

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2024年10月25日提出
【発行者名】	りそなアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役 西山 明宏
【本店の所在の場所】	東京都江東区木場一丁目5番65号
【事務連絡者氏名】	塚田 光子
【電話番号】	03-6704-3821
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	りそなラップ型ファンド（安定型） りそなラップ型ファンド（安定成長型） りそなラップ型ファンド（成長型）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	りそなラップ型ファンド（安定型） 1兆円を上限とします。 りそなラップ型ファンド（安定成長型） 1兆円を上限とします。 りそなラップ型ファンド（成長型） 1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

## (1) 【ファンドの名称】

りそなラップ型ファンド（安定型）  
りそなラップ型ファンド（安定成長型）  
りそなラップ型ファンド（成長型）

- 以下、上記を総称して「ファンド」または「当ファンド」ということがあります。また、各々については、正式名称ではなく、以下の略称および愛称を使用することがあります。

ファンドの名称	略称	愛称
りそなラップ型ファンド（安定型）	安定型	R 2 4 6（安定型）
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	安定成長型	R 2 4 6（安定成長型）
りそなラップ型ファンド（成長型）	成長型	R 2 4 6（成長型）

- 愛称として「R 2 4 6」という名称を用いることがあります。

## (2) 【内国投資信託受益証券の形態等】

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

## (3) 【発行（売出）価額の総額】

各ファンド、1兆円を上限とします。

## (4) 【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

## (5) 【申込手数料】

申込手数料（スイッチングの際の申込手数料を含みます。）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%）が上限となっております。

## (6) 【申込単位】

販売会社にお問い合わせください。

## (7) 【申込期間】

2024年10月26日から2025年4月25日までとします。

- 上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

## (8) 【申込取扱場所】

販売会社につきましては、委託会社の照会先にお問い合わせください。

委託会社の照会先

りそなアセットマネジメント株式会社

電話番号：0120-223351

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時）

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

## (9) 【払込期日】

- 取得申込者は、申込金額を販売会社が指定する期日までに販売会社に支払うものとします。
- 申込期間における各取得申込受付日の発行価額の総額（設定総額）は、販売会社によって、追加設定が

行なわれる日に委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

( 1 0 ) 【払込取扱場所】

申込金額は、販売会社にお支払いいただきます。

( 1 1 ) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、株式会社証券保管振替機構とします。

( 1 2 ) 【その他】

該当事項はありません。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

- ファンドの目的  
 <りそなラップ型ファンド（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。  
 <りそなラップ型ファンド（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。  
 <りそなラップ型ファンド（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 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (含む日本)		
	年2回	日本		
	年4回	北米	ファミリーファンド	あり (部分ヘッジ)
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ( )	年6回 (隔月)	欧州		
	年12回 (毎月)	アジア		
	日々	オセアニア		
不動産投信	その他 ( )	中南米	ファンド・オブ・ファンズ	なし
その他資産 (投資信託証券(資産複合(株式、債券、不動産投信)資産配分変更型))		アフリカ		
		中近東 (中東)		
		エマージング		
資産複合 ( ) 資産配分固定型 資産配分変更型				

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

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用されます。このため、組入れている資産を示す属性区分上の投資対象資産(その他資産(投資信託証券(資産複合(株式、債券、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、組み合わせられ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、組み合わせられ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。

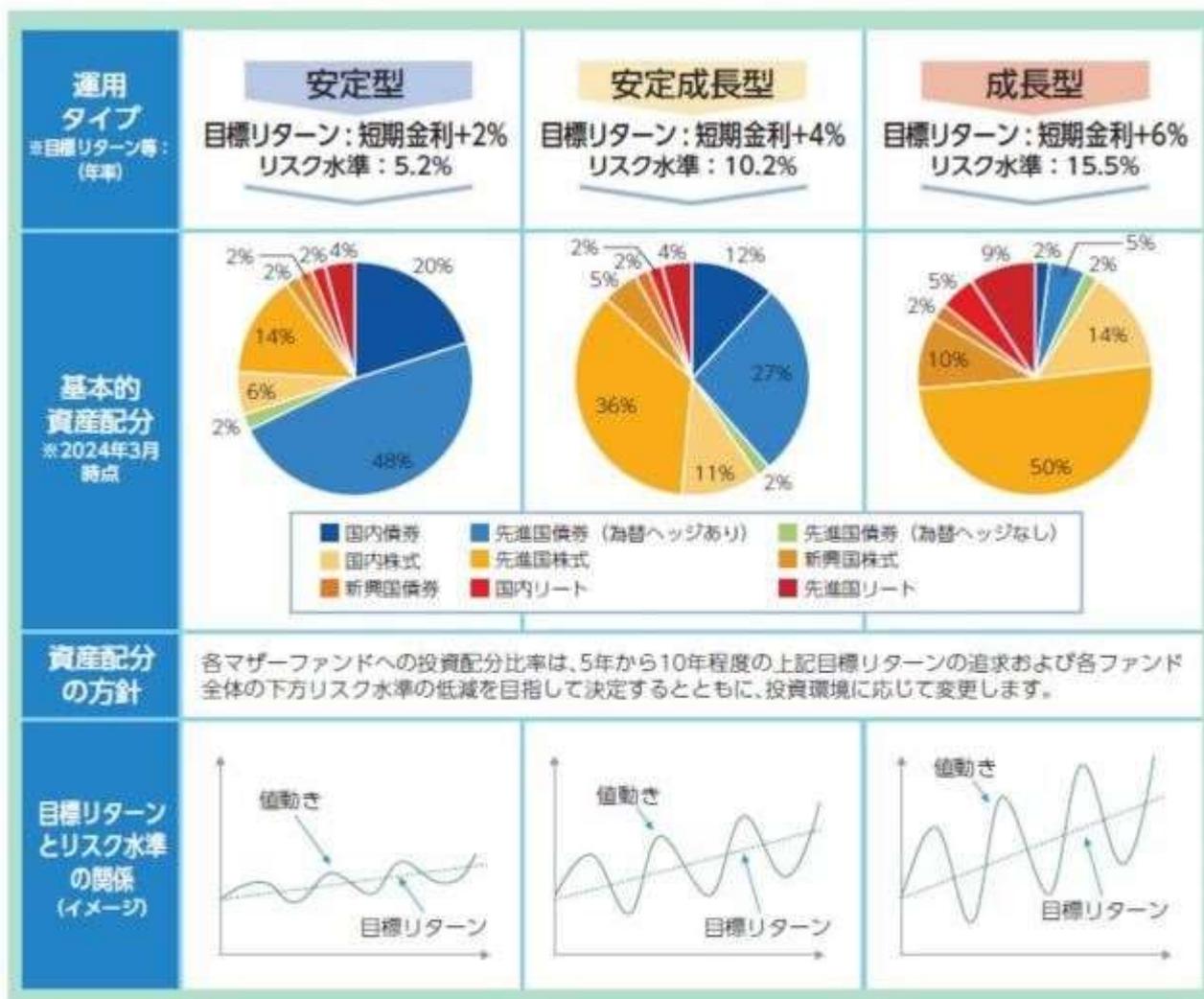
● 各マザーファンドは、以下の対象指数の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

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

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

## 2 目標リターン別に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。



※「目標リターン」とは、必ず一定の収益を得ることのできる運用を意味するものではなく、記載されている目標リターンの数値は、その達成を示唆・保証するものではありません。したがって、投資者の元本が保証されるものではなく、各ファンドの基準価額は下落することがあります。

※目標リターンは、運用管理費用（信託報酬）控除後のものです。その他発生する費用につきましては考慮していません。

※目標リターンに記載している短期金利は無担保コールO/N物レート（確報）のことを指します。

※目標リターンは、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。

※リスク水準は、2003年4月から2024年1月までの期間に、上記の資産配分で各マザーファンドを保有していたと仮定し、各対象指数の収益率に基づき算出したものです。実際の運用では資産配分の見直しや各マザーファンドのリスク水準の変化等に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、各マザーファンドの対象指数の過去の収益率およびリスクに鑑み下方リスク水準の低減を目指して定期的に見直します。ただし、信託財産に現金等が含まれることや各マザーファンドの基準価額が変動すること等により、実際の資産別構成比率が上記の基本的資産配分と一致しない場合があります。

※「目標リターンとリスク水準の関係」は、あくまでイメージを示したものであり、基準価額の上昇を示唆・保証するものではありません。

### 3 中長期的な運用に理想的なポートフォリオ構築を目指します。

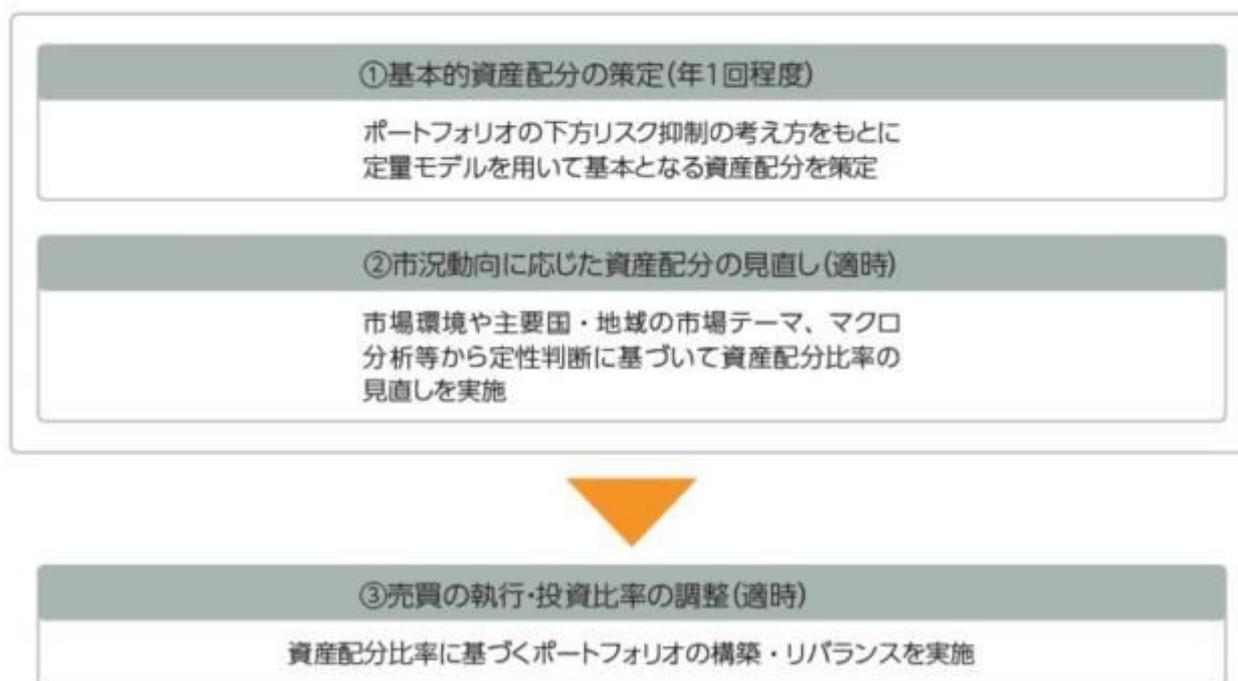
先を見据えたシミュレーションにより、中長期的な運用に理想的なポートフォリオを構築します。

- 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。

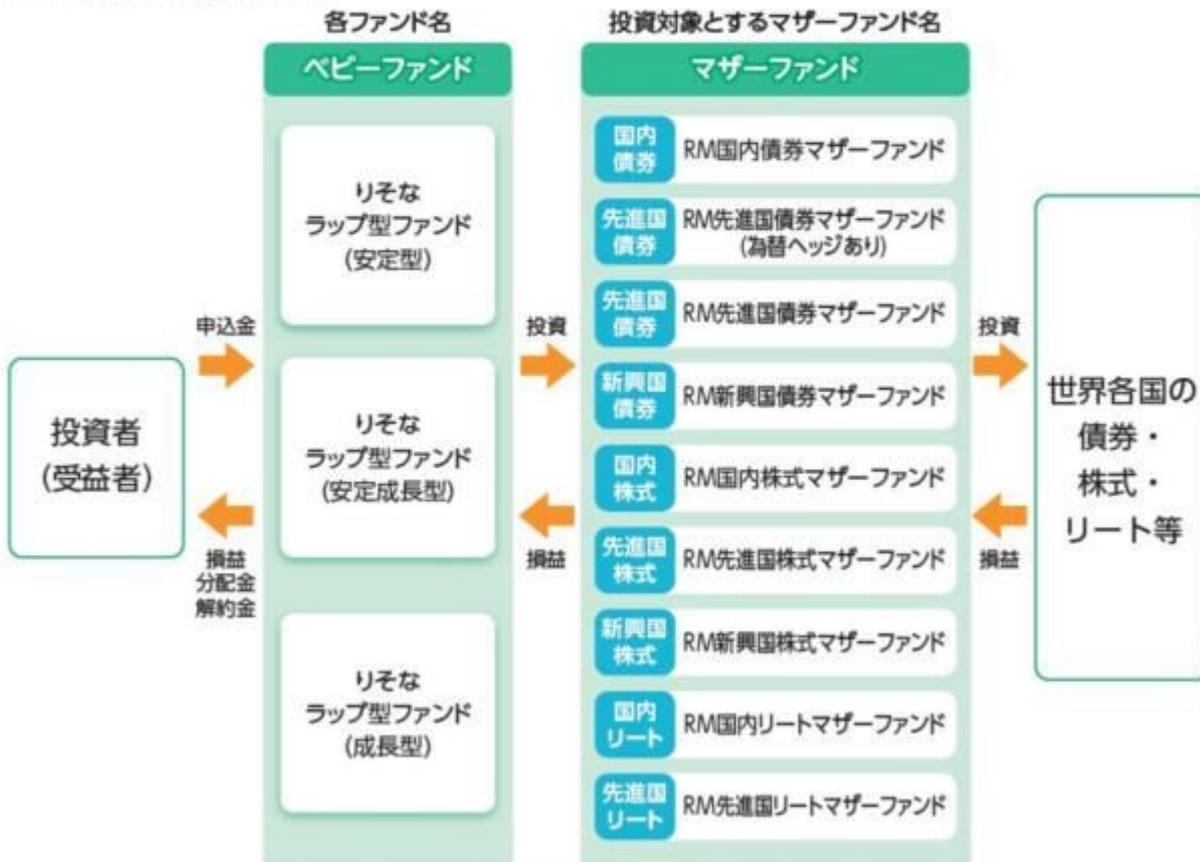
## 4 実質組入外貨建資産の一部について、対円での為替ヘッジを行います。

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

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。



※各ファンド間でスイッチングができる場合があります。詳しくは販売会社にご確認ください。

### 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。

## ■ 配分方針

原則、毎年1月25日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、以下の収益配分方針に基づいて分配を行います。

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

★将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

## ■ 各マザーファンドが対象とする指数の著作権等について

### ● RM国内債券マザーファンド

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

### ● RM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)

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

### ● RM先進国債券マザーファンド

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

### ● RM新興国債券マザーファンド

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

### ● RM国内株式マザーファンド

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

### ● RM先進国株式マザーファンド

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

### ● RM新興国株式マザーファンド

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

### ● RM国内リートマザーファンド

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

### ● RM先進国リートマザーファンド

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

#### 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】

2016年2月26日

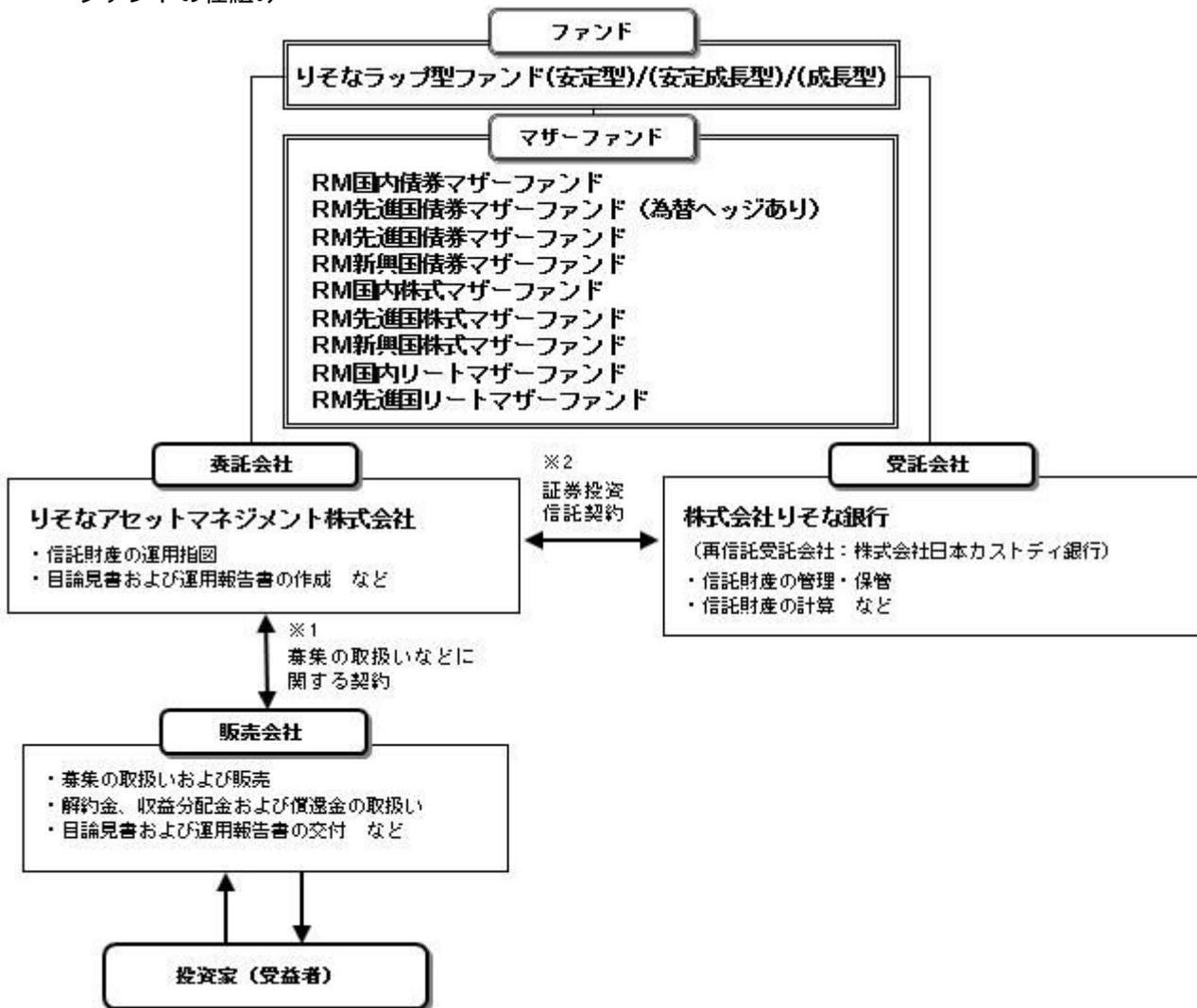
・ファンドの信託契約締結、運用開始

2019年9月3日

- ・投資対象に「RAM先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）」（2021年4月24日付で名称を「RM先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）」に変更）を追加する旨の約款変更を実施

