.89
		INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000.00	868,904.69
		INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000.00	848,436.81
		INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000.00	957,394.07
		INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000.00	814,257.61
		INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000.00	866,858.87
		INTL FINANCE CORP	1,000,000.00	935,058.41
		KFW	1,000,000.00	895,186.75
		米ドル 小計	17,000,000.00	15,268,225.51 (2,218,931,213)
		特殊債券合計		2,218,931,213 (2,218,931,213)
		合計		2,347,258,567 (2,347,258,567)

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

外貨建有価証券の内訳

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

(注)時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

R Mユーロ建SDGs債券マザーファンド(為替ヘッジあり)

貸借対照表

(単位：円)

2023年 8月21日現在

資産の部	
流動資産	
預金	4,084,629
コール・ローン	56,551,041
国債証券	139,626,741
特殊債券	1,551,009,778
未収利息	4,310,647
前払費用	1,214,327
流動資産合計	1,756,797,163
資産合計	
1,756,797,163	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,360,798
未払金	130,011,464
未払解約金	433,000
未払利息	153
流動負債合計	131,805,415
負債合計	
131,805,415	
純資産の部	
元本等	
元本	1,876,715,910
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	251,724,162
元本等合計	1,624,991,748
純資産合計	
1,624,991,748	
負債純資産合計	
1,756,797,163	

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2023年 8月21日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 8月23日
期首元本額	774,720,159円
期中追加設定元本額	1,399,478,809円
期中一部解約元本額	297,483,058円
期末元本額	1,876,715,910円
期末元本の内訳	
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	1,073,823,609円
九州SDGs・グローバルバランス	258,878,586円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定型)	44,737,871円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定成長型)	182,164,015円
ラップ型ファンド・プラスESG(成長型)	18,453,250円
りそなユーロ建SDGs債券ファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	298,658,579円

2. 計算日における受益権の総数	1,876,715,910口
3. 元本の欠損 純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	251,724,162円
4. 計算日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額)	0.8659円 (8,659円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2023年 8月21日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

金融商品の時価等に関する事項

2023年 8月21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	国債証券、特殊債券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 デリバティブ取引 (その他の注記)の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

2023年 8月21日現在	
該当事項はありません。	

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2023年 8月21日現在	
	損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券	1,061,505	
特殊債券	9,840,622	
合計	10,902,127	

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

2 デリバティブ取引に関する注記

(通貨関連)

(2023年 8月21日現在)

(単位: 円)

--	--	--	--

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	1,672,489,603	-	1,673,850,401	1,360,798
	ユーロ	1,672,489,603	-	1,673,850,401	1,360,798
	合計	1,672,489,603	-	1,673,850,401	1,360,798

(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

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	ユーロ	GOV OF FRANCE	160,000.00	158,462.24	
		GOV OF FRANCE	150,000.00	147,042.75	
		GOV OF FRANCE	110,000.00	102,648.59	
		GOV OF FRANCE	100,000.00	92,984.10	
		GOV OF FRANCE	120,000.00	108,293.64	
		GOV OF FRANCE	110,000.00	95,812.42	
		GOV OF FRANCE	110,000.00	85,822.99	
		GOV OF FRANCE	120,000.00	91,976.16	
		ユーロ 小計		980,000.00	883,042.89 (139,626,741)
	国債証券合計			139,626,741 (139,626,741)	
特殊債券	ユーロ	ASIAN DEVELOPMENT BANK	1,000,000.00	941,218.31	
		EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000.00	993,277.00	
		EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000.00	877,790.00	
		EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000.00	827,190.08	
		EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000.00	946,330.00	
		EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000.00	798,106.00	
		EUROPEAN UNION	1,000,000.00	932,267.00	
		INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000.00	895,238.00	
		INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000.00	968,305.00	
		INTL DEVELOPMENT ASSOC	1,000,000.00	774,332.27	

	KFW	1,000,000.00	855,014.00	
	ユーロ 小計	11,000,000.00	9,809,067.66 (1,551,009,778)	
	特殊債券合計		1,551,009,778 (1,551,009,778)	
	合計		1,690,636,519 (1,690,636,519)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額（単位：円）であります。

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

外貨建有価証券の内訳

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

(注)時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

R M新興国債券マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2023年 8月21日現在

資産の部	
流動資産	
預金	1,206,607
コール・ローン	11,332,419
投資信託受益証券	10,466,695,854
流動資産合計	10,479,234,880
資産合計	10,479,234,880
負債の部	
流動負債	
未払解約金	1,016,500
未払利息	30
流動負債合計	1,016,530
負債合計	1,016,530
純資産の部	
元本等	
元本	8,073,114,382
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	2,405,103,968
元本等合計	10,478,218,350
純資産合計	10,478,218,350
負債純資産合計	10,479,234,880

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1.有価証券の評価基準及び評価方法 投資信託受益証券

2. デリバティブの評価基準及び評価方法	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。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	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。
4. 収益及び費用の計上基準	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。 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。
5. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	為替予約取引による為替差損益 原則として、約定日基準で計上しております。 外貨建取引等の処理基準 外貨建資産等については、投資信託財産の計算に関する規則第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分して整理する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。

(貸借対照表に関する注記)

2023年 8月21日現在

1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 8月23日
期首元本額	8,384,271,906円
期中追加設定元本額	1,734,951,987円
期中一部解約元本額	2,046,109,511円
期末元本額	8,073,114,382円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	796,807,353円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	923,908,425円
りそなラップ型ファンド(成長型)	588,261,601円
DCりそな グローバルバランス	21,611,115円
つみたてバランスファンド	1,393,442,029円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	303,158,851円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	220,725,317円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	153,150,918円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	78,731,624円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	53,791,094円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	30,023,162円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	62,482,250円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	108,539,663円
九州SDGs・グローバルバランス	34,798,944円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定型)	3,388,160円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定成長型)	25,523,305円
ラップ型ファンド・プラスESG(成長型)	33,133,149円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定型)	8,904,884円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定成長型)	10,473,266円
りそな つみたてラップ型ファンド(成長型)	6,772,774円
ターゲットリターンバランスファンド(目標2%)	18,632円
ターゲットリターンバランスファンド(目標3%)	21,622円
ターゲットリターンバランスファンド(目標4%)	27,941円
ターゲットリターンバランスファンド(目標5%)	34,804円
ターゲットリターンバランスファンド(目標6%)	63,593円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2065	37,433円
FWりそな先進国+新興国債券アクティブファンド	32,621,917円
FWりそな新興国債券インデックスファンド	2,482,331,514円
Smart-i 8資産バランス 安定型	76,595,370円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	245,376,010円
Smart-i 8資産バランス 成長型	330,267,363円
りそなVIグローバル・バランスファンド(安定型)(適格機関投資家専用)	3,995,922円
りそなVIグローバル・バランスファンド(安定成長型)(適格機関投資家専用)	8,025,283円
りそなVIグローバル・バランスファンド(成長型)(適格機関投資家専用)	15,474,515円
りそなFT マルチアセットファンド(適格機関投資家専用)	14,294,203円
りそなDAAマルチアセットファンド(適格機関投資家専用)	6,300,376円
2. 計算日における受益権の総数	8,073,114,382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	1.2979円
(10,000口当たり純資産額)	(12,979円)

（注） は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

2023年 8月21日現在	
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

金融商品の時価等に関する事項

2023年 8月21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	投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

2023年 8月21日現在	
該当事項はありません。	

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2023年 8月21日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
投資信託受益証券		112,390,224
合計		112,390,224

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

2 デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	米ドル	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	1,326,247	58,434,442.82	
		VANECK J.P.MORGAN EM LOCAL	545,832	13,585,758.48	
			1,872,079	72,020,201.30	

	米ドル 小計		
		(10,466,695,854)	
合計		10,466,695,854	
		(10,466,695,854)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

外貨建有価証券の内訳

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

(注)時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

R M国内株式E S Gマザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2023年 8月21日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	159,881,199
株式	3,527,541,730
投資証券	45,873,500
派生商品評価勘定	32,340
未収配当金	3,811,370
前払金	2,505,750
差入委託証拠金	6,405,000
流動資産合計	3,746,050,889
資産合計	3,746,050,889
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,372,350
未払利息	433
流動負債合計	2,372,783
負債合計	2,372,783
純資産の部	
元本等	
元本	2,528,053,182
剰余金	
剰余金又は欠損金()	1,215,624,924
元本等合計	3,743,678,106
純資産合計	3,743,678,106
負債純資産合計	3,746,050,889

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1.有価証券の評価基準及び評価方法 株式

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

(貸借対照表に関する注記)

2023年 8月21日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 8月23日
期首元本額	1,936,936,330円
期中追加設定元本額	1,603,707,271円
期中一部解約元本額	1,012,590,419円
期末元本額	2,528,053,182円
期末元本の内訳	
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	398,525,153円
国内株式ESGインデックス・オープン	94,567,074円
九州SDGs・グローバルバランス	176,468,550円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定型)	12,045,615円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定成長型)	140,649,120円
ラップ型ファンド・プラスESG(成長型)	192,054,545円
Smart-i 国内株式ESGインデックス	856,701,406円
国内株式ESGインデックスファンド(適格機関投資家専用)	657,041,719円
2. 計算日における受益権の総数	2,528,053,182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	1.4809円
(10,000口当たり純資産額)	(14,809円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2023年 8月21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

2023年 8月21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る場合、当該価額が異なることもあります。

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

(関連当事者との取引に関する注記)

2023年 8月21日現在

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2023年 8月21日現在	
	損益に含まれた評価差額(円)	
株式		296,882,456
投資証券		2,283,932
合計		294,598,524

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

2 デリバティブ取引に関する注記

(株式関連)

(2023年 8月21日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等	うち1年超		時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引					
	買建	172,504,010	-	170,164,000	2,340,010	
合計		172,504,010	-	170,164,000	2,340,010	

(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	
I N P E X	10,700	1,979.50	21,180,650	
大林組	7,200	1,275.50	9,183,600	
清水建設	6,100	971.20	5,924,320	
大和ハウス工業	6,600	3,873.00	25,561,800	
積水ハウス	6,800	2,849.00	19,373,200	
高砂熱学工業	500	2,786.00	1,393,000	
大気社	300	4,440.00	1,332,000	
明治ホールディングス	2,400	3,599.00	8,637,600	
サッポロホールディングス	700	4,072.00	2,850,400	

アサヒグループホールディングス	5,300	5,302.00	28,100,600
キリンホールディングス	8,600	2,013.50	17,316,100
サントリー食品インターナショナル	1,500	4,610.00	6,915,000
伊藤園	500	4,245.00	2,122,500
キッコーマン	1,500	7,787.00	11,680,500
味の素	5,000	5,712.00	28,560,000
キューピー	1,100	2,364.00	2,600,400
カゴメ	800	3,306.00	2,644,800
ニチレイ	1,200	3,339.00	4,006,800
日清食品ホールディングス	700	12,135.00	8,494,500
東洋紡	900	1,005.50	904,950
帝人	2,000	1,409.00	2,818,000
東レ	15,300	779.50	11,926,350
クラレ	3,100	1,546.00	4,792,600
旭化成	13,800	911.70	12,581,460
住友化学	15,500	390.10	6,046,550
東ソー	2,900	1,799.50	5,218,550
デンカ	800	2,592.50	2,074,000
カネカ	500	3,887.00	1,943,500
三井化学	1,900	3,970.00	7,543,000
J S R	2,000	4,050.00	8,100,000
東京応化工業	400	9,236.00	3,694,400
三菱ケミカルグループ	14,100	835.70	11,783,370
ダイセル	2,800	1,146.50	3,210,200
積水化学工業	4,000	2,187.00	8,748,000
U B E	1,000	2,394.50	2,394,500
花王	5,100	5,671.00	28,922,100
日本ペイントホールディングス	10,500	1,080.50	11,345,250
関西ペイント	1,800	2,273.50	4,092,300
D I C	800	2,416.00	1,932,800
富士フイルムホールディングス	4,100	8,175.00	33,517,500
日東電工	1,700	9,696.00	16,483,200
信越ポリマー	500	1,309.00	654,500
ニフコ	900	4,040.00	3,636,000
ユニ・チャーム	4,500	5,747.00	25,861,500
協和キリン	3,000	2,583.00	7,749,000
アステラス製薬	20,000	2,257.50	45,150,000
塩野義製薬	2,900	6,300.00	18,270,000
エーザイ	2,800	9,345.00	26,166,000
小野薬品工業	4,300	2,779.50	11,951,850
第一三共	20,400	4,194.00	85,557,600
E N E O Sホールディングス	31,800	513.60	16,332,480
ブリヂストン	6,300	5,513.00	34,731,900

住友理工	400	982.00	392,800
太平洋セメント	1,300	2,683.50	3,488,550
TOTO	1,500	3,842.00	5,763,000
日本特殊陶業	1,700	3,272.00	5,562,400
日本製鉄	8,900	3,268.00	29,085,200
神戸製鋼所	3,900	1,682.00	6,559,800
JFEホールディングス	5,400	2,184.00	11,793,600
日本軽金属ホールディングス	600	1,508.00	904,800
三井金属鉱業	600	3,492.00	2,095,200
三菱マテリアル	1,400	2,326.50	3,257,100
住友金属鉱山	2,700	4,338.00	11,712,600
DOWAホールディングス	600	4,460.00	2,676,000
UACJ	400	3,035.00	1,214,000
LIXIL	3,200	1,765.00	5,648,000
三浦工業	1,000	3,262.00	3,262,000
アマダ	3,800	1,433.00	5,445,400
ナブテスコ	1,200	2,603.00	3,123,600
小松製作所	10,200	3,898.00	39,759,600
日立建機	1,200	4,163.00	4,995,600
クボタ	11,200	2,159.50	24,186,400
荏原製作所	1,000	7,042.00	7,042,000
ダイキン工業	2,900	23,375.00	67,787,500
栗田工業	1,200	5,417.00	6,500,400
ダイフク	3,400	2,594.00	8,819,600
グローリー	500	2,923.00	1,461,500
セガサミーホールディングス	1,700	2,903.00	4,935,100
NTN	4,400	276.90	1,218,360
日立造船	1,800	828.00	1,490,400
三菱重工業	3,500	7,610.00	26,635,000
イビデン	1,200	8,015.00	9,618,000
コニカミノルタ	5,000	444.80	2,224,000
ブラザー工業	2,600	2,415.50	6,280,300
日立製作所	10,300	9,172.00	94,471,600
富士電機	1,400	6,376.00	8,926,400
安川電機	2,600	5,352.00	13,915,200
オムロン	1,900	6,665.00	12,663,500
日本電気	2,700	7,414.00	20,017,800
富士通	1,900	17,635.00	33,506,500
ルネサスエレクトロニクス	14,000	2,381.00	33,334,000
セイコーエプソン	3,200	2,275.00	7,280,000
アルバック	500	5,459.00	2,729,500
パナソニックホールディングス	24,400	1,577.00	38,478,800
シャープ	2,500	873.50	2,183,750

アンリツ	1,500	1,032.50	1,548,750
ソニーグループ	13,900	12,000.00	166,800,000
T D K	4,300	5,031.00	21,633,300
アルプスアルパイン	2,100	1,170.50	2,458,050
横河電機	2,500	2,695.50	6,738,750
アズビル	1,300	4,481.00	5,825,300
アドバンテスト	2,100	18,480.00	38,808,000
シスメックス	1,900	7,453.00	14,160,700
スタンレー電気	1,400	2,528.00	3,539,200
ファナック	10,600	4,033.00	42,749,800
太陽誘電	1,300	3,947.00	5,131,100
村田製作所	6,300	7,995.00	50,368,500
リコー	6,100	1,165.00	7,106,500
東京エレクトロン	4,900	20,790.00	101,871,000
川崎重工業	1,700	3,587.00	6,097,900
トヨタ自動車	117,000	2,356.50	275,710,500
ヤマハ発動機	3,300	3,723.00	12,285,900
島津製作所	2,600	4,078.00	10,602,800
ニコン	3,300	1,550.00	5,115,000
H O Y A	3,900	15,725.00	61,327,500
前田工織	200	3,085.00	617,000
大日本印刷	2,400	3,830.00	9,192,000
N I S S H A	400	1,706.00	682,400
アシックス	1,800	5,117.00	9,210,600
ヤマハ	1,500	4,466.00	6,699,000
リンテック	400	2,267.50	907,000
任天堂	11,500	6,128.00	70,472,000
コクヨ	900	2,193.00	1,973,700
美津濃	200	4,430.00	886,000
東北電力	5,000	978.90	4,894,500
九州電力	4,400	910.50	4,006,200
電源開発	1,600	2,205.50	3,528,800
レノバ	400	1,367.00	546,800
東京瓦斯	4,300	3,264.00	14,035,200
大阪瓦斯	4,100	2,237.00	9,171,700
東邦瓦斯	800	2,511.50	2,009,200
西部ガスホールディングス	300	1,982.00	594,600
東武鉄道	2,100	3,858.00	8,101,800
相鉄ホールディングス	900	2,774.00	2,496,600
東急	5,900	1,770.50	10,445,950
京王電鉄	1,100	4,858.00	5,343,800
西日本旅客鉄道	2,400	6,089.00	14,613,600
西武ホールディングス	2,500	1,569.50	3,923,750

西日本鉄道	700	2,612.00	1,828,400
阪急阪神ホールディングス	2,500	4,935.00	12,337,500
南海電気鉄道	1,100	2,925.50	3,218,050
京阪ホールディングス	1,100	4,051.00	4,456,100
名古屋鉄道	2,100	2,252.50	4,730,250
ヤマトホールディングス	3,100	2,591.00	8,032,100
山九	500	4,970.00	2,485,000
センコーグループホールディングス	1,200	997.00	1,196,400
九州旅客鉄道	1,500	3,139.00	4,708,500
S Gホールディングス	3,500	2,049.00	7,171,500
NIPPON EXPRESSホールディングス	800	7,270.00	5,816,000
日本郵船	5,300	3,801.00	20,145,300
ANAホールディングス	1,800	3,274.00	5,893,200
トランコム	100	7,380.00	738,000
T I S	2,400	3,286.00	7,886,400
S H I F T	100	29,925.00	2,992,500
ティーガイア	200	1,691.00	338,200
オープンドア	100	1,123.00	112,300
マネーフォワード	500	5,122.00	2,561,000
ビジョナル	200	6,850.00	1,370,000
野村総合研究所	4,300	4,040.00	17,372,000
メルカリ	1,200	3,174.00	3,808,800
Zホールディングス	29,500	400.00	11,800,000
伊藤忠テクノソリューションズ	1,100	4,319.00	4,750,900
B I P R O G Y	800	3,648.00	2,918,400
ビジョン	400	1,762.00	704,800
K D D I	16,500	4,213.00	69,514,500
ソフトバンク	31,700	1,617.50	51,274,750
N T Tデータグループ	7,000	1,849.00	12,943,000
カプコン	1,900	5,833.00	11,082,700
S C S K	1,700	2,453.50	4,170,950
T O K A Iホールディングス	1,100	909.00	999,900
アズワン	300	5,540.00	1,662,000
伊藤忠商事	13,100	5,450.00	71,395,000
丸紅	16,900	2,310.50	39,047,450
三井物産	14,500	5,251.00	76,139,500
キヤノンマーケティングジャパン	500	3,747.00	1,873,500
モスフードサービス	300	3,330.00	999,000
ローソン	500	6,980.00	3,490,000
ゲオホールディングス	300	2,447.00	734,100
アダストリア	300	2,946.00	883,800
ジンズホールディングス	100	3,440.00	344,000
D C Mホールディングス	1,200	1,234.00	1,480,800

J．フロント リテイリング	2,700	1,544.50	4,170,150
マツキヨココカラ&カンパニー	1,300	8,845.00	11,498,500
Z O Z O	1,400	2,710.00	3,794,000
オイシックス・ラ・大地	300	1,747.00	524,100
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	600	1,122.00	673,200
イオン北海道	500	858.00	429,000
スギホールディングス	300	6,520.00	1,956,000
日本瓦斯	1,200	2,206.00	2,647,200
マックスバリュ東海	100	2,770.00	277,000
丸井グループ	2,000	2,408.00	4,816,000
イオン	7,200	3,040.00	21,888,000
平和堂	300	2,343.00	702,900
ヤオコー	200	7,607.00	1,521,400
ヤマダホールディングス	6,400	459.00	2,937,600
ファーストリテイリング	1,900	33,070.00	62,833,000
サンドラッグ	800	4,203.00	3,362,400
りそなホールディングス	23,600	715.00	16,874,000
三井住友トラスト・ホールディングス	3,700	5,160.00	19,092,000
三井住友フィナンシャルグループ	14,400	6,295.00	90,648,000
みずほフィナンシャルグループ	26,600	2,259.00	60,089,400
大和証券グループ本社	14,700	767.40	11,280,780
野村ホールディングス	32,100	536.00	17,205,600
S O M P Oホールディングス	3,500	6,158.00	21,553,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	4,700	5,100.00	23,970,000
東京海上ホールディングス	19,900	3,101.00	61,709,900
T & Dホールディングス	5,500	2,230.50	12,267,750
東京センチュリー	400	5,257.00	2,102,800
オリックス	12,900	2,594.00	33,462,600
ヒューリック	4,200	1,240.00	5,208,000
野村不動産ホールディングス	1,200	3,517.00	4,220,400
三井不動産	9,900	3,008.00	29,779,200
三菱地所	12,400	1,749.50	21,693,800
平和不動産	300	3,700.00	1,110,000
東京建物	2,100	1,829.50	3,841,950
住友不動産	3,200	3,570.00	11,424,000
ディップ	400	3,340.00	1,336,000
H．U．グループホールディングス	600	2,541.50	1,524,900
オリエンタルランド	12,000	5,114.00	61,368,000
ダスキン	500	3,204.00	1,602,000
リゾートトラスト	800	2,284.00	1,827,200
サイバーエージェント	4,700	893.30	4,198,510
楽天グループ	16,500	539.00	8,893,500

テクノプロ・ホールディングス	1,200	3,504.00	4,204,800	
リクルートホールディングス	15,900	4,778.00	75,970,200	
エラン	300	778.00	233,400	
インソース	600	1,087.00	652,200	
カーブスホールディングス	600	721.00	432,600	
L I T A L I C O	200	2,032.00	406,400	
乃村工藝社	900	832.00	748,800	
セコム	2,300	10,090.00	23,207,000	
ベネッセホールディングス	700	1,827.50	1,279,250	
合 計	1,127,500		3,527,541,730	

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	森ヒルズリート投資法人	17	2,441,200	
	日本プロロジスリート投資法人	24	6,729,600	
	ヒューリックリート投資法人	14	2,286,200	
	積水ハウス・リート投資法人	46	3,776,600	
	日本ビルファンド投資法人	17	9,928,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	14	8,036,000	
	日本プライムリアルティ投資法人	9	3,204,000	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	32	4,854,400	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	10	2,960,000	
	ジャパンエクセレント投資法人	13	1,657,500	
合 計		196	45,873,500	

(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E S Gマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2023年 8月21日現在	
資産の部	
流動資産	
預金	384,155,013
コール・ローン	21,819,796
株式	6,246,693,571
投資証券	139,095,676
派生商品評価勘定	57,768
未収入金	2,209
未収配当金	8,690,180
差入委託証拠金	89,611,678
流動資産合計	6,890,125,891

2023年 8月21日現在

資産合計	6,890,125,891
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	11,924,428
未払解約金	9,118,000
未払利息	59
流動負債合計	21,042,487
負債合計	21,042,487
純資産の部	
元本等	
元本	3,720,634,253
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	3,148,449,151
元本等合計	6,869,083,404
純資産合計	6,869,083,404
負債純資産合計	6,890,125,891

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2023年 8月21日現在

1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 8月23日
期首元本額	2,730,736,332円
期中追加設定元本額	1,839,984,023円
期中一部解約元本額	850,086,102円
期末元本額	3,720,634,253円
期末元本の内訳	
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	827,169,759円
先進国株式ESGインデックス・オープン	34,294,193円
九州SDGs・グローバルバランス	405,301,392円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定型)	16,497,443円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定成長型)	270,038,850円
ラップ型ファンド・プラスESG(成長型)	673,425,531円
Smart-i 先進国株式ESGインデックス	1,493,907,085円

2. 計算日における受益権の総数	3,720,634,253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 (10,000口当たり純資産額)	1.8462円 (18,462円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2023年 8月21日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、株価変動リスク、リートの価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

金融商品の時価等に関する事項

2023年 8月21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)

2023年 8月21日現在	
該当事項はありません。	

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2023年 8月21日現在	
	損益に含まれた評価差額(円)	
株式	493,479,031	
投資証券	5,443,125	
合計	488,035,906	

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

2 デリバティブ取引に関する注記

(株式関連)

(2023年 8月21日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				

	買建	502,355,587	-	490,488,082	11,867,505
	合計	502,355,587	-	490,488,082	11,867,505

(注) 時価の算定方法

先物取引

外国先物取引について

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

(通貨関連)

(2023年 8月21日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	21,318,133	-	21,318,978	845
	米ドル	18,157,175	-	18,157,662	487
	ユーロ	3,160,958	-	3,161,316	358
	合計	21,318,133	-	21,318,978	845

(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	BAKER HUGHES COMPANY	1,724	35.26	60,788.24	
	CHENIERE ENERGY INC	409	163.90	67,035.10	
	HALLIBURTON CO	1,481	39.40	58,351.40	
	HF SINCLAIR CORP	270	57.61	15,554.70	
	KINDER MORGAN INC	3,479	17.43	60,638.97	
	MARATHON PETROLEUM CORP	745	144.62	107,741.90	
	ONEOK INC	769	65.60	50,446.40	
	PHILLIPS 66	776	114.24	88,650.24	
	SCHLUMBERGER LTD	2,354	58.03	136,602.62	
	TARGA RESOURCES CORP	372	84.75	31,527.00	
	VALERO ENERGY CORP	619	133.58	82,686.02	
	WILLIAMS COS INC	2,007	34.77	69,783.39	
	AMCOR PLC	2,580	9.57	24,690.60	

