

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2024年10月22日提出
【計算期間】	第2期(自 2023年7月21日至 2024年7月22日)
【ファンド名】	ラップ型ファンド・プラスE S G（安定型） ラップ型ファンド・プラスE S G（安定成長型） ラップ型ファンド・プラスE S G（成長型）
【発行者名】	りそなアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役 西山 明宏
【本店の所在の場所】	東京都江東区木場一丁目5番65号
【事務連絡者氏名】	塚田 光子
【連絡場所】	東京都江東区木場一丁目5番65号
【電話番号】	03-6704-3821
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

- ファンドの目的
 <ラップ型ファンド・プラスESG（安定型）>
 信託財産の中長期的な安定性を重視した成長を目指して運用を行います。
 <ラップ型ファンド・プラスESG（安定成長型）>
 信託財産の中長期的な安定性と成長性のバランスを重視した成長を目指して運用を行います。
 <ラップ型ファンド・プラスESG（成長型）>
 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	年1回	グローバル (含む日本)		
一般 大型株 中小型株	年2回	日本		
債券	年4回	北米	ファミリーファンド	あり
一般	年6回 (隔月)	欧州		(部分ヘッジ)
公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年12回 (毎月)	アジア		
不動産投信	日々	オセアニア		
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))	その他 ()	中南米	ファンド・オブ・ファンズ	なし
資産複合 ()		アフリカ		
資産配分固定型 資産配分変更型		中近東 (中東)		
		エマージング		

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

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用されます。このため、組入れている資産を示す属性区分上の投資対象資産(その他資産(投資信託証券(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なわれないファンドをいう。
- (2) 追加型投信：一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行な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)：「MRF及びMMF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)：「MRF及びMMF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なわないものとする。

(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な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、為替のヘッジを行なわない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行な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、積極的に投資を行な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7月31日現在、上記の組入比率は、以下の通りです。

特にESG/SDGsを重視した運用を行うマザーファンド	組入比率
安定型	90.6%
安定成長型	82.5%
成長型	80.1%

・上記組入比率は、ファンドの純資産総額に対する比率です。

- 国内債券、先進国債券、国内株式および先進国株式に投資を行う5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国内SDGs債券マザーファンド、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。

*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-KOKUSA 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。

- 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SDGs債券マザーファンド 【主要投資対象】 国内のSDGs債および国債 【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	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)
	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

* 発行国が先進国以外場合があります。

※ 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 目標リターン別に3つの運用タイプからお選びいただけます。

- 5年から10年程度の中長期的な運用のニーズやお客さまがとり得るリスクの水準に応じて3つのファンドからお好みの運用タイプをお選びいただけます。
- 運用にあたっては、目標リターンから下落するリスクを低減しつつ、目標リターンを目指します。

運用タイプ	安定型	安定成長型	成長型
目標リターン（年率） 想定リスク水準（年率）	目標リターン：短期金利+2% 想定リスク水準：4.8%	目標リターン：短期金利+4% 想定リスク水準：9.4%	目標リターン：短期金利+6% 想定リスク水準：14.5%
基本的 資産配分			
特にESG/SDGsを重視した運用の割合	特にESG/SDGsを重視した運用：90%	特にESG/SDGsを重視した運用：82%	特にESG/SDGsを重視した運用：80%
※2024年3月時点			
資産配分の 方針	各資産への投資配分比率は、5年から10年程度の上記目標リターンの追求および各ファンド全体の下方リスク水準の低減を目指して決定するとともに、投資環境に応じて変更します。		
目標リターン と想定リスク 水準の関係 (イメージ)			

- ※「目標リターン」とは、必ず一定の収益を得ることのできる運用を意味するものではなく、記載されている目標リターンの数値は、その達成を示唆・保証するものではありません。したがって、投資者の元本が保証されるものではなく、各ファンドの基準価額は下落することがあります。
- ※目標リターンは、運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。その他発生する費用につきましては考慮していません。
- ※目標リターンに記載している短期金利は無担保コール〇/N物レート(確報)のことを指します。
- ※目標リターンは、5年から10年程度の中長期的な期間、運用することを想定して設定しています。
- ※想定リスク水準は、2011年6月から2024年1月までの期間に、上記の資産配分で各資産を保有していたと仮定し、各指数^{*}の収益率に基づき算出したものです。実際の運用では資産配分の見直しや各マザーファンドのリスク水準の変化等によって将来的に変動します。
- ※上記の基本的資産配分は、2024年3月時点のものです。四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。基本的資産配分は、各運用タイプの「目標リターン」に応じて、各指数^{*}の過去の収益率およびリスクに鑑み下方リスク水準の低減を目指して定期的に見直しします。ただし、信託財産に現金等が含まれることや各マザーファンドの基準価額が変動すること等により、実際の資産別構成比率が上記の基本的資産配分と一致しない場合があります。また、特にESG/SDGsを重視した運用の割合も同様です。
- ※「目標リターンと想定リスク水準の関係」は、あくまでイメージを示したものであり、基準価額の上昇を示唆・保証するものではありません。

- *1 想定リスク水準の算出には、原則として各マザーファンドの対象指数を利用します。ただし、RM国内SDGs債券マザーファンド、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、対象指数を設けていないため、それぞれのマザーファンドの投資対象と運用手法に基づいて、NOMURA-BPI/Ladder 10年指数、FTSE米国債1-10年インデックス（円ヘッジ・円ベース）およびFTSE独債1-10年インデックス（円ヘッジ・円ベース）を利用します。
- *2 基本的資産配分の算出・見直しには、国内債券：NOMURA-BPI総合を含む複数の指数、先進国債券（為替ヘッジあり）：FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）を含む複数の指数、国内株式：東証株価指数（TOPIX、配当込み）、先進国株式：MSCI-KOKUSAI指数（配当込み、円換算ベース）、新興国債券：JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）、新興国株式：MSCIエマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）、国内リート：東証REIT指数（配当込み）および先進国リート：S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）を利用します。

3 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。

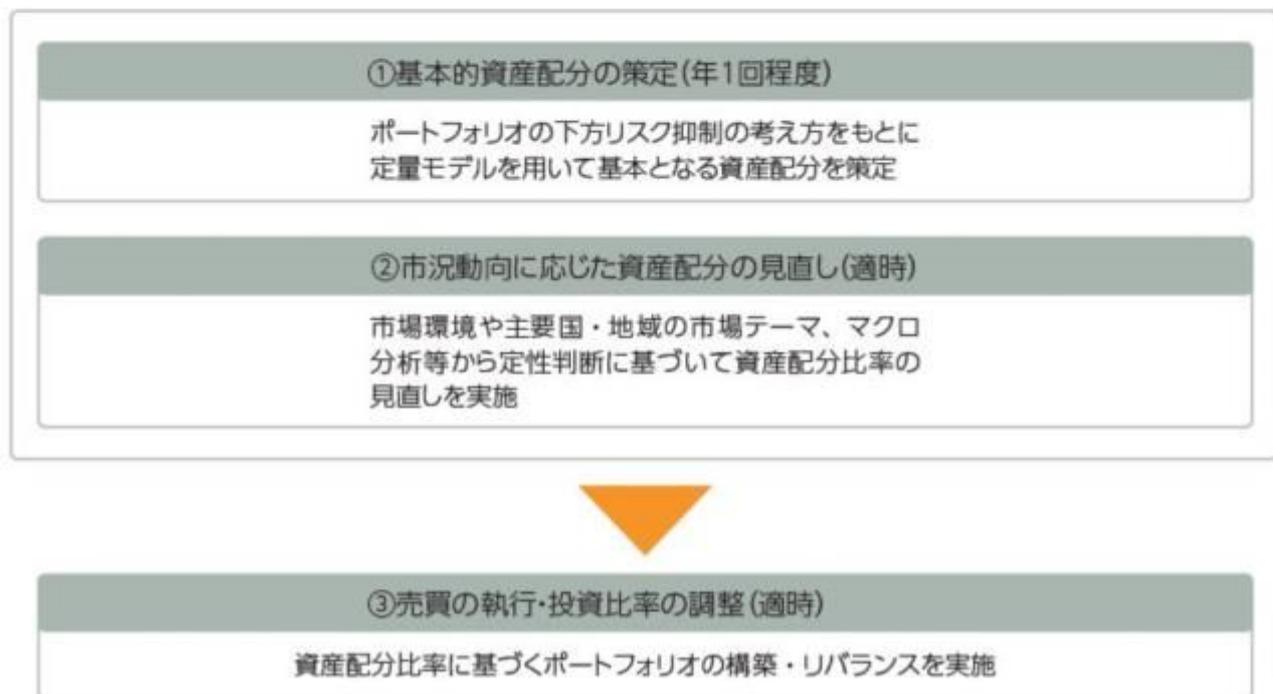
先を見据えたシミュレーションにより、中長期的な運用に理想的なポートフォリオを構築します。

- 当ファンドでは、過去に起きていなかった事象も今後起こり得ると考え、過去のデータをランダムに組み合わせ、将来起こり得る可能性のある数万通りのシナリオを作成します。このように作成されたマーケット・シナリオに基づきポートフォリオをシミュレーションした結果、目標リターンからのマイナス幅が一番小さいポートフォリオを採用します。

運用期間中も資産配分の見直しを行います。

- 資産配分の見直しについては、①年1回程度の基本的資産配分の策定と②市況動向に応じた資産配分の見直しを実施し、③売買の執行・投資比率の調整を行うことで、運用期間中も目標リターンからのマイナス幅（下落リスク）を最小化するよう運用していきます。

運用プロセスのイメージ



※ 上記の運用プロセスおよびイメージ図は、今後変更になる場合があります。

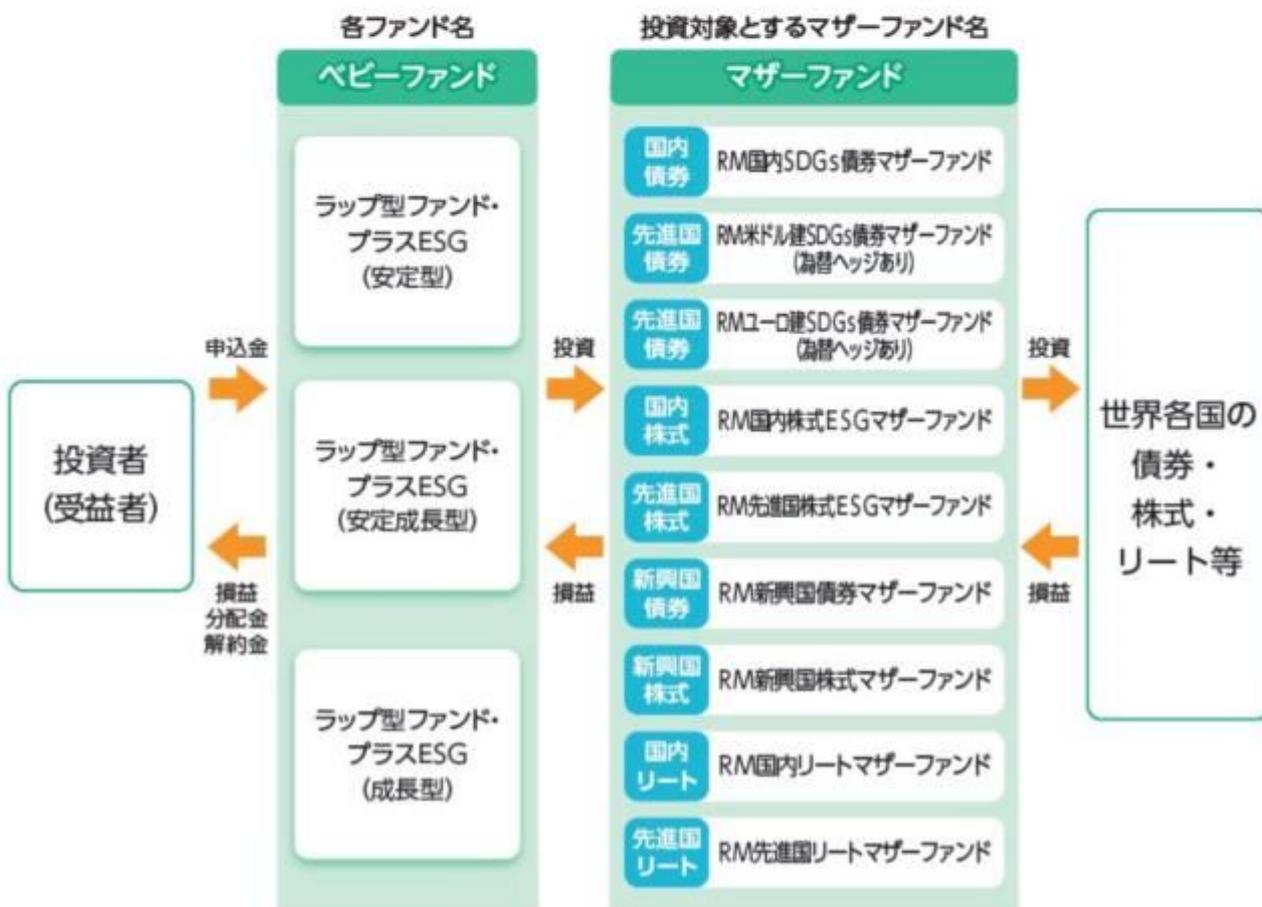
4 実質組入外貨建資産の一部について、対円での為替ヘッジを行います。

- 各ファンドが外貨建資産として組み入れるRM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

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



主な投資制限

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

分配方針

原則、毎年7月20日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、以下の収益分配方針に基づいて分配を行います。

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

★将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

各マザーファンドが対象とする指数の著作権等について

● RM国内株式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・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

国内債券、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。

ー国内債券および先進国債券の投資についてー

● RM国内SDGs債券マザーファンド、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"> ・ 資金調達の用途 ・ 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
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。	<ul style="list-style-type: none"> ● 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>
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上のリスクや機会は何か、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、今後変更される場合があります。

〈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	▷ 二酸化炭素排出 ▷ 環境インパクト金融 など	自然資本	▷ 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	▷ 有害物質の排出と廃棄 ▷ 包装材の廃棄 など	環境に関する市場機会	▷ グリーンテクノロジー ▷ 再生可能エネルギー など
	人的資本	▷ 人材開発 ▷ サプライチェーン上の労働規範 など	製造物責任	▷ 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	▷ 希少資源 など	社会に関する市場機会	▷ 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	▷ オーナーシップとコントロール ▷ 議決権行使 など	企業行動	▷ 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

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

(2) 【ファンドの沿革】

2022年11月1日

- ・ファンドの信託契約締結、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み



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

委託会社の概況（2024年7月末現在）

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

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

RM国内SDGs債券マザーファンド、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新興国債券マザーファンド、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。

<ラップ型ファンド・プラスESG（安定型）>

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、信託財産の中長期的な安定性を重視した運用を行います。なお、国内および先進国の債券・株式については、特にESG/SDGsを重視した運用を行います。

各マザーファンド受益証券への投資比率は、5年から10年程度の中長期的な運用収益目標（円短期金

利^{*1}+2%^{*2}（年率）の追求および当ファンド全体の下方リスク水準の低減を目指して決定するとともに、投資環境に応じて変更します。

*1 無担保コールO/N物レート（確報）です。

*2 信託報酬控除後のものです。その他の費用については考慮しておりません。

株価指数先物取引、債券先物取引等を利用することがあります。

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。

<ラップ型ファンド・プラスESG（安定成長型）>

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、信託財産の中長期的な安定性と成長性のバランスを重視した運用を行います。なお、国内および先進国の債券・株式については、特にESG/SDGsを重視した運用を行います。

各マザーファンド受益証券への投資比率は、5年から10年程度の中長期的な運用収益目標（円短期金利^{*1}+4%^{*2}（年率））の追求および当ファンド全体の下方リスク水準の低減を目指して決定するとともに、投資環境に応じて変更します。

*1 無担保コールO/N物レート（確報）です。

*2 信託報酬控除後のものです。その他の費用については考慮しておりません。

株価指数先物取引、債券先物取引等を利用することがあります。

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。

<ラップ型ファンド・プラスESG（成長型）>

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、信託財産の中長期的な成長性を重視した運用を行います。なお、国内および先進国の債券・株式については、特にESG/SDGsを重視した運用を行います。

各マザーファンド受益証券への投資比率は、5年から10年程度の中長期的な運用収益目標（円短期金利^{*1}+6%^{*2}（年率））の追求および当ファンド全体の下方リスク水準の低減を目指して決定するとともに、投資環境に応じて変更します。

*1 無担保コールO/N物レート（確報）です。

*2 信託報酬控除後のものです。その他の費用については考慮しておりません。

株価指数先物取引、債券先物取引等を利用することがあります。

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、）
 - 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、資金の借入れの指図を行うことができます。

《参考情報》

投資対象とするマザーファンドの概要

< RM国内SDGs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、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	国内のSDGs債および国債を主要投資対象とします。
投資方針	主として、国内のSDGs債および国債に投資し、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、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。 国内の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。 ポートフォリオの構築は、残存期間が10年程度までの国内のSDGs債および国債を、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。 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7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 S D G s 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 S D G s 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	主として、米ドル建の S D G s 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。 米ドル建の S D G s 債は、発行体の信用力・E S G 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。 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 S D G s 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。 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。 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。 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割合には制限を設けません。 デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
収益分配	収益分配は行いません。

ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
決算日	毎年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 S D G s 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	ユーロ建の S D G s 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	主として、ユーロ建の S D G s 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。 ユーロ建の S D G s 債は、発行体の信用力・ E S G 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。 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 S D G s 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。 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。 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。 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割合には制限を設けません。 デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
決算日	毎年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	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。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。非株式割合(株式以外の資産への投資割合)は、原則として信託財産総額の50%以下を基本とします。資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	株式への投資割合には、制限を設けません。新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。外貨建資産への投資は行いません。デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入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 ESG 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	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。 * DR(預託証券)もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。

投資方針	<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新興国債券マザーファンド >

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、JPモルガンGBI EMグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	<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"> JPモルガンGBI EMグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）に採用されている新興国の債券 新興国債券の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）
投資方針	<p>主として、JPモルガンGBI EMグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）に採用されている新興国の現地通貨建て債券または新興国債券の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）に投資し、JPモルガンGBI EMグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、JPモルガンGBI EMグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の債券先物取引を活用することがあります。</p> <p>債券またはETF（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。</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ません。）の行使等により取得したものに限りません。</p> <p>株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入る有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
決算日	毎年1月25日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

< R M新興国株式マザーファンド >

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

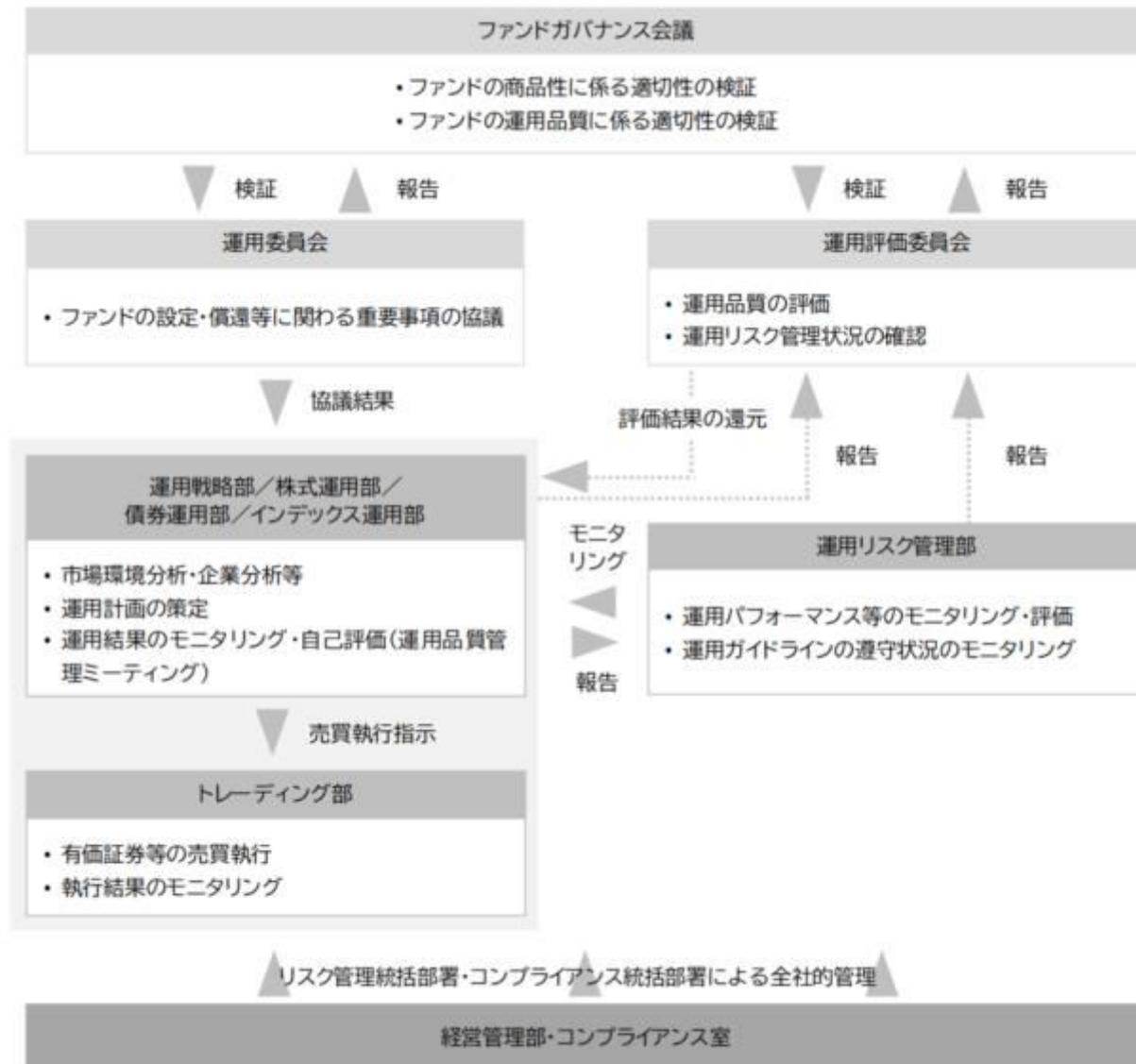
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
決算日	毎年1月25日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

< 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	次の有価証券を主要投資対象とします。 ・先進国（除く日本）の金融商品取引所に上場（上場予定を含みます。）されているまたは店頭登録されている（登録予定を含みます。）不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に規定する不動産投資信託証券をいいます。） ・先進国（除く日本）の金融商品取引所に上場（上場予定を含みます。）されているまたは店頭登録されている（登録予定を含みます。）不動産関連株式 ・先進国の不動産投資信託証券に関する指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）
投資方針	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。 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。 為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。 資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	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割合には、制限を設けません。 デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
決算日	毎年1月25日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

（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7月末現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

（４）【分配方針】

収益分配方針

原則として毎決算時に以下の収益分配方針に基づいて分配を行います。

- 1) 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。
- 2) 原則として、基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配金額を決定します。ただし、信託財産の中長期的な成長に資することを考慮して分配を行わないことがあります。
- 3) 留保金は、運用の基本方針に基づいて運用します。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、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
 2. 前記1.の信用取引の指図は、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
 - イ) 信託財産に属する株券および新株引受権証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の指図を行うときは、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の場合は、基準価額の下落要因となります。

・リートの価格変動リスク

リートの価格は、不動産市況(不動産価格、賃貸料等)、金利・景気動向、社会情勢の変化、関係法令・各種規制等の変更、災害等の要因により変動します。リートの価格および分配金はその影響を受け下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

・為替変動リスク

為替相場は、各国の経済状況、金利動向、政治情勢等のさまざまな要因により変動します。当ファ

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

資産配分リスク

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

信用リスク

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

流動性リスク

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

カントリーリスク

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

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

(その他の留意点)

「目標リターン」とは、必ず一定の収益を得ることのできる運用を意味するものではなく、記載されている目標リターンの数値は、その達成を示唆・保証するものではありません。したがって、投資者の元本が保証されるものではなく、各ファンドの基準価額は下落することがあります。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性が生じた場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響をおよぼす可能性や、換金のお申込みの受付が中止となる可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性があります。

分配金はファンドの純資産から支払われますので、分配金支払い後は純資産が減少し、基準価額が下落する要因となります。収益分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益の水準を示すものではありません。収益分配は、計算期間に生じた収益を超えて行われる場合があります。投資者の購入価額によっては、収益分配金の一部または全部が、実質的な元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり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7月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

〔参考情報〕

ラップ型ファンド・プラスESG(安定型)

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

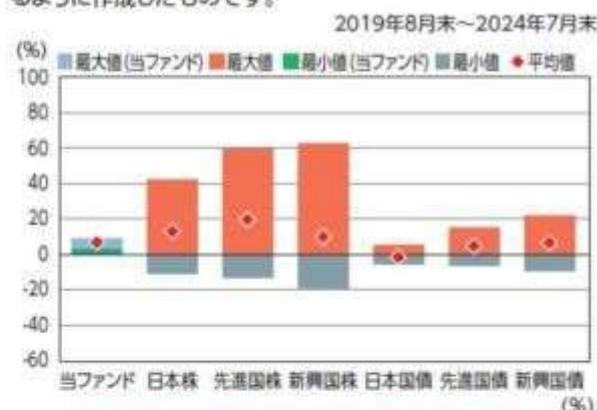


- * 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- * 年間騰落率は、2023年11月から2024年7月の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

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

ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	9.1	42.1	59.8	62.7	5.4	15.3	21.5
最小値	3.9	△10.8	△12.4	△19.4	△5.5	△6.1	△8.8
平均値	7.0	13.2	19.9	10.3	△1.3	5.0	6.7

- * 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- * 2019年8月から2024年7月の5年間(当ファンドは2023年11月から2024年7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。

ラップ型ファンド・プラスESG(安定成長型)

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、2023年11月から2024年7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。

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

ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	19.6	42.1	59.8	62.7	5.4	15.3	21.5
最小値	9.3	△10.8	△12.4	△19.4	△5.5	△6.1	△8.8
平均値	15.1	13.2	19.9	10.3	△1.3	5.0	6.7

- * 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- * 2019年8月から2024年7月の5年間(当ファンドは2023年11月から2024年7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。

ラップ型ファンド・プラスESG(成長型)

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

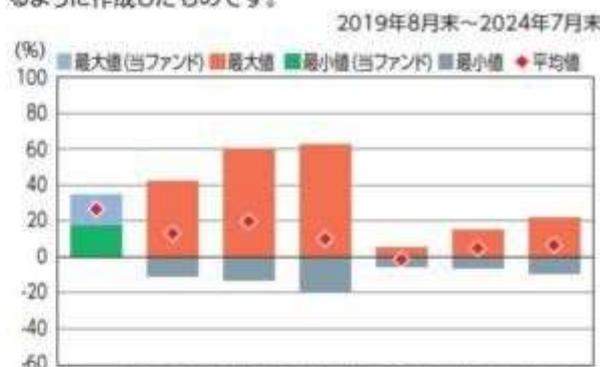


- * 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- * 年間騰落率は、2023年11月から2024年7月の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

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

ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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



(%)	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	34.3	42.1	59.8	62.7	5.4	15.3	21.5
最小値	17.0	△10.8	△12.4	△19.4	△5.5	△6.1	△8.8
平均値	26.6	13.2	19.9	10.3	△1.3	5.0	6.7

- * 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- * 2019年8月から2024年7月の5年間(当ファンドは2023年11月から2024年7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。

各資産クラスの指数

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

○代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

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

東証株価指数(TOPIX、配当込み)

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

MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み、円ベース)

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

MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)

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

NOMURA-BPI国債

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

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した指数です。なお、FTSE世界国債インデックスに関する著作権等の知的財産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、各ファンドの信託財産の純資産総額に次の率を乗じて得た額とします。

<ラップ型ファンド・プラスESG(安定型)>
年率0.66%(税抜0.60%)
<ラップ型ファンド・プラスESG(安定成長型)>
年率1.10%(税抜1.00%)
<ラップ型ファンド・プラスESG(成長型)>
年率1.21%(税抜1.10%)

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。

ファンド	信託報酬 = 日々の純資産総額 × 信託報酬率			
	合計	委託会社	販売会社	受託会社
ラップ型ファンド・プラスESG(安定型)	0.60%	0.28%	0.28%	0.04%
ラップ型ファンド・プラスESG(安定成長型)	1.00%	0.48%	0.48%	
ラップ型ファンド・プラスESG(成長型)	1.10%	0.53%	0.53%	

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

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

支払時期

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

(4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

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

上場投資信託証券、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

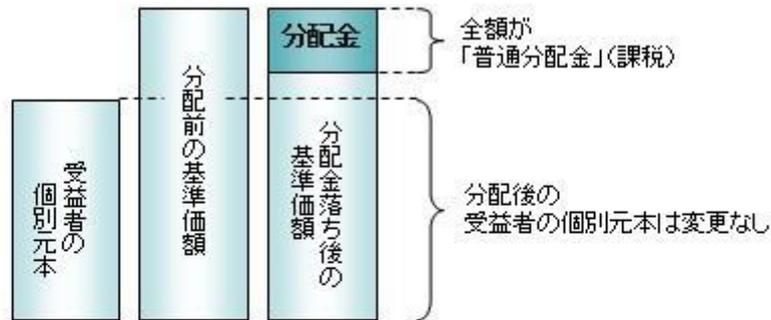
イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

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。

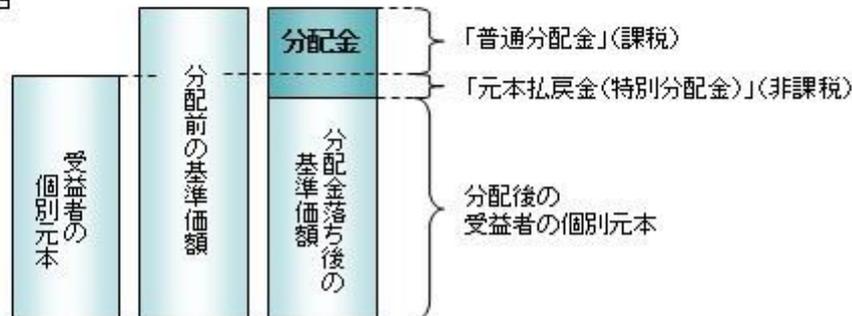
ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

<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7月末現在のものですので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

【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
安定型	0.70%	0.66%	0.04%
安定成長型	1.16%	1.10%	0.06%
成長型	1.29%	1.20%	0.09%

※対象期間は2023年7月21日～2024年7月22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】

【ラップ型ファンド・プラスESG(安定型)】

以下の運用状況は2024年7月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1)【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	625,844,349	100.47
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		2,914,682	0.47
合計(純資産総額)		622,929,667	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米ドル建SDGs債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	187,620,344	0.8584	161,053,304	0.8619	161,709,974	25.96
日本	親投資信託受益証券	RM国内SDGs債券マザーファンド	158,086,539	0.9893	156,395,014	0.9869	156,015,605	25.05
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）	125,565,015	0.8731	109,630,815	0.8767	110,082,848	17.67
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	34,781,630	2.5097	87,291,457	2.3917	83,187,224	13.35
日本	親投資信託受益証券	RM国内株式ESGマザーファンド	27,741,176	1.9219	53,317,083	1.9239	53,371,248	8.57
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	11,226,494	1.8622	20,906,770	1.8170	20,398,539	3.27
日本	親投資信託受益証券	RM国内リートマザーファンド	11,984,454	1.3935	16,700,337	1.3980	16,754,266	2.69
日本	親投資信託受益証券	RM新興国債券マザーファンド	8,707,444	1.4441	12,574,776	1.3973	12,166,911	1.95
日本	親投資信託受益証券	RM新興国株式マザーファンド	5,988,147	2.1260	12,731,278	2.0303	12,157,734	1.95

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	100.47
合計	100.47

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第1計算期間末 (2023年 7月20日)	215	215	1.0337	1.0337
第2計算期間末 (2024年 7月22日)	627	627	1.1027	1.1027
2023年 7月末日	216		1.0341	
8月末日	273		1.0365	
9月末日	316		1.0191	
10月末日	317		1.0051	
11月末日	334		1.0407	
12月末日	348		1.0529	
2024年 1月末日	392		1.0646	
2月末日	414		1.0704	
3月末日	468		1.0870	
4月末日	548		1.0794	

5月末日	598		1.0829
6月末日	617		1.1020
7月末日	622		1.0926

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2022年11月 1日～2023年 7月20日	0.0000
第2期	2023年 7月21日～2024年 7月22日	0.0000

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1期	2022年11月 1日～2023年 7月20日	3.37
第2期	2023年 7月21日～2024年 7月22日	6.68

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

（４）【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	2022年11月 1日～2023年 7月20日	214,790,048	5,951,773
第2期	2023年 7月21日～2024年 7月22日	427,724,026	67,608,737

(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。

【ラップ型ファンド・プラスESG（安定成長型）】

以下の運用状況は2024年 7月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

（１）【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	6,459,127,990	99.99
コール・ローン等・その他資産（負債控除後）		392,432	0.01
合計（純資産総額）		6,459,520,422	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	764,171,748	2.5090	1,917,306,916	2.3917	1,827,669,569	28.29
日本	親投資信託受益証券	RM国内SDGs債券マザーファンド	1,046,917,445	0.9893	1,035,811,968	0.9869	1,033,202,826	16.00
日本	親投資信託受益証券	RM国内株式ESGマザーファンド	530,831,444	1.9373	1,028,425,099	1.9239	1,021,266,615	15.81
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）	999,016,544	0.8583	857,550,535	0.8619	861,052,359	13.33
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）	667,796,203	0.8731	583,053,432	0.8767	585,456,931	9.06

日本	親投資信託受益証券	R M先進国リートマザーファンド	213,251,275	1.8633	397,363,721	1.8170	387,477,566	6.00
日本	親投資信託受益証券	R M新興国株式マザーファンド	174,755,125	2.1266	371,646,104	2.0303	354,805,330	5.49
日本	親投資信託受益証券	R M国内リートマザーファンド	187,460,560	1.3934	261,207,545	1.3980	262,069,862	4.06
日本	親投資信託受益証券	R M新興国債券マザーファンド	90,264,748	1.4441	130,355,225	1.3973	126,126,932	1.95

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.99
合計	99.99

【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】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第1計算期間末 (2023年 7月20日)	1,475	1,475	1.0694	1.0694
第2計算期間末 (2024年 7月22日)	6,374	6,374	1.2271	1.2271
2023年 7月末日	1,534		1.0757	
8月末日	1,776		1.0834	
9月末日	1,939		1.0613	
10月末日	2,062		1.0375	
11月末日	2,290		1.0909	
12月末日	2,764		1.1036	
2024年 1月末日	3,348		1.1337	
2月末日	3,783		1.1551	
3月末日	4,458		1.1856	
4月末日	5,029		1.1839	
5月末日	5,561		1.1946	
6月末日	6,148		1.2303	
7月末日	6,459		1.2019	

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2022年11月 1日～2023年 7月20日	0.0000
第2期	2023年 7月21日～2024年 7月22日	0.0000

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
---	----	--------

第1期	2022年11月 1日～2023年 7月20日	6.94
第2期	2023年 7月21日～2024年 7月22日	14.75

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

(4)【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	2022年11月 1日～2023年 7月20日	1,406,300,508	26,842,176
第2期	2023年 7月21日～2024年 7月22日	4,122,457,793	307,414,173

(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。

【ラップ型ファンド・プラスESG(成長型)】

以下の運用状況は2024年 7月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1)【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	8,977,306,343	99.97
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		2,487,063	0.03
合計(純資産総額)		8,979,793,406	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	1,970,727,037	2.5091	4,944,751,209	2.3917	4,713,387,854	52.49
日本	親投資信託受益証券	RM国内株式ESGマザーファンド	915,427,011	1.9410	1,776,859,381	1.9239	1,761,190,026	19.61
日本	親投資信託受益証券	RM新興国株式マザーファンド	355,571,670	2.1270	756,313,032	2.0303	721,917,161	8.04
日本	親投資信託受益証券	RM国内SDGs債券マザーファンド	636,000,989	0.9894	629,259,378	0.9869	627,669,376	6.99
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	290,143,067	1.8644	540,960,186	1.8170	527,189,952	5.87
日本	親投資信託受益証券	RM国内リートマザーファンド	259,510,649	1.3935	361,628,090	1.3980	362,795,887	4.04
日本	親投資信託受益証券	RM新興国債券マザーファンド	125,919,673	1.4447	181,922,407	1.3973	175,947,559	1.96
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)	60,862,603	0.8584	52,244,458	0.8619	52,457,477	0.58
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)	39,638,475	0.8731	34,608,352	0.8767	34,751,051	0.39

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.97
合計	99.97

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第1計算期間末 (2023年 7月20日)	1,874	1,874	1.1179	1.1179
第2計算期間末 (2024年 7月22日)	9,115	9,115	1.4057	1.4057
2023年 7月末日	1,989		1.1314	
8月末日	2,327		1.1471	
9月末日	3,043		1.1194	
10月末日	3,100		1.0846	
11月末日	3,461		1.1614	
12月末日	3,195		1.1735	
2024年 1月末日	4,084		1.2318	
2月末日	5,191		1.2778	
3月末日	6,373		1.3267	
4月末日	7,180		1.3346	
5月末日	7,919		1.3563	
6月末日	8,873		1.4184	
7月末日	8,979		1.3574	

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2022年11月 1日～2023年 7月20日	0.0000
第2期	2023年 7月21日～2024年 7月22日	0.0000

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1期	2022年11月 1日～2023年 7月20日	11.79
第2期	2023年 7月21日～2024年 7月22日	25.74