### （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を。販売会社が行なう募集の取扱い、収益分配金・償還金の支払い、解約請求の受付の業務範囲の取決めの内容などが含まれています。
- 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を。運用の基本方針、投資対象、投資制限、信託報酬、受益者の権利、募集方法の取決めの内容などが含まれています。

#### 委託会社の概況（2024年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】

- 以下に掲げるマザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。
- RM国内債券マザーファンド受益証券
  - RM先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）受益証券
  - RM先進国債券マザーファンド受益証券
  - RM新興国債券マザーファンド受益証券
  - RM国内株式マザーファンド受益証券

R M先進国株式マザーファンド受益証券  
 R M新興国株式マザーファンド受益証券  
 R M国内リートマザーファンド受益証券  
 R M先進国リートマザーファンド受益証券

#### <りそなラップ型ファンド（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・上場投資信託証券ならびに国内および先進国の不動産投資信託証券等（上場投資信託証券を含む。）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。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<sup>1</sup>+2%<sup>2</sup>（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ことがあります。

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。

#### <りそなラップ型ファンド（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・上場投資信託証券ならびに国内および先進国の不動産投資信託証券等（上場投資信託証券を含む。）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。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<sup>1</sup>+4%<sup>2</sup>（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ことがあります。

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。

#### <りそなラップ型ファンド（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・上場投資信託証券ならびに国内および先進国の不動産投資信託証券等（上場投資信託証券を含む。）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。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<sup>1</sup>+6%<sup>2</sup>（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ことがあります。

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

## （２）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

有価証券の指図範囲

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

- 1) 株券または新株引受権証書
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券

- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- 6) 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 7) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
- 8) 協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
- 9) 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
- 10) コマーシャル・ペーパー
- 11) 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
- 12) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1) から11) までの証券または証書の性質を有するもの
- 13) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
- 14) 投資証券、新投資口予約権証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
- 15) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
- 16) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかると限ります。）
- 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国内債券マザーファンド >

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、NOMURA - B P I 総合の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	次の有価証券を主要投資対象とします。 ・ NOMURA - B P I 総合に採用されている国内の債券
投資方針	主として、NOMURA - B P I 総合に採用されている国内の債券に投資し、NOMURA - B P I 総合の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、NOMURA - B P I 総合への連動性を高めるため、国内債券を対象とした債券先物取引を活用することがあります。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	<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す。）の行使等により取得したものに限り ます。</p> <p>株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は、行いません。</p> <p>デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
収益分配	収益分配は行いません。
<b>ファンドに係る費用</b>	
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。
<b>その他</b>	
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先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり） >

<b>運用の基本方針</b>	
基本方針	この投資信託は、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
主な投資対象	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）に採用されている先進国の債券を主要投資対象とします。
投資方針	<p>主として、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）に採用されている先進国の債券に投資し、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）への連動性を高めるため、先進国債券の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）または海外の債券先物取引を活用することがあります。</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>外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行います。</p> <p>資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限り ます。</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。
<b>ファンドに係る費用</b>	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入の有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
<b>その他</b>	
決算日	毎年12月10日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

## &lt; R M先進国債券マザーファンド &gt;

<b>運用の基本方針</b>	
基本方針	この投資信託は、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	次の有価証券を主要投資対象とします。 ・FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に採用されている先進国の債券
投資方針	主として、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に採用されている先進国の債券に投資し、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）への連動性を高めるため、先進国債券の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）または海外の債券先物取引を活用することがあります。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。為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	株式への投資は、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。 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。 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。
<b>ファンドに係る費用</b>	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入の有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
<b>その他</b>	
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

## &lt; R M新興国債券マザーファンド &gt;

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

## &lt; R M国内株式マザーファンド &gt;

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

## &lt; R M先進国株式マザーファンド &gt;

<b>運用の基本方針</b>	
基本方針	この投資信託は、MSCI - KOKUSAI 指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	<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"> <li>金融商品取引所に上場されているまたは店頭登録されている（上場予定および店頭登録予定を含みます。）先進国株式（*）（日本の株式を除きます。以下同じ。）</li> <li>（*）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。</li> <li>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）</li> </ul>
投資方針	<p>主として、先進国株式または先進国株式の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）に投資し、MSCI - KOKUSAI 指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。なお、MSCI - KOKUSAI 指数（配当込み、円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の金融商品取引市場に上場する株価指数先物取引を活用することがあります。</p> <p>株式またはETF（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。</p> <p>為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。</p> <p>資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。</p>

主な投資制限	<p>株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
収益分配	収益分配は行いません。
<b>ファンドに係る費用</b>	
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。
<b>その他</b>	
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

## &lt; R M新興国株式マザーファンド &gt;

<b>運用の基本方針</b>	
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"> <li>・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（*）</li> <li>（*）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。</li> <li>・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）</li> </ul>
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。
<b>ファンドに係る費用</b>	
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。
<b>その他</b>	
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

## &lt; R M国内リートマザーファンド &gt;

<b>運用の基本方針</b>	
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。
<b>ファンドに係る費用</b>	

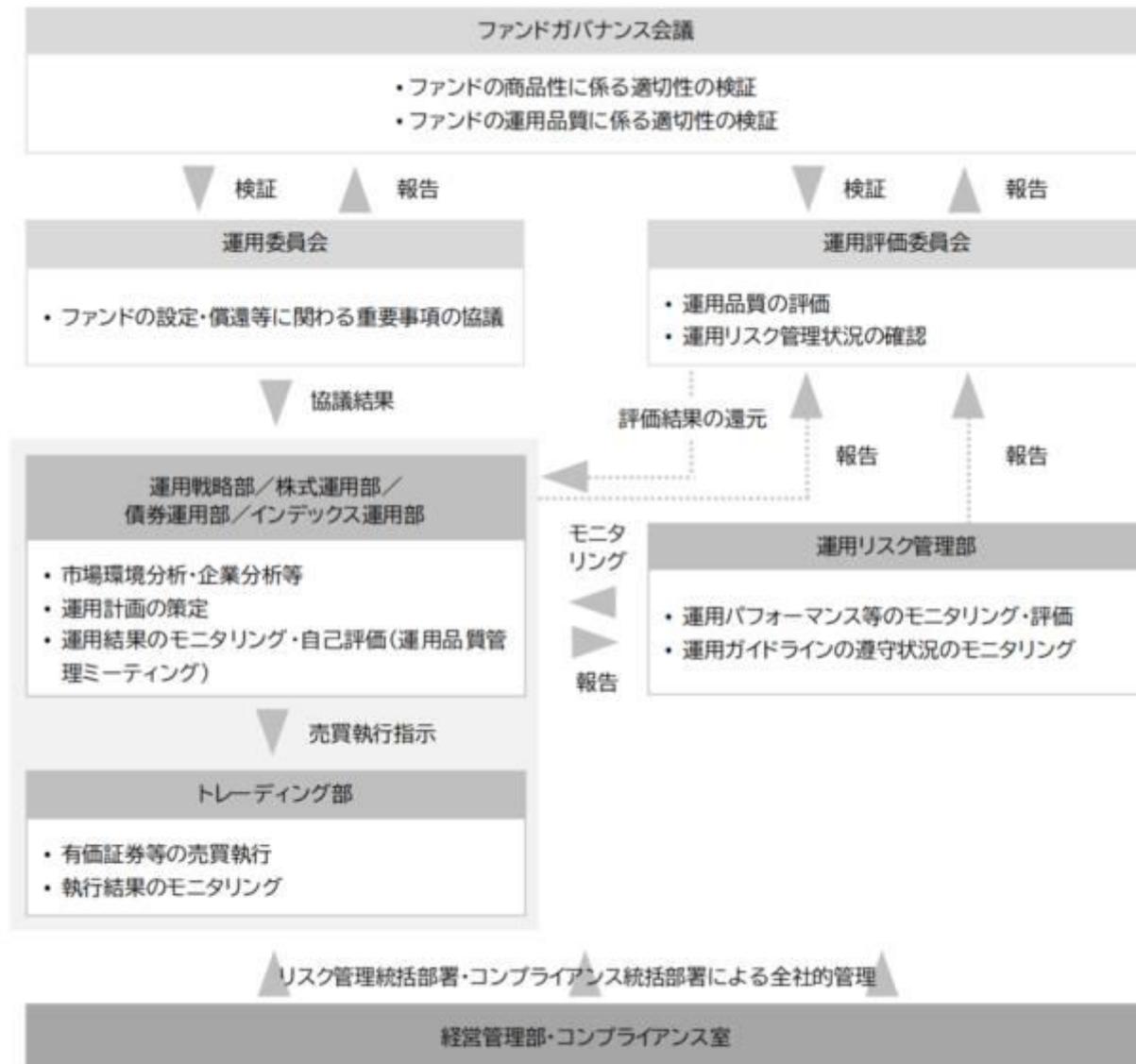
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
<b>その他</b>	
決算日	毎年1月25日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

## &lt; R M先進国リートマザーファンド &gt;

<b>運用の基本方針</b>	
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。
<b>ファンドに係る費用</b>	
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。
<b>その他</b>	
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。

## &lt; 分配金受取りコース(一般コース) &gt;

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の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- 8) 投資する株式等の範囲
  1. 委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
  2. 前記1.の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとします。
- 9) 信用取引の指図範囲
  1. 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
  2. 前記1.の信用取引の指図は、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
    - イ) 信託財産に属する株券および新株引受権証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および範囲
  1. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、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。以下同じ。)、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。以下同じ。)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。以下同じ。)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次の範囲で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。)。
    - イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする有価証券(以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。)の時価総額の範囲内とします。
    - ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額(組入ヘッジ対象有価証券を差し引いた額)に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権、組入抵当証券および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等(株式、株価指数にかかる先物取引の買建においては、信託財産が未収配当金として計上している額を含むものとし、この額には信託財産が当該限月を超えて受取る配当金も含まれます。)ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。
    - ハ) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、10)で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
  2. 委託者は、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、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次の範囲で行うことの指図をすることができます。
    - イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合せてヘッジ対象と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ヘッジ対象と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の純資産総額に占めるヘッジ対象とす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。)との合計額の範囲内とします。

ロ)先物取引の買建およびブット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合せて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。

ハ)コール・オプションおよびブット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ10)で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

3. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、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次の範囲で行うことの指図をすることができます。

イ)先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品(信託財産が1年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。)の時価総額の範囲内とします。

ロ)先物取引の買建およびブット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額(以下ロ)において「金融商品運用額等」といいます。)の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額(約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差引いた額。以下同じ。)に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。

ハ)コール・オプションおよびブット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ10)で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

#### 11) スワップ取引の運用指図および範囲

1. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なる通貨、異なる受取金利または異なる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. スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下3.において「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総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スワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

4. 前記3.においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

5. 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。

6. 委託者は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

#### 12) 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図および範囲

1. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、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. 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下3.において「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。)が、信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下3.において「ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額」といいます。)を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象金利商品の時価総額の合計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金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

4. 為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下4.において「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。)が、信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかる保有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との合計額(以下「保有外貨建資産の時価総額の合計額」といいます。)を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額の合計額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額が保有外貨建資産の時価総額の合計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為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

5. 前記3.および4.においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にか

かる金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品および保有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とは、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品および保有外貨建資産の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

6. 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。
  7. 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、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、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指図にあたっては、当該信託財産にかかる直物為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる直物為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下3.において「直物為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、保有外貨建資産の時価総額の合計額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額の合計額が減少して、直物為替先渡取引の想定元本の合計額が保有外貨建資産の時価総額の合計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直物為替先渡取引の一部の解約（反対の売買による解消を含む。）を指図するものとします。
  4. 前記3.においてマザーファンドの信託財産にかかる直物為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる直物為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
  5. 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。
  6. 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がその影響を受け下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

##### ・為替変動リスク

為替相場は、各国の経済状況、金利動向、政治情勢等のさまざまな要因により変動します。当ファンドは、実質的に外貨建資産に投資を行いますので、投資先の通貨に対して円高となった場合には、基準価額の下落要因となります。また当ファンドは原則として為替ヘッジにより為替変動リスクの一部低減を図っていますが、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戻りに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

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

#### （2）リスク管理体制

##### 委託会社における投資リスクに対する管理体制

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

運用評価委員会は、運用実績、流動性リスクを含む運用リスクの状況、主な投資制限等の遵守状況および運用事務状況等を確認することを通じ、信託財産の適切な運用に寄与することを目的に運用部門に対

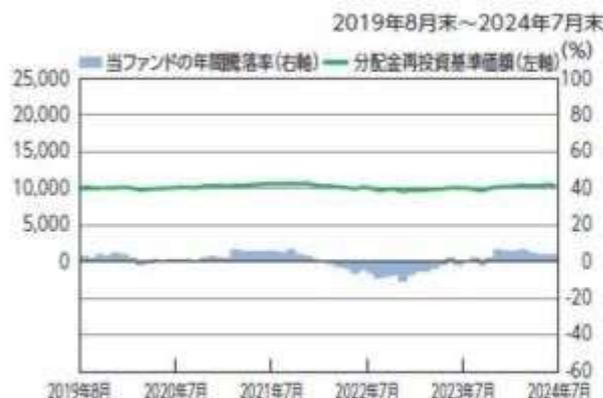
する管理・指導、改善提案等を行います。なお、流動性リスクについては、緊急時対応策の有効性検証結果や流動性リスク管理プロセスの見直し結果についても確認を行います。  
運用リスクを管理する部門は、運用業務等に係る情報のうち、経営に重要な影響を与えるまたは受益者の利益が著しく阻害される一切の事案についてはすみやかに、また法令・主な投資制限等の遵守状況については定期的に取締役会等に報告します。

上記体制は2024年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】

### りそなラップ型ファンド(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

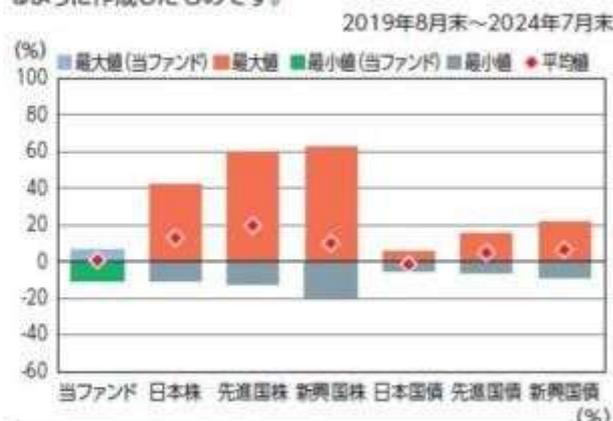


- \* 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。2019年8月末を10,000として指数化しております。
- \* 年間騰落率は、2019年8月から2024年7月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

\* 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	6.6	42.1	59.8	62.7	5.4	15.3	21.5
最小値	△10.3	△10.8	△12.4	△19.4	△5.5	△6.1	△8.8
平均値	0.9	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。