AVERY DENNISON CORP	133	177.15	23,560.95
BALL CORP	544	54.57	29,686.08
ECOLAB INC	423	179.35	75,865.05
INTERNATIONAL PAPER CO	545	34.51	18,807.95
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	440	63.69	28,023.60
LINDE PLC	817	375.10	306,456.70
LYONDELLBASELL INDU-CL A	434	97.39	42,267.26
MARTIN MARIETTA MATERIALS	107	431.17	46,135.19
NEWMONT CORP	1,366	38.20	52,181.20
NUCOR CORP	415	168.34	69,861.10
PPG INDUSTRIES INC	387	139.53	53,998.11
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	407	270.15	109,951.05
STEEL DYNAMICS INC	269	105.24	28,309.56
WESTROCK CO	414	32.11	13,293.54
3M CO	913	100.01	91,309.13
AECOM	231	86.89	20,071.59
ALLEGION PLC	139	107.63	14,960.57
AXON ENTERPRISE INC	113	200.10	22,611.30
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	227	134.14	30,449.78
CARRIER GLOBAL CORP	1,379	53.39	73,624.81
CATERPILLAR INC	859	273.80	235,194.20
CUMMINS INC	243	233.62	56,769.66
DOVER CORP	243	140.57	34,158.51
EATON CORP PLC	661	214.65	141,883.65
EMERSON ELECTRIC CO	960	95.79	91,958.40
FASTENAL CO	940	57.49	54,040.60
FERGUSON PLC	343	155.30	53,267.90
FORTIVE CORP	581	76.08	44,202.48
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS I	207	66.51	13,767.57
GENERAC HOLDINGS INC	101	113.35	11,448.35
GRACO INC	273	75.47	20,603.31
IDEX CORP	131	219.42	28,744.02
ILLINOIS TOOL WORKS	515	235.78	121,426.70
INGERSOLL-RAND INC	700	66.49	46,543.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	1,136	59.29	67,353.44
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	318	181.48	57,710.64
LENOX INTERNATIONAL INC	51	348.60	17,778.60
MASCO CORP	343	56.79	19,478.97
OTIS WORLDWIDE CORP	681	83.73	57,020.13
OWENS CORNING	152	136.37	20,728.24
PENTAIR PLC	260	66.60	17,316.00
QUANTA SERVICES INC	247	203.07	50,158.29
ROCKWELL AUTOMATION INC	189	291.54	55,101.06

TORO CO	183	98.28	17,985.24
TRANE TECHNOLOGIES PLC	378	196.95	74,447.10
UNITED RENTALS INC	120	451.41	54,169.20
MW GRAINGER INC	75	703.55	52,766.25
XYLEM INC	412	99.46	40,977.52
AUTOMATIC DATA PROCESSING	687	251.05	172,471.35
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	196	179.00	35,084.00
CERIDIAN HCM HOLDING INC	261	69.86	18,233.46
CINTAS CORP	154	485.44	74,757.76
CLARIVATE PLC	662	7.09	4,693.58
PAYCHEX INC	546	120.48	65,782.08
PAYLOCITY HOLDING CORP	74	191.49	14,170.26
ROBERT HALF INC	174	74.65	12,989.10
TRANSUNION	319	77.25	24,642.75
WASTE MANAGEMENT INC	688	158.87	109,302.56
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	196	94.99	18,618.04
CSX CORP	3,400	30.87	104,958.00
DELTA AIR LINES INC	259	41.49	10,745.91
EXPEDITORS INTL WASH INC	252	115.83	29,189.16
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	144	191.01	27,505.44
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	294	56.39	16,578.66
NORFOLK SOUTHERN CORP	386	212.11	81,874.46
OLD DOMINION FREIGHT LINE	162	393.49	63,745.38
UNION PACIFIC CORP	1,016	225.26	228,864.16
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	1,204	171.24	206,172.96
APTIV PLC	468	95.88	44,871.84
BORGWARNER INC	369	39.64	14,627.16
LEAR CORP	107	141.97	15,190.79
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	1,051	20.78	21,839.78
TESLA INC	4,762	215.49	1,026,163.38
DECKERS OUTDOOR CORP	44	557.29	24,520.76
HASBRO INC	208	63.76	13,262.08
LULULEMON ATHLETICA INC	192	381.29	73,207.68
NIKE INC -CL B	2,054	104.81	215,279.74
NVR INC	5	6,078.96	30,394.80
PULTEGROUP INC	375	79.30	29,737.50
VF CORP	592	20.01	11,845.92
WHIRLPOOL CORP	98	135.15	13,244.70
ARAMARK	420	36.70	15,414.00
BOOKING HOLDINGS INC	63	3,058.43	192,681.09
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	436	150.80	65,748.80
MCDONALD'S CORP	1,216	281.74	342,595.84
VAIL RESORTS INC	63	224.91	14,169.33

YUM! BRANDS INC	472	129.12	60,944.64
ALPHABET INC-CL A	9,953	127.46	1,268,609.38
ALPHABET INC-CL C	8,969	128.11	1,149,018.59
COMCAST CORP-CLASS A	7,012	45.76	320,869.12
ELECTRONIC ARTS INC	453	118.36	53,617.08
FOX CORP - CLASS A	509	33.45	17,026.05
FOX CORP- CLASS B	235	31.29	7,353.15
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	673	32.35	21,771.55
OMNICOM GROUP	337	79.91	26,929.67
SIRIUS XM HOLDINGS INC	1,044	4.49	4,687.56
SNAP INC - A	1,641	9.18	15,064.38
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	290	137.46	39,863.40
WALT DISNEY CO/THE	3,045	85.96	261,748.20
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	427	17.43	7,442.61
ADVANCE AUTO PARTS INC	96	69.83	6,703.68
AUTOZONE INC	31	2,458.39	76,210.09
BEST BUY CO INC	350	78.59	27,506.50
BURLINGTON STORES INC	113	172.23	19,461.99
CARMAX INC	255	82.49	21,034.95
EBAY INC	935	42.99	40,195.65
GENUINE PARTS CO	243	154.87	37,633.41
HOME DEPOT INC	1,689	327.37	552,927.93
LKQ CORP	439	52.39	22,999.21
LOWE'S COS INC	993	219.35	217,814.55
MERCADOLIBRE INC	75	1,199.59	89,969.25
POOL CORP	68	349.49	23,765.32
TJX COMPANIES INC	1,916	89.52	171,520.32
TRACTOR SUPPLY COMPANY	190	219.32	41,670.80
ULTA BEAUTY INC	82	452.93	37,140.26
KROGER CO	1,173	47.57	55,799.61
TARGET CORP	761	131.21	99,850.81
BUNGE LTD	264	112.53	29,707.92
CAMPBELL SOUP CO	348	42.83	14,904.84
COCA-COLA CO/THE	6,852	60.95	417,629.40
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	327	62.57	20,460.39
CONAGRA BRANDS INC	839	30.19	25,329.41
DARLING INGREDIENTS INC	292	63.83	18,638.36
GENERAL MILLS INC	969	70.21	68,033.49
HORMEL FOODS CORP	532	39.29	20,902.28
JM SMUCKER CO/THE	180	142.05	25,569.00
KELLOGG CO	463	61.85	28,636.55
KEURIG DR PEPPER INC	1,548	33.75	52,245.00
LAMB WESTON HOLDINGS INC	246	94.75	23,308.50

MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	406	84.97	34,497.82
PEPSICO INC	2,296	178.18	409,101.28
CHURCH & DWIGHT CO INC	407	93.09	37,887.63
CLOROX COMPANY	212	153.85	32,616.20
COLGATE-PALMOLIVE CO	1,313	74.55	97,884.15
KIMBERLY-CLARK CORP	559	128.24	71,686.16
PROCTER & GAMBLE CO/THE	3,938	152.54	600,702.52
ALIGN TECHNOLOGY INC	118	350.36	41,342.48
AMERISOURCEBERGEN CORP	289	180.40	52,135.60
CIGNA GROUP/THE	492	276.01	135,796.92
COOPER COS INC/THE	82	368.96	30,254.72
DAVITA INC	97	101.56	9,851.32
DENTSPLY SIRONA INC	353	37.30	13,166.90
DEXCOM INC	638	106.05	67,659.90
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	1,024	76.58	78,417.92
ELEVANCE HEALTH INC	394	462.78	182,335.32
HCA HEALTHCARE INC	352	269.04	94,702.08
HOLOGIC INC	425	73.15	31,088.75
HUMANA INC	212	490.39	103,962.68
IDEXX LABORATORIES INC	136	483.73	65,787.28
INSULET CORP	120	205.10	24,612.60
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	153	214.43	32,807.79
MOLINA HEALTHCARE INC	96	314.23	30,166.08
QUEST DIAGNOSTICS INC	197	133.50	26,299.50
STERIS PLC	160	223.87	35,819.20
TELEFLEX INC	84	217.61	18,279.24
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	352	119.18	41,951.36
AGILENT TECHNOLOGIES INC	506	119.25	60,340.50
AMGEN INC	888	261.82	232,496.16
AVANTOR INC	1,116	21.43	23,915.88
BIO-TECHNE CORP	270	78.24	21,124.80
BIOGEN INC	247	261.15	64,504.05
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	3,500	62.06	217,210.00
DANAHER CORP	1,153	251.41	289,875.73
ELI LILLY & CO	1,348	546.43	736,587.64
GILEAD SCIENCES INC	2,074	75.88	157,375.12
ILLUMINA INC	270	167.22	45,149.40
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	97	138.47	13,431.59
JOHNSON & JOHNSON	4,336	172.49	747,916.64
MERCK & CO. INC.	4,232	109.20	462,134.40
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	38	1,184.68	45,017.84
REPLIGEN CORP	94	157.80	14,833.20
WATERS CORP	102	270.00	27,540.00

WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	127	387.77	49,246.79
ZOETIS INC	767	181.57	139,264.19
CITIZENS FINANCIAL GROUP	844	27.71	23,387.24
HUNTINGTON BANCSHARES INC	2,472	11.14	27,538.08
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	659	123.20	81,188.80
REGIONS FINANCIAL CORP	1,601	19.54	31,283.54
TRUIST FINANCIAL CORP	2,187	28.78	62,941.86
US BANCORP	2,588	36.84	95,341.92
WEBSTER FINANCIAL CORP	281	41.86	11,762.66
ALLY FINANCIAL INC	438	27.23	11,926.74
AMERICAN EXPRESS CO	1,054	160.23	168,882.42
AMERIPRISE FINANCIAL INC	174	332.37	57,832.38
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	1,322	44.02	58,194.44
BLACKROCK INC	250	670.25	167,562.50
CBOE GLOBAL MARKETS INC	184	150.12	27,622.08
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	437	93.34	40,789.58
EQUITABLE HOLDINGS INC	593	27.55	16,337.15
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	66	429.40	28,340.40
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	999	55.39	55,334.61
FISERV INC	1,056	120.08	126,804.48
FRANKLIN RESOURCES INC	483	26.26	12,683.58
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	931	113.75	105,901.25
INVESCO LTD	468	15.24	7,132.32
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	138	225.11	31,065.18
MARKETAXESS HOLDINGS INC	59	248.20	14,643.80
MASTERCARD INC-CLASS A	1,421	392.17	557,273.57
MOODY'S CORP	274	327.02	89,603.48
MORGAN STANLEY	2,090	84.89	177,420.10
NASDAQ INC	595	51.80	30,821.00
NORTHERN TRUST CORP	343	76.74	26,321.82
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	335	105.10	35,208.50
S&P GLOBAL INC	547	382.00	208,954.00
SCHWAB (CHARLES) CORP	2,502	59.52	148,919.04
STATE STREET CORP	566	67.95	38,459.70
SYNCHRONY FINANCIAL	732	33.17	24,280.44
T ROWE PRICE GROUP INC	386	107.61	41,537.46
VISA INC-CLASS A SHARES	2,713	238.17	646,155.21
AFLAC INC	956	74.85	71,556.60
ALLSTATE CORP	430	106.19	45,661.70
ARCH CAPITAL GROUP LTD	634	75.24	47,702.16
ASSURANT INC	86	140.71	12,101.06
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	507	71.82	36,412.74
MARSH & MCLENNAN COS	821	188.84	155,037.64

PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	420	76.47	32,117.40
PROGRESSIVE CORP	970	133.93	129,912.10
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	631	92.80	58,556.80
TRAVELERS COS INC/THE	387	162.47	62,875.89
WILLIS TOWERS WATSON PLC	173	198.94	34,416.62
ACCENTURE PLC-CL A	1,053	302.94	318,995.82
ADOBE INC	765	508.13	388,719.45
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	261	100.90	26,334.90
ANSYS INC	150	292.59	43,888.50
AUTODESK INC	355	199.68	70,886.40
BLACK KNIGHT INC	282	74.40	20,980.80
CADENCE DESIGN SYS INC	453	220.55	99,909.15
DOCUSIGN INC	362	48.28	17,477.36
FAIR ISAAC CORP	42	846.13	35,537.46
GARTNER INC	133	328.15	43,643.95
GEN DIGITAL INC	910	20.37	18,536.70
HUBSPOT INC	79	504.93	39,889.47
INTL BUSINESS MACHINES CORP	1,510	141.41	213,529.10
INTUIT INC	467	485.96	226,943.32
MICROSOFT CORP	11,815	316.48	3,739,211.20
PTC INC	187	139.93	26,166.91
SALESFORCE INC	1,667	204.83	341,451.61
SERVICENOW INC	339	541.50	183,568.50
SPLUNK INC	256	97.49	24,957.44
SYNOPSYS INC	258	426.02	109,913.16
TWILIO INC - A	319	59.31	18,919.89
VMWARE INC-CLASS A	397	154.87	61,483.39
WORKDAY INC-CLASS A	345	224.42	77,424.90
ZSCALER INC	144	136.21	19,614.24
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	2,210	17.00	37,570.00
HP INC	1,494	31.06	46,403.64
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	290	129.37	37,517.30
NETAPP INC	357	75.31	26,885.67
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	309	64.35	19,884.15
TRIMBLE INC	424	52.78	22,378.72
WESTERN DIGITAL CORP	499	39.74	19,830.26
LIBERTY GLOBAL PLC-A	277	17.67	4,894.59
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	457	18.91	8,641.87
VERIZON COMMUNICATIONS INC	6,992	33.18	231,994.56
AMERICAN WATER WORKS CO INC	334	138.96	46,412.64
ATMOS ENERGY CORP	246	116.96	28,772.16
CMS ENERGY CORP	486	56.93	27,667.98
CONSOLIDATED EDISON INC	584	89.32	52,162.88

	EDISON INTERNATIONAL	661	69.04	45,635.44
	ESSENTIAL UTILITIES INC	399	37.51	14,966.49
	EVERSOURCE ENERGY	603	64.47	38,875.41
	EXELON CORP	1,641	40.01	65,656.41
	SEMPRA	520	141.43	73,543.60
	UGI CORP	330	23.22	7,662.60
	APPLIED MATERIALS INC	1,408	142.66	200,865.28
	INTEL CORP	6,953	32.75	227,710.75
	LAM RESEARCH CORP	225	652.94	146,911.50
	MARVELL TECHNOLOGY INC	1,451	57.59	83,563.09
	NVIDIA CORP	4,126	432.99	1,786,516.74
	NXP SEMICONDUCTORS NV	443	196.57	87,080.51
	TEXAS INSTRUMENTS INC	1,513	166.49	251,899.37
	CBRE GROUP INC - A	513	82.29	42,214.77
	米ドル 小計	251,683		32,167,290.61 (4,674,872,344)
カナダドル	CAMECO CORP	679	46.95	31,879.05
	ENBRIDGE INC	3,353	47.25	158,429.25
	KEYERA CORP	324	32.72	10,601.28
	PARKLAND CORP	182	36.46	6,635.72
	PEMBINA PIPELINE CORP	957	41.50	39,715.50
	AGNICO EAGLE MINES LTD	790	62.62	49,469.80
	IVANHOE MINES LTD-CL A	1,023	11.57	11,836.11
	KINROSS GOLD CORP	2,391	6.26	14,967.66
	LUNDIN MINING CORP	1,264	9.77	12,349.28
	NUTRIEN LTD	836	83.27	69,613.72
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	104	104.17	10,833.68
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	785	55.56	43,614.60
	CAE INC	528	32.07	16,932.96
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	137	110.17	15,093.29
	RB GLOBAL INC	282	76.69	21,626.58
	THOMSON REUTERS CORP	281	171.44	48,174.64
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	941	153.95	144,866.95
	MAGNA INTERNATIONAL INC	476	75.36	35,871.36
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	337	40.50	13,648.50
	CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	92	155.57	14,312.44
	DOLLARAMA INC	474	86.38	40,944.12
	ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	1,318	69.50	91,601.00
	METRO INC	388	70.20	27,237.60
	BANK OF MONTREAL	1,200	113.26	135,912.00
	BANK OF NOVA SCOTIA	1,967	62.42	122,780.14
	NATIONAL BANK OF CANADA	579	100.33	58,091.07
	TORONTO-DOMINION BANK	3,025	83.93	253,888.25

	BROOKFIELD CORP	2,335	44.83	104,678.05
	INTACT FINANCIAL CORP	302	195.50	59,041.00
	SUN LIFE FINANCIAL INC	975	64.51	62,897.25
	OPEN TEXT CORP	437	50.02	21,858.74
	SHOPIFY INC - CLASS A	1,986	71.98	142,952.28
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	618	53.55	33,093.90
	TELUS CORP	717	22.83	16,369.11
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	1,266	9.76	12,356.16
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	204	38.13	7,778.52
	FORTIS INC	838	53.71	45,008.98
	HYDRO ONE LTD	509	36.73	18,695.57
	FIRSTSERVICE CORP	67	198.61	13,306.87
	カナダドル 小計	34,967		2,038,962.98 (218,841,896)
ユーロ	GALP ENERGIA SGPS SA	947	12.31	11,662.30
	NESTE OYJ	739	32.19	23,788.41
	OMV AG	239	41.98	10,033.22
	REPSOL SA	2,213	13.86	30,672.18
	TENARIS SA	798	15.27	12,189.45
	TOTALENERGIES SE	3,937	57.01	224,448.37
	AKZO NOBEL	280	74.02	20,725.60
	COVESTRO AG	348	47.90	16,669.20
	CRH PLC	1,246	51.76	64,492.96
	DSM-FIRMENICH AG	304	83.11	25,265.44
	EVONIK INDUSTRIES AG	352	17.62	6,204.00
	HEIDELBERG MATERIALS AG	228	76.32	17,400.96
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	389	35.59	13,844.51
	STORA ENSO OYJ-R SHS	932	10.70	9,977.06
	SYMRISE AG	210	88.52	18,589.20
	UMICORE	377	23.53	8,870.81
	UPM-KYMMENE OYJ	938	29.09	27,286.42
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	375	31.30	11,737.50
	BOUYGUES SA	366	31.20	11,419.20
	BRENTAG SE	249	71.58	17,823.42
	CNH INDUSTRIAL NV	1,795	11.97	21,486.15
	EIFFAGE	135	90.18	12,174.30
	GEA GROUP AG	292	35.26	10,295.92
	KINGSPAN GROUP PLC	247	73.22	18,085.34
	KNORR-BREMSE AG	129	62.64	8,080.56
	METSO CORPORATION	1,125	10.08	11,345.62
	PRYSMIAN SPA	411	34.54	14,195.94
	SCHNEIDER ELECTRIC SE	902	154.32	139,196.64
	WARTSILA OYJ ABP	698	10.78	7,527.93

TELEPERFORMANCE	104	115.60	12,022.40
WOLTERS KLUWER	420	109.10	45,822.00
ADP	49	117.60	5,762.40
DEUTSCHE GROUP AG	1,711	42.90	73,410.45
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	1,009	8.45	8,535.13
GETLINK	682	14.87	10,144.75
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	548	98.25	53,841.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	93	90.65	8,430.45
MICHELIN(CGDE)	1,183	28.47	33,680.01
VALEO SA	298	17.93	5,343.14
ADIDAS AG	267	183.60	49,021.20
HERMES INTERNATIONAL	53	1,862.60	98,717.80
KERING	123	492.60	60,589.80
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	461	776.90	358,150.90
MONCLER SPA	342	62.46	21,361.32
PUMA SE	201	62.28	12,518.28
AMADEUS IT GROUP SA	760	61.52	46,755.20
JUST EAT TAKEAWAY	406	13.11	5,323.47
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	1,368	23.02	31,491.36
PROSUS NV	1,325	63.79	84,521.75
ZALANDO SE	359	26.46	9,499.14
CARREFOUR SA	1,051	18.11	19,038.86
HELLOFRESH SE	235	25.90	6,086.50
JERONIMO MARTINS	453	23.36	10,582.08
KESKO OYJ-B SHS	438	17.25	7,555.50
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N.V.	1,633	30.53	49,863.65
DANONE	1,057	53.19	56,221.83
JDE PEET'S BV	101	26.90	2,716.90
KERRY GROUP PLC-A	284	84.36	23,958.24
BEIERSDORF AG	178	119.50	21,271.00
HENKEL AG & CO KGAA	164	64.02	10,499.28
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	286	71.98	20,586.28
L'OREAL	401	398.20	159,678.20
MERCK KGAA	225	159.05	35,786.25
BNP PARIBAS	1,840	58.22	107,124.80
COMMERZBANK AG	1,725	10.05	17,344.87
CREDIT AGRICOLE SA	2,015	11.33	22,829.95
FINECOBANK SPA	1,099	12.51	13,748.49
ING GROEP NV-CVA	6,116	12.92	79,030.95
KBC GROEP NV	424	62.20	26,372.80
MEDIOBANCA SPA	1,012	11.63	11,769.56
SOCIETE GENERALE SA	1,215	25.30	30,745.57
DEUTSCHE BOERSE AG	314	162.95	51,166.30

	NEXI SPA	1,129	6.61	7,464.94
	WORLDLINE SA	381	30.35	11,563.35
	ASSICURAZIONI GENERALI	1,662	18.40	30,589.11
	AXA SA	3,085	27.17	83,834.87
	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	236	355.30	83,850.80
	NN GROUP NV	453	34.11	15,451.83
	POSTE ITALIANE SPA	774	9.95	7,702.84
	DASSAULT SYSTEMES SE	1,125	35.75	40,224.37
	NOKIA OYJ	8,850	3.50	31,005.97
	ELISA OYJ	226	45.62	10,310.12
	KONINKLIJKE KPN NV	5,834	3.23	18,855.48
	ORANGE	3,109	10.26	31,910.77
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	1,281	1.72	2,207.80
	ENEL SPA	13,391	5.92	79,328.28
	IBERDROLA SA	9,999	10.62	106,239.37
	NATURGY ENERGY GROUP SA	198	25.44	5,037.12
	REDEIA CORP SA	644	14.62	9,418.50
	TERNA SPA	2,313	7.23	16,722.99
	VERBUND AG	119	74.80	8,901.20
	ASML HOLDING NV	673	598.20	402,588.60
	STMICROELECTRONICS NV	1,151	42.15	48,514.65
	LEG IMMOBILIEN SE	106	58.68	6,220.08
	VONOVIA SE	1,200	19.75	23,700.00
	ユーロ 小計	113,168		3,726,051.46 (589,163,256)
英債券	ANGLO AMERICAN PLC	2,126	19.72	41,933.22
	ANTOFAGASTA PLC	654	13.75	8,995.77
	CRODA INTERNATIONAL PLC	227	52.06	11,817.62
	ENDEAVOUR MINING PLC	307	15.70	4,819.90
	JOHNSON MATTHEY PLC	257	15.99	4,110.71
	MONDI PLC	802	12.60	10,109.21
	ASHTED GROUP PLC	722	53.28	38,468.16
	DCC PLC	185	42.64	7,888.40
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	118	99.06	11,689.08
	INTERTEK GROUP PLC	263	40.55	10,664.65
	RELX PLC	3,208	24.81	79,590.48
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	1,858	4.33	8,056.28
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	180	39.91	7,183.80
	BURBERRY GROUP PLC	628	21.49	13,495.72
	TAYLOR WIMPEY PLC	5,889	1.12	6,631.01
	AUTO TRADER GROUP PLC	1,644	5.98	9,831.12
	INFORMA PLC	2,317	7.06	16,362.65
	WPP PLC	1,731	7.44	12,889.02

	KINGFISHER PLC	3,200	2.27	7,270.40
	OCADO GROUP PLC	775	7.61	5,897.75
	SAINSBURY (J) PLC	3,312	2.62	8,677.44
	TESCO PLC	11,922	2.49	29,769.23
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	564	19.60	11,054.40
	COCA-COLA HBC AG-DI	348	22.92	7,976.16
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	1,190	56.54	67,282.60
	UNILEVER PLC	4,211	39.80	167,597.80
	NMC HEALTH PLC	5	0.00	0.00
	ASTRAZENECA PLC	2,583	106.58	275,296.14
	HSBC HOLDINGS PLC	33,272	5.83	194,275.20
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	109,110	0.42	46,093.51
	3I GROUP PLC	1,625	18.88	30,680.00
	ABRDN PLC	3,791	1.61	6,137.62
	SCHRODERS PLC	1,456	4.04	5,893.88
	ST JAMES'S PLACE PLC	1,011	8.58	8,676.40
	ADMIRAL GROUP PLC	365	23.61	8,617.65
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	10,341	2.18	22,595.08
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	1,289	5.08	6,550.69
	PRUDENTIAL PLC	4,530	9.47	42,899.10
	SAGE GROUP PLC/THE	1,812	9.43	17,094.40
	BT GROUP PLC	12,272	1.12	13,799.86
	VODAFONE GROUP PLC	38,026	0.70	26,960.43
	NATIONAL GRID PLC	6,089	9.51	57,930.74
	英ポンド 小計	276,215		1,373,563.28 (254,493,804)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	406	13.53	5,493.18
	GIVAUDAN-REG	15	2,751.00	41,265.00
	SIG GROUP AG	540	21.84	11,793.60
	SIKA AG-REG	241	247.50	59,647.50
	ABB LTD-REG	2,610	32.57	85,007.70
	GEBERIT AG-REG	56	442.80	24,796.80
	VAT GROUP AG	47	344.60	16,196.20
	SGS SA-REG	241	80.58	19,419.78
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	96	269.00	25,824.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	3	10,340.00	31,020.00
	SONOVA HOLDING AG-REG	91	230.80	21,002.80
	LONZA GROUP AG-REG	123	471.90	58,043.70
	NOVARTIS AG-REG	3,417	89.39	305,445.63
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	54	95.35	5,148.90
	JULIUS BAER GROUP LTD	354	58.84	20,829.36
	BALOISE HOLDING AG - REG	79	134.20	10,601.80
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	53	536.80	28,450.40