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

(4) 【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	2022年11月 1日～2023年 7月20日	1,796,542,679	119,520,405
第2期	2023年 7月21日～2024年 7月22日	6,151,904,330	1,344,447,762

(注)第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

(参考)

RM国内SDGs債券マザーファンド

以下の運用状況は2024年7月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	296,235,000	10.96
特殊債券	日本	590,332,000	21.84
社債券	日本	1,749,184,000	64.71
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		67,296,509	2.49
合計（純資産総額）		2,703,047,509	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	社債券	第19回森永乳業株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	100.30	100,307,000	100.03	100,036,000	1.092	2031/6/5	3.70
日本	国債証券	第168回利付国債（5年）	100,000,000	100.20	100,204,000	99.86	99,864,000	0.600	2029/3/20	3.69
日本	国債証券	第448回利付国債（2年）	100,000,000	99.92	99,922,000	99.81	99,817,000	0.005	2025/5/1	3.69
日本	特殊債券	第113回東日本高速道路株式会社社債（一般担保付、独立行政法	100,000,000	100.00	100,007,000	99.79	99,792,000	0.439	2026/7/24	3.69
日本	社債券	第18回野村不動産ホールディングス株式会社無担保社債（グリーン	100,000,000	100.02	100,022,000	99.67	99,670,000	0.913	2029/7/10	3.69
日本	社債券	第20回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債（社債	100,000,000	99.94	99,944,000	99.65	99,650,000	0.633	2027/7/16	3.69
日本	社債券	第67回日産自動車株式会社無担保社債（特定社債間限定同順位特	100,000,000	99.83	99,834,000	99.65	99,650,000	1.015	2026/1/20	3.69
日本	特殊債券	F35回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99.87	99,870,000	99.42	99,421,000	0.638	2029/6/28	3.68
日本	特殊債券	第99回中日本高速道路株式会社社債（グリーンボンド（気候変動	100,000,000	99.35	99,352,000	99.01	99,019,000	0.440	2028/3/28	3.66
日本	特殊債券	第61回西日本高速道路株式会社社債（一般担保付、独立行政法人	100,000,000	99.16	99,167,000	98.96	98,964,000	0.040	2026/6/19	3.66
日本	特殊債券	第65回西日本高速道路株式会社社債（一般担保付、独立行政法人	100,000,000	99.02	99,024,000	98.77	98,779,000	0.100	2026/12/18	3.65
日本	社債券	第5回日本貨物鉄道株式会社社債（一般担保付）（グリーンボンド	100,000,000	98.72	98,728,000	98.64	98,641,000	1.228	2034/6/13	3.65

日本	社債券	第31回KDDI株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	98.92	98,925,000	98.62	98,620,000	0.430	2027/10/27	3.65
日本	社債券	第8回日本碍子株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	98.28	98,284,000	97.98	97,980,000	0.305	2027/11/24	3.62
日本	社債券	第25回NTTファイナンス株式会社無担保社債(社債間限定)	100,000,000	98.28	98,287,000	97.97	97,973,000	0.648	2030/6/20	3.62
日本	社債券	第8回日本製鉄株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	98.15	98,153,000	97.93	97,933,000	1.150	2033/3/18	3.62
日本	社債券	第84回三井不動産株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	97.34	97,347,000	97.17	97,172,000	1.057	2033/9/12	3.59
日本	社債券	第33回東京建物株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	97.26	97,264,000	96.92	96,926,000	0.290	2028/7/28	3.59
日本	国債証券	第359回利付国債(10年)	100,000,000	96.89	96,897,000	96.55	96,554,000	0.100	2030/6/20	3.57
日本	社債券	第1回東日本旅客鉄道株式会社サステナビリティポイント・無担保普	100,000,000	96.40	96,403,000	96.06	96,063,000	0.220	2030/1/25	3.55
日本	社債券	第14回九州旅客鉄道株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約)	100,000,000	95.72	95,723,000	95.55	95,550,000	0.768	2033/7/21	3.53
日本	社債券	第30回豊田通商株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	95.47	95,477,000	95.26	95,260,000	0.684	2032/11/25	3.52
日本	社債券	第132回東武鉄道株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	95.45	95,456,000	95.23	95,237,000	0.624	2032/6/2	3.52
日本	社債券	第524回東北電力株式会社社債(一般担保付)(グリーンボンド)	100,000,000	95.15	95,157,000	94.86	94,869,000	0.320	2030/9/25	3.51
日本	特殊債券	第88回東日本高速道路株式会社社債(一般担保付、独立行政法人)	100,000,000	94.57	94,579,000	94.35	94,357,000	0.185	2031/11/28	3.49
日本	社債券	第545回中部電力株式会社社債(一般担保付)(グリーンボンド)	100,000,000	94.33	94,334,000	94.07	94,070,000	0.300	2031/7/25	3.48
日本	社債券	第494回九州電力株式会社社債(一般担保付)(グリーンボンド)	100,000,000	94.13	94,139,000	93.88	93,884,000	0.310	2031/5/23	3.47

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	10.96
特殊債券	21.84
社債券	64.71
合計	97.51

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 7月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	159,603,128	6.00
特殊債券	ドイツ	142,006,035	5.34
	国際機関	2,246,613,848	84.43
	小計	2,388,619,883	89.77
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		112,679,715	4.23
合計（純資産総額）		2,660,902,726	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		2,513,671,316	94.47

(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	2,000,000	13,207.97	264,159,416	13,526.06	270,521,344	1.125	2028/9/13	10.17
国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	2,000,000	12,423.26	248,465,251	12,826.99	256,539,873	1.625	2031/11/3	9.64
国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000	15,431.50	154,315,012	15,834.88	158,348,843	4.750	2033/11/14	5.95
国際機関	特殊債券	EUROPEAN BK RECON & DEV	1,000,000	15,029.47	150,294,741	15,152.64	151,526,450	1.625	2024/9/27	5.69
国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000	14,888.67	148,886,724	14,990.75	149,907,528	2.875	2025/6/13	5.63
国際機関	特殊債券	INTER-AMERICAN DEVELOP BK	1,000,000	14,477.19	144,771,919	14,806.61	148,066,172	3.500	2029/9/14	5.56
国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000	14,578.36	145,783,654	14,797.27	147,972,750	3.125	2027/6/15	5.56
国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000	14,513.81	145,138,124	14,664.40	146,644,077	2.125	2026/4/13	5.51
国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000	14,279.73	142,797,303	14,508.55	145,085,555	2.375	2027/5/24	5.45
国際機関	特殊債券	INTER-AMERICAN DEVELOP BK	1,000,000	14,010.35	140,103,540	14,423.19	144,231,911	3.500	2033/4/12	5.42
ドイツ	特殊債券	KfW	1,000,000	13,972.61	139,726,155	14,200.60	142,006,035	1.000	2026/10/1	5.34
国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000	13,497.66	134,976,647	13,810.35	138,103,576	1.375	2028/4/20	5.19
国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000	13,175.78	131,757,839	13,584.96	135,849,606	2.500	2032/3/29	5.11
国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000	12,328.93	123,289,336	12,720.58	127,205,802	0.875	2030/5/17	4.78

国際機関	特殊債券	INTER-AMERICAN DEVEL BK	1,000,000	12,248.78	122,487,830	12,661.03	126,610,361	1.125	2031/1/13	4.76
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	400,000	15,352.23	61,408,929	15,662.01	62,648,076	4.500	2033/11/15	2.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	370,000	12,812.63	47,406,736	13,050.59	48,287,186	1.625	2031/5/15	1.81
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	270,000	14,965.03	40,405,594	15,207.08	41,059,118	4.000	2029/1/31	1.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	40,000	14,973.05	5,989,222	15,263.34	6,105,339	4.125	2032/11/15	0.23
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,000	14,902.53	1,490,253	15,034.09	1,503,409	3.625	2026/5/15	0.06

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	6.00
特殊債券	89.77
合計	95.77

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	16,547,000.00	2,557,508,719	2,513,671,316	94.47

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

RM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7月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	フランス	199,125,836	11.12
特殊債券	ドイツ	148,334,137	8.29
	国際機関	1,360,413,979	76.00
	小計	1,508,748,116	84.29
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		82,107,851	4.59
合計(純資産総額)		1,789,981,803	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		1,683,762,413	94.07

(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	EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000	16,219.33	162,193,389	16,386.80	163,868,053	2.750	2034/1/16	9.15

国際機関	特殊債券	ASIAN DEVELOPMENT BANK	1,000,000	15,908.01	159,080,101	16,050.50	160,505,080	0.350	2025/7/16	8.97
国際機関	特殊債券	EUROPEAN UNION	1,000,000	15,728.80	157,288,076	15,904.49	159,044,979	0.000	2025/11/4	8.89
国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000	15,219.42	152,194,295	15,438.81	154,388,156	0.000	2027/1/15	8.63
国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000	14,910.29	149,102,937	15,156.05	151,560,540	0.000	2027/11/15	8.47
国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000	14,705.05	147,050,551	15,074.59	150,745,901	1.500	2032/6/15	8.42
ドイツ	特殊債券	KFW	1,000,000	14,580.33	145,803,323	14,833.41	148,334,137	0.000	2028/9/15	8.29
国際機関	特殊債券	ASIAN DEVELOPMENT BANK	1,000,000	14,045.65	140,456,599	14,393.35	143,933,511	0.000	2029/10/24	8.04
国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000	13,735.43	137,354,359	13,982.77	139,827,709	0.010	2030/11/15	7.81
国際機関	特殊債券	INTL DEVELOPMENT ASSOC	1,000,000	13,390.48	133,904,860	13,654.00	136,540,050	0.000	2031/7/15	7.63
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	560,000	14,677.41	82,193,527	14,845.74	83,136,186	0.500	2029/5/25	4.64
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	350,000	16,365.33	57,278,680	16,554.21	57,939,749	3.000	2033/5/25	3.24
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	350,000	15,133.30	52,966,566	15,333.30	53,666,558	0.750	2028/5/25	3.00
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	10,000	17,191.64	1,719,164	17,168.13	1,716,813	3.500	2033/11/25	0.10
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	10,000	13,339.45	1,333,945	13,442.41	1,344,241	0.000	2031/11/25	0.08
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	10,000	13,134.21	1,313,421	13,222.89	1,322,289	0.000	2032/5/25	0.07

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	11.12
特殊債券	84.29
合計	95.41

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	10,235,700.00	1,720,993,570	1,683,762,413	94.07

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

R M国内株式E S Gマザーファンド

以下の運用状況は2024年 7月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	7,188,999,000	96.93
投資証券	日本	33,207,700	0.45
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		194,495,412	2.62
合計（純資産総額）		7,416,702,112	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	212,572,000	2.87

(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	190,300	3,137.82	597,128,146	2,949.00	561,194,700	7.57
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	22,400	12,991.12	291,001,132	13,530.00	303,072,000	4.09
日本	株式	日立製作所	電気機器	83,200	2,534.85	210,899,757	3,288.00	273,561,600	3.69
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	8,500	29,630.62	251,860,273	31,020.00	263,670,000	3.56
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	22,500	8,477.79	190,750,430	10,915.00	245,587,500	3.31
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	26,600	6,481.44	172,406,520	8,658.00	230,302,800	3.11
日本	株式	第一三共	医薬品	33,200	4,670.88	155,073,513	6,148.00	204,113,600	2.75
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	33,700	4,521.10	152,361,329	6,022.00	202,941,400	2.74
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	21,300	6,553.99	139,600,092	7,783.00	165,777,900	2.24
日本	株式	任天堂	その他製品	18,600	7,644.73	142,192,033	8,388.00	156,016,800	2.10
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	43,300	2,855.21	123,630,680	3,448.00	149,298,400	2.01
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	3,100	40,129.21	124,400,570	41,650.00	129,115,000	1.74
日本	株式	KDDI	情報・通信業	26,900	4,560.91	122,688,728	4,520.00	121,588,000	1.64
日本	株式	HOYA	精密機器	6,300	17,616.25	110,982,402	18,940.00	119,322,000	1.61
日本	株式	三菱重工業	機械	57,500	1,176.69	67,659,705	1,830.00	105,225,000	1.42
日本	株式	村田製作所	電気機器	30,900	2,963.15	91,561,350	3,351.00	103,545,900	1.40
日本	株式	ダイキン工業	機械	4,700	22,300.72	104,813,390	21,905.00	102,953,500	1.39
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	51,200	1,869.12	95,699,216	1,965.00	100,608,000	1.36
日本	株式	富士通	電気機器	31,600	2,321.05	73,345,221	2,732.50	86,347,000	1.16
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	19,600	4,896.44	95,970,255	4,282.00	83,927,200	1.13
日本	株式	M&A Dインシュアランスグループホールディングス	保険業	23,100	2,456.47	56,744,684	3,582.00	82,744,200	1.12
日本	株式	アドバンテスト	電気機器	13,700	5,287.05	72,432,630	6,029.00	82,597,300	1.11
日本	株式	ファナック	電気機器	17,100	4,306.55	73,642,040	4,510.00	77,121,000	1.04
日本	株式	オリックス	その他金融業	20,700	3,077.80	63,710,663	3,664.00	75,844,800	1.02
日本	株式	三井不動産	不動産業	47,900	1,374.93	65,859,270	1,573.50	75,370,650	1.02
日本	株式	TDK	電気機器	7,000	7,511.54	52,580,840	10,535.00	73,745,000	0.99
日本	株式	丸紅	卸売業	25,600	2,576.88	65,968,187	2,860.50	73,228,800	0.99
日本	株式	小松製作所	機械	16,600	4,182.49	69,429,385	4,357.00	72,326,200	0.98
日本	株式	富士フイルムホールディングス	化学	20,100	3,178.94	63,896,868	3,580.00	71,958,000	0.97
日本	株式	ルネサスエレクトロニクス	電気機器	26,800	2,565.73	68,761,736	2,578.00	69,090,400	0.93

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	0.53

建設業	1.68
食料品	2.99
繊維製品	0.35
化学	5.57
医薬品	4.68
石油・石炭製品	0.55
ゴム製品	0.87
ガラス・土石製品	0.46
鉄鋼	1.16
非鉄金属	0.56
金属製品	0.12
機械	5.55
電気機器	22.35
輸送用機器	8.08
精密機器	2.00
その他製品	3.06
電気・ガス業	1.07
陸運業	1.77
海運業	0.54
空運業	0.11
倉庫・運輸関連業	0.01
情報・通信業	4.31
卸売業	3.61
小売業	3.83
銀行業	5.94
証券、商品先物取引業	1.09
保険業	4.94
その他金融業	1.08
不動産業	2.50
サービス業	5.57
投資証券	0.45
合計	97.38

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	112,957,200	111,880,000	1.51
	大阪取引所	ミニTOPIX先物	買建	36	日本円	100,599,210	100,692,000	1.36

(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。

以下の運用状況は2024年 7月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	10,104,713,636	69.88
	カナダ	452,566,328	3.13
	ドイツ	142,512,032	0.99
	イタリア	80,530,965	0.56
	フランス	418,414,902	2.89
	オランダ	323,343,889	2.24
	スペイン	73,520,041	0.51
	ベルギー	15,249,172	0.11
	オーストリア	6,384,872	0.04
	ルクセンブルク	6,172,540	0.04
	フィンランド	53,398,067	0.37
	アイルランド	383,943,806	2.66
	ポルトガル	6,247,470	0.04
	イギリス	533,800,926	3.69
	スイス	371,228,729	2.57
	スウェーデン	136,186,411	0.94
	ノルウェー	38,431,766	0.27
	デンマーク	253,247,058	1.75
	ケイマン	2,692,837	0.02
	リベリア	16,411,818	0.11
	オーストラリア	207,849,571	1.44
	バミューダ	17,361,088	0.12
	ニュージーランド	10,497,500	0.07
	香港	61,226,662	0.42
	シンガポール	21,735,420	0.15
	キュラソー	29,154,054	0.20
ジャージー	32,716,549	0.23	
小計		13,799,538,109	95.43
投資証券	アメリカ	244,547,257	1.69
	カナダ	584,100	0.00
	フランス	2,398,770	0.02
	ベルギー	1,897,791	0.01
	イギリス	9,167,949	0.06
	オーストラリア	18,985,122	0.13
	シンガポール	6,495,832	0.04
小計		284,076,821	1.96
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		377,456,448	2.61
合計（純資産総額）		14,461,071,378	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	400,429,390	2.77
	買建	ドイツ	80,860,401	0.56

(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		128,323,851	0.89
	売建		664,276,531	4.59

(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	19,947	59,983.61	1,196,493,180	64,469.92	1,285,981,590	8.89
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	70,644	9,908.59	699,983,138	15,812.60	1,117,065,399	7.72
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	16,649	22,103.80	368,006,167	25,959.00	432,191,518	2.99
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	14,418	22,338.55	322,077,323	26,198.33	377,727,643	2.61
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	2,283	101,720.16	232,227,132	120,459.61	275,009,295	1.90
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	8,094	33,821.86	273,754,158	33,936.19	274,679,545	1.90
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	9,209	17,052.13	157,033,148	19,810.44	182,434,342	1.26
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	4,468	39,930.13	178,407,837	40,106.96	179,197,915	1.24
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	6,808	23,353.80	158,992,725	24,593.14	167,430,133	1.16
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	6,647	23,644.96	157,168,105	24,649.54	163,845,546	1.13
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	金融サービス	2,354	65,474.50	154,126,983	68,209.27	160,564,640	1.11
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	一般消費財・サービス流通・小売り	2,799	50,055.19	140,104,500	55,440.90	155,179,089	1.07
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	1,128	118,277.24	133,416,734	132,851.87	149,856,913	1.04
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	7,155	16,896.44	120,894,097	17,568.70	125,704,120	0.87

アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	11,566	9,097.61	105,223,064	10,317.13	119,328,032	0.83
アメリカ	株式	SALESFORCE INC	ソフトウェア・サービス	2,739	37,387.43	102,404,183	39,318.84	107,694,328	0.74
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	4,377	20,758.39	90,859,475	23,886.63	104,551,802	0.72
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	1,265	89,634.72	113,387,921	82,120.95	103,883,005	0.72
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	3,881	25,798.94	100,125,708	26,399.55	102,456,689	0.71
アメリカ	株式	ADVANCED MICRO DEVICES	半導体・半導体製造装置	4,564	25,318.75	115,554,819	21,103.79	96,317,714	0.67
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	5,564	15,281.66	85,027,203	17,022.26	94,711,899	0.65
アイルランド	株式	LINDE PLC	素材	1,361	64,660.47	88,002,906	68,727.57	93,538,228	0.65
アイルランド	株式	ACCENTURE PLC-CL A	ソフトウェア・サービス	1,775	51,075.02	90,658,164	50,183.24	89,075,265	0.62
フランス	株式	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	耐久消費財・アパレル	779	120,501.61	93,870,756	107,574.23	83,800,330	0.58
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	1,987	35,146.56	69,836,228	41,949.96	83,354,578	0.58
アメリカ	株式	MCDONALD'S CORP	消費者サービス	2,036	42,638.99	86,812,988	40,616.11	82,694,407	0.57
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	3,086	25,100.77	77,460,978	25,530.65	78,787,590	0.54
アメリカ	株式	TEXAS INSTRUMENTS INC	半導体・半導体製造装置	2,570	25,009.30	64,273,917	30,638.91	78,742,013	0.54
アメリカ	株式	AMGEN INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1,514	42,300.57	64,043,072	50,805.20	76,919,078	0.53
アメリカ	株式	INTUIT INC	ソフトウェア・サービス	790	90,188.07	71,248,581	96,921.35	76,567,868	0.53

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	2.80
		素材	3.64
		資本財	6.38
		商業・専門サービス	1.62
		運輸	1.75
		自動車・自動車部品	2.07
		耐久消費財・アパレル	1.92
		消費者サービス	1.75
		メディア・娯楽	7.32
		一般消費財・サービス流通・小売り	3.39

	生活必需品流通・小売り	0.85
	食品・飲料・タバコ	2.49
	家庭用品・パーソナル用品	2.66
	ヘルスケア機器・サービス	2.47
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.93
	銀行	3.43
	金融サービス	7.49
	保険	3.51
	ソフトウェア・サービス	14.88
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	0.62
	電気通信サービス	0.90
	公益事業	1.63
	半導体・半導体製造装置	11.73
	不動産管理・開発	0.21
投資証券		1.96
合計		97.39

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	SP500MIN2409	買建	7	米ドル	1,955,039.94	298,026,289	1,915,375	291,979,765	2.02
	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP500MIC2409	買建	26	米ドル	714,664.88	108,943,516	711,425	108,449,625	0.75
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	STX E6002409	買建	19	ユーロ	489,268.89	80,675,544	490,390	80,860,401	0.56

(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	673,000.00	102,666,859	102,563,071	0.71
	カナダドル	買建	30,000.00	3,300,030	3,300,099	0.02
	ユーロ	買建	60,000.00	9,912,501	9,891,530	0.07
	英ポンド	買建	20,000.00	3,914,000	3,914,094	0.03
	スイスフラン	買建	20,000.00	3,456,698	3,456,786	0.02
	デンマーククローネ	買建	100,000.00	2,209,200	2,209,530	0.02
	オーストラリアドル	買建	30,000.00	2,988,540	2,988,741	0.02
	米ドル	売建	3,493,000.00	538,026,790	532,392,581	3.68
	カナダドル	売建	190,000.00	21,126,480	20,903,173	0.14
	ユーロ	売建	350,000.00	58,309,300	57,705,550	0.40
	英ポンド	売建	120,000.00	23,758,800	23,487,876	0.16
	スウェーデンクローナ	売建	400,000.00	5,688,400	5,663,480	0.04

デンマーククローネ	売建	450,000.00	10,046,250	9,943,965	0.07
オーストラリアドル	売建	100,000.00	10,084,300	9,963,730	0.07
ニュージーランドドル	売建	10,000.00	905,240	899,867	0.01
香港ドル	売建	170,000.00	3,352,060	3,316,309	0.02

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

R M新興国債券マザーファンド

以下の運用状況は2024年 7月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	アイルランド	11,300,228,924	97.08
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		340,424,666	2.92
合計(純資産総額)		11,640,653,590	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		77,610,736	0.67

(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 (%)
アイルランド	投資信託受益証券	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	1,729,562	6,743.40	11,663,129,599	6,533.57	11,300,228,924	97.08

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	97.08
合計	97.08

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	509,200.00	78,356,205	77,610,736	0.67

(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 7月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	98,499,626	0.26
	メキシコ	722,414,414	1.91
	ブラジル	1,552,662,651	4.10
	チリ	156,734,403	0.41
	コロンビア	37,342,176	0.10
	ペルー	11,758,953	0.03
	オランダ	20,091,879	0.05
	ルクセンブルク	40,518,383	0.11
	ギリシャ	185,707,972	0.49
	イギリス	55,395,756	0.15
	トルコ	281,532,444	0.74
	チェコ	47,579,428	0.13
	キプロス	0	0.00
	ハンガリー	89,185,646	0.24
	ポーランド	302,981,255	0.80
	ロシア	0	0.00
	ケイマン	4,862,271,533	12.84
	バミューダ	135,781,659	0.36
	香港	280,328,460	0.74
	シンガポール	9,238,960	0.02
	マレーシア	514,281,775	1.36
	タイ	496,871,354	1.31
	フィリピン	194,037,011	0.51
	インドネシア	593,109,578	1.57
	韓国	4,307,015,923	11.38
	台湾	6,572,417,619	17.36
	中国	3,496,113,949	9.23
	インド	7,244,956,407	19.14
	カザフスタン	0	0.00
	カタール	293,836,061	0.78
	エジプト	24,690,231	0.07
	南アフリカ	998,416,054	2.64
	英ヴァージン諸島	0	0.00
アラブ首長国連邦	435,928,253	1.15	
クウェート	274,801,959	0.73	
サウジアラビア	1,454,098,994	3.84	
小計		35,790,600,766	94.53
投資証券	メキシコ	32,772,930	0.09
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		2,036,288,323	5.38
合計(純資産総額)		37,859,662,019	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	2,043,267,642	5.40

(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		437,734,988	1.16
	売建		911,081	0.00

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	776,000	2,991.21	2,321,186,054	4,359.15	3,382,705,056	8.93
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	208,100	5,568.02	1,158,706,247	6,898.73	1,435,626,962	3.79
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	150,377	8,229.79	1,237,571,693	8,950.50	1,345,949,339	3.56
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	一般消費財・サービス流通・小売り	490,340	1,418.66	695,628,752	1,486.66	728,969,845	1.93
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	95,915	4,963.83	476,106,186	5,538.12	531,189,643	1.40
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	163,722	1,845.71	302,184,117	2,213.29	362,364,838	0.96
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	104,718	3,064.68	320,927,616	3,435.18	359,725,650	0.95
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	17,192	16,080.71	276,459,704	20,873.44	358,856,352	0.95
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	392,800	485.51	190,712,027	908.93	357,027,861	0.94
ケイマン	株式	PDD HOLDINGS INC	一般消費財・サービス流通・小売り	18,823	21,919.65	412,593,581	18,774.51	353,392,609	0.93
ケイマン	株式	MEITUAN	消費者サービス	159,610	1,407.90	224,715,046	2,075.86	331,328,653	0.88
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	3,027,000	90.04	272,571,410	105.93	320,678,261	0.85
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	47,900	4,441.85	212,765,020	5,819.93	278,774,982	0.74
インド	株式	HDFC BANK LIMITED	銀行	88,573	2,671.70	236,640,899	2,956.45	261,862,222	0.69
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	28,549	7,041.66	201,032,371	7,988.59	228,066,270	0.60
サウジアラビア	株式	AL RAJHI BANK	銀行	61,780	3,568.65	220,471,511	3,459.50	213,727,910	0.56
インド	株式	BHARTI AIRTEL LTD	電気通信サービス	71,541	2,194.80	157,018,775	2,690.74	192,498,266	0.51
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	25,932	6,738.30	174,737,740	6,961.50	180,525,618	0.48
ブラジル	株式	VALE SA	素材	107,404	1,887.12	202,684,429	1,634.25	175,525,026	0.46

中国	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	2,048,000	73.43	150,389,283	84.28	172,611,994	0.46
ケイマン	株式	NETEASE INC	メディア・娯楽	60,900	3,040.51	185,167,664	2,782.12	169,431,473	0.45
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	2,500,000	57.78	144,455,781	67.11	167,786,000	0.44
インドネシア	株式	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	銀行	1,749,800	89.81	157,151,070	95.64	167,359,621	0.44
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	5,622	26,662.81	149,898,341	28,874.31	162,331,373	0.43
インド	株式	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	自動車・自動車部品	29,432	3,069.83	90,351,373	5,347.44	157,385,942	0.42
インド	株式	AXIS BANK LTD	銀行	72,011	1,954.16	140,721,370	2,141.09	154,182,752	0.41
ケイマン	株式	XIAOMI CORP-CLASS B	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	482,200	269.19	129,805,871	318.40	153,534,023	0.41
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	エネルギー	150,300	1,030.03	154,814,589	994.60	149,489,537	0.39
インド	株式	LARSEN & TOUBRO LTD	資本財	21,276	6,566.77	139,714,786	6,925.90	147,355,651	0.39
ケイマン	株式	JD.COM INC - CL A	一般消費財・サービス流通・小売り	73,260	1,774.62	130,008,870	1,993.92	146,074,726	0.39

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国外	エネルギー	4.88
		素材	6.48
		資本財	4.73
		商業・専門サービス	0.04
		運輸	1.82
		自動車・自動車部品	3.74
		耐久消費財・アパレル	1.02
		消費者サービス	2.19
		メディア・娯楽	5.69
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.57
		生活必需品流通・小売り	1.25
		食品・飲料・タバコ	3.00
		家庭用品・パーソナル用品	0.75
		ヘルスケア機器・サービス	0.88
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.40
		銀行	16.01
		金融サービス	2.57
		保険	2.58
		ソフトウェア・サービス	2.55
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8.55
電気通信サービス	2.57		
公益事業	2.92		
半導体・半導体製造装置	12.00		
不動産管理・開発	1.33		

投資証券			0.09
合計			94.62

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 2409	買建	250	米ドル	13,704,072.29	2,089,048,777	13,403,750	2,043,267,642	5.40

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

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	買建	2,871,956.47	442,369,355	437,734,988	1.16
	カタルリアル	売建	13,804.50	584,344	578,132	0.00
	オフショア人民元	売建	15,811.65	335,031	332,949	0.00

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

RM国内リートマザーファンド

以下の運用状況は2024年 7月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	日本	64,022,598,400	98.66
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		870,583,513	1.34
合計(純資産総額)		64,893,181,913	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	818,575,000	1.26

(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	7,510	589,295.24	4,425,607,252	579,000	4,348,290,000	6.70
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	6,613	550,127.52	3,637,993,289	520,000	3,438,760,000	5.30
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	20,817	155,665.17	3,240,481,843	147,700	3,074,670,900	4.74
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	32,431	96,985.12	3,145,324,493	93,600	3,035,541,600	4.68
日本	投資証券	G L P 投資法人	21,623	131,795.1	2,849,805,447	131,400	2,841,262,200	4.38
日本	投資証券	K D X 不動産投資法人	18,010	160,147.63	2,884,258,816	154,600	2,784,346,000	4.29
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	11,214	267,112.55	2,995,400,135	247,100	2,770,979,400	4.27

日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	35,469	63,921.91	2,267,246,347	68,100	2,415,438,900	3.72
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	9,704	253,440.25	2,459,384,186	242,100	2,349,338,400	3.62
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	14,400	148,879.5	2,143,864,800	143,400	2,064,960,000	3.18
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	12,827	166,404.3	2,134,467,956	156,100	2,002,294,700	3.09
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	6,327	328,313.8	2,077,241,412	315,000	1,993,005,000	3.07
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	23,649	77,096.92	1,823,265,061	76,800	1,816,243,200	2.80
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	19,344	78,496.34	1,518,433,200	79,300	1,533,979,200	2.36
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	11,787	134,054.37	1,580,098,859	123,600	1,456,873,200	2.25
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	4,402	344,136.89	1,514,890,589	326,500	1,437,253,000	2.21
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	2,223	618,931.28	1,375,884,235	642,000	1,427,166,000	2.20
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	8,247	149,710.67	1,234,663,895	148,200	1,222,205,400	1.88
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	2,684	453,639.55	1,217,568,552	422,500	1,133,990,000	1.75
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	4,325	276,973.92	1,197,912,209	256,200	1,108,065,000	1.71
日本	投資証券	アクティブア・プロパティーズ投資法人	3,129	398,743.06	1,247,667,034	353,500	1,106,101,500	1.70
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	2,388	441,331.4	1,053,899,383	434,500	1,037,586,000	1.60
日本	投資証券	イオンリート投資法人	7,897	139,040.58	1,098,003,460	129,600	1,023,451,200	1.58
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	3,170	317,822.87	1,007,498,497	311,500	987,455,000	1.52
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	7,570	137,294.21	1,039,317,169	128,600	973,502,000	1.50
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	9,508	105,802.42	1,005,969,409	101,900	968,865,200	1.49
日本	投資証券	森トラストリート投資法人	12,408	72,895.85	904,491,706	69,800	866,078,400	1.33
日本	投資証券	三菱地所物流リート投資法人	2,223	378,725.82	841,907,497	378,500	841,405,500	1.30
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	5,688	153,454.34	872,848,285	142,700	811,677,600	1.25
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	2,667	302,010.21	805,461,230	293,400	782,497,800	1.21

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	98.66
合計	98.66

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	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	478	日本円	812,184,880	818,575,000	1.26

(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7月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	622,493,814	0.79
	オーストラリア	49,958,947	0.06

	小計	672,452,761	0.86
投資証券	アメリカ	60,858,916,693	77.50
	カナダ	1,104,835,330	1.41
	ドイツ	25,950,949	0.03
	イタリア	4,831,899	0.01
	フランス	1,305,165,118	1.66
	オランダ	134,857,887	0.17
	スペイン	361,079,948	0.46
	ベルギー	793,436,904	1.01
	アイルランド	23,924,093	0.03
	イギリス	3,778,822,162	4.81
	オーストラリア	5,551,378,515	7.07
	ニュージーランド	211,679,000	0.27
	香港	644,273,560	0.82
	シンガポール	2,424,963,409	3.09
	韓国	140,044,320	0.18
	イスラエル	80,462,517	0.10
ガーンジー	167,225,097	0.21	
	小計	77,611,847,401	98.83
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		246,938,564	0.31
合計(純資産総額)		78,531,238,726	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		780,439,805	0.99
	売建		23,455,657	0.03

(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	332,158	18,732.44	6,222,132,280	19,221.15	6,384,461,930	8.13
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	34,048	120,372.54	4,098,444,538	117,191.29	3,990,129,342	5.08
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	214,530	13,711.65	2,941,562,400	17,109.86	3,670,579,467	4.67
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	312,413	8,328.68	2,601,990,345	8,897.92	2,779,826,756	3.54
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	116,938	21,744.13	2,542,715,211	23,599.23	2,759,647,506	3.51
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	56,737	43,601.56	2,473,821,927	46,398.16	2,632,492,563	3.35
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	116,418	21,236.49	2,472,310,698	22,109.89	2,573,990,059	3.28
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	620,402	2,637.02	1,636,017,215	3,492.73	2,166,898,228	2.76
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	75,956	22,278.84	1,692,211,616	24,862.96	1,888,491,294	2.40
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	374,412	4,571.09	1,711,471,705	4,789.66	1,793,307,977	2.28
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	105,161	10,658.39	1,120,846,975	15,440.64	1,623,753,942	2.07
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	50,938	27,353.78	1,393,347,280	31,423.98	1,600,674,775	2.04

アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	123,714	9,151.67	1,132,189,729	10,605.25	1,312,017,997	1.67
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	145,264	7,195.54	1,045,253,079	8,362.85	1,214,822,263	1.55
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	206,550	5,096.23	1,052,627,183	5,333.87	1,101,712,005	1.40
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	56,488	18,394.56	1,039,072,180	18,143.40	1,024,884,876	1.31
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	23,033	36,380.04	837,941,509	42,805.15	985,931,066	1.26
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	41,908	20,401.21	854,974,308	21,541.29	902,752,650	1.15
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	44,709	18,877.19	843,980,672	19,396.46	867,196,580	1.10
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	480,607	1,673.47	804,282,430	1,787.28	858,983,508	1.09
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	252,606	2,894.62	731,200,186	3,329.28	840,998,529	1.07
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	239,475	3,033.52	726,452,262	3,358.25	804,217,685	1.02
アメリカ	投資証券	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	97,505	6,946.51	677,319,533	7,660.11	746,899,026	0.95
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	78,526	9,473.13	743,887,470	9,268.35	727,806,609	0.93
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	66,898	9,920.04	663,631,027	10,449.76	699,068,178	0.89
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	253,028	2,946.32	745,501,548	2,713.43	686,574,272	0.87
アメリカ	投資証券	UDR INC	108,676	5,642.42	613,195,737	6,227.17	676,744,362	0.86
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	38,215	15,037.14	574,644,455	17,041.26	651,232,041	0.83
アメリカ	投資証券	AMERICAN HOMES 4 RENT- A	115,434	5,370.64	619,955,439	5,509.18	635,946,869	0.81
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	1,867,816	295.56	552,062,779	338.81	632,834,739	0.81

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)	0.86
投資証券			98.83
合計			99.69

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等 (円)	評価額 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	米ドル	買建	3,578,000.00	551,004,743	545,348,026	0.69
	ユーロ	買建	370,000.00	61,263,207	61,003,010	0.08
	英ポンド	買建	345,000.00	68,001,261	67,527,643	0.09
	オーストラリアドル	買建	740,000.00	74,623,820	73,731,602	0.09
	ニュージーランドドル	買建	80,000.00	7,241,920	7,198,936	0.01
	香港ドル	買建	440,000.00	8,675,920	8,583,388	0.01
	シンガポールドル	買建	150,000.00	17,194,860	17,047,200	0.02
	米ドル	売建	133,000.00	20,270,929	20,271,461	0.03
	オーストラリアドル	売建	30,000.00	2,988,906	2,989,119	0.00
	香港ドル	売建	10,000.00	195,084	195,077	0.00

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

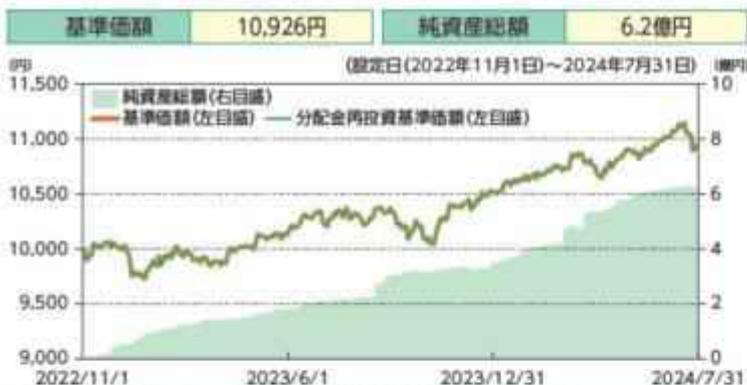
参考情報

運用実績

ラップ型ファンド・プラスESG(安定型)

2024年7月31日現在

基準価額・純資産の推移



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

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

2023年7月20日	0円
2024年7月22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SDGs債券マザーファンド	25.0
RM米ドル建SDGs債券マザーファンド(為替ヘッジあり)	26.0
RMユーロ建SDGs債券マザーファンド(為替ヘッジあり)	17.7
RM国内株式ESGマザーファンド	8.6
RM先進国株式ESGマザーファンド	13.4
RM新興国債券マザーファンド	2.0
RM新興国株式マザーファンド	2.0
RM国内リートマザーファンド	2.7
RM先進国リートマザーファンド	3.3
現金等	-0.5
合計	100.0