### りそなラップ型ファンド(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

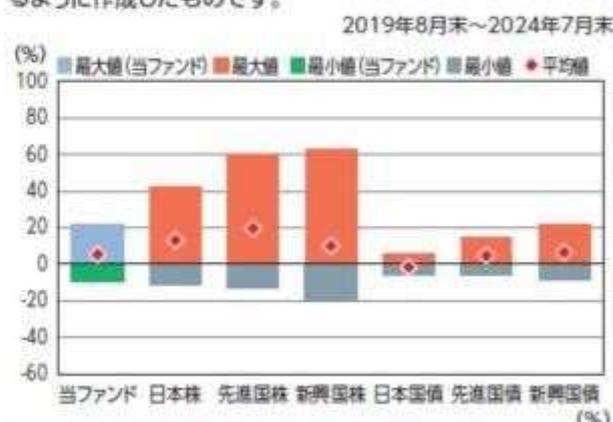


- \* 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。2019年8月末を10,000として指数化しております。
- \* 年間騰落率は、2019年8月から2024年7月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

\* 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	21.6	42.1	59.8	62.7	5.4	15.3	21.5
最小値	△9.1	△10.8	△12.4	△19.4	△5.5	△6.1	△8.8
平均値	5.4	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。

## りそなラップ型ファンド(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。2019年8月末を10,000として指数化しております。
- \* 年間騰落率は、2019年8月から2024年7月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

※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	41.0	42.1	59.8	62.7	5.4	15.3	21.5
最小値	△16.4	△10.8	△12.4	△19.4	△5.5	△6.1	△8.8
平均値	11.0	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、当該騰落率に關連して資産運用または投資判断をした結果生じた損害等、当該騰落率の利用に起因する損害及び一切の問題について、何らの責任も負いません。

## 東証株価指数(TOPIX、配当込み)

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

## MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み、円ベース)

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

## MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)

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

## NOMURA-BPI国債

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

## FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより開発され、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、JP Morgan Securities LLCが開発し、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、JP 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（スイッチングの際の申込手数料を含みます。）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%）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。

<りそなラップ型ファンド(安定型)>  
年率0.66%(税抜0.60%)  
<りそなラップ型ファンド(安定成長型)>  
年率1.10%(税抜1.00%)  
<りそなラップ型ファンド(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
りそなラップ型ファンド(安定型)	0.60%	0.28%	0.28%	0.04%
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	1.00%	0.48%	0.48%	
りそなラップ型ファンド(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。
- ・安定型および安定成長型は、NISAの「成長投資枠(特定非課税管理勘定)」の対象、成長型は、NISAの「成長投資枠(特定非課税管理勘定)」および「つみたて投資枠(特定累積投資勘定)」の対象ですが、販売会社により取扱いが異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

#### 個人受益者の場合

- 1) 収益分配金に対する課税  
収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については配当所得として、20.315%(所得税15.315%および地方税5%)の税率による源泉徴収(原則として、確定申告は不要です。)が行なわれます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税(配当控除の適用はありません。)のいずれかを選択することもできます。
- 2) 解約金および償還金に対する課税  
解約時および償還時の差益(譲渡益)\*については譲渡所得として、20.315%(所得税15.315%および地方税5%)の税率による申告分離課税の対象となり、確定申告が必要となります。なお、源泉徴収ありの特定口座(源泉徴収選択口座)を選択している場合は、20.315%(所得税15.315%および地方税5%)の税率による源泉徴収(原則として、確定申告は不要です。)が行なわれます。

\* 解約価額および償還価額から取得費用(申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額を含みます。)を控除した利益

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

#### 少額投資非課税制度「愛称：NISA(ニーサ)」をご利用の場合

NISAは、少額上場株式等に関する非課税制度です。

NISAをご利用の場合、一定の額を上限として、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が無期限で非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設し、税法上の要件を満たした商品を購入するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。なお、他の口座で生じた配当所得・譲渡所得との損益通算はできません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

#### 法人受益者の場合

- 1) 収益分配金、解約金、償還金に対する課税  
収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については配当所得として、15.315%(所得税のみ)の税率による源泉徴収が行なわれます。源泉徴収された税金は、所有期間に応じて法人税から控除される場合があります。
  - 2) 益金不算入制度の適用  
益金不算入制度は適用されません。
- 買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

#### 個別元本

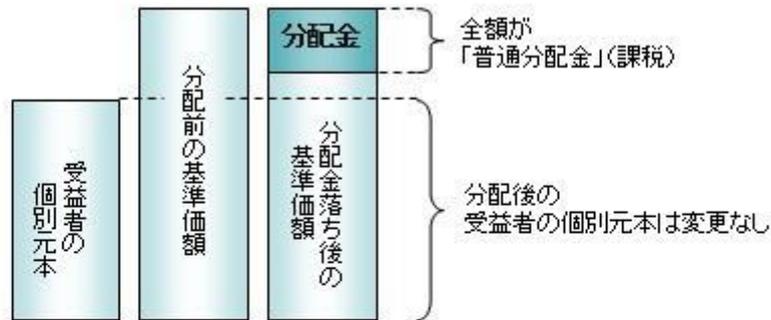
- 1) 各受益者の買付時の基準価額(申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額は含まれません。)が個別元本になります。
- 2) 受益者が同一ファンドを複数回お申込みの場合、1口当たりの個別元本は、申込口数で加重平均した値となります。ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。

#### 普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

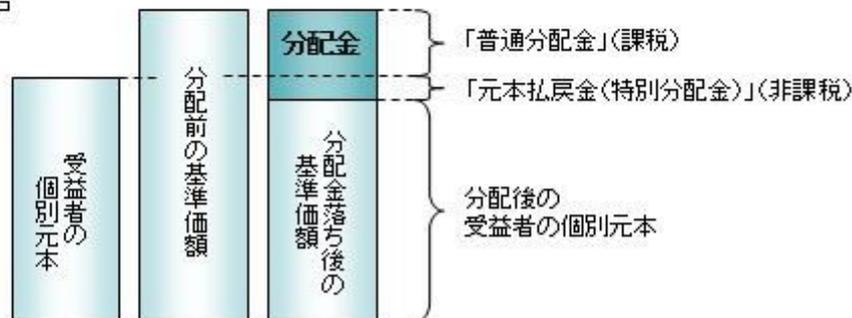
- 1) 収益分配金には課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」(元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。
- 2) 受益者が収益分配金を受け取る際
  - イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。
  - ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。
- 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。

## &lt;分配金に関するイメージ図&gt;

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	0.69%	0.66%	0.03%
安定成長型	1.14%	1.10%	0.04%
成長型	1.25%	1.20%	0.05%

※対象期間は2023年1月26日～2024年1月25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】

## 【りそなラップ型ファンド(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	48,221,178,575	99.71
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		141,440,933	0.29
合計(純資産総額)		48,362,619,508	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	R M先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	24,672,739,244	0.8458	20,868,202,853	0.8468	20,892,875,591	43.20
日本	親投資信託受益証券	R M国内債券マザーファンド	12,355,716,165	0.9828	12,143,197,847	0.9703	11,988,751,394	24.79
日本	親投資信託受益証券	R M先進国株式マザーファンド	1,639,976,086	3.1621	5,185,768,382	3.2053	5,256,615,348	10.87
日本	親投資信託受益証券	R M国内株式マザーファンド	1,900,092,180	2.1316	4,050,346,749	2.1775	4,137,450,721	8.56
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	869,206,621	1.6776	1,458,236,740	1.8170	1,579,348,430	3.27
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	928,414,414	1.4361	1,333,295,940	1.3980	1,297,923,350	2.68
日本	親投資信託受益証券	R M先進国債券マザーファンド	921,262,487	1.2259	1,129,424,959	1.2863	1,185,019,937	2.45
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	673,969,392	1.3653	920,211,698	1.3973	941,737,431	1.95
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	463,703,085	1.7947	832,246,356	2.0303	941,456,373	1.95

## ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.71
合計	99.71

## 【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 (2017年 1月25日)	20,784	20,784	1.0185	1.0185
第2計算期間末 (2018年 1月25日)	22,683	22,683	1.0567	1.0567
第3計算期間末 (2019年 1月25日)	25,807	25,807	1.0330	1.0330
第4計算期間末 (2020年 1月27日)	30,465	30,465	1.0764	1.0764
第5計算期間末 (2021年 1月25日)	42,570	42,570	1.1028	1.1028
第6計算期間末 (2022年 1月25日)	55,845	55,845	1.1121	1.1121
第7計算期間末 (2023年 1月25日)	52,737	52,737	1.0401	1.0401
第8計算期間末 (2024年 1月25日)	50,932	50,932	1.0843	1.0843
2023年 7月末日	52,761		1.0695	
8月末日	52,336		1.0678	
9月末日	51,115		1.0462	
10月末日	49,796		1.0306	

11月末日	51,017		1.0691
12月末日	51,267		1.0863
2024年 1月末日	51,237		1.0889
2月末日	50,755		1.0948
3月末日	50,755		1.1090
4月末日	49,665		1.0990
5月末日	48,867		1.0987
6月末日	49,337		1.1166
7月末日	48,362		1.1100

## 【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2016年 2月26日～2017年 1月25日	0.0000
第2期	2017年 1月26日～2018年 1月25日	0.0000
第3期	2018年 1月26日～2019年 1月25日	0.0000
第4期	2019年 1月26日～2020年 1月27日	0.0000
第5期	2020年 1月28日～2021年 1月25日	0.0000
第6期	2021年 1月26日～2022年 1月25日	0.0000
第7期	2022年 1月26日～2023年 1月25日	0.0000
第8期	2023年 1月26日～2024年 1月25日	0.0000
当中間期	2024年 1月26日～2024年 7月25日	

## 【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1期	2016年 2月26日～2017年 1月25日	1.85
第2期	2017年 1月26日～2018年 1月25日	3.75
第3期	2018年 1月26日～2019年 1月25日	2.24
第4期	2019年 1月26日～2020年 1月27日	4.20
第5期	2020年 1月28日～2021年 1月25日	2.45
第6期	2021年 1月26日～2022年 1月25日	0.84
第7期	2022年 1月26日～2023年 1月25日	6.47
第8期	2023年 1月26日～2024年 1月25日	4.25
当中間期	2024年 1月26日～2024年 7月25日	1.90

(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	2016年 2月26日～2017年 1月25日	25,381,905,439	4,973,752,236
第2期	2017年 1月26日～2018年 1月25日	6,097,994,810	5,039,903,818
第3期	2018年 1月26日～2019年 1月25日	7,006,194,546	3,489,739,773
第4期	2019年 1月26日～2020年 1月27日	8,485,272,377	5,165,483,563
第5期	2020年 1月28日～2021年 1月25日	16,343,902,608	6,042,857,533

第6期	2021年 1月26日～2022年 1月25日	17,991,903,564	6,378,710,842
第7期	2022年 1月26日～2023年 1月25日	6,025,270,820	5,539,188,136
第8期	2023年 1月26日～2024年 1月25日	2,801,853,137	6,531,050,641
当中間期	2024年 1月26日～2024年 7月25日	1,579,874,100	4,950,096,611

(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。

### 【りそなラップ型ファンド（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	81,526,808,722	99.71
コール・ローン等・その他資産（負債控除後）		240,635,966	0.29
合計（純資産総額）		81,767,444,688	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	R M先進国株式マザーファンド	8,425,154,852	3.0045	25,313,377,753	3.2053	27,005,148,847	33.03
日本	親投資信託受益証券	R M先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	21,809,794,772	0.8432	18,390,018,952	0.8468	18,468,534,212	22.59
日本	親投資信託受益証券	R M国内債券マザーファンド	13,505,443,716	0.9793	13,225,881,032	0.9703	13,104,332,037	16.03
日本	親投資信託受益証券	R M国内株式マザーファンド	4,943,473,314	2.1169	10,464,860,332	2.1775	10,764,413,141	13.16
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	1,964,052,964	1.8066	3,548,382,676	2.0303	3,987,616,732	4.88
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	1,517,361,679	1.6764	2,543,848,686	1.8170	2,757,046,170	3.37
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	1,602,519,347	1.4329	2,296,249,973	1.3980	2,240,322,047	2.74
日本	親投資信託受益証券	R M先進国債券マザーファンド	1,245,441,407	1.2327	1,535,315,626	1.2863	1,602,011,281	1.96
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	1,143,193,484	1.3704	1,566,684,602	1.3973	1,597,384,255	1.95

##### ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.71
合計	99.71

##### 【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 (2017年 1月25日)	11,533	11,533	1.0254	1.0254
第2計算期間末 (2018年 1月25日)	13,222	13,222	1.1092	1.1092
第3計算期間末 (2019年 1月25日)	15,814	15,814	1.0460	1.0460
第4計算期間末 (2020年 1月27日)	21,818	21,818	1.1280	1.1280
第5計算期間末 (2021年 1月25日)	27,905	27,905	1.1726	1.1726
第6計算期間末 (2022年 1月25日)	46,339	46,339	1.2410	1.2410
第7計算期間末 (2023年 1月25日)	55,976	55,976	1.2008	1.2008
第8計算期間末 (2024年 1月25日)	67,554	67,554	1.3618	1.3618
2023年 7月末日	62,051		1.3098	
8月末日	62,579		1.3146	
9月末日	62,210		1.2865	
10月末日	61,140		1.2572	
11月末日	64,271		1.3215	
12月末日	66,262		1.3411	
2024年 1月末日	68,438		1.3692	
2月末日	71,243		1.3984	
3月末日	74,980		1.4310	
4月末日	75,069		1.4302	
5月末日	77,486		1.4407	
6月末日	81,784		1.4831	
7月末日	81,767		1.4501	

## 【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2016年 2月26日～2017年 1月25日	0.0000
第2期	2017年 1月26日～2018年 1月25日	0.0000
第3期	2018年 1月26日～2019年 1月25日	0.0000
第4期	2019年 1月26日～2020年 1月27日	0.0000
第5期	2020年 1月28日～2021年 1月25日	0.0000
第6期	2021年 1月26日～2022年 1月25日	0.0000
第7期	2022年 1月26日～2023年 1月25日	0.0000
第8期	2023年 1月26日～2024年 1月25日	0.0000
当中間期	2024年 1月26日～2024年 7月25日	

## 【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1期	2016年 2月26日～2017年 1月25日	2.54
第2期	2017年 1月26日～2018年 1月25日	8.17
第3期	2018年 1月26日～2019年 1月25日	5.70

第4期	2019年 1月26日～2020年 1月27日	7.84
第5期	2020年 1月28日～2021年 1月25日	3.95
第6期	2021年 1月26日～2022年 1月25日	5.83
第7期	2022年 1月26日～2023年 1月25日	3.24
第8期	2023年 1月26日～2024年 1月25日	13.41
当中間期	2024年 1月26日～2024年 7月25日	6.13

(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	2016年 2月26日～2017年 1月25日	13,938,406,425	2,689,976,686
第2期	2017年 1月26日～2018年 1月25日	3,629,066,210	2,956,644,450
第3期	2018年 1月26日～2019年 1月25日	5,192,436,946	1,994,834,117
第4期	2019年 1月26日～2020年 1月27日	6,629,563,738	2,405,436,519
第5期	2020年 1月28日～2021年 1月25日	8,246,883,187	3,790,679,482
第6期	2021年 1月26日～2022年 1月25日	18,505,700,189	4,964,755,424
第7期	2022年 1月26日～2023年 1月25日	13,294,353,008	4,020,070,867
第8期	2023年 1月26日～2024年 1月25日	10,746,713,419	7,753,483,620
当中間期	2024年 1月26日～2024年 7月25日	10,590,754,744	4,076,658,563

(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。

#### 【りそなラップ型ファンド（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	58,343,976,766	99.71
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		169,428,387	0.29
合計（純資産総額）		58,513,405,153	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	R M先進国株式マザーファンド	8,629,146,899	2.9780	25,697,599,466	3.2053	27,659,004,555	47.27
日本	親投資信託受益証券	R M国内株式マザーファンド	4,491,269,088	2.1001	9,432,514,279	2.1775	9,779,738,439	16.71
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	2,938,833,398	1.8197	5,347,993,183	2.0303	5,966,713,447	10.20
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	2,768,703,357	1.6524	4,575,125,427	1.8170	5,030,733,999	8.60
日本	親投資信託受益証券	R M国内債券マザーファンド	3,971,724,471	0.9769	3,879,977,636	0.9703	3,853,764,254	6.59

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	2,281,470,169	1.4300	3,262,502,342	1.3980	3,189,495,296	5.45
日本	親投資信託受益証券	R M先進国債券マザーファンド	893,212,145	1.2369	1,104,814,103	1.2863	1,148,938,782	1.96
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	819,477,787	1.3739	1,125,881,280	1.3973	1,145,056,311	1.96
日本	親投資信託受益証券	R M先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	673,750,217	0.8358	563,120,432	0.8468	570,531,683	0.98

#### ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.71
合計	99.71

#### 【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 (2017年 1月25日)	4,579	4,579	1.0940	1.0940
第2計算期間末 (2018年 1月25日)	5,569	5,569	1.2340	1.2340
第3計算期間末 (2019年 1月25日)	7,562	7,562	1.1363	1.1363
第4計算期間末 (2020年 1月27日)	11,154	11,154	1.3102	1.3102
第5計算期間末 (2021年 1月25日)	14,999	14,999	1.3197	1.3197
第6計算期間末 (2022年 1月25日)	25,917	25,917	1.4980	1.4980
第7計算期間末 (2023年 1月25日)	34,023	34,023	1.5379	1.5379
第8計算期間末 (2024年 1月25日)	44,689	44,689	1.8872	1.8872
2023年 7月末日	38,855		1.7701	
8月末日	39,671		1.7856	
9月末日	39,445		1.7472	
10月末日	38,815		1.6917	
11月末日	41,430		1.8014	
12月末日	42,295		1.8274	
2024年 1月末日	45,310		1.8988	
2月末日	48,200		1.9651	
3月末日	51,042		2.0353	
4月末日	52,798		2.0521	
5月末日	55,034		2.0788	
6月末日	58,719		2.1644	
7月末日	58,513		2.0896	