	SWISS RE AG	521	83.88	43,701.48	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	253	405.70	102,642.10	
	TEMENOS GROUP AG-REG	107	68.32	7,310.24	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	293	58.16	17,040.88	
	SWISSCOM AG-REG	43	528.40	22,721.20	
	スイスフラン 小計	9,643		963,402.25 (158,816,860)	
スウェーデンク ローナ	BOLIDEN AB	435	283.80	123,453.00	
	HOLMEN AB-B SHARES	114	394.50	44,973.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	984	136.80	134,611.20	
	ALFA LAVAL AB	480	367.70	176,496.00	
	ASSA ABLOY AB-B	1,639	239.10	391,884.90	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	4,475	140.30	627,842.50	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	2,536	122.30	310,152.80	
	BEIJER REF AB	572	125.30	71,671.60	
	EPIROC AB-A	1,182	203.10	240,064.20	
	EPIROC AB-B	610	173.00	105,530.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	588	93.10	54,742.80	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	2,675	78.88	211,004.00	
	SANDVIK AB	1,870	202.40	378,488.00	
	SKF AB-B SHARES	646	180.60	116,667.60	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	1,039	164.86	171,289.54	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	1,062	261.10	277,288.20	
	NORDEA BANK ABP	5,409	119.82	648,106.38	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	2,340	91.78	214,765.20	
	EQT AB	595	224.50	133,577.50	
KINNEVIK AB - B	456	125.95	57,433.20		
TELE2 AB-B SHS	1,080	76.78	82,922.40		
TELIA CO AB	4,305	21.32	91,782.60		
	スウェーデンクローナ 小計	35,092		4,664,746.62 (61,807,892)	
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	498	283.50	141,183.00	
	EQUINOR ASA	1,569	321.80	504,904.20	
	NORSK HYDRO ASA	2,253	59.22	133,422.66	
	MOWI ASA	709	181.65	128,789.85	
	ORKLA ASA	1,575	80.20	126,315.00	
	SALMAR ASA	139	474.00	65,886.00	
	DNB BANK ASA	1,638	209.40	342,997.20	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	244	156.60	38,210.40	
	TELENOR ASA	1,123	109.30	122,743.90	
	ノルウェークローネ 小計	9,748		1,604,452.21 (21,932,861)	
デンマークク	CHR HANSEN HOLDING A/S	170	452.50	76,925.00	

ローネ	NOVOZYMES A/S-B SHARES	367	300.00	110,100.00
	ROCKWOOL A/S-B SHS	17	1,694.00	28,798.00
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	1,657	156.38	259,121.66
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	5	13,040.00	65,200.00
	AP MOELLER-MAERSK A/S-B	8	13,355.00	106,840.00
	DSV A/S	314	1,307.50	410,555.00
	PANDORA A/S	147	699.80	102,870.60
	COLOPLAST-B	188	800.00	150,400.00
	GENMAB A/S	114	2,455.00	279,870.00
	NOVO NORDISK A/S-B	2,760	1,251.20	3,453,312.00
	ORSTED A/S	307	530.80	162,955.60
デンマーククローネ 小計		6,054		5,206,947.86 (110,491,433)
オーストラリア ドル	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	3,134	38.40	120,345.60
	BLUESCOPE STEEL LTD	782	20.56	16,077.92
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	2,765	20.33	56,212.45
	IGO LTD	1,162	12.35	14,350.70
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	716	45.20	32,363.20
	MINERAL RESOURCES LTD	272	63.37	17,236.64
	NEWCREST MINING LTD	1,569	24.99	39,209.31
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	1,919	10.36	19,880.84
	ORICA LTD	891	15.27	13,605.57
	PILBARA MINERALS LTD	4,599	4.73	21,753.27
	BRAMBLES LTD	2,449	14.07	34,457.43
	COMPUTERSHARE LTD	874	24.72	21,605.28
	AURIZON HOLDINGS LTD	2,643	3.71	9,805.53
	TRANSURBAN GROUP	5,068	13.17	66,745.56
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	1,039	40.20	41,767.80
	IDP EDUCATION LTD	356	22.58	8,038.48
	REA GROUP LTD	103	159.29	16,406.87
	SEEK LTD	653	23.51	15,352.03
	COLES GROUP LTD	2,355	17.30	40,741.50
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	2,324	5.57	12,944.68
	COCHLEAR LTD	105	261.70	27,478.50
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	306	55.72	17,050.32
	SONIC HEALTHCARE LTD	726	32.57	23,645.82
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	4,959	24.49	121,445.91
	ASX LTD	312	59.02	18,414.24
	MACQUARIE GROUP LTD	610	168.80	102,968.00
QBE INSURANCE GROUP LTD	2,584	14.99	38,734.16	
SUNCORP GROUP LTD	1,985	13.25	26,301.25	
XERO LTD	222	114.29	25,372.38	
TELSTRA GROUP LTD	6,669	4.00	26,676.00	

	APA GROUP	1,923	9.31	17,903.13	
	LENDLEASE GROUP	954	7.96	7,593.84	
	オーストラリアドル 小計	57,028		1,072,484.21 (99,955,528)	
ニュージーランドドル	EBOS GROUP LTD	262	34.59	9,062.58	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	2,779	5.08	14,117.32	
	MERCURY NZ LTD	826	6.59	5,443.34	
	MERIDIAN ENERGY LTD	2,181	5.38	11,744.68	
	ニュージーランドドル 小計	6,048		40,367.92 (3,476,485)	
香港ドル	MTR CORP	2,523	32.90	83,006.70	
	WH GROUP LTD	17,000	3.92	66,640.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	5,742	21.60	124,027.20	
	HANG SENG BANK LTD	1,261	102.00	128,622.00	
	AIA GROUP LTD	19,400	69.65	1,351,210.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	7,289	8.56	62,393.84	
	HONG KONG & CHINA GAS	20,079	5.87	117,863.73	
	SINO LAND CO	6,000	8.89	53,340.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	672	63.20	42,470.40	
	SWIRE PROPERTIES LTD	1,804	17.42	31,425.68	
	香港ドル 小計	81,770		2,060,999.55 (38,252,151)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	2,509	6.68	16,760.12	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	2,100	27.93	58,653.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	1,380	9.55	13,179.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	4,405	3.08	13,567.40	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	968	6.62	6,408.16	
	シンガポールドル 小計	11,362		108,567.68 (11,627,598)	
イスラエルシュケル	BANK LEUMI LE-ISRAEL	2,644	29.27	77,389.88	
	イスラエルシュケル 小計	2,644		77,389.88 (2,961,463)	
	合 計	895,422		6,246,693,571 (6,246,693,571)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額（単位：円）であります。

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

(2) 株式以外の有価証券

種 類	通貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	AMERICAN TOWER CORP	774	136,572.30	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	755	14,420.50	
		BOSTON PROPERTIES INC	235	14,875.50	
		CROWN CASTLE INC	717	71,864.91	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	487	59,092.58	

	EQUINIX INC	155	116,214.35	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	940	18,884.60	
	IRON MOUNTAIN INC	480	28,372.80	
	PROLOGIS INC	1,536	186,577.92	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	187	41,609.37	
	WELLTOWER INC	815	66,178.00	
	WEYERHAEUSER CO	1,275	41,182.50	
	米ドル 小計	8,356	795,845.33 (115,660,201)	
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	115	5,616.60	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	292	5,600.56	
	カナダドル 小計	407	11,217.16 (1,203,937)	
ユーロ	GECINA SA	65	6,038.50	
	KLEPIERRE	368	8,688.48	
	ユーロ 小計	433	14,726.98 (2,328,630)	
英ポンド	SEGRO PLC	2,149	15,107.47	
	英ポンド 小計	2,149	15,107.47 (2,799,112)	
オーストラリアドル	DEXUS/AU	2,103	16,277.22	
	GOODMAN GROUP	2,959	66,281.60	
	GPT GROUP	3,278	13,538.14	
	MIRVAC GROUP	6,751	15,999.87	
	SCENTRE GROUP	8,253	21,787.92	
	STOCKLAND	4,073	16,780.76	
	VICINITY CENTRES	7,638	14,092.11	
	オーストラリアドル 小計	35,055	164,757.62 (15,355,410)	
シンガポールドル	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	8,592	16,324.80	
	シンガポールドル 小計	8,592	16,324.80 (1,748,386)	
	合計		139,095,676 (139,095,676)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式 285銘柄	97.6%		73.3%
	投資証券 12銘柄		2.4%	1.8%
カナダドル	株式 39銘柄	99.5%		3.4%
	投資証券 2銘柄		0.5%	0.0%

ユーロ	株式	95銘柄	99.6%		9.3%
	投資証券	2銘柄		0.4%	0.0%
英ポンド	株式	42銘柄	98.9%		4.0%
	投資証券	1銘柄		1.1%	0.0%
スイスフラン	株式	22銘柄	100.0%		2.5%
スウェーデンクローナ	株式	22銘柄	100.0%		1.0%
ノルウェークローネ	株式	9銘柄	100.0%		0.3%
デンマーククローネ	株式	12銘柄	100.0%		1.7%
オーストラリアドル	株式	32銘柄	86.7%		1.6%
	投資証券	7銘柄		13.3%	0.2%
ニュージーランドドル	株式	4銘柄	100.0%		0.1%
香港ドル	株式	10銘柄	100.0%		0.6%
シンガポールドル	株式	5銘柄	86.9%		0.2%
	投資証券	1銘柄		13.1%	0.0%
イスラエルシェケル	株式	1銘柄	100.0%		0.0%

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

R M新興国株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2023年 8月21日現在

資産の部	
流動資産	
預金	1,395,212,155
コール・ローン	14,376,214
株式	25,045,138,836
投資証券	28,429,616
派生商品評価勘定	4,460
未収入金	1,064,853
未収配当金	76,048,889
差入委託証拠金	507,957,317
流動資産合計	27,068,232,340
資産合計	27,068,232,340
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	102,803,611
未払解約金	3,380,600
未払利息	38
流動負債合計	106,184,249
負債合計	106,184,249
純資産の部	
元本等	
元本	15,820,968,450
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	11,141,079,641
元本等合計	26,962,048,091
純資産合計	26,962,048,091

2023年 8月21日現在

負債純資産合計

27,068,232,340

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2023年 8月21日現在

1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 8月23日
期首元本額	12,154,895,161円
期中追加設定元本額	7,302,171,862円
期中一部解約元本額	3,636,098,573円
期末元本額	15,820,968,450円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	593,839,711円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	2,327,815,018円
りそなラップ型ファンド(成長型)	2,191,806,135円
DCりそな グローバルバランス	15,945,764円
つみたてバランスファンド	1,041,667,171円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	459,372,542円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	334,676,834円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	231,432,127円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	119,069,086円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	81,209,500円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	45,288,945円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	94,231,378円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	152,927,309円
九州SDGs・グローバルバランス	81,159,555円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定型)	2,509,750円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定成長型)	56,238,465円
ラップ型ファンド・プラスESG(成長型)	121,582,545円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定型)	6,742,827円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定成長型)	20,380,550円
りそな つみたてラップ型ファンド(成長型)	22,943,933円
りそな つみたてリスクコントロールファンド	1,028,738円
ターゲットリターンバランスファンド(目標2%)	14,073円
ターゲットリターンバランスファンド(目標3%)	29,997円
ターゲットリターンバランスファンド(目標4%)	60,302円
ターゲットリターンバランスファンド(目標5%)	99,584円
ターゲットリターンバランスファンド(目標6%)	212,349円

りそなターゲット・イヤー・ファンド2065	56,688円
FWりそな先進国+新興国株式アクティブファンド	82,798,208円
FWりそな新興国株式インデックスファンド	3,923,237,749円
Smart-i 新興国株式インデックス	2,607,606,934円
Smart-i 8資産バランス 安定型	115,443,902円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	375,155,001円
Smart-i 8資産バランス 成長型	498,397,757円
Smart-i Select 全世界株式インデックス	50,780,892円
Smart-i Select 全世界株式インデックス（除く日本）	30,033,024円
りそなVIグローバル・バランスファンド（安定型）（適格機関投資家専用）	2,945,048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）	16,808,699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）	70,800,747円
りそなFT マルチアセットファンド（適格機関投資家専用）	25,226,638円
りそなDAAマルチアセットファンド（適格機関投資家専用）	19,392,975円
2. 計算日における受益権の総数	15,820,968,450口
3. 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.7042円
(10,000口当たり純資産額)	(17,042円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2023年 8月21日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、株価変動リスク、リートの価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

金融商品の時価等に関する事項

2023年 8月21日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	株式、投資証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 デリバティブ取引 (その他の注記)の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

2023年 8月21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

	2023年 8月21日現在
--	---------------

種類	損益に含まれた評価差額（円）
株式	905,721,821
投資証券	2,929,259
合計	908,651,080

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

2 デリバティブ取引に関する注記

(株式関連)

(2023年 8月21日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 買建	1,989,999,330	-	1,887,204,514	102,794,816
	合計	1,989,999,330	-	1,887,204,514	102,794,816

(注) 時価の算定方法

先物取引

外国先物取引について

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

(通貨関連)

(2023年 8月21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	5,792,777	-	5,784,518	8,259
	米ドル	5,792,777	-	5,784,518	8,259
	売建	5,792,777	-	5,788,853	3,924
	ブラジルリアル	5,694,024	-	5,689,860	4,164
	フィリピンペソ	57,944	-	58,389	445
	オフショア人民元	40,809	-	40,604	205
	合計	11,585,554	-	11,573,371	4,335

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	

米ドル	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	29,100	1.38	40,158.00
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	1,600	0.00	0.00
	SURGUTNEFTEGAS-SP ADR	13,769	0.00	0.00
	TATNEFT PAO-SPONSORED ADR	4,090	0.00	0.00
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	5,573	7.74	43,135.02
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	11,117	0.00	0.00
	NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR	2,773	0.00	0.00
	PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	2,330	0.00	0.00
	PHOSAGRO PJSC(BLOCKED)-GDR	15	0.00	0.00
	POLYUS PJSC-REG S-GDR	1,288	0.00	0.00
	SEVERSTAL - GDR REG S	3,862	0.00	0.00
	SOUTHERN COPPER CORP	2,307	77.25	178,215.75
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	11,187	24.12	269,830.44
	NIO INC - ADR	36,208	10.67	386,339.36
	H WORLD GROUP LTD	5,136	43.92	225,573.12
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	11,675	6.67	77,872.25
	YUM CHINA HOLDINGS INC	11,085	52.76	584,844.60
	AUTOHOME INC-ADR	2,118	30.60	64,810.80
	IQIYI INC-ADR	11,203	5.24	58,703.72
	JOYY INC	1,098	31.96	35,092.08
	KANZHUN LTD	4,502	14.71	66,224.42
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	19,111	6.53	124,794.83
	VK CO LTD	2,211	0.00	0.00
	WEIBO CORP-SPON ADR	1,731	12.65	21,897.15
	MINISO GROUP HOLDING LTD-ADR	2,291	20.15	46,163.65
	PDD HOLDINGS INC	13,382	76.98	1,030,146.36
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	9,598	14.93	143,298.14
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	1	0.00	0.00
	X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	2,296	0.00	0.00
	LEGEND BIOTECH CORP-ADR	1,616	66.36	107,237.76
	COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	105,788	1.20	127,580.32
	CREDICORP LTD	1,808	138.80	250,950.40
	TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	2,188	0.00	0.00
LUFAX HOLDING LTD-ADR	16,257	1.30	21,134.10	
QIFU TECHNOLOGY INC	3,164	15.96	50,497.44	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	14,388	2.37	34,142.72	
DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	1,554	35.14	54,607.56	
KE HOLDINGS INC	17,711	14.76	261,414.36	
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	31,080	0.57	17,964.24	
	米ドル 小計	418,211		4,322,628.59 (628,207,612)
メキシコペソ	CEMEX SAB-CPO	385,000	13.26	5,105,100.00
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	83,000	81.44	6,759,520.00

	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	5,350	217.93	1,165,925.50
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	27,700	36.97	1,024,069.00
	ALFA S.A.B.-A	87,800	10.26	900,828.00
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	14,500	133.46	1,935,170.00
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	10,200	303.02	3,090,804.00
	GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	5,295	457.15	2,420,609.25
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	5,980	165.96	992,440.80
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	59,200	15.87	939,504.00
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	139,200	67.16	9,348,672.00
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	13,400	162.50	2,177,500.00
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	14,350	147.84	2,121,504.00
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	51,800	197.79	10,245,522.00
	GRUMA S.A.B.-B	5,455	282.61	1,541,637.55
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	33,400	88.75	2,964,250.00
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	40,200	38.25	1,537,650.00
	BANCO DEL BAJIO SA	22,200	52.02	1,154,844.00
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	69,000	145.17	10,016,730.00
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	54,000	36.97	1,996,380.00
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	830,200	16.61	13,789,622.00
	メキシコペソ 小計	1,957,230		81,228,282.10 (693,307,756)
ブラジルリアル	COSAN SA	34,500	18.01	621,345.00
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	99,000	34.49	3,414,510.00
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	126,500	31.52	3,987,280.00
	PRIO SA	19,700	45.17	889,849.00
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	20,900	18.30	382,470.00
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	17,000	12.22	207,740.00
	GERDAU SA-PREF	31,695	25.50	808,222.50
	KLABIN SA - UNIT	18,200	22.48	409,136.00
	SUZANO SA	21,307	50.68	1,079,838.76
	VALE SA	89,704	61.22	5,491,678.88
	WEG SA	45,000	36.26	1,631,700.00
	CCR SA	26,700	12.79	341,493.00
	LOCALIZA RENT A CAR	23,710	62.97	1,493,018.70
	RUMO SA	36,000	22.27	801,720.00
	LOJAS RENNER S.A.	23,620	17.36	410,043.20
	MAGAZINE LUIZA SA	86,300	3.00	258,900.00
	VIBRA ENERGIA SA	28,100	17.83	501,023.00
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	19,100	11.85	226,335.00
	RAIA DROGASIL SA	33,876	26.70	904,489.20
	SENDAS DISTRIBUIDORA SA	34,700	13.43	466,021.00
	AMBEV SA	126,400	14.36	1,815,104.00
	JBS SA	21,300	19.21	409,173.00

	NATURA &CO HOLDING SA	22,400	16.24	363,776.00	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	150,892	4.63	698,629.96	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	14,200	29.74	422,308.00	
	HYPERA SA	9,800	41.40	405,720.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	42,615	13.38	570,188.70	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	142,636	15.19	2,166,640.84	
	BANCO DO BRASIL S.A.	22,000	47.79	1,051,380.00	
	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	8,100	26.44	214,164.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	129,000	26.96	3,477,840.00	
	ITAUSA SA	129,170	9.37	1,210,322.90	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	153,300	13.66	2,094,078.00	
	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	32,400	30.70	994,680.00	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	18,600	29.88	555,768.00	
	TOTVS SA	12,700	27.92	354,584.00	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	11,000	42.63	468,930.00	
	TIM SA	24,000	14.90	357,600.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	7,100	38.14	270,794.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	30,800	34.65	1,067,220.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	34,434	12.01	413,552.34	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	8,100	59.84	484,704.00	
	CPFL ENERGIA SA	7,200	34.41	247,752.00	
	ENERGISA SA-UNITS	6,100	47.95	292,495.00	
	ENEVA SA	22,700	12.76	289,652.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	6,275	41.80	262,295.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	28,200	31.90	899,580.00	
	ブラジルリアル 小計	2,057,034		46,185,744.98 (1,350,037,037)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	9,594	6,400.00	61,401,600.00	
	EMPRESAS CMPC SA	33,869	1,620.00	54,867,780.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	3,822	55,096.00	210,576,912.00	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES	466,759	61.00	28,472,299.00	
	FALABELLA SA	21,259	2,179.90	46,342,494.10	
	CENCOSUD SA	35,890	1,820.00	65,319,800.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	3,292	6,644.00	21,872,048.00	
	BANCO DE CHILE	1,244,596	94.00	116,992,024.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	1,739	25,200.00	43,822,800.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	1,641,012	40.05	65,722,530.60	
	ENEL AMERICAS SA	517,290	101.95	52,737,715.50	
	ENEL CHILE SA	827,632	56.90	47,092,260.80	
	チリペソ 小計	4,806,754		815,220,264.00 (136,301,567)	
コロンビアペソ	BANCOLOMBIA SA	6,380	30,550.00	194,909,000.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	10,944	27,830.00	304,571,520.00	

	INTERCONEXION ELECTRICA SA	12,989	16,330.00	212,110,370.00	
	コロンビアペソ 小計	30,313		711,590,890.00 (25,087,848)	
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	1,474	21.64	31,897.36	
	MYTILINEOS S.A.	2,599	35.20	91,484.80	
	OPAP SA	4,870	15.07	73,390.90	
	JUMBO SA	2,974	27.06	80,476.44	
	ALPHA SERVICES AND HOLDINGS	65,690	1.44	94,593.60	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	74,565	1.50	111,884.78	
	NATIONAL BANK OF GREECE	14,028	6.20	86,973.60	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	4,849	14.33	69,486.17	
	PUBLIC POWER CORP	5,654	9.71	54,900.34	
	TERNA ENERGY SA	1,400	16.25	22,750.00	
	ユーロ 小計	178,103		717,837.99 (113,504,542)	
英ポンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	5,948	0.00	0.00	
	英ポンド 小計	5,948		0.00 (0)	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	27,711	127.00	3,519,297.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	34,746	41.90	1,455,857.40	
	HEKTAS TICARET T.A.S	35,672	26.26	936,746.72	
	KOZA ALTIN ISLETMELERI AS	25,931	25.70	666,426.70	
	SASA POLYESTER SANAYI	27,188	52.35	1,423,291.80	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	15,288	70.65	1,080,097.20	
	KOC HOLDING AS	18,208	135.00	2,458,080.00	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	37,427	49.44	1,850,390.88	
	PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS	1,253	899.90	1,127,574.70	
	TURK HAVA YOLLARI AO	14,261	251.40	3,585,215.40	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	1,780	892.70	1,589,006.00	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	3,208	277.90	891,503.20	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	11,198	235.00	2,631,530.00	
	AKBANK T.A.S.	83,796	28.66	2,401,593.36	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	30,648	58.50	1,792,908.00	
	TURKIYE IS BANKASI-C	90,125	16.61	1,496,976.25	
	YAPI VE KREDI BANKASI	92,810	15.90	1,475,679.00	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	31,132	51.70	1,609,524.40	
	トルコリラ 小計	582,382		31,991,698.01 (171,600,268)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	2,117	712.50	1,508,362.50	
	MONETA MONEY BANK AS	7,045	85.50	602,347.50	
	CEZ AS	4,323	946.50	4,091,719.50	
	チェココルナ 小計	13,485		6,202,429.50 (40,812,606)	

ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	11,609	2,652.00	30,787,068.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	3,960	9,230.00	36,550,800.00	
	OTP BANK PLC	6,308	14,100.00	88,942,800.00	
ハンガリーフォリント 小計		21,877		156,280,668.00 (64,711,136)	
ポーランドズロ チ	ORLEN SA	14,813	62.57	926,849.41	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	3,988	106.30	423,924.40	
	LPP SA	26	12,950.00	336,700.00	
	CD PROJEKT SA	1,602	154.00	246,708.00	
	CYFROWY POLSAT SA	8,679	14.19	123,198.40	
	ALLEGRO.EU SA	11,388	34.48	392,658.24	
	PEPCO GROUP NV	5,086	31.36	159,496.96	
	DINO POLSKA SA	1,364	396.20	540,416.80	
	BANK PEKAO SA	5,176	105.90	548,138.40	
	MBANK SA	290	419.50	121,655.00	
	PKO BANK POLSKI SA	22,290	36.77	819,603.30	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	977	370.40	361,880.80	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	15,971	39.23	626,542.33	
	PGE SA	29,021	8.88	257,822.56	
ポーランドズロチ 小計		120,671		5,885,594.60 (208,684,350)	
ロシアルーブル	GAZPROM PJSC	209,472	0.00	0.00	
	LUKOIL PJSC	7,345	0.00	0.00	
	ROSNEFT OIL CO PJSC	20,180	0.00	0.00	
	SURGUTNEFTEGAS-PREFERENCE	131,600	0.00	0.00	
	ALROSA PJSC	46,260	0.00	0.00	
	UNITED CO RUSAL INTERNATIONA	55,000	0.00	0.00	
	YANDEX NV-A	5,354	0.00	0.00	
	OZON HOLDINGS PLC - ADR	920	0.00	0.00	
	MAGNIT PJSC	1,334	0.00	0.00	
	SBERBANK OF RUSSIA PJSC	190,680	0.00	0.00	
	VTB BANK PJSC	65,736,000	0.00	0.00	
	MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ	22,980	0.00	0.00	
	MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JO	16,768	0.00	0.00	
	INTER RAO UES PJSC	725,000	0.00	0.00	
ロシアルーブル 小計		67,168,893		0.00 (0)	
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO-H	58,000	5.47	317,260.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	50,000	9.23	461,500.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	650,000	4.24	2,756,000.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	89,500	21.85	1,955,575.00	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	38,000	8.33	316,540.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	560,000	5.61	3,141,600.00	