※比率はファンドの純資産総額に対する組入比率であり、四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。
 ※現金等には未収・未払項目が含まれるためマイナスとなる場合があります。

■通貨別組入比率

通貨	比率(%)
日本円	79.4
米ドル	13.1
ユーロ	1.2
英ポンド	0.7
カナダドル	0.5
その他	5.1
合計	100.0

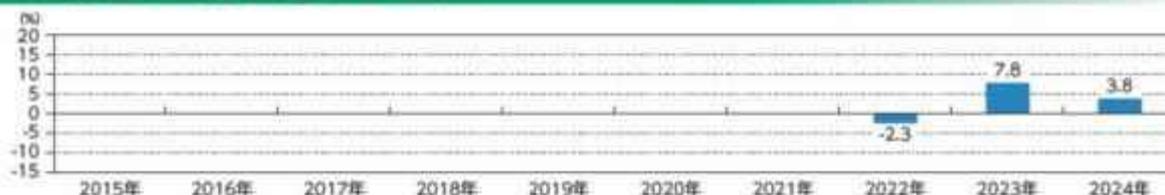
※比率はファンドの純資産総額に対する組入比率であり、四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。
 ※上記通貨別組入比率は、各マザーファンドが実質的に保有している株式・債券等の通貨を基準に算出しています。
 ※為替ヘッジをかけている外貨建資産については、日本円に含めてあります。

■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SDGs債券	日本 第19回読売不動産株式会社債券(社債)固定利率付(2021/6/5)	2031/6/5	3.70
	日本 第168回利付国債(5年)	2029/3/20	3.69
	日本 第448回利付国債(2年)	2025/5/1	3.69
米ドル建SDGs債券	国際機関 INTL BK RECON & DEVELOP.	2028/9/13	10.17
	国際機関 INTL BK RECON & DEVELOP.	2031/11/3	9.64
(為替ヘッジあり)	国際機関 INTL BK RECON & DEVELOP.	2033/11/14	5.95
ユーロ建SDGs債券	国際機関 EUROPEAN INVESTMENT BANK	2034/1/16	9.15
	国際機関 ASIAN DEVELOPMENT BANK	2025/7/16	8.97
(為替ヘッジあり)	国際機関 EUROPEAN UNION	2025/11/4	8.89
国内株式ESG	日本 トヨタ自動車	—	7.57
	日本 ソニーグループ	—	4.09
	日本 日立製作所	—	3.69
先進国株式ESG	アメリカ MICROSOFT CORP	—	8.89
	アメリカ NVIDIA CORP	—	7.72
	アメリカ ALPHABET INC-CL A	—	2.99
新興国債券	アイルランド ISHARES JPM EM LCL GOV BND	—	97.08
	台湾 TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	—	8.93
新興国株式	ケイマン TENCENT HOLDINGS LTD	—	3.79
	韓国 SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	—	3.56
国内リート	日本 日本ビルファンド投資法人	—	6.70
	日本 ジャパネットリアルエステイト投資法人	—	5.30
	日本 野村不動産マスターファンド投資法人	—	4.74
	アメリカ PROLOGIS INC	—	8.13
先進国リート	アメリカ EQUINIX INC	—	5.08
	アメリカ WELLTOWER INC	—	4.67

※比率は、各マザーファンドの純資産総額に対する組入比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)



※ファンドにベンチマークはありません。
 ※2022年11月1日が設定日のため、2021年以前の実績はありません。2022年は11月1日から12月末までの騰落率です。2024年は7月末までの騰落率です。
 ※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

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

ラップ型ファンド・プラスESG(安定成長型)

2024年7月31日現在

基準価額・純資産の推移



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

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

2023年7月20日	0円
2024年7月22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SDGs債券マザーファンド	16.0
RM米ドル建SDGs債券マザーファンド(為替ヘッジあり)	13.3
RMユーロ建SDGs債券マザーファンド(為替ヘッジあり)	9.1
RM国内株式ESGマザーファンド	15.8
RM先進国株式ESGマザーファンド	28.3
RM新興国債券マザーファンド	2.0
RM新興国株式マザーファンド	5.5
RM国内リートマザーファンド	4.1
RM先進国リートマザーファンド	6.0
現金等	0.0
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。
※現金等には未収・未払項目が含まれるためマイナスとなる場合があります。

■ 通貨別組入比率

通貨	比率(%)
日本円	58.1
米ドル	27.2
ユーロ	2.5
英ポンド	1.4
香港ドル	1.1
その他	9.7
合計	100.0

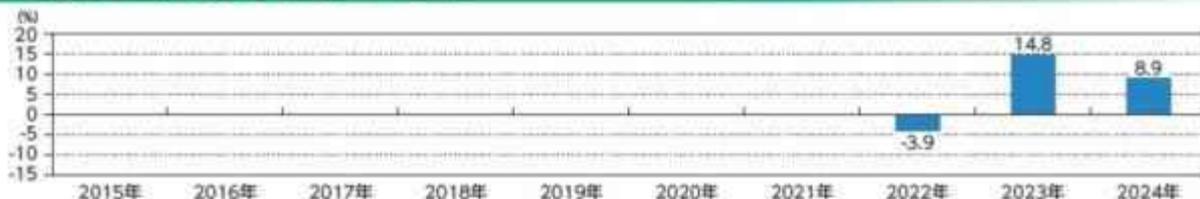
※比率はファンドの純資産総額に対する組入比率であり、四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。
※上記通貨別組入比率は、各マザーファンドが実質的に保有している株式・債券等の通貨を基準に算出しています。
※為替ヘッジをかけている外貨建資産については、日本円に含めています。

■ 各マザーファンドにおける組入上位銘柄

	国・地域	銘柄名	償還期間	比率(%)
国内SDGs債券	日本	新168回利付国債(5年)	2029/3/20	3.69
	日本	第448回利付国債(2年)	2025/5/1	3.69
	日本	トヨタ自動車	—	7.57
米ドル建SDGs債券(為替ヘッジあり)	国際機関	INTL BK RECON & DEVELOP	2028/9/13	10.17
	国際機関	INTL BK RECON & DEVELOP	2031/11/3	9.64
	国際機関	INTL BK RECON & DEVELOP	2033/11/14	5.95
ユーロ建SDGs債券(為替ヘッジあり)	国際機関	EUROPEAN INVESTMENT BANK	2034/1/16	9.15
	国際機関	ASIAN DEVELOPMENT BANK	2025/7/16	8.97
先進国株式ESG	アメリカ	MICROSOFT CORP	—	8.89
	アメリカ	NVIDIA CORP	—	7.72
	アメリカ	ALPHABET INC-CL A	—	2.99
新興国債券	アイスランド	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	—	97.08
	台湾	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	—	8.93
新興国株式	ケイマン	TENCENT HOLDINGS LTD	—	3.79
	韓国	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	—	3.56
国内リート	日本	日本ビルファンド投資法人	—	6.70
	日本	ジャパンリアルエステイト投資法人	—	5.30
	日本	野村不動産マスターファンド投資法人	—	4.74
先進国リート	アメリカ	PROLOGIS INC	—	8.13
	アメリカ	EQUINIX INC	—	5.08
	アメリカ	WELLTOWER INC	—	4.67

※比率は、各マザーファンドの純資産総額に対する組入比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)



※ファンドにベンチマークはありません。
※2022年11月1日が設定日のため、2021年以前の実績はありません。2022年は11月1日から12月末日までの騰落率です。2024年は7月末日までの騰落率です。
※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。

ラップ型ファンド・プラスESG(成長型)

2024年7月31日現在

基準価額・純資産の推移



分配の推移

(1万口当たり、税引前)

2023年7月20日	0円
2024年7月22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SDGs債券マザーファンド	7.0
RMドル建SDGs債券マザーファンド(為替ヘッジあり)	0.6
RMユーロ建SDGs債券マザーファンド(為替ヘッジあり)	0.4
RM国内株式ESGマザーファンド	19.6
RM先進国株式ESGマザーファンド	52.5
RM新興国債券マザーファンド	2.0
RM新興国株式マザーファンド	8.0
RM国内リートマザーファンド	4.0
RM先進国リートマザーファンド	5.9
現金等	0.0
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。
※現金等には未取・未払項目が含まれるためマイナスとなる場合があります。

■通貨別組入比率

通貨	比率(%)
米ドル	46.1
日本円	31.3
ユーロ	4.5
英ポンド	2.3
カナダドル	1.7
その他	14.0
合計	100.0

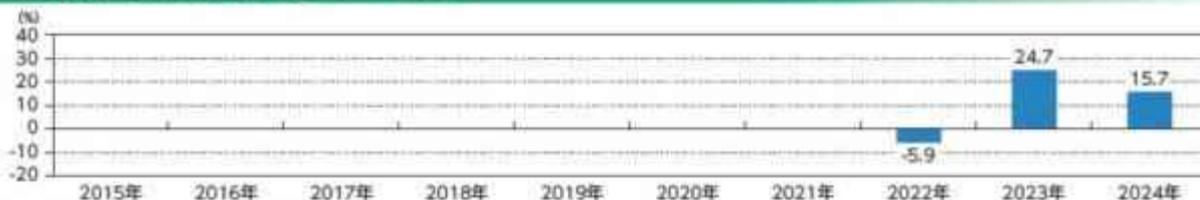
※比率はファンドの純資産総額に対する組入比率であり、四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。
※上記通貨別組入比率は、各マザーファンドが実質的に保有している株式・債券等の通貨を基準に算出しています。
※為替ヘッジをかけている外貨建資産については、日本円に含めています。

■各マザーファンドにおける組入上位銘柄

	国・地域	銘柄名	償還期限	比率(%)
国内SDGs債券	日本	第一勧業銀行株式会社無担保社債(信託限定定期付)	2031/6/5	3.70
	日本	第168回利付国債(5年)	2029/3/20	3.69
	日本	第448回利付国債(2年)	2025/5/1	3.69
米ドル建SDGs債券	国際機関	INTL BK RECON & DEVELOP	2028/9/13	10.17
	国際機関	INTL BK RECON & DEVELOP	2031/11/3	9.64
ユーロ建SDGs債券	国際機関	INTL BK RECON & DEVELOP	2033/11/14	5.95
	国際機関	EUROPEAN INVESTMENT BANK	2034/1/16	9.15
為替ヘッジあり	国際機関	ASIAN DEVELOPMENT BANK	2025/7/16	8.97
	国際機関	EUROPEAN UNION	2025/11/4	8.89
国内株式ESG	日本	トヨタ自動車	—	7.57
	日本	ソニーグループ	—	4.09
	日本	日立製作所	—	3.69
先進国株式ESG	アメリカ	MICROSOFT CORP	—	8.89
	アメリカ	NVIDIA CORP	—	7.72
	アメリカ	ALPHABET INC-CL A	—	2.99
新興国債券	アイルランド	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	—	97.08
	台湾	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	—	8.93
新興国株式	ケイマン	TENCENT HOLDINGS LTD	—	3.79
	韓国	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	—	3.56
国内リート	日本	日本ビルファンド投資法人	—	6.70
	日本	ジャパンリアルエステイト投資法人	—	5.30
	日本	野村不動産マスターファンド投資法人	—	4.74
先進国リート	アメリカ	PROLOGIS INC	—	8.13
	アメリカ	EQUINIX INC	—	5.08
	アメリカ	WELLTOWER INC	—	4.67

※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。

※2022年11月1日が設定日のため、2021年以前の実績はありません。2022年は11月1日から12月末までの騰落率です。2024年は7月末までの騰落率です。

※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※運用実績は過去のものであり、将来の運用成果を約束するものではありません。

※運用実績については、別途、委託会社のホームページで開示しています。

第2【管理及び運営】

1【申込(販売)手続等】

- (1) 申込方法
販売会社所定の方法でお申し込みください。
- (2) コースの選択

収益分配金の受取方法によって、<分配金再投資コース(自動けいぞく投資コース)>と<分配金受取りコース(一般コース)>の2通りがあります。ただし、販売会社によって取扱コースは異なります。

<分配金再投資コース(自動けいぞく投資コース)>

収益分配金を自動的に再投資するコースです。

<分配金受取りコース(一般コース)>

収益分配金を再投資せず、その都度受け取るコースです。

(3) 申込みの受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(4) 取扱時間

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

^{*}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号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。

2【換金(解約)手続等】

(1) 解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(2) 取扱時間

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

^{*}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にするため、大口の解約には受付時間制限および金額制限を行なう場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

(5) 解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

委託会社の照会先

りそなアセットマネジメント株式会社

電話番号：0120-223351

(受付時間は営業日の午前9時～午後5時)

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

(6) 手取額

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

(7) 解約単位

販売会社が定める単位とします。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

(8) 解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

(9) 受付の中止および取消

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

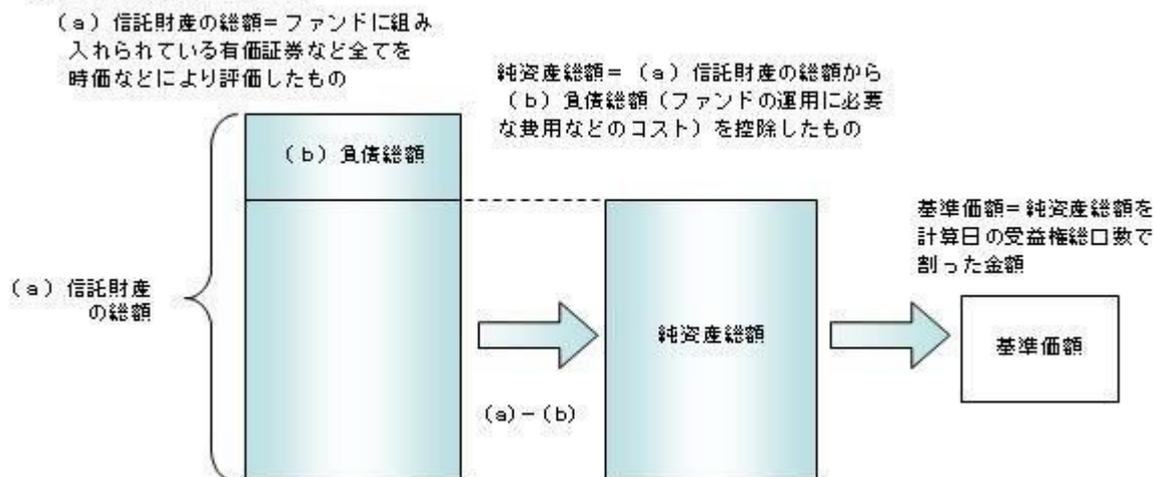
3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額の算出

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

<基準価額算出の流れ>



有価証券などの評価基準

- ・信託財産に属する資産については、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価します。
 - <主な資産の評価方法>
 - マザーファンド受益証券
基準価額計算日の基準価額で評価します。
 - 国内上場株式
原則として、基準価額計算日におけるわが国の金融商品取引所の最終相場で評価します。
 - 外国株式
原則として、基準価額計算日に知りうる直近の日における外国金融商品市場の最終相場で評価します。
 - 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（2022年11月1日設定）。ただし、約款の規定に基づき、信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

（４）【計算期間】

毎年7月21日から翌年7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) 各ファンドの信託財産の純資産総額が20億円を下回ることとなったとき

ロ) 繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき

ハ) やむを得ない事情が発生したとき

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

3) 委託会社は、次のいずれかの場合には、後述の「書面決議」の規定は適用せず、信託契約を解約し繰上償還させます。

イ) 信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合で、書面決議が困難な場合

ロ) 監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき

ハ) 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したとき（監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引き継ぐことを命じたときは、書面決議で可決された場合、存続します。）

ニ) 受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合またはその任務に違反するなどして解任された場合には、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せん。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。

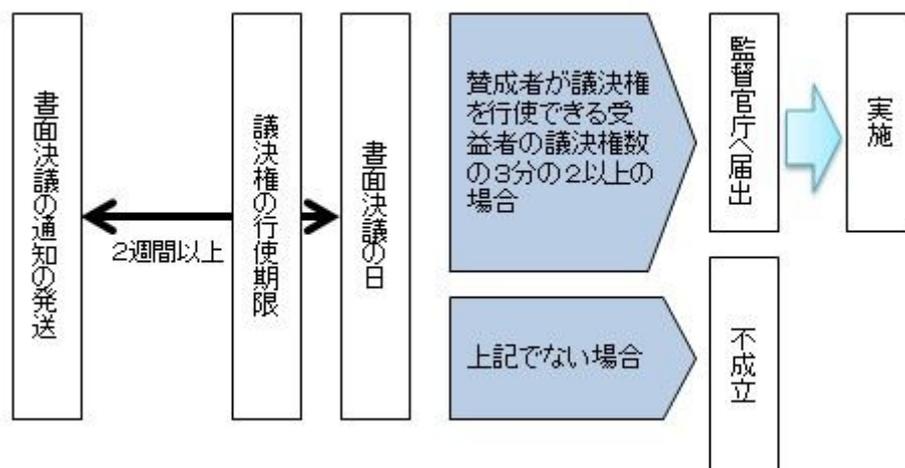
3) 書面決議は、議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。

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】

ラップ型ファンド・プラスE S G (安定型)
ラップ型ファンド・プラスE S G (安定成長型)
ラップ型ファンド・プラスE S G (成長型)

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期計算期間(2023年7月21日から2024年7月22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】

【ラップ型ファンド・プラスESG（安定型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 2023年 7月20日現在	第2期 2024年 7月22日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,114,797	3,570,525
親投資信託受益証券	215,039,525	625,561,731
流動資産合計	216,154,322	629,132,256
資産合計	216,154,322	629,132,256
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	12
未払受託者報酬	18,311	114,049
未払委託者報酬	256,351	1,596,705
未払利息	3	-
その他未払費用	2,755	17,304
流動負債合計	277,420	1,728,070
負債合計	277,420	1,728,070
純資産の部		
元本等		
元本	208,838,275	568,953,564
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	7,038,627	58,450,622
（分配準備積立金）	7,123,563	33,445,615
元本等合計	215,876,902	627,404,186
純資産合計	215,876,902	627,404,186
負債純資産合計	216,154,322	629,132,256

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期		第2期	
	自	2022年11月1日	自	2023年7月21日
	至	2023年7月20日	至	2024年7月22日
営業収益				
受取利息		-		55
有価証券売買等損益		7,861,625		32,207,806
営業収益合計		7,861,625		32,207,861
営業費用				
支払利息		329		912
受託者報酬		39,450		181,209
委託者報酬		552,302		2,536,882
その他費用		5,927		27,519
営業費用合計		598,008		2,746,522
営業利益又は営業損失（ ）		7,263,617		29,461,339
経常利益又は経常損失（ ）		7,263,617		29,461,339
当期純利益又は当期純損失（ ）		7,263,617		29,461,339
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（ ）		140,054		2,008,222
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		-		7,038,627
剰余金増加額又は欠損金減少額		15,023		26,803,607
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		15,023		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		26,803,607
剰余金減少額又は欠損金増加額		99,959		2,844,729
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		2,844,729
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		99,959		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		7,038,627		58,450,622

（ 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7月21日から翌年7月20日までとなっております。ただし、当計算期間末日が休業日のため、当計算期間は2023年7月21日から2024年7月22日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

第1期 2023年7月20日現在		第2期 2024年7月22日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況		1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首元本額	1,000,000円	期首元本額	208,838,275円
期中追加設定元本額	213,790,048円	期中追加設定元本額	427,724,026円
期中一部解約元本額	5,951,773円	期中一部解約元本額	67,608,737円
2. 計算期間の末日における受益権の総数	208,838,275口	2. 計算期間の末日における受益権の総数	568,953,564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	1.0337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	1.1027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)	(10,337円)	(10,000口当たり純資産額)	(11,027円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第1期 自 2022年11月1日 至 2023年7月20日		第2期 自 2023年7月21日 至 2024年7月22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	1,381,969円	A 費用控除後の配当等収益額	6,308,648円
B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	5,741,594円	B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	21,144,469円
C 収益調整金額	198,509円	C 収益調整金額	25,005,007円
D 分配準備積立金額	0円	D 分配準備積立金額	5,992,498円
E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D)	7,322,072円	E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D)	58,450,622円
F 当ファンドの期末残存口数	208,838,275口	F 当ファンドの期末残存口数	568,953,564口
G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000)	350円	G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000)	1,027円
H 10,000口当たり分配金額	0円	H 10,000口当たり分配金額	0円
I 収益分配金金額(I=F×H/10,000)	0円	I 収益分配金金額(I=F×H/10,000)	0円

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

第1期 自 2022年11月1日 至 2023年7月20日	第2期 自 2023年7月21日 至 2024年7月22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1期 2023年7月20日現在	第2期 2024年7月22日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	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。	同左
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

(関連当事者との取引に関する注記)

第1期 自 2022年11月 1日 至 2023年 7月20日	第2期 自 2023年 7月21日 至 2024年 7月22日
該当事項はありません。	同左

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	第1期 自 2022年11月 1日 至 2023年 7月20日	第2期 自 2023年 7月21日 至 2024年 7月22日
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	5,454,022	12,118,110
合計	5,454,022	12,118,110

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SDG s 債券マザーファンド	158,348,069	156,669,579	
	R M米ドル建SDG s 債券マザーファンド(為替ヘッジあり)	187,949,212	161,335,603	
	R Mユーロ建SDG s 債券マザーファンド(為替ヘッジあり)	126,000,182	110,010,758	
	R M国内株式ESGマザーファンド	10,932,647	21,396,283	
	R M先進国株式ESGマザーファンド	45,612,560	114,478,403	
	R M新興国債券マザーファンド	8,478,738	12,251,776	
	R M新興国株式マザーファンド	5,648,745	12,026,178	
	R M国内リートマザーファンド	13,341,716	18,591,681	
	R M先進国リートマザーファンド	10,074,735	18,801,470	
合計		566,386,604	625,561,731	

(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。

【ラップ型ファンド・プラスE S G（安定成長型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 2023年 7月20日現在	第2期 2024年 7月22日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	7,279,827	49,060,099
親投資信託受益証券	1,470,985,121	6,352,896,769
未収利息	-	13
流動資産合計	1,478,264,948	6,401,956,881
資産合計	1,478,264,948	6,401,956,881
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	1,367,127
未払受託者報酬	119,675	1,054,112
未払委託者報酬	2,872,220	25,298,628
未払利息	19	-
その他未払費用	18,209	160,657
流動負債合計	3,010,123	27,880,524
負債合計	3,010,123	27,880,524
純資産の部		
元本等		
元本	1,379,458,332	5,194,501,952
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	95,796,493	1,179,574,405
（分配準備積立金）	91,431,834	598,159,897
元本等合計	1,475,254,825	6,374,076,357
純資産合計	1,475,254,825	6,374,076,357
負債純資産合計	1,478,264,948	6,401,956,881

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期		第2期	
	自	2022年11月 1日	自	2023年 7月21日
	至	2023年 7月20日	至	2024年 7月22日
営業収益				
受取利息		-		1,185
有価証券売買等損益		98,903,221		572,671,548
営業収益合計		98,903,221		572,672,733
営業費用				
支払利息		3,121		10,403
受託者報酬		235,469		1,528,939
委託者報酬		5,650,993		36,694,547
その他費用		35,929		233,601
営業費用合計		5,925,512		38,467,490
営業利益又は営業損失（ ）		92,977,709		534,205,243
経常利益又は経常損失（ ）		92,977,709		534,205,243
当期純利益又は当期純損失（ ）		92,977,709		534,205,243
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		1,545,875		18,391,753
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		-		95,796,493
剰余金増加額又は欠損金減少額		4,364,659		596,195,882
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		88,864		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		4,275,795		596,195,882
剰余金減少額又は欠損金増加額		-		28,231,460
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		28,231,460
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		95,796,493		1,179,574,405

（ 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7月21日から翌年7月20日までとなっております。ただし、当計算期間末日が休業日のため、当計算期間は2023年7月21日から2024年7月22日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

第1期 2023年7月20日現在		第2期 2024年7月22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	6,385,632円	期首元本額	1,379,458,332円
期中追加設定元本額	1,399,914,876円	期中追加設定元本額	4,122,457,793円
期中一部解約元本額	26,842,176円	期中一部解約元本額	307,414,173円
2. 計算期間の末日における受益権の総数	1,379,458,332口	2. 計算期間の末日における受益権の総数	5,194,501,952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	1.0694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	1.2271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)	(10,694円)	(10,000口当たり純資産額)	(12,271円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第1期 自 2022年11月1日 至 2023年7月20日		第2期 自 2023年7月21日 至 2024年7月22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	10,987,369円	A 費用控除後の配当等収益額	64,834,852円
B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	80,444,465円	B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	450,978,638円
C 収益調整金額	4,364,659円	C 収益調整金額	581,414,508円
D 分配準備積立金額	0円	D 分配準備積立金額	82,346,407円
E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D)	95,796,493円	E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D)	1,179,574,405円
F 当ファンドの期末残存口数	1,379,458,332口	F 当ファンドの期末残存口数	5,194,501,952口
G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000)	694円	G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000)	2,270円
H 10,000口当たり分配金額	0円	H 10,000口当たり分配金額	0円
I 収益分配金金額(I=F×H/10,000)	0円	I 収益分配金金額(I=F×H/10,000)	0円

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

第1期 自 2022年11月1日 至 2023年7月20日	第2期 自 2023年7月21日 至 2024年7月22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1期 2023年7月20日現在	第2期 2024年7月22日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	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。	同左
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

(関連当事者との取引に関する注記)

第1期 自 2022年11月 1日 至 2023年 7月20日	第2期 自 2023年 7月21日 至 2024年 7月22日
該当事項はありません。	同左

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	第1期 自 2022年11月 1日 至 2023年 7月20日	第2期 自 2023年 7月21日 至 2024年 7月22日
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	85,291,740	359,833,196
合計	85,291,740	359,833,196

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SDGs債券マザーファンド	1,042,389,194	1,031,339,868	
	R M米ドル建SDGs債券マザーファンド(為替ヘッジあり)	992,327,511	851,813,935	
	R Mユーロ建SDGs債券マザーファンド(為替ヘッジあり)	664,956,972	580,573,932	
	R M国内株式ESGマザーファンド	340,268,816	665,940,099	
	R M先進国株式ESGマザーファンド	839,028,212	2,105,793,006	
	R M新興国債券マザーファンド	86,719,118	125,309,125	
	R M新興国株式マザーファンド	163,346,033	347,763,704	
	R M国内リートマザーファンド	199,086,171	277,426,579	
	R M先進国リートマザーファンド	196,622,292	366,936,521	
合計		4,524,744,319	6,352,896,769	

(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。

【ラップ型ファンド・プラスE S G（成長型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 2023年 7月20日現在	第2期 2024年 7月22日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	9,924,194	67,168,944
親投資信託受益証券	1,869,362,134	9,088,848,682
未収利息	-	18
流動資産合計	1,879,286,328	9,156,017,644
資産合計	1,879,286,328	9,156,017,644
負債の部		
流動負債		
未払解約金	425,606	150,126
未払受託者報酬	146,788	1,473,268
未払委託者報酬	3,889,807	39,041,591
未払利息	26	-
その他未払費用	22,344	224,585
流動負債合計	4,484,571	40,889,570
負債合計	4,484,571	40,889,570
純資産の部		
元本等		
元本	1,677,022,274	6,484,478,842
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	197,779,483	2,630,649,232
（分配準備積立金）	175,476,524	1,177,863,484
元本等合計	1,874,801,757	9,115,128,074
純資産合計	1,874,801,757	9,115,128,074
負債純資産合計	1,879,286,328	9,156,017,644

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期		第2期	
	自	2022年11月1日	自	2023年7月21日
	至	2023年7月20日	至	2024年7月22日
営業収益				
受取利息		-		2,049
有価証券売買等損益		194,149,234		1,225,947,348
営業収益合計		194,149,234		1,225,949,397
営業費用				
支払利息		4,695		16,372
受託者報酬		305,381		2,119,522
委託者報酬		8,092,592		56,167,317
その他費用		46,668		324,011
営業費用合計		8,449,336		58,627,222
営業利益又は営業損失（ ）		185,699,898		1,167,322,175
経常利益又は経常損失（ ）		185,699,898		1,167,322,175
当期純利益又は当期純損失（ ）		185,699,898		1,167,322,175
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（ ）		10,223,374		107,152,589
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		-		197,779,483
剰余金増加額又は欠損金減少額		22,302,959		1,583,305,185
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		625,579		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		21,677,380		1,583,305,185
剰余金減少額又は欠損金増加額		-		210,605,022
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		210,605,022
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		197,779,483		2,630,649,232

（ 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7月21日から翌年7月20日までとなっております。ただし、当計算期間末日が休業日のため、当計算期間は2023年7月21日から2024年7月22日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

第1期 2023年7月20日現在		第2期 2024年7月22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	5,303,428円	期首元本額	1,677,022,274円
期中追加設定元本額	1,791,239,251円	期中追加設定元本額	6,151,904,330円
期中一部解約元本額	119,520,405円	期中一部解約元本額	1,344,447,762円
2. 計算期間の末日における受益権の総数	1,677,022,274口	2. 計算期間の末日における受益権の総数	6,484,478,842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	1.1179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	1.4057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)	(11,179円)	(10,000口当たり純資産額)	(14,057円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第1期 自 2022年11月1日 至 2023年7月20日		第2期 自 2023年7月21日 至 2024年7月22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	16,676,164円	A 費用控除後の配当等収益額	97,115,942円
B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	158,800,360円	B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	963,053,644円
C 収益調整金額	22,302,959円	C 収益調整金額	1,452,785,748円
D 分配準備積立金額	0円	D 分配準備積立金額	117,693,898円
E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D)	197,779,483円	E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D)	2,630,649,232円
F 当ファンドの期末残存口数	1,677,022,274口	F 当ファンドの期末残存口数	6,484,478,842口
G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000)	1,179円	G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000)	4,056円
H 10,000口当たり分配金額	0円	H 10,000口当たり分配金額	0円
I 収益分配金金額(I=F×H/10,000)	0円	I 収益分配金金額(I=F×H/10,000)	0円

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

第1期 自 2022年11月1日 至 2023年7月20日	第2期 自 2023年7月21日 至 2024年7月22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1期 2023年7月20日現在	第2期 2024年7月22日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	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。	同左
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

（関連当事者との取引に関する注記）

第1期 自 2022年11月 1日 至 2023年 7月20日	第2期 自 2023年 7月21日 至 2024年 7月22日
該当事項はありません。	同左

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	第1期 自 2022年11月 1日 至 2023年 7月20日	第2期 自 2023年 7月21日 至 2024年 7月22日
	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	177,759,490	910,033,202
合計	177,759,490	910,033,202

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SDG s 債券マザーファンド	636,000,989	629,259,378	
	R M米ドル建SDG s 債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	60,862,603	52,244,458	
	R Mユーロ建SDG s 債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	39,638,475	34,608,352	
	R M国内株式ESGマザーファンド	661,621,216	1,294,858,881	
	R M先進国株式ESGマザーファンド	2,093,595,569	5,254,506,159	
	R M新興国債券マザーファンド	125,079,175	180,739,407	
	R M新興国株式マザーファンド	343,502,223	731,316,232	
	R M国内リートマザーファンド	283,062,669	394,447,829	
	R M先進国リートマザーファンド	276,962,805	516,867,986	
合計		4,520,325,724	9,088,848,682	

(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）

「ラップ型ファンド・プラスESG」の各ファンドは「RM国内SDGs債券マザーファンド」、「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新興国債券マザーファンド」、「RM新興国株式マザーファンド」、「RM国内リートマザーファンド」および「RM先進国リートマザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同親投資信託の受益証券です。
なお、以下に記載した状況は監査意見の対象外となっております。

RM国内SDGs債券マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2024年 7月22日現在	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	59,843,240
国債証券	297,023,000
特殊債券	591,999,000
社債券	1,753,784,000
未収入金	100,166,000
未収利息	2,052,507
前払費用	661,911
流動資産合計	2,805,529,658
資産合計	2,805,529,658
負債の部	
流動負債	
未払金	100,000,000
流動負債合計	100,000,000
負債合計	100,000,000
純資産の部	
元本等	
元本	2,734,637,616
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	29,107,958
元本等合計	2,705,529,658
純資産合計	2,705,529,658
負債純資産合計	2,805,529,658

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、特殊債券、社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額、又は価格情報会社の提供する価額で評価しております。
-----------------	--

（貸借対照表に関する注記）

2024年 7月22日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 7月21日
期首元本額	1,924,755,847円
期中追加設定元本額	3,347,514,378円
期中一部解約元本額	2,537,632,609円
期末元本額	2,734,637,616円
期末元本の内訳	

ラップ型ファンド・プラスESG(安定型)	158,348,069円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定成長型)	1,042,389,194円
ラップ型ファンド・プラスESG(成長型)	636,000,989円
りそな国内SDGs債券ファンド(適格機関投資家専用)	897,899,364円
2. 計算日における受益権の総数	2,734,637,616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	29,107,958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	0.9894円
(10,000口当たり純資産額)	(9,894円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2024年 7月22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

2024年 7月22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、社債券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(関連当事者との取引に関する注記)

2024年 7月22日現在	
該当事項はありません。	

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2024年 7月22日現在	
	損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券	623,000	
特殊債券	2,359,000	
社債券	22,513,000	
合計	25,495,000	

(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）	100,000,000	99,922,000	
	第168回利付国債（5年）	100,000,000	100,204,000	
	第359回利付国債（10年）	100,000,000	96,897,000	
	国債証券合計	300,000,000	297,023,000	
特殊債券	F35回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,870,000	
	第88回東日本高速道路株式会社社債（一般担保付、独立行政法人）	100,000,000	94,579,000	
	第113回東日本高速道路株式会社社債（一般担保付、独立行政法）	100,000,000	100,007,000	
	第99回中日本高速道路株式会社社債（グリーンボンド（気候変動）	100,000,000	99,352,000	
	第61回西日本高速道路株式会社社債（一般担保付、独立行政法人）	100,000,000	99,167,000	
	第65回西日本高速道路株式会社社債（一般担保付、独立行政法人）	100,000,000	99,024,000	
	特殊債券合計	600,000,000	591,999,000	
社債券	第19回森永乳業株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	100,307,000	
	第18回野村不動産ホールディングス株式会社無担保社債（グリーン）	100,000,000	100,022,000	
	第20回富士フィルムホールディングス株式会社無担保社債（社債）	100,000,000	99,944,000	
	第8回日本碍子株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）（	100,000,000	98,284,000	
	第8回日本製鉄株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）（	100,000,000	98,153,000	
	第67回日産自動車株式会社無担保社債（特定社債間限定同順位特約付）	100,000,000	99,834,000	
	第30回豊田通商株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	95,477,000	
	第25回NTTファイナンス株式会社無担保社債（社債間限定）	100,000,000	98,287,000	
	第84回三井不動産株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	97,347,000	
	第33回東京建物株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	97,264,000	
	第132回東武鉄道株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	95,456,000	
	第1回東日本旅客鉄道株式会社サステナビリティボンド・無担保普	100,000,000	96,403,000	
	第14回九州旅客鉄道株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	95,723,000	
	第5回日本貨物鉄道株式会社社債（一般担保付）（グリーンボンド）	100,000,000	98,728,000	
	第31回KDDI株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	98,925,000	
	第545回中部電力株式会社社債（一般担保付）（グリーンボンド）	100,000,000	94,334,000	
	第524回東北電力株式会社社債（一般担保付）（グリーンボンド）	100,000,000	95,157,000	
第494回九州電力株式会社社債（一般担保付）（グリーンボンド）	100,000,000	94,139,000		
	社債券合計	1,800,000,000	1,753,784,000	

合計	2,642,806,000
----	---------------

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）

2024年 7月22日現在

資産の部	
流動資産	
預金	4,835,200
コール・ローン	57,715,741
国債証券	163,836,640
特殊債券	2,455,188,225
派生商品評価勘定	877,551
未収利息	12,733,988
前払費用	2,022,232
流動資産合計	2,697,209,577
資産合計	
2,697,209,577	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	37,713,391
未払金	7,983,862
流動負債合計	45,697,253
負債合計	
45,697,253	
純資産の部	
元本等	
元本	3,088,733,024
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	437,220,700
元本等合計	2,651,512,324
純資産合計	
2,651,512,324	
負債純資産合計	
2,697,209,577	

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）

2024年 7月22日現在

1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 7月21日
期首元本額	2,562,031,575円
期中追加設定元本額	2,455,707,252円
期中一部解約元本額	1,929,005,803円
期末元本額	3,088,733,024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	1,520,420,596円
九州SDGs・グローバルバランス	326,175,353円
ラップ型ファンド・プラスESG（安定型）	187,949,212円
ラップ型ファンド・プラスESG（安定成長型）	992,327,511円
ラップ型ファンド・プラスESG（成長型）	60,862,603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）	997,749円
2. 計算日における受益権の総数	3,088,733,024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	437,220,700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	0.8584円
(10,000口当たり純資産額)	(8,584円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

2024年 7月22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

2024年 7月22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）

2024年 7月22日現在	
該当事項はありません。	

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2024年 7月22日現在
	損益に含まれた評価差額（円）

国債証券		1,893,360
特殊債券		40,050,118
合計		41,943,478

(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)

(2024年 7月22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	2,557,508,719	-	2,594,344,559	36,835,840
	米ドル	2,557,508,719	-	2,594,344,559	36,835,840
	合計	2,557,508,719	-	2,594,344,559	36,835,840

(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

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	10,000.00	9,838.86	
		US TREASURY N/B	270,000.00	268,054.10	
		US TREASURY N/B	370,000.00	314,348.23	
		US TREASURY N/B	40,000.00	39,758.58	
		US TREASURY N/B	400,000.00	407,968.75	
		米ドル 小計	1,090,000.00	1,039,968.52 (163,836,640)	
		国債証券合計		163,836,640 (163,836,640)	
特殊債券	米ドル	EUROPEAN BK RECON & DEV	1,000,000.00	993,069.08	
		EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000.00	982,089.75	
		EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000.00	959,762.11	
		EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000.00	948,332.16	
		EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000.00	827,846.31	