#### 【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2016年 2月26日～2017年 1月25日	0.0000
第2期	2017年 1月26日～2018年 1月25日	0.0000
第3期	2018年 1月26日～2019年 1月25日	0.0000
第4期	2019年 1月26日～2020年 1月27日	0.0000
第5期	2020年 1月28日～2021年 1月25日	0.0000
第6期	2021年 1月26日～2022年 1月25日	0.0000
第7期	2022年 1月26日～2023年 1月25日	0.0000
第8期	2023年 1月26日～2024年 1月25日	0.0000
当中間期	2024年 1月26日～2024年 7月25日	

## 【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1期	2016年 2月26日～2017年 1月25日	9.40
第2期	2017年 1月26日～2018年 1月25日	12.80
第3期	2018年 1月26日～2019年 1月25日	7.92
第4期	2019年 1月26日～2020年 1月27日	15.30
第5期	2020年 1月28日～2021年 1月25日	0.73
第6期	2021年 1月26日～2022年 1月25日	13.51
第7期	2022年 1月26日～2023年 1月25日	2.66
第8期	2023年 1月26日～2024年 1月25日	22.71
当中間期	2024年 1月26日～2024年 7月25日	10.44

(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	2016年 2月26日～2017年 1月25日	5,825,054,815	1,639,445,533
第2期	2017年 1月26日～2018年 1月25日	2,050,607,361	1,722,691,092
第3期	2018年 1月26日～2019年 1月25日	3,485,323,161	1,344,051,033
第4期	2019年 1月26日～2020年 1月27日	4,205,065,813	2,346,609,085
第5期	2020年 1月28日～2021年 1月25日	5,660,248,833	2,807,367,924
第6期	2021年 1月26日～2022年 1月25日	8,389,590,851	2,453,741,504
第7期	2022年 1月26日～2023年 1月25日	7,028,388,102	2,206,080,560
第8期	2023年 1月26日～2024年 1月25日	6,766,220,056	5,210,153,030
当中間期	2024年 1月26日～2024年 7月25日	5,799,162,483	1,630,288,276

(注)第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

## (参考)

## RM国内債券マザーファンド

以下の運用状況は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	192,906,959,020	85.37
地方債証券	日本	10,964,451,805	4.85
特殊債証券	日本	11,115,864,685	4.92
社債証券	日本	9,345,735,000	4.14
	フランス	498,284,000	0.22
	小計	9,844,019,000	4.36
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		1,147,288,718	0.51
合計（純資産総額）		225,978,583,228	100.00

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第147回利付国債(5年)	3,320,000,000	99.90	3,316,779,600	99.40	3,300,312,400	0.005	2026/3/20	1.46
日本	国債証券	第153回利付国債(5年)	3,070,000,000	99.46	3,053,453,600	98.63	3,028,063,800	0.005	2027/6/20	1.34
日本	国債証券	第148回利付国債(5年)	3,040,000,000	99.78	3,033,327,700	99.20	3,015,832,000	0.005	2026/6/20	1.33
日本	国債証券	第149回利付国債(5年)	2,810,000,000	99.66	2,800,686,800	99.07	2,784,119,900	0.005	2026/9/20	1.23
日本	国債証券	第158回利付国債(5年)	2,820,000,000	99.34	2,801,467,600	98.41	2,775,274,800	0.100	2028/3/20	1.23
日本	国債証券	第150回利付国債(5年)	2,760,000,000	99.37	2,742,623,800	98.93	2,730,661,200	0.005	2026/12/20	1.21
日本	国債証券	第367回日本国債(10年)	2,850,000,000	96.34	2,745,754,100	94.95	2,706,103,500	0.200	2032/6/20	1.20
日本	国債証券	第366回日本国債(10年)	2,820,000,000	96.68	2,726,519,700	95.27	2,686,670,400	0.200	2032/3/20	1.19
日本	国債証券	第362回利付国債(10年)	2,780,000,000	97.01	2,697,002,500	95.80	2,663,295,600	0.100	2031/3/20	1.18
日本	国債証券	第359回利付国債(10年)	2,680,000,000	97.96	2,625,577,600	96.55	2,587,647,200	0.100	2030/6/20	1.15
日本	国債証券	第369回日本国債(10年)	2,660,000,000	98.15	2,610,827,000	96.69	2,572,007,200	0.500	2032/12/20	1.14
日本	国債証券	第146回利付国債(5年)	2,430,000,000	100.12	2,432,988,900	99.68	2,422,442,700	0.100	2025/12/20	1.07
日本	国債証券	第370回利付国債(10年)	2,460,000,000	97.65	2,402,396,600	96.44	2,372,620,800	0.500	2033/3/20	1.05
日本	国債証券	第368回日本国債(10年)	2,440,000,000	96.08	2,344,563,700	94.62	2,308,752,400	0.200	2032/9/20	1.02
日本	国債証券	第152回利付国債(5年)	2,330,000,000	99.85	2,326,716,000	99.03	2,307,562,100	0.100	2027/3/20	1.02
日本	国債証券	第360回利付国債(10年)	2,390,000,000	97.57	2,331,929,400	96.32	2,302,215,300	0.100	2030/9/20	1.02
日本	国債証券	第453回利付国債(2年)	2,300,000,000	99.83	2,296,316,500	99.68	2,292,640,000	0.005	2025/10/1	1.01
日本	国債証券	第364回利付国債(10年)	2,370,000,000	96.40	2,284,691,100	95.17	2,255,694,900	0.100	2031/9/20	1.00
日本	国債証券	第365回利付国債(10年)	2,370,000,000	96.10	2,277,806,300	94.85	2,248,016,100	0.100	2031/12/20	0.99
日本	国債証券	第356回利付国債(10年)	2,310,000,000	98.31	2,271,080,000	97.14	2,244,049,500	0.100	2029/9/20	0.99

日本	国債証券	第156回利付国債(5年)	2,260,000,000	99.71	2,253,605,000	98.91	2,235,546,800	0.200	2027/12/20	0.99
日本	国債証券	第361回利付国債(10年)	2,280,000,000	97.41	2,221,027,700	96.06	2,190,327,600	0.100	2030/12/20	0.97
日本	国債証券	第154回利付国債(5年)	2,180,000,000	99.51	2,169,471,400	98.74	2,152,728,200	0.100	2027/9/20	0.95
日本	国債証券	第357回利付国債(10年)	2,210,000,000	98.32	2,173,077,000	96.96	2,142,838,100	0.100	2029/12/20	0.95
日本	国債証券	第358回利付国債(10年)	2,180,000,000	98.03	2,137,262,000	96.77	2,109,673,200	0.100	2030/3/20	0.93
日本	国債証券	第161回利付国債(5年)	2,120,000,000	99.77	2,115,126,000	98.97	2,098,227,600	0.300	2028/6/20	0.93
日本	国債証券	第373回利付国債(10年)	2,100,000,000	98.16	2,061,518,400	96.40	2,024,442,000	0.600	2033/12/20	0.90
日本	国債証券	第363回利付国債(10年)	2,050,000,000	96.91	1,986,682,100	95.49	1,957,627,000	0.100	2031/6/20	0.87
日本	国債証券	第353回利付国債(10年)	1,950,000,000	98.96	1,929,759,000	97.80	1,907,100,000	0.100	2028/12/20	0.84
日本	国債証券	第371回利付国債(10年)	1,950,000,000	97.19	1,895,236,600	95.29	1,858,311,000	0.400	2033/6/20	0.82

#### ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	85.37
地方債証券	4.85
特殊債券	4.92
社債券	4.36
合計	99.49

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

#### R M先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)

以下の運用状況は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	62,682,651,587	44.38
	カナダ	2,684,765,583	1.90
	メキシコ	1,015,838,614	0.72
	ドイツ	8,199,433,249	5.81
	イタリア	9,414,862,491	6.67
	フランス	10,209,028,425	7.23
	オランダ	1,973,316,869	1.40
	スペイン	6,202,017,738	4.39
	ベルギー	2,191,616,854	1.55
	オーストリア	1,544,500,854	1.09
	フィンランド	714,771,447	0.51

アイルランド	654,554,663	0.46
イギリス	7,036,561,911	4.98
スウェーデン	214,970,741	0.15
ノルウェー	209,222,699	0.15
デンマーク	353,707,926	0.25
ポーランド	732,034,154	0.52
オーストラリア	1,691,564,004	1.20
ニュージーランド	327,698,798	0.23
シンガポール	531,564,894	0.38
マレーシア	661,198,122	0.47
中国	13,594,119,886	9.62
イスラエル	419,502,190	0.30
小計	133,259,503,699	94.34
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	7,987,602,625	5.66
合計(純資産総額)	141,247,106,324	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		133,390,351,277	94.44

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,320,000	15,529.06	826,146,141	15,662.01	833,219,418	4.500	2033/11/15	0.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,590,000	14,038.43	644,364,183	14,327.27	657,621,960	0.375	2026/1/31	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,040,000	14,169.78	572,459,151	14,399.32	581,732,831	3.375	2033/5/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,430,000	12,788.78	566,543,107	13,060.41	578,576,430	1.875	2032/2/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,180,000	12,714.27	531,456,514	13,050.59	545,514,697	1.625	2031/5/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,220,000	12,201.75	514,913,858	12,580.46	530,895,762	0.875	2030/11/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,500,000	14,780.85	517,329,770	15,071.31	527,495,991	4.000	2034/2/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,600,000	14,564.38	524,317,796	14,557.72	524,078,001	3.500	2033/2/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,730,000	13,733.59	512,263,187	14,004.82	522,380,142	2.875	2032/5/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,770,000	13,550.28	510,845,800	13,835.71	521,606,509	2.750	2032/8/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,520,000	14,341.90	504,834,893	14,515.14	510,933,148	2.375	2027/5/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,960,000	12,312.57	487,578,120	12,652.22	501,028,002	1.375	2031/11/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,930,000	12,421.47	488,164,090	12,712.95	499,619,327	1.125	2031/2/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,470,000	14,085.93	488,782,092	14,337.99	497,528,404	0.750	2026/3/31	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,870,000	12,094.73	468,066,365	12,463.16	482,324,323	0.625	2030/8/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,220,000	14,295.26	460,307,586	14,510.38	467,234,316	1.625	2026/5/15	0.33
中国	国債証券	GOV OF CHINA	20,910,000	2,107.84	440,750,382	2,121.54	443,614,158	2.220	2025/9/25	0.31
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,960,000	14,804.97	438,227,195	14,940.01	442,224,388	3.875	2033/8/15	0.31
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,870,000	15,095.80	433,249,483	15,263.35	438,058,222	4.125	2032/11/15	0.31
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,980,000	14,148.93	421,638,200	14,575.75	434,357,598	0.250	2025/7/31	0.31

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,720,000	15,186.12	413,062,495	15,523.87	422,249,272	4.375	2034/5/15	0.30
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,330,000	12,283.89	409,053,676	12,623.04	420,347,374	1.250	2031/8/15	0.30
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,000,000	13,364.40	400,932,087	13,716.02	411,480,813	1.250	2028/5/31	0.29
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,580,000	15,310.16	395,002,238	15,618.25	402,950,902	4.625	2029/4/30	0.29
中国	国債証券	GOV OF CHINA	18,100,000	2,118.55	383,458,981	2,162.36	391,387,928	2.550	2028/10/15	0.28
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,400,000	16,247.05	389,929,325	16,119.33	386,864,139	4.750	2053/11/15	0.27
中国	国債証券	GOV OF CHINA	17,980,000	2,121.08	381,370,711	2,137.48	384,320,155	2.390	2026/11/15	0.27
中国	国債証券	GOV OF CHINA	17,460,000	2,165.35	378,070,137	2,197.24	383,639,088	3.010	2028/5/13	0.27
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,770,000	13,395.06	371,043,427	13,741.93	380,651,461	1.250	2028/4/30	0.27
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,770,000	13,198.26	365,591,998	13,584.13	376,280,423	0.750	2028/1/31	0.27

#### ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	94.34
合計	94.34

#### 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	411,734,900.00	66,013,676,294	62,717,709,257	44.40
	カナダドル	売建	24,194,000.00	2,826,110,839	2,660,130,300	1.88
	メキシコペソ	売建	127,366,000.00	1,095,448,789	1,030,632,934	0.73
	ユーロ	売建	248,631,700.00	42,672,130,890	40,975,828,354	29.01
	英ポンド	売建	36,202,100.00	7,326,199,140	7,081,946,879	5.01
	スウェーデンクローナ	売建	15,053,000.00	226,796,595	213,049,624	0.15
	ノルウェークローネ	売建	15,053,000.00	226,055,079	209,563,349	0.15
	デンマーククローネ	売建	15,939,000.00	366,651,298	352,065,413	0.25
	ポーランドズロチ	売建	19,415,000.00	771,384,547	745,574,830	0.53
	オーストラリアドル	売建	17,049,000.00	1,811,714,491	1,697,637,126	1.20
	ニュージーランドドル	売建	3,596,000.00	349,379,405	323,400,146	0.23
	シンガポールドル	売建	4,642,000.00	548,381,882	527,331,200	0.37
	マレーシアリングット	売建	19,420,000.00	660,858,716	641,087,214	0.45
	中国元	売建	655,845,000.00	14,505,341,186	13,797,349,665	9.77
	イスラエルシケル	売建	10,246,000.00	438,328,339	417,044,986	0.30

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

#### R M先進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（％）
国債証券	アメリカ	15,600,110,966	46.49

カナダ	657,565,131	1.96
メキシコ	249,020,992	0.74
ドイツ	2,040,475,175	6.08
イタリア	2,344,052,210	6.99
フランス	2,537,840,021	7.56
オランダ	483,409,241	1.44
スペイン	1,541,344,973	4.59
ベルギー	538,158,035	1.60
オーストリア	383,019,189	1.14
フィンランド	178,939,655	0.53
アイルランド	162,725,198	0.48
イギリス	1,749,334,015	5.21
スウェーデン	52,899,202	0.16
ノルウェー	51,942,428	0.15
デンマーク	88,483,636	0.26
ポーランド	182,869,822	0.54
オーストラリア	416,239,697	1.24
ニュージーランド	80,998,933	0.24
シンガポール	132,198,878	0.39
マレーシア	165,096,803	0.49
中国	3,386,512,222	10.09
イスラエル	104,493,210	0.31
小計	33,127,729,632	98.72
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	429,909,326	1.28
合計(純資産総額)	33,557,638,958	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 (%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,320,000	14,076.30	185,807,287	14,316.55	188,978,559	0.500	2026/2/28	0.56
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,190,000	15,686.99	186,675,213	15,662.01	186,378,027	4.500	2033/11/15	0.56
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,270,000	14,165.01	179,895,634	14,435.35	183,328,987	0.250	2025/10/31	0.55
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,250,000	13,692.16	171,152,010	13,835.71	172,946,454	2.750	2032/8/15	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,330,000	12,407.09	165,014,318	12,623.04	167,886,489	1.250	2031/8/15	0.50
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,100,000	15,254.97	167,804,733	15,177.30	166,950,383	4.250	2026/1/31	0.50
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,140,000	14,221.87	162,129,408	14,336.20	163,432,770	2.625	2029/2/15	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,130,000	14,121.54	159,573,418	14,372.53	162,409,605	0.375	2025/12/31	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,110,000	14,466.55	160,578,771	14,557.42	161,587,412	2.875	2028/8/15	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,200,000	12,344.59	148,135,095	12,580.46	150,965,619	0.875	2030/11/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,050,000	13,935.15	146,319,176	14,162.33	148,704,475	0.625	2026/7/31	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	950,000	15,444.07	146,718,736	15,502.43	147,273,116	4.375	2030/11/30	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,030,000	13,945.58	143,639,477	14,162.33	145,872,008	0.750	2026/8/31	0.43

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,000,000	14,246.58	142,465,898	14,524.07	145,240,783	0.250	2025/8/31	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,000,000	14,084.62	140,846,223	14,304.05	143,040,525	0.750	2026/4/30	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	950,000	14,842.92	141,007,775	14,940.01	141,930,124	3.875	2033/8/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	980,000	14,155.48	138,723,734	14,413.02	141,247,628	0.375	2025/11/30	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	900,000	15,576.31	140,186,872	15,557.21	140,014,949	4.625	2028/9/30	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	900,000	15,179.09	136,611,845	15,193.98	136,745,825	4.000	2028/6/30	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,020,000	12,832.33	130,889,849	13,050.59	133,116,025	1.625	2031/5/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	930,000	13,995.30	130,156,309	14,133.15	131,438,323	2.375	2029/5/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,000,000	12,876.60	128,766,068	13,060.41	130,604,161	1.875	2032/2/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	850,000	15,405.96	130,950,724	15,351.77	130,490,128	4.625	2026/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	890,000	14,312.59	127,382,065	14,399.32	128,154,014	3.375	2033/5/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	900,000	14,026.26	126,236,398	14,207.28	127,865,600	1.250	2026/12/31	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	880,000	14,355.56	126,328,934	14,510.38	127,691,366	1.625	2026/5/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	860,000	14,661.67	126,090,441	14,793.23	127,221,779	2.250	2025/11/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,000,000	12,519.89	125,198,972	12,712.96	127,129,600	1.125	2031/2/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	870,000	14,474.17	125,925,349	14,557.72	126,652,183	3.500	2033/2/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	840,000	14,957.28	125,641,165	14,995.39	125,961,291	3.625	2028/3/31	0.38

#### ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	98.72
合計	98.72

#### 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国内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	日本	152,381,586,200	99.51
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		755,290,237	0.49
合計(純資産総額)		153,136,876,437	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	587,370,000	0.38

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

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

### イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	2,058,300	3,137.11	6,457,125,398	2,949.00	6,069,926,700	3.96
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	2,322,300	1,463.72	3,399,207,789	1,750.00	4,064,025,000	2.65
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	271,100	13,846.21	3,753,708,161	13,530.00	3,667,983,000	2.40
日本	株式	日立製作所	電気機器	939,700	2,529.36	2,376,846,062	3,288.00	3,089,733,600	2.02
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	267,000	8,298.82	2,215,786,100	10,915.00	2,914,305,000	1.90
日本	株式	キーエンス	電気機器	38,700	66,649.40	2,579,331,982	65,890.00	2,549,943,000	1.67
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	81,900	30,834.09	2,525,312,679	31,020.00	2,540,538,000	1.66
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	286,700	6,415.33	1,839,277,447	8,658.00	2,482,248,600	1.62
日本	株式	三菱商事	卸売業	786,600	2,847.35	2,239,731,831	3,144.00	2,473,070,400	1.61
日本	株式	信越化学工業	化学	347,800	6,044.59	2,102,309,272	6,748.00	2,346,954,400	1.53

日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	372,300	4,315.60	1,606,698,934	6,022.00	2,241,990,600	1.46
日本	株式	三井物産	卸売業	613,700	3,222.85	1,977,867,514	3,530.00	2,166,361,000	1.41
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	275,400	6,817.27	1,877,477,304	7,783.00	2,143,438,200	1.40
日本	株式	第一三共	医薬品	338,300	4,634.93	1,567,999,230	6,148.00	2,079,868,400	1.36
日本	株式	任天堂	その他製品	244,500	8,056.91	1,969,915,037	8,388.00	2,050,866,000	1.34
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	11,551,100	178.79	2,065,247,392	160.40	1,852,796,440	1.21
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	514,700	2,830.92	1,457,076,452	3,448.00	1,774,685,600	1.16
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	191,600	7,450.42	1,427,501,370	9,162.00	1,755,439,200	1.15
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	917,400	1,656.71	1,519,867,028	1,647.00	1,510,957,800	0.99
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	343,700	4,289.49	1,474,299,301	4,302.00	1,478,597,400	0.97
日本	株式	HOYA	精密機器	76,200	18,597.87	1,417,157,954	18,940.00	1,443,228,000	0.94
日本	株式	KDDI	情報・通信業	285,600	4,727.24	1,350,100,233	4,520.00	1,290,912,000	0.84
日本	株式	三菱重工業	機械	683,900	1,153.49	788,877,150	1,830.00	1,251,537,000	0.82
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	620,400	1,952.15	1,211,116,670	1,965.00	1,219,086,000	0.80
日本	株式	村田製作所	電気機器	345,900	3,040.70	1,051,780,840	3,351.00	1,159,110,900	0.76
日本	株式	三菱電機	電気機器	428,400	2,310.88	989,981,520	2,601.00	1,114,268,400	0.73
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	231,700	3,976.45	921,344,731	4,434.00	1,027,357,800	0.67
日本	株式	ダイキン工業	機械	46,700	23,156.77	1,081,421,256	21,905.00	1,022,963,500	0.67
日本	株式	富士通	電気機器	359,900	2,246.46	808,504,533	2,732.50	983,426,750	0.64
日本	株式	丸紅	卸売業	339,800	2,602.79	884,428,809	2,860.50	971,997,900	0.63

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.08
		鉱業	0.30
		建設業	2.12
		食料品	3.21
		繊維製品	0.37
		パルプ・紙	0.15
		化学	5.71
		医薬品	4.79
		石油・石炭製品	0.53
		ゴム製品	0.63
		ガラス・土石製品	0.68
		鉄鋼	0.85
		非鉄金属	0.73
		金属製品	0.54
		機械	5.49
		電気機器	17.12
		輸送用機器	7.73
精密機器	2.25		
その他製品	2.42		

	電気・ガス業	1.38
	陸運業	2.29
	海運業	0.75
	空運業	0.35
	倉庫・運輸関連業	0.14
	情報・通信業	7.13
	卸売業	7.49
	小売業	4.01
	銀行業	8.30
	証券、商品先物取引業	0.94
	保険業	3.28
	その他金融業	1.21
	不動産業	2.01
	サービス業	4.54
合 計		99.51

## 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

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	21	日本円	582,516,550	587,370,000	0.38

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

## R M先進国株式マザーファンド

以下の運用状況は2024年 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	228,686,287,564	70.50
	カナダ	10,382,835,993	3.20
	パナマ	85,660,573	0.03
	ドイツ	7,362,551,575	2.27
	イタリア	1,832,900,581	0.57
	フランス	8,822,731,592	2.72
	オランダ	5,872,383,972	1.81
	スペイン	2,243,887,011	0.69
	ベルギー	676,689,122	0.21
	オーストリア	168,652,113	0.05
	ルクセンブルク	144,353,132	0.04
	フィンランド	857,548,303	0.26
	アイルランド	5,708,346,368	1.76

	ポルトガル	134,886,779	0.04
	イギリス	12,114,556,011	3.73
	スイス	9,701,347,761	2.99
	スウェーデン	2,720,418,481	0.84
	ノルウェー	494,699,243	0.15
	デンマーク	3,182,773,251	0.98
	ケイマン	390,048,180	0.12
	リベリア	201,224,206	0.06
	オーストラリア	5,776,443,299	1.78
	バミューダ	387,548,056	0.12
	ニュージーランド	223,171,475	0.07
	香港	1,144,285,800	0.35
	シンガポール	934,338,779	0.29
	イスラエル	632,246,177	0.19
	キュラソー	343,251,427	0.11
	ジャージー	959,461,814	0.30
	マン島	25,038,471	0.01
	小計	312,210,567,109	96.25
新株予約権証券	カナダ	0	0.00
投資証券	アメリカ	5,399,465,144	1.66
	カナダ	15,810,895	0.00
	フランス	106,197,404	0.03
	ベルギー	26,398,447	0.01
	イギリス	108,330,395	0.03
	オーストラリア	411,323,720	0.13
	香港	61,722,811	0.02
	シンガポール	75,711,927	0.02
	小計	6,204,960,743	1.91
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		5,945,317,624	1.83
合計（純資産総額）		324,360,845,476	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	4,963,656,005	1.53
	買建	ドイツ	1,059,696,910	0.33

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

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建		1,043,193,489	0.32
	売建		8,495,645,547	2.62

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	490,576	29,218.17	14,333,735,320	33,353.87	16,362,609,110	5.04
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	236,062	62,087.28	14,656,449,285	64,469.92	15,218,899,388	4.69
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	836,158	10,858.30	9,079,255,415	15,812.60	13,221,832,994	4.08
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	313,056	24,910.22	7,798,293,957	27,699.87	8,671,611,254	2.67
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	73,238	63,422.66	4,644,948,919	70,608.68	5,171,238,769	1.59
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	196,967	23,030.63	4,536,275,123	25,959.00	5,113,067,850	1.58
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	170,575	23,254.72	3,966,674,206	26,198.33	4,468,781,573	1.38
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	27,020	102,872.60	2,779,617,911	120,459.61	3,254,818,727	1.00
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	95,807	30,728.85	2,944,039,431	33,936.19	3,251,324,824	1.00
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	147,229	19,687.62	2,898,589,489	21,878.18	3,221,103,859	0.99
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	96,000	26,939.19	2,586,162,893	32,803.56	3,149,142,106	0.97
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	43,805	58,825.07	2,576,832,261	67,265.67	2,946,572,867	0.91
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	30,810	77,514.21	2,388,212,983	87,855.74	2,706,835,510	0.83
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	149,917	15,745.52	2,360,522,261	18,013.83	2,700,580,072	0.83
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	108,994	16,945.61	1,846,970,579	19,810.43	2,159,219,097	0.67
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	52,826	41,578.00	2,196,399,956	40,106.96	2,118,690,480	0.65
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	80,547	23,960.51	1,929,947,940	24,593.14	1,980,904,066	0.61
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	78,573	23,590.09	1,853,544,142	24,649.54	1,936,788,935	0.60
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	金融サービス	27,823	67,808.36	1,886,632,023	68,209.27	1,897,786,742	0.59
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	一般消費財・サービス流通・小売り	33,098	53,425.64	1,768,282,057	55,440.90	1,834,983,027	0.57
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	14,810	108,079.95	1,600,664,207	123,480.97	1,828,753,213	0.56
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	13,357	132,527.03	1,770,163,670	132,851.87	1,774,502,468	0.55

アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	59,177	25,289.79	1,496,574,258	28,472.74	1,684,931,524	0.52
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需品流通・小売り	147,950	8,519.87	1,260,515,004	10,547.32	1,560,476,527	0.48
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	237,203	5,222.59	1,238,815,059	6,292.72	1,492,652,821	0.46
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	84,641	18,405.60	1,557,868,863	17,568.70	1,487,033,183	0.46
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	58,605	22,571.79	1,322,819,800	24,324.85	1,425,557,881	0.44
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	136,633	9,070.18	1,239,285,904	10,317.13	1,409,661,680	0.43
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	14,445	86,201.77	1,245,184,585	94,906.09	1,370,918,545	0.42
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	89,133	16,406.92	1,462,398,179	15,328.33	1,366,260,751	0.42

## ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国外	エネルギー	4.43
		素材	3.61
		資本財	6.89
		商業・専門サービス	1.59
		運輸	1.60
		自動車・自動車部品	1.63
		耐久消費財・アパレル	1.28
		消費者サービス	1.81
		メディア・娯楽	6.24
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.75
		生活必需品流通・小売り	1.73
		食品・飲料・タバコ	3.14
		家庭用品・パーソナル用品	1.54
		ヘルスケア機器・サービス	4.11
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.02
		銀行	5.68
		金融サービス	6.62
		保険	3.03
		ソフトウェア・サービス	9.63
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.51
電気通信サービス	1.11		
公益事業	2.61		
半導体・半導体製造装置	8.41		
不動産管理・開発	0.28		
新株予約権証券			
投資証券			1.91
合計			98.17

## 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	119	米ドル	33,322,340.54	5,079,657,594	32,561,375	4,963,656,005	1.53
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	STX E6002409	買建	249	ユーロ	6,431,797.67	1,060,539,118	6,426,690	1,059,696,910	0.33

(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	5,460,000.00	837,929,729	832,113,100	0.26
	カナダドル	買建	220,000.00	24,417,486	24,201,006	0.01
	ユーロ	買建	780,000.00	130,128,458	128,597,540	0.04
	英ポンド	買建	140,000.00	27,652,861	27,399,204	0.01
	スウェーデンクローナ	買建	470,000.00	6,690,262	6,654,589	0.00
	デンマーククローネ	買建	330,000.00	7,383,783	7,292,241	0.00
	オーストラリアドル	買建	170,000.00	17,098,355	16,935,809	0.01
	米ドル	売建	43,340,000.00	6,675,660,200	6,605,752,780	2.04
	カナダドル	売建	2,370,000.00	263,525,040	260,739,579	0.08
	ユーロ	売建	5,620,000.00	936,280,760	926,586,260	0.29
	英ポンド	売建	1,690,000.00	334,603,100	330,787,587	0.10
	スウェーデンクローナ	売建	4,860,000.00	69,114,060	68,811,282	0.02
	デンマーククローネ	売建	3,630,000.00	81,039,750	80,214,651	0.02
	オーストラリアドル	売建	1,620,000.00	163,365,660	161,412,426	0.05
	ニュージーランドドル	売建	40,000.00	3,620,960	3,599,468	0.00
	香港ドル	売建	1,620,000.00	31,943,160	31,602,474	0.01
	シンガポールドル	売建	230,000.00	26,374,790	26,139,040	0.01

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## 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
	カタールリアル	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	GLP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	KDX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	アクティブピア・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。

#### R M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	MP 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

## りそなラップ型ファンド(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(西託報酬)控除後の価額です。  
 ※分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

## 分配の推移

(1万口当たり、税引前)

2020年1月27日	0円
2021年1月25日	0円
2022年1月25日	0円
2023年1月25日	0円
2024年1月25日	0円
設定来累計	0円

## 主要な資産の状況

## ■資産の組入比率

資産	比率(%)
RM国内債券マザーファンド	24.8
RM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)	43.2
RM先進国債券マザーファンド	2.5
RM国内株式マザーファンド	8.6
RM先進国株式マザーファンド	10.9
RM新興国株式マザーファンド	1.9
RM新興国債券マザーファンド	1.9
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	0.3
合計	100.0

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

## ■通貨別組入比率

通貨	比率(%)
日本円	79.6
米ドル	12.2
ユーロ	1.8
英ポンド	0.7
豪ドル	0.5
その他	5.2
合計	100.0

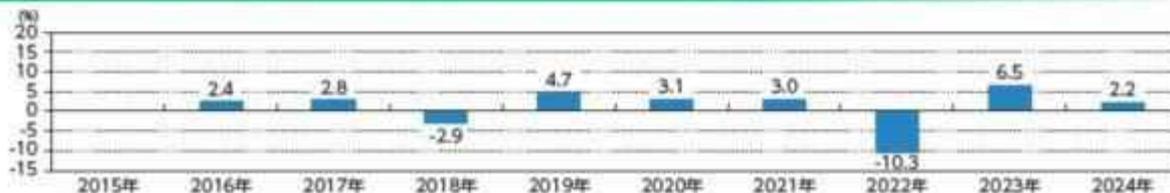
※比率はファンドの純資産総額に対する組入比率であり、四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。  
 ※上記通貨別組入比率は、各マザーファンドが実質的に保有している株式・債券等の通貨を基準に算出しています。  
 ※為替ヘッジをかけている外貨建資産については、日本円に含めています。

## ■各マザーファンドにおける組入上位銘柄

	国・地域	銘柄名	償還期間	比率(%)
国内債券	日本	第147回利付国債(5年)	2026/3/20	1.46
	日本	第153回利付国債(5年)	2027/6/20	1.34
	日本	第148回利付国債(5年)	2026/6/20	1.33
先進国債券(為替ヘッジあり)	アメリカ	US TREASURY N/B	2033/11/15	0.59
	アメリカ	US TREASURY N/B	2026/1/31	0.47
	アメリカ	US TREASURY N/B	2033/5/15	0.41
先進国債券	アメリカ	US TREASURY N/B	2026/2/28	0.56
	アメリカ	US TREASURY N/B	2033/11/15	0.56
国内株式	日本	トヨタ自動車	—	3.96
	日本	三菱UFJフィナンシャル・グループ	—	2.65
先進国株式	日本	ソニーグループ	—	2.40
	アメリカ	APPLE INC	—	5.04
新興国株式	アメリカ	MICROSOFT CORP	—	4.69
	アメリカ	NVIDIA CORP	—	4.08
新興国債券	台湾	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	—	8.93
	ケイマン	TENCENT HOLDINGS LTD	—	3.79
国内リート	韓国	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	—	3.56
	アイルランド	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	—	97.08
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
先進国リート	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。  
 ※2016年2月26日が設定日のため、2015年以前の実績はありません。2016年は2月26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。

## りそなラップ型ファンド(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)

2020年1月27日	0円
2021年1月25日	0円
2022年1月25日	0円
2023年1月25日	0円
2024年1月25日	0円
設定来累計	0円

## 主要な資産の状況

## ■資産の組入比率

資産	比率(%)
RM国内債券マザーファンド	16.0
RM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)	22.6
RM先進国債券マザーファンド	2.0
RM国内株式マザーファンド	13.2
RM先進国株式マザーファンド	33.0
RM新興国株式マザーファンド	4.9
RM新興国債券マザーファンド	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	3.4
現金等	0.3
合計	100.0

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

※現金等には未収・未払項目が含まれるためマイナスとなる場合があります。

## ■通貨別組入比率

通貨	比率(%)
日本円	54.9
米ドル	29.2
ユーロ	3.7
英ポンド	1.6
カナダドル	1.1
その他	9.5
合計	100.0

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

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

※為替ヘッジをかけている外貨建資産については、日本円に含めています。

## ■各マザーファンドにおける組入上位銘柄

	国・地域	銘柄名	償還期間	比率(%)
国内債券	日本	第147回利付国債(5年)	2026/3/20	1.46
	日本	第153回利付国債(5年)	2027/6/20	1.34
	日本	第148回利付国債(5年)	2026/6/20	1.33
先進国債券(為替ヘッジあり)	アメリカ	US TREASURY N/B	2033/11/15	0.59
	アメリカ	US TREASURY N/B	2026/1/31	0.47
先進国債券	アメリカ	US TREASURY N/B	2033/5/15	0.41
	アメリカ	US TREASURY N/B	2026/2/28	0.56
先進国債券	アメリカ	US TREASURY N/B	2033/11/15	0.56
	アメリカ	US TREASURY N/B	2025/10/31	0.55
国内株式	日本	トヨタ自動車	—	3.96
	日本	三菱UFJフィナンシャルグループ	—	2.65
	日本	ソニーグループ	—	2.40
先進国株式	アメリカ	APPLE INC	—	5.04
	アメリカ	MICROSOFT CORP	—	4.69
	アメリカ	NVIDIA CORP	—	4.08
新興国株式	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
新興国債券	アイルランド	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	—	97.08
国内リート	日本	日本ビルファンド投資法人	—	6.70
	日本	ジャパハ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。