YANKUANG ENERGY GROUP CO-H	57,000	10.94	623,580.00
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	110,000	3.39	372,900.00
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	30,500	21.10	643,550.00
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	64,500	7.13	459,885.00
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	100,000	4.18	418,000.00
CHINA RESOURCES CEMENT	68,000	2.85	193,800.00
CMOC GROUP LTD-H	87,000	4.65	404,550.00
DONGYUE GROUP	44,000	6.76	297,440.00
GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD-H	9,640	41.05	395,722.00
JIANGXI COPPER CO LTD-H	31,000	12.02	372,620.00
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	42,000	4.40	184,800.00
SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	20,500	14.92	305,860.00
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	31,500	10.08	317,520.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	152,000	11.94	1,814,880.00
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	61,000	3.50	213,500.00
BOC AVIATION LTD	6,100	59.20	361,120.00
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	68,000	3.37	229,160.00
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	43,000	8.15	350,450.00
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	26,000	4.26	110,760.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	113,000	4.53	511,890.00
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	58,000	8.91	516,780.00
CITIC LTD	155,000	7.61	1,179,550.00
CRRG CORP LTD - H	118,000	3.93	463,740.00
FOSUN INTERNATIONAL LTD	72,500	4.83	350,175.00
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	17,000	16.90	287,300.00
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	27,000	11.50	310,500.00
WEICHAJ POWER CO LTD-H	49,000	9.68	474,320.00
ZHUZHOU CRRG TIMES ELECTRI-H	13,800	25.70	354,660.00
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL LIMITED	92,000	2.82	259,440.00
AIR CHINA LTD-H	42,000	5.88	246,960.00
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	46,000	4.37	201,020.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	40,000	9.41	376,400.00
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	46,000	4.29	197,340.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	83,700	7.51	628,587.00
COSCO SHIPPING PORTS LTD	46,000	4.46	205,160.00
JD LOGISTICS INC	52,200	10.54	550,188.00
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	30,000	6.70	201,000.00
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	3,500	120.70	422,450.00
SHENZHEN INTL HOLDINGS	32,500	6.20	201,500.00
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	32,000	5.90	188,800.00
BYD CO LTD-H	26,500	225.20	5,967,800.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	70,000	2.99	209,300.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	16,400	35.65	584,660.00

GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	161,000	9.46	1,523,060.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	64,000	9.31	595,840.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	70,000	4.21	294,700.00
LI AUTO INC-CLASS A	29,688	155.40	4,613,515.20
MINTH GROUP LTD	22,000	22.70	499,400.00
XPENG INC-CLASS A SHARES	27,664	61.00	1,687,504.00
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	32,000	16.16	517,120.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	32,400	79.15	2,564,460.00
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	110,000	3.21	353,100.00
HAIER SMART HOME CO LTD-H	61,000	22.70	1,384,700.00
LI NING CO LTD	62,500	39.10	2,443,750.00
SHENZHO INTERNATIONAL GROUP	21,900	74.60	1,633,740.00
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	41,500	7.86	326,190.00
EAST BUY HOLDING LTD	10,500	36.20	380,100.00
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	44,000	21.65	952,600.00
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	27,000	13.52	365,040.00
MEITUAN	133,810	129.90	17,381,919.00
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	41,510	40.40	1,677,004.00
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LT	34,800	17.12	595,776.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	25,000	14.24	356,000.00
TRIP.COM GROUP LTD	14,460	299.60	4,332,216.00
BAIDU INC-CLASS A	59,530	126.10	7,506,733.00
BILIBILI INC-CLASS Z	5,117	116.90	598,177.30
CHINA LITERATURE LTD	9,800	31.55	309,190.00
CHINA RUYI HOLDINGS LIMITED	136,000	1.80	244,800.00
KINGSOFT CORP LTD	24,200	29.60	716,320.00
KUAISHOU TECHNOLOGY	61,100	63.60	3,885,960.00
NETEASE INC	52,100	156.50	8,153,650.00
TENCENT HOLDINGS LTD	164,400	325.00	53,430,000.00
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	437,740	87.00	38,083,380.00
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	20,000	6.95	139,000.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-H	1,900	111.10	211,090.00
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	49,600	11.94	592,224.00
JD.COM INC - CL A	62,210	131.20	8,161,952.00
POP MART INTERNATIONAL GROUP	15,000	21.25	318,750.00
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	50,000	6.69	334,500.00
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	19,500	21.70	423,150.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	118,000	4.35	513,300.00
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	29,550	41.15	1,215,982.50
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	15,000	17.48	262,200.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	2,600	132.80	345,280.00
CHINA FEIHE LTD	95,000	4.37	415,150.00
CHINA MENGNIU DAIRY CO	84,000	25.25	2,121,000.00

CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	42,000	46.00	1,932,000.00
DALI FOODS GROUP CO LTD	66,500	3.56	236,740.00
NONGFU SPRING CO LTD-H	46,800	42.25	1,977,300.00
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	48,000	7.70	369,600.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	50,000	10.98	549,000.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	16,000	66.20	1,059,200.00
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	31,000	5.92	183,520.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	123,000	5.43	667,890.00
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	14,000	16.52	231,280.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	17,500	28.95	506,625.00
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	9,000	17.44	156,960.00
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	9,000	40.30	362,700.00
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	24,200	12.90	312,180.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	64,000	8.11	519,040.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	21,500	12.96	278,640.00
SINOPHARM GROUP CO-H	33,600	21.20	712,320.00
3SBIO INC	52,500	6.82	358,050.00
AKESO INC	13,000	32.50	422,500.00
BEIGENE LTD	18,296	114.70	2,098,551.20
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	33,000	10.98	362,340.00
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	43,500	5.46	237,510.00
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	90,000	2.91	261,900.00
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	240,000	5.65	1,356,000.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	30,000	17.62	528,600.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	2,700	40.70	109,890.00
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	32,000	9.62	307,840.00
INNOVENT BIOLOGICS INC	29,500	31.45	927,775.00
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	9,600	17.06	163,776.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	14,000	18.88	264,320.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	279,250	2.99	834,957.50
WUXI APPTec CO LTD-H	10,168	81.90	832,759.20
WUXI BIOLOGICS (CAYMAN) INC.	101,500	40.05	4,065,075.00
ZAI LAB LTD	23,030	18.16	418,224.80
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	772,000	2.55	1,968,600.00
BANK OF CHINA LTD-H	2,100,000	2.64	5,544,000.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	232,000	4.33	1,004,560.00
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	245,000	3.47	850,150.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	2,546,000	4.08	10,387,680.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	69,000	2.22	153,180.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	103,000	30.95	3,187,850.00
CHINA MINSHENG BANKING-H	171,600	2.75	471,900.00
IND & COMM BK OF CHINA-H	1,497,000	3.41	5,104,770.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	214,000	3.98	851,720.00

CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	250,000	0.77	192,500.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	82,000	4.19	343,580.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	38,800	16.80	651,840.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	53,000	15.68	831,040.00
FAR EAST HORIZON LTD	38,000	5.19	197,220.00
GF SECURITIES CO LTD-H	26,800	11.58	310,344.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	65,200	5.04	328,608.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	35,800	10.68	382,344.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	199,000	11.58	2,304,420.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	71,200	18.00	1,281,600.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	33,400	7.83	261,522.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	20,700	19.82	410,274.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	224,000	2.64	591,360.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	184,000	8.29	1,525,360.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	168,000	45.45	7,635,600.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	19,800	23.30	461,340.00
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	80,000	4.85	388,000.00
GDS HOLDINGS LTD-CL A	25,524	10.60	270,554.40
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	72,000	12.40	892,800.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	17,500	16.28	284,900.00
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	19,500	29.55	576,225.00
KINGBOARD HOLDINGS LTD	19,000	18.50	351,500.00
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	24,000	6.79	162,960.00
LENOVO GROUP LTD	196,000	7.29	1,428,840.00
SUNNY OPTICAL TECH	19,100	65.15	1,244,365.00
XIAOMI CORP-CLASS B	403,400	11.74	4,735,916.00
ZTE CORP-H	18,800	24.65	463,420.00
CHINA TOWER CORP LTD-H	1,178,000	0.79	930,620.00
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	14,500	29.15	422,675.00
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	122,000	1.73	211,060.00
CGN POWER CO LTD-H	285,000	1.96	558,600.00
CHINA GAS HOLDINGS LTD	78,000	8.29	646,620.00
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	88,000	6.37	560,560.00
CHINA POWER INTERNATIONAL	126,000	2.97	374,220.00
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	24,200	23.60	571,120.00
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	52,000	16.06	835,120.00
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	21,000	83.00	1,743,000.00
GUANGDONG INVESTMENT LTD	78,000	6.13	478,140.00
HUANENG POWER INTL INC-H	96,000	4.36	418,560.00
KUNLUN ENERGY CO LTD	102,000	5.61	572,220.00
FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	11,000	20.10	221,100.00
GCL TECHNOLOGY HOLDINGS LTD	517,000	1.43	739,310.00
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	16,000	19.28	308,480.00

	SHANGHAI FUDAN MICROELECT-H	7,000	18.90	132,300.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	130,000	6.88	894,400.00	
	C&D INTERNATIONAL INVESTMENT	16,000	19.86	317,760.00	
	CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	94,000	1.12	105,280.00	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	102,000	16.08	1,640,160.00	
	CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	40,000	8.25	330,000.00	
	CHINA RESOURCES LAND LTD	86,000	31.80	2,734,800.00	
	CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	18,800	33.65	632,620.00	
	CHINA VANKE CO LTD-H	56,400	9.56	539,184.00	
	COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	276,000	0.76	209,760.00	
	COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	57,000	7.11	405,270.00	
	GREENTOWN CHINA HOLDINGS	21,500	7.32	157,380.00	
	GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	36,000	3.71	133,560.00	
	LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	50,500	16.54	835,270.00	
	YUEXIU PROPERTY CO LTD	50,800	9.33	473,964.00	
	香港ドル 小計	22,201,387		305,138,634.10 (5,663,373,048)	
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	95,700	2.16	206,712.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	5,900	22.50	132,750.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	66,900	6.80	454,920.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	102,800	4.75	488,300.00	
	GAMUDA BHD	49,000	4.48	219,520.00	
	SIME DARBY BERHAD	56,700	2.11	119,637.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	13,800	6.82	94,116.00	
	MISC BHD	36,800	7.09	260,912.00	
	GENTING BHD	57,900	4.40	254,760.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	91,400	2.58	235,812.00	
	MR DIY GROUP M BHD	92,550	1.56	144,378.00	
	IOI CORP BHD	69,200	3.98	275,416.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	12,000	22.66	271,920.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	1,800	132.00	237,600.00	
	PPB GROUP BERHAD	16,120	16.02	258,242.40	
	QL RESOURCES BHD	30,350	5.43	164,800.50	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	63,000	4.39	276,570.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	59,200	6.00	355,200.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	153,200	0.80	123,326.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	36,600	3.86	141,276.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	172,800	5.55	959,040.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	16,200	19.90	322,380.00	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	5,300	18.44	97,732.00	
	MALAYAN BANKING BHD	142,900	9.00	1,286,100.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	389,100	4.13	1,606,983.00	
	RHB BANK BHD	39,200	5.65	221,480.00	

	AXIATA GROUP BERHAD	72,600	2.60	188,760.00	
	CELCOMDIGI BHD	90,500	4.38	396,390.00	
	MAXIS BHD	64,700	3.93	254,271.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	36,600	5.04	184,464.00	
	PETRONAS GAS BHD	22,900	17.00	389,300.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	71,400	9.95	710,430.00	
	INARI AMERTRON BHD	74,800	3.01	225,148.00	
	マレーシアリングット 小計	2,309,920		11,558,645.90 (361,298,997)	
タイパーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	201,000	8.65	1,738,650.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	37,900	158.50	6,007,150.00	
	PTT PCL-NVDR	270,400	36.00	9,734,400.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	31,600	51.75	1,635,300.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	53,800	30.50	1,640,900.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	54,100	36.50	1,974,650.00	
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	32,200	36.75	1,183,350.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	19,700	314.00	6,185,800.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	115,700	70.75	8,185,775.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	234,600	8.80	2,064,480.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	207,000	7.10	1,469,700.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	190,600	3.98	758,588.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	75,900	32.75	2,485,725.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	45,225	39.00	1,763,775.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	145,900	13.50	1,969,650.00	
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	85,300	20.10	1,714,530.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	36,100	35.00	1,263,500.00	
	CP ALL PCL-NVDR	157,200	62.00	9,746,400.00	
	CP AXTRA PCL-NVDR	59,000	34.25	2,020,750.00	
	CARABAO GROUP PCL-NVDR	4,900	76.00	372,400.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	94,100	19.40	1,825,540.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	31,400	29.00	910,600.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	280,500	28.00	7,854,000.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	16,900	261.00	4,410,900.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	13,200	128.50	1,696,200.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	84,100	19.50	1,639,950.00	
	SCB X PCL-NVDR	21,200	113.50	2,406,200.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	23,600	45.25	1,067,900.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	16,300	38.00	619,400.00	
	SRI SAWAD CORP PCL-NVDR	16,200	46.00	745,200.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	84,500	99.50	8,407,750.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	30,000	222.00	6,660,000.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	28,600	75.75	2,166,450.00	
	TRUE CORP PCL/NEW-NVDR	327,315	6.80	2,225,742.00	

	B GRIMM POWER PCL-NVDR	25,200	35.75	900,900.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	6,300	132.50	834,750.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	48,000	57.25	2,748,000.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	21,300	52.75	1,123,575.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	81,400	48.00	3,907,200.00	
	RATCH GROUP PCL-NVDR	21,900	35.25	771,975.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	57,400	66.75	3,831,450.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	207,600	8.35	1,733,460.00	
	タイパーツ 小計	3,595,140		122,402,615.00 (504,298,773)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	51,250	47.05	2,411,312.50	
	AYALA CORPORATION	7,910	590.00	4,666,900.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	72,731	38.05	2,767,414.55	
	SM INVESTMENTS CORP	6,870	860.00	5,908,200.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	24,500	213.80	5,238,100.00	
	JOLLIBEE FOODS CORP	11,290	243.80	2,752,502.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	24,530	117.60	2,884,728.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	54,578	111.10	6,063,615.80	
	BDO UNIBANK INC	65,396	138.20	9,037,727.20	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	45,472	56.95	2,589,630.40	
	PLDT INC	1,865	1,215.00	2,265,975.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	7,490	350.00	2,621,500.00	
	AYALA LAND INC	181,100	29.50	5,342,450.00	
SM PRIME HOLDINGS INC	252,700	30.00	7,581,000.00		
	フィリピンペソ 小計	807,682		62,131,055.45 (160,670,909)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY TBK PT	355,100	2,540.00	901,954,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	45,500	26,800.00	1,219,400,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK	175,600	1,950.00	342,420,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	909,184	895.00	813,719,680.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	89,700	9,375.00	840,937,500.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	292,209	3,180.00	929,224,620.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	101,289	6,725.00	681,168,525.00	
	VALE INDONESIA TBK	49,100	6,075.00	298,282,500.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	507,600	6,525.00	3,312,090,000.00	
	GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT	22,100,000	92.00	2,033,200,000.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	409,300	2,900.00	1,186,970,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	181,300	5,225.00	947,292,500.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	75,400	11,700.00	882,180,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	117,600	7,050.00	829,080,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	202,200	3,690.00	746,118,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	526,300	1,845.00	971,023,500.00	
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	1,473,900	9,250.00	13,633,575,000.00		

	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	999,900	5,775.00	5,774,422,500.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	207,300	9,050.00	1,876,065,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	1,816,545	5,575.00	10,127,238,375.00	
	SARANA MENARA NUSANTARA PT	412,300	1,010.00	416,423,000.00	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	1,327,300	3,760.00	4,990,648,000.00	
	インドネシアルピア 小計	32,374,627		53,753,432,700.00 (510,657,610)	
韓国ウォン	HD HYUNDAI	1,185	58,600.00	69,441,000.00	
	S-OIL CORP	1,083	73,000.00	79,059,000.00	
	SK INNOVATION CO LTD	1,402	174,100.00	244,088,200.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORP	2,898	35,150.00	101,864,700.00	
	HYUNDAI STEEL CO	2,249	34,150.00	76,803,350.00	
	KOREA ZINC CO LTD	231	465,500.00	107,530,500.00	
	KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	458	115,900.00	53,082,200.00	
	LG CHEM LTD	1,320	569,000.00	751,080,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	197	334,500.00	65,896,500.00	
	LOTTE CHEMICAL CORP	484	130,000.00	62,920,000.00	
	POSCO FUTURE M CO LTD	803	417,500.00	335,252,500.00	
	POSCO HOLDINGS INC	1,912	549,000.00	1,049,688,000.00	
	SK IE TECHNOLOGY CO LTD	775	89,200.00	69,130,000.00	
	SKC CO LTD	602	90,700.00	54,601,400.00	
	CJ CORP	425	70,400.00	29,920,000.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	1,487	53,700.00	79,851,900.00	
	DOOSAN ENERBILITY	11,421	16,020.00	182,964,420.00	
	ECOPRO BM CO LTD	1,314	312,000.00	409,968,000.00	
	GS HOLDINGS	1,411	37,400.00	52,771,400.00	
	HANWHA AEROSPACE CO LTD	957	107,600.00	102,973,200.00	
	HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	607	121,000.00	73,447,000.00	
	HD KOREA SHIPBUILDING & OFFS	1,038	114,000.00	118,332,000.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONST	2,000	34,700.00	69,400,000.00	
	HYUNDAI MIPO DOCKYARD	517	84,400.00	43,634,800.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	1,854	46,950.00	87,045,300.00	
	LG CORP	2,401	79,700.00	191,359,700.00	
	LG ENERGY SOLUTION	938	529,000.00	496,202,000.00	
	POSCO INTERNATIONAL CORP	1,476	81,500.00	120,294,000.00	
	SAMSUNG C&T CORP	2,130	102,400.00	218,112,000.00	
	SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	3,781	35,500.00	134,225,500.00	
	SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	15,535	8,310.00	129,095,850.00	
	SK	1,030	138,800.00	142,964,000.00	
	SK SQUARE CO LTD	2,400	43,950.00	105,480,000.00	
	HMM CO LTD	6,429	17,560.00	112,893,240.00	
	HYUNDAI GLOVIS CO LTD	524	171,300.00	89,761,200.00	
	KOREAN AIR LINES CO LTD	4,956	23,650.00	117,209,400.00	

PAN OCEAN CO LTD	5,356	4,400.00	23,566,400.00
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	1,948	39,650.00	77,238,200.00
HANON SYSTEMS	3,541	9,400.00	33,285,400.00
HYUNDAI MOBIS CO LTD	1,635	229,500.00	375,232,500.00
HYUNDAI MOTOR CO	3,690	186,100.00	686,709,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	870	104,400.00	90,828,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	533	101,700.00	54,206,100.00
KIA CORP	7,008	78,400.00	549,427,200.00
COWAY CO LTD	1,442	40,950.00	59,049,900.00
F&F CO LTD / NEW	518	103,600.00	53,664,800.00
LG ELECTRONICS INC	2,914	98,300.00	286,446,200.00
KANGWON LAND INC	3,072	15,170.00	46,602,240.00
HYBE CO LTD	525	236,500.00	124,162,500.00
KAKAO CORP	8,310	48,450.00	402,619,500.00
KAKAO GAMES CORP	1,051	27,750.00	29,165,250.00
KRAFTON INC	724	158,000.00	114,392,000.00
NAVER CORP	3,490	212,500.00	741,625,000.00
NCSOFT CORP	383	250,000.00	95,750,000.00
NETMARBLE CORPORATION	392	44,100.00	17,287,200.00
PEARL ABYSS CORP	960	57,000.00	54,720,000.00
HOTEL SHILLA CO LTD	885	87,800.00	77,703,000.00
BGF RETAIL CO LTD/NEW	138	160,200.00	22,107,600.00
E-MART INC	557	71,100.00	39,602,700.00
CJ CHEILJEDANG CORP	221	303,500.00	67,073,500.00
KT&G CORP	2,766	85,400.00	236,216,400.00
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	591	122,400.00	72,338,400.00
AMOREPACIFIC CORP	788	122,000.00	96,136,000.00
LG H&H	260	447,500.00	116,350,000.00
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	2,829	68,600.00	194,069,400.00
HLB INC	3,131	29,900.00	93,616,900.00
CELLTRION INC	2,900	150,400.00	436,160,000.00
CELLTRION PHARM INC	355	73,300.00	26,021,500.00
HANMI PHARM CO LTD	214	303,000.00	64,842,000.00
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	477	771,000.00	367,767,000.00
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	783	86,500.00	67,729,500.00
SK BIOSCIENCE CO LTD	710	75,800.00	53,818,000.00
YUHAN CORP	1,526	73,300.00	111,855,800.00
HANA FINANCIAL GROUP	7,972	37,550.00	299,348,600.00
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	6,372	10,440.00	66,523,680.00
KAKAOBANK CORP	4,052	25,600.00	103,731,200.00
KB FINANCIAL GROUP INC	10,410	52,000.00	541,320,000.00
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	11,243	34,800.00	391,256,400.00
WOORI FINANCIAL GROUP INC	15,149	11,380.00	172,395,620.00

	KAKAOPAY CORP	730	44,550.00	32,521,500.00	
	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	1,162	50,500.00	58,681,000.00	
	MERITZ FINANCIAL GROUP INC	2,513	49,550.00	124,519,150.00	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	5,653	6,560.00	37,083,680.00	
	NH INVESTMENT & SECURITIES C	2,964	10,270.00	30,440,280.00	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	1,943	36,200.00	70,336,600.00	
	DB INSURANCE CO LTD	1,260	81,900.00	103,194,000.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	856	251,000.00	214,856,000.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	2,205	66,000.00	145,530,000.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	1,032	136,400.00	140,764,800.00	
	COSMOAM&T CO LTD	620	153,000.00	94,860,000.00	
	L&F CO LTD	644	211,000.00	135,884,000.00	
	LG DISPLAY CO LTD	5,817	13,150.00	76,493,550.00	
	LG INNOTEK CO LTD	384	256,000.00	98,304,000.00	
	LOTTE ENERGY MATERIALS CORP	440	49,900.00	21,956,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	1,437	144,600.00	207,790,200.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	126,333	66,300.00	8,375,877,900.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	21,845	54,500.00	1,190,552,500.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	1,461	597,000.00	872,217,000.00	
	KT CORP	1,598	32,650.00	52,174,700.00	
	LG UPLUS CORP	6,485	10,210.00	66,211,850.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	7,197	17,940.00	129,114,180.00	
	SK HYNIX INC	14,474	117,200.00	1,696,352,800.00	
	韓国ウォン 小計	411,974		27,838,018,540.00 (3,023,208,813)	
新台幣ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	31,000	79.00	2,449,000.00	
	ASIA CEMENT CORP	54,000	39.10	2,111,400.00	
	CHINA STEEL CORP	315,000	27.20	8,568,000.00	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	88,000	62.10	5,464,800.00	
	FORMOSA PLASTICS CORP	102,000	80.30	8,190,600.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	127,000	66.40	8,432,800.00	
	TAIWAN CEMENT	152,917	35.15	5,375,032.55	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	3,600	897.00	3,229,200.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	92,000	28.75	2,645,000.00	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	1,500	1,545.00	2,317,500.00	
	WALSIN LIHWA CORP	74,000	36.40	2,693,600.00	
	CHINA AIRLINES LTD	75,000	23.65	1,773,750.00	
	EVA AIRWAYS CORP	66,000	33.20	2,191,200.00	
	EVERGREEN MARINE CORP LTD	27,420	107.00	2,933,940.00	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	55,000	29.35	1,614,250.00	
	WAN HAI LINES LTD	18,650	50.50	941,825.00	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	41,000	43.90	1,799,900.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	53,000	37.75	2,000,750.00	

ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	5,420	482.00	2,612,440.00
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	11,289	168.50	1,902,196.50
GIANT MANUFACTURING	9,000	203.00	1,827,000.00
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	5,000	304.50	1,522,500.00
POU CHEN	61,000	29.35	1,790,350.00
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	8,160	692.00	5,646,720.00
MOMO.COM INC	2,200	529.00	1,163,800.00
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	16,000	270.00	4,320,000.00
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	130,000	72.40	9,412,000.00
PHARMAESSENTIA CORP	7,000	329.00	2,303,000.00
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	155,046	17.15	2,659,038.90
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	470,000	23.35	10,974,500.00
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	373,197	24.60	9,180,646.20
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	293,723	26.20	7,695,542.60
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	222,430	20.80	4,626,544.00
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	299,502	35.70	10,692,221.40
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	282,350	17.10	4,828,185.00
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	288,055	17.65	5,084,170.75
TAIWAN BUSINESS BANK	172,000	13.65	2,347,800.00
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	256,978	26.55	6,822,765.90
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	106,000	42.50	4,505,000.00
CHAILEASE HOLDING CO LTD	39,009	180.00	7,021,620.00
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	255,208	23.95	6,112,231.60
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	252,000	45.20	11,390,400.00
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	414,000	11.90	4,926,600.00
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	198,825	62.40	12,406,680.00
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	366,835	9.39	3,444,580.65
ACCTON TECHNOLOGY CORP	14,000	411.50	5,761,000.00
ACER INC	78,000	37.40	2,917,200.00
ADVANTECH CO LTD	12,427	345.50	4,293,528.50
ASUSTEK COMPUTER INC	18,000	384.00	6,912,000.00
AUO CORP	176,200	17.65	3,109,930.00
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	16,000	166.50	2,664,000.00
COMPAL ELECTRONICS	100,000	34.75	3,475,000.00
DELTA ELECTRONICS INC	52,000	341.50	17,758,000.00
E INK HOLDINGS INC	24,000	181.00	4,344,000.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	330,800	106.00	35,064,800.00
INNOLUX CORP	254,475	14.35	3,651,716.25
INVENTEC CORP	73,000	57.00	4,161,000.00
LARGAN PRECISION CO LTD	2,500	2,025.00	5,062,500.00
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	56,000	146.00	8,176,000.00
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	17,000	173.00	2,941,000.00
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	6,000	231.00	1,386,000.00