	INTER-AMERICAN DEVEL BK	1,000,000.00	965,498.78	
	INTER-AMERICAN DEVEL BK	1,000,000.00	823,250.35	
	INTER-AMERICAN DEVEL BK	1,000,000.00	938,775.46	
	INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000.00	967,069.40	
	INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000.00	900,416.95	
	INTL BK RECON & DEVELOP	2,000,000.00	1,764,321.12	
	INTL BK RECON & DEVELOP	2,000,000.00	1,669,681.78	
	INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000.00	884,647.69	
	INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000.00	1,031,148.30	
	KFW	1,000,000.00	928,629.45	
	米ドル 小計	17,000,000.00	15,584,538.69	(2,455,188,225)
	特殊債券合計		2,455,188,225	(2,455,188,225)
	合計		2,619,024,865	(2,619,024,865)

(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 5銘柄	6.3%	6.3%
	特殊債券 15銘柄	93.7%	93.7%

(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 7月22日現在

資産の部	
流動資産	
預金	3,107,010
コール・ローン	36,442,072
国債証券	206,163,086
特殊債券	1,561,218,773
派生商品評価勘定	488,033
未収入金	58,833
未収利息	2,777,230
前払費用	408,663
流動資産合計	1,810,663,700
資産合計	1,810,663,700
負債の部	
流動負債	

2024年 7月22日現在

派生商品評価勘定	30,130,798
未払金	18,707
流動負債合計	30,149,505
負債合計	30,149,505
純資産の部	
元本等	
元本	2,039,395,307
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	258,881,112
元本等合計	1,780,514,195
純資産合計	1,780,514,195
負債純資産合計	1,810,663,700

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）

2024年 7月22日現在

1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 7月21日
期首元本額	1,849,111,108円
期中追加設定元本額	1,609,343,849円
期中一部解約元本額	1,419,059,650円
期末元本額	2,039,395,307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	994,770,269円
九州SDGs・グローバルバランス	213,037,839円
ラップ型ファンド・プラスESG（安定型）	126,000,182円
ラップ型ファンド・プラスESG（安定成長型）	664,956,972円
ラップ型ファンド・プラスESG（成長型）	39,638,475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）	991,570円
2. 計算日における受益権の総数	2,039,395,307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	258,881,112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	0.8731円
(10,000口当たり純資産額)	(8,731円)

（注） は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

2024年 7月22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

2024年 7月22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）

2024年 7月22日現在

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2024年 7月22日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
国債証券		1,325,157
特殊債券		16,203,202
合計		17,528,359

（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）

（2024年 7月22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	1,720,993,570	-	1,750,636,335	29,642,765	
	ユーロ	1,720,993,570	-	1,750,636,335	29,642,765	
	合計	1,720,993,570	-	1,750,636,335	29,642,765	

（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

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	350,000.00	324,003.21	
		GOV OF FRANCE	560,000.00	501,484.20	
		GOV OF FRANCE	10,000.00	8,097.96	
		GOV OF FRANCE	10,000.00	7,964.56	
		GOV OF FRANCE	350,000.00	349,376.65	
		GOV OF FRANCE	10,000.00	10,350.00	
			ユーロ 小計	1,290,000.00	1,201,276.58 (206,163,086)
		国債証券合計		206,163,086 (206,163,086)	
特殊債券	ユーロ	ASIAN DEVELOPMENT BANK	1,000,000.00	971,460.50	
		ASIAN DEVELOPMENT BANK	1,000,000.00	866,768.75	
		EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000.00	914,321.50	
		EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000.00	841,608.50	
		EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000.00	906,922.50	
		EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000.00	985,782.50	
		EUROPEAN UNION	1,000,000.00	962,326.50	
		INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000.00	932,327.75	
		INTL DEVELOPMENT ASSOC	1,000,000.00	821,357.50	
		KFW	1,000,000.00	894,075.25	
	ユーロ 小計	10,000,000.00	9,096,951.25 (1,561,218,773)		
		特殊債券合計		1,561,218,773 (1,561,218,773)	
		合計		1,767,381,859 (1,767,381,859)	

(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 6銘柄	11.7%	11.7%

特殊債券	10銘柄	88.3%	88.3%
------	------	-------	-------

（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国内株式E S Gマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2024年 7月22日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	187,507,838
株式	6,323,350,630
投資証券	28,989,800
派生商品評価勘定	3,815,920
未収配当金	6,567,430
未収利息	51
差入委託証拠金	8,819,013
流動資産合計	6,559,050,682
資産合計	
6,559,050,682	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,241,140
前受金	4,048,000
未払解約金	1,820,000
流動負債合計	8,109,140
負債合計	
8,109,140	
純資産の部	
元本等	
元本	3,347,328,166
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	3,203,613,376
元本等合計	6,550,941,542
純資産合計	
6,550,941,542	
負債純資産合計	
6,559,050,682	

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

2024年 7月22日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 7月21日
期首元本額	2,359,889,618円
期中追加設定元本額	3,840,750,002円
期中一部解約元本額	2,853,311,454円
期末元本額	3,347,328,166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	304,589,894円
国内株式ESGインデックス・オープン	65,030,029円
九州SDGs・グローバルバランス	140,403,660円
ラップ型ファンド・プラスESG（安定型）	10,932,647円
ラップ型ファンド・プラスESG（安定成長型）	340,268,816円
ラップ型ファンド・プラスESG（成長型）	661,621,216円
Smart-i 国内株式ESGインデックス	1,384,507,555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）	439,974,349円
2. 計算日における受益権の総数	3,347,328,166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	1.9571円
(10,000口当たり純資産額)	(19,571円)

（注） は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

2024年 7月22日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、株価変動リスク、リートの価格変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

金融商品の時価等に関する事項

2024年 7月22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）

2024年 7月22日現在	
該当事項はありません。	

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

- 1 有価証券に関する注記
売買目的有価証券

種類	2024年 7月22日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式	727,676,530	
投資証券	1,542,553	
合計	726,133,977	

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

2 デリバティブ取引に関する注記

(株式関連)

(2024年 7月22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	201,789,220	-	203,364,000	1,574,780
	合計	201,789,220	-	203,364,000	1,574,780

(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	14,600	2,372.00	34,631,200	
大林組	10,100	2,038.50	20,588,850	
清水建設	8,100	916.10	7,420,410	
戸田建設	3,500	1,064.00	3,724,000	
大和ハウス工業	8,700	4,248.00	36,957,600	
積水ハウス	9,300	3,842.00	35,730,600	
高砂熱学工業	700	5,580.00	3,906,000	
明治ホールディングス	3,600	3,750.00	13,500,000	
サッポロホールディングス	1,000	6,267.00	6,267,000	
アサヒグループホールディングス	7,500	5,870.00	44,025,000	
麒麟ホールディングス	12,000	2,143.00	25,716,000	
サントリー食品インターナショナル	2,200	5,543.00	12,194,600	
伊藤園	800	3,594.00	2,875,200	
キッコーマン	10,500	2,006.50	21,068,250	
味の素	7,300	6,265.00	45,734,500	
カゴメ	1,200	3,530.00	4,236,000	
ニチレイ	1,700	3,757.00	6,386,900	
日清食品ホールディングス	3,100	4,325.00	13,407,500	
東洋紡	1,300	1,028.00	1,336,400	

帝人	2,800	1,430.50	4,005,400
東レ	21,500	785.00	16,877,500
クラレ	4,700	1,889.50	8,880,650
旭化成	19,500	1,040.00	20,280,000
住友化学	23,100	381.40	8,810,340
東ソー	4,000	2,083.00	8,332,000
デンカ	1,200	2,177.50	2,613,000
エア・ウォーター	2,800	2,135.50	5,979,400
カネカ	700	4,324.00	3,026,800
三井化学	2,600	4,453.00	11,577,800
東京応化工業	1,500	4,031.00	6,046,500
三菱ケミカルグループ	21,000	893.50	18,763,500
ダイセル	3,600	1,462.00	5,263,200
積水化学工業	5,900	2,276.00	13,428,400
U B E	1,500	2,750.00	4,125,000
日本化薬	2,100	1,273.00	2,673,300
花王	7,200	6,896.00	49,651,200
日本ペイントホールディングス	14,700	978.50	14,383,950
関西ペイント	2,600	2,442.00	6,349,200
中国塗料	600	2,091.00	1,254,600
D I C	1,200	3,047.00	3,656,400
富士フイルムホールディングス	17,400	3,767.00	65,545,800
資生堂	6,200	4,686.00	29,053,200
ライオン	4,000	1,297.50	5,190,000
日東電工	2,200	13,565.00	29,843,000
信越ポリマー	600	1,492.00	895,200
ニフコ	1,200	3,820.00	4,584,000
ユニ・チャーム	6,300	5,165.00	32,539,500
協和キリン	4,200	3,171.00	13,318,200
アステラス製薬	28,100	1,636.50	45,985,650
塩野義製薬	3,900	6,770.00	26,403,000
エーザイ	3,900	6,575.00	25,642,500
小野薬品工業	5,800	2,249.00	13,044,200
第一三共	28,700	5,854.00	168,009,800
E N E O Sホールディングス	44,700	801.00	35,804,700
ブリヂストン	8,900	6,111.00	54,387,900
住友理工	600	1,475.00	885,000
太平洋セメント	1,700	4,140.00	7,038,000
東海カーボン	3,100	958.40	2,971,040
T O T O	2,200	4,201.00	9,242,200
日本特殊陶業	2,400	4,618.00	11,083,200
日本製鉄	13,300	3,309.00	44,009,700
神戸製鋼所	5,800	1,923.00	11,153,400

J F Eホールディングス	8,900	2,246.00	19,989,400
日本軽金属ホールディングス	900	1,760.00	1,584,000
三井金属鉱業	800	5,359.00	4,287,200
三菱マテリアル	1,900	2,834.50	5,385,550
住友金属鉱山	3,800	4,824.00	18,331,200
D O W Aホールディングス	800	5,543.00	4,434,400
東邦チタニウム	500	1,365.00	682,500
U A C J	500	3,960.00	1,980,000
L I X I L	4,500	1,801.00	8,104,500
三浦工業	1,400	3,491.00	4,887,400
ナブテスコ	1,700	2,791.00	4,744,700
小松製作所	14,300	4,907.00	70,170,100
日立建機	1,700	4,557.00	7,746,900
クボタ	15,500	2,245.00	34,797,500
荏原製作所	7,200	2,188.50	15,757,200
ダイキン工業	4,100	22,485.00	92,188,500
栗田工業	1,600	6,521.00	10,433,600
ダイフク	4,700	2,786.50	13,096,550
グローリー	600	2,709.00	1,625,400
セガサミーホールディングス	2,400	2,433.50	5,840,400
N T N	6,600	315.00	2,079,000
日立造船	2,500	1,153.00	2,882,500
三菱重工業	49,700	1,859.50	92,417,150
I H I	2,200	5,475.00	12,045,000
イビデン	1,700	6,500.00	11,050,000
コニカミノルタ	7,000	466.60	3,266,200
ブラザー工業	3,600	3,172.00	11,419,200
日立製作所	71,900	3,461.00	248,845,900
富士電機	2,000	8,435.00	16,870,000
安川電機	3,700	5,390.00	19,943,000
オムロン	2,700	5,576.00	15,055,200
日本電気	3,800	13,525.00	51,395,000
富士通	27,300	2,626.50	71,703,450
ルネサスエレクトロニクス	23,200	3,042.00	70,574,400
セイコーエプソン	4,500	2,680.50	12,062,250
アルバック	700	9,168.00	6,417,600
パナソニックホールディングス	36,200	1,271.50	46,028,300
シャープ	4,000	937.50	3,750,000
アンリツ	2,100	1,267.50	2,661,750
ソニーグループ	19,400	14,460.00	280,524,000
T D K	6,000	10,395.00	62,370,000
アルプスアルパイン	2,900	1,604.00	4,651,600
マクセル	700	1,801.00	1,260,700

横河電機	3,500	3,940.00	13,790,000
アズビル	1,800	4,543.00	8,177,400
アドバンテスト	11,900	5,926.00	70,519,400
シスメックス	7,800	2,551.00	19,897,800
スタンレー電気	2,000	2,851.00	5,702,000
ウシオ電機	1,200	2,156.00	2,587,200
ファナック	14,800	4,340.00	64,232,000
ローム	5,100	2,204.00	11,240,400
太陽誘電	1,900	4,802.00	9,123,800
村田製作所	26,700	3,581.00	95,612,700
リコー	8,500	1,459.00	12,401,500
東京エレクトロン	7,300	30,370.00	221,701,000
川崎重工業	2,300	6,047.00	13,908,100
トヨタ自動車	164,400	3,090.00	507,996,000
ヤマハ発動機	13,800	1,509.50	20,831,100
島津製作所	3,700	4,251.00	15,728,700
ニコン	4,600	1,685.50	7,753,300
H O Y A	5,400	18,850.00	101,790,000
ノーリツ鋼機	300	4,170.00	1,251,000
前田工織	600	1,663.00	997,800
大日本印刷	3,200	5,207.00	16,662,400
N I S S H A	600	1,929.00	1,157,400
アシックス	10,000	2,586.00	25,860,000
ヤマハ	2,000	3,542.00	7,084,000
ピジョン	1,800	1,510.00	2,718,000
リンテック	600	3,445.00	2,067,000
任天堂	16,100	8,532.00	137,365,200
コクヨ	1,200	2,624.00	3,148,800
美津濃	300	7,580.00	2,274,000
東北電力	7,000	1,334.50	9,341,500
九州電力	6,200	1,602.50	9,935,500
電源開発	2,300	2,530.50	5,820,150
レノバ	600	968.00	580,800
東京瓦斯	5,600	3,379.00	18,922,400
大阪瓦斯	5,700	3,511.00	20,012,700
東邦瓦斯	1,100	3,971.00	4,368,100
西部ガスホールディングス	400	1,932.00	772,800
相鉄ホールディングス	1,200	2,425.00	2,910,000
東急	7,800	1,787.00	13,938,600
京王電鉄	1,600	3,838.00	6,140,800
西日本旅客鉄道	6,800	2,950.00	20,060,000
西武ホールディングス	3,500	2,573.00	9,005,500
西日本鉄道	900	2,491.50	2,242,350

阪急阪神ホールディングス	3,500	4,279.00	14,976,500
南海電気鉄道	1,600	2,681.00	4,289,600
京阪ホールディングス	1,500	2,979.50	4,469,250
名古屋鉄道	2,900	1,805.00	5,234,500
ヤマトホールディングス	3,900	1,833.00	7,148,700
山九	700	5,421.00	3,794,700
センコーグループホールディングス	1,700	1,110.00	1,887,000
九州旅客鉄道	2,100	3,922.00	8,236,200
S Gホールディングス	5,000	1,484.00	7,420,000
日本郵船	7,100	4,461.00	31,673,100
A N Aホールディングス	2,500	2,966.50	7,416,250
ランコム	100	6,400.00	640,000
T I S	3,300	3,252.00	10,731,600
S H I F T	200	11,400.00	2,280,000
ティーガイア	300	3,355.00	1,006,500
マネーフォワード	700	4,901.00	3,430,700
野村総合研究所	5,900	4,604.00	27,163,600
メルカリ	1,800	2,266.00	4,078,800
S a n s a n	1,100	2,303.00	2,533,300
フリー	700	2,580.00	1,806,000
L I N E ヤフー	41,400	390.50	16,166,700
ネットワンシステムズ	1,200	3,040.00	3,648,000
B I P R O G Y	1,100	4,517.00	4,968,700
K D D I	23,200	4,620.00	107,184,000
ソフトバンク	44,200	2,001.50	88,466,300
S C S K	2,400	3,141.00	7,538,400
あらた	400	3,565.00	1,426,000
双日	3,500	3,763.00	13,170,500
T O K A Iホールディングス	1,500	983.00	1,474,500
アズワン	900	3,113.00	2,801,700
伊藤忠商事	18,400	7,948.00	146,243,200
丸紅	22,100	2,996.50	66,222,650
キャノンマーケティングジャパン	700	4,551.00	3,185,700
伊藤忠エネクス	800	1,628.00	1,302,400
P A L T A C	400	4,255.00	1,702,000
アスクル	600	2,156.00	1,293,600
ゲオホールディングス	400	1,688.00	675,200
アダストリア	500	3,105.00	1,552,500
エディオン	1,000	1,717.00	1,717,000
ジンズホールディングス	200	4,355.00	871,000
J . フロント リテイリング	3,800	1,965.00	7,467,000
マツキヨココカラ & カンパニー	5,300	2,500.00	13,250,000
Z O Z O	2,100	4,281.00	8,990,100

三越伊勢丹ホールディングス	5,200	3,264.00	16,972,800
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	800	883.00	706,400
イオン北海道	600	899.00	539,400
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	5,900	4,005.00	23,629,500
スギホールディングス	1,600	2,519.00	4,030,400
日本瓦斯	1,600	2,507.50	4,012,000
丸井グループ	2,400	2,415.50	5,797,200
イオン	10,100	3,334.00	33,673,400
ヤオコー	300	9,224.00	2,767,200
ケーズホールディングス	2,200	1,632.00	3,590,400
ヤマダホールディングス	8,200	454.00	3,722,800
ファーストリテイリング	2,700	41,590.00	112,293,000
三井住友トラスト・ホールディングス	10,200	3,845.00	39,219,000
三井住友フィナンシャルグループ	19,400	10,895.00	211,363,000
みずほフィナンシャルグループ	37,400	3,402.00	127,234,800
大和証券グループ本社	20,700	1,294.50	26,796,150
野村ホールディングス	46,600	953.40	44,428,440
S O M P Oホールディングス	13,800	3,372.00	46,533,600
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	19,900	3,664.00	72,913,600
東京海上ホールディングス	29,100	6,111.00	177,830,100
T & Dホールディングス	7,600	2,887.50	21,945,000
東京センチュリー	2,300	1,560.50	3,589,150
オリックス	17,900	3,682.00	65,907,800
ヒューリック	6,000	1,471.50	8,829,000
東急不動産ホールディングス	8,900	1,094.00	9,736,600
三井不動産	41,400	1,518.00	62,845,200
三菱地所	17,500	2,638.00	46,165,000
平和不動産	500	3,895.00	1,947,500
東京建物	2,900	2,645.00	7,670,500
住友不動産	4,400	5,008.00	22,035,200
ジェイエイシーリクルートメント	1,000	696.00	696,000
パーソルホールディングス	28,900	254.20	7,346,380
H . U . グループホールディングス	800	2,561.00	2,048,800
オリエンタルランド	16,900	4,499.00	76,033,100
ダスキン	600	3,832.00	2,299,200
リゾートトラスト	1,300	2,477.50	3,220,750
ビー・エム・エル	300	3,010.00	903,000
ユー・エス・エス	6,400	1,370.00	8,768,000
楽天グループ	23,300	870.40	20,280,320
テクノプロ・ホールディングス	1,700	2,832.50	4,815,250
リクルートホールディングス	23,000	8,985.00	206,655,000
インソース	700	858.00	600,600

カーブスホールディングス	800	790.00	632,000	
LITALICO	400	1,718.00	687,200	
乃村工藝社	1,200	864.00	1,036,800	
セコム	3,300	9,633.00	31,788,900	
合計	1,864,900		6,323,350,630	

(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	24	3,136,800	
	積水ハウス・リート投資法人	65	5,226,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	20	10,420,000	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	46	6,564,200	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	14	3,642,800	
合計		169	28,989,800	

(注) 券面総額欄の数値は口数を表しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

RM先進国株式ESGマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2024年 7月22日現在

資産の部	
流動資産	
預金	391,370,703
コール・ローン	3,108,683
株式	14,899,826,972
投資証券	297,018,131
派生商品評価勘定	2,580
未収配当金	9,478,069
差入委託証拠金	249,902,577
流動資産合計	15,850,707,715
資産合計	15,850,707,715
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	10,495,786
未払金	191,250,538
未払解約金	950,000
流動負債合計	202,696,324
負債合計	202,696,324
純資産の部	
元本等	
元本	6,234,813,583
剰余金	
剰余金又は欠損金()	9,413,197,808
元本等合計	15,648,011,391
純資産合計	15,648,011,391

2024年 7月22日現在

負債純資産合計

15,850,707,715

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2024年 7月22日現在

1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 7月21日
期首元本額	3,598,118,896円
期中追加設定元本額	4,747,373,430円
期中一部解約元本額	2,110,678,743円
期末元本額	6,234,813,583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	592,296,159円
先進国株式ESGインデックス・オープン	18,981,441円
九州SDGs・グローバルバランス	270,175,204円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定型)	45,612,560円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定成長型)	839,028,212円
ラップ型ファンド・プラスESG(成長型)	2,093,595,569円
Smart-i 先進国株式ESGインデックス	2,375,124,438円
2. 計算日における受益権の総数	6,234,813,583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	2.5098円
(10,000口当たり純資産額)	(25,098円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2024年 7月22日現在

1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、株価変動リスク、リートの価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	

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

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

金融商品の時価等に関する事項

2024年 7月22日現在

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

(関連当事者との取引に関する注記)

2024年 7月22日現在

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2024年 7月22日現在	
	損益に含まれた評価差額(円)	
株式	1,626,484,613	
投資証券	22,503,277	
合計	1,648,987,890	

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

2 デリバティブ取引に関する注記

(株式関連)

(2024年 7月22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	553,261,197	-	-	542,765,765	10,495,432
	買建					
合計		553,261,197	-	-	542,765,765	10,495,432

(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 7月22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	97,949,835	-	-	97,952,061	2,226
	買建					

米ドル	79,835,616	-	79,836,985	1,369
カナダドル	5,741,365	-	5,741,825	460
スイスフラン	3,546,176	-	3,546,252	76
スウェーデンク ローナ	2,217,105	-	2,217,780	675
デンマーククロー ネ	3,449,130	-	3,448,980	150
オーストラリアドル	3,160,443	-	3,160,239	204
合計	97,949,835	-	97,952,061	2,226

(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	2,916	35.93	104,771.88	
	CHENIERE ENERGY INC	672	181.93	122,256.96	
	HALLIBURTON CO	2,595	34.40	89,268.00	
	HF SINCLAIR CORP	457	48.41	22,123.37	
	KINDER MORGAN INC	5,818	21.49	125,028.82	
	MARATHON PETROLEUM CORP	1,049	165.16	173,252.84	
	ONEOK INC	1,698	83.47	141,732.06	
	PHILLIPS 66	1,245	138.47	172,395.15	
	SCHLUMBERGER LTD	4,140	49.67	205,633.80	
	TARGA RESOURCES CORP	616	136.37	84,003.92	
	VALERO ENERGY CORP	959	148.33	142,248.47	
	WILLIAMS COS INC	3,547	44.00	156,068.00	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	648	262.91	170,365.68	
	AVERY DENNISON CORP	237	219.99	52,137.63	
	BALL CORP	924	61.04	56,400.96	
	CRH PLC	2,003	79.87	159,979.61	
	ECOLAB INC	750	243.17	182,377.50	
	INTERNATIONAL PAPER CO	969	45.72	44,302.68	
	INTL FLAVORS & FRAGRANCES	748	95.67	71,561.16	
LINDE PLC	1,401	444.75	623,094.75		

LYONDELLBASELL INDU-CL A	762	97.00	73,914.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	180	559.08	100,634.40
NEWMONT CORP	3,361	47.00	157,967.00
NUCOR CORP	703	162.50	114,237.50
PPG INDUSTRIES INC	688	128.04	88,091.52
SMURFIT WESTROCK PLC	1,518	46.53	70,632.54
STEEL DYNAMICS INC	441	128.44	56,642.04
3M CO	1,605	103.92	166,791.60
AERCAP HOLDINGS NV	608	93.58	56,896.64
ALLEGION PLC	245	124.10	30,404.50
AXON ENTERPRISE INC	208	308.45	64,157.60
CARRIER GLOBAL CORP	2,353	66.24	155,862.72
CATERPILLAR INC	1,451	347.63	504,411.13
CNH INDUSTRIAL NV	2,449	10.42	25,518.58
CUMMINS INC	397	291.15	115,586.55
DEERE & CO	768	378.06	290,350.08
DOVER CORP	399	183.70	73,296.30
EATON CORP PLC	1,162	311.89	362,416.18
EMCOR GROUP INC	137	363.61	49,814.57
FERGUSON PLC	589	207.37	122,140.93
FORTIVE CORP	1,020	75.59	77,101.80
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS I	385	71.79	27,639.15
GENERAL ELECTRIC CO	3,176	159.13	505,396.88
GRACO INC	506	81.96	41,471.76
IDEX CORP	220	202.97	44,653.40
ILLINOIS TOOL WORKS	868	242.62	210,594.16
INGERSOLL-RAND INC	1,172	96.86	113,519.92
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	1,979	68.95	136,452.05
LENNOX INTERNATIONAL INC	93	555.76	51,685.68
OWENS CORNING	238	172.78	41,121.64
PENTAIR PLC	497	78.84	39,183.48
QUANTA SERVICES INC	425	258.56	109,888.00
ROCKWELL AUTOMATION INC	333	269.76	89,830.08
TORO CO	292	97.35	28,426.20
TRANE TECHNOLOGIES PLC	660	330.14	217,892.40
UNITED RENTALS INC	195	718.64	140,134.80
WW GRAINGER INC	129	945.83	122,012.07
XYLEM INC	702	137.49	96,517.98
AUTOMATIC DATA PROCESSING	1,193	246.97	294,635.21
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	342	201.89	69,046.38
CERIDIAN HCM HOLDING INC	455	53.34	24,269.70
CINTAS CORP	265	758.56	201,018.40
PAYCHEX INC	941	122.68	115,441.88

PAYLOCITY HOLDING CORP	140	142.94	20,011.60
TRANSUNION	564	77.55	43,738.20
VERALTO CORP	716	98.46	70,497.36
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	356	88.86	31,634.16
CSX CORP	5,700	34.69	197,733.00
DELTA AIR LINES INC	415	45.44	18,857.60
EXPEDITORS INTL WASH INC	421	120.20	50,604.20
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	5,353	3.38	18,093.14
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	225	164.18	36,940.50
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	502	50.00	25,100.00
OLD DOMINION FREIGHT LINE	571	195.47	111,613.37
UNION PACIFIC CORP	1,773	242.32	429,633.36
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	2,116	145.18	307,200.88
APTIV PLC	790	68.87	54,407.30
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	2,054	16.75	34,404.50
TESLA INC	8,326	239.20	1,991,579.20
DECKERS OUTDOOR CORP	75	871.24	65,343.00
DR HORTON INC	868	173.84	150,893.12
LULULEMON ATHLETICA INC	334	280.23	93,598.49
NIKE INC -CL B	3,521	72.70	255,976.70
NVR INC	9	8,428.58	75,857.22
PULTEGROUP INC	617	124.76	76,976.92
BOOKING HOLDINGS INC	99	3,967.25	392,757.75
DARDEN RESTAURANTS INC	327	142.86	46,715.22
DOMINO'S PIZZA INC	101	404.17	40,821.17
DOORDASH INC - A	821	106.10	87,108.10
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	730	219.19	160,008.70
MCDONALD'S CORP	2,095	257.28	539,001.60
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	708	168.29	119,149.32
YUM! BRANDS INC	817	126.93	103,701.81
ALPHABET INC-CL A	17,121	177.66	3,041,716.86
ALPHABET INC-CL C	14,829	179.39	2,660,174.31
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	274	320.31	87,764.94
COMCAST CORP-CLASS A	11,523	40.08	461,841.84
ELECTRONIC ARTS INC	740	140.20	103,748.00
FOX CORP - CLASS A	626	36.89	23,093.14
FOX CORP- CLASS B	344	34.33	11,809.52
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	1,065	29.65	31,577.25
OMNICOM GROUP	573	91.00	52,143.00
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	474	150.32	71,251.68
WALT DISNEY CO/THE	5,332	95.74	510,485.68
AUTOZONE INC	50	2,950.40	147,520.00
BATH & BODY WORKS INC	607	37.57	22,804.99

BEST BUY CO INC	566	88.60	50,147.60
BURLINGTON STORES INC	177	244.70	43,311.90
CARMAX INC	442	80.01	35,364.42
DICK'S SPORTING GOODS INC	162	212.11	34,361.82
EBAY INC	1,509	53.60	80,882.40
ETSY INC	340	62.76	21,338.40
GENUINE PARTS CO	407	138.26	56,271.82
HOME DEPOT INC	2,880	363.36	1,046,476.80
LKQ CORP	749	45.09	33,772.41
LOWE'S COS INC	1,663	238.52	396,658.76
MERCADOLIBRE INC	133	1,649.99	219,448.67
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	172	1,042.86	179,371.92
POOL CORP	117	328.52	38,436.84
TJX COMPANIES INC	3,293	111.75	367,992.75
TRACTOR SUPPLY COMPANY	314	268.45	84,293.30
ULTA BEAUTY INC	141	390.92	55,119.72
WILLIAMS-SONOMA INC	356	146.88	52,289.28
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	977	20.00	19,540.00
KROGER CO	1,997	54.51	108,856.47
TARGET CORP	1,343	149.73	201,087.39
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	2,059	11.01	22,669.59
BUNGE GLOBAL SA	419	111.92	46,894.48
CAMPBELL SOUP CO	600	46.40	27,840.00
COCA-COLA CO/THE	11,902	65.29	777,081.58
COCA-COLA EUROPAFIC PARTNE	552	73.66	40,660.32
CONAGRA BRANDS INC	1,448	29.63	42,904.24
GENERAL MILLS INC	1,644	64.38	105,840.72
HORMEL FOODS CORP	831	31.79	26,417.49
JM SMUCKER CO/THE	323	117.99	38,110.77
KELLANOVA	799	57.96	46,310.04
KEURIG DR PEPPER INC	3,151	32.98	103,919.98
LAMB WESTON HOLDINGS INC	441	77.48	34,168.68
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	735	73.59	54,088.65
PEPSICO INC	3,994	169.36	676,423.84
CHURCH & DWIGHT CO INC	708	102.61	72,647.88
CLOROX COMPANY	360	135.14	48,650.40
COLGATE-PALMOLIVE CO	2,271	98.08	222,739.68
KIMBERLY-CLARK CORP	978	143.63	140,470.14
PROCTER & GAMBLE CO/THE	6,835	167.96	1,148,006.60
ALIGN TECHNOLOGY INC	208	251.60	52,332.80
CENCORA INC	522	223.60	116,719.20
CIGNA GROUP/THE	824	335.84	276,732.16
COOPER COS INC/THE	577	90.75	52,362.75

DAVITA INC	166	137.95	22,899.70
DEXCOM INC	1,120	111.66	125,059.20
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	1,747	86.50	151,115.50
ELEVANCE HEALTH INC	676	500.12	338,081.12
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES I	1,257	80.44	101,113.08
HCA HEALTHCARE INC	576	322.16	185,564.16
HENRY SCHEIN INC	359	70.34	25,252.06
HOLOGIC INC	682	78.11	53,271.02
HUMANA INC	350	387.38	135,583.00
IDEXX LABORATORIES INC	241	468.20	112,836.20
INSULET CORP	191	195.03	37,250.73
LABCORP HOLDINGS INC	244	211.37	51,574.28
MOLINA HEALTHCARE INC	170	288.36	49,021.20
QUEST DIAGNOSTICS INC	322	146.01	47,015.22
SOLVENTUM CORP	412	54.60	22,495.20
STERIS PLC	287	224.29	64,371.23
TELEFLEX INC	131	221.79	29,054.49
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	596	110.50	65,858.00
AGILENT TECHNOLOGIES INC	851	131.78	112,144.78
AMGEN INC	1,557	331.29	515,818.53
AVANTOR INC	1,971	20.85	41,095.35
BIO-TECHNE CORP	440	75.46	33,202.40
BIOGEN INC	422	226.40	95,540.80
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	5,886	42.64	250,979.04
CATALENT INC	508	57.91	29,418.28
DANAHER CORP	2,044	243.54	497,795.76
ELI LILLY & CO	2,348	857.47	2,013,339.56
GILEAD SCIENCES INC	3,622	72.56	262,812.32
IQVIA HOLDINGS INC	529	224.57	118,797.53
JOHNSON & JOHNSON	7,000	154.69	1,082,830.00
MERCK & CO. INC.	7,357	125.77	925,289.89
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	62	1,344.26	83,344.12
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	299	145.69	43,561.31
REPLIGEN CORP	164	123.81	20,304.84
WATERS CORP	172	302.72	52,067.84
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	213	317.92	67,716.96
ZOETIS INC	1,330	178.58	237,511.40
CITIZENS FINANCIAL GROUP	1,317	41.00	53,997.00
HUNTINGTON BANCSHARES INC	4,190	14.86	62,263.40
KEYCORP	2,750	15.59	42,872.50
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	1,153	175.51	202,363.03
REGIONS FINANCIAL CORP	2,644	22.09	58,405.96
TRUIST FINANCIAL CORP	3,864	42.41	163,872.24

US BANCORP	4,514	44.76	202,046.64
ALLY FINANCIAL INC	758	41.86	31,729.88
AMERICAN EXPRESS CO	1,673	242.38	405,501.74
AMERIPRISE FINANCIAL INC	291	410.89	119,568.99
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	2,189	62.69	137,228.41
BLACKROCK INC	432	830.70	358,862.40
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	1,109	147.27	163,322.43
CBOE GLOBAL MARKETS INC	305	184.63	56,312.15
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	728	141.77	103,208.56
EQUITABLE HOLDINGS INC	981	41.73	40,937.13
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	110	424.32	46,675.20
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	1,672	75.25	125,818.00
FISERV INC	1,714	156.04	267,452.56
FRANKLIN RESOURCES INC	773	23.49	18,157.77
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	1,662	147.68	245,444.16
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	216	211.62	45,709.92
MARKETAXESS HOLDINGS INC	116	219.16	25,422.56
MASTERCARD INC-CLASS A	2,420	443.69	1,073,729.80
MOODY'S CORP	477	442.14	210,900.78
MORGAN STANLEY	3,561	102.09	363,542.49
NASDAQ INC	1,168	62.51	73,011.68
NORTHERN TRUST CORP	591	85.49	50,524.59
PAYPAL HOLDINGS INC	2,902	59.33	172,175.66
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	575	108.62	62,456.50
S&P GLOBAL INC	930	479.84	446,251.20
SCHWAB (CHARLES) CORP	4,376	62.08	271,662.08
STATE STREET CORP	875	84.49	73,928.75
SYNCHRONY FINANCIAL	1,178	49.97	58,864.66
T ROWE PRICE GROUP INC	648	114.79	74,383.92
VISA INC-CLASS A SHARES	4,594	265.46	1,219,523.24
AFLAC INC	1,593	92.91	148,005.63
ALLSTATE CORP	769	174.38	134,098.22
ARCH CAPITAL GROUP LTD	1,094	96.10	105,133.40
ASSURANT INC	162	169.79	27,505.98
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	868	101.11	87,763.48
MARSH & MCLENNAN COS	1,430	216.75	309,952.50
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	688	84.71	58,280.48
PROGRESSIVE CORP	1,704	219.35	373,772.40
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	1,046	123.76	129,452.96
TRAVELERS COS INC/THE	667	203.48	135,721.16
WILLIS TOWERS WATSON PLC	299	263.13	78,675.87
ACCENTURE PLC-CL A	1,827	329.19	601,430.13
ADOBE INC	1,302	551.00	717,402.00

AKAMAI TECHNOLOGIES INC	456	95.05	43,342.80
ANSYS INC	254	314.54	79,893.16
ASPEN TECHNOLOGY INC	89	191.71	17,062.19
ATLASSIAN CORP-CL A	457	176.50	80,660.50
AUTODESK INC	622	242.45	150,803.90
CADENCE DESIGN SYS INC	792	279.95	221,720.40
CONFLUENT INC-CLASS A	529	24.37	12,891.73
DOCUSIGN INC	573	55.89	32,024.97
FAIR ISAAC CORP	72	1,590.79	114,536.88
GARTNER INC	226	458.55	103,632.30
GEN DIGITAL INC	1,667	25.48	42,475.16
HUBSPOT INC	140	479.82	67,174.80
INTL BUSINESS MACHINES CORP	2,663	183.25	487,994.75
INTUIT INC	813	636.56	517,523.28
MANHATTAN ASSOCIATES INC	179	218.59	39,127.61
MICROSOFT CORP	20,506	437.11	8,963,377.66
PALO ALTO NETWORKS INC	939	330.89	310,705.71
PTC INC	348	175.92	61,220.16
SALESFORCE INC	2,818	247.63	697,821.34
SERVICENOW INC	596	751.20	447,715.20
SYNOPSYS INC	443	563.12	249,462.16
TWILIO INC - A	484	58.65	28,386.60
UIPATH INC - CLASS A	1,140	12.05	13,737.00
WORKDAY INC-CLASS A	613	227.49	139,451.37
ZSCALER INC	261	188.54	49,208.94
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	3,759	20.48	76,984.32
HP INC	2,833	37.15	105,245.95
JUNIPER NETWORKS INC	912	37.29	34,008.48
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	505	137.40	69,387.00
NETAPP INC	597	126.22	75,353.34
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	575	102.63	59,012.25
TRIMBLE INC	728	55.98	40,753.44
WESTERN DIGITAL CORP	943	69.82	65,840.26
VERIZON COMMUNICATIONS INC	12,233	41.62	509,137.46
AMERICAN WATER WORKS CO INC	568	141.16	80,178.88
ATMOS ENERGY CORP	441	122.95	54,220.95
CMS ENERGY CORP	872	61.34	53,488.48
CONSOLIDATED EDISON INC	1,007	94.04	94,698.28
EDISON INTERNATIONAL	1,121	74.94	84,007.74
ESSENTIAL UTILITIES INC	732	40.72	29,807.04
EVERSOURCE ENERGY	1,021	61.10	62,383.10
EXELON CORP	2,912	36.13	105,210.56
NRG ENERGY INC	589	74.91	44,121.99