※2016年2月26日が設定日のため、2015年以前の実績はありません。2016年は2月26日から12月未までの騰落率です。2024年は7月未までの騰落率です。

※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。

## りそなラップ型ファンド(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)

2020年1月27日	0円
2021年1月25日	0円
2022年1月25日	0円
2023年1月25日	0円
2024年1月25日	0円
設定来累計	0円

## 主要な資産の状況

## ■資産の組入比率

資産	比率(%)
RM国内債券マザーファンド	6.6
RM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)	1.0
RM先進国債券マザーファンド	2.0
RM国内株式マザーファンド	16.7
RM先進国株式マザーファンド	47.3
RM新興国株式マザーファンド	10.2
RM新興国債券マザーファンド	2.0
RM国内リートマザーファンド	5.5
RM先進国リートマザーファンド	8.6
現金等	0.3
合計	100.0

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

## ■通貨別組入比率

通貨	比率(%)
米ドル	44.6
日本円	30.1
ユーロ	5.2
英ポンド	2.4
香港ドル	2.1
その他	15.6
合計	100.0

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

## ■各マザーファンドにおける組入上位銘柄

	国・地域	銘柄名	償還期間	比率(%)
国内債券	日本	第147回利付国債(5年)	2026/3/20	1.46
	日本	第153回利付国債(5年)	2027/6/20	1.34
	日本	第148回利付国債(5年)	2026/6/20	1.33
先進国債券(為替ヘッジあり)	アメリカ	US TREASURY N/B	2033/11/15	0.59
	アメリカ	US TREASURY N/B	2026/1/31	0.47
先進国債券	アメリカ	US TREASURY N/B	2033/5/15	0.41
	アメリカ	US TREASURY N/B	2026/2/28	0.56
先進国債券	アメリカ	US TREASURY N/B	2033/11/15	0.56
	アメリカ	US TREASURY N/B	2025/10/31	0.55
国内株式	日本	トヨタ自動車	—	3.96
	日本	三菱UFJフィナンシャルグループ	—	2.65
	日本	ソニーグループ	—	2.40
先進国株式	アメリカ	APPLE INC	—	5.04
	アメリカ	MICROSOFT CORP	—	4.69
	アメリカ	NVIDIA CORP	—	4.08
新興国株式	台湾	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	—	8.93
新興国債券	ケイマン	TENCENT HOLDINGS LTD	—	3.79
	韓国	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	—	3.56
国内リート	アイルランド	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	—	97.08
国内リート	日本	日本ビルファンド投資法人	—	6.70
	日本	ジャパハ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。  
※2016年2月26日が設定日のため、2015年以前の実績はありません。2016年は2月26日から12月未までの騰落率です。2024年は7月未までの騰落率です。  
※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) スイッチング  
 ・スイッチングとは、保有しているファンドを売却し、その売却代金をもって他のファンドを取得することで、売却するファンドと取得するファンドを同時に申込みいただきます。  
 ・申込みの際に、スイッチングの旨をご指示ください。  
 販売会社によっては、一部のファンドのみの取扱いとなる場合や全部または一部のファンド間でスイッチングが行えない場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
- (4) 申込みの受付  
 販売会社の営業日に受け付けます。
- (5) 取扱時間  
 原則として、午後3時<sup>\*</sup>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。  
<sup>\*</sup>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。
- (6) 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（スイッチングを含みます。）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
- (7) 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。
- (8) 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。
- (9) 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。
- (10) 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（スイッチングを含みます。以下同じ。）の受付を中止すること、および既に受け付けた取得の申込みの受付を取り消すことができます。  
 金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場をいいます。

## 2【換金（解約）手続等】

- (1) 解約の受付  
 販売会社の営業日に受け付けます。
- (2) 取扱時間  
 原則として、午後3時<sup>\*</sup>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。  
<sup>\*</sup>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（スイッチングを含みます。）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つき、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（スイッチングを含みます。以下同じ。）の受付を中止すること、および既に受け付けた解約請求の受付を取り消すことができます。  
 ・解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日（この計算日が解約請求を受け付けない日であるときは、この計算日以降の最初の解約請求を受け付けることができる日とします。）に解約請求を受け付けたものとして取り扱います。

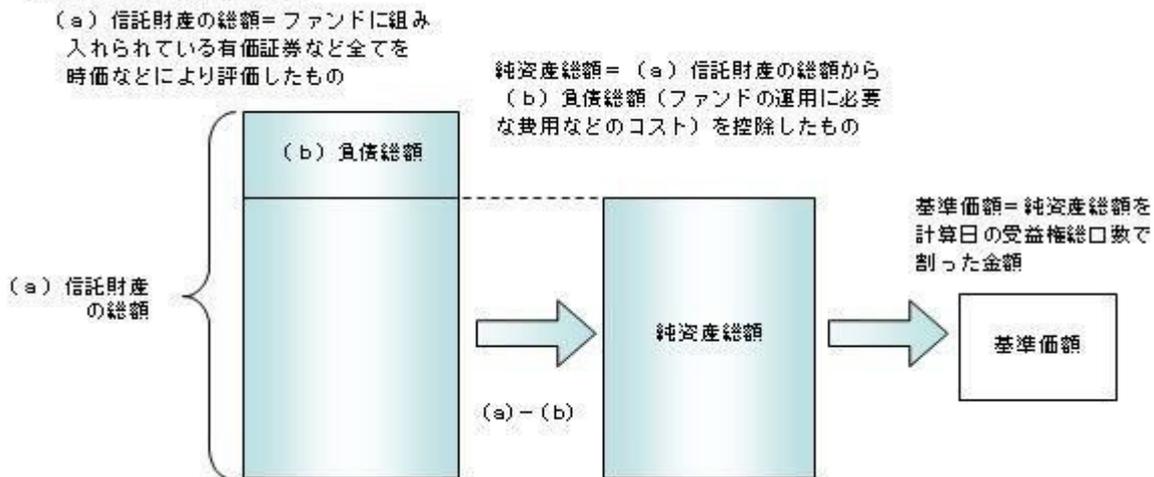
### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

##### 基準価額の算出

- ・基準価額は委託会社の営業日において日々算出されます。
- ・基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）を評価して得た信託財産の総額から負債総額を控除した金額（純資産総額）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。なお、ファンドは1万口当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<sup>\*</sup>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。
- <sup>\*</sup> 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（2016年2月26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】

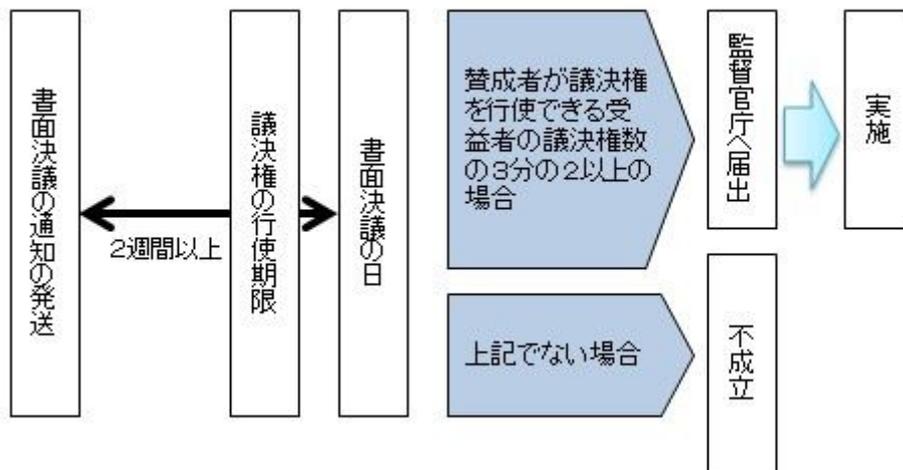
毎年1月26日から翌年1月25日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

## (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、委託会社が新受託会社を選任できないとき
- 4) 繰上償還を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。
  - 償還金について
  - ・ 償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日（償還日が休業日の場合は翌営業日）から起算して5営業日まで）から受益者に支払います。
  - ・ 償還金の支払いは、販売会社において行なわれます。
  - 信託約款の変更など
  - 1) 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、この信託約款を変更すること、または当ファンドと他のファンドとの併合（以下「併合」といいます。）を行なうことができます。信託約款の変更または併合を行なう際には、委託会社は、その旨および内容をあらかじめ監督官庁に届け出ます。
  - 2) この変更事項のうち、その内容が重大なものまたは併合（受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものを除きます。）については、書面決議を行ないます。（後述の「書面決議」をご覧ください。）
  - 3) 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、後述の「書面決議」の規定を適用します。
  - 書面決議
  - 1) 繰上償還、信託約款の重大な変更または併合に対して、委託会社は書面決議を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびにその内容および理由などの事項を定め、決議の日の2週間前までに知っている受益者に対し書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。
  - 2) 受益者は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、書面決議について賛成するものとみなします。
  - 3) 書面決議は、議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
  - 4) 繰上償還、信託約款の重大な変更または併合に関する委託会社の提案に対して、すべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときは、書面決議を行ないません。
  - 5) 当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合であっても、併合にかかる他のファンドにおいて併合の書面決議が否決された場合は、当該他のファンドとの併合を行なうことはできません。
  - 6) 当ファンドは、受益者からの換金請求に対して、投資信託契約の一部を解約することにより応じることができるため、受益者の保護に欠けるおそれがないものとして、書面決議において反対した受益者からの買取請求は受け付けません。

## ＜書面決議の主な流れ＞



## 公告

公告は電子公告により行ない、委託会社のホームページに掲載します。

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

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

## 運用報告書の作成

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

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

## 関係法人との契約について

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

## 他の受益者の氏名などの開示の請求の制限

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

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

## 4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

## (1) 収益分配金・償還金受領権

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

## (2) 解約請求権

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

## (3) 帳簿閲覧権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

りそなラップ型ファンド(安定型)  
りそなラップ型ファンド(安定成長型)  
りそなラップ型ファンド(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8期計算期間(2023年1月26日から2024年1月25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】

## 【りそなラップ型ファンド（安定型）】

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第7期 2023年 1月25日現在	第8期 2024年 1月25日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	329,994,458	350,049,426
親投資信託受益証券	52,584,688,597	50,813,341,229
未収入金	3,146,000,000	2,979,000,000
流動資産合計	56,060,683,055	54,142,390,655
資産合計	56,060,683,055	54,142,390,655
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払金	3,091,000,000	2,967,000,000
未払解約金	52,149,438	70,595,343
未払受託者報酬	11,850,972	11,390,249
未払委託者報酬	165,913,562	159,463,373
未払利息	895	949
その他未払費用	1,807,167	1,736,924
流動負債合計	3,322,722,034	3,210,186,838
負債合計	3,322,722,034	3,210,186,838
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	50,702,808,263	46,973,610,759
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,035,152,758	3,958,593,058
（分配準備積立金）	2,655,118,310	3,197,334,586
元本等合計	52,737,961,021	50,932,203,817
純資産合計	52,737,961,021	50,932,203,817
負債純資産合計	56,060,683,055	54,142,390,655

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第7期		第8期	
	自 至	2022年 1月26日 2023年 1月25日	自 至	2023年 1月26日 2024年 1月25日
営業収益				
有価証券売買等損益		3,298,177,000		2,480,652,632
営業収益合計		3,298,177,000		2,480,652,632
営業費用				
支払利息		308,873		227,837
受託者報酬		23,838,895		22,862,990
委託者報酬		333,744,465		320,081,769
その他費用		3,651,931		3,504,960
営業費用合計		361,544,164		346,677,556
営業利益又は営業損失（ ）		3,659,721,164		2,133,975,076
経常利益又は経常損失（ ）		3,659,721,164		2,133,975,076
当期純利益又は当期純損失（ ）		3,659,721,164		2,133,975,076
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（ ）		243,404,993		113,418,533
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		5,628,463,830		2,035,152,758
剰余金増加額又は欠損金減少額		433,107,125		167,933,984
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		433,107,125		167,933,984
剰余金減少額又は欠損金増加額		610,102,026		265,050,227
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		610,102,026		265,050,227
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		2,035,152,758		3,958,593,058

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

第7期 2023年 1月25日現在		第8期 2024年 1月25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	50,216,725,579円	期首元本額	50,702,808,263円
期中追加設定元本額	6,025,270,820円	期中追加設定元本額	2,801,853,137円
期中一部解約元本額	5,539,188,136円	期中一部解約元本額	6,531,050,641円
2. 計算期間の末日における受益権の総数	50,702,808,263口	2. 計算期間の末日における受益権の総数	46,973,610,759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	1.0401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	1.0843円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額)	(10,401円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額)	(10,843円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第7期 自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日		第8期 自 2023年 1月26日 至 2024年 1月25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	645,348,229円	A 費用控除後の配当等収益額	873,859,906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	0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	0円
C 収益調整金額	3,413,744,935円	C 収益調整金額	3,301,457,099円
D 分配準備積立金額	2,009,770,081円	D 分配準備積立金額	2,323,474,680円
E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D)	6,068,863,245円	E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D)	6,498,791,685円
F 当ファンドの期末残存口数	50,702,808,263口	F 当ファンドの期末残存口数	46,973,610,759口
G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000)	1,196円	G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000)	1,383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7期 自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日	第8期 自 2023年 1月26日 至 2024年 1月25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7期 2023年 1月25日現在	第8期 2024年 1月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左
2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券	2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券

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

## （関連当事者との取引に関する注記）

第7期 自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日	第8期 自 2023年 1月26日 至 2024年 1月25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7期 自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日	第8期 自 2023年 1月26日 至 2024年 1月25日
	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	
親投資信託受益証券	3,182,748,610	332,904,430
合計	3,182,748,610	332,904,430

## 2 デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

## （4）【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	R M国内債券マザーファンド	12,716,960,090	12,621,582,889	
	R M先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	25,875,443,749	21,973,426,831	
	R M先進国債券マザーファンド	2,320,035,109	2,841,346,997	
	R M新興国債券マザーファンド	737,683,453	1,005,757,619	
	R M国内株式マザーファンド	2,204,112,729	4,298,019,821	
	R M先進国株式マザーファンド	1,456,278,785	4,070,153,576	
	R M新興国株式マザーファンド	572,041,338	1,015,773,803	
	R M国内リートマザーファンド	828,798,328	1,183,275,372	
	R M先進国リートマザーファンド	1,120,847,668	1,804,004,321	
	合計	47,832,201,249	50,813,341,229	

(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。

## 【りそなラップ型ファンド（安定成長型）】

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第7期 2023年 1月25日現在	第8期 2024年 1月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	564,261,960	801,814,358
親投資信託受益証券	55,815,851,019	67,440,392,376
未収入金	3,279,000,000	4,137,000,000
流動資産合計	59,659,112,979	72,379,206,734
資産合計	59,659,112,979	72,379,206,734
負債の部		
流動負債		
未払金	3,366,000,000	4,227,000,000
未払解約金	9,588,749	243,465,670
未払受託者報酬	12,212,451	14,068,641
未払委託者報酬	293,098,632	337,647,319
未払利息	1,530	2,174
その他未払費用	1,862,306	2,145,391
流動負債合計	3,682,763,668	4,824,329,195
負債合計	3,682,763,668	4,824,329,195
純資産の部		
元本等		
元本	46,614,012,158	49,607,241,957
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	9,362,337,153	17,947,635,582
（分配準備積立金）	3,503,755,816	8,283,326,482
元本等合計	55,976,349,311	67,554,877,539
純資産合計	55,976,349,311	67,554,877,539
負債純資産合計	59,659,112,979	72,379,206,734

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第7期		第8期	
	自 至	2022年 1月26日 2023年 1月25日	自 至	2023年 1月26日 2024年 1月25日
<b>営業収益</b>				
有価証券売買等損益		1,160,155,803		8,397,541,357
その他収益		145		-
営業収益合計		1,160,155,658		8,397,541,357
<b>営業費用</b>				
支払利息		406,247		402,352
受託者報酬		23,131,698		26,774,650
委託者報酬		555,160,668		642,591,515
その他費用		3,546,851		4,113,400
営業費用合計		582,245,464		673,881,917
営業利益又は営業損失（ ）		1,742,401,122		7,723,659,440
経常利益又は経常損失（ ）		1,742,401,122		7,723,659,440
当期純利益又は当期純損失（ ）		1,742,401,122		7,723,659,440
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（ ）		90,178,534		639,842,807
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		8,999,675,964		9,362,337,153
剰余金増加額又は欠損金減少額		2,975,717,520		3,108,838,720
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		2,975,717,520		3,108,838,720
剰余金減少額又は欠損金増加額		960,833,743		1,607,356,924
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		960,833,743		1,607,356,924
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		9,362,337,153		17,947,635,582