	PEGATRON CORP	56,000	76.90	4,306,400.00	
	QUANTA COMPUTER INC	72,000	256.00	18,432,000.00	
	SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	34,000	59.70	2,029,800.00	
	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	35,000	174.50	6,107,500.00	
	WISTRON CORP	73,000	120.50	8,796,500.00	
	WIWYNN CORP	2,000	1,645.00	3,290,000.00	
	WPG HOLDINGS LTD	35,960	53.70	1,931,052.00	
	YAGEO CORPORATION	8,524	461.50	3,933,826.00	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	18,000	95.10	1,711,800.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	101,000	117.50	11,867,500.00	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	44,000	71.40	3,141,600.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	47,000	93.90	4,413,300.00	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	82,000	107.00	8,774,000.00	
	EMEMORY TECHNOLOGY INC	1,800	1,820.00	3,276,000.00	
	GLOBAL UNICHIP CORP	2,300	1,345.00	3,093,500.00	
	GLOBALWAFERS CO LTD	6,000	456.00	2,736,000.00	
	MEDIATEK INC	39,800	674.00	26,825,200.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	30,000	64.60	1,938,000.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS COR	16,000	386.00	6,176,000.00	
	PARADE TECHNOLOGIES LTD	2,000	818.00	1,636,000.00	
	POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU	70,000	27.25	1,907,500.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	13,000	417.50	5,427,500.00	
	SILERGY CORP	8,640	290.00	2,505,600.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	652,000	539.00	351,428,000.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	298,000	43.80	13,052,400.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	21,000	70.40	1,478,400.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	9,000	132.00	1,188,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	77,000	25.65	1,975,050.00	
	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	49,608	33.20	1,646,985.60	
	新台湾ドル 小計	9,212,348		828,654,169.40 (3,771,536,586)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	19,660	352.90	6,938,014.00	
	COAL INDIA LTD	42,402	227.45	9,644,334.90	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	14,851	261.15	3,878,338.65	
	INDIAN OIL CORP LTD	70,217	91.40	6,417,833.80	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	81,360	175.30	14,262,408.00	
	PETRONET LNG LTD	18,996	219.25	4,164,873.00	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	80,649	2,556.80	206,203,363.20	
	ACC LTD	1,469	1,934.10	2,841,192.90	
	AMBUJA CEMENTS LTD	13,736	453.05	6,223,094.80	
	ASIAN PAINTS LTD	10,272	3,163.55	32,495,985.60	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	6,576	705.25	4,637,724.00	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	7,281	1,790.95	13,039,906.95	

HINDALCO INDUSTRIES LTD	31,670	439.50	13,918,965.00
JINDAL STEEL & POWER LTD	10,594	641.05	6,791,283.70
JSW STEEL LTD	15,763	787.10	12,407,057.30
PI INDUSTRIES LTD	2,083	3,760.20	7,832,496.60
PIDILITE INDUSTRIES LTD	4,189	2,477.60	10,378,666.40
SHREE CEMENT LTD	251	23,537.25	5,907,849.75
SRF LTD	4,133	2,277.80	9,414,147.40
TATA STEEL LTD	197,316	115.80	22,849,192.80
ULTRATECH CEMENT LTD	3,033	8,214.85	24,915,640.05
UPL LTD	13,811	578.45	7,988,972.95
VEDANTA LTD	18,821	233.35	4,391,880.35
ABB INDIA LTD	1,585	4,279.50	6,783,007.50
ADANI ENTERPRISES LTD	4,197	2,577.40	10,817,347.80
BHARAT ELECTRONICS LTD	102,464	127.15	13,028,297.60
CG POWER AND INDUSTRIAL SOLU	15,444	429.65	6,635,514.60
HAVELLS INDIA LTD	7,120	1,286.15	9,157,388.00
HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	2,237	3,788.00	8,473,756.00
LARSEN & TOUBRO LTD	18,402	2,641.95	48,617,163.90
SIEMENS LTD	2,310	3,606.10	8,330,091.00
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	6,472	643.40	4,164,084.80
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	14,130	835.90	11,811,267.00
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	7,859	654.75	5,145,680.25
INTERGLOBE AVIATION LTD	3,501	2,454.30	8,592,504.30
BAJAJ AUTO LTD	1,903	4,615.55	8,783,391.65
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	2,334	2,379.95	5,554,803.30
BHARAT FORGE LTD	6,216	970.75	6,034,182.00
EICHER MOTORS LTD	3,761	3,349.60	12,597,845.60
HERO MOTOCORP LTD	2,952	2,927.05	8,640,651.60
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	24,535	1,552.65	38,094,267.75
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	3,577	9,456.05	33,824,290.85
MRF LTD	54	107,760.35	5,819,058.90
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN	53,088	94.20	5,000,889.60
SONA BLW PRECISION FORGINGS	10,800	566.85	6,121,980.00
TATA MOTORS LTD	44,047	615.80	27,124,142.60
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LT	2,841	2,785.80	7,914,457.80
TVS MOTOR CO LTD	6,191	1,341.40	8,304,607.40
PAGE INDUSTRIES LTD	149	40,300.05	6,004,707.45
TITAN CO LTD	9,515	3,050.45	29,025,031.75
INDIAN HOTELS CO LTD	22,920	381.65	8,747,418.00
JUBILANT FOODWORKS LTD	10,195	481.35	4,907,363.25
ZOMATO LTD	116,147	89.35	10,377,734.45
INFO EDGE INDIA LTD	1,911	4,189.50	8,006,134.50
TRENT LTD	4,453	1,974.00	8,790,222.00

AVENUE SUPERMARTS LTD	4,103	3,540.95	14,528,517.85
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	3,003	4,535.05	13,618,755.15
ITC LTD	79,816	441.65	35,250,736.40
MARICO LTD	12,369	550.75	6,812,226.75
NESTLE INDIA LTD	851	21,830.00	18,577,330.00
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	15,548	842.55	13,099,967.40
UNITED SPIRITS LTD	7,422	995.45	7,388,229.90
VARUN BEVERAGES LTD	11,762	899.25	10,576,978.50
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	3,413	1,996.60	6,814,395.80
DABUR INDIA LTD	17,113	565.50	9,677,401.50
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	11,134	1,026.45	11,428,494.30
HINDUSTAN UNILEVER LTD	21,860	2,554.75	55,846,835.00
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	2,793	4,848.35	13,541,441.55
MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	20,500	533.40	10,934,700.00
AUROBINDO PHARMA LTD	7,383	857.80	6,333,137.40
CIPLA LTD	13,421	1,236.40	16,593,724.40
DIVI'S LABORATORIES LTD	3,145	3,654.90	11,494,660.50
DR. REDDY'S LABORATORIES	2,966	5,874.45	17,423,618.70
LUPIN LTD	4,421	1,067.60	4,719,859.60
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	25,785	1,134.90	29,263,396.50
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	2,579	1,980.60	5,107,967.40
AU SMALL FINANCE BANK LTD	5,313	711.05	3,777,808.65
AXIS BANK LTD	60,500	943.05	57,054,525.00
BANDHAN BANK LTD	19,777	229.45	4,537,832.65
BANK OF BARODA	27,026	191.70	5,180,884.20
HDFC BANK LIMITED	73,394	1,590.75	116,751,505.50
ICICI BANK LTD	136,870	950.65	130,115,465.50
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	28,784	1,750.80	50,395,027.20
STATE BANK OF INDIA	47,984	572.95	27,492,432.80
YES BANK LTD	275,079	16.90	4,648,835.10
BAJAJ FINANCE LTD	7,278	6,862.10	49,942,363.80
BAJAJ FINSERV LTD	9,746	1,460.15	14,230,621.90
BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMEN	806	6,943.20	5,596,219.20
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	11,638	1,016.95	11,835,264.10
MUTHOOT FINANCE LTD	2,371	1,241.60	2,943,833.60
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	7,713	842.45	6,497,816.85
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	7,408	1,820.45	13,485,893.60
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	24,553	625.95	15,368,950.35
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	5,683	1,327.90	7,546,455.70
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	8,896	537.50	4,781,600.00
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	11,421	1,282.45	14,646,861.45
HCL TECHNOLOGIES LTD	25,519	1,173.70	29,951,650.30
INFOSYS LTD	87,548	1,388.80	121,586,662.40

	LTIMINDTREE LTD	2,255	5,085.15	11,467,013.25	
	MPHASIS LTD	1,924	2,291.05	4,407,980.20	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	24,319	3,367.10	81,884,504.90	
	TATA ELXSI LTD	853	7,008.15	5,977,951.95	
	TECH MAHINDRA LTD	14,666	1,210.80	17,757,592.80	
	WIPRO LTD	37,402	411.70	15,398,403.40	
	BHARTI AIRTEL LTD	59,315	856.25	50,788,468.75	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	7,170	994.75	7,132,357.50	
	ADANI POWER LTD	20,741	304.60	6,317,708.60	
	GAIL INDIA LTD	58,140	112.60	6,546,564.00	
	INDRAPRASTHA GAS LTD	7,746	429.20	3,324,583.20	
	NTPC LTD	113,658	215.15	24,453,518.70	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	90,939	241.00	21,916,299.00	
	TATA POWER CO LTD	39,023	230.10	8,979,192.30	
	DLF LTD	15,745	474.05	7,463,917.25	
	GODREJ PROPERTIES LTD	3,754	1,526.00	5,728,604.00	
	インドルピー 小計	2,836,787		2,125,718,049.55 (3,741,263,767)	
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	16,008	16.26	260,290.08	
	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	68,061	3.80	258,631.80	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	107,154	1.90	203,699.75	
	INDUSTRIES QATAR	41,380	13.01	538,353.80	
	COMMERCIAL BANK PQSC	89,506	6.08	544,196.48	
	DUKHAN BANK	47,311	4.28	202,491.08	
	MASRAF AL RAYAN	156,266	2.39	374,569.60	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	26,217	10.15	266,102.55	
	QATAR ISLAMIC BANK	41,163	20.22	832,315.86	
	QATAR NATIONAL BANK	122,744	16.18	1,985,997.92	
	OOREDOO QPSC	18,307	11.13	203,756.91	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	11,535	18.20	209,937.00	
	BARWA REAL ESTATE CO	60,279	2.70	162,753.30	
	カタールリアル 小計	805,931		6,043,096.13 (241,300,828)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	5,798	146.42	848,943.16	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	2,290	175.31	401,459.90	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	1,807	663.00	1,198,041.00	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	11,272	306.64	3,456,446.08	
	GOLD FIELDS LTD	23,923	220.63	5,278,131.49	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	15,256	66.31	1,011,625.36	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	23,265	95.56	2,223,203.40	
	KUMBA IRON ORE LTD	1,694	391.00	662,354.00	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	9,656	123.76	1,195,026.56	
	SASOL LTD	14,307	240.76	3,444,553.32	

	SIBANYE STILLWATER LTD	72,813	28.82	2,098,470.66	
	BIDVEST GROUP LTD	8,221	266.02	2,186,950.42	
	MULTICHOICE GROUP LTD	9,584	83.21	797,484.64	
	MR PRICE GROUP LTD	6,240	141.10	880,464.00	
	NASPERS LTD-N SHS	5,199	3,221.14	16,746,706.86	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	52,043	16.44	855,586.92	
	THE FOSCHINI GROUP LTD	10,240	102.96	1,054,310.40	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	22,905	75.95	1,739,634.75	
	BID CORP LTD	8,546	404.57	3,457,455.22	
	CLICKS GROUP LTD	6,931	271.80	1,883,845.80	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	12,899	252.71	3,259,706.29	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	9,547	188.74	1,801,900.78	
	ABSA GROUP LTD	22,911	175.74	4,026,379.14	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	2,173	1,652.16	3,590,143.68	
	NEDBANK GROUP LTD	12,732	204.51	2,603,821.32	
	STANDARD BANK GROUP LTD	35,808	187.82	6,725,458.56	
	FIRSTRAND LTD	134,868	70.10	9,454,246.80	
	REINET INVESTMENTS SCA	3,701	423.51	1,567,410.51	
	REMGRO LTD	14,915	154.04	2,297,506.60	
	DISCOVERY LTD	13,990	146.79	2,053,592.10	
	OLD MUTUAL LTD	121,527	12.73	1,547,038.71	
	OUTSURANCE GROUP LTD	22,382	37.93	848,949.26	
	SANLAM LTD	49,120	62.59	3,074,420.80	
	MTN GROUP LTD	45,604	128.53	5,861,482.12	
	VODACOM GROUP LTD	15,613	109.92	1,716,180.96	
	NEPI ROCKCASTLE N.V.	10,844	115.85	1,256,277.40	
	南アフリカランド 小計	840,624		103,105,208.97 (790,816,952)	
アラブディルハム	MULTIPLY GROUP	88,559	3.56	315,270.04	
	AMERICANA RESTAURANTS INTERN	70,134	4.09	286,848.06	
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	88,102	3.87	340,954.74	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	73,466	8.75	642,827.50	
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	35,275	10.78	380,264.50	
	DUBAI ISLAMIC BANK	80,564	5.65	455,186.60	
	EMIRATES NBD PJSC	47,764	16.90	807,211.60	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	117,934	13.94	1,643,999.96	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	92,661	21.30	1,973,679.30	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	106,834	5.12	546,990.08	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	179,649	6.78	1,218,020.22	
	アラブディルハム 小計	980,942		8,611,252.60 (341,263,940)	
クウェートディ ナル	AGILITY	35,573	0.60	21,486.09	
	BOUBYAN BANK K.S.C	38,661	0.62	23,969.82	

	GULF BANK	32,739	0.26	8,512.14	
	KUWAIT FINANCE HOUSE	216,159	0.75	163,416.20	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	200,495	0.93	186,460.35	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	52,466	0.51	27,072.45	
	MABANEE CO KPSC	20,333	0.85	17,384.71	
	クウェートディナール 小計	596,426		448,301.76 (212,082,596)	
オフショア人民 元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	18,900	6.28	118,692.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	47,900	6.07	290,753.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	11,500	27.35	314,525.00	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-A	8,100	14.03	113,643.00	
	GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	9,700	6.62	64,214.00	
	INNER MONGOLIA DIAN TOU EN-A	2,700	13.17	35,559.00	
	JIZHONG ENERGY RESOURCES-A	4,900	6.33	31,017.00	
	OFFSHORE OIL ENGINEERING-A	10,500	6.05	63,525.00	
	PETROCHINA CO LTD-A	33,500	7.68	257,280.00	
	PINGDINGSHAN TIANAN COAL -A	3,200	7.73	24,736.00	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	15,700	16.12	253,084.00	
	SHAN XI HUA YANG GROUP NEW-A	5,100	7.59	38,709.00	
	SHANXI COKING COAL ENERGY-A	12,420	8.24	102,340.80	
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	6,500	15.57	101,205.00	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO-A	6,736	16.84	113,434.24	
	YANTAI JEREH OILFIELD-A	900	27.31	24,579.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	23,100	5.92	136,752.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	6,200	25.68	159,216.00	
	ANHUI HONGLU STEEL CONSTRU-A	650	28.55	18,557.50	
	ASIA-POTASH INTERNATIONAL-A	1,500	28.04	42,060.00	
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	33,700	6.22	209,614.00	
	BBMG CORPORATION-A	900	2.32	2,088.00	
	CANMAX TECHNOLOGIES CO LTD-A	1,040	28.42	29,556.80	
	CHENGXIN LITHIUM GROUP CO-A	1,400	24.88	34,832.00	
	CHINA JUSHI CO LTD -A	7,414	14.30	106,020.20	
	CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	5,700	23.39	133,323.00	
	CHINA RARE EARTH RESOURCES-A	1,900	29.57	56,183.00	
	CMOC GROUP LTD-A	28,400	5.67	161,028.00	
	CNGR ADVANCED MATERIAL CO -A	600	58.30	34,980.00	
	CNNC HUA YUAN TITANIUM -A	4,785	5.56	26,604.60	
	DO-FLUORIDE NEW MATERIALS -A	2,100	17.06	35,826.00	
	GANFENG LITHIUM GROUP CO L-A	2,740	50.00	137,000.00	
	GEM CO LTD-A	10,800	6.55	70,740.00	
	GUANGDONG HEC TECHNOLOGY H-A	6,300	6.74	42,462.00	
	GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	4,180	34.86	145,714.80	
	HANGZHOU OXYGEN PLANT GROU-A	2,000	31.68	63,360.00	

HENAN SHENHUO COAL & POWER-A	3,500	14.24	49,840.00
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	9,320	14.52	135,326.40
HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	1,950	7.26	14,157.00
HESTEEL CO LTD-A	1,500	2.31	3,465.00
HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A	1,400	62.82	87,948.00
HUAFON CHEMICAL CO LTD -A	4,600	7.06	32,476.00
HUAIBEI MINING HOLDINGS CO-A	3,700	11.76	43,512.00
HUAXIN CEMENT CO LTD-A	1,100	13.46	14,806.00
HUBEI FEILIHUA QUARTZ GLAS-A	1,000	45.68	45,680.00
HUBEI XINGFA CHEMICALS GRP-A	1,900	21.63	41,097.00
HUNAN CHANGYUAN LICO CO LT-A	3,324	9.83	32,674.92
HUNAN VALIN STEEL CO LTD -A	14,600	5.88	85,848.00
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	73,300	1.81	132,673.00
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	15,700	4.30	67,510.00
INNER MONGOLIA YUAN XING-A	5,900	6.86	40,474.00
JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	7,600	11.61	88,236.00
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	390	68.48	26,707.20
JIANGSU YOKE TECHNOLOGY-A	500	62.04	31,020.00
JIANGXI COPPER CO LTD-A	2,000	18.80	37,600.00
JINDUICHENG MOLYBDENUM CO -A	6,700	11.48	76,916.00
LB GROUP CO LTD-A	4,500	17.22	77,490.00
LUXI CHEMICAL GROUP CO LT-A	1,900	10.03	19,057.00
LUXIANG COMPANY,LTD.	400	54.91	21,964.00
NINGBO SHANSHAN CO LTD-A	2,300	13.66	31,418.00
NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	11,900	13.66	162,554.00
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	18,100	3.90	70,590.00
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY-A	8,400	17.99	151,116.00
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	15,750	11.77	185,377.50
SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A	8,090	14.55	117,709.50
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	6,368	23.83	151,749.44
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	3,520	32.17	113,238.40
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	10,000	3.14	31,400.00
SHANDONG SUN PAPER INDUSTR-A	2,200	11.61	25,542.00
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	4,408	36.80	162,214.40
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	3,700	7.64	28,268.00
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	4,800	4.13	19,824.00
SHENGHE RESOURCES HOLDINGS-A	1,700	11.61	19,737.00
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	1,080	49.04	52,963.20
SHENZHEN DYNANONIC CO LTD-A	320	111.55	35,696.00
SHENZHEN SENIOR TECHNOLOGY-A	1,798	14.92	26,826.16
SHENZHEN YUTO PACKAGING TE-A	1,700	23.73	40,341.00
SICHUAN HEBANG BIOTECHNOL- A	14,200	2.42	34,364.00
SICHUAN YAHUA INDUSTRIAL-A	1,900	16.78	31,882.00

SINOMA SCIENCE&TECHNOLOGY -A	2,200	22.42	49,324.00
SINOMINE RESOURCE GROUP CO-A	980	40.36	39,552.80
SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A	600	3.14	1,884.00
SKSHU PAINT CO LTD-A	784	77.61	60,846.24
SUNRESIN NEW MATERIALS CO -A	1,200	63.82	76,584.00
TANGSHAN JIDONG CEMENT INV-A	3,700	7.92	29,304.00
TIANQI LITHIUM CORP-A	2,300	59.12	135,976.00
TIANSHAN ALUMINUM GROUP CO-A	7,500	6.50	48,750.00
TIBET SUMMIT RESOURCES CO-A	1,500	15.88	23,820.00
TONGKUN GROUP CO LTD-A	1,500	14.14	21,210.00
TONGLING NONFERROUS METALS-A	10,400	3.13	32,552.00
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	5,500	91.80	504,900.00
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	640	28.58	18,291.20
WESTERN MINING CO -A	3,300	11.87	39,171.00
WESTERN SUPERCONDUCTING TE-A	560	47.83	26,784.80
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD-A	1,200	17.80	21,360.00
XINJIANG ZHONGTAI CHEMICAL-A	4,100	7.25	29,725.00
YINTAI GOLD CO LTD-A	2,380	13.05	31,059.00
YONGXING SPECIAL MATERIALS-A	910	49.18	44,753.80
YUNNAN ALUMINIUM CO LTD-A	7,300	14.38	104,974.00
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	1,400	88.80	124,320.00
YUNNAN TIN CO LTD-A	3,500	14.26	49,910.00
YUNNAN YUNTIANHUA CO-A	1,500	16.86	25,290.00
ZANGGE MINING CO LTD-A	3,300	23.55	77,715.00
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	2,708	48.50	131,338.00
ZHEJIANG JUHUA CO-A	5,700	16.13	91,941.00
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	6,700	9.45	63,315.00
ZHONGJIN GOLD CORP-A	10,000	10.23	102,300.00
ZIBO QIXIANG TENGDA CHEMIC-A	4,500	6.28	28,260.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	36,000	12.08	434,880.00
AECC AERO-ENGINE CONTROL-A	1,000	22.80	22,800.00
AECC AVIATION POWER CO-A	4,600	39.55	181,930.00
AVICOPTER PLC-A	500	39.42	19,710.00
BEIJING EASPRING MATERIAL-A	700	44.10	30,870.00
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	3,700	26.48	97,976.00
BEIJING UNITED INFORMATION-A	841	34.05	28,636.05
CHINA BAOAN GROUP-A	4,500	10.71	48,195.00
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	6,900	28.16	194,304.00
CHINA ENERGY ENGINEERING COR	52,300	2.36	123,428.00
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	9,700	8.03	77,891.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	31,200	7.59	236,808.00
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	73,200	5.85	428,220.00
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	6,960	235.87	1,641,655.20

COSCO SHIPPING DEVELOPMENT CO	18,400	2.47	45,448.00
CRRC CORP LTD-A	36,500	6.15	224,475.00
DAJIN HEAVY INDUSTRY CO LT-A	1,200	26.10	31,320.00
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	4,400	17.74	78,056.00
EVE ENERGY CO LTD-A	3,020	54.30	163,986.00
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	417	6.01	2,506.17
FAW JIEFANG GROUP CO LTD-A	3,200	8.49	27,168.00
GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A	600	81.09	48,654.00
GOLDWIND SCIENCE &TECHNOL-A	3,400	10.61	36,074.00
GOODWE TECHNOLOGIES CO LTD-A	280	151.60	42,448.00
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	3,900	25.03	97,617.00
GUANGDONG KINLONG HARDWARE-A	400	61.93	24,772.00
GUANGZHOU GREAT POWER ENER-A	1,000	39.40	39,400.00
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	1,680	33.65	56,532.00
HOYMILES POWER ELECTRONICS-A	298	288.00	85,824.00
HOYUAN GREEN ENERGY CO LTD	978	43.82	42,855.96
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	2,436	65.63	159,874.68
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	5,300	14.31	75,843.00
JIANGXI SPECIAL ELECTRIC -A	2,500	9.88	24,700.00
KEDA INDUSTRIAL GROUP CO LTD	2,800	10.37	29,036.00
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A	2,200	14.65	32,230.00
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	39,700	3.83	152,051.00
MING YANG SMART ENERGY GRO-A	4,300	16.52	71,036.00
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	11,682	23.01	268,802.82
NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO -A	540	94.82	51,202.80
NINGBO ORIENT WIRES & CABL-A	1,000	40.50	40,500.00
NINGBO RONBAY NEW ENERGY T-A	450	52.07	23,431.50
NORTH INDUSTRIES GROUP RED-A	2,400	16.18	38,832.00
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	26,400	5.60	147,840.00
PYLON TECHNOLOGIES CO LTD-A	200	152.20	30,440.00
RIYUE HEAVY INDUSTRY CO LT-A	2,000	16.17	32,340.00
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	12,600	15.75	198,450.00
SHANGHAI CONSTRUCTION GROU-A	5,600	2.82	15,792.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	24,000	4.52	108,480.00
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	2,400	67.92	163,008.00
SHENZHEN KSTAR SCIENCE AND-A	1,200	30.64	36,768.00
SICHUAN NEW ENERGY POWER CO	2,400	13.57	32,568.00
SICHUAN ROAD&BRIDGE GROUP-A	13,860	9.29	128,759.40
SIEYUAN ELECTRIC CO LTD-A	1,500	49.54	74,310.00
SINOMA INTERNATIONAL ENGIN-A	5,500	12.47	68,585.00
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	2,200	107.13	235,686.00
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	1,300	14.68	19,084.00
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	409	196.50	80,368.50

TBEA CO LTD-A	10,920	15.09	164,782.80
TITAN WIND ENERGY SUZHOU-A	2,800	13.27	37,156.00
WEICHAI POWER CO LTD-A	9,500	12.10	114,950.00
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	20,700	6.26	129,582.00
XIAMEN C & D INC-A	4,400	11.40	50,160.00
ZHEFU HOLDING GROUP CO LTD-A	5,300	4.11	21,783.00
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	4,100	25.75	105,575.00
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	420	52.60	22,092.00
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	3,800	26.50	100,700.00
ZHEJIANG WEIXING NEW BUILD-A	1,300	20.94	27,222.00
ZHUZHOU CRRR TIMES ELECTRI-A	800	39.51	31,608.00
ZHUZHOU KIBING GROUP CO LT-A	4,000	8.38	33,520.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	15,500	6.37	98,735.00
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	1,800	43.32	77,976.00
ZHEJIANG WEIMING ENVIRONME-A	2,340	17.71	41,441.40
AIR CHINA LTD-A	11,400	8.83	100,662.00
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	56,400	5.37	302,868.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	24,800	4.55	112,840.00
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	17,600	6.69	117,744.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	20,770	9.57	198,768.90
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	24,100	7.28	175,448.00
HAINAN AIRLINES HOLDING CO-A	81,700	1.61	131,537.00
JUNEYAO AIRLINES CO LTD-A	3,500	16.60	58,100.00
LIAONING PORT CO LTD-A	21,900	1.62	35,478.00
S F HOLDING CO LTD-A	8,600	46.07	396,202.00
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	2,100	45.12	94,752.00
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	8,900	5.20	46,280.00
SPRING AIRLINES CO LTD-A	1,900	59.39	112,841.00
YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	7,400	14.98	110,852.00
YUNDA HOLDING CO LTD-A	4,870	10.10	49,187.00
BETHEL AUTOMOTIVE SAFETY S-A	900	80.22	72,198.00
BYD CO LTD -A	2,800	240.29	672,812.00
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	200	136.51	27,302.00
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	10,226	13.29	135,903.54
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	3,400	37.63	127,942.00
GREAT WALL MOTOR CO LTD-A	3,300	25.89	85,437.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A	6,900	10.46	72,174.00
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	7,100	18.45	130,995.00
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	1,000	139.57	139,570.00
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	1,200	18.03	21,636.00
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	1,900	67.05	127,395.00
SAIC MOTOR CORP LTD-A	12,410	14.21	176,346.10
SAILUN GROUP CO LTD-A	3,100	11.49	35,619.00