	SEMPRA	1,840	77.57	142,728.80
	ADVANCED MICRO DEVICES	4,692	151.58	711,213.36
	APPLIED MATERIALS INC	2,412	210.26	507,147.12
	ENPHASE ENERGY INC	403	105.46	42,500.38
	FIRST SOLAR INC	293	216.43	63,413.99
	INTEL CORP	12,352	32.98	407,368.96
	LAM RESEARCH CORP	380	917.11	348,501.80
	LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	415	56.23	23,335.45
	MARVELL TECHNOLOGY INC	2,509	66.51	166,873.59
	NVIDIA CORP	72,620	117.93	8,564,076.60
	NXP SEMICONDUCTORS NV	742	269.29	199,813.18
	TEXAS INSTRUMENTS INC	2,641	199.10	525,823.10
	CBRE GROUP INC - A	900	97.83	88,047.00
	米ドル 小計	515,557		73,094,547.71 (11,515,315,046)
カナダドル	CAMECO CORP	1,286	64.05	82,368.30
	ENBRIDGE INC	6,210	50.17	311,555.70
	IMPERIAL OIL LTD	559	95.25	53,244.75
	KEYERA CORP	683	38.28	26,145.24
	PARKLAND CORP	297	37.66	11,185.02
	PEMBINA PIPELINE CORP	1,717	52.01	89,301.17
	AGNICO EAGLE MINES LTD	1,470	101.83	149,690.10
	IVANHOE MINES LTD-CL A	1,776	18.99	33,726.24
	KINROSS GOLD CORP	3,274	12.13	39,713.62
	LUNDIN MINING CORP	1,973	14.39	28,391.47
	NUTRIEN LTD	1,467	69.38	101,780.46
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	159	108.55	17,259.45
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	1,342	82.45	110,647.90
	CAE INC	900	25.33	22,797.00
	STANTEC INC	342	117.18	40,075.56
	WSP GLOBAL INC	352	219.73	77,344.96
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	937	26.17	24,521.29
	RB GLOBAL INC	483	109.47	52,874.01
	THOMSON REUTERS CORP	464	223.44	103,676.16
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	1,592	165.66	263,730.72
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	470	54.09	25,422.30
	CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	172	140.29	24,129.88
	DOLLARAMA INC	822	126.95	104,352.90
	ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	2,256	82.05	185,104.80
	METRO INC	695	82.50	57,337.50
	BANK OF MONTREAL	2,123	119.46	253,613.58
	BANK OF NOVA SCOTIA	3,558	64.16	228,281.28
	NATIONAL BANK OF CANADA	990	112.50	111,375.00

	TORONTO-DOMINION BANK	5,143	79.42	408,457.06
	BROOKFIELD CORP	3,957	63.27	250,359.39
	IA FINANCIAL CORP INC	232	89.09	20,668.88
	INTACT FINANCIAL CORP	526	237.83	125,098.58
	SUN LIFE FINANCIAL INC	1,621	68.00	110,228.00
	CGI INC	582	145.45	84,651.90
	OPEN TEXT CORP	769	42.47	32,659.43
	SHOPIFY INC - CLASS A	3,523	86.76	305,655.48
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	1,022	51.47	52,602.34
	TELUS CORP	1,465	21.72	31,819.80
	FORTIS INC	1,463	55.62	81,372.06
	HYDRO ONE LTD	949	41.05	38,956.45
	FIRSTSERVICE CORP	115	224.79	25,850.85
	カナダドル 小計	59,736		4,198,026.58 (482,269,293)
ユーロ	GALP ENERGIA SGPS SA	1,291	18.82	24,303.07
	NESTE OYJ	1,221	17.40	21,245.40
	OMV AG	422	39.50	16,669.00
	REPSOL SA	3,340	13.29	44,388.60
	TENARIS SA	1,330	14.50	19,285.00
	TOTALENERGIES SE	6,266	62.73	393,066.18
	AKZO NOBEL	529	57.08	30,195.32
	COVESTRO AG	514	54.74	28,136.36
	DSM-FIRMENICH AG	557	110.80	61,715.60
	EVONIK INDUSTRIES AG	814	18.77	15,282.85
	HEIDELBERG MATERIALS AG	395	100.60	39,737.00
	OCI NV	270	22.60	6,102.00
	STORA ENSO OYJ-R SHS	1,591	12.66	20,142.06
	SYMRISE AG	405	112.05	45,380.25
	UMICORE	539	14.00	7,546.00
	UPM-KYMMENE OYJ	1,540	31.14	47,955.60
	VOESTALPINE AG	274	24.00	6,576.00
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	604	39.00	23,556.00
	BOUYGUES SA	498	32.58	16,224.84
	EIFFAGE	216	91.56	19,776.96
	GEA GROUP AG	394	40.00	15,760.00
	KINGSPAN GROUP PLC	449	84.60	37,985.40
	KNORR-BREMSE AG	201	73.50	14,773.50
	KONE OYJ-B	985	46.99	46,285.15
	METSO CORPORATION	2,008	9.63	19,337.04
	MTU AERO ENGINES AG	167	247.80	41,382.60
	REXEL SA	539	25.21	13,588.19
	SCHNEIDER ELECTRIC SE	1,586	222.90	353,519.40

WARTSILA OYJ ABP	1,624	18.48	30,019.64
WOLTERS KLUWER	730	150.55	109,901.50
ADP	82	118.60	9,725.20
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	1,396	5.77	8,057.71
GETLINK	1,024	16.18	16,573.44
MICHELIN(CGDE)	2,007	34.62	69,482.34
ADIDAS AG	478	227.10	108,553.80
HERMES INTERNATIONAL	93	2,062.00	191,766.00
KERING	221	315.05	69,626.05
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	803	679.80	545,879.40
MONCLER SPA	590	56.38	33,264.20
PUMA SE	316	43.97	13,894.52
AMADEUS IT GROUP SA	1,323	60.90	80,570.70
PUBLICIS GROUPE	644	98.60	63,498.40
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	2,318	28.11	65,158.98
PROSUS NV	4,163	32.14	133,819.63
ZALANDO SE	698	23.29	16,256.42
CARREFOUR SA	1,546	14.69	22,710.74
JERONIMO MARTINS	867	19.81	17,175.27
KESKO OYJ-B SHS	665	16.53	10,995.77
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N.V.	2,795	29.44	82,284.80
DANONE	1,897	58.50	110,974.50
JDE PEET'S BV	253	18.38	4,650.14
KERRY GROUP PLC-A	458	79.10	36,227.80
LOTUS BAKERIES	1	9,900.00	9,900.00
BEIERSDORF AG	303	137.10	41,541.30
HENKEL AG & CO KGAA	293	74.45	21,813.85
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	461	82.54	38,050.94
L'OREAL	702	404.45	283,923.90
EUROFINS SCIENTIFIC	334	48.35	16,148.90
MERCK KGAA	386	149.60	57,745.60
ORION OYJ-CLASS B	278	39.39	10,950.42
QIAGEN N.V.	570	37.61	21,440.55
SARTORIUS AG-VORZUG	67	209.10	14,009.70
BANCO DE SABADELL SA	16,397	1.94	31,859.37
BNP PARIBAS	3,013	63.05	189,969.65
COMMERZBANK AG	3,007	15.23	45,811.64
CREDIT AGRICOLE SA	3,130	13.88	43,444.40
FINECOBANK SPA	1,875	15.76	29,559.37
ING GROEP NV-CVA	9,639	16.82	162,185.81
INTESA SANPAOLO	42,830	3.64	156,115.35
KBC GROEP NV	745	67.62	50,376.90
MEDIOBANCA SPA	1,319	14.34	18,914.46

	DEUTSCHE BOERSE AG	560	186.70	104,552.00
	EURAZEO	108	76.60	8,272.80
	NEXI SPA	1,764	5.65	9,977.18
	AGEAS	509	42.96	21,866.64
	ASR NEDERLAND NV	409	45.86	18,756.74
	AXA SA	5,330	31.94	170,240.20
	GENERALI	3,056	23.31	71,235.36
	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	401	444.60	178,284.60
	NN GROUP NV	779	45.42	35,382.18
	POSTE ITALIANE SPA	1,059	12.09	12,808.60
	SAMPO OYJ-A SHS	1,292	39.31	50,788.52
	DASSAULT SYSTEMES SE	1,984	34.46	68,368.64
	NOKIA OYJ	15,893	3.37	53,630.92
	CELLNEX TELECOM SA	1,487	32.56	48,416.72
	ELISA OYJ	389	42.66	16,594.74
	KONINKLIJKE KPN NV	11,510	3.75	43,243.07
	ENEL SPA	23,926	6.74	161,404.79
	IBERDROLA SA	17,386	11.75	204,285.50
	REDEIA CORP SA	1,128	16.25	18,330.00
	VERBUND AG	219	74.75	16,370.25
	ASML HOLDING NV	1,162	829.50	963,879.00
	STMICROELECTRONICS NV	1,990	36.77	73,182.25
	LEG IMMOBILIEN SE	216	80.56	17,400.96
	ユーロ 小計	233,843		6,892,016.09 (1,182,807,801)
英債券	ANGLO AMERICAN PLC	3,771	22.46	84,696.66
	ANTOFAGASTA PLC	1,063	19.22	20,430.86
	CRODA INTERNATIONAL PLC	344	40.27	13,852.88
	ENDEAVOUR MINING PLC	573	17.79	10,193.67
	MONDI PLC	1,144	15.67	17,932.20
	ASHTED GROUP PLC	1,295	52.84	68,427.80
	BUNZL PLC	1,000	32.20	32,200.00
	DCC PLC	257	54.00	13,878.00
	SMITHS GROUP PLC	854	17.16	14,654.64
	SPIRAX GROUP PLC	203	84.50	17,153.50
	INTERTEK GROUP PLC	499	46.38	23,143.62
	RELX PLC	5,491	34.70	190,537.70
	RENTOKIL INITIAL PLC	7,311	4.48	32,760.59
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	2,579	4.96	12,802.15
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	257	49.24	12,654.68
	BURBERRY GROUP PLC	1,059	6.97	7,387.58
	TAYLOR WIMPEY PLC	10,976	1.56	17,128.04
	WHITBREAD PLC	464	28.97	13,442.08

	AUTO TRADER GROUP PLC	2,808	8.02	22,525.77
	INFORMA PLC	4,126	8.43	34,790.43
	MPP PLC	3,361	7.44	25,005.84
	KINGFISHER PLC	4,661	2.74	12,780.46
	SAINSBURY (J) PLC	4,917	2.72	13,413.57
	TESCO PLC	20,951	3.26	68,300.26
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	896	25.06	22,453.76
	COCA-COLA HBC AG-DI	612	27.56	16,866.72
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	2,084	43.91	91,508.44
	UNILEVER PLC	7,308	44.95	328,494.60
	NMC HEALTH PLC	5	0.00	0.00
	ASTRAZENECA PLC	4,514	121.06	546,464.84
	HSBC HOLDINGS PLC	54,991	6.60	362,995.59
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	185,596	0.59	109,761.47
	3I GROUP PLC	2,868	30.47	87,387.96
	M&G PLC	5,562	2.04	11,368.72
	SCHRODERS PLC	2,486	3.91	9,725.23
	ADMIRAL GROUP PLC	714	25.66	18,321.24
	AVIVA PLC	7,730	4.81	37,219.95
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	17,024	2.26	38,627.45
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	2,059	5.34	11,005.35
	PRUDENTIAL PLC	8,232	7.01	57,739.24
	SAGE GROUP PLC/THE	2,955	10.45	30,879.75
	BT GROUP PLC	19,776	1.41	28,052.25
	VODAFONE GROUP PLC	66,354	0.70	46,779.57
	NATIONAL GRID PLC	14,130	9.34	132,058.98
	英ポンド 小計	485,860		2,767,804.09 (563,718,659)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	406	14.56	5,911.36
	GIVAUDAN-REG	27	4,233.00	114,291.00
	SIG GROUP AG	939	17.37	16,310.43
	SIKA AG-REG	448	262.30	117,510.40
	ABB LTD-REG	4,663	48.29	225,176.27
	GEBERIT AG-REG	99	557.00	55,143.00
	VAT GROUP AG	80	442.60	35,408.00
	SGS SA-REG	443	81.34	36,033.62
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	139	257.60	35,806.40
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	6	10,750.00	64,500.00
	ALCON INC	1,462	79.96	116,901.52
	SONOVA HOLDING AG-REG	142	262.50	37,275.00
	LONZA GROUP AG-REG	218	507.40	110,613.20
	NOVARTIS AG-REG	5,734	94.20	540,142.80
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	54	93.50	5,049.00

	JULIUS BAER GROUP LTD	567	51.08	28,962.36	
	BALOISE HOLDING AG - REG	134	156.70	20,997.80	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	82	667.80	54,759.60	
	SWISS RE AG	888	106.45	94,527.60	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	428	472.50	202,230.00	
	TEMENOS GROUP AG-REG	148	66.10	9,782.80	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	458	79.16	36,255.28	
	SWISSCOM AG-REG	78	531.50	41,457.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	235	87.65	20,597.75	
	スイスフラン 小計	17,878		2,025,642.19 (359,207,129)	
スウェーデンク ローナ	BOLIDEN AB	878	312.30	274,199.40	
	HOLMEN AB-B SHARES	196	428.20	83,927.20	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	1,946	152.40	296,570.40	
	ALFA LAVAL AB	885	462.00	408,870.00	
	ASSA ABLOY AB-B	2,820	314.90	888,018.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	7,915	182.95	1,448,049.25	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	4,409	159.80	704,558.20	
	EPIROC AB-A	2,017	203.60	410,661.20	
	EPIROC AB-B	1,082	185.40	200,602.80	
	HUSQVARNA AB-B SHS	588	76.56	45,017.28	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	4,251	45.61	193,888.11	
	SANDVIK AB	3,200	213.50	683,200.00	
	SKF AB-B SHARES	881	198.75	175,098.75	
	VOLVO AB-A SHS	512	287.20	147,046.40	
	VOLVO AB-B SHS	4,695	281.40	1,321,173.00	
	EVOLUTION AB	554	1,066.50	590,841.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	1,767	168.95	298,534.65	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	1,849	301.80	558,028.20	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	3,936	106.95	420,955.20	
	EQT AB	1,112	325.00	361,400.00	
TELE2 AB-B SHS	1,792	106.80	191,385.60		
TELIA CO AB	5,887	30.54	179,788.98		
	スウェーデンクローナ 小計	53,172		9,881,813.62 (146,152,023)	
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	793	261.80	207,607.40	
	EQUINOR ASA	2,542	294.15	747,729.30	
	NORSK HYDRO ASA	4,097	63.50	260,159.50	
	YARA INTERNATIONAL ASA	445	312.90	139,240.50	
	MOWI ASA	1,516	177.70	269,393.20	
	ORKLA ASA	2,269	91.50	207,613.50	
	SALMAR ASA	139	581.50	80,828.50	
	DNB BANK ASA	2,532	218.80	554,001.60	

	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	454	179.90	81,674.60
	TELENOR ASA	1,795	126.60	227,247.00
	ノルウェークローネ 小計	16,582		2,775,495.10 (40,105,904)
デンマーククローネ	NOVONESIS (NOVOZYMES) B	1,107	417.70	462,393.90
	ROCKWOOL A/S-B SHS	30	2,918.00	87,540.00
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	2,969	158.75	471,328.75
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	9	10,420.00	93,780.00
	AP MOELLER-MAERSK A/S-B	13	10,605.00	137,865.00
	DSV A/S	504	1,184.50	596,988.00
	PANDORA A/S	250	1,053.50	263,375.00
	COLOPLAST-B	373	857.60	319,884.80
	GENMAB A/S	195	1,869.00	364,455.00
	NOVO NORDISK A/S-B	9,486	906.10	8,595,264.60
	TRYG A/S	878	146.90	128,978.20
	ORSTED A/S	520	393.70	204,724.00
	デンマーククローネ 小計	16,334		11,726,577.25 (269,711,276)
オーストラリアドル	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	5,610	29.21	163,868.10
	BLUESCOPE STEEL LTD	1,043	21.40	22,320.20
	FORTESCUE LTD	4,762	21.62	102,954.44
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	1,274	53.73	68,452.02
	MINERAL RESOURCES LTD	447	55.94	25,005.18
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	3,581	14.30	51,208.30
	ORICA LTD	1,324	17.60	23,302.40
	PILBARA MINERALS LTD	7,742	2.99	23,148.58
	BRAMBLES LTD	4,092	14.96	61,216.32
	COMPUTERSHARE LTD	1,449	26.20	37,963.80
	AURIZON HOLDINGS LTD	5,727	3.63	20,789.01
	TRANSURBAN GROUP	9,197	12.83	117,997.51
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	1,706	53.11	90,605.66
	CAR GROUP LTD	1,112	34.79	38,686.48
	REA GROUP LTD	150	196.82	29,523.00
	SEEK LTD	875	21.28	18,620.00
	COLES GROUP LTD	3,805	17.63	67,082.15
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	3,615	5.26	19,014.90
	COCHLEAR LTD	196	323.80	63,464.80
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	570	46.92	26,744.40
	CSL LTD	1,411	311.70	439,808.70
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	8,786	29.71	261,032.06
ASX LTD	532	64.75	34,447.00	
MACQUARIE GROUP LTD	1,067	210.06	224,134.02	
QBE INSURANCE GROUP LTD	4,540	16.97	77,043.80	

	SUNCORP GROUP LTD	3,564	16.96	60,445.44	
	WISETECH GLOBAL LTD	500	94.50	47,250.00	
	XERO LTD	446	135.41	60,392.86	
	APA GROUP	3,590	7.93	28,468.70	
	オーストラリアドル 小計	82,713		2,304,989.83 (242,899,828)	
ニュージーランドドル	SPARK NEW ZEALAND LTD	4,460	4.18	18,642.80	
	MERCURY NZ LTD	1,680	7.06	11,869.20	
	MERIDIAN ENERGY LTD	4,254	6.89	29,310.06	
	ニュージーランドドル 小計	10,394		59,822.06 (5,668,738)	
香港ドル	MTR CORP	3,523	25.00	88,075.00	
	HANG SENG BANK LTD	1,961	99.55	195,217.55	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	3,600	239.00	860,400.00	
	AIA GROUP LTD	33,000	54.15	1,786,950.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD (CKI)	1,500	50.85	76,275.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	34,079	6.31	215,038.49	
	SINO LAND CO	12,000	8.12	97,440.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	1,172	69.35	81,278.20	
	香港ドル 小計	90,835		3,400,674.24 (68,591,599)	
シンガポールドル	KEPPEL LTD	4,709	6.58	30,985.22	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	3,700	32.63	120,731.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	2,480	9.77	24,229.60	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	8,705	2.71	23,590.55	
	シンガポールドル 小計	19,594		199,536.37 (23,379,676)	
	合 計	1,602,498		14,899,826,972 (14,899,826,972)	

(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	1,360	285,790.40	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	1,515	30,406.05	
		BXP INC	424	28,306.24	
		CROWN CASTLE INC	1,270	133,451.60	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	912	141,515.04	
		EQUINIX INC	277	217,949.14	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	2,167	45,290.30	
		IRON MOUNTAIN INC	859	84,422.52	
		PROLOGIS INC	2,694	333,382.50	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	318	66,462.00	

	WELLTOWER INC	1,660	178,300.60
	WEYERHAEUSER CO	2,146	64,680.44
	米ドル 小計	15,602	1,609,956.83 (253,632,598)
カナダドル	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	292	5,145.04
	カナダドル 小計	292	5,145.04 (591,062)
ユーロ	COVIVIO	125	5,722.50
	GECINA SA	96	8,390.40
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	456	12,020.16
	ユーロ 小計	677	26,133.06 (4,484,955)
英ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	1,788	11,407.44
	SEGRO PLC	3,884	35,274.48
	英ポンド 小計	5,672	46,681.92 (9,507,706)
オーストラリアドル	GOODMAN GROUP	5,061	187,763.10
	GPT GROUP	5,072	22,113.92
	オーストラリアドル 小計	10,133	209,877.02 (22,116,840)
シンガポールドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	9,900	26,730.00
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	14,792	30,323.60
	シンガポールドル 小計	24,692	57,053.60 (6,684,970)
	合計		297,018,131 (297,018,131)

(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 291銘柄	97.8%		75.7%
	投資証券 12銘柄		2.2%	1.7%
カナダドル	株式 41銘柄	99.9%		3.2%
	投資証券 1銘柄		0.1%	0.0%
ユーロ	株式 94銘柄	99.6%		7.7%
	投資証券 3銘柄		0.4%	0.0%
英ポンド	株式 44銘柄	98.3%		3.7%
	投資証券 2銘柄		1.7%	0.1%
スイスフラン	株式 24銘柄	100.0%		2.4%
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 10銘柄	100.0%		0.3%
デンマーククローネ	株式 12銘柄	100.0%		1.8%
オーストラリアドル	株式 29銘柄	91.7%		1.6%

	投資証券	2銘柄		8.3%	0.1%
ニュージーランドドル	株式	3銘柄	100.0%		0.0%
香港ドル	株式	8銘柄	100.0%		0.5%
シンガポールドル	株式	4銘柄	77.8%		0.2%
	投資証券	2銘柄		22.2%	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新興国債券マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2024年 7月22日現在

資産の部	
流動資産	
預金	13,545,210
コール・ローン	33,722,318
投資信託受益証券	11,548,566,596
未収配当金	326,397,118
未収利息	9
流動資産合計	11,922,231,251
資産合計	11,922,231,251
負債の部	
流動負債	
未払解約金	2,630,000
流動負債合計	2,630,000
負債合計	2,630,000
純資産の部	
元本等	
元本	8,249,115,240
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	3,670,486,011
元本等合計	11,919,601,251
純資産合計	11,919,601,251
負債純資産合計	11,922,231,251

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場（計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場）で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則としてわが国における計算日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
4. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 為替予約取引による為替差損益 原則として、約定日基準で計上しております。
5. その他財務諸表作成のための基礎と	外貨建取引等の処理基準

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

(貸借対照表に関する注記)

2024年 7月22日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 7月21日
期首元本額	8,016,360,322円
期中追加設定元本額	2,777,651,646円
期中一部解約元本額	2,544,896,728円
期末元本額	8,249,115,240円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	660,470,280円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	1,121,879,096円
りそなラップ型ファンド(成長型)	815,214,909円
DCりそな グローバルバランス	21,810,525円
つみたてバランスファンド	1,867,384,003円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	323,050,382円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	281,849,404円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	206,497,337円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	106,577,135円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	77,460,506円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	45,711,799円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	117,143,017円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	86,400,565円
九州SDGs・グローバルバランス	27,901,121円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定型)	8,478,738円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定成長型)	86,719,118円
ラップ型ファンド・プラスESG(成長型)	125,079,175円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定型)	45,155,132円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定成長型)	42,954,149円
りそな つみたてラップ型ファンド(成長型)	29,010,506円
ターゲットリターンバランスファンド(目標2%)	1,575,696円
ターゲットリターンバランスファンド(目標3%)	851,691円
ターゲットリターンバランスファンド(目標4%)	3,314,151円
ターゲットリターンバランスファンド(目標5%)	1,320,295円
ターゲットリターンバランスファンド(目標6%)	2,599,939円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2065	1,161,286円
FWりそな先進国+新興国債券アクティブファンド	1,339,573円
FWりそな新興国債券インデックスファンド	1,199,953,150円
Smart-i 8資産バランス 安定型	88,885,097円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	327,349,490円
Smart-i 8資産バランス 成長型	498,312,933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)	1,850,192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)	3,869,122円
りそなVIグローバル・バランスファンド(成長型)(適格機関投資家専用)	19,985,728円
2. 計算日における受益権の総数	8,249,115,240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	1.4450円
(10,000口当たり純資産額)	(14,450円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2024年 7月22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

2024年 7月22日現在

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

2024年 7月22日現在

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2024年 7月22日現在	
	損益に含まれた評価差額(円)	
投資信託受益証券		366,752,526
合計		366,752,526

(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	1,709,154	73,305,615.06	
		米ドル 小計	1,709,154	73,305,615.06 (11,548,566,596)	
合計				11,548,566,596 (11,548,566,596)	

(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 1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新興国株式マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2024年 7月22日現在

資産の部	
流動資産	
預金	522,715,157
コール・ローン	34,702,400
株式	37,511,345,601
投資証券	36,656,559
派生商品評価勘定	634,724
未収入金	1,510,915
未収配当金	191,297,790
未収利息	9
差入委託証拠金	592,602,094
流動資産合計	38,891,465,249
資産合計	
38,891,465,249	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	18,418,914
未払金	5,754,769
流動負債合計	24,173,683
負債合計	
24,173,683	
純資産の部	
元本等	
元本	18,255,951,980
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	20,611,339,586
元本等合計	38,867,291,566
純資産合計	
38,867,291,566	
負債純資産合計	
38,891,465,249	

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

5. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	原則として、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。 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 7月22日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 7月21日
期首元本額	15,608,210,450円
期中追加設定元本額	5,379,908,367円
期中一部解約元本額	2,732,166,837円
期末元本額	18,255,951,980円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	440,901,940円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	1,867,511,946円
りそなラップ型ファンド(成長型)	2,830,940,136円
DCりそな グローバルバランス	14,532,007円
つみたてバランスファンド	1,262,500,542円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	473,933,596円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	394,630,283円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	281,629,525円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	145,750,737円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	103,762,544円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	61,376,596円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	156,028,939円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	119,764,860円
九州SDGs・グローバルバランス	61,781,142円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定型)	5,648,745円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定成長型)	163,346,033円
ラップ型ファンド・プラスESG(成長型)	343,502,223円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定型)	30,087,781円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定成長型)	81,206,679円
りそな つみたてラップ型ファンド(成長型)	98,890,228円
りそな つみたてリスクコントロールファンド	3,109,951円
ターゲットリターンバランスファンド(目標2%)	1,053,315円
ターゲットリターンバランスファンド(目標3%)	1,072,194円
ターゲットリターンバランスファンド(目標4%)	6,645,799円
ターゲットリターンバランスファンド(目標5%)	3,599,079円
ターゲットリターンバランスファンド(目標6%)	8,670,843円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2065	1,564,862円
りそな新興国株式インデックス	10,053,938円
FWりそな先進国+新興国株式アクティブファンド	53,300,745円
FWりそな新興国株式インデックスファンド	4,091,104,009円
Smart-i 新興国株式インデックス	3,421,825,885円
Smart-i 8資産バランス 安定型	125,572,557円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	447,224,230円
Smart-i 8資産バランス 成長型	672,090,306円
Smart-i Select 全世界株式インデックス	246,912,015円
Smart-i Select 全世界株式インデックス(除く日本)	79,282,503円
Smart-i DC 全世界株式インデックス	51,601,181円
Smart-i DC 全世界株式インデックス(除く日本)	537,264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)	1,232,661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)	8,099,670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)	83,672,491円
2. 計算日における受益権の総数	18,255,951,980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	2.1290円
(10,000口当たり純資産額)	(21,290円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

2024年 7月22日現在

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

金融商品の時価等に関する事項

2024年 7月22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）

2024年 7月22日現在

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2024年 7月22日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式		4,225,708,475
投資証券		7,555,775
合計		4,218,152,700

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

2 デリバティブ取引に関する注記

（株式関連）

（2024年 7月22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	1,348,630,983	-	1,330,819,150	17,811,833
	合計	1,348,630,983	-	1,330,819,150	17,811,833

（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 7月22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	34,768,587	-	34,792,645	24,058
	米ドル	34,768,587	-	34,792,645	24,058
	売建	2,188,857	-	2,185,272	3,585
	タイパーツ	1,147,614	-	1,144,897	2,717
	オフショア人民元	1,041,243	-	1,040,375	868
	合計	36,957,444	-	36,977,917	27,643

(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	31,900	1.79	57,101.00	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	1,600	0.00	0.00	
	SURGUTNEFTGAS-SP ADR	13,769	0.00	0.00	
	TATNEFT PAO-SPONSORED ADR	4,090	0.00	0.00	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	4,996	16.19	80,885.24	
	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	
	SOLIDCORE RESOURCES PLC	5,948	0.00	0.00	
	SOUTHERN COPPER CORP	2,715	104.30	283,174.50	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	13,411	19.75	264,867.25	
	NIO INC - ADR	43,205	4.46	192,694.30	

	H WORLD GROUP LTD	6,391	30.10	192,369.10	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	14,022	10.09	141,481.98	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	12,372	30.32	375,119.04	
	AUTOHOME INC-ADR	2,118	25.22	53,415.96	
	IQIYI INC-ADR	15,423	3.50	53,980.50	
	KANZHUN LTD	8,346	15.70	131,032.20	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	23,615	14.26	336,749.90	
	VK CO LTD	2,211	0.00	0.00	
	PDD HOLDINGS INC	18,823	133.04	2,504,211.92	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	11,890	13.64	162,179.60	
	X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	2,296	0.00	0.00	
	LEGEND BIOTECH CORP-ADR	2,240	58.74	131,577.60	
	COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	98,520	1.57	154,676.40	
	CREDICORP LTD	2,141	172.20	368,680.20	
	TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	2,188	0.00	0.00	
	QIFU TECHNOLOGY INC	3,969	19.24	76,363.56	
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	24,726	1.63	40,352.83	
	KE HOLDINGS INC	20,820	14.12	293,978.40	
	米ドル 小計	415,130		5,894,891.48 (928,681,203)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-CPO	456,600	11.21	5,118,486.00	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	98,500	103.48	10,192,780.00	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	6,450	258.47	1,667,131.50	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	27,700	25.65	710,505.00	
	ALFA S.A.B. -A	108,000	11.04	1,192,320.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	17,700	128.91	2,281,707.00	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	11,960	293.58	3,511,216.80	
	GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	5,830	558.35	3,255,180.50	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL CENT	8,600	159.56	1,372,216.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	5,980	169.63	1,014,387.40	
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	165,300	63.84	10,552,752.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	16,100	179.47	2,889,467.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	16,850	160.22	2,699,707.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	61,100	209.91	12,825,501.00	
	GRUMA S.A.B. -B	6,105	344.48	2,103,050.40	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	42,500	65.07	2,765,475.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	45,900	34.03	1,561,977.00	
	BANCO DEL BAJIO SA	22,200	57.24	1,270,728.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	81,900	149.81	12,269,439.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	59,100	43.96	2,598,036.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	588,900	15.93	9,381,177.00	
	メキシコペソ 小計	1,853,275		91,233,239.60 (798,354,709)	

ブラジルリアル	COSAN SA	38,400	14.03	538,752.00
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	117,500	41.71	4,900,925.00
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	150,300	38.69	5,815,107.00
	PRIO SA	24,800	45.29	1,123,192.00
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	22,900	23.22	531,738.00
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	19,200	12.64	242,688.00
	GERDAU SA-PREF	45,234	18.79	849,946.86
	KLABIN SA - UNIT	24,530	21.51	527,640.30
	SUZANO SA	24,507	53.60	1,313,575.20
	VALE SA	107,404	61.12	6,564,532.48
	WEG SA	53,200	47.29	2,515,828.00
	(Right)LOCALIZA RENT A CAR SA - RTS	274	10.90	2,986.60
	CCR SA	32,300	12.41	400,843.00
	LOCALIZA RENT A CAR	29,610	43.41	1,285,370.10
	RUMO SA	42,300	22.56	954,288.00
	LOJAS RENNER S.A.	30,720	13.05	400,896.00
	VIBRA ENERGIA SA	29,900	23.09	690,391.00
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	19,100	10.25	195,775.00
	RAIA DROGASIL SA	41,476	25.77	1,068,836.52
	SENDAS DISTRIBUIDORA SA	41,700	10.54	439,518.00
	AMBEV SA	144,700	11.73	1,697,331.00
	BRF SA	19,900	20.99	417,701.00
	JBS SA	24,800	31.22	774,256.00
	NATURA &CO HOLDING SA	28,800	15.07	434,016.00
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	150,892	3.89	586,969.88
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	18,600	28.10	522,660.00
	HYPERA SA	11,400	28.37	323,418.00
	BANCO BRADESCO S.A.	51,115	11.46	585,777.90
	BANCO BRADESCO SA-PREF	167,936	12.49	2,097,520.64
	BANCO DO BRASIL S.A.	52,400	27.11	1,420,564.00
	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	152,800	34.26	5,234,928.00
	ITAUSA SA	171,628	10.36	1,778,066.08
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	180,100	11.17	2,011,717.00
	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	36,400	31.75	1,155,700.00
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	22,000	34.10	750,200.00	
CAIXA SEGURIDADE PARTICIPACO	19,000	14.53	276,070.00	
TOTVS SA	16,400	28.06	460,184.00	
TELEFONICA BRASIL S.A.	13,000	49.03	637,390.00	
TIM SA	28,500	16.77	477,945.00	
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	7,100	41.44	294,224.00	
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	38,900	37.09	1,442,801.00	
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	57,374	10.55	605,295.70	
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	10,300	84.90	874,470.00	

	COMPANHIA PARANAENSE DE ENER	35,200	10.07	354,464.00
	CPFL ENERGIA SA	7,200	32.88	236,736.00
	ENERGISA SA-UNITS	6,900	46.30	319,470.00
	ENEVA SA	12,700	12.56	159,512.00
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	6,275	45.60	286,140.00
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	33,800	32.49	1,098,162.00
	ブラジルリアル 小計	2,421,475		57,676,518.26 (1,622,480,832)
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	12,153	6,854.00	83,296,662.00
	EMPRESAS CMPC SA	33,869	1,648.00	55,816,112.00
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	4,419	37,206.00	164,413,314.00
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES	466,759	65.20	30,432,686.80
	LATAM AIRLINES GROUP SA	5,527,400	13.09	72,353,666.00
	FALABELLA SA	29,867	3,047.00	91,004,749.00
	CENCOSUD SA	35,890	1,725.00	61,910,250.00
	BANCO DE CHILE	1,384,067	111.70	154,600,283.90
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	2,535	28,000.00	70,980,000.00
	BANCO SANTANDER CHILE	2,146,867	47.80	102,620,242.60
	ENEL AMERICAS SA	721,398	88.00	63,483,024.00
	ENEL CHILE SA	827,632	54.20	44,857,654.40
	チリペソ 小計	11,192,856		995,768,644.70 (166,056,370)
コロンビアペソ	BANCOLOMBIA SA	7,429	35,700.00	265,215,300.00
	BANCOLOMBIA SA-PREF	13,694	34,000.00	465,596,000.00
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	15,693	18,300.00	287,181,900.00
	コロンビアペソ 小計	36,816		1,017,993,200.00 (39,701,734)
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	1,871	23.00	43,033.00
	METLEN ENERGY & METALS SA	3,508	35.96	126,147.68
	OPAP SA	5,739	15.81	90,733.59
	JUMBO SA	3,787	25.34	95,962.58
	ALPHA SERVICES AND HOLDINGS	65,690	1.67	110,227.82
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	80,797	2.18	176,864.63
	NATIONAL BANK OF GREECE	24,924	8.30	206,869.20
	PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS S	33,092	3.90	129,058.80
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	6,206	14.15	87,814.90
	PUBLIC POWER CORP	6,514	11.54	75,171.56
	ユーロ 小計	232,128		1,141,883.76 (195,970,090)
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	31,268	165.00	5,159,220.00
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	43,208	57.55	2,486,620.40
	SASA POLYESTER SANAYI	43,418	45.96	1,995,491.28
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	45,551	63.00	2,869,713.00