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

第7期 2023年 1月25日現在		第8期 2024年 1月25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	37,339,730,017円	期首元本額	46,614,012,158円
期中追加設定元本額	13,294,353,008円	期中追加設定元本額	10,746,713,419円
期中一部解約元本額	4,020,070,867円	期中一部解約元本額	7,753,483,620円
2. 計算期間の末日における受益権の総数	46,614,012,158口	2. 計算期間の末日における受益権の総数	49,607,241,957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	1.2008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	1.3618円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額)	(12,008円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額)	(13,618円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第7期 自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日		第8期 自 2023年 1月26日 至 2024年 1月25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	441,211,142円	A 費用控除後の配当等収益額	1,181,625,670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	0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	4,121,679,719円
C 収益調整金額	7,260,601,799円	C 収益調整金額	9,664,309,100円
D 分配準備積立金額	3,062,544,674円	D 分配準備積立金額	2,980,021,093円
E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D)	10,764,357,615円	E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D)	17,947,635,582円
F 当ファンドの期末残存口数	46,614,012,158口	F 当ファンドの期末残存口数	49,607,241,957口
G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000)	2,309円	G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000)	3,617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7期 自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日	第8期 自 2023年 1月26日 至 2024年 1月25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7期 2023年 1月25日現在	第8期 2024年 1月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左
2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券	2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券

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

## （関連当事者との取引に関する注記）

第7期 自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日	第8期 自 2023年 1月26日 至 2024年 1月25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7期 自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日	第8期 自 2023年 1月26日 至 2024年 1月25日
	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	
親投資信託受益証券	1,645,497,291	4,797,089,817
合計	1,645,497,291	4,797,089,817

## 2 デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

## （4）【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	R M国内債券マザーファンド	10,901,988,880	10,820,223,963	
	R M先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	17,987,639,675	15,275,103,612	
	R M先進国債券マザーファンド	2,304,991,428	2,822,923,001	
	R M新興国債券マザーファンド	975,559,552	1,330,077,893	
	R M国内株式マザーファンド	3,317,617,400	6,469,353,930	
	R M先進国株式マザーファンド	7,616,076,268	21,286,171,561	
	R M新興国株式マザーファンド	2,532,894,373	4,497,660,538	
	R M国内リートマザーファンド	1,277,042,223	1,823,233,181	
	R M先進国リートマザーファンド	1,935,784,217	3,115,644,697	
	合計	48,849,594,016	67,440,392,376	

(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。

## 【りそなラップ型ファンド（成長型）】

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第7期 2023年 1月25日現在	第8期 2024年 1月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	367,918,420	558,631,823
親投資信託受益証券	33,926,838,063	44,507,738,958
未収入金	2,043,000,000	2,543,000,000
流動資産合計	36,337,756,483	47,609,370,781
資産合計	36,337,756,483	47,609,370,781
負債の部		
流動負債		
未払金	2,104,000,000	2,612,000,000
未払解約金	8,844,118	60,121,635
未払受託者報酬	7,266,012	8,971,386
未払委託者報酬	192,549,037	237,741,781
未払利息	997	1,515
その他未払費用	1,107,986	1,368,048
流動負債合計	2,313,768,150	2,920,204,365
負債合計	2,313,768,150	2,920,204,365
純資産の部		
元本等		
元本	22,124,292,205	23,680,359,231
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	11,899,696,128	21,008,807,185
（分配準備積立金）	3,420,617,108	9,837,977,059
元本等合計	34,023,988,333	44,689,166,416
純資産合計	34,023,988,333	44,689,166,416
負債純資産合計	36,337,756,483	47,609,370,781

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第7期		第8期	
	自 至	2022年 1月26日 2023年 1月25日	自 至	2023年 1月26日 2024年 1月25日
<b>営業収益</b>				
有価証券売買等損益		1,106,242,369		8,359,900,895
その他収益		425		-
営業収益合計		1,106,242,794		8,359,900,895
<b>営業費用</b>				
支払利息		244,113		272,229
受託者報酬		13,470,511		16,765,254
委託者報酬		356,968,187		444,279,330
その他費用		2,067,594		2,577,653
営業費用合計		372,750,405		463,894,466
営業利益又は営業損失（ ）		733,492,389		7,896,006,429
経常利益又は経常損失（ ）		733,492,389		7,896,006,429
当期純利益又は当期純損失（ ）		733,492,389		7,896,006,429
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（ ）		116,225,094		766,031,613
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		8,615,578,599		11,899,696,128
剰余金増加額又は欠損金減少額		3,778,523,700		4,846,899,166
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		3,778,523,700		4,846,899,166
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,111,673,466		2,867,762,925
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,111,673,466		2,867,762,925
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		11,899,696,128		21,008,807,185

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

第7期 2023年 1月25日現在	第8期 2024年 1月25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 17,301,984,663円	期首元本額 22,124,292,205円
期中追加設定元本額 7,028,388,102円	期中追加設定元本額 6,766,220,056円
期中一部解約元本額 2,206,080,560円	期中一部解約元本額 5,210,153,030円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 22,124,292,205口	2. 計算期間の末日における受益権の総数 23,680,359,231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 1.5379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 1.8872円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (15,379円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (18,872円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第7期 自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日	第8期 自 2023年 1月26日 至 2024年 1月25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 416,189,400円	A 費用控除後の配当等収益額 847,994,458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 201,077,895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 6,281,980,358円
C 収益調整金額 8,479,079,020円	C 収益調整金額 11,170,830,126円
D 分配準備積立金額 2,803,349,813円	D 分配準備積立金額 2,708,002,243円
E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D) 11,899,696,128円	E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D) 21,008,807,185円
F 当ファンドの期末残存口数 22,124,292,205口	F 当ファンドの期末残存口数 23,680,359,231口
G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000) 5,378円	G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000) 8,871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7期 自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日	第8期 自 2023年 1月26日 至 2024年 1月25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7期 2023年 1月25日現在	第8期 2024年 1月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左
2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券	2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券

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

## （関連当事者との取引に関する注記）

第7期 自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日	第8期 自 2023年 1月26日 至 2024年 1月25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7期 自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日	第8期 自 2023年 1月26日 至 2024年 1月25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	364,483,564	5,760,614,352
合計	364,483,564	5,760,614,352

## 2 デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

## （4）【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	R M国内債券マザーファンド	2,830,085,791	2,808,860,147	
	R M先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	507,355,546	430,846,329	
	R M先進国債券マザーファンド	715,239,502	875,953,818	
	R M新興国債券マザーファンド	644,476,597	878,679,392	
	R M国内株式マザーファンド	4,246,343,169	8,280,369,179	
	R M先進国株式マザーファンド	7,055,314,466	19,718,898,401	
	R M新興国株式マザーファンド	2,489,470,479	4,420,552,729	
	R M国内リートマザーファンド	1,790,814,999	2,556,746,574	
	R M先進国リートマザーファンド	2,818,783,715	4,536,832,389	
	合計	23,097,884,264	44,507,738,958	

(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）

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

## RM国内債券マザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）

2024年 1月25日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	166,622
コール・ローン	959,186,229
国債証券	165,147,000,050
地方債証券	10,142,480,245
特殊債券	10,613,649,498
社債券	8,170,595,000
未収入金	254,750,300
未収利息	266,988,512
前払費用	24,543,279
流動資産合計	195,579,359,735
資産合計	
195,579,359,735	
負債の部	
流動負債	
未払金	200,000,000
未払解約金	227,276,800
未払利息	2,601
流動負債合計	427,279,401
負債合計	
427,279,401	
純資産の部	
元本等	
元本	196,635,848,934
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,483,768,600
元本等合計	195,152,080,334
純資産合計	
195,152,080,334	
負債純資産合計	
195,579,359,735	

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

2024年 1月25日現在

1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 1月26日
期首元本額	171,182,009,039円
期中追加設定元本額	128,209,175,235円
期中一部解約元本額	102,755,335,340円
期末元本額	196,635,848,934円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド（安定型）	12,716,960,090円

りそなラップ型ファンド（安定成長型）	10,901,988,880円
りそなラップ型ファンド（成長型）	2,830,085,791円
DCりそな グローバルバランス	1,039,824,561円
つみたてバランスファンド	8,670,274,888円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	6,490,362,621円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	1,982,783,739円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	635,639,529円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	1,093,190,319円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	337,235,106円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	82,980,009円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	108,021,789円
りそな つみたてラップ型ファンド（安定型）	424,908,834円
りそな つみたてラップ型ファンド（安定成長型）	306,691,572円
りそな つみたてラップ型ファンド（成長型）	76,060,916円
りそな つみたてリスクコントロールファンド	144,478,846円
ターゲットリターンバランスファンド（目標2%）	10,370,614円
ターゲットリターンバランスファンド（目標3%）	3,983,407円
ターゲットリターンバランスファンド（目標4%）	12,305,481円
ターゲットリターンバランスファンド（目標5%）	3,135,005円
ターゲットリターンバランスファンド（目標6%）	2,744,631円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2065	105,101円
FWりそな円建債券アクティブファンド	263,265,696円
FWりそな国内債券インデックスファンド	129,252,671,381円
Smart-i 国内債券インデックス	2,751,284,481円
Smart-i 8資産バランス 安定型	2,126,018,709円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	1,615,275,727円
Smart-i 8資産バランス 成長型	443,018,313円
りそなFT 国内債券インデックス（適格機関投資家専用）	6,698,593,148円
りそなFT RCバランスファンド（適格機関投資家専用）	4,736,997,621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）	41,424,265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）	45,260,861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）	77,737,472円
りそなFT マルチアセットファンド（適格機関投資家専用）	352,770,852円
りそなDAAマルチアセットファンド（適格機関投資家専用）	792,989円
りそなマルチアセットファンド（適格機関投資家専用）	356,605,690円
2. 計算日における受益権の総数	196,635,848,934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	1,483,768,600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	0.9925円
(10,000口当たり純資産額)	(9,925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 1月25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 1月25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、地方債証券、特殊債券、社債券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

## 3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

## （関連当事者との取引に関する注記）

2024年 1月25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 1月25日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
国債証券		2,442,199,640
地方債証券		56,125,465
特殊債券		94,856,363
社債券		4,944,000
合計		2,598,125,468

(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445回利付国債(2年)	210,000,000	210,094,500	
	第446回利付国債(2年)	130,000,000	130,049,400	
	第447回利付国債(2年)	2,240,000,000	2,240,784,000	
	第448回利付国債(2年)	420,000,000	420,105,000	
	第449回利付国債(2年)	1,230,000,000	1,230,159,900	
	第450回利付国債(2年)	2,430,000,000	2,430,170,100	
	第451回利付国債(2年)	280,000,000	280,000,000	
	第452回利付国債(2年)	1,000,000,000	999,840,000	
	第453回利付国債(2年)	1,190,000,000	1,189,595,400	
	第454回利付国債(2年)	850,000,000	851,122,000	
	第455回利付国債(2年)	200,000,000	199,870,000	
	第143回利付国債(5年)	1,010,000,000	1,011,555,400	
	第144回利付国債(5年)	1,000,000,000	1,001,460,000	
	第145回利付国債(5年)	1,770,000,000	1,772,619,600	
	第146回利付国債(5年)	2,430,000,000	2,432,988,900	
	第147回利付国債(5年)	3,320,000,000	3,316,779,600	
	第148回利付国債(5年)	2,410,000,000	2,407,108,000	
	第149回利付国債(5年)	2,290,000,000	2,286,656,600	

第150回利付国債(5年)	1,480,000,000	1,476,995,600	
第151回利付国債(5年)	270,000,000	269,195,400	
第152回利付国債(5年)	2,130,000,000	2,130,000,000	
第153回利付国債(5年)	2,510,000,000	2,499,809,400	
第154回利付国債(5年)	1,670,000,000	1,666,660,000	
第155回利付国債(5年)	90,000,000	90,400,500	
第156回利付国債(5年)	2,200,000,000	2,201,276,000	
第157回利付国債(5年)	220,000,000	219,817,400	
第158回利付国債(5年)	2,740,000,000	2,726,491,800	
第159回利付国債(5年)	490,000,000	486,692,500	
第160回利付国債(5年)	480,000,000	478,848,000	
第161回利付国債(5年)	1,450,000,000	1,452,827,500	
第162回利付国債(5年)	660,000,000	660,145,200	
第163回利付国債(5年)	190,000,000	190,913,900	
第1回利付国債(40年)	100,000,000	114,132,000	
第2回利付国債(40年)	180,000,000	198,120,600	
第3回利付国債(40年)	110,000,000	120,829,500	
第4回利付国債(40年)	170,000,000	186,479,800	
第5回利付国債(40年)	220,000,000	231,462,000	
第6回利付国債(40年)	200,000,000	205,590,000	
第7回利付国債(40年)	450,000,000	439,915,500	
第8回利付国債(40年)	470,000,000	424,847,100	
第9回利付国債(40年)	800,000,000	525,392,000	
第10回利付国債(40年)	710,000,000	547,772,100	
第11回利付国債(40年)	580,000,000	428,776,600	
第12回利付国債(40年)	590,000,000	386,225,800	
第13回利付国債(40年)	740,000,000	478,040,000	
第14回利付国債(40年)	760,000,000	523,229,600	
第15回利付国債(40年)	860,000,000	652,043,400	
第16回利付国債(40年)	450,000,000	373,455,000	
第338回利付国債(10年)	631,000,000	634,142,380	
第339回利付国債(10年)	385,000,000	387,175,250	
第340回利付国債(10年)	934,000,000	940,005,620	
第341回利付国債(10年)	440,000,000	442,208,800	
第342回利付国債(10年)	380,000,000	380,406,600	
第343回利付国債(10年)	780,000,000	780,834,600	
第344回利付国債(10年)	960,000,000	961,008,000	
第345回利付国債(10年)	1,070,000,000	1,070,770,400	
第346回利付国債(10年)	1,310,000,000	1,310,000,000	
第347回利付国債(10年)	750,000,000	749,362,500	
第348回利付国債(10年)	1,690,000,000	1,686,620,000	
第349回利付国債(10年)	1,340,000,000	1,335,578,000	

第350回利付国債(10年)	980,000,000	975,168,600
第351回利付国債(10年)	1,360,000,000	1,350,820,000
第352回利付国債(10年)	1,180,000,000	1,169,710,400
第353回利付国債(10年)	1,950,000,000	1,929,759,000
第354回利付国債(10年)	1,440,000,000	1,423,598,400
第355回利付国債(10年)	1,720,000,000	1,699,016,000
第356回利付国債(10年)	1,970,000,000	1,943,779,300
第357回利付国債(10年)	1,890,000,000	1,862,689,500
第358回利付国債(10年)	1,740,000,000	1,711,759,800
第359回利付国債(10年)	2,370,000,000	2,327,079,300
第360回利付国債(10年)	1,480,000,000	1,449,364,000
第361回利付国債(10年)	1,980,000,000	1,933,628,400
第362回利付国債(10年)	1,850,000,000	1,801,419,000
第363回利付国債(10年)	1,890,000,000	1,834,755,300
第364回利付国債(10年)	1,920,000,000	1,857,926,400
第365回利付国債(10年)	1,860,000,000	1,793,914,200
第366回日本国債(10年)	2,540,000,000	2,463,012,600
第367回日本国債(10年)	2,290,000,000	2,214,109,400
第368回日本国債(10年)	1,480,000,000	1,426,616,400
第369回日本国債(10年)	1,690,000,000	1,667,962,400
第370回利付国債(10年)	1,390,000,000	1,369,038,800
第371回利付国債(10年)	1,600,000,000	1,557,664,000
第372回利付国債(10年)	1,520,000,000	1,531,658,400
第1回利付国債(30年)	60,000,000	68,256,600
第7回利付国債(30年)	40,000,000	45,491,600
第10回利付国債(30年)	30,000,000	31,138,200
第11回利付国債(30年)	80,000,000	87,323,200
第12回利付国債(30年)	80,000,000	90,286,400
第13回利付国債(30年)	200,000,000	223,964,000
第14回利付国債(30年)	60,000,000	69,562,800
第15回利付国債(30年)	200,000,000	234,096,000
第16回利付国債(30年)	140,000,000	164,080,000
第17回利付国債(30年)	160,000,000	186,035,200
第18回利付国債(30年)	60,000,000	69,174,000
第19回利付国債(30年)	100,000,000	115,306,000
第20回利付国債(30年)	100,000,000	117,614,000
第21回利付国債(30年)	180,000,000	207,752,400
第22回利付国債(30年)	50,000,000	58,855,000
第23回利付国債(30年)	220,000,000	259,256,800
第24回利付国債(30年)	170,000,000	200,319,500
第25回利付国債(30年)	200,000,000	230,890,000
第26回利付国債(30年)	205,000,000	239,036,150
第27回利付国債(30年)	295,000,000	347,725,350