SERES GROUP CO L-A	3,100	35.04	108,624.00
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	1,300	21.78	28,314.00
SHENZHEN KEDALI INDUSTRY C-A	400	120.17	48,068.00
BEIJING ROBOROCK TECHNOLOG-A	280	265.26	74,272.80
ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A	600	72.00	43,200.00
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	4,600	35.48	163,208.00
HAIER SMART HOME CO LTD-A	9,400	22.91	215,354.00
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	1,000	26.85	26,850.00
JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	1,040	41.27	42,920.80
OPPEIN HOME GROUP INC-A	1,040	97.23	101,119.20
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	31,790	3.86	122,709.40
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	300	48.00	14,400.00
BTG HOTELS GROUP CO LTD-A	1,600	19.34	30,944.00
OFFCN EDUCATION TECHNOLOGY-A	10,200	4.31	43,962.00
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	1,700	45.23	76,891.00
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	8,300	4.56	37,848.00
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	5,080	12.29	62,433.20
37 INTERACTIVE ENTERTAINME-A	3,900	24.97	97,383.00
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	1,300	8.50	11,050.00
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	23,800	7.15	170,170.00
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY XI	100	390.00	39,000.00
GIANT NETWORK GROUP CO LTD-A	4,100	13.05	53,505.00
KUNLUN TECH CO LTD-A	2,500	35.63	89,075.00
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	3,110	29.22	90,874.20
PERFECT WORLD CO LTD-A	4,450	13.55	60,297.50
WANDA FILM HOLDING CO LTD-A	4,500	13.48	60,660.00
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	17,100	5.33	91,143.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	3,400	114.09	387,906.00
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	5,000	7.45	37,250.00
WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A	6,000	4.88	29,280.00
DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	1,036	28.30	29,318.80
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	2,164	38.00	82,232.00
ANGEL YEAST CO LTD-A	700	35.67	24,969.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	600	265.79	159,474.00
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	500	59.40	29,700.00
ANHUI YINGJIA DISTILLERY C-A	600	68.17	40,902.00
ANJOY FOODS GROUP CO LTD	400	136.14	54,456.00
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	6,600	6.60	43,560.00
BEIJING YANJING BREWERY CO-A	3,900	10.56	41,184.00
CHONGQING BREWERY CO-A	800	92.32	73,856.00
CHONGQING FULING ZHACAI -A	910	17.93	16,316.30
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	8,170	41.35	337,829.50
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	900	20.24	18,216.00

GUANGDONG HAID GROUP CO-A	2,800	46.74	130,872.00
HEBEI YANGYUAN ZHIHUI BEVERA	2,600	26.76	69,576.00
HEILONGJIANG AGRICULTURE-A	2,500	13.91	34,775.00
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	7,400	25.28	187,072.00
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	11,500	26.95	309,925.00
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	2,000	58.80	117,600.00
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	2,700	134.05	361,935.00
JIUGUI LIQUOR CO LTD-A	400	95.04	38,016.00
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	300	32.78	9,834.00
JUEWEI FOOD CO LTD-A	300	35.35	10,605.00
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	2,000	1,802.59	3,605,180.00
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	2,500	229.70	574,250.00
MEIHUA HOLDINGS GROUP CO -A	5,400	8.80	47,520.00
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	9,416	41.01	386,150.16
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	7,600	11.57	87,932.00
SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT-A	1,372	33.55	46,030.60
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	2,120	225.76	478,611.20
SHEDE SPIRITS CO LTD-A	700	135.39	94,773.00
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	400	67.50	27,000.00
TOLY BREAD CO LTD-A	1,176	9.83	11,560.08
TSINGTAO BREWERY CO LTD-A	1,500	94.28	141,420.00
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	10,060	17.10	172,026.00
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	6,400	163.53	1,046,592.00
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	2,200	35.64	78,408.00
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	1,100	15.55	17,105.00
BY-HEALTH CO LTD-A	1,300	19.34	25,142.00
YUNNAN BOTANEE BIO-TECHNOL-A	400	96.72	38,688.00
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	13,168	18.08	238,077.44
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD-A	1,000	47.51	47,510.00
CHINA MEHECO CO LTD -A	2,240	13.00	29,120.00
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	3,300	31.19	102,927.00
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	700	63.09	44,163.00
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	2,940	37.63	110,632.20
IRAY TECHNOLOGY CO LTD-A	280	236.31	66,166.80
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	1,180	22.04	26,007.20
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A	500	33.68	16,840.00
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	5,960	9.58	57,096.80
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	1,900	18.79	35,701.00
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	8,380	6.57	55,056.60
OVCTEK CHINA INC-A	920	27.00	24,840.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	4,400	19.25	84,700.00
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	1,900	271.80	516,420.00
SHENZHEN NEW INDUSTRIES BI-A	1,000	53.99	53,990.00

TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	300	106.10	31,830.00
APELOA PHARMACEUTICAL CO-A	900	17.42	15,678.00
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	680	123.50	83,980.00
BEIJING TIAN TAN BIOLOGICAL-A	3,300	24.18	79,794.00
BEIJING TONGRENTANG CO-A	2,300	56.28	129,444.00
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	1,015	60.77	61,681.55
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	300	45.10	13,530.00
BGI GENOMICS CO LTD-A	300	54.03	16,209.00
BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY COR-A	800	97.35	77,880.00
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	700	137.82	96,474.00
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	1,500	48.18	72,270.00
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	4,050	44.79	181,399.50
DAAN GENE CO LTD-A	960	9.95	9,552.00
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	1,200	51.67	62,004.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	300	63.01	18,903.00
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	4,680	21.81	102,070.80
HUBEI JUMPCAN PHARMACEUT-A	1,300	26.24	34,112.00
HUMANWELL HEALTHCARE GROUP-A	3,800	22.04	83,752.00
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	300	430.72	129,216.00
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	11,016	39.95	440,089.20
JOINCARE PHARMACEUTICAL GR-A	1,600	11.45	18,320.00
JOINN LABORATORIES CHINA C-A	1,097	25.38	27,841.86
LIVZON PHARMACEUTICAL GROU-A	500	33.51	16,755.00
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	1,098	12.99	14,263.02
PHARMARON BEIJING CO LTD-A	3,675	27.18	99,886.50
PORTON PHARMA SOLUTIONS L-A	800	25.54	20,432.00
SHANDONG BUCHANG PHARMACEU-A	260	18.77	4,880.20
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	3,600	28.76	103,536.00
SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCE-A	835	39.25	32,773.75
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	10,500	7.07	74,235.00
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	960	28.21	27,081.60
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	1,700	27.84	47,328.00
SHIJIAZHANG YILING PHARMA-A	2,600	22.89	59,514.00
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	2,400	26.65	63,960.00
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	3,000	25.53	76,590.00
WUXI APPTEC CO LTD-A	3,728	77.77	289,926.56
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	2,960	52.68	155,932.80
ZHANGZHOU PIENZHEHUANG PHA-A	900	282.90	254,610.00
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	1,210	17.63	21,332.30
ZHEJIANG JIUZHOU PHARMACEU-A	1,300	26.15	33,995.00
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	5,463	16.06	87,735.78
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A	400	33.40	13,360.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	125,400	3.49	437,646.00

BANK OF BEIJING CO LTD -A	32,600	4.52	147,352.00
BANK OF CHANGSHA CO LTD-A	7,500	8.27	62,025.00
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	5,400	13.86	74,844.00
BANK OF CHINA LTD-A	52,600	3.78	198,828.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	62,200	5.57	346,454.00
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	13,000	11.63	151,190.00
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	23,800	7.12	169,456.00
BANK OF NANJING CO LTD -A	15,500	8.46	131,130.00
BANK OF NINGBO CO LTD -A	9,900	27.35	270,765.00
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	24,610	6.08	149,628.80
BANK OF SUZHOU CO LTD-A	5,100	6.94	35,394.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	9,200	5.96	54,832.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	78,400	3.06	239,904.00
CHINA MERCHANTS BANK-A	34,000	31.88	1,083,920.00
CHINA MINSHENG BANKING-A	46,000	3.97	182,620.00
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	21,970	2.65	58,220.50
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-A	8,500	3.84	32,640.00
HUAXIA BANK CO LTD-A	24,300	5.58	135,594.00
IND & COMM BK OF CHINA-A	94,400	4.61	435,184.00
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	35,300	15.94	562,682.00
PING AN BANK CO LTD-A	34,400	11.56	397,664.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	42,400	4.89	207,336.00
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	44,600	7.07	315,322.00
SHANGHAI RURAL COMMERCIAL -A	13,500	5.81	78,435.00
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A	13,900	3.84	53,376.00
BOC INTERNATIONAL CHINA CO-A	3,000	11.90	35,700.00
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	8,800	8.59	75,592.00
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	6,800	6.49	44,132.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-A	8,000	12.40	99,200.00
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	3,000	8.99	26,970.00
CHINA INTERNATIONAL CAPTAL-A	3,500	40.83	142,905.00
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	11,900	14.93	177,667.00
CITIC SECURITIES CO-A	21,500	23.97	515,355.00
CSC FINANCIAL CO LTD-A	7,500	26.91	201,825.00
DONGXING SECURITIES CO LT-A	6,200	8.83	54,746.00
EAST MONEY INFORMATION CO-A	27,812	16.07	446,938.84
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	6,600	17.67	116,622.00
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	500	6.33	3,165.00
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	17,000	7.50	127,500.00
GF SECURITIES CO LTD-A	9,500	15.85	150,575.00
GUANGZHOU YUEXIU CAPITAL H-A	4,374	7.20	31,492.80
GUOLIAN SECURITIES CO LTD-A	2,200	11.42	25,124.00
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	11,300	9.92	112,096.00

GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	12,000	15.30	183,600.00
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	9,500	7.42	70,490.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	18,700	10.48	195,976.00
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	1,000	173.98	173,980.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	13,100	17.24	225,844.00
HUAXI SECURITIES CO LTD-A	300	9.25	2,775.00
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	16,300	6.96	113,448.00
NANJING SECURITIES CO LTD	7,600	8.77	66,652.00
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	10,800	10.63	114,804.00
SDIC CAPITAL CO LTD-A	11,000	7.80	85,800.00
SHANXI SECURITIES CO LTD-A	400	6.43	2,572.00
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	45,600	4.82	219,792.00
SINOLINK SECURITIES CO LTD-A	7,700	9.90	76,230.00
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	9,700	8.90	86,330.00
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	3,800	4.53	17,214.00
WESTERN SECURITIES CO LTD-A	10,000	7.10	71,000.00
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	6,000	10.83	64,980.00
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD-A	10,500	7.87	82,635.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	4,500	36.11	162,495.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	11,100	28.52	316,572.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	3,800	42.83	162,754.00
PICC HOLDING CO-A	15,500	6.01	93,155.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	16,500	47.52	784,080.00
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	11,700	10.88	127,296.00
BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	800	368.41	294,728.00
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	4,674	13.34	62,351.16
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	1,170	50.39	58,956.30
DHC SOFTWARE CO LTD -A	400	6.58	2,632.00
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	3,073	37.23	114,407.79
IFLYTEK CO LTD - A	3,600	56.68	204,048.00
NAVINFO CO LTD-A	4,800	10.80	51,840.00
QI AN XIN TECHNOLOGY GROUP-A	1,252	49.32	61,748.64
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	900	109.18	98,262.00
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	2,995	49.00	146,755.00
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	900	80.42	72,378.00
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	5,908	17.10	101,026.80
AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A	2,300	21.38	49,174.00
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	57,300	3.86	221,178.00
CETC CYBERSPACE SECURITY T-A	1,300	25.24	32,812.00
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	4,500	31.46	141,570.00
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	6,700	11.27	75,509.00
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-A	11,000	6.01	66,110.00
CHINA ZHENHUA GROUP SCIENC-A	1,200	89.46	107,352.00

FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	17,600	20.10	353,760.00
GOERTEK INC -A	6,100	16.01	97,661.00
GRG BANKING EQUIPMENT CO -A	2,200	11.41	25,102.00
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	6,900	5.81	40,089.00
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICAT-A	300	10.05	3,015.00
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	1,500	54.63	81,945.00
HENGDIAN GROUP DMEGC -A	2,700	16.46	44,442.00
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO-A	3,700	14.16	52,392.00
HUAGONG TECH CO LTD-A	2,700	32.50	87,750.00
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	2,400	40.91	98,184.00
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	9,600	11.36	109,056.00
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	10,433	31.01	323,527.33
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	576	115.55	66,556.80
NINESTAR CORP-A	1,800	30.50	54,900.00
RAYTRON TECHNOLOGY CO LTD-A	700	47.73	33,411.00
SHANGHAI FRIENDESS ELECTRO-A	280	244.99	68,597.20
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	2,300	14.45	33,235.00
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	780	71.40	55,692.00
SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY-A	3,500	16.73	58,555.00
SHENZHEN SUNLORD ELECTRONI-A	800	25.70	20,560.00
SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	1,794	124.88	224,034.72
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	3,300	18.83	62,139.00
TIANJIN712 COMMUNICATION &-A	700	27.47	19,229.00
TIANMA MICROELECTRONICS-A	2,400	8.70	20,880.00
UNISPLENDOR CORP LTD-A	4,876	25.24	123,070.24
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	2,700	43.24	116,748.00
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	3,464	7.61	26,361.04
WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHA-A	1,760	20.42	35,939.20
XIAMEN FARATRONIC CO LTD-A	400	124.94	49,976.00
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	2,240	34.74	77,817.60
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	6,300	19.62	123,606.00
ZHEJIANG SUPCON TECHNOLOGY-A	870	51.67	44,952.90
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	1,700	115.51	196,367.00
ZTE CORP-A	6,400	34.61	221,504.00
CHINA UNITED NETWORK-A	46,500	5.06	235,290.00
CECEP SOLAR ENERGY CO LT-A	6,500	6.19	40,235.00
CECEP WIND POWER CORP-A	7,900	3.49	27,571.00
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	32,500	7.23	234,975.00
CHINA THREE GORGES RENEWAB-A	42,200	5.14	216,908.00
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	35,300	22.06	778,718.00
DATANG INTL POWER GEN CO-A	20,000	2.94	58,800.00
ENN NATURAL GAS CO LTD-A	4,800	18.51	88,848.00
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	31,000	3.56	110,360.00

HUADIAN POWER INTL CORP-A	12,500	5.58	69,750.00
HUANENG POWER INTL INC-A	18,200	8.96	163,072.00
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	13,800	13.04	179,952.00
SHANGHAI ELECTRIC POWER CO-A	7,100	9.75	69,225.00
SHENZHEN ENERGY GROUP CO L-A	11,600	6.54	75,864.00
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A	5,200	15.03	78,156.00
ZHEJIANG ZHENENG ELECTRIC-A	21,300	4.71	100,323.00
3PEAK INC-A	200	175.77	35,154.00
ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	943	134.50	126,833.50
AMLOGIC SHANGHAI INC-A	600	84.84	50,904.00
CAMBRICON TECHNOLOGIES-A	800	151.40	121,120.00
CHINA RESOURCES MICROELECT-A	2,200	54.42	119,724.00
FLAT GLASS GROUP CO LTD-A	2,300	32.20	74,060.00
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR I-A	1,356	93.77	127,152.12
HANGZHOU CHANG CHUAN TECHN-A	1,300	35.35	45,955.00
HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	2,352	30.40	71,500.80
HANGZHOU LION ELECTRONICS -A	1,000	32.85	32,850.00
HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	2,000	25.58	51,160.00
INGENIC SEMICONDUCTOR CO -A	1,200	73.80	88,560.00
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	4,312	28.11	121,210.32
JCET GROUP CO LTD-A	3,800	30.40	115,520.00
JIANGSU PACIFIC QUARTZ CO -A	700	90.94	63,658.00
JINKO SOLAR CO LTD-A	13,400	10.71	143,514.00
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	12,936	27.91	361,043.76
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A	1,514	48.62	73,610.68
NATIONAL SILICON INDUSTRY -A	5,600	20.65	115,640.00
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	900	257.00	231,300.00
RISEN ENERGY CO LTD-A	2,400	20.10	48,240.00
SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	9,900	16.56	163,944.00
SG MICRO CORP-A	1,007	74.28	74,799.96
SHANGHAI AIKO SOLAR ENERGY-A	3,220	22.31	71,838.20
SHANGHAI FUDAN MICROELE-DO-A	800	51.50	41,200.00
SHENZHEN SC NEW ENERGY TEC-A	300	88.70	26,610.00
STARPOWER SEMICONDUCTOR LT-A	200	199.00	39,800.00
TCL ZHONGHUAN RENEWABLE EN-A	5,375	26.09	140,233.75
TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	1,900	8.88	16,872.00
TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	3,200	18.87	60,384.00
TONGWEI CO LTD-A	6,600	32.45	214,170.00
TRINA SOLAR CO LTD-A	3,200	34.88	111,616.00
UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	1,819	87.43	159,035.17
VERISILICON MICROELECTRONI-A	1,000	63.56	63,560.00
WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	2,185	88.23	192,782.55
WUXI AUTOWELL TECHNOLOGY C-A	400	160.52	64,208.00

	XINJIANG DAQO NEW ENERGY C-A	3,600	39.88	143,568.00	
	YANGZHOU YANGJIE ELECTRONI-A	700	35.00	24,500.00	
	ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	1,800	55.97	100,746.00	
	CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	12,100	13.90	168,190.00	
	CHINA VANKE CO LTD -A	16,400	14.31	234,684.00	
	GEMDALE CORP-A	7,200	7.81	56,232.00	
	HAINAN AIRPORT INFRASTRUCT-A	21,800	4.06	88,508.00	
	HANGZHOU BINJIANG REAL EST-A	5,600	10.36	58,016.00	
	POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	17,400	14.16	246,384.00	
	SHANGHAI LINGANG HOLDINGS-A	1,680	12.24	20,563.20	
	YOUNGOR GROUP CO-A	3,100	6.97	21,607.00	
	ZHEJIANG CHINA COMMODITIES-A	13,000	8.71	113,230.00	
	オフショア人民元 小計	4,123,031		60,939,528.59 (1,211,514,392)	
サウジアラビア リアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	7,849	10.64	83,513.36	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	70,868	35.00	2,480,380.00	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	3,568	42.30	150,926.40	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	8,294	13.20	109,480.80	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	6,122	137.20	839,938.40	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	10,211	36.90	376,785.90	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	34,492	41.30	1,424,519.60	
	SAUDI ARAMCO BASE OIL CO	1,374	142.60	195,932.40	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	23,960	88.00	2,108,480.00	
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	9,618	25.15	241,892.70	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	18,931	12.48	236,258.88	
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	7,669	43.70	335,135.30	
	SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	1,076	176.60	190,021.60	
	JARIR MARKETING CO	14,720	15.10	222,272.00	
	NAHDI MEDICAL CO	871	154.60	134,656.60	
	ALMARAI CO	6,924	66.80	462,523.20	
	SAVOLA	6,673	37.00	246,901.00	
	DALLAH HEALTHCARE CO	835	151.80	126,753.00	
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	2,355	261.80	616,539.00	
	MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	2,644	113.60	300,358.40	
	AL RAJHI BANK	51,979	73.10	3,799,664.90	
	ALINMA BANK	24,489	36.05	882,828.45	
	ARAB NATIONAL BANK	16,584	26.25	435,330.00	
	BANK AL-JAZIRA	11,133	17.96	199,948.68	
	BANK ALBILAD	13,423	41.95	563,094.85	
	BANQUE SAUDI FRANSI	16,111	38.70	623,495.70	
	RIYAD BANK	38,641	30.50	1,178,550.50	
	SAUDI AWWAL BANK	26,419	36.00	951,084.00	
	SAUDI INVESTMENT BANK/THE	13,432	16.74	224,851.68	

THE SAUDI NATIONAL BANK	78,054	35.90	2,802,138.60	
SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING	1,363	183.60	250,246.80	
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	1,990	209.80	417,502.00	
ARABIAN INTERNET & COMMUNICA	542	327.00	177,234.00	
ELM CO	642	706.00	453,252.00	
ETIHAD ETISALAT CO	10,475	45.20	473,470.00	
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	13,459	12.92	173,890.28	
SAUDI TELECOM CO	52,586	40.75	2,142,879.50	
ACWA POWER CO	2,007	188.80	378,921.60	
SAUDI ELECTRICITY CO	21,376	21.10	451,033.60	
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	14,772	18.48	272,986.56	
EMAAR ECONOMIC CITY	8,295	9.00	74,655.00	
サウジアラビアリアル 小計	656,826		27,810,327.24 (1,079,596,903)	
合計	159,114,546		25,045,138,836 (25,045,138,836)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	76,400	1,943,616.00	
		OPERADORA DE SITES MEX- A-1	33,000	532,950.00	
		メキシコペソ 小計	109,400	2,476,566.00 (21,138,233)	
	南アフリカランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	81,251	950,636.70	
		南アフリカランド 小計	81,251	950,636.70 (7,291,383)	
合計				28,429,616 (28,429,616)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式 39銘柄	100.0%		2.5%
メキシコペソ	株式 21銘柄	97.0%		2.8%
	投資証券 2銘柄		3.0%	0.1%
ブラジルリアル	株式 47銘柄	100.0%		5.4%
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%
英ポンド	株式 1銘柄			
トルコリラ	株式 18銘柄	100.0%		0.7%
チェココルナ	株式 3銘柄	100.0%		0.2%

ハンガリーフォリント	株式	3銘柄	100.0%		0.3%
ポーランドズロチ	株式	14銘柄	100.0%		0.8%
ロシアルーブル	株式	14銘柄			
香港ドル	株式	193銘柄	100.0%		22.6%
マレーシアリングット	株式	33銘柄	100.0%		1.4%
タイバーツ	株式	42銘柄	100.0%		2.0%
フィリピンペソ	株式	14銘柄	100.0%		0.6%
インドネシアルピア	株式	22銘柄	100.0%		2.0%
韓国ウォン	株式	102銘柄	100.0%		12.1%
新台湾ドル	株式	90銘柄	100.0%		15.0%
インドルピー	株式	114銘柄	100.0%		14.9%
カタールリアル	株式	13銘柄	100.0%		1.0%
南アフリカランド	株式	36銘柄	99.1%		3.2%
	投資証券	1銘柄		0.9%	0.0%
アラブディルハム	株式	11銘柄	100.0%		1.4%
クウェートディナール	株式	7銘柄	100.0%		0.8%
オフショア人民元	株式	521銘柄	100.0%		4.8%
サウジアラビアリアル	株式	41銘柄	100.0%		4.3%

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

R M国内リートマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2023年 8月21日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	502,992,779
投資証券	45,487,947,400
未収配当金	317,690,351
前払金	4,180,100
差入委託証拠金	44,378,500
流動資産合計	46,357,189,130
資産合計	46,357,189,130
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	6,764,610
未払金	69,085,460
未払解約金	31,654,150
未払利息	1,364
流動負債合計	107,505,584
負債合計	107,505,584
純資産の部	
元本等	
元本	32,289,660,802
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	13,960,022,744
元本等合計	46,249,683,546

2023年 8月21日現在

純資産合計	46,249,683,546
負債純資産合計	46,357,189,130

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2023年 8月21日現在

1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 8月23日
期首元本額	21,244,694,454円
期中追加設定元本額	24,030,493,086円
期中一部解約元本額	12,985,526,738円
期末元本額	32,289,660,802円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	1,025,657,749円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	1,356,881,495円
りそなラップ型ファンド(成長型)	1,661,353,706円
DCりそな グローバルバランス	28,693,532円
つみたてバランスファンド	2,544,672,535円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	264,718,090円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	199,938,660円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	138,685,653円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	71,288,548円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	48,706,686円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	27,185,280円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	56,581,123円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	141,797,159円
九州SDGs・グローバルバランス	60,668,299円
りそな国内リートインデックス(ラップ専用)	1,566,680,043円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定型)	4,290,382円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定成長型)	49,394,892円
ラップ型ファンド・プラスESG(成長型)	54,389,795円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定型)	11,475,961円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定成長型)	21,643,447円
りそな つみたてラップ型ファンド(成長型)	23,324,071円
りそな つみたてリスクコントロールファンド	3,311,561円
ターゲットリターンバランスファンド(目標2%)	16,920円
ターゲットリターンバランスファンド(目標3%)	19,643円
ターゲットリターンバランスファンド(目標4%)	39,029円
ターゲットリターンバランスファンド(目標5%)	64,622円
ターゲットリターンバランスファンド(目標6%)	180,295円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2065	33,508円
FWりそな国内リートインデックスオープン	7,362,952,526円
FWりそな国内リートインデックスファンド	6,420,271,152円
Smart-i Jリートインデックス	3,204,967,498円
Smart-i 8資産バランス 安定型	64,448,907円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	220,475,980円
Smart-i 8資産バランス 成長型	299,080,363円
J-REITインデックスファンド(適格機関投資家専用)	4,182,736,555円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	162,109,460円
りそなVIGlobal・バランスファンド(安定型)(適格機関投資家専用)	5,017,713円

りそなV I グローバル・バランスファンド（安定成長型）（適格機関投資家専用）	20,491,680円
りそなV I グローバル・バランスファンド（成長型）（適格機関投資家専用）	19,704,480円
りそなD A A マルチアセットファンド（適格機関投資家専用）	5,532,158円
りそなマルチアセットファンド（適格機関投資家専用）	14,177,252円
りそなD A A ファンド（適格機関投資家専用）	14,832円
J - R E I T インデックスファンド202102（適格機関投資家専用）	136,541,799円
りそなD A A ファンド202205（適格機関投資家専用）	333,595,909円
りそなF T グローバルリートファンド202307（適格機関投資家専用）	475,849,854円
2. 計算日における受益権の総数	32,289,660,802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	1.4323円
(10,000口当たり純資産額)	(14,323円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2023年 8月21日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、リートの価格変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

金融商品の時価等に関する事項

2023年 8月21日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	投資証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 デリバティブ取引 (その他の注記)の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

2023年 8月21日現在	
該当事項はありません。	

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2023年 8月21日現在	
	損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券		203,931,648
合計		203,931,648

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

2 デリバティブ取引に関する注記

(投資証券関連)

(2023年 8月21日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	不動産投信指数先物取引 買建	723,858,610	-	717,094,000	6,764,610
	合計	723,858,610	-	717,094,000	6,764,610