	KOC HOLDING AS	24,481	225.20	5,513,121.20	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	42,569	49.64	2,113,125.16	
	PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS	7,907	247.60	1,957,773.20	
	TURK HAVA YOLLARI AO	16,774	315.50	5,292,197.00	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	2,149	1,049.00	2,254,301.00	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	4,511	297.25	1,340,894.75	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	14,326	614.50	8,803,327.00	
	COCA-COLA ICECEK AS	2,465	874.00	2,154,410.00	
	AKBANK T.A.S.	95,565	68.75	6,570,093.75	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	34,570	106.50	3,681,705.00	
	TURKIYE IS BANKASI-C	259,296	17.57	4,555,830.72	
	YAPI VE KREDI BANKASI	104,229	32.26	3,362,427.54	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	37,556	110.40	4,146,182.40	
	トルコリラ 小計	809,843		64,256,433.40 (307,036,515)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	2,474	810.00	2,003,940.00	
	MONETA MONEY BANK AS	9,667	109.20	1,055,636.40	
	CEZ AS	4,830	911.00	4,400,130.00	
	チェココルナ 小計	16,971		7,459,706.40 (50,740,922)	
ハンガリーフォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	13,379	2,846.00	38,076,634.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	4,614	9,765.00	45,055,710.00	
	OTP BANK PLC	6,963	18,620.00	129,651,060.00	
	ハンガリーフォリント 小計	24,956		212,783,404.00 (93,546,393)	
ポーランドズロチ	ORLEN SA	17,899	65.18	1,166,656.82	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	4,424	137.40	607,857.60	
	BUDIMEX	397	659.00	261,623.00	
	LPP SA	35	16,390.00	573,650.00	
	CD PROJEKT SA	2,083	157.50	328,072.50	
	ALLEGRO.EU SA	17,580	35.13	617,585.40	
	DINO POLSKA SA	1,567	402.80	631,187.60	
	BANK PEKAO SA	5,839	163.60	955,260.40	
	MBANK SA	464	641.00	297,424.00	
	PKO BANK POLSKI SA	27,580	60.16	1,659,212.80	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	1,142	548.20	626,044.40	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	19,309	48.92	944,596.28	
	PGE SA	29,021	7.15	207,674.27	
	ポーランドズロチ 小計	127,340		8,876,845.07 (355,313,477)	
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	13,147	0.00	0.00
	MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ	22,980	0.00	0.00
	MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JO	16,768	0.00	0.00
	INTER RAO UES PJSC	725,000	0.00	0.00
	ロシアグループ 小計	1,446,040		0.00 (0)
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO-H	64,000	7.83	501,120.00
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	58,000	6.82	395,560.00
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	768,000	4.73	3,632,640.00
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	106,500	33.10	3,525,150.00
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	38,000	8.89	337,820.00
	PETROCHINA CO LTD-H	664,000	7.11	4,721,040.00
	YANKUANG ENERGY GROUP CO-H	103,500	9.93	1,027,755.00
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	124,000	4.65	576,600.00
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	39,000	19.90	776,100.00
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	91,000	9.88	899,080.00
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	152,000	2.60	395,200.00
	CMOC GROUP LTD-H	117,000	6.93	810,810.00
	GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD-H	11,440	17.74	202,945.60
	JIANGXI COPPER CO LTD-H	34,000	14.42	490,280.00
	MMG LTD	140,000	2.76	386,400.00
	SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	20,500	17.10	350,550.00
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	49,000	14.88	729,120.00
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	172,000	16.32	2,807,040.00
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	83,000	3.67	304,610.00
	BOC AVIATION LTD	7,000	63.95	447,650.00
	CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	82,000	4.16	341,120.00
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	133,000	3.78	502,740.00
	CHINA STATE CONSTRUCTION INT	62,000	10.90	675,800.00
	CITIC LTD	178,000	7.16	1,274,480.00
	CRRG CORP LTD - H	138,000	4.97	685,860.00
	FOSUN INTERNATIONAL LTD	83,500	4.13	344,855.00
	HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	21,000	21.40	449,400.00
	SINOTRUK HONG KONG LTD	22,500	18.06	406,350.00
	WEICHAI POWER CO LTD-H	61,000	12.12	739,320.00
	ZHUZHOU CRRG TIMES ELECTRI-H	16,000	29.40	470,400.00

CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	40,000	11.64	465,600.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	91,200	10.62	968,544.00
JD LOGISTICS INC	63,100	8.15	514,265.00
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	42,000	7.36	309,120.00
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	4,000	107.20	428,800.00
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	48,000	5.03	241,440.00
BYD CO LTD-H	33,000	243.00	8,019,000.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	18,800	45.80	861,040.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	192,000	8.07	1,549,440.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	72,000	12.02	865,440.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	92,000	2.88	264,960.00
LI AUTO INC-CLASS A	38,988	77.25	3,011,823.00
XPENG INC-CLASS A SHARES	39,564	32.40	1,281,873.60
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	38,000	10.18	386,840.00
ZHEJIANG LEPMOTOR TECHNOLOG	15,200	24.25	368,600.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	40,200	72.60	2,918,520.00
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	126,000	4.01	505,260.00
HAIER SMART HOME CO LTD-H	76,600	23.70	1,815,420.00
HISENSE HOME APPLIANCES GR-H	10,000	22.80	228,000.00
LI NING CO LTD	71,500	15.06	1,076,790.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	26,300	70.65	1,858,095.00
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	53,000	13.14	696,420.00
MEITUAN	159,610	117.50	18,754,175.00
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	47,010	55.45	2,606,704.50
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LT	38,000	13.76	522,880.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	34,000	9.29	315,860.00
TRIP.COM GROUP LTD	17,260	344.20	5,940,892.00
BAIDU INC-CLASS A	71,730	88.15	6,322,999.50
BILIBILI INC-CLASS Z	7,377	121.20	894,092.40
CHINA LITERATURE LTD	12,200	25.70	313,540.00
CHINA RUYI HOLDINGS LIMITED	208,000	2.14	445,120.00
KINGSOFT CORP LTD	28,800	22.15	637,920.00
KUAISHOU TECHNOLOGY	73,300	45.20	3,313,160.00
NETEASE INC	60,900	141.80	8,635,620.00
TENCENT HOLDINGS LTD	208,100	364.00	75,748,400.00
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	490,340	73.80	36,187,092.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-H	3,200	56.10	179,520.00
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	62,600	8.03	502,678.00
JD.COM INC - CL A	73,260	102.70	7,523,802.00
MINISO GROUP HOLDING LTD	12,492	33.65	420,355.80
POP MART INTERNATIONAL GROUP	15,000	41.60	624,000.00
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	56,000	3.79	212,240.00
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	25,000	12.50	312,500.00

ALIBABA HEALTH INFORMATION T	180,000	3.30	594,000.00
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	35,250	20.55	724,387.50
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	3,800	115.55	439,090.00
CHINA FEIHE LTD	115,000	3.60	414,000.00
CHINA MENGNIU DAIRY CO	101,000	14.50	1,464,500.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	52,000	27.55	1,432,600.00
NONGFU SPRING CO LTD-H	63,600	33.75	2,146,500.00
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	60,000	8.55	513,000.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	60,000	9.45	567,000.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	20,000	51.00	1,020,000.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	154,000	4.68	720,720.00
GIANT BIOGENE HOLDING CO LTD	9,600	39.90	383,040.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	19,500	23.90	466,050.00
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	10,800	26.15	282,420.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	77,200	4.05	312,660.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	21,500	11.76	252,840.00
SINOPHARM GROUP CO-H	41,600	18.90	786,240.00
AKESO INC	20,000	40.25	805,000.00
BEIGENE LTD	20,996	92.25	1,936,881.00
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	56,500	5.42	306,230.00
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	266,000	6.02	1,601,320.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	36,000	13.08	470,880.00
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	38,000	17.28	656,640.00
INNOVENT BIOLOGICS INC	39,000	40.55	1,581,450.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	326,250	2.85	929,812.50
WUXI APPTTEC CO LTD-H	10,168	28.65	291,313.20
WUXI BIOLOGICS (CAYMAN) INC.	122,500	10.82	1,325,450.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	870,000	3.35	2,914,500.00
BANK OF CHINA LTD-H	2,500,000	3.39	8,475,000.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	275,000	5.54	1,523,500.00
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	280,000	4.54	1,271,200.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	3,027,000	5.34	16,164,180.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	101,000	2.42	244,420.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	122,500	33.85	4,146,625.00
CHINA MINSHENG BANKING-H	209,600	2.78	582,688.00
IND & COMM BK OF CHINA-H	2,048,000	4.25	8,704,000.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	239,000	4.08	975,120.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	115,500	3.78	436,590.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	47,600	8.36	397,936.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	50,000	11.58	579,000.00
FAR EAST HORIZON LTD	64,000	5.08	325,120.00
GF SECURITIES CO LTD-H	33,000	6.76	223,080.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	86,400	3.51	303,264.00

	HUATAI SECURITIES CO LTD-H	41,200	8.18	337,016.00	
	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	235,000	11.00	2,585,000.00	
	CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	83,400	20.15	1,680,510.00	
	CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	43,000	7.97	342,710.00	
	NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	28,900	14.80	427,720.00	
	PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	264,000	2.57	678,480.00	
	PICC PROPERTY & CASUALTY-H	218,000	9.55	2,081,900.00	
	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	211,000	34.35	7,247,850.00	
	KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	90,000	6.20	558,000.00	
	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	22,500	30.80	693,000.00	
	BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	24,500	33.70	825,650.00	
	LENOVO GROUP LTD	254,000	10.18	2,585,720.00	
	SUNNY OPTICAL TECH	22,400	48.25	1,080,800.00	
	XIAOMI CORP-CLASS B	482,200	16.52	7,965,944.00	
	ZTE CORP-H	23,600	18.02	425,272.00	
	CHINA TOWER CORP LTD-H	1,400,000	0.98	1,372,000.00	
	BEIJING ENTERPRISES HLDGS	16,500	25.55	421,575.00	
	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	122,000	2.19	267,180.00	
	CGN POWER CO LTD-H	324,000	3.31	1,072,440.00	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	88,800	7.16	635,808.00	
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	100,000	7.35	735,000.00	
	CHINA POWER INTERNATIONAL	158,000	3.65	576,700.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	30,000	26.85	805,500.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	62,000	21.60	1,339,200.00	
	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	24,500	59.70	1,462,650.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD	92,000	4.09	376,280.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	134,000	4.89	655,260.00	
	KUNLUN ENERGY CO LTD	124,000	8.08	1,001,920.00	
	FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	11,000	11.90	130,900.00	
	GCL TECHNOLOGY HOLDINGS LTD	658,000	1.15	756,700.00	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	18,000	23.60	424,800.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	150,000	3.70	555,000.00	
	C&D INTERNATIONAL INVESTMENT	23,000	14.20	326,600.00	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	122,000	13.02	1,588,440.00	
	CHINA RESOURCES LAND LTD	102,000	25.35	2,585,700.00	
	CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	22,200	23.90	530,580.00	
	LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	66,000	10.68	704,880.00	
	香港ドル 小計	24,495,135		345,787,569.60 (6,974,535,278)	
マレーシアリン ギット	PETRONAS DAGANGAN BHD	10,900	16.86	183,774.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	88,200	6.06	534,492.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	116,900	5.56	649,964.00	
	GAMUDA BHD	57,800	8.20	473,960.00	

	SIME DARBY BERHAD	99,700	2.64	263,208.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	28,000	9.99	279,720.00	
	MISC BHD	44,700	8.65	386,655.00	
	GENTING BHD	57,900	4.83	279,657.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	91,400	2.62	239,468.00	
	MR DIY GROUP M BHD	92,550	2.14	198,057.00	
	IOI CORP BHD	85,100	3.85	327,635.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	16,500	21.50	354,750.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	2,200	122.50	269,500.00	
	PPB GROUP BERHAD	19,620	15.04	295,084.80	
	QL RESOURCES BHD	30,350	6.70	203,345.00	
	SD GUTHRIE BHD	63,000	4.50	283,500.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	68,900	6.33	436,137.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	82,000	4.41	361,620.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	219,100	7.15	1,566,565.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	20,600	19.02	391,812.00	
	MALAYAN BANKING BHD	169,600	10.10	1,712,960.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	459,400	4.24	1,947,856.00	
	RHB BANK BHD	50,200	5.70	286,140.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	95,100	2.63	250,113.00	
	CELCOMDIGI BHD	113,500	3.71	421,085.00	
	MAXIS BHD	64,700	3.63	234,861.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	36,600	7.13	260,958.00	
	PETRONAS GAS BHD	22,900	18.20	416,780.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	82,600	14.44	1,192,744.00	
	YTL CORP BHD	106,800	3.58	382,344.00	
	YTL POWER INTERNATIONAL BHD	78,700	4.80	377,760.00	
	INARI AMERTRON BHD	92,700	3.85	356,895.00	
	マレーシアリングット 小計	2,668,220		15,819,399.80 (531,604,602)	
タイパーツ	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	42,700	144.50	6,170,150.00	
	PTT PCL-NVDR	319,400	32.25	10,300,650.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	39,100	53.00	2,072,300.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	53,800	18.30	984,540.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	79,000	27.50	2,172,500.00	
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	48,500	28.50	1,382,250.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	25,500	227.00	5,788,500.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	131,800	58.25	7,677,350.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	234,600	7.85	1,841,610.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	190,600	3.90	743,340.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	114,000	30.50	3,477,000.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	51,825	32.50	1,684,312.50	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	204,100	8.95	1,826,695.00	

	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	85,300	16.20	1,381,860.00	
	CP ALL PCL-NVDR	187,100	57.00	10,664,700.00	
	CP AXTRA PCL-NVDR	73,900	30.25	2,235,475.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	130,000	23.90	3,107,000.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	344,000	26.75	9,202,000.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	18,700	247.00	4,618,900.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	19,100	128.00	2,444,800.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	98,900	17.10	1,691,190.00	
	SCB X PCL-NVDR	26,600	101.50	2,699,900.00	
	TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR	685,400	1.76	1,206,304.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	29,400	39.50	1,161,300.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	96,000	92.25	8,856,000.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	36,500	228.00	8,322,000.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	28,600	78.25	2,237,950.00	
	TRUE CORP PCL/NEW-NVDR	327,315	9.20	3,011,298.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	21,300	39.75	846,675.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	92,300	45.50	4,199,650.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	63,600	57.00	3,625,200.00	
	タイパーツ 小計	3,898,940		117,633,399.50 (510,528,953)	
フィリピンペソ	AYALA CORPORATION	7,600	597.00	4,537,200.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	72,731	27.90	2,029,194.90	
	SM INVESTMENTS CORP	6,580	911.00	5,994,380.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	32,760	369.80	12,114,648.00	
	JOLLIBEE FOODS CORP	15,800	229.40	3,624,520.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	24,530	120.30	2,950,959.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	54,578	127.80	6,975,068.40	
	BDO UNIBANK INC	74,086	148.80	11,023,996.80	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	57,732	70.00	4,041,240.00	
	PLDT INC	2,235	1,489.00	3,327,915.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	9,630	389.00	3,746,070.00	
	AYALA LAND INC	222,200	31.70	7,043,740.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	331,200	30.25	10,018,800.00	
	フィリピンペソ 小計	911,662		77,427,732.10 (209,085,847)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY TBK PT	483,900	3,100.00	1,500,090,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	45,500	24,650.00	1,121,575,000.00	
	AMMAN MINERAL INTERNASIONAL	209,900	11,300.00	2,371,870,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK	307,000	1,350.00	414,450,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	910,347	1,055.00	960,416,085.00	
	CHANDRA ASRI PACIFIC TBK PT	233,900	9,475.00	2,216,202,500.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	70,200	8,500.00	596,700,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	292,209	2,340.00	683,769,060.00	

	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	630,400	4,530.00	2,855,712,000.00	
	GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT	26,963,000	50.00	1,348,150,000.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	556,700	2,880.00	1,603,296,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	219,400	5,475.00	1,201,215,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	75,400	10,800.00	814,320,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	154,200	6,075.00	936,765,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	276,400	2,800.00	773,920,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	730,700	1,575.00	1,150,852,500.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	1,749,800	10,125.00	17,716,725,000.00	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	1,180,700	6,525.00	7,704,067,500.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	463,600	5,100.00	2,364,360,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	2,154,145	4,900.00	10,555,310,500.00	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	1,576,000	3,140.00	4,948,640,000.00	
	インドネシアルピア 小計	39,283,401		63,838,406,145.00 (625,616,380)	
韓国ウォン	HD HYUNDAI	1,442	79,300.00	114,350,600.00	
	S-OIL CORP	1,463	68,100.00	99,630,300.00	
	SK INNOVATION CO LTD	1,895	112,000.00	212,240,000.00	
	ENCHEM CO LTD	341	190,900.00	65,096,900.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORP	3,349	26,500.00	88,748,500.00	
	HYUNDAI STEEL CO	2,559	28,000.00	71,652,000.00	
	KOREA ZINC CO LTD	267	520,000.00	138,840,000.00	
	KUM YANG CO LTD	1,116	75,600.00	84,369,600.00	
	KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	458	152,500.00	69,845,000.00	
	LG CHEM LTD	1,572	333,500.00	524,262,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	265	230,000.00	60,950,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORP	563	104,600.00	58,889,800.00	
	POSCO HOLDINGS INC	2,268	370,500.00	840,294,000.00	
	SKC CO LTD	602	155,500.00	93,611,000.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	1,860	49,250.00	91,605,000.00	
	DOOSAN ENERBILITY	14,355	20,200.00	289,971,000.00	
	ECOPRO BM CO LTD	1,505	194,000.00	291,970,000.00	
	ECOPRO CO LTD	3,196	100,300.00	320,558,800.00	
	ECOPRO MATERIALS CO LTD	441	96,900.00	42,732,900.00	
	GS HOLDINGS	1,411	47,900.00	67,586,900.00	
	HANWHA AEROSPACE CO LTD	1,137	281,500.00	320,065,500.00	
	HANWHA OCEAN CO LTD	3,102	30,100.00	93,370,200.00	
	HD HYUNDAI ELECTRIC CO LTD	661	307,000.00	202,927,000.00	
	HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	733	164,300.00	120,431,900.00	
	HD KOREA SHIPBUILDING & OFFS	1,376	174,100.00	239,561,600.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONST	2,296	32,600.00	74,849,600.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	2,176	49,100.00	106,841,600.00	
	L&F CO LTD	821	126,000.00	103,446,000.00	

LG CORP	2,961	81,800.00	242,209,800.00
LG ENERGY SOLUTION	1,435	345,500.00	495,792,500.00
POSCO FUTURE M CO LTD	962	257,000.00	247,234,000.00
POSCO INTERNATIONAL CORP	1,772	56,400.00	99,940,800.00
SAMSUNG C&T CORP	2,648	147,500.00	390,580,000.00
SAMSUNG E&A CO LTD	4,565	25,000.00	114,125,000.00
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	21,428	10,550.00	226,065,400.00
SK	1,151	150,000.00	172,650,000.00
SK IE TECHNOLOGY CO LTD	775	41,600.00	32,240,000.00
SK SQUARE CO LTD	3,018	88,000.00	265,584,000.00
HANJIN KAL CORP	866	70,100.00	60,706,600.00
HMM CO LTD	7,839	17,250.00	135,222,750.00
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,230	119,100.00	146,493,000.00
KOREAN AIR LINES CO LTD	5,483	21,550.00	118,158,650.00
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	2,338	41,050.00	95,974,900.00
HYUNDAI MOBIS CO LTD	1,896	223,500.00	423,756,000.00
HYUNDAI MOTOR CO	4,292	258,500.00	1,109,482,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	1,138	168,500.00	191,753,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	714	166,300.00	118,738,200.00
KIA CORP	8,243	116,300.00	958,660,900.00
COWAY CO LTD	1,628	63,300.00	103,052,400.00
LG ELECTRONICS INC	3,387	111,800.00	378,666,600.00
HYBE CO LTD	687	182,500.00	125,377,500.00
KAKAO CORP	9,494	41,350.00	392,576,900.00
KRAFTON INC	872	280,500.00	244,596,000.00
NAVER CORP	4,095	172,200.00	705,159,000.00
NCSOFT CORP	458	189,100.00	86,607,800.00
NETMARBLE CORPORATION	904	60,100.00	54,330,400.00
CJ CHEILJEDANG CORP	272	371,000.00	100,912,000.00
KT&G CORP	3,351	90,400.00	302,930,400.00
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	783	91,000.00	71,253,000.00
AMOREPACIFIC CORP	932	163,200.00	152,102,400.00
LG H&H	315	342,500.00	107,887,500.00
HLB INC	3,748	83,400.00	312,583,200.00
ALTEOGEN INC	1,267	271,500.00	343,990,500.00
CELLTRION INC	4,814	187,900.00	904,550,600.00
CELLTRION PHARM INC	569	93,500.00	53,201,500.00
HANMI PHARM CO LTD	218	303,000.00	66,054,000.00
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	562	835,000.00	469,270,000.00
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	954	86,400.00	82,425,600.00
SK BIOSCIENCE CO LTD	710	55,000.00	39,050,000.00
YUHAN CORP	1,830	95,400.00	174,582,000.00
HANA FINANCIAL GROUP	9,256	62,700.00	580,351,200.00

	INDUSTRIAL BANK OF KOREA	8,613	13,960.00	120,237,480.00	
	KAKAOBANK CORP	5,191	21,400.00	111,087,400.00	
	KB FINANCIAL GROUP INC	12,077	84,800.00	1,024,129,600.00	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	13,645	53,400.00	728,643,000.00	
	WOORI FINANCIAL GROUP INC	18,838	14,870.00	280,121,060.00	
	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	1,162	73,700.00	85,639,400.00	
	MERITZ FINANCIAL GROUP INC	3,040	82,500.00	250,800,000.00	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	7,939	7,740.00	61,447,860.00	
	NH INVESTMENT & SECURITIES C	3,822	13,570.00	51,864,540.00	
	DB INSURANCE CO LTD	1,452	105,800.00	153,621,600.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	983	363,000.00	356,829,000.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	2,498	93,000.00	232,314,000.00	
	POSCO DX CO LTD	1,565	34,650.00	54,227,250.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	1,376	155,700.00	214,243,200.00	
	COSMOAM&T CO LTD	779	139,900.00	108,982,100.00	
	LG DISPLAY CO LTD	9,723	12,600.00	122,509,800.00	
	LG INNOTEK CO LTD	466	297,500.00	138,635,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	1,693	168,000.00	284,424,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	150,377	84,400.00	12,691,818,800.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	25,932	66,300.00	1,719,291,600.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	1,736	357,500.00	620,620,000.00	
	KT CORP	896	37,100.00	33,241,600.00	
	LG UPLUS CORP	6,485	9,990.00	64,785,150.00	
	SK TELECOM	1,621	53,900.00	87,371,900.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	8,066	19,720.00	159,061,520.00	
	HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD	1,397	151,000.00	210,947,000.00	
	SK HYNIX INC	17,192	209,500.00	3,601,724,000.00	
	韓国ウォン 小計	487,654		39,954,193,560.00 (4,538,796,388)	
新台幣ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	36,000	65.10	2,343,600.00	
	ASIA CEMENT CORP	69,000	40.95	2,825,550.00	
	CHINA STEEL CORP	376,000	23.35	8,779,600.00	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	110,000	50.50	5,555,000.00	
	FORMOSA PLASTICS CORP	122,000	60.10	7,332,200.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	149,000	50.40	7,509,600.00	
	TCC GROUP HOLDINGS	214,917	34.60	7,436,128.20	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	4,200	970.00	4,074,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	92,000	33.05	3,040,600.00	
	FORTUNE ELECTRIC CO LTD	4,000	957.00	3,828,000.00	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	2,000	1,770.00	3,540,000.00	
	WALSIN LIHWA CORP	84,000	35.75	3,003,000.00	
	CHINA AIRLINES LTD	95,000	22.25	2,113,750.00	
	EVA AIRWAYS CORP	86,000	33.50	2,881,000.00	

EVERGREEN MARINE CORP LTD	31,420	167.00	5,247,140.00
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	55,000	29.65	1,630,750.00
WAN HAI LINES LTD	23,650	71.10	1,681,515.00
YANG MING MARINE TRANSPORT	52,000	60.20	3,130,400.00
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	53,000	46.70	2,475,100.00
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	5,420	548.00	2,970,160.00
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	14,289	139.00	1,986,171.00
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	5,000	383.00	1,915,000.00
POU CHEN	73,000	35.85	2,617,050.00
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	10,160	630.00	6,400,800.00
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	18,000	282.00	5,076,000.00
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	149,000	86.90	12,948,100.00
PHARMAESSENTIA CORP	8,000	648.00	5,184,000.00
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	177,046	18.75	3,319,612.50
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	557,000	35.95	20,024,150.00
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	447,197	30.25	13,527,709.25
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	345,723	29.15	10,077,825.45
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	282,430	27.40	7,738,582.00
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	363,502	42.25	15,357,959.50
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	334,350	26.60	8,893,710.00
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	359,055	19.75	7,091,336.25
TAIWAN BUSINESS BANK	200,128	18.30	3,662,342.40
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	317,978	26.65	8,474,113.70
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	122,000	42.20	5,148,400.00
CHAILEASE HOLDING CO LTD	46,929	150.50	7,062,814.50
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	316,208	32.60	10,308,380.80
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	301,000	62.60	18,842,600.00
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	513,000	15.90	8,156,700.00
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	246,766	86.10	21,246,552.60
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	418,835	10.85	4,544,359.75
ACCTON TECHNOLOGY CORP	16,000	521.00	8,336,000.00
ACER INC	86,000	46.20	3,973,200.00
ADVANTECH CO LTD	14,427	367.50	5,301,922.50
ASIA VITAL COMPONENTS	10,000	687.00	6,870,000.00
ASUSTEK COMPUTER INC	22,000	481.50	10,593,000.00
AUO CORP	193,200	19.00	3,670,800.00
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	20,000	202.00	4,040,000.00
COMPAL ELECTRONICS	133,000	33.60	4,468,800.00
DELTA ELECTRONICS INC	61,000	399.00	24,339,000.00
E INK HOLDINGS INC	26,000	262.00	6,812,000.00
GIGABYTE TECHNOLOGY CO LTD	16,000	277.50	4,440,000.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	392,800	204.00	80,131,200.00
INNOLUX CORP	273,751	16.15	4,421,078.65

INVENTEC CORP	87,000	53.60	4,663,200.00	
LARGAN PRECISION CO LTD	3,200	2,900.00	9,280,000.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	64,000	109.50	7,008,000.00	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	23,000	180.50	4,151,500.00	
PEGATRON CORP	64,000	106.00	6,784,000.00	
QUANTA COMPUTER INC	85,000	297.00	25,245,000.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	40,000	73.40	2,936,000.00	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	41,000	192.50	7,892,500.00	
WISTRON CORP	83,000	105.50	8,756,500.00	
WIWYNN CORP	3,000	2,205.00	6,615,000.00	
WPG HOLDINGS LTD	47,960	94.20	4,517,832.00	
YAGEO CORPORATION	10,524	766.00	8,061,384.00	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	22,000	140.00	3,080,000.00	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	120,000	121.00	14,520,000.00	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	55,000	85.00	4,675,000.00	
TAIWAN MOBILE CO LTD	59,000	103.50	6,106,500.00	
ALCHIP TECHNOLOGIES LTD	2,500	2,715.00	6,787,500.00	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	104,000	171.00	17,784,000.00	
EMEMORY TECHNOLOGY INC	2,000	2,450.00	4,900,000.00	
GLOBAL UNICHIP CORP	2,800	1,440.00	4,032,000.00	
GLOBALWAFERS CO LTD	8,000	544.00	4,352,000.00	
MEDIATEK INC	47,900	1,260.00	60,354,000.00	
NANYA TECHNOLOGY CORP	39,000	64.20	2,503,800.00	
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	18,400	543.00	9,991,200.00	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	15,000	534.00	8,010,000.00	
SILERGY CORP	9,640	447.00	4,309,080.00	
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	776,000	970.00	752,720,000.00	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	355,000	51.90	18,424,500.00	
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	29,000	118.50	3,436,500.00	
WINBOND ELECTRONICS CORP	99,000	24.40	2,415,600.00	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	53,647	48.05	2,577,738.35	
新台湾ドル 小計	10,924,952		1,485,288,698.40 (7,142,159,235)	
インドルピー				
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	48,477	303.80	14,727,312.60	
COAL INDIA LTD	47,308	488.00	23,086,304.00	
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	27,863	341.65	9,519,393.95	
INDIAN OIL CORP LTD	87,227	165.49	14,435,196.23	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	99,694	319.65	31,867,187.10	
PETRONET LNG LTD	23,778	342.90	8,153,476.20	
RELIANCE INDUSTRIES LTD	95,915	3,110.30	298,324,424.50	
AMBUJA CEMENTS LTD	18,748	677.90	12,709,269.20	
APL APOLLO TUBES LTD	4,859	1,489.45	7,237,237.55	
ASIAN PAINTS LTD	12,149	2,946.05	35,791,561.45	

GRASIM INDUSTRIES LTD	8,176	2,743.00	22,426,768.00
HINDALCO INDUSTRIES LTD	42,737	663.00	28,334,631.00
JINDAL STAINLESS LTD	9,837	745.30	7,331,516.10
JINDAL STEEL & POWER LTD	11,587	946.35	10,965,357.45
JSW STEEL LTD	19,465	889.45	17,313,144.25
NMDC LTD	32,477	228.76	7,429,438.52
PI INDUSTRIES LTD	2,242	3,835.30	8,598,742.60
PIDILITE INDUSTRIES LTD	4,795	3,134.75	15,031,126.25
SHREE CEMENT LTD	297	27,284.15	8,103,392.55
SOLAR INDUSTRIES INDIA LTD	812	10,869.25	8,825,831.00
SRF LTD	4,666	2,342.60	10,930,571.60
SUPREME INDUSTRIES LTD	2,023	5,783.80	11,700,627.40
TATA STEEL LTD	236,993	157.77	37,390,385.61
ULTRATECH CEMENT LTD	3,653	11,258.30	41,126,569.90
UPL LTD	13,811	542.60	7,493,848.60
VEDANTA LTD	35,544	439.80	15,632,251.20
ABB INDIA LTD	1,585	7,620.50	12,078,492.50
ADANI ENTERPRISES LTD	5,367	3,005.70	16,131,591.90
ASHOK LEYLAND LTD	48,007	223.95	10,751,167.65
ASTRAL LTD	4,281	2,272.10	9,726,860.10
BHARAT ELECTRONICS LTD	113,007	306.30	34,614,044.10
BHARAT HEAVY ELECTRICALS	33,162	294.10	9,752,944.20
CG POWER AND INDUSTRIAL SOLU	19,772	675.65	13,358,951.80
CUMMINS INDIA LTD	4,466	3,559.45	15,896,503.70
HAVELLS INDIA LTD	7,902	1,768.50	13,974,687.00
HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	6,363	4,800.25	30,543,990.75
LARSEN & TOUBRO LTD	21,276	3,618.50	76,987,206.00
POLYCAB INDIA LTD	1,581	6,349.85	10,039,112.85
SIEMENS LTD	2,836	6,850.20	19,427,167.20
SUZLON ENERGY LTD	307,162	54.55	16,755,687.10
THERMAX LTD	1,230	4,972.35	6,115,990.50
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	7,631	989.10	7,547,822.10
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	16,262	1,469.30	23,893,756.60
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	7,859	1,010.95	7,945,056.05
GMR AIRPORTS INFRASTRUCTURE	77,131	91.94	7,091,424.14
INTERGLOBE AVIATION LTD	5,306	4,281.40	22,717,108.40
BAJAJ AUTO LTD	2,131	9,386.05	20,001,672.55
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	2,334	3,139.65	7,327,943.10
BHARAT FORGE LTD	8,017	1,579.40	12,662,049.80
BOSCH LTD	215	34,073.30	7,325,759.50
EICHER MOTORS LTD	4,352	4,850.70	21,110,246.40
HERO MOTOCORP LTD	3,740	5,427.70	20,299,598.00
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	29,432	2,749.30	80,917,397.60

MARUTI SUZUKI INDIA LTD	4,470	12,524.30	55,983,621.00
MRF LTD	73	128,123.55	9,353,019.15
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN	86,338	192.20	16,594,163.60
SONA BLW PRECISION FORGINGS	12,173	693.50	8,441,975.50
TATA MOTORS LTD	52,521	990.00	51,995,790.00
TATA MOTORS LTD-A-DVR	13,696	677.05	9,272,876.80
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LT	3,429	4,002.35	13,724,058.15
TVS MOTOR CO LTD	7,624	2,404.55	18,332,289.20
PAGE INDUSTRIES LTD	196	40,505.10	7,938,999.60
TITAN CO LTD	11,239	3,259.00	36,627,901.00
INDIAN HOTELS CO LTD	27,297	577.90	15,774,936.30
JUBILANT FOODWORKS LTD	10,980	560.15	6,150,447.00
ZOMATO LTD	208,714	218.89	45,685,407.46
INFO EDGE INDIA LTD	2,281	6,827.60	15,573,755.60
TRENT LTD	5,739	5,166.35	29,649,682.65
AVENUE SUPERMARTS LTD	5,012	5,010.70	25,113,628.40
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	3,364	5,877.95	19,773,423.80
ITC LTD	94,849	474.55	45,010,592.95
MARICO LTD	15,967	668.65	10,676,334.55
NESTLE INDIA LTD	10,383	2,597.85	26,973,476.55
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	18,336	1,188.00	21,783,168.00
UNITED SPIRITS LTD	9,458	1,297.75	12,274,119.50
VARUN BEVERAGES LTD	14,101	1,559.70	21,993,329.70
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	4,259	3,120.95	13,292,126.05
DABUR INDIA LTD	15,898	632.90	10,061,844.20
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	12,732	1,451.90	18,485,590.80
HINDUSTAN UNILEVER LTD	26,007	2,727.00	70,921,089.00
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	3,210	6,381.95	20,486,059.50
MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	24,763	920.45	22,793,103.35
AUROBINDO PHARMA LTD	8,399	1,330.80	11,177,389.20
CIPLA LTD	16,428	1,485.50	24,403,794.00
DIVI'S LABORATORIES LTD	3,794	4,519.80	17,148,121.20
DR. REDDY'S LABORATORIES	3,727	6,636.00	24,732,372.00
LUPIN LTD	7,170	1,786.65	12,810,280.50
MANKIND PHARMA LTD	2,983	2,129.00	6,350,807.00
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	30,329	1,568.65	47,575,585.85
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	3,310	2,946.35	9,752,418.50
AU SMALL FINANCE BANK LTD	10,528	633.65	6,671,067.20
AXIS BANK LTD	72,011	1,292.35	93,063,415.85
BANDHAN BANK LTD	25,449	192.45	4,897,660.05
BANK OF BARODA	32,605	250.60	8,170,813.00
CANARA BANK	53,143	112.89	5,999,313.27
HDFC BANK LIMITED	88,573	1,607.30	142,363,382.90

ICICI BANK LTD	163,722	1,248.65	204,431,475.30
IDFC FIRST BANK LTD	109,925	76.02	8,356,498.50
INDUSIND BANK LTD	9,262	1,432.45	13,267,351.90
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	34,493	1,821.60	62,832,448.80
PUNJAB NATIONAL BANK	69,448	116.51	8,091,386.48
STATE BANK OF INDIA	56,345	889.35	50,110,425.75
UNION BANK OF INDIA	46,909	135.65	6,363,205.85
YES BANK LTD	463,728	24.77	11,486,542.56
BAJAJ FINANCE LTD	8,801	6,932.30	61,011,172.30
BAJAJ FINSERV LTD	12,194	1,640.25	20,001,208.50
BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMEN	806	9,714.35	7,829,766.10
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	13,260	1,426.70	18,918,042.00
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	3,113	4,066.15	12,657,924.95
JIO FINANCIAL SERVICES LTD	90,636	338.75	30,702,945.00
MUTHOOT FINANCE LTD	3,756	1,841.25	6,915,735.00
POWER FINANCE CORPORATION	47,152	533.70	25,165,022.40
REC LTD	41,809	598.40	25,018,505.60
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	9,485	718.60	6,815,921.00
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	9,006	2,810.85	25,314,515.10
SUNDARAM FINANCE LTD	1,982	4,202.45	8,329,255.90
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	29,778	635.90	18,935,830.20
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	7,188	1,881.40	13,523,503.20
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	11,312	643.40	7,278,140.80
PB FINTECH LTD	9,546	1,413.05	13,488,975.30
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	14,063	1,647.70	23,171,605.10
HCL TECHNOLOGIES LTD	30,088	1,594.55	47,976,820.40
INFOSYS LTD	104,718	1,792.95	187,754,138.10
LTIMINDTREE LTD	2,775	5,762.75	15,991,631.25
MPHASIS LTD	3,266	2,873.55	9,385,014.30
PERSISTENT SYSTEMS LTD	3,124	4,583.45	14,318,697.80
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	28,549	4,302.40	122,829,217.60
TATA ELXSI LTD	1,069	6,980.55	7,462,207.95
TECH MAHINDRA LTD	16,514	1,491.40	24,628,979.60
WIPRO LTD	41,653	557.20	23,209,051.60
BHARTI AIRTEL LTD	71,541	1,461.75	104,575,056.75
INDUS TOWERS LTD	24,187	409.50	9,904,576.50
TATA COMMUNICATIONS LTD	3,349	1,788.40	5,989,351.60
ADANI GREEN ENERGY LTD	9,923	1,723.30	17,100,305.90
ADANI POWER LTD	24,069	694.50	16,715,920.50
GAIL INDIA LTD	73,371	219.76	16,124,010.96
JSW ENERGY LTD	10,450	705.00	7,367,250.00
NHPC LTD	90,500	106.27	9,617,435.00
NTPC LTD	137,935	364.65	50,297,997.75

	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	147,023	332.20	48,841,040.60
	TATA POWER CO LTD	45,750	414.15	18,947,362.50
	TORRENT POWER LTD	5,030	1,526.50	7,678,295.00
	DLF LTD	23,262	816.40	18,991,096.80
	GODREJ PROPERTIES LTD	4,105	3,245.75	13,323,803.75
	MACROTECH DEVELOPERS LTD	9,643	1,448.65	13,969,331.95
	PHOENIX MILLS LTD	3,244	3,961.85	12,852,241.40
	インドルピー 小計	4,883,955		3,861,201,265.43 (7,297,670,391)
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	18,651	14.77	275,475.27
	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	90,755	4.43	402,861.44
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	187,792	1.67	314,363.80
	INDUSTRIES QATAR	47,498	13.10	622,223.80
	COMMERCIAL BANK PQSC	104,492	4.06	424,864.47
	DUKHAN BANK	57,922	3.74	216,802.04
	MASRAF AL RAYAN	196,047	2.32	455,809.27
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	29,447	10.27	302,420.69
	QATAR ISLAMIC BANK	55,218	19.30	1,065,707.40
	QATAR NATIONAL BANK	145,670	14.90	2,170,483.00
	QOOREDOO QPSC	24,164	10.45	252,513.80
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	13,086	15.27	199,823.22
	BARWA REAL ESTATE CO	76,272	2.78	212,112.43
	カタールリアル 小計	1,047,014		6,915,460.63 (299,301,136)
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	7,793	191.45	1,491,969.85
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	2,095	610.96	1,279,961.20
	ANGLOGOLD ASHANTI PLC	13,351	515.33	6,880,170.83
	GOLD FIELDS LTD	28,426	301.79	8,578,682.54
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	17,719	178.69	3,166,208.11
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	28,030	91.22	2,556,896.60
	KUMBA IRON ORE LTD	2,210	410.00	906,100.00
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	10,590	127.56	1,350,860.40
	SASOL LTD	18,714	136.43	2,553,151.02
	SIBANYE STILLWATER LTD	83,639	20.29	1,697,035.31
	BIDVEST GROUP LTD	11,047	269.50	2,977,166.50
	NASPERS LTD-N SHS	5,622	3,436.02	19,317,304.44
	PEPKOR HOLDINGS LTD	79,385	19.67	1,561,502.95
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	27,276	59.02	1,609,829.52
	BID CORP LTD	10,719	436.20	4,675,627.80
	CLICKS GROUP LTD	7,697	335.23	2,580,265.31
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	15,813	288.17	4,556,832.21
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	11,723	232.49	2,725,480.27
	ABSA GROUP LTD	26,797	155.70	4,172,292.90

	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	2,686	2,700.53	7,253,623.58
	NEDBANK GROUP LTD	14,864	256.55	3,813,359.20
	STANDARD BANK GROUP LTD	42,311	209.40	8,859,923.40
	FIRSTRAND LTD	159,474	78.50	12,518,709.00
	REINET INVESTMENTS SCA	4,084	451.42	1,843,599.28
	REMGRO LTD	14,915	133.59	1,992,494.85
	DISCOVERY LTD	16,635	136.80	2,275,668.00
	OLD MUTUAL LTD	141,224	11.98	1,691,863.52
	OUTSURANCE GROUP LTD	28,467	47.49	1,351,897.83
	SANLAM LTD	54,894	79.64	4,371,758.16
	MTN GROUP LTD	54,292	75.22	4,083,844.24
	VODACOM GROUP LTD	19,783	93.07	1,841,203.81
	NEPI ROCKCASTLE N.V.	17,784	130.52	2,321,167.68
	南アフリカランド 小計	980,059		128,856,450.31 (1,113,319,730)
アラブディールハム	MULTIPLY GROUP	132,837	2.37	314,823.69
	AMERICANA RESTAURANTS INTERN	96,797	3.09	299,102.73
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	99,491	3.57	355,182.87
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	90,397	8.39	758,430.83
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	44,112	12.20	538,166.40
	DUBAI ISLAMIC BANK	93,109	5.96	554,929.64
	EMIRATES NBD PJSC	58,262	17.55	1,022,498.10
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	139,486	12.60	1,757,523.60
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	110,047	16.28	1,791,565.16
	ALDAR PROPERTIES PJSC	125,204	6.91	865,159.64
	EMAAR PROPERTIES PJSC	210,694	8.35	1,759,294.90
	アラブディールハム 小計	1,200,436		10,016,677.56 (430,316,467)
クウェートディナール	BOUBYAN BANK K.S.C	46,546	0.57	26,670.85
	GULF BANK	57,778	0.27	15,600.06
	KUWAIT FINANCE HOUSE	323,971	0.72	234,231.03
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	249,701	0.86	216,740.46
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	64,994	0.45	29,312.29
	MABANEE CO KPSC	21,552	0.88	19,095.07
	クウェートディナール 小計	764,542		541,649.76 (279,686,270)
オフショア人民元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	18,900	8.04	151,956.00
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	58,200	6.50	378,300.00
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	13,100	41.97	549,807.00
	CNOOC ENERGY TECHNOLOGY & -A	13,700	3.96	54,252.00
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-A	8,100	14.26	115,506.00
	GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	9,700	5.93	57,521.00
	INNER MONGOLIA DIAN TOU EN-A	5,300	19.56	103,668.00

JIZHONG ENERGY RESOURCES-A	4,900	5.83	28,567.00
OFFSHORE OIL ENGINEERING-A	10,500	5.65	59,325.00
PETROCHINA CO LTD-A	40,400	9.97	402,788.00
PINGDINGSHAN TIANAN COAL -A	5,000	10.33	51,650.00
SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	17,400	25.40	441,960.00
SHAN XI HUA YANG GROUP NEW-A	5,100	7.65	39,015.00
SHANXI COKING COAL ENERGY-A	12,420	8.65	107,433.00
SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	6,500	15.94	103,610.00
YANKUANG ENERGY GROUP CO-A	8,756	15.49	135,630.44
YANTAI JEREH OILFIELD-A	900	32.97	29,673.00
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	23,100	7.26	167,706.00
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	7,800	24.92	194,376.00
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	42,300	7.07	299,061.00
CATHAY BIOTECH INC-A	1,260	41.09	51,773.40
CHIFENG JILONG GOLD MINING-A	3,400	20.28	68,952.00
CHINA JUSHI CO LTD -A	7,414	10.56	78,291.84
CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	5,700	17.42	99,294.00
CHINA RARE EARTH RESOURCES-A	1,900	23.98	45,562.00
CITI PACIFIC SPECIAL STEE-A	7,100	12.79	90,809.00
CMOC GROUP LTD-A	36,400	8.41	306,124.00
CNGR ADVANCED MATERIAL CO -A	840	31.36	26,342.40
GANFENG LITHIUM GROUP CO L-A	2,740	28.92	79,240.80
GEM CO LTD-A	10,800	6.13	66,204.00
GUANGDONG HEC TECHNOLOGY H-A	6,300	6.63	41,769.00
GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	4,180	16.34	68,301.20
HANGZHOU OXYGEN PLANT GROU-A	2,000	19.80	39,600.00
HAOHUA CHEMICAL SCIENCE -A	1,600	26.40	42,240.00
HENAN SHENHUO COAL & POWER-A	3,500	18.60	65,100.00
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	14,520	14.65	212,718.00
HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	1,950	7.34	14,313.00
HESTEEL CO LTD-A	1,500	1.91	2,865.00
HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A	1,400	48.43	67,802.00
HUAFON CHEMICAL CO LTD -A	15,600	7.48	116,688.00
HUAIBEI MINING HOLDINGS CO-A	3,700	14.80	54,760.00
HUNAN VALIN STEEL CO LTD -A	14,600	4.52	65,992.00
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	73,300	1.45	106,285.00
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	15,700	3.67	57,619.00
INNER MONGOLIA YUAN XING-A	5,900	6.74	39,766.00
JCHX MINING MANAGEMENT CO -A	1,300	44.73	58,149.00
JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	13,900	8.25	114,675.00
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	390	55.08	21,481.20
JIANGSU YOKE TECHNOLOGY-A	500	65.72	32,860.00
JIANGXI COPPER CO LTD-A	4,300	22.69	97,567.00

JINDUICHENG MOLYBDENUM CO -A	6,700	10.89	72,963.00
LB GROUP CO LTD-A	4,500	18.13	81,585.00
MEIHUA HOLDINGS GROUP CO -A	5,400	10.42	56,268.00
NANJING IRON & STEEL CO-A	13,000	4.77	62,010.00
NINGBO SHANSHAN CO LTD-A	2,300	7.70	17,710.00
NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	15,400	17.60	271,040.00
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	18,100	2.41	43,621.00
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY-A	10,600	16.25	172,250.00
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	19,550	9.77	191,003.50
SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A	8,090	17.97	145,377.30
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	6,368	30.50	194,224.00
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	3,520	26.91	94,723.20
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	36,900	3.83	141,327.00
SHANDONG SUN PAPER INDUSTR-A	8,800	14.13	124,344.00
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	4,408	13.34	58,802.72
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	3,700	4.62	17,094.00
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	4,800	3.50	16,800.00
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	1,080	31.93	34,484.40
SHENZHEN YUTO PACKAGING TE-A	1,700	24.07	40,919.00
SICHUAN HEBANG BIOTECHNOL- A	14,200	1.67	23,714.00
SINOMA SCIENCE&TECHNOLOGY -A	2,200	11.22	24,684.00
SINOMINE RESOURCE GROUP CO-A	980	26.94	26,401.20
SUNRESIN NEW MATERIALS CO -A	1,200	40.65	48,780.00
TIANQI LITHIUM CORP-A	2,900	29.23	84,767.00
TIANSHAN ALUMINUM GROUP CO-A	7,500	7.54	56,550.00
TONGKUN GROUP CO LTD-A	7,600	14.42	109,592.00
TONGLING NONFERROUS METALS-A	27,300	3.38	92,274.00
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	6,300	82.54	520,002.00
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	640	28.26	18,086.40
WESTERN MINING CO -A	3,300	17.22	56,826.00
WESTERN SUPERCONDUCTING TE-A	560	36.16	20,249.60
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD-A	1,200	16.98	20,376.00
YINTAI GOLD CO LTD-A	5,580	18.14	101,221.20
YONGXING SPECIAL MATERIALS-A	910	34.48	31,376.80
YUNNAN ALUMINIUM CO LTD-A	7,300	12.85	93,805.00
YUNNAN CHIHONG ZINC & GERM-A	11,000	5.58	61,380.00
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	1,400	30.40	42,560.00
YUNNAN TIN CO LTD-A	3,500	14.94	52,290.00
YUNNAN YUNTIANHUA CO-A	4,400	20.43	89,892.00
ZANGGE MINING CO LTD-A	3,300	23.73	78,309.00
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	2,708	23.55	63,773.40
ZHEJIANG JUHUA CO-A	5,700	19.60	111,720.00
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	6,700	8.69	58,223.00

ZHEJIANG NHU CO LTD-A	5,463	21.08	115,160.04
ZHONGJIN GOLD CORP-A	10,000	17.24	172,400.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	40,400	17.94	724,776.00
AECC AERO-ENGINE CONTROL-A	1,000	20.64	20,640.00
AECC AVIATION POWER CO-A	6,300	39.97	251,811.00
AVICOPTER PLC-A	500	40.57	20,285.00
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	3,700	28.03	103,711.00
CHINA BAOAN GROUP-A	4,500	8.19	36,855.00
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	8,600	43.10	370,660.00
CHINA ENERGY ENGINEERING COR	52,300	2.15	112,445.00
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	9,700	7.62	73,914.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	38,300	6.34	242,822.00
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	84,800	5.45	462,160.00
CHINA XD ELECTRIC CO LTD-A	11,300	6.79	76,727.00
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	8,260	189.44	1,564,774.40
COSCO SHIPPING DEVELOPMENT CO	18,400	2.44	44,896.00
CRRC CORP LTD-A	46,800	7.96	372,528.00
CSSC SCIENCE & TECHNOLOGY -A	3,300	12.70	41,910.00
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	4,400	16.75	73,700.00
EVE ENERGY CO LTD-A	4,020	40.00	160,800.00
FAW JIEFANG GROUP CO LTD-A	3,200	8.07	25,824.00
GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A	600	65.07	39,042.00
GOLDWIND SCIENCE &TECHNOL-A	3,400	6.97	23,698.00
GONEO GROUP CO LTD	1,160	74.17	86,037.20
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	3,900	19.19	74,841.00
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	2,436	46.36	112,932.96
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	5,300	14.26	75,578.00
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A	2,200	17.27	37,994.00
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	39,700	3.07	121,879.00
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	14,782	24.80	366,593.60
NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO -A	756	95.96	72,545.76
NINGBO ORIENT WIRES & CABL-A	1,000	46.18	46,180.00
NINGBO SANXING MEDICAL CO -A	3,100	29.79	92,349.00
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	33,900	5.37	182,043.00
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	15,900	16.40	260,760.00
SHANDONG HIMILE MECHANICAL-A	1,800	37.52	67,536.00
SHANGHAI CONSTRUCTION GROU-A	5,600	2.18	12,208.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	24,000	3.64	87,360.00
SHANXI COAL INTERNATIONAL -A	4,500	13.32	59,940.00
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	2,400	51.13	122,712.00
SICHUAN ROAD&BRIDGE GROUP-A	13,860	7.06	97,851.60
SIEYUAN ELECTRIC CO LTD-A	1,500	62.46	93,690.00
SINOMA INTERNATIONAL ENGIN-A	5,500	10.15	55,825.00

SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	3,920	72.30	283,416.00
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	1,300	18.01	23,413.00
TBEA CO LTD-A	10,920	13.56	148,075.20
TIAN DI SCIENCE & TECHNOLO-A	9,000	6.00	54,000.00
WEICHAJ POWER CO LTD-A	13,200	13.90	183,480.00
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	20,700	6.55	135,585.00
XIAMEN C & D INC-A	4,400	8.33	36,652.00
YUTONG BUS CO LTD-A	4,900	22.92	112,308.00
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	4,100	19.17	78,597.00
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	420	53.38	22,419.60
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	3,800	19.20	72,960.00
ZHEJIANG WEIXING NEW BUILD-A	1,300	15.05	19,565.00
ZHUZHOU CRRCTIMES ELECTRI-A	800	55.05	44,040.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	15,500	7.30	113,150.00
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	1,800	31.50	56,700.00
ZHEJIANG WEIMING ENVIRONME-A	2,340	19.21	44,951.40
AIR CHINA LTD-A	23,900	7.38	176,382.00
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	98,300	5.72	562,276.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	33,300	4.03	134,199.00
CHINA MERCHANTS EXPRESSWAY-A	10,700	12.16	130,112.00
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	17,600	5.95	104,720.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	23,670	13.19	312,207.30
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	34,900	6.96	242,904.00
GUANGZHOU BAIYUN INTERNATI-A	5,000	9.65	48,250.00
HAINAN AIRLINES HOLDING CO-A	81,700	1.08	88,236.00
JUNEYAO AIRLINES CO LTD-A	3,500	11.53	40,355.00
LIAONING PORT CO LTD-A	21,900	1.26	27,594.00
S F HOLDING CO LTD-A	8,600	36.28	312,008.00
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	2,100	35.62	74,802.00
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	8,900	6.10	54,290.00
SPRING AIRLINES CO LTD-A	1,900	55.65	105,735.00
YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	7,400	14.55	107,670.00
YUNDA HOLDING CO LTD-A	4,870	7.15	34,820.50
AIMA TECHNOLOGY GROUP CO L-A	1,700	26.62	45,254.00
ANHUI JIANGHUAI AUTO GROUP-A	4,300	19.59	84,237.00
BAIC BLUEPARK NEW ENERGY -A	10,900	9.21	100,389.00
BETHEL AUTOMOTIVE SAFETY S-A	1,260	44.57	56,158.20
BYD CO LTD -A	3,500	264.06	924,210.00
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	700	128.00	89,600.00
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	17,126	15.39	263,569.14
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	3,400	48.60	165,240.00
GREAT WALL MOTOR CO LTD-A	6,400	26.33	168,512.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A	6,900	7.96	54,924.00

HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	7,100	15.63	110,973.00
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	1,000	99.79	99,790.00
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	1,200	15.54	18,648.00
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	2,755	39.23	108,078.65
SAIC MOTOR CORP LTD-A	14,310	14.87	212,789.70
SAILUN GROUP CO LTD-A	6,100	13.39	81,679.00
SERES GROUP CO L-A	3,100	75.30	233,430.00
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	1,300	17.21	22,373.00
SHENZHEN KEDALI INDUSTRY C-A	400	80.78	32,312.00
ZHEJIANG WANFENG AUTO -A	4,500	11.68	52,560.00
BEIJING ROBOROCK TECHNOLOG-A	280	332.63	93,136.40
ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A	600	40.71	24,426.00
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	6,000	39.25	235,500.00
HAIER SMART HOME CO LTD-A	11,600	27.02	313,432.00
HANG ZHOU GREAT STAR INDUS-A	2,700	25.40	68,580.00
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	1,000	21.08	21,080.00
HISENSE HOME APPLIANCES G-A	1,800	27.10	48,780.00
HISENSE VISUAL TECH CO LTD-A	2,900	21.02	60,958.00
JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	1,040	25.19	26,197.60
MIDEA GROUP CO LTD-A	6,700	63.60	426,120.00
OPPEIN HOME GROUP INC-A	1,040	47.65	49,556.00
SICHUAN CHANGHONG ELECTRIC-A	10,300	4.34	44,702.00
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	1,700	48.59	82,603.00
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	1,700	23.72	40,324.00
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	5,080	7.94	40,335.20
37 INTERACTIVE ENTERTAINME-A	3,900	12.99	50,661.00
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	1,300	7.72	10,036.00
CHINA FILM CO LTD-A	4,000	10.58	42,320.00
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	32,600	6.11	199,186.00
JIANGSU PHOENIX PUBLISH-A	5,500	10.20	56,100.00
KINGNET NETWORK CO LTD-A	4,600	8.96	41,216.00
KUNLUN TECH CO LTD-A	2,500	30.75	76,875.00
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	3,110	20.14	62,635.40
ORIENTAL PEARL GROUP CO LT-A	7,300	6.00	43,800.00
PEOPLE.CN CO LTD-A	2,000	20.13	40,260.00
WANDA FILM HOLDING CO LTD-A	4,500	11.49	51,705.00
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	17,100	3.19	54,549.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	3,400	69.83	237,422.00
HLA GROUP CORP L-A	9,300	7.14	66,402.00
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	5,000	5.36	26,800.00
WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A	6,000	4.23	25,380.00
ZHEJIANG CHINA COMMODITIES-A	13,000	7.76	100,880.00
DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	1,036	12.85	13,312.60

YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	2,596	23.37	60,668.52
ANGEL YEAST CO LTD-A	700	29.46	20,622.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	800	212.18	169,744.00
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	500	38.31	19,155.00
ANHUI YINGJIA DISTILLERY C-A	1,600	60.12	96,192.00
ANJOY FOODS GROUP CO LTD	400	80.90	32,360.00
BEIJING YANJING BREWERY CO-A	3,900	9.75	38,025.00
CHONGQING BREWERY CO-A	800	62.15	49,720.00
EASTROC BEVERAGE GROUP CO -A	800	239.40	191,520.00
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	8,170	36.27	296,325.90
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	2,800	45.82	128,296.00
HEBEI YANGYUAN ZHIHUI BEVERA	2,600	21.59	56,134.00
HEILONGJIANG AGRICULTURE-A	2,500	13.07	32,675.00
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	7,400	24.19	179,006.00
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	11,500	26.40	303,600.00
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	2,000	51.03	102,060.00
JIANGSU YANGHE DISTILLERY-A	2,700	83.56	225,612.00
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	300	19.79	5,937.00
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	2,400	1,525.62	3,661,488.00
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	2,800	146.98	411,544.00
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	11,016	45.88	505,414.08
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	7,600	9.62	73,112.00
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	2,320	204.01	473,303.20
SHEDE SPIRITS CO LTD-A	700	56.18	39,326.00
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	400	37.54	15,016.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-A	1,500	70.46	105,690.00
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	12,460	20.70	257,922.00
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	7,600	133.42	1,013,992.00
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	2,200	27.71	60,962.00
BY-HEALTH CO LTD-A	1,300	13.61	17,693.00
YUNNAN BOTANEE BIO-TECHNOL-A	400	47.80	19,120.00
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	17,368	10.80	187,574.40
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD-A	1,000	43.67	43,670.00
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	3,300	30.80	101,640.00
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	700	29.31	20,517.00
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	2,940	29.48	86,671.20
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A	3,000	38.14	114,420.00
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	10,763	4.64	49,940.32
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	1,900	13.41	25,479.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	4,400	20.18	88,792.00
SHANGHAI UNITED IMAGING HE-A	1,800	113.00	203,400.00
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	2,300	285.25	656,075.00
SHENZHEN NEW INDUSTRIES BI-A	1,500	67.71	101,565.00

ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	680	67.45	45,866.00
BEIJING TIANTAN BIOLOGICAL-A	3,960	25.78	102,088.80
BEIJING TONGRENTANG CO-A	2,300	39.33	90,459.00
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	1,715	74.22	127,287.30
BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY COR-A	800	60.50	48,400.00
CHANGCHUN HIGH-TECH INDUST-A	700	94.89	66,423.00
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	1,950	43.99	85,780.50
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	4,050	28.33	114,736.50
CSPC INNOVATION PHARMACEUT-A	3,480	27.19	94,621.20
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	1,200	53.32	63,984.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	300	52.05	15,615.00
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	4,680	16.98	79,466.40
HUBEI JUMPCAN PHARMACEUT-A	1,300	32.79	42,627.00
HUMANWELL HEALTHCARE GROUP-A	3,800	18.34	69,692.00
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	560	171.21	95,877.60
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	11,616	42.23	490,543.68
JIANGSU NHWA PHARMACEUTICA-A	2,200	23.35	51,370.00
JOINCARE PHARMACEUTICAL GR-A	1,600	10.58	16,928.00
LIVZON PHARMACEUTICAL GROU-A	500	36.11	18,055.00
MGI TECH CO LTD-A	906	44.92	40,697.52
PHARMARON BEIJING CO LTD-A	3,675	20.01	73,536.75
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	3,600	23.38	84,168.00
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	10,500	7.93	83,265.00
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	960	15.62	14,995.20
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	1,700	28.90	49,130.00
SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A	2,600	15.67	40,742.00
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	2,400	32.03	76,872.00
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	3,000	11.70	35,100.00
WUXI APPTec CO LTD-A	4,728	39.60	187,228.80
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	4,160	53.38	222,060.80
ZHANGZHOU PIENZEHUANG PHA-A	1,100	231.06	254,166.00
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	1,210	17.38	21,029.80
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	165,500	4.71	779,505.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	40,600	5.63	228,578.00
BANK OF CHANGSHA CO LTD-A	7,500	7.69	57,675.00
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	5,400	14.93	80,622.00
BANK OF CHINA LTD-A	64,800	4.67	302,616.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	77,900	7.46	581,134.00
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	13,000	12.96	168,480.00
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	33,900	7.85	266,115.00
BANK OF NANJING CO LTD -A	20,000	10.15	203,000.00
BANK OF NINGBO CO LTD -A	11,700	22.32	261,144.00
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	24,610	7.49	184,328.90

BANK OF SUZHOU CO LTD-A	5,100	7.19	36,669.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	20,400	7.55	154,020.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	78,400	3.37	264,208.00
CHINA MERCHANTS BANK-A	39,600	34.25	1,356,300.00
CHINA MINSHENG BANKING-A	67,800	3.79	256,962.00
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	42,270	2.87	121,314.90
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-A	26,300	5.20	136,760.00
CNPC CAPITAL CO LTD-A	10,900	5.40	58,860.00
HUAXIA BANK CO LTD-A	24,300	6.51	158,193.00
IND & COMM BK OF CHINA-A	122,400	5.91	723,384.00
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	37,400	17.13	640,662.00
PING AN BANK CO LTD-A	34,400	10.37	356,728.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	53,700	4.98	267,426.00
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	52,600	8.73	459,198.00
SHANGHAI RURAL COMMERCIAL -A	18,900	6.82	128,898.00
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A	13,900	2.23	30,997.00
BOC INTERNATIONAL CHINA CO-A	3,000	8.91	26,730.00
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	8,800	6.61	58,168.00
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	6,800	4.92	33,456.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-A	12,100	10.14	122,694.00
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	12,900	6.70	86,430.00
CHINA INTERNATIONAL CAPTAL-A	4,300	28.82	123,926.00
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	17,100	14.70	251,370.00
CITIC SECURITIES CO-A	24,800	19.39	480,872.00
CSC FINANCIAL CO LTD-A	7,500	19.65	147,375.00
DONGXING SECURITIES CO LT-A	6,200	8.11	50,282.00
EAST MONEY INFORMATION CO-A	27,812	10.70	297,588.40
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	6,600	14.74	97,284.00
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	9,400	5.00	47,000.00
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	17,000	7.63	129,710.00
GF SECURITIES CO LTD-A	9,500	12.21	115,995.00
GUANGZHOU YUEXIU CAPITAL H-A	4,374	5.02	21,957.48
GUOLIAN SECURITIES CO LTD-A	2,200	9.89	21,758.00
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	11,300	8.27	93,451.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	14,700	14.05	206,535.00
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	9,500	6.24	59,280.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	18,700	8.75	163,625.00
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	1,000	99.36	99,360.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	13,100	12.88	168,728.00
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	16,300	5.20	84,760.00
NANJING SECURITIES CO LTD	7,600	7.58	57,608.00
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	15,100	7.91	119,441.00
SDIC CAPITAL CO LTD-A	11,000	5.77	63,470.00

SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	45,600	4.38	199,728.00
SINOLINK SECURITIES CO LTD-A	7,700	7.48	57,596.00
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	9,700	6.00	58,200.00
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	3,800	3.67	13,946.00
TIANFENG SECURITIES CO LTD-A	19,400	2.20	42,680.00
WESTERN SECURITIES CO LTD-A	10,000	6.20	62,000.00
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	6,000	10.89	65,340.00
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD-A	10,500	5.68	59,640.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	4,500	32.03	144,135.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	12,800	29.70	380,160.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	3,800	31.35	119,130.00
PICC HOLDING CO-A	15,500	5.43	84,165.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	21,100	43.03	907,933.00
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	11,700	7.35	85,995.00
BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	1,200	203.48	244,176.00
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	1,170	30.90	36,153.00
EMPYREAN TECHNOLOGY CO LTD-A	700	77.32	54,124.00
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	3,073	17.49	53,746.77
IFLYTEK CO LTD - A	4,300	39.30	168,990.00
ISOFTSTONE INFORMATION TEC-A	1,900	34.12	64,828.00
RANGE INTELLIGENT COMPUTI-A	3,200	23.03	73,696.00
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	900	49.75	44,775.00
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	3,594	31.88	114,576.72
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	900	46.22	41,598.00
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	5,908	9.36	55,298.88
ACCELINK TECHNOLOGIES CO -A	1,900	34.59	65,721.00
ANKER INNOVATIONS TECHNOLO-A	1,040	55.70	57,928.00
AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A	4,500	37.05	166,725.00
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	69,600	4.07	283,272.00
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	4,500	33.95	152,775.00
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	6,700	8.57	57,419.00
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-A	11,000	6.26	68,860.00
CHINA ZHENHUA GROUP SCIENC-A	1,200	40.35	48,420.00
EOPTOLINK TECHNOLOGY INC L-A	1,400	105.36	147,504.00
EVERDISPLAY OPTRONICS SHAN-A	23,718	2.00	47,436.00
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	24,800	24.66	611,568.00
GOERTEK INC -A	6,100	23.05	140,605.00
GRG BANKING EQUIPMENT CO -A	2,200	9.97	21,934.00
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	22,300	6.78	151,194.00
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICAT-A	7,600	9.23	70,148.00
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	1,500	30.31	45,465.00
HENGDIAN GROUP DMEGC -A	2,700	11.95	32,265.00
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO-A	3,700	15.05	55,685.00

HUAGONG TECH CO LTD-A	2,700	29.14	78,678.00
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	2,400	38.23	91,752.00
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	9,600	18.68	179,328.00
LUXSHARE PRECISIONIndustr-A	14,233	40.15	571,454.95
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	1,076	79.87	85,940.12
NINESTAR CORP-A	1,800	28.64	51,552.00
OFILM GROUP CO LTD-A	7,700	8.17	62,909.00
SHANGHAI BOCHU ELECTRONIC-A	392	155.73	61,046.16
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	4,500	22.25	100,125.00
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	780	120.60	94,068.00
SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	2,511	82.58	207,358.38
SUPCON TECHNOLOGY CO LTD-A	870	37.38	32,520.60
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	3,300	24.74	81,642.00
SUZHOU TFC OPTICAL COMMUNI-A	1,120	91.21	102,155.20
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	31,790	3.98	126,524.20
UNISPLENDOR CORP LTD-A	4,876	24.60	119,949.60
UNIVERSAL SCIENTIFIC INDUS-A	3,800	15.77	59,926.00
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	2,700	30.61	82,647.00
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	3,464	6.06	20,991.84
WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHA-A	3,860	35.30	136,258.00
XIAMEN FARATRONIC CO LTD-A	400	86.38	34,552.00
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	2,240	37.90	84,896.00
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	6,300	15.12	95,256.00
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	2,380	134.98	321,252.40
ZTE CORP-A	8,500	28.11	238,935.00
CHINA UNITED NETWORK-A	59,700	4.80	286,560.00
CGN POWER CO LTD-A	40,600	5.00	203,000.00
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	38,100	11.70	445,770.00
CHINA THREE GORGES RENEWAB-A	53,300	4.68	249,444.00
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	47,200	30.58	1,443,376.00
DATANG INTL POWER GEN CO-A	20,000	3.00	60,000.00
ENN NATURAL GAS CO LTD-A	4,800	20.43	98,064.00
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	40,500	5.80	234,900.00
HUADIAN POWER INTL CORP-A	12,500	6.08	76,000.00
HUANENG POWER INTL INC-A	18,200	8.75	159,250.00
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	13,800	18.50	255,300.00
SHANGHAI ELECTRIC POWER CO-A	7,100	9.69	68,799.00
SHENERGY COMPANY LIMITED	9,900	8.29	82,071.00
SHENZHEN ENERGY GROUP CO L-A	11,600	6.80	78,880.00
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A	9,000	19.60	176,400.00
WINTIME ENERGY GROUP CO LTD	47,800	1.15	54,970.00
ZHEJIANG ZHENENG ELECTRIC-A	21,300	7.05	150,165.00
ACM RESEARCH SHANGHAI I-A	630	93.01	58,596.30

ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	1,143	153.85	175,850.55
AMLOGIC SHANGHAI INC-A	600	67.44	40,464.00
CAMBRICON TECHNOLOGIES-A	800	268.40	214,720.00
CHINA RESOURCES MICROELECT-A	2,200	39.41	86,702.00
FLAT GLASS GROUP CO LTD-A	2,300	18.75	43,125.00
GALAXYCORE INC-A	3,767	12.45	46,899.15
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR I-A	1,356	96.00	130,176.00
HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	7,912	14.55	115,119.60
HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	2,000	20.13	40,260.00
HWATSING TECHNOLOGY CO LTD-A	512	144.00	73,728.00
HYGON INFORMATION TECHNOLO-A	4,600	78.22	359,812.00
INGENIC SEMICONDUCTOR CO -A	1,200	60.11	72,132.00
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	6,612	10.51	69,492.12
JCET GROUP CO LTD-A	3,800	35.11	133,418.00
JIANGSU PACIFIC QUARTZ CO -A	1,050	27.14	28,497.00
JINKO SOLAR CO LTD-A	13,400	7.53	100,902.00
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	12,936	14.39	186,149.04
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A	2,264	63.01	142,654.64
NATIONAL SILICON INDUSTRY -A	5,600	15.11	84,616.00
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	900	355.00	319,500.00
PIOTECH INC-A	438	133.26	58,367.88
ROCKCHIP ELECTRONICS CO L-A	900	68.00	61,200.00
SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	9,900	11.96	118,404.00
SG MICRO CORP-A	1,007	82.82	83,399.74
SHANGHAI AIKO SOLAR ENERGY-A	3,220	8.94	28,786.80
SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY-A	1,000	68.11	68,110.00
STARPOWER SEMICONDUCTOR LT-A	280	92.36	25,860.80
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	409	112.40	45,971.60
TCL ZHONGHUAN RENEWABLE EN-A	8,075	8.68	70,091.00
TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	1,900	8.84	16,796.00
TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	3,200	23.70	75,840.00
TONGWEI CO LTD-A	8,700	18.31	159,297.00
TRINA SOLAR CO LTD-A	3,200	17.13	54,816.00
UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	1,819	54.09	98,389.71
WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	2,185	111.10	242,753.50
XINJIANG DAQO NEW ENERGY C-A	3,600	18.80	67,680.00
ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	3,900	30.47	118,833.00
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	19,800	9.51	188,298.00
HAINAN AIRPORT INFRASTRUCT-A	21,800	3.38	73,684.00
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	26,600	9.19	244,454.00
SHANGHAI LINGANG HOLDINGS-A	7,280	9.57	69,669.60
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A	3,900	19.56	76,284.00
YOUNGOR FASHION CO LTD	14,000	7.14	99,960.00

	オフショア人民元 小計	5,059,197		68,481,995.45 (1,480,005,492)
サウジアラビア リアル	ADES HOLDING CO	10,805	20.66	223,231.30
	SAUDI ARABIAN OIL CO	114,609	28.50	3,266,356.50
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	3,568	40.70	145,217.60
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	7,303	117.40	857,372.20
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	11,987	29.10	348,821.70
	SAUDI ARABIAN MINING CO	40,896	44.35	1,813,737.60
	SAUDI ARAMCO BASE OIL CO	1,626	135.40	220,160.40
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	28,460	79.10	2,251,186.00
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	10,923	21.04	229,819.92
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	21,550	8.61	185,545.50
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	8,796	39.90	350,960.40
	SAL SAUDI LOGISTICS SERVICES	823	320.40	263,689.20
	SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	1,076	264.60	284,709.60
	JARIR MARKETING CO	19,801	13.08	258,997.08
	NAHDI MEDICAL CO	1,177	132.60	156,070.20
	ALMARAI CO	7,936	60.20	477,747.20
	SAVOLA	7,913	48.85	386,550.05
	DALLAH HEALTHCARE CO	1,090	159.00	173,310.00
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	2,772	284.00	787,248.00
	MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	3,089	119.80	370,062.20
	AL RAJHI BANK	61,780	84.60	5,226,588.00
	ALINMA BANK	37,481	32.70	1,225,628.70
	ARAB NATIONAL BANK	28,242	21.46	606,073.32
	BANK AL-JAZIRA	16,766	16.66	279,321.56
	BANK ALBILAD	19,200	34.60	664,320.00
	BANQUE SAUDI FRANSI	18,465	37.75	697,053.75
	RIYAD BANK	44,963	27.95	1,256,715.85
	SAUDI AWWAL BANK	31,852	39.00	1,242,228.00
	SAUDI INVESTMENT BANK/THE	20,518	12.74	261,399.32
	THE SAUDI NATIONAL BANK	92,723	38.30	3,551,290.90
	SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING	1,595	247.40	394,603.00
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	2,528	237.40	600,147.20
	CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	2,200	149.60	329,120.00
ARABIAN INTERNET & COMMUNICA	788	279.20	220,009.60	
ELM CO	746	905.00	675,130.00	
ETIHAD ETISALAT CO	11,843	53.70	635,969.10	
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	13,459	11.20	150,740.80	
SAUDI TELECOM CO	63,223	38.60	2,440,407.80	
ACWA POWER CO	4,639	393.80	1,826,838.20	
POWER & WATER UTILITY CO FOR	2,042	63.00	128,646.00	
SAUDI ELECTRICITY CO	26,234	16.96	444,928.64	

	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	18,952	12.78	242,206.56	
	サウジアラビアリアル 小計	826,439		36,150,158.95 (1,520,837,187)	
	合計	116,008,436		37,511,345,601 (37,511,345,601)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	89,800	2,193,814.00	
		OPERADORA DE SITES MEX- A-1	42,600	701,196.00	
		PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA	21,279	1,293,975.99	
		メキシコペソ 小計	153,679	4,188,985.99 (36,656,559)	
	合計			36,656,559 (36,656,559)	

(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 33銘柄	100.0%		2.5%
メキシコペソ	株式 21銘柄	95.6%		2.1%
	投資証券 3銘柄		4.4%	0.1%
ブラジルリアル	株式 49銘柄	100.0%		4.3%
チリペソ	株式 12銘柄	100.0%		0.4%
コロンビアペソ	株式 3銘柄	100.0%		0.1%
ユーロ	株式 10銘柄	100.0%		0.5%
トルコリラ	株式 17銘柄	100.0%		0.8%
チェココルナ	株式 3銘柄	100.0%		0.1%
ハンガリーフォリント	株式 3銘柄	100.0%		0.2%
ポーランドズロチ	株式 13銘柄	100.0%		0.9%
ロシアルーブル	株式 14銘柄			
香港ドル	株式 153銘柄	100.0%		18.6%
マレーシアリンギット	株式 32銘柄	100.0%		1.4%
タイバーツ	株式 31銘柄	100.0%		1.4%
フィリピンペソ	株式 13銘柄	100.0%		0.6%
インドネシアルピア	株式 21銘柄	100.0%		1.7%
韓国ウォン	株式 98銘柄	100.0%		12.1%
新台湾ドル	株式 88銘柄	100.0%		19.1%
インドルピー	株式 146銘柄	100.0%		19.5%
カタールリアル	株式 13銘柄	100.0%		0.8%
南アフリカランド	株式 32銘柄	100.0%		3.0%
アラブディルハム	株式 11銘柄	100.0%		1.1%
クウェートディナール	株式 6銘柄	100.0%		0.7%

オフショア人民元	株式	480銘柄	100.0%		3.9%
サウジアラビアリアル	株式	42銘柄	100.0%		4.1%

(注) 時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

R M国内リートマザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2024年 7月22日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	422,698,061
投資証券	64,312,671,000
派生商品評価勘定	4,987,420
未収配当金	470,690,001
未収利息	115
差入委託証拠金	42,212,908
流動資産合計	65,253,259,505
資産合計	65,253,259,505
負債の部	
流動負債	
前受金	9,516,700
未払解約金	77,924,000
流動負債合計	87,440,700
負債合計	87,440,700
純資産の部	
元本等	
元本	46,763,525,370
剰余金	
剰余金又は欠損金()	18,402,293,435
元本等合計	65,165,818,805
純資産合計	65,165,818,805
負債純資産合計	65,253,259,505