(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ではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	883	100,043,900	
	サンケイリアルエステート投資法人	1,391	128,389,300	
	S O S i L A 物流リート投資法人	2,167	274,558,900	
	東海道リート投資法人	646	76,551,000	
	日本アコモデーションファンド投資法人	1,499	971,352,000	
	森ヒルズリート投資法人	5,106	733,221,600	
	産業ファンド投資法人	6,626	932,940,800	
	アドバンス・レジデンス投資法人	4,125	1,398,375,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	3,188	700,722,400	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	2,278	908,922,000	
	G L P 投資法人	14,668	2,010,982,800	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	2,135	701,347,500	
	日本プロロジスリート投資法人	7,565	2,121,226,000	
	星野リゾート・リート投資法人	801	511,038,000	
	O n e リート投資法人	757	191,293,900	
	イオンリート投資法人	5,327	775,078,500	
	ヒューリックリート投資法人	4,063	663,487,900	
	日本リート投資法人	1,410	475,170,000	
	積水ハウス・リート投資法人	13,049	1,071,322,900	
	トーセイ・リート投資法人	914	122,201,800	
ケネディクス商業リート投資法人	1,888	528,828,800		
ヘルスケア&メディカル投資法人	1,071	154,652,400		
サムティ・レジデンシャル投資法人	1,183	132,022,800		

野村不動産マスターファンド投資法人	14,043	2,378,884,200	
いちごホテルリート投資法人	719	81,462,700	
ラサールロジポート投資法人	5,551	820,437,800	
スターアジア不動産投資法人	6,692	364,044,800	
マリモ地方創生リート投資法人	669	83,022,900	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	1,806	853,335,000	
大江戸温泉リート投資法人	664	42,960,800	
投資法人みらい	5,553	259,325,100	
三菱地所物流リート投資法人	1,499	583,860,500	
C R E ロジスティクスファンド投資法人	1,869	306,889,800	
ザイマックス・リート投資法人	704	82,016,000	
タカラレーベン不動産投資法人	2,059	195,193,200	
アドバンス・ロジスティクス投資法人	1,903	245,487,000	
日本ビルファンド投資法人	5,066	2,958,544,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	4,461	2,560,614,000	
日本都市ファンド投資法人	20,815	2,004,484,500	
オリックス不動産投資法人	8,652	1,559,955,600	
日本プライムリアルティ投資法人	2,970	1,057,320,000	
N T T 都市開発リート投資法人	4,174	563,907,400	
東急リアル・エステート投資法人	2,911	526,308,800	
グローバル・ワン不動産投資法人	3,206	367,087,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	9,714	1,473,613,800	
森トラストリート投資法人	8,370	604,314,000	
インヴィンシブル投資法人	21,025	1,255,192,500	
フロンティア不動産投資法人	1,611	745,087,500	
平和不動産リート投資法人	3,244	451,889,200	
日本ロジスティクスファンド投資法人	2,782	823,472,000	
福岡リート投資法人	2,246	366,098,000	
ケネディクス・オフィス投資法人	2,527	842,754,500	
いちごオフィスリート投資法人	3,558	314,883,000	
大和証券オフィス投資法人	900	585,900,000	
阪急阪神リート投資法人	2,070	288,144,000	
スターツプロシード投資法人	753	158,883,000	
大和ハウスリート投資法人	6,546	1,811,932,800	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	14,004	1,046,098,800	
大和証券リビング投資法人	6,024	659,628,000	
ジャパンエクセレント投資法人	3,774	481,185,000	
合計	267,874	45,487,947,400	

(注) 券面総額欄の数値は口数を表しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

R M先進国リートマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2023年 8月21日現在

資産の部	
流動資産	
預金	330,347,552
コール・ローン	61,354,703
株式	588,060,121
投資証券	57,861,333,604
派生商品評価勘定	9,605
未収入金	6,620,859
未収配当金	124,587,190
流動資産合計	58,972,313,634
資産合計	58,972,313,634
負債の部	
流動負債	
未払解約金	62,267,925
未払利息	166
流動負債合計	62,268,091
負債合計	62,268,091
純資産の部	
元本等	
元本	39,814,547,515
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	19,095,498,028
元本等合計	58,910,045,543
純資産合計	58,910,045,543
負債純資産合計	58,972,313,634

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2023年 8月21日現在

1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 8月23日
期首元本額	19,547,199,916円
期中追加設定元本額	32,875,480,928円
期中一部解約元本額	12,608,133,329円
期末元本額	39,814,547,515円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	1,095,912,905円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	1,710,967,750円
りそなラップ型ファンド(成長型)	2,559,398,627円
DCりそな グローバルバランス	28,193,527円
つみたてバランスファンド	1,198,394,055円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	541,769,255円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	385,879,347円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	266,244,047円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	137,014,554円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	93,451,076円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	52,111,743円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	108,415,468円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	265,185,503円
九州SDGs・グローバルバランス	117,160,311円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定型)	4,640,386円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定成長型)	67,705,611円
ラップ型ファンド・プラスESG(成長型)	68,556,315円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定型)	12,482,970円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定成長型)	30,363,431円
りそな つみたてラップ型ファンド(成長型)	37,632,392円
りそな つみたてリスクコントロールファンド	1,189,935円
ターゲットリターンバランスファンド(目標2%)	32,912円
ターゲットリターンバランスファンド(目標3%)	38,184円
ターゲットリターンバランスファンド(目標4%)	75,488円
ターゲットリターンバランスファンド(目標5%)	124,887円
ターゲットリターンバランスファンド(目標6%)	348,065円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2065	64,666円
FWりそな先進国リートインデックスオープン	14,048,255,004円
FWりそな先進国リートインデックスファンド	12,266,241,475円
Smart-i 先進国リートインデックス	2,771,113,980円
Smart-i 8資産バランス 安定型	137,246,955円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	443,871,291円
Smart-i 8資産バランス 成長型	573,643,268円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	141,140,145円
りそなVIグローバル・バランスファンド(安定型)(適格機関投資家専用)	5,546,847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)	13,968,531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)	100,889,084円
りそなDAAマルチアセットファンド(適格機関投資家専用)	22,593,173円
りそなマルチアセットファンド(適格機関投資家専用)	13,745,742円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	28,474円
りそなDAAファンド202205(適格機関投資家専用)	298,877,374円
りそなFT グローバルリートファンド202307(適格機関投資家専用)	194,032,762円
2. 計算日における受益権の総数	39,814,547,515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	1.4796円
(10,000口当たり純資産額)	(14,796円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2023年 8月21日現在

- 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。
- 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

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

金融商品の時価等に関する事項

2023年 8月21日現在

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

ん。

2. 時価の算定方法

株式、投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

デリバティブ取引

（その他の注記）の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

2023年 8月21日現在

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2023年 8月21日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式	16,133,913	
投資証券	2,806,345,651	
合計	2,790,211,738	

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

2 デリバティブ取引に関する注記

(通貨関連)

(2023年 8月21日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	69,985,800	-	69,989,044	3,244
		米ドル	54,181,010	-	54,182,464
	ユーロ	15,804,790	-	15,806,580	1,790
	売建	3,057,810	-	3,051,449	6,361
		米ドル	3,057,810	-	3,051,449
	合計		73,043,610	-	73,040,493

(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	AMERICOLD REALTY TRUST INC	87,951	32.01	2,815,311.51	
	BROADSTONE NET LEASE INC-A	61,138	16.03	980,042.14	
	STAR HOLDINGS	3,563	13.22	47,102.86	
米ドル 小計		152,652		3,842,456.51 (558,424,204)	
オーストラリアドル	CENTURIA CAPITAL GROUP	222,365	1.43	317,981.95	
オーストラリアドル 小計		222,365		317,981.95 (29,635,917)	
合計		375,017		588,060,121 (588,060,121)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	ACADIA REALTY TRUST	31,077	455,278.05	
		AGREE REALTY CORP	30,188	1,852,637.56	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	22,884	410,767.80	
		ALEXANDER'S INC	738	135,024.48	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	51,174	5,890,127.40	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	3,468	58,713.24	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	16,990	355,091.00	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	102,151	3,585,500.10	
		APARTMENT INCOME REIT CO	48,219	1,595,566.71	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	48,768	385,754.88	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	69,391	1,020,741.61	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	21,671	245,749.14	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	12,741	36,311.85	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	46,138	8,273,004.78	
		BLUEROCK HOMES TRUST INC	607	8,649.75	
		BOSTON PROPERTIES INC	46,198	2,924,333.40	

BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	21,236	51,603.48	
BRANDYWINE REALTY TRUST	55,191	255,534.33	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	97,325	2,100,273.50	
BRT APARTMENTS CORP	3,225	59,211.00	
CAMDEN PROPERTY TRUST	34,709	3,685,748.71	
CARETRUST REIT INC	31,518	623,110.86	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	8,439	183,463.86	
CENTERSPACE	4,898	296,231.04	
CHATHAM LODGING TRUST	17,055	157,588.20	
CITY OFFICE REIT INC	14,501	70,039.83	
CLIPPER REALTY INC	2,188	13,346.80	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	8,122	260,391.32	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	36,572	915,762.88	
COUSINS PROPERTIES INC	49,201	1,077,501.90	
CTO REALTY GROWTH INC	6,920	114,387.60	
CUBESMART	72,731	3,005,244.92	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	69,020	542,497.20	
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	92,300	48,919.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	94,644	11,484,102.96	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	82,808	244,283.60	
DOUGLAS EMMETT INC	55,281	715,888.95	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	82,000		
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	29,974	405,248.48	
EASTGROUP PROPERTIES INC	14,461	2,548,172.81	
ELME COMMUNITIES	28,983	444,889.05	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	42,453	352,784.43	
EPR PROPERTIES	24,436	1,064,676.52	
EQUINIX INC	30,377	22,775,763.29	
EQUITY COMMONWEALTH	35,876	674,110.04	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	56,903	3,801,120.40	
EQUITY RESIDENTIAL	110,810	7,075,218.50	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	48,291	1,134,355.59	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	20,861	4,929,662.91	
EXTRA SPACE STORAGE INC	68,617	8,704,752.62	
FARMLAND PARTNERS INC	15,087	163,995.69	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	23,882	2,302,702.44	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	42,813	2,171,047.23	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	27,857	691,967.88	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	33,544	60,714.64	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	85,362	3,921,530.28	
GETTY REALTY CORP	14,649	442,839.27	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	13,837	180,434.48	
GLADSTONE LAND CORP	11,212	174,010.24	

GLOBAL MEDICAL REIT INC	21,276	196,377.48	
GLOBAL NET LEASE INC	33,604	359,226.76	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	123,875	2,087,293.75	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	177,827	3,572,544.43	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	8,823	57,173.04	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	34,295	768,893.90	
HOST HOTELS & RESORTS INC	230,278	3,709,778.58	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	39,736	232,455.60	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	73,085	1,173,014.25	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	17,584	69,105.12	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	8,924	680,633.48	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	21,401	498,429.29	
INVITATION HOMES INC	188,908	6,320,861.68	
IRON MOUNTAIN INC	94,767	5,601,677.37	
JBG SMITH PROPERTIES	30,544	433,724.80	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	274,900	74,223.00	
KILROY REALTY CORP	34,224	1,185,861.60	
KIMCO REALTY CORP	201,600	3,848,544.00	
KITE REALTY GROUP TRUST	71,081	1,566,625.24	
LTC PROPERTIES INC	13,323	424,337.55	
LXP INDUSTRIAL TRUST	94,968	898,397.28	
MACERICH CO/THE	70,317	817,786.71	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	635,700	50,220.30	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	193,545	1,341,266.85	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	37,914	5,451,274.92	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	26,147	848,470.15	
NATL HEALTH INVESTORS INC	14,162	708,949.72	
NECESSITY RETAIL REIT INC/TH	42,346	296,845.46	
NETSTREIT CORP	18,899	325,062.80	
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES	11,428	122,736.72	
NEXPOINT RESIDENTIAL	7,337	272,863.03	
NNN REIT INC	59,265	2,293,555.50	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	17,029	117,329.81	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	75,791	2,304,804.31	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	5,669	110,602.19	
ORION OFFICE REIT INC	19,499	116,409.03	
PARAMOUNT GROUP INC	52,275	247,783.50	
PARK HOTELS & RESORTS INC	70,332	904,469.52	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	40,092	585,343.20	
PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	38,045	1,302,660.80	
PHYSICIANS REALTY TRUST	77,193	1,052,912.52	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	39,816	258,804.00	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	12,349	269,949.14	

	POSTAL REALTY TRUST INC- A	6,456	92,256.24
	PRIME US REIT	183,100	28,929.80
	PROLOGIS INC	299,967	36,436,991.49
	PUBLIC STORAGE	51,400	14,054,816.00
	REALTY INCOME CORP	218,732	12,445,850.80
	REGENCY CENTERS CORP	53,254	3,265,002.74
	RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	41,175	552,568.50
	REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	65,006	3,330,257.38
	RLJ LODGING TRUST	50,339	487,281.52
	RPT REALTY	27,355	265,343.50
	RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	19,273	1,622,208.41
	SABRA HEALTH CARE REIT INC	75,388	903,902.12
	SAFEHOLD INC	12,956	259,120.00
	SAUL CENTERS INC	4,442	163,598.86
	SERVICE PROPERTIES TRUST	52,270	432,795.60
	SIMON PROPERTY GROUP INC	106,242	12,281,575.20
	SITE CENTERS CORP	59,534	778,109.38
	SL GREEN REALTY CORP	21,051	679,105.26
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	45,775	1,732,583.75
	STAG INDUSTRIAL INC	58,074	2,037,816.66
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	33,606	188,865.72
	SUN COMMUNITIES INC	40,433	4,890,775.68
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	68,000	601,120.00
	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	34,405	810,925.85
	TERRENO REALTY CORP	24,017	1,390,103.96
	UDR INC	100,586	3,863,508.26
	UMH PROPERTIES INC	18,720	281,736.00
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	4,387	203,688.41
	URBAN EDGE PROPERTIES	37,301	589,355.80
	VENTAS INC	130,004	5,454,967.84
	VERIS RESIDENTIAL INC	26,189	475,854.13
	VICI PROPERTIES INC	326,234	9,813,118.72
	VORNADO REALTY TRUST	52,358	1,104,753.80
	WELLTOWER INC	161,467	13,111,120.40
	WHITESTONE REIT	15,983	155,674.42
	WP CAREY INC	69,537	4,445,500.41
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	35,531	401,144.99
	米ドル 小計	8,263,292	310,349,986.46 (45,103,163,532)
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	20,562	423,782.82
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	20,272	139,674.08
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	5,322	60,670.80
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	7,377	500,160.60

	BSR REAL ESTATE INVESTMENT T	6,564	111,916.20
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	14,969	48,649.25
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	26,590	1,298,655.60
	CHOICE PROPERTIES REIT	52,611	694,465.20
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	15,851	205,745.98
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	16,684	243,419.56
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	39,654	538,104.78
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	5,350	68,212.50
	EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	15,851	40,420.05
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	32,437	458,659.18
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	10,257	751,632.96
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	42,850	445,211.50
	INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	2,543	8,595.34
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	22,620	281,619.00
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	18,755	337,590.00
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	5,378	73,409.70
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	6,979	111,245.26
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	12,242	96,956.64
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	37,128	238,733.04
	PRIMARIS REIT	14,963	199,756.05
	PRO REAL ESTATE INVESTMENT T	8,626	44,768.94
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	47,761	916,055.98
	SLATE GROCERY REIT	10,423	132,789.02
	SLATE OFFICE REIT	6,335	10,326.05
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	23,279	567,774.81
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	16,181	40,614.31
	カナダドル 小計	566,414	9,089,615.20 (975,588,399)
ユーロ	AEDIFICA	15,227	870,984.40
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	2,209	10,912.46
	ALTAREA	1,602	133,606.80
	CARE PROPERTY INVEST	11,306	140,194.40
	CARMILA	18,272	261,655.04
	COFINIMMO	9,912	666,582.00
	COVIVIO	15,119	601,736.20
	CROMWELL REIT EUR	114,140	174,634.20
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	13,695	300,468.30
	GECINA SA	17,703	1,644,608.70
	HAMBORNER REIT AG	22,165	145,180.75
	ICADE	10,070	323,448.40
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	14,471	33,428.01
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	93,814	494,868.85
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	9,152	123,735.04

	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	132,455	122,388.42
	KLEPIERRE	63,217	1,492,553.37
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	19,976	114,862.00
	MERCIALYS	26,360	209,430.20
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	108,344	858,084.48
	MONTEA NV	4,410	309,141.00
	NSI NV	5,397	99,952.44
	RETAIL ESTATES	3,532	196,379.20
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	34,848	1,644,825.60
	VASTNED RETAIL NV	6,207	119,050.26
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	50,731	1,244,938.74
	WERELDHAVE NV	13,508	211,265.12
	XIOR STUDENT HOUSING NV	8,062	210,015.10
	ユーロ 小計	845,904	12,758,929.48 (2,017,441,929)
英債券	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	141,815	64,242.19
	AEW UK REIT PLC	42,887	40,828.42
	ASSURA PLC	972,570	428,125.31
	BALANCED COMM PROPERTY TRUST	252,276	165,745.33
	BIG YELLOW GROUP PLC	57,281	592,858.35
	BRITISH LAND CO PLC	302,823	940,568.23
	CLS HOLDINGS PLC	64,468	81,100.74
	CUSTODIAN PROPERTY INCOME REIT PLC	153,661	122,467.81
	DERWENT LONDON PLC	36,322	681,763.94
	EDISTON PROPERTY INVESTMENT	57,084	39,387.96
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	188,158	160,875.09
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	83,526	327,421.92
	HAMMERSON PLC	1,312,197	330,673.64
	HELICAL PLC	33,175	76,966.00
	HOME REIT PLC	147,401	56,086.08
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	142,814	122,105.97
	INTU PROPERTIES PLC	117,549	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	244,865	1,434,419.17
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	320,018	559,391.46
	LXI REIT PLC	558,595	492,680.79
	NEWRIVER REIT PLC	107,134	87,849.88
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	190,871	127,883.57
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	421,955	375,539.95
	PRS REIT PLC/THE	171,235	126,371.43
	REGIONAL REIT LTD	151,551	63,878.74
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	71,296	582,131.84
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	197,166	79,655.06
	SEGRO PLC	398,356	2,800,442.68

	SHAFTESBURY CAPITAL PLC	634,595	753,898.86
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	398,928	287,228.16
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	106,966	62,468.14
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	607,025	818,269.70
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	267,793	134,432.08
	UNITE GROUP PLC	140,090	1,265,713.15
	URBAN LOGISTICS REIT PLC	147,659	166,559.35
	WAREHOUSE REIT PLC	145,941	117,482.50
	WORKSPACE GROUP PLC	43,511	213,029.85
	英ボンド 小計	9,431,557	14,780,543.34 (2,738,539,070)
オーストラリアドル	ABACUS GROUP	126,889	150,997.91
	ABACUS STORAGE KING	126,889	154,804.58
	ARENA REIT	111,944	411,953.92
	BWP TRUST	155,714	548,113.28
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	176,579	536,800.16
	CENTURIA OFFICE REIT	150,261	198,344.52
	CHARTER HALL GROUP	153,730	1,598,792.00
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	212,716	750,887.48
	CHARTER HALL RETAIL REIT	169,064	583,270.80
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	102,691	275,211.88
	CROMWELL PROPERTY GROUP	432,684	218,505.42
	DEXUS INDUSTRIA REIT	71,835	191,799.45
	DEXUS/AU	350,498	2,712,854.52
	GDI PROPERTY GROUP	181,458	118,854.99
	GOODMAN GROUP	556,344	12,462,105.60
	GPT GROUP	621,294	2,565,944.22
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	88,398	211,271.22
	HEALTHCO REIT	136,880	201,213.60
	HMC CAPITAL LTD	77,093	392,403.37
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	507,628	583,772.20
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	67,652	208,368.16
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	119,014	479,626.42
	MIRVAC GROUP	1,285,701	3,047,111.37
	NATIONAL STORAGE REIT	397,707	874,955.40
	RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE	96,236	67,365.20
	REGION RE LTD	377,521	830,546.20
	RURAL FUNDS GROUP	133,000	259,350.00
	SCENTRE GROUP	1,680,919	4,437,626.16
	STOCKLAND	777,608	3,203,744.96
	VICINITY CENTRES	1,255,947	2,317,222.21
	WAYPOINT REIT	219,293	550,425.43
	オーストラリアドル 小計	10,921,187	41,144,242.63

ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	285,348	333,857.16
	GOODMAN PROPERTY TRUST	342,168	769,878.00
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	498,622	453,746.02
	PRECINCT PROPERTIES GROUP	432,348	553,405.44
	STRIDE STAPLED GROUP	186,933	267,314.19
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	159,328	368,047.68
ニュージーランドドル 小計		1,904,747	2,746,248.49 (236,506,919)
香港ドル	CHAMPION REIT	601,000	1,586,640.00
	FORTUNE REIT	470,000	2,467,500.00
	LINK REIT	828,600	31,735,380.00
	PROSPERITY REIT	431,000	689,600.00
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	345,000	900,450.00
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	795,000	1,152,750.00
香港ドル 小計		3,470,600	38,532,320.00 (715,159,859)
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LT	184,100	224,602.00
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	1,093,900	2,964,469.00
	CAPITALAND ASCOTT TRUST	695,096	702,046.96
	CAPITALAND CHINA TRUST	376,400	351,934.00
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	1,639,132	3,114,350.80
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	266,200	282,172.00
	DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	209,200	121,336.00
	EC WORLD REIT	50,000	14,500.00
	ESR-LOGOS REIT	2,101,050	661,830.75
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	321,400	197,661.00
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	461,400	117,657.00
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	352,100	771,099.00
	FRASERS LOGISTICS & COMMERC I	942,479	1,102,700.43
	KEPPEL DC REIT	432,200	907,620.00
	KEPPEL REIT	649,200	564,804.00
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	611,800	370,139.00
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	650,700	1,438,047.00
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,069,600	1,764,840.00
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA	750,400	1,140,608.00
	OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	779,700	202,722.00
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	126,100	481,702.00
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	188,100	129,789.00
	SPH REIT	333,900	302,179.50
	STARHILL GLOBAL REIT	435,300	213,297.00
	SUNTEC REIT	734,500	888,745.00
シンガポールドル 小計		15,453,957	19,030,851.44 (2,038,204,189)

韓国ウォン	D&D PLATFORM REIT CO LTD	15,215	45,264,625.00
	E KOCREF CR-REIT CO LTD	3,951	19,695,735.00
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	43,823	170,033,240.00
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	16,308	69,961,320.00
	JR REIT XXVII	47,106	179,709,390.00
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	14,612	77,589,720.00
	LOTTE REIT CO LTD	44,180	149,328,400.00
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	34,232	137,099,160.00
	NH ALL-ONE REIT CO LTD	11,869	36,378,485.00
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	26,417	158,237,830.00
	SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LT	4,632	14,498,160.00
SK REITS CO LTD	27,542	118,706,020.00	
韓国ウォン 小計		289,887	1,176,502,085.00 (127,768,126)
イスラエルシェケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	237,765	378,759.64
	REIT 1 LTD	62,662	986,299.88
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	75,019	577,046.14
イスラエルシェケル 小計		375,446	1,942,105.66 (74,318,168)
合計			57,861,333,604 (57,861,333,604)

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額（単位:円）であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式 3銘柄	1.2%		1.0%
	投資証券 139銘柄		98.8%	77.1%
カナダドル	投資証券 30銘柄		100.0%	1.7%
ユーロ	投資証券 28銘柄		100.0%	3.5%
英ポンド	投資証券 37銘柄		100.0%	4.7%
オーストラリアドル	株式 1銘柄	0.8%		0.1%
	投資証券 31銘柄		99.2%	6.5%
ニュージーランドドル	投資証券 6銘柄		100.0%	0.4%
香港ドル	投資証券 6銘柄		100.0%	1.2%
シンガポールドル	投資証券 25銘柄		100.0%	3.5%
韓国ウォン	投資証券 12銘柄		100.0%	0.2%
イスラエルシェケル	投資証券 3銘柄		100.0%	0.1%

(注)時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

【中間財務諸表】

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)ならびに同規則第38条の3および第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第4期中間計算期間(2023年 8月22日から2024年 2月21日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

【埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第3期 2023年 8月21日現在	第4期中間計算期間末 2024年 2月21日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	47,574,497	46,951,517
親投資信託受益証券	6,430,052,956	6,185,844,671
流動資産合計	6,477,627,453	6,232,796,188
資産合計	6,477,627,453	6,232,796,188
負債の部		
流動負債		
未払解約金	99,169	5,672,460
未払受託者報酬	1,066,040	1,053,293
未払委託者報酬	27,361,491	27,034,491
未払利息	129	127
その他未払費用	216,674	214,077
流動負債合計	28,743,503	33,974,448
負債合計	28,743,503	33,974,448
純資産の部		
元本等		
元本	5,841,506,765	5,268,978,409
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	607,377,185	929,843,331
（分配準備積立金）	401,780,775	349,032,273
元本等合計	6,448,883,950	6,198,821,740
純資産合計	6,448,883,950	6,198,821,740
負債純資産合計	6,477,627,453	6,232,796,188

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期中間計算期間 自 2022年 8月23日 至 2023年 2月22日	第4期中間計算期間 自 2023年 8月22日 至 2024年 2月21日
営業収益		
有価証券売買等損益	301,636,031	431,713,715
営業収益合計	301,636,031	431,713,715
営業費用		
支払利息	18,605	15,089
受託者報酬	1,094,593	1,053,293
委託者報酬	28,094,537	27,034,491
その他費用	222,732	215,409
営業費用合計	29,430,467	28,318,282
営業利益又は営業損失（ ）	331,066,498	403,395,433
経常利益又は経常損失（ ）	331,066,498	403,395,433
中間純利益又は中間純損失（ ）	331,066,498	403,395,433
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	13,636,788	27,175,037
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	603,095,767	607,377,185
剰余金増加額又は欠損金減少額	11,620,204	28,181,188
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	11,620,204	28,181,188
剰余金減少額又は欠損金増加額	34,262,994	81,935,438
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	34,262,994	81,935,438
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	263,023,267	929,843,331

（ 3 ）【中間注記表】

（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。
-----------------	---------------------------------------

（中間貸借対照表に関する注記）

第3期 2023年 8月21日現在		第4期中間計算期間末 2024年 2月21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	6,357,699,438円	期首元本額	5,841,506,765円
期中追加設定元本額	456,220,480円	期中追加設定元本額	211,839,102円
期中一部解約元本額	972,413,153円	期中一部解約元本額	784,367,458円
2. 計算期間の末日における受益権の総数	5,841,506,765口	2. 中間計算期間の末日における受益権の総数	5,268,978,409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	1.1040円	3. 中間計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1.1765円
1口当たり純資産額		1口当たり純資産額	
(10,000口当たり純資産額)	(11,040円)	(10,000口当たり純資産額)	(11,765円)

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

第3期 2023年 8月21日現在		第4期中間計算期間末 2024年 2月21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. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	親投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。	2. 時価の算定方法	親投資信託受益証券 同左
	コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 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。		コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。	3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	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）

デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは「RM国内債券マザーファンド（埼玉重視型）」、「RM米ドル建SDGs債券マザーファンド（為替ヘッジあり）」、「RMユーロ建SDGs債券マザーファンド（為替ヘッジあり）」、「RM新興国債券マザーファンド」、「RM国内株式ESGMマザーファンド」、「RM先進国株式ESGMマザーファンド」、「RM新興国株式マザーファンド」、「RM国内リートマザーファンド」および「RM先進国リートマザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同親投資信託の受益証券です。
なお、以下に記載した状況は監査意見の対象外となっております。

RM国内債券マザーファンド（埼玉重視型）

貸借対照表

（単位：円）

2024年 2月21日現在

資産の部

2024年 2月21日現在

流動資産	
コール・ローン	4,281,799
国債証券	127,277,200
地方債証券	837,343,000
未収利息	890,832
流動資産合計	969,792,831
資産合計	
	969,792,831
負債の部	
流動負債	
未払利息	11
流動負債合計	11
負債合計	
	11
純資産の部	
元本等	
元本	987,265,548
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	17,472,728
元本等合計	969,792,820
純資産合計	
	969,792,820
負債純資産合計	
	969,792,831

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

2024年 2月21日現在

1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 8月22日
期首元本額	1,015,082,191円
期中追加設定元本額	18,176,429円
期中一部解約元本額	45,993,072円
期末元本額	987,265,548円
期末元本の内訳	
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	987,265,548円
2. 計算日における受益権の総数	987,265,548口
3. 元本の欠損	
純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	17,472,728円
4. 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	0.9823円
(10,000口当たり純資産額)	(9,823円)

（注） は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

2024年 2月21日現在

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

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
デリバティブ取引に関する注記
該当事項はありません。

R M米ドル建SDGs債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

貸借対照表

（単位：円）

2024年 2月21日現在

資産の部	
流動資産	
預金	3,176,738
コール・ローン	108,445,271
国債証券	30,886,471
特殊債券	2,199,205,615
派生商品評価勘定	2,791,862
未収入金	38,859,222
未収利息	16,265,302
前払費用	2,110,195
流動資産合計	2,401,740,676
資産合計	2,401,740,676
負債の部	
流動負債	
未払金	36,159,456
未払解約金	87,687,570
未払利息	294
流動負債合計	123,847,320
負債合計	123,847,320
純資産の部	
元本等	
元本	2,655,058,445
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	377,165,089
元本等合計	2,277,893,356
純資産合計	2,277,893,356
負債純資産合計	2,401,740,676

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

2024年 2月21日現在

1. 投資信託財産に係る元本の状況 期首	2023年 8月22日
-------------------------	-------------

期首元本額	2,665,691,042円
期中追加設定元本額	446,843,582円
期中一部解約元本額	457,476,179円
期末元本額	2,655,058,445円
期末元本の内訳	
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	1,553,090,213円
九州SDGs・グローバルバランス	335,573,914円
ラップ型ファンド・プラスESG（安定型）	122,773,809円
ラップ型ファンド・プラスESG（安定成長型）	584,004,689円
ラップ型ファンド・プラスESG（成長型）	58,628,234円
りそな米ドル建SDGs債券ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	987,586円
2. 計算日における受益権の総数	2,655,058,445口
3. 元本の欠損	
純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	377,165,089円
4. 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	0.8579円
(10,000口当たり純資産額)	(8,579円)

（注） は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

2024年 2月21日現在

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

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

（通貨関連）

（2024年 2月21日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	2,243,762,943	-	2,240,971,081	2,791,862
	米ドル	2,243,762,943	-	2,240,971,081	2,791,862
	合計	2,243,762,943	-	2,240,971,081	2,791,862

（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。

R Mユーロ建SDGs債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

貸借対照表

（単位：円）

2024年 2月21日現在

資産の部	
流動資産	
預金	2,010,930
コール・ローン	102,964,242
国債証券	49,170,985
特殊債券	1,479,730,953
未収入金	574,356
未収利息	1,471,793
前払費用	528,537
流動資産合計	1,636,451,796
資産合計	
1,636,451,796	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,928,611
未払金	5,359,542
未払解約金	88,386,823
未払利息	279
流動負債合計	97,675,255
負債合計	
97,675,255	
純資産の部	
元本等	
元本	1,753,820,707
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	215,044,166
元本等合計	1,538,776,541
純資産合計	
1,538,776,541	
負債純資産合計	
1,636,451,796	

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

2024年 2月21日現在

1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 8月22日
期首元本額	1,876,715,910円
期中追加設定元本額	300,252,221円
期中一部解約元本額	423,147,424円
期末元本額	1,753,820,707円

期末元本の内訳	
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	1,026,497,758円
九州SDGs・グローバルバランス	222,491,154円
ラップ型ファンド・プラスESG（安定型）	80,833,039円
ラップ型ファンド・プラスESG（安定成長型）	384,924,456円
ラップ型ファンド・プラスESG（成長型）	38,089,014円
りそなユーロ建SDGs債券ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	985,286円
2. 計算日における受益権の総数	1,753,820,707口
3. 元本の欠損	
純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	215,044,166円
4. 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	0.8774円
(10,000口当たり純資産額)	(8,774円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2024年 2月21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	<p>国債証券、特殊債券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>デリバティブ取引 (その他の注記)のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>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。</p>

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

デリバティブ取引に関する注記

(通貨関連)

(2024年 2月21日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	1,502,430,934	-	1,506,359,545	3,928,611
	ユーロ	1,502,430,934	-	1,506,359,545	3,928,611
	合計	1,502,430,934	-	1,506,359,545	3,928,611

(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。

R M新興国債券マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2024年 2月21日現在

資産の部	
流動資産	
預金	11,640,270
コール・ローン	33,419,593
投資信託受益証券	12,545,304,955
派生商品評価勘定	28,975
流動資産合計	12,590,393,793
資産合計	12,590,393,793
負債の部	
流動負債	
未払解約金	8,177,300
未払利息	90
流動負債合計	8,177,390
負債合計	8,177,390
純資産の部	
元本等	
元本	9,120,785,688
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	3,461,430,715
元本等合計	12,582,216,403
純資産合計	12,582,216,403
負債純資産合計	12,590,393,793

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

(貸借対照表に関する注記)

2024年 2月21日現在

1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 8月22日
期首元本額	8,073,114,382円
期中追加設定元本額	1,488,116,737円
期中一部解約元本額	440,445,431円
期末元本額	9,120,785,688円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	737,683,453円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	975,559,552円
りそなラップ型ファンド(成長型)	656,215,248円
DCりそな グローバルバランス	22,035,911円

つみたてバランスファンド	1,581,282,737円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	326,700,550円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	249,813,371円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	175,963,041円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	94,748,741円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	63,979,399円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	37,952,399円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	89,591,772円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	91,074,973円
九州SDGs・グローバルバランス	29,457,343円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定型)	5,834,841円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定成長型)	52,063,974円
ラップ型ファンド・プラスESG(成長型)	66,173,015円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定型)	27,026,444円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定成長型)	26,999,991円
りそな つみたてラップ型ファンド(成長型)	17,259,440円
ターゲットリターンバランスファンド(目標2%)	574,890円
ターゲットリターンバランスファンド(目標3%)	263,021円
ターゲットリターンバランスファンド(目標4%)	1,176,244円
ターゲットリターンバランスファンド(目標5%)	421,949円
ターゲットリターンバランスファンド(目標6%)	946,734円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2065	246,661円
FWりそな先進国+新興国債券アクティブファンド	30,356,303円
FWりそな新興国債券インデックスファンド	2,956,388,365円
Smart-i 8資産バランス 安定型	82,969,642円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	279,998,501円
Smart-i 8資産バランス 成長型	412,941,672円
りそなVIグローバル・バランスファンド(安定型)(適格機関投資家専用)	2,418,204円
りそなVIグローバル・バランスファンド(安定成長型)(適格機関投資家専用)	4,366,331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)	20,300,976円
2. 計算日における受益権の総数	9,120,785,688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	1.3795円
(10,000口当たり純資産額)	(13,795円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2024年 2月21日現在

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

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

デリバティブ取引に関する注記

(通貨関連)

(2024年 2月21日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外	為替予約取引				

の取引	買建	49,095,594	-	49,124,569	28,975
	米ドル	49,095,594	-	49,124,569	28,975
	合計	49,095,594	-	49,124,569	28,975

(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。

R M国内株式 E S G マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2024年 2月21日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	218,159,463
株式	4,431,114,260
投資証券	31,925,800
派生商品評価勘定	8,183,620
未収配当金	5,097,420
差入委託証拠金	10,444,731
流動資産合計	4,704,925,294
資産合計	4,704,925,294
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	127,960
前受金	9,044,250
未払解約金	7,414,200
未払利息	591
流動負債合計	16,587,001
負債合計	16,587,001
純資産の部	
元本等	
元本	2,660,993,827
剰余金	
剰余金又は欠損金()	2,027,344,466
元本等合計	4,688,338,293
純資産合計	4,688,338,293
負債純資産合計	4,704,925,294

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
--------------------	---

2. デリバティブの評価基準及び評価方法	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。
3. 収益及び費用の計上基準	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。 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21日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 8月22日
期首元本額	2,528,053,182円
期中追加設定元本額	1,351,125,113円
期中一部解約元本額	1,218,184,468円
期末元本額	2,660,993,827円
期末元本の内訳	
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	325,924,357円
国内株式ESGインデックス・オープン	72,276,557円
九州SDGs・グローバルバランス	137,647,765円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定型)	20,018,118円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定成長型)	260,736,260円
ラップ型ファンド・プラスESG(成長型)	351,642,577円
Smart-i 国内株式ESGインデックス	1,104,083,069円
国内株式ESGインデックスファンド(適格機関投資家専用)	388,665,124円
2. 計算日における受益権の総数	2,660,993,827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	1.7619円
(10,000口当たり純資産額)	(17,619円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2024年 2月21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)のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

デリバティブ取引に関する注記

(株式関連)

(2024年 2月21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	225,925,340	-	233,981,000	8,055,660
	合計	225,925,340	-	233,981,000	8,055,660

(注) 時価の算定方法

先物取引

国内先物取引について

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

R M先進国株式E S Gマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2024年 2月21日現在

資産の部	
流動資産	
預金	409,346,021
コール・ローン	50,141,955
株式	9,340,352,893
投資証券	203,755,075
派生商品評価勘定	9,183,976
未収入金	35,882
未収配当金	8,656,010
差入委託証拠金	219,593,493
流動資産合計	10,241,065,305
資産合計	
10,241,065,305	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	827,570
未払解約金	9,014,600
未払利息	136
流動負債合計	9,842,306
負債合計	
9,842,306	
純資産の部	
元本等	
元本	4,687,774,198
剰余金	
剰余金又は欠損金()	5,543,448,801
元本等合計	10,231,222,999
純資産合計	
10,231,222,999	
負債純資産合計	
10,241,065,305	

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。

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

(貸借対照表に関する注記)

2024年 2月21日現在

1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 8月22日
期首元本額	3,720,634,253円
期中追加設定元本額	1,839,727,804円
期中一部解約元本額	872,587,859円
期末元本額	4,687,774,198円
期末元本の内訳	
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	674,842,505円
先進国株式ESGインデックス・オープン	33,338,258円
九州SDGs・グローバルバランス	316,344,480円
ラップ型ファンド・プラスESG（安定型）	25,680,707円
ラップ型ファンド・プラスESG（安定成長型）	489,148,516円
ラップ型ファンド・プラスESG（成長型）	1,208,475,498円
Smart-i 先進国株式ESGインデックス	1,939,944,234円
2. 計算日における受益権の総数	4,687,774,198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	2.1825円
(10,000口当たり純資産額)	(21,825円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2024年 2月21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）のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

デリバティブ取引に関する注記

(株式関連)

(2024年 2月21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	719,354,364	-	727,658,905	8,304,541
	合計	719,354,364	-	727,658,905	8,304,541

(注) 時価の算定方法

先物取引

外国先物取引について

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

(通貨関連)

(2024年 2月21日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	80,675,513	-	80,727,378	51,865
	米ドル	64,499,812	-	64,538,539	38,727
	ユーロ	6,813,576	-	6,814,222	646
	英ポンド	1,894,290	-	1,894,386	96
	オーストラリアドル	3,633,215	-	3,640,711	7,496
	香港ドル	3,834,620	-	3,839,520	4,900
合計		80,675,513	-	80,727,378	51,865

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

R M新興国株式マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2024年 2月21日現在

資産の部	
流動資産	
預金	1,256,644,073
コール・ローン	14,705,245
株式	31,991,389,916
投資証券	43,992,010
派生商品評価勘定	57,367,343
未収配当金	27,884,311
差入委託証拠金	668,775,662
流動資産合計	34,060,758,560
資産合計	34,060,758,560
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	314,545
未払解約金	21,964,100
未払利息	39
流動負債合計	22,278,684
負債合計	22,278,684
純資産の部	
元本等	
元本	18,188,113,293

2024年 2月21日現在

剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	15,850,366,583
元本等合計	34,038,479,876
純資産合計	34,038,479,876
負債純資産合計	34,060,758,560

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

(貸借対照表に関する注記)

2024年 2月21日現在

1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 8月22日
期首元本額	15,820,968,450円
期中追加設定元本額	2,858,392,684円
期中一部解約元本額	491,247,841円
期末元本額	18,188,113,293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	16,523,864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	56,957,879円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	134,425,821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)	112,885,498円
ラップ型ファンド・プラスESG(成長型)	240,119,116円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定型)	20,199,225円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定成長型)	51,874,513円
りそな つみたてラップ型ファンド(成長型)	57,712,986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%)	429,694円
ターゲットリターンバランスファンド(目標3%)	354,816円
ターゲットリターンバランスファンド(目標4%)	2,493,606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
りそな新興国株式インデックス	539,031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	4,407,395,924円
Smart-i 新興国株式インデックス	2,991,391,498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	619,963,641円
Smart-i Select 全世界株式インデックス	124,387,622円
Smart-i Select 全世界株式インデックス(除く日本)	45,466,435円
Smart-i DC 全世界株式インデックス	9,731,458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	18,188,113,293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	1.8715円
(10,000口当たり純資産額)	(18,715円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2024年 2月21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)のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

デリバティブ取引に関する注記

(株式関連)

(2024年 2月21日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等	時価		評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	1,955,478,872	-	2,012,535,917	57,057,045
	合計	1,955,478,872	-	2,012,535,917	57,057,045

(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21日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	4,340,559	-	4,355,792	15,233
	米ドル	4,340,559	-	4,355,792	15,233
	売建	4,340,559	-	4,360,039	19,480
	ブラジルリアル	4,340,559	-	4,360,039	19,480
	合計	8,681,118	-	8,715,831	4,247

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

R M国内リートマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2024年 2月21日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	600,054,133
投資証券	48,825,397,950
派生商品評価勘定	131,700
未収配当金	400,875,111
前払金	40,612,500
差入委託証拠金	53,776,084
流動資産合計	49,920,847,478
資産合計	49,920,847,478
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	38,631,930
未払金	290,668,477
未払解約金	33,000,000
未払利息	1,627
流動負債合計	362,302,034
負債合計	362,302,034
純資産の部	
元本等	
元本	36,494,334,102
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	13,064,211,342
元本等合計	49,558,545,444
純資産合計	49,558,545,444
負債純資産合計	49,920,847,478

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

2024年 2月21日現在

1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 8月22日
期首元本額	32,289,660,802円
期中追加設定元本額	9,850,815,097円
期中一部解約元本額	5,646,141,797円
期末元本額	36,494,334,102円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド（安定型）	844,876,623円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	1,325,081,138円
りそなラップ型ファンド（成長型）	2,012,522,779円
DCりそな グローバルバランス	31,508,934円
つみたてバランスファンド	3,185,161,798円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	310,531,575円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	238,731,021円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	176,611,485円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	95,125,288円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	64,229,173円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	38,097,198円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	89,909,112円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	131,268,307円
九州SDGs・グローバルバランス	54,989,214円
りそな国内リートインデックス（ラップ専用）	2,789,607,387円
ラップ型ファンド・プラスESG（安定型）	6,934,663円
ラップ型ファンド・プラスESG（安定成長型）	100,760,512円
ラップ型ファンド・プラスESG（成長型）	107,066,256円
りそな つみたてラップ型ファンド（安定型）	32,629,520円
りそな つみたてラップ型ファンド（安定成長型）	55,767,362円
りそな つみたてラップ型ファンド（成長型）	61,865,533円
りそな つみたてリスクコントロールファンド	9,020,436円
ターゲットリターンバランスファンド（目標2%）	578,591円
ターゲットリターンバランスファンド（目標3%）	265,974円
ターゲットリターンバランスファンド（目標4%）	1,827,638円
ターゲットリターンバランスファンド（目標5%）	863,557円
ターゲットリターンバランスファンド（目標6%）	2,999,593円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2065	235,839円
りそなJリートインデックス（年1回決算型）	671,068円
りそなJリートインデックス（年4回決算型）	15,406,538円
FWりそな国内リートインデックスオープン	8,210,410,086円
FWりそな国内リートインデックスファンド	7,617,730,008円
Smart-i Jリートインデックス	3,394,107,362円
Smart-i 8資産バランス 安定型	78,601,072円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	271,798,436円
Smart-i 8資産バランス 成長型	414,399,988円
J-REITインデックスファンド（適格機関投資家専用）	3,183,166,944円
りそなDAAファンド（適格機関投資家専用）	192,358,703円
りそなVIグローバル・バランスファンド（安定型）（適格機関投資家専用）	2,715,554円
りそなVIグローバル・バランスファンド（安定成長型）（適格機関投資家専用）	10,834,218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）	26,028,647円

りそなマルチアセットファンド（適格機関投資家専用）	12,060,625円
りそなDAAファンド（適格機関投資家専用）	17,894,606円
J-REITインデックスファンド202102（適格機関投資家専用）	133,840,674円
りそなDAAファンド202205（適格機関投資家専用）	402,895,432円
りそなFTグローバルリートファンド202307（適格機関投資家専用）	489,477,796円
りそなマルチアセットファンド202310（適格機関投資家専用）	250,869,839円
2. 計算日における受益権の総数	36,494,334,102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	1.3580円
(10,000口当たり純資産額)	(13,580円)

（注）は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

2024年 2月21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	投資証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 デリバティブ取引 （その他の注記）のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

（投資証券関連）

（2024年 2月21日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	不動産投信指数先物取引				
	買建	960,785,730	-	922,285,500	38,500,230
	合計	960,785,730	-	922,285,500	38,500,230

（注）時価の算定方法

先物取引

国内先物取引について

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

R M先進国リートマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2024年 2月21日現在

資産の部	
流動資産	
預金	367,883,924
コール・ローン	4,628,714
株式	565,651,527

2024年 2月21日現在

投資証券	67,129,626,785
派生商品評価勘定	128
未収入金	6,628,908
未収配当金	109,280,167
流動資産合計	68,183,700,153
資産合計	68,183,700,153
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,627
未払解約金	17,165,500
未払利息	12
流動負債合計	17,168,139
負債合計	17,168,139
純資産の部	
元本等	
元本	41,522,805,499
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	26,643,726,515
元本等合計	68,166,532,014
純資産合計	68,166,532,014
負債純資産合計	68,183,700,153

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2024年 2月21日現在

1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 8月22日
期首元本額	39,814,547,515円
期中追加設定元本額	7,380,560,143円
期中一部解約元本額	5,672,302,159円
期末元本額	41,522,805,499円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	1,130,733,976円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	1,979,873,571円
りそなラップ型ファンド(成長型)	2,946,665,216円
DCりそな グローバルバランス	28,249,531円
つみたてバランスファンド	1,342,352,529円

りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	568,043,508円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	426,451,640円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	304,445,839円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	162,613,738円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	110,025,722円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	64,591,398円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	152,484,199円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	230,241,359円
九州SDGs・グローバルバランス	95,523,097円
ラップ型ファンド・プラスESG（安定型）	8,925,111円
ラップ型ファンド・プラスESG（安定成長型）	140,541,145円
ラップ型ファンド・プラスESG（成長型）	143,661,272円
りそな つみたてラップ型ファンド（安定型）	41,550,210円
りそな つみたてラップ型ファンド（安定成長型）	80,679,348円
りそな つみたてラップ型ファンド（成長型）	95,935,957円
りそな つみたてリスクコントロールファンド	2,778,354円
ターゲットリターンバランスファンド（目標2%）	983,063円
ターゲットリターンバランスファンド（目標3%）	440,325円
ターゲットリターンバランスファンド（目標4%）	3,043,049円
ターゲットリターンバランスファンド（目標5%）	1,465,126円
ターゲットリターンバランスファンド（目標6%）	5,026,661円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2065	418,734円
FWりそな先進国リートインデックスオープン	13,618,352,076円
FWりそな先進国リートインデックスファンド	12,645,579,418円
Smart-i 先進国リートインデックス	3,012,233,648円
Smart-i 8資産バランス 安定型	139,502,908円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	485,048,620円
Smart-i 8資産バランス 成長型	703,265,762円
りそなDAAファンド（適格機関投資家専用）	156,299,096円
りそなVIグローバル・バランスファンド（安定型）（適格機関投資家専用）	3,671,649円
りそなVIグローバル・バランスファンド（安定成長型）（適格機関投資家専用）	8,220,943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）	132,099,812円
りそなマルチアセットファンド（適格機関投資家専用）	10,484,631円
りそなDAAファンド（適格機関投資家専用）	31,968,287円
りそなDAAファンド202205（適格機関投資家専用）	327,368,792円
りそなFT グローバルリートファンド202307（適格機関投資家専用）	180,966,179円
2. 計算日における受益権の総数	41,522,805,499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	1.6417円
(10,000口当たり純資産額)	(16,417円)

（注） は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

2024年 2月21日現在

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

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

(通貨関連)

(2024年 2月21日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	71,686,920	-	71,689,419	2,499
	米ドル	50,113,360	-	50,114,863	1,503
	カナダドル	2,219,000	-	2,218,882	118
	ユーロ	6,489,120	-	6,489,736	616
	英ポンド	9,471,450	-	9,471,930	480
	オーストラリアドル	1,475,190	-	1,475,218	28
	香港ドル	1,918,800	-	1,918,790	10
	合計	71,686,920	-	71,689,419	2,499

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

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。

【埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG】

【純資産額計算書】

資産総額	6,231,327,942円
負債総額	3,709,715円
純資産総額（ - ）	6,227,618,227円
発行済口数	5,262,640,757口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1834円

（参考）

RM国内債券マザーファンド（埼玉重視型）

純資産額計算書

資産総額	970,277,922円
負債総額	12円
純資産総額（ - ）	970,277,910円
発行済口数	987,265,548口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9828円

RM米ドル建SDGs債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

純資産額計算書

資産総額	2,314,069,333円
負債総額	7,342,223円
純資産総額（ - ）	2,306,727,110円
発行済口数	2,690,557,863口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8573円

RMユーロ建SDGs債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

純資産額計算書

資産総額	1,566,457,532円
負債総額	13,678,478円
純資産総額（ - ）	1,552,779,054円
発行済口数	1,777,538,066口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8736円

RM新興国債券マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	12,671,448,358円
------	-----------------

負債総額	11,751,019円
純資産総額（ - ）	12,659,697,339円
発行済口数	9,161,460,018口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3818円

R M国内株式E S Gマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	5,084,935,226円
負債総額	180,820,871円
純資産総額（ - ）	4,904,114,355円
発行済口数	2,735,083,925口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7930円

R M先進国株式E S Gマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	10,805,565,206円
負債総額	585,820円
純資産総額（ - ）	10,804,979,386円
発行済口数	4,851,808,628口
1口当たり純資産額（ / ）	2.2270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

R M国内リートマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	50,843,956,772円
負債総額	346,754,085円
純資産総額（ - ）	50,497,202,687円
発行済口数	37,198,129,784口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3575円

R M先進国リートマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	68,389,320,672円
------	-----------------

負債総額	80,817,423円
純資産総額（ - ）	68,308,503,249円
発行済口数	41,504,601,384口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6458円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

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)

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

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

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：千円）

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

2. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：千円）

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

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：千円）

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

（税効果会計関係）

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生 of 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)

- 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。
- 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。
- 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)

- 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。
- 関連情報
 - 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。
 - 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。
 - 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

- 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。
- 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。
- 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)

- 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。
- 関連情報
 - 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。
 - 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。
 - 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	

		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
株式会社埼玉りそな銀行	70,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

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【その他】

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

独立監査人の監査報告書

2023年5月22日

りそなアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 松崎 雅則

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 石坂 武嗣

監査意見

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

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

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業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

2023年11月6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」に掲げられている埼玉りそな・グローバルバランス・プラスE S Gの2022年8月23日から2023年8月21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、埼玉りそな・グローバルバランス・プラスE S Gの2023年8月21日現在の信託財産の状況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。
- 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

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。

独立監査人の中間監査報告書

2024年5月6日

りそなアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人トーマツ
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 松崎 雅則
業務執行社員

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている埼玉りそな・グローバルバランス・プラスE S Gの2023年8月22日から2024年2月21日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、埼玉りそな・グローバルバランス・プラスE S Gの2024年2月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年8月22日から2024年2月21日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。