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 7月22日現在

1. 投資信託財産に係る元本の状況 期首	2023年 7月21日
-------------------------	-------------

期首元本額	31,278,827,263円
期中追加設定元本額	29,945,727,434円
期中一部解約元本額	14,461,029,327円
期末元本額	46,763,525,370円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	1,039,293,527円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	1,795,477,804円
りそなラップ型ファンド(成長型)	2,439,148,908円
DCりそな グローバルバランス	34,383,291円
つみたてバランスファンド	3,938,629,625円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	315,625,925円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	289,421,751円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	215,186,988円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	111,301,079円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	80,899,515円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	47,742,584円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	123,440,371円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	120,607,358円
九州SDGs・グローバルバランス	53,237,683円
りそな国内リートインデックス(ラップ専用)	4,425,171,335円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定型)	13,341,716円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定成長型)	199,086,171円
ラップ型ファンド・プラスESG(成長型)	283,062,669円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定型)	71,107,525円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定成長型)	75,786,088円
りそな つみたてラップ型ファンド(成長型)	87,145,079円
りそな つみたてリスクコントロールファンド	12,864,722円
ターゲットリターンバランスファンド(目標2%)	1,643,380円
ターゲットリターンバランスファンド(目標3%)	1,248,014円
ターゲットリターンバランスファンド(目標4%)	5,985,226円
ターゲットリターンバランスファンド(目標5%)	2,804,790円
ターゲットリターンバランスファンド(目標6%)	7,451,178円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2065	1,187,625円
りそなJリートインデックス(年1回決算型)	92,240,533円
りそなJリートインデックス(年4回決算型)	118,832,575円
FWりそな国内リートインデックスオープン	9,401,342,306円
FWりそな国内リートインデックスファンド	9,601,142,522円
Smart-i Jリートインデックス	3,636,311,426円
Smart-i 8資産バランス 安定型	91,046,498円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	341,862,925円
Smart-i 8資産バランス 成長型	525,047,294円
J-REITインデックスファンド(適格機関投資家専用)	5,346,977,744円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	178,844,449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)	2,914,619円
りそなVIグローバル・バランスファンド(安定成長型)(適格機関投資家専用)	10,275,928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)	31,244,566円
りそなマルチアセットファンド(適格機関投資家専用)	18,001,490円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	47,751,015円
りそなマルチアセットファンド(適格機関投資家専用)	253,651,586円
J-REITインデックスファンド202102(適格機関投資家専用)	130,958,734円
りそなDAAファンド202205(適格機関投資家専用)	371,840,801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)	502,595,243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)	199,641,900円
りそなマルチアセットファンド202403(適格機関投資家専用)	68,719,289円
2. 計算日における受益権の総数	46,763,525,370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	1.3935円
(10,000口当たり純資産額)	(13,935円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2024年 7月22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

2024年 7月22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)

2024年 7月22日現在	
該当事項はありません。	

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2024年 7月22日現在	
	損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券		2,423,476,778
合計		2,423,476,778

(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)

(2024年 7月22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	761,316,580	-	766,304,000	4,987,420
	合計	761,316,580	-	766,304,000	4,987,420

(注) 時価の算定方法

先物取引

国内先物取引について

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	1,321	160,501,500	
	サンケイリアルエステート投資法人	2,082	175,512,600	
	S O S i L A 物流リート投資法人	3,243	371,972,100	
	東海道リート投資法人	1,110	136,530,000	
	日本アコモデーションファンド投資法人	2,244	1,420,452,000	
	森ヒルズリート投資法人	7,643	998,940,100	
	産業ファンド投資法人	11,838	1,495,139,400	
	アドバンス・レジデンス投資法人	6,377	2,011,943,500	
	アクティブ・プロパティーズ投資法人	3,345	1,199,182,500	
	G L P 投資法人	21,832	2,934,220,800	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	3,196	989,162,000	
	日本プロロジスリート投資法人	11,322	2,858,805,000	
	星野リゾート・リート投資法人	1,366	717,150,000	
	O n e リート投資法人	1,134	293,932,800	
	イオンリート投資法人	7,973	1,056,422,500	
	ヒューリックリート投資法人	6,081	873,231,600	
	日本リート投資法人	2,111	691,352,500	
	積水ハウス・リート投資法人	19,531	1,570,292,400	
	トーセイ・リート投資法人	1,369	190,838,600	
	ヘルスケア&メディカル投資法人	1,602	202,973,400	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	1,771	184,715,300	
	野村不動産マスターファンド投資法人	21,018	3,072,831,600	
	いちごホテルリート投資法人	1,077	118,577,700	
	ラサールロジポート投資法人	8,308	1,223,768,400	
	スターアジア不動産投資法人	10,017	584,992,800	
	マリモ地方創生リート投資法人	1,002	125,049,600	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	2,703	1,158,235,500	
	日本ホテル&レジデンシャル投資法人	994	73,754,800	
	投資法人みらい	8,920	395,156,000	
	三菱地所物流リート投資法人	2,244	851,598,000	
	C R E ロジスティクスファンド投資法人	2,798	396,756,400	
	ザイマックス・リート投資法人	1,054	124,372,000	
タカラレーベン不動産投資法人	3,462	342,045,600		
アドバンス・ロジスティクス投資法人	2,848	339,196,800		
日本ビルファンド投資法人	7,582	4,382,396,000		
ジャパンリアルエステイト投資法人	6,676	3,478,196,000		

日本都市ファンド投資法人	31,154	2,794,513,800	
オリックス不動産投資法人	12,950	2,044,805,000	
日本プライムリアルティ投資法人	4,445	1,440,180,000	
N T T都市開発リート投資法人	6,590	757,191,000	
東急リアル・エステート投資法人	4,358	672,875,200	
グローバル・ワン不動産投資法人	4,799	482,299,500	
ユナイテッド・アーバン投資法人	14,539	2,074,715,300	
森トラストリート投資法人	12,528	875,707,200	
インヴィンシブル投資法人	31,469	2,064,366,400	
フロンティア不動産投資法人	2,412	1,043,190,000	
平和不動産リート投資法人	5,037	659,847,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	4,149	1,079,569,800	
福岡リート投資法人	3,361	527,004,800	
K D X不動産投資法人	18,417	2,850,951,600	
いちごオフィスリート投資法人	5,326	437,797,200	
大和証券オフィス投資法人	2,693	789,856,900	
阪急阪神リート投資法人	3,099	407,518,500	
スタートプロシード投資法人	1,127	217,060,200	
大和ハウスリート投資法人	9,797	2,390,468,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	23,877	1,869,569,100	
大和証券リビング投資法人	9,571	961,885,500	
ジャパンエクセレント投資法人	5,649	671,101,200	
合計	416,541	64,312,671,000	

(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）

2024年 7月22日現在

資産の部	
流動資産	
預金	261,777,090
コール・ローン	101,130,345
株式	658,842,471
投資証券	78,664,415,688
派生商品評価勘定	802
未収配当金	151,762,474
未収利息	27
流動資産合計	79,837,928,897
資産合計	79,837,928,897
負債の部	
流動負債	

2024年 7月22日現在

未払解約金	103,700,000
流動負債合計	103,700,000
負債合計	103,700,000
純資産の部	
元本等	
元本	42,726,125,915
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	37,008,102,982
元本等合計	79,734,228,897
純資産合計	79,734,228,897
負債純資産合計	79,837,928,897

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)

2024年 7月22日現在

1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 7月21日
期首元本額	39,434,592,049円
期中追加設定元本額	18,369,384,331円
期中一部解約元本額	15,077,850,465円
期末元本額	42,726,125,915円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	777,297,873円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	1,375,669,026円
りそなラップ型ファンド(成長型)	2,706,336,706円
DCりそな グローバルバランス	25,895,019円
つみたてバランスファンド	1,487,931,640円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	548,059,349円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	464,186,442円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	338,690,437円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	173,444,985円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	123,088,822円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	73,348,080円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	187,810,905円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	216,133,951円
九州SDGs・グローバルバランス	93,349,762円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定型)	10,074,735円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定成長型)	196,622,292円
ラップ型ファンド・プラスESG(成長型)	276,962,805円

りそな つみたてラップ型ファンド(安定型)	53,600,125円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定成長型)	63,201,817円
りそな つみたてラップ型ファンド(成長型)	96,814,898円
りそな つみたてリスクコントロールファンド	3,710,740円
ターゲットリターンバランスファンド(目標2%)	2,509,870円
ターゲットリターンバランスファンド(目標3%)	1,877,911円
ターゲットリターンバランスファンド(目標4%)	9,096,264円
ターゲットリターンバランスファンド(目標5%)	4,255,450円
ターゲットリターンバランスファンド(目標6%)	11,326,552円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2065	1,805,201円
FWりそな先進国リートインデックスオープン	14,176,962,435円
FWりそな先進国リートインデックスファンド	13,679,711,171円
Smart-i 先進国リートインデックス	3,306,209,509円
Smart-i 8資産バランス 安定型	148,836,353円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	533,732,936円
Smart-i 8資産バランス 成長型	806,039,083円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	130,535,926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)	2,196,248円
りそなVIGlobal・バランスファンド(安定成長型)(適格機関投資家専用)	4,653,837円
りそなVIGlobal・バランスファンド(成長型)(適格機関投資家専用)	83,688,474円
りそなマルチアセットファンド(適格機関投資家専用)	13,535,928円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	76,144,846円
りそなDAAファンド202205(適格機関投資家専用)	271,400,450円
りそなFT Globalリートファンド202307(適格機関投資家専用)	169,377,062円
2. 計算日における受益権の総数	42,726,125,915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	1.8662円
(10,000口当たり純資産額)	(18,662円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2024年 7月22日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、株価変動リスク、リートの価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

金融商品の時価等に関する事項

2024年 7月22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)

2024年 7月22日現在	

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2024年 7月22日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式		26,726,607
投資証券		5,032,800,901
合計		5,059,527,508

(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)

(2024年 7月22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	46,767,609	-	46,768,411	802	
	米ドル	46,767,609	-	46,768,411	802	
	合計	46,767,609	-	46,768,411	802	

(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	94,565	28.50	2,695,102.50	
	BROADSTONE NET LEASE INC-A	66,644	17.28	1,151,608.32	
	米ドル 小計	161,209		3,846,710.82 (606,010,822)	
オーストラリアドル	CENTURIA CAPITAL GROUP	302,927	1.65	501,344.18	
	オーストラリアドル 小計	302,927		501,344.18 (52,831,649)	
		464,136		658,842,471	

合計

(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	36,707	735,241.21	
		AGREE REALTY CORP	35,540	2,369,807.20	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	26,093	465,238.19	
		ALEXANDER'S INC	784	185,133.76	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	55,749	6,980,332.29	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	4,522	75,969.60	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	17,489	418,161.99	
		AMERICAN HEALTHCARE REIT INC	23,033	379,123.18	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	113,946	4,129,403.04	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	46,923	422,776.23	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	79,622	1,188,756.46	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	24,353	282,494.80	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	12,741	12,358.77	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	50,296	10,429,881.52	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	21,236	74,963.08	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	60,603	279,985.86	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	106,668	2,599,499.16	
		BRT APARTMENTS CORP	4,288	77,184.00	
		BXP INC	51,157	3,415,241.32	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	37,723	4,249,495.95	
		CARETRUST REIT INC	50,255	1,345,326.35	
		CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	8,617	222,490.94	
		CENTERSPACE	5,258	364,957.78	
		CHATHAM LODGING TRUST	17,173	149,920.29	
		CITY OFFICE REIT INC	14,501	79,030.45	
		CLIPPER REALTY INC	2,188	8,773.88	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	8,904	230,791.68	
		COPT DEFENSE PROPERTIES	39,730	1,059,996.40	
		COUSINS PROPERTIES INC	53,763	1,298,376.45	
		CTO REALTY GROWTH INC	6,920	130,718.80	
		CUBESMART	79,658	3,816,414.78	
		DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	75,130	626,584.20	
		DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	315,100	201,664.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	114,962	17,838,653.54			
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	75,621	238,206.15			
DOUGLAS EMMETT INC	59,128	860,312.40			
EAGLE HOSPITALITY TRUST	82,000	0.00			

EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	36,960	496,372.80	
EASTGROUP PROPERTIES INC	17,024	3,193,702.40	
ELME COMMUNITIES	31,628	517,750.36	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	46,799	497,941.36	
EPR PROPERTIES	26,821	1,178,246.53	
EQUINIX INC	33,624	26,456,035.68	
EQUITY COMMONWEALTH	38,280	733,444.80	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	66,039	4,479,425.37	
EQUITY RESIDENTIAL	122,149	8,567,530.86	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	62,045	1,909,124.65	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	22,740	6,476,124.60	
EXTRA SPACE STORAGE INC	75,000	12,307,500.00	
FARMLAND PARTNERS INC	16,063	183,921.35	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	26,433	2,894,413.50	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	46,871	2,502,911.40	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	32,515	873,027.75	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	33,544	54,005.84	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	96,202	4,621,544.08	
GETTY REALTY CORP	17,648	537,028.64	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	14,588	209,337.80	
GLADSTONE LAND CORP	11,837	175,069.23	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	22,348	212,082.52	
GLOBAL NET LEASE INC	70,183	593,748.18	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	134,003	2,339,692.38	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	249,251	5,209,345.90	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	37,464	1,039,626.00	
HOST HOTELS & RESORTS INC	249,613	4,458,088.18	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	44,583	238,073.22	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	79,467	1,502,720.97	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	21,463	101,519.99	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	10,029	1,186,230.12	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	24,243	643,409.22	
INVITATION HOMES INC	203,930	7,325,165.60	
IRON MOUNTAIN INC	103,833	10,204,707.24	
JBG SMITH PROPERTIES	29,478	477,838.38	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	274,900	46,458.10	
KILROY REALTY CORP	37,769	1,304,918.95	
KIMCO REALTY CORP	236,358	5,020,243.92	
KITE REALTY GROUP TRUST	77,721	1,835,770.02	
LTC PROPERTIES INC	15,603	572,005.98	
LXP INDUSTRIAL TRUST	103,984	1,043,999.36	
MACERICH CO/THE	76,314	1,228,655.40	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	635,700	48,948.90	

MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	212,251	1,018,804.80	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	41,374	5,945,443.80	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	24,640	1,088,841.60	
NATL HEALTH INVESTORS INC	15,357	1,107,239.70	
NET LEASE OFFICE PROPERTY	5,138	132,560.40	
NETSTREIT CORP	26,378	453,174.04	
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES	12,198	75,871.56	
NEXPOINT RESIDENTIAL	8,254	336,680.66	
NNN REIT INC	64,917	2,993,322.87	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	17,029	41,721.05	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	87,488	3,141,694.08	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	5,940	150,341.40	
ORION OFFICE REIT INC	19,499	77,606.02	
PARAMOUNT GROUP INC	58,164	300,126.24	
PARK HOTELS & RESORTS INC	74,386	1,102,400.52	
PEAKSTONE REALTY TRUST	12,777	170,572.95	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	42,442	584,850.76	
PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	43,308	1,512,315.36	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	44,503	357,804.12	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	12,985	311,120.60	
POSTAL REALTY TRUST INC- A	7,547	108,148.51	
PRIME US REIT	201,410	31,621.37	
PROLOGIS INC	328,021	40,592,598.75	
PUBLIC STORAGE	56,026	16,900,242.90	
REALTY INCOME CORP	308,482	17,762,393.56	
REGENCY CENTERS CORP	58,235	3,849,333.50	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	45,254	604,140.90	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	77,001	3,781,519.11	
RLJ LODGING TRUST	55,024	526,029.44	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	21,186	2,172,200.58	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	81,890	1,346,271.60	
SAFEHOLD INC	15,965	352,028.25	
SAUL CENTERS INC	4,713	181,120.59	
SERVICE PROPERTIES TRUST	59,798	354,602.14	
SIMON PROPERTY GROUP INC	115,467	17,718,411.15	
SITE CENTERS CORP	63,716	987,598.00	
SL GREEN REALTY CORP	22,920	1,392,848.40	
STAG INDUSTRIAL INC	64,488	2,524,060.32	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	39,133	234,798.00	
SUN COMMUNITIES INC	44,138	5,601,112.20	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	71,841	747,864.81	
TANGER INC	38,672	1,092,097.28	
TERRENO REALTY CORP	34,249	2,296,395.45	

	UDR INC	107,278	4,454,182.56
	UMH PROPERTIES INC	23,338	406,781.34
	UNITI GROUP INC	87,392	322,476.48
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	4,387	178,550.90
	URBAN EDGE PROPERTIES	42,502	831,764.14
	VENTAS INC	143,373	7,641,780.90
	VERIS RESIDENTIAL INC	28,947	450,704.79
	VICI PROPERTIES INC	369,616	11,203,060.96
	VORNADO REALTY TRUST	56,603	1,625,072.13
	WELLTOWER INC	211,823	22,751,908.43
	WHITESTONE REIT	16,673	232,588.35
	WP CAREY INC	77,480	4,577,518.40
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	35,890	514,303.70
	米ドル 小計	9,280,934	389,991,595.65 (61,439,275,978)
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	21,773	370,576.46
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	20,272	135,214.24
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	8,455	650,696.80
	BSR REAL ESTATE INVESTMENT T	6,564	108,174.72
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	14,969	48,649.25
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	28,867	1,386,482.01
	CHOICE PROPERTIES REIT	56,466	782,054.10
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	18,269	246,083.43
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	19,148	272,476.04
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	49,087	665,619.72
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	2,675	48,738.50
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	37,998	609,867.90
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	10,820	804,142.40
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	44,661	421,153.23
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	25,476	318,959.52
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	20,170	371,329.70
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	7,250	112,882.50
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	6,979	114,316.02
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	12,242	94,753.08
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	41,452	203,114.80
	PRIMARIS REIT	16,503	221,965.35
	PRO REAL ESTATE INVESTMENT T	8,626	43,820.08
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	51,722	911,341.64
	SLATE GROCERY REIT	10,423	122,782.94
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	24,843	587,785.38
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	2,814	24,566.22
	カナダドル 小計	568,524	9,677,546.03 (1,111,756,487)

ユーロ	AEDIFICA	17,033	1,034,754.75
	ALTAREA	1,602	151,549.20
	CARE PROPERTY INVEST	12,957	180,879.72
	CARMILA	20,473	339,851.80
	COFINIMMO	12,926	779,437.80
	COVIVIO	17,780	813,968.40
	CROMWELL REIT EUR	112,740	155,581.20
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	15,699	358,722.15
	GECINA SA	18,176	1,588,582.40
	HAMBORNER REIT AG	24,028	160,507.04
	ICADE	10,844	226,422.72
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	14,471	28,449.98
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	100,397	529,092.19
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	156,686	142,584.26
	KLEPIERRE	69,058	1,731,974.64
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	16,228	133,231.88
	MERCIALYS	33,290	359,864.90
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	119,277	1,229,745.87
	MONTEA NV	6,293	511,620.90
	NSI NV	6,467	124,813.10
	RETAIL ESTATES	4,283	277,538.40
	SHURGARD SELF STORAGE LTD	10,879	382,940.80
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	35,944	2,638,289.60
	VASTNED RETAIL NV	6,207	148,657.65
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	62,482	1,647,025.52
	WERELDHAVE NV	13,255	179,207.60
XIOR STUDENT HOUSING NV	12,324	399,913.80	
	ユーロ 小計	931,799	16,255,208.27 (2,789,718,843)
英ポンド	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	141,815	76,580.10
	AEW UK REIT PLC	60,678	54,670.87
	ASSURA PLC	1,087,273	453,827.75
	BALANCED COMM PROPERTY TRUST	250,435	208,862.79
	BIG YELLOW GROUP PLC	69,229	833,517.16
	BRITISH LAND CO PLC	331,626	1,335,789.52
	CLS HOLDINGS PLC	43,072	40,487.68
	CUSTODIAN PROPERTY INCOME REIT PLC	153,661	118,472.63
	DERWENT LONDON PLC	39,619	889,050.36
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	215,782	204,129.77
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	144,943	497,154.49
	HAMMERSON PLC	1,402,407	407,258.99
	HELICAL PLC	40,024	94,456.64
	HOME REIT PLC	147,401	56,086.08

	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	142,814	125,676.32
	INTU PROPERTIES PLC	117,549	0.00
	LAND SECURITIES GROUP PLC	265,690	1,695,102.20
	LIFE SCIENCE REIT PLC	113,860	38,712.40
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	720,949	1,447,665.59
	NEWRIVER REIT PLC	107,134	84,528.72
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	190,871	138,190.60
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	485,746	460,244.33
	PRS REIT PLC/THE	196,625	155,137.12
	REGIONAL REIT LTD	151,551	20,610.93
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	78,847	635,901.05
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	158,292	74,080.65
	SEGRO PLC	473,853	4,303,532.94
	SHAFTESBURY CAPITAL PLC	696,527	1,047,576.60
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	437,038	329,089.61
	TARGET HEALTHCARE REIT PLC	222,819	183,825.67
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	106,966	63,751.73
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	807,017	1,308,174.55
	UNITE GROUP PLC	140,131	1,313,027.47
	URBAN LOGISTICS REIT PLC	167,518	210,067.57
	WAREHOUSE REIT PLC	145,941	125,509.26
	WORKSPACE GROUP PLC	47,673	294,142.41
	英債券 小計	10,103,376	19,324,892.55 (3,935,900,865)
オーストラリアドル	ABACUS GROUP	160,679	186,387.64
	ABACUS STORAGE KING	177,394	219,081.59
	ARENA REIT	126,228	497,338.32
	BWP TRUST	198,394	708,266.58
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	186,282	594,239.58
	CENTURIA OFFICE REIT	150,261	178,810.59
	CHARTER HALL GROUP	167,030	2,096,226.50
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	233,679	822,550.08
	CHARTER HALL RETAIL REIT	182,580	609,817.20
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	117,508	289,069.68
	CROMWELL PROPERTY GROUP	526,553	215,886.73
	DEXUS INDUSTRIA REIT	71,835	206,884.80
	DEXUS/AU	380,120	2,600,020.80
	GDI PROPERTY GROUP	181,458	105,245.64
	GOODMAN GROUP	612,210	22,712,991.00
	GPT GROUP	677,127	2,952,273.72
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	102,884	238,690.88
	HEALTHCO REIT	164,038	184,542.75
	HMC CAPITAL LTD	89,314	683,252.10

	HOMECO DAILY NEEDS REIT	628,247	779,026.28
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	67,652	222,575.08
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	131,218	658,714.36
	MIRVAC GROUP	1,394,639	2,859,009.95
	NATIONAL STORAGE REIT	458,647	1,114,512.21
	REGION RE LTD	409,145	912,393.35
	RURAL FUNDS GROUP	133,000	271,320.00
	SCENTRE GROUP	1,838,894	5,976,405.50
	STOCKLAND	844,374	3,808,126.74
	VICINITY CENTRES	1,368,148	2,708,933.04
	WAYPOINT REIT	235,137	571,382.91
	オーストラリアドル 小計	12,014,675	55,983,975.60 (5,899,591,348)
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	286,929	305,579.38
	GOODMAN PROPERTY TRUST	369,352	771,945.68
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	549,790	472,819.40
	PRECINCT PROPERTIES GROUP	572,771	707,372.18
	ニュージーランドドル 小計	1,778,842	2,257,716.64 (213,941,228)
香港ドル	CHAMPION REIT	714,000	1,185,240.00
	FORTUNE REIT	541,000	2,055,800.00
	LINK REIT	902,800	29,025,020.00
	PROSPERITY REIT	431,000	586,160.00
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	345,000	589,950.00
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	795,000	787,050.00
	香港ドル 小計	3,728,800	34,229,220.00 (690,403,367)
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LT	257,200	334,360.00
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	1,256,900	3,393,630.00
	CAPITALAND ASCOTT TRUST	900,596	810,536.40
	CAPITALAND CHINA TRUST	423,300	289,960.50
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL	1,808,032	3,706,465.60
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	247,700	243,984.50
	EC WORLD REIT	50,000	14,000.00
	ESR-LOGOS REIT	2,179,650	621,200.25
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	366,500	227,230.00
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	399,600	875,124.00
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL	1,030,279	1,025,127.60
	KEPPEL DC REIT	485,400	941,676.00
	KEPPEL REIT	786,500	688,187.50
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	613,500	361,965.00
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	737,500	1,688,875.00
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,189,600	1,617,856.00
		830,500	1,087,955.00

	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA			
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	134,600	492,636.00	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	188,100	126,027.00	
	SPH REIT	449,100	381,735.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	497,800	248,900.00	
	SUNTEC REIT	785,900	919,503.00	
	シンガポールドル 小計	15,618,257	20,096,934.35 (2,354,757,797)	
韓国ウォン	D&D PLATFORM REIT CO LTD	15,215	52,111,375.00	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	55,813	268,181,465.00	
	JR REIT XXVII	57,253	224,718,025.00	
	KORAMCO LIFE INFRA REIT	14,612	70,137,600.00	
	LOTTE REIT CO LTD	44,180	157,943,500.00	
	NH ALL-ONE REIT CO LTD	11,869	43,499,885.00	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	26,417	168,012,120.00	
	SK REITS CO LTD	48,808	243,551,920.00	
	韓国ウォン 小計	274,167	1,228,155,890.00 (139,518,509)	
イスラエルシェケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	292,578	490,068.15	
	REIT 1 LTD	69,381	1,042,796.43	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	75,019	539,836.72	
	イスラエルシェケル 小計	436,978	2,072,701.30 (89,551,266)	
合計			78,664,415,688 (78,664,415,688)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額（単位:円）であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式 2銘柄	1.0%		0.8%
	投資証券 136銘柄		99.0%	77.4%
カナダドル	投資証券 26銘柄		100.0%	1.4%
ユーロ	投資証券 27銘柄		100.0%	3.5%
英債券	投資証券 36銘柄		100.0%	5.0%
オーストラリアドル	株式 1銘柄	0.9%		0.1%
	投資証券 30銘柄		99.1%	7.3%
ニュージーランドドル	投資証券 4銘柄		100.0%	0.3%
香港ドル	投資証券 6銘柄		100.0%	0.9%
シンガポールドル	投資証券 22銘柄		100.0%	3.0%
韓国ウォン	投資証券 8銘柄		100.0%	0.2%
イスラエルシェケル	投資証券 3銘柄		100.0%	0.1%

(注)時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
注記表（その他の注記）の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2024年 7月31日現在です。

【ラップ型ファンド・プラスESG（安定型）】

【純資産額計算書】

資産総額	657,655,833円
負債総額	34,726,166円
純資産総額（ - ）	622,929,667円
発行済口数	570,115,507口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0926円

【ラップ型ファンド・プラスESG（安定成長型）】

【純資産額計算書】

資産総額	6,841,062,699円
負債総額	381,542,277円
純資産総額（ - ）	6,459,520,422円
発行済口数	5,374,532,952口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2019円

【ラップ型ファンド・プラスESG（成長型）】

【純資産額計算書】

資産総額	9,464,610,182円
負債総額	484,816,776円
純資産総額（ - ）	8,979,793,406円
発行済口数	6,615,224,118口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3574円

（参考）

RM国内SDGs債券マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	2,703,047,509円
負債総額	円
純資産総額（ - ）	2,703,047,509円
発行済口数	2,738,904,337口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9869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	2,675,683,588円
------	----------------

負債総額	14,780,862円
純資産総額（ - ）	2,660,902,726円
発行済口数	3,087,200,713口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8619円

R M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	1,790,000,510円
負債総額	18,707円
純資産総額（ - ）	1,789,981,803円
発行済口数	2,041,799,371口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8767円

R M国内株式ESGマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	8,386,164,302円
負債総額	969,462,190円
純資産総額（ - ）	7,416,702,112円
発行済口数	3,854,950,253口
1口当たり純資産額（ / ）	1.9239円

R M先進国株式ESGマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	15,164,524,009円
負債総額	703,452,631円
純資産総額（ - ）	14,461,071,378円
発行済口数	6,046,481,026口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3917円

R M新興国債券マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	11,730,156,182円
負債総額	89,502,592円
純資産総額（ - ）	11,640,653,590円
発行済口数	8,330,894,402口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3973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	37,910,150,202円
------	-----------------

負債総額	50,488,183円
純資産総額（ - ）	37,859,662,019円
発行済口数	18,647,083,334口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0303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	66,068,956,413円
負債総額	1,175,774,500円
純資産総額（ - ）	64,893,181,913円
発行済口数	46,416,941,219口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3980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	79,337,669,870円
負債総額	806,431,144円
純資産総額（ - ）	78,531,238,726円
発行済口数	43,221,449,245口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8170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。

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

2024年7月末現在	資本金の額	1,000,000,000円
	発行可能株式総数	3,960,000株
	発行済株式総数	3,960,000株

過去5年間における主な資本金の増減
該当事項はありません。

(2) 委託会社の機構（2024年7月末現在）

会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

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

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

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

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

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

投資運用の意思決定機構

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

PLAN：計画

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

DO：実行

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

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

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

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

CHECK：検証 ACTION：改善

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

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2024年7月末現在、委託会社が運用する証券投資信託は以下のとおりです（ただし、親投資信託を除きます。）。

ファンドの種類	本数	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	170	1,872,523
単位型株式投資信託	9	45,759
単位型公社債投資信託	11	19,712
合計	190	1,937,994

3【委託会社等の経理状況】

- (1) 委託会社であるりそなアセットマネジメント株式会社(以下、「当社」という。)の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年内閣府令第52号)により作成しております。
- (2) 財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。
- (3) 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第9期事業年度(自2023年4月1日至2024年3月31日)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツにより監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

			(単位：千円)	
			前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
資産の部				
流動資産				
預金			9,745,910	13,119,743
前払費用			323,722	370,082
未収入金			314	251
未収委託者報酬			948,037	1,130,264
未収運用受託報酬			2,750,484	3,192,978
未収投資助言報酬			479,787	528,962
流動資産計			14,248,255	18,342,282
固定資産				
有形固定資産				
建物	1		11,556	10,220
器具備品	1		17,947	29,165
有形固定資産計			29,503	39,386
無形固定資産				
ソフトウェア			11,002	8,159
無形固定資産計			11,002	8,159
投資その他の資産				
投資有価証券			60,103	106,647
繰延税金資産			117,863	143,330
投資その他の資産計			177,967	249,977
固定資産計			218,474	297,523
資産合計			14,466,729	18,639,805

			(単位：千円)	
			前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
負債の部				
流動負債				
未払金				
未払手数料			252,008	334,583
その他未払金			263,623	323,811
未払費用			111,825	120,123
未払法人税等			607,485	963,350
未払消費税等			99,188	192,864
預り金			2,245	3,404
賞与引当金			265,505	299,790
流動負債計			1,601,882	2,237,928
負債合計			1,601,882	2,237,928
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	11,375,212	14,907,622
利益剰余金計	11,375,212	14,907,622
株主資本計	12,865,212	16,397,622
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	364	4,254
評価・換算差額等計	364	4,254
純資産合計	12,864,847	16,401,876
負債・純資産合計	14,466,729	18,639,805

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自 至	2022年4月1日 2023年3月31日)	(自 至	2023年4月1日 2024年3月31日)
営業収益				
委託者報酬		4,696,038		5,305,650
運用受託報酬		5,142,361		5,754,081
投資助言報酬		952,145		1,007,903
営業収益計		10,790,545		12,067,636
営業費用				
支払手数料		1,210,415		1,449,655
広告宣伝費		68,988		171,443
調査費				
調査費		1,772,867		2,013,532
委託調査費		148,470		119,505
委託計算費		300,448		276,698
事務委託費		26,903		39,175
営業雑経費				
印刷費		114,901		134,495
協会費		13,978		14,633
販売促進費		836		7,194
その他		70,972		90,318
営業費用計		3,728,783		4,316,653
一般管理費				
給料				
役員報酬		124,995		136,596
給料・手当		1,361,136		1,452,513
賞与		192,845		234,518
賞与引当金繰入額		265,505		299,790
旅費交通費		20,681		39,740
租税公課		85,343		95,998
不動産賃借料		113,302		124,318
固定資産減価償却費		13,938		17,438
諸経費		267,977		311,828
一般管理費計		2,445,724		2,712,744
営業利益		4,616,037		5,038,238
営業外収益				
受取利息		5,137		6,811
受取配当金		64		162
投資有価証券売却益		564		2,000
為替差益		-		50,481
雑収入		2,431		3,233
営業外収益計		8,198		62,688

営業外費用		
投資有価証券売却損	290	15
為替差損	64,517	-
雑損失	22	2,326
営業外費用計	64,829	2,341
経常利益	4,559,406	5,098,585
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	4,557,038	5,098,585
法人税、住民税及び事業税	1,384,185	1,593,680
法人税等調整額	1,450	27,504
法人税等計	1,385,636	1,566,175
当期純利益	3,171,401	3,532,410

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（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

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024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	11,375,212	11,375,212	12,865,212
当期変動額						
当期純利益	-	-	-	3,532,410	3,532,410	3,532,410
株主資本以外の項目 の当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	3,532,410	3,532,410	3,532,410
当期末残高	1,000,000	490,000	490,000	14,907,622	14,907,622	16,397,622

	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
当期変動額			
当期純利益	-	-	3,532,410
株主資本以外の項目 の当期変動額（純額）	4,618	4,618	4,618
当期変動額合計	4,618	4,618	3,537,028
当期末残高	4,254	4,254	16,401,876

（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）グループ通算制度の適用

当社は、株式会社りそなホールディングスを通算親法人とするグループ企業内の通算子法人として、グループ通算制度を適用しております。

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 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
建物	2,865千円	4,201千円
器具備品	40,455千円	52,832千円

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（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。

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024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

（1）当会計年度中の配当金支払額
該当事項はありません。

（2）基準日が当会計年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が当会計年度の末日後となるもの。
2024年5月27日開催の取締役会に次の議案を提案いたします。

株式の種類	配当金の総額 （百万円）	1株当たり 配当額（円）	配当の原資	基準日	効力発生日
普通株式	1,766	446.01	利益剰余金	2024年3月31日	2024年5月28日

（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 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	-

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024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	106,647	106,647	-
資産計	106,647	106,647	-

（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	-	68,696	6,973	3,974
合計	-	68,696	6,973	3,974

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 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

当事業年度(自 2023年4月1日 至 2024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	-	106,647	-	106,647
資産計	-	106,647	-	106,647

(有価証券関係)

1. その他有価証券

前事業年度(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

当事業年度(自 2023年4月1日 至 2024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		50,401	41,986	8,415
小計		50,401	41,986	8,415
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	56,245	58,529	2,283
	小計	56,245	58,529	2,283
合計		106,647	100,515	6,132

2. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(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

当事業年度(自 2023年4月1日 至 2024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	12,985	2,000	15
合計	12,985	2,000	15

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
繰延税金資産		
賞与引当金	81,271千円	91,795千円
未払事業所税	1,628千円	1,738千円
未払事業税	31,451千円	47,887千円
未確定債務	961千円	769千円
減価償却超過額	2,390千円	3,016千円
その他有価証券評価差額金	846千円	699千円
繰延税金資産小計	118,549千円	145,906千円
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	118,549千円	145,906千円
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	685千円	2,576千円
繰延税金負債合計	685千円	2,576千円
繰延税金資産の純額	117,863千円	143,330千円

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 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%

当事業年度(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

法定実効税率	30.62%
(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	0.01%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	30.72%

3. 法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果の会計処理

当社は、グループ通算制度を適用しており、「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)に従って、法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理並びに開示を行っております。

(収益認識関係)

1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

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

2. 収益を理解するための基礎となる情報

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

3. 当事業年度及び翌事業年度以降の収益の金額を理解するための情報

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(セグメント情報等)

前事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

1. セグメント情報

当社は、「資産運用業」の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

(単位：千円)

顧客の名称又は氏名	営業収益額
株式会社りそな銀行	5,545,681

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

1. セグメント情報

当社は、「資産運用業」の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

(単位：千円)

顧客の名称又は氏名	営業収益額
株式会社りそな銀行	6,148,663

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 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)

当事業年度(自 2023年4月1日 至 2024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)	5,325,355	未収運用 受託報酬	2,985,561
							投資助言 報酬 (注2)	823,308	未収投資 助言報酬	463,233
							支払手数料 (注3)	964,675	未払 手数料	215,271

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 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
1株当たり純資産額	3,248円70銭	4,141円89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()	800円86銭	892円02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 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
当期純利益又は当期純損失()(千円)	3,171,401	3,532,410
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)	3,171,401	3,532,410
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 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

- (1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
(2) 運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
(3) 通常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つて、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 (2024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(2024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 (2024年3月末現在)	事業の内容
auカブコム証券株式会社	7,196百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社SBI証券	54,323百万円	
松井証券株式会社	11,945百万円	
マネックス証券株式会社	13,195百万円	
moomoo証券株式会社	3,500百万円 (2023年12月末現在)	
楽天証券株式会社	19,495百万円	
株式会社関西みらい銀行	38,971百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社埼玉りそな銀行	70,000百万円	
株式会社広島銀行	54,573百万円	
株式会社みなと銀行	39,984百万円	
株式会社りそな銀行	279,928百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

- (1) 受託会社
ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行ないます。
- (2) 販売会社
日本におけるファンドの募集、解約、収益分配金および償還金の取扱いなどを行ないます。

3【資本関係】

- (1) 受託会社
該当事項はありません。
- (2) 販売会社
該当事項はありません。

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2023年10月20日	有価証券届出書
2023年10月20日	有価証券報告書
2024年 4月19日	有価証券届出書
2024年 4月19日	半期報告書

独立監査人の監査報告書

2024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2024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。

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

独立監査人の監査報告書

2024年10月3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 鈴木 健嗣
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」に掲げられているラップ型ファンド・プラスESG（安定型）の2023年7月21日から2024年7月22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、ラップ型ファンド・プラスESG（安定型）の2024年7月22日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうかを検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうかを注意を払うことにある。

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- 経営者が継続企業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。

独立監査人の監査報告書

2024年10月3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 鈴木 健嗣
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」に掲げられているラップ型ファンド・プラスESG（安定成長型）の2023年7月21日から2024年7月22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、ラップ型ファンド・プラスESG（安定成長型）の2024年7月22日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうかを検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうかを注意を払うことにある。

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- 経営者が継続企業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。

独立監査人の監査報告書

2024年10月3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 鈴木 健嗣
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」に掲げられているラップ型ファンド・プラスESG（成長型）の2023年7月21日から2024年7月22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、ラップ型ファンド・プラスESG（成長型）の2024年7月22日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうかを検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうかを注意を払うことにある。

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- 経営者が継続企業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。