第28回利付国債(30年)	290,000,000	341,576,500	
第29回利付国債(30年)	150,000,000	174,601,500	
第30回利付国債(30年)	190,000,000	218,182,700	
第31回利付国債(30年)	170,000,000	192,650,800	
第32回利付国債(30年)	335,000,000	383,541,500	
第33回利付国債(30年)	290,000,000	318,654,900	
第34回利付国債(30年)	335,000,000	377,534,950	
第35回利付国債(30年)	406,000,000	443,928,520	
第36回利付国債(30年)	425,000,000	463,573,000	
第37回利付国債(30年)	570,000,000	610,789,200	
第38回利付国債(30年)	220,000,000	231,536,800	
第39回利付国債(30年)	380,000,000	405,577,800	
第40回利付国債(30年)	315,000,000	330,343,650	
第41回利付国債(30年)	305,000,000	313,866,350	
第42回利付国債(30年)	440,000,000	451,862,400	
第43回利付国債(30年)	340,000,000	348,714,200	
第44回利付国債(30年)	460,000,000	471,159,600	
第45回利付国債(30年)	450,000,000	444,343,500	
第46回利付国債(30年)	580,000,000	571,735,000	
第47回利付国債(30年)	570,000,000	570,906,300	
第48回利付国債(30年)	393,000,000	378,836,280	
第49回利付国債(30年)	520,000,000	500,292,000	
第50回利付国債(30年)	560,000,000	475,468,000	
第51回利付国債(30年)	590,000,000	443,774,400	
第52回利付国債(30年)	480,000,000	377,169,600	
第53回利付国債(30年)	510,000,000	408,770,100	
第54回利付国債(30年)	550,000,000	460,135,500	
第55回利付国債(30年)	320,000,000	266,656,000	
第56回利付国債(30年)	510,000,000	423,641,700	
第57回利付国債(30年)	470,000,000	389,183,500	
第58回利付国債(30年)	820,000,000	676,860,800	
第59回利付国債(30年)	490,000,000	393,617,000	
第60回利付国債(30年)	400,000,000	336,236,000	
第61回利付国債(30年)	440,000,000	351,049,600	
第62回利付国債(30年)	530,000,000	399,996,300	
第63回利付国債(30年)	410,000,000	299,763,300	
第64回利付国債(30年)	420,000,000	305,814,600	
第65回利付国債(30年)	400,000,000	290,064,000	
第66回利付国債(30年)	620,000,000	447,385,800	
第67回利付国債(30年)	460,000,000	349,949,600	
第68回利付国債(30年)	530,000,000	401,708,200	
第69回利付国債(30年)	540,000,000	419,418,000	

第70回利付国債(30年)	800,000,000	619,200,000
第71回利付国債(30年)	540,000,000	416,485,800
第72回利付国債(30年)	570,000,000	438,461,100
第73回利付国債(30年)	360,000,000	276,192,000
第74回利付国債(30年)	720,000,000	598,420,800
第75回利付国債(30年)	550,000,000	492,761,500
第76回利付国債(30年)	460,000,000	421,631,400
第77回利付国債(30年)	450,000,000	432,067,500
第78回利付国債(30年)	740,000,000	676,944,600
第79回利付国債(30年)	550,000,000	477,378,000
第80回利付国債(30年)	330,000,000	330,957,000
第75回利付国債(20年)	100,000,000	102,445,000
第76回利付国債(20年)	100,000,000	102,216,000
第77回利付国債(20年)	20,000,000	20,466,200
第78回利付国債(20年)	50,000,000	51,330,500
第79回利付国債(20年)	20,000,000	20,560,200
第80回利付国債(20年)	90,000,000	92,646,900
第81回利付国債(20年)	30,000,000	30,984,300
第82回利付国債(20年)	170,000,000	175,858,200
第83回利付国債(20年)	10,000,000	10,391,800
第84回利付国債(20年)	120,000,000	124,473,600
第85回利付国債(20年)	150,000,000	156,588,000
第86回利付国債(20年)	100,000,000	104,821,000
第87回利付国債(20年)	90,000,000	94,146,300
第88回利付国債(20年)	185,000,000	194,941,900
第89回利付国債(20年)	120,000,000	126,162,000
第90回利付国債(20年)	170,000,000	179,622,000
第91回利付国債(20年)	80,000,000	84,740,000
第92回利付国債(20年)	255,000,000	269,932,800
第93回利付国債(20年)	80,000,000	84,765,600
第94回利付国債(20年)	140,000,000	148,778,000
第95回利付国債(20年)	185,000,000	198,643,750
第96回利付国債(20年)	70,000,000	74,689,300
第97回利付国債(20年)	130,000,000	139,672,000
第98回利付国債(20年)	70,000,000	74,953,900
第99回利付国債(20年)	85,000,000	91,318,050
第100回利付国債(20年)	151,000,000	163,347,270
第101回利付国債(20年)	20,000,000	21,799,800
第102回利付国債(20年)	145,000,000	158,593,750
第103回利付国債(20年)	100,000,000	108,940,000
第104回利付国債(20年)	10,000,000	10,806,900
第105回利付国債(20年)	12,000,000	12,999,360
第106回利付国債(20年)	40,000,000	43,514,800

第107回利付国債(20年)	80,000,000	86,909,600	
第108回利付国債(20年)	220,000,000	236,878,400	
第109回利付国債(20年)	80,000,000	86,441,600	
第110回利付国債(20年)	195,000,000	212,676,750	
第111回利付国債(20年)	50,000,000	55,001,500	
第112回利付国債(20年)	205,000,000	224,419,650	
第113回利付国債(20年)	85,000,000	93,369,100	
第114回利付国債(20年)	160,000,000	176,334,400	
第115回利付国債(20年)	100,000,000	110,787,000	
第116回利付国債(20年)	140,000,000	155,580,600	
第117回利付国債(20年)	225,000,000	248,685,750	
第118回利付国債(20年)	131,000,000	144,343,660	
第119回利付国債(20年)	150,000,000	163,404,000	
第120回利付国債(20年)	240,000,000	258,367,200	
第121回利付国債(20年)	115,000,000	126,172,250	
第122回利付国債(20年)	190,000,000	207,227,300	
第123回利付国債(20年)	265,000,000	294,748,900	
第124回利付国債(20年)	200,000,000	221,110,000	
第125回利付国債(20年)	120,000,000	134,536,800	
第126回利付国債(20年)	100,000,000	110,691,000	
第127回利付国債(20年)	130,000,000	142,998,700	
第128回利付国債(20年)	225,000,000	247,734,000	
第129回利付国債(20年)	240,000,000	262,536,000	
第130回利付国債(20年)	220,000,000	240,893,400	
第131回利付国債(20年)	30,000,000	32,628,000	
第132回利付国債(20年)	80,000,000	87,029,600	
第133回利付国債(20年)	355,000,000	388,884,750	
第134回利付国債(20年)	45,000,000	49,346,550	
第135回利付国債(20年)	40,000,000	43,552,000	
第136回利付国債(20年)	220,000,000	237,822,200	
第137回利付国債(20年)	160,000,000	174,348,800	
第138回利付国債(20年)	210,000,000	225,378,300	
第140回利付国債(20年)	790,000,000	861,100,000	
第141回利付国債(20年)	145,000,000	158,139,900	
第142回利付国債(20年)	240,000,000	263,772,000	
第143回利付国債(20年)	335,000,000	362,470,000	
第144回利付国債(20年)	430,000,000	461,549,100	
第145回利付国債(20年)	755,000,000	824,112,700	
第146回利付国債(20年)	610,000,000	665,735,700	
第147回利付国債(20年)	775,000,000	838,402,750	
第148回利付国債(20年)	995,000,000	1,066,351,450	
第149回利付国債(20年)	610,000,000	653,175,800	

	第150回利付国債(20年)	1,030,000,000	1,091,707,300
	第151回利付国債(20年)	875,000,000	908,258,750
	第152回利付国債(20年)	970,000,000	1,005,075,200
	第153回利付国債(20年)	760,000,000	794,291,200
	第154回利付国債(20年)	888,000,000	917,055,360
	第155回利付国債(20年)	940,000,000	947,548,200
	第156回利付国債(20年)	980,000,000	918,309,000
	第157回利付国債(20年)	970,000,000	882,942,500
	第158回利付国債(20年)	550,000,000	517,665,500
	第159回利付国債(20年)	850,000,000	806,998,500
	第160回利付国債(20年)	1,010,000,000	967,489,100
	第161回利付国債(20年)	660,000,000	621,825,600
	第162回利付国債(20年)	720,000,000	675,669,600
	第163回利付国債(20年)	800,000,000	747,720,000
	第164回利付国債(20年)	1,030,000,000	945,097,100
	第165回利付国債(20年)	840,000,000	767,340,000
	第166回利付国債(20年)	600,000,000	561,570,000
	第167回利付国債(20年)	740,000,000	669,870,200
	第168回利付国債(20年)	1,010,000,000	896,102,300
	第169回利付国債(20年)	620,000,000	538,730,400
	第170回利付国債(20年)	820,000,000	708,758,800
	第171回利付国債(20年)	670,000,000	576,025,800
	第172回利付国債(20年)	910,000,000	791,199,500
	第173回利付国債(20年)	820,000,000	709,226,200
	第174回利付国債(20年)	990,000,000	852,300,900
	第175回利付国債(20年)	740,000,000	645,013,600
	第176回利付国債(20年)	1,070,000,000	928,503,200
	第177回利付国債(20年)	820,000,000	695,548,600
	第178回利付国債(20年)	1,000,000,000	859,850,000
	第179回利付国債(20年)	500,000,000	427,935,000
	第180回利付国債(20年)	1,060,000,000	953,480,600
	第181回利付国債(20年)	800,000,000	730,264,000
	第182回利付国債(20年)	790,000,000	743,943,000
	第183回利付国債(20年)	640,000,000	632,435,200
	第184回利付国債(20年)	1,020,000,000	955,046,400
	第185回利付国債(20年)	760,000,000	709,520,800
	第186回利付国債(20年)	680,000,000	678,449,600
	国債証券合計	170,746,000,000	165,147,000,050
地方債証券	第14回東京都公募公債	100,000,000	108,088,000
	第746回東京都公募公債	100,000,000	100,556,000
	第751回東京都公募公債	200,000,000	200,852,000
	第761回東京都公募公債	100,000,000	99,736,000

第785回東京都公募公債	100,000,000	99,204,000	
第789回東京都公募公債	100,000,000	98,366,000	
第817回東京都公募公債	100,000,000	95,964,000	
第843回東京都公募公債	100,000,000	99,914,000	
第24回東京都公募公債（20年）	100,000,000	109,781,000	
平成28年度第8回北海道公募公債	100,000,000	99,643,000	
第15回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	109,185,000	
第220回神奈川県公募公債	100,000,000	99,828,000	
第20回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	107,901,000	
第170回大阪府公募公債	100,000,000	99,875,000	
第403回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	100,585,000	
第451回大阪府公募公債	100,000,000	97,659,000	
第471回大阪府公募公債	140,000,000	134,159,200	
第5回大阪府公募公債（15年）	200,000,000	196,050,000	
第4回大阪府公募公債（20年）	100,000,000	110,417,000	
平成27年度第13回京都府公募公債	100,000,000	99,872,000	
平成29年度第1回兵庫県公募公債	100,000,000	99,825,000	
令和元年度第2回兵庫県公募公債	100,000,000	98,203,000	
第5回静岡県公募公債（20年）	100,000,000	107,295,000	
第6回静岡県公募公債（15年）	200,000,000	206,574,000	
平成30年度第14回静岡県公募公債	100,000,000	98,678,000	
平成22年度第8回愛知県公募公債	100,000,000	108,765,000	
平成26年度第11回愛知県公募公債（15年）	100,000,000	102,824,000	
平成28年度第8回愛知県公募公債	100,000,000	99,733,000	
平成29年度第11回愛知県公募公債	100,000,000	99,790,000	
令和3年度第12回愛知県公募公債	100,000,000	83,943,000	
平成30年度第1回広島県公募公債	100,000,000	99,338,000	
令和3年度第1回広島県公募公債	100,000,000	96,703,000	
令和4年度第5回広島県公募公債	100,000,000	100,207,000	
令和5年度第1回広島県公募公債（20年）	100,000,000	96,716,000	
第8回埼玉県公募公債	100,000,000	109,654,000	
第14回埼玉県公募公債（20年）	100,000,000	106,221,000	
令和3年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	90,662,000	
第3回埼玉県公募公債（10年）	100,000,000	100,314,000	
平成27年度第1回福岡県公募公債（20年）	200,000,000	205,890,000	
令和5年度第2回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	92,944,000	
第11回千葉県公募公債	100,000,000	109,077,000	
令和4年度第6回千葉県公募公債	100,000,000	98,149,000	
令和3年度第5回千葉県公募公債	100,000,000	95,949,000	
令和5年度第8回千葉県公募公債	100,000,000	100,270,000	
第15回千葉県公募公債	90,000,000	84,318,300	
令和3年度第3回茨城県公募公債	100,000,000	99,579,000	

令和5年度第2回茨城県公募公債	100,000,000	99,840,000	
第18回群馬県公募公債(5年)	100,000,000	100,437,000	
第152回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,650,000	
第156回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,870,000	
第169回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,951,000	
第172回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,914,000	
第174回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,549,000	
第181回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,308,000	
第185回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,349,000	
第187回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,345,000	
第191回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,557,000	
第197回共同発行市場公募地方債	100,000,000	97,883,000	
第207回共同発行市場公募地方債	100,000,000	97,767,000	
第209回共同発行市場公募地方債	100,000,000	97,429,000	
第217回共同発行市場公募地方債	100,000,000	97,176,000	
第222回共同発行市場公募地方債	100,000,000	96,022,000	
第231回共同発行市場公募地方債	100,000,000	96,623,000	
第245回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,100,000	
第246回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,302,000	
第249回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,075,000	
第250回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,607,000	
令和3年度第2回堺市公募公債	90,000,000	84,259,800	
令和元年度第3回堺市公募公債	100,000,000	97,936,000	
令和4年度第2回長崎県公募公債(20年・定時償還)	95,000,000	90,011,550	
令和5年度第2回島根県公募公債(20年)	100,000,000	99,793,000	
令和4年度第1回島根県公募公債	100,000,000	91,355,000	
令和2年度第1回佐賀県公募公債	100,000,000	97,196,000	
令和4年度第3回奈良県公募公債(20年・定時償還)	95,000,000	90,655,650	
平成27年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	100,623,000	
第11回大阪市公募公債	100,000,000	110,602,000	
第9回大阪市公募公債(20年)	100,000,000	109,392,000	
第17回名古屋市公募公債	100,000,000	102,061,000	
令和元年度第4回京都市公募公債	114,500,000	112,234,045	
平成22年度第9回神戸市公募公債	100,000,000	110,343,000	
平成26年度第3回神戸市公募公債(20年)	100,000,000	105,511,000	
第23回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	110,732,000	
第21回横浜市公募公債	100,000,000	109,195,000	
第25回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	108,038,000	
平成26年度第5回札幌市公募公債(15年)	100,000,000	102,816,000	
令和4年度第3回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	97,106,000	
第12回川崎市公募公債(30年)	100,000,000	71,927,000	

	第37回川崎市公募公債	90,000,000	84,024,900
	第70回川崎市公募公債(5年)	100,000,000	100,223,000
	平成27年度第2回広島市公募公債	100,000,000	100,608,000
	令和5年度第3回仙台市公募公債(5年)	100,000,000	99,382,000
	平成29年度第3回千葉市公募公債	120,000,000	119,602,800
	平成26年度第1回福井県公募公債	100,000,000	105,517,000
	平成29年度第5回福井県公募公債	100,000,000	99,349,000
	令和2年度第1回山梨県公募公債(10年)	100,000,000	97,294,000
	平成29年度第2回岡山県公募公債	100,000,000	99,682,000
	地方債証券合計	10,134,500,000	10,142,480,245
特殊債券	第34回新関西国際空港株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	94,354,000
	第28回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,462,000
	第47回株式会社日本政策投資銀行無担保社債(社債間限定同順位)	100,000,000	102,840,000
	第49回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	99,313,000
	第89回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	99,567,000
	第117回株式会社日本政策投資銀行無担保社債(社債間限定同順位)	100,000,000	71,900,000
	第131回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	75,828,000
	第16回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,307,000
	第127回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,911,000
	第138回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,442,000
	第148回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,774,000
	第183回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,386,000
	第205回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,544,000
	第249回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,596,000
	第251回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	103,000,000	103,748,810
	第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	133,000,000	133,567,910
	第270回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	97,770,000
	第300回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,873,000
	第330回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,642,000
	第345回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,222,000
	第375回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	98,426,000

第387回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	97,755,000	
第12回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,472,000	
第283回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	91,918,000	
第312回日本高速道路保有・債務返済機構債券(ソーシャルボン)	100,000,000	96,675,000	
第314回日本高速道路保有・債務返済機構債券(ソーシャルボン)	100,000,000	94,192,000	
第316回日本高速道路保有・債務返済機構債券(ソーシャルボン)	100,000,000	98,034,000	
第320回日本高速道路保有・債務返済機構債券(ソーシャルボン)	100,000,000	100,192,000	
第1回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,803,000	
第5回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	109,911,000	
第13回公営企業債券	100,000,000	102,813,000	
第18回公営企業債券(20年)	100,000,000	105,678,000	
第20回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	108,064,000	
第30回地方公共団体金融機構債券(5年)	100,000,000	99,354,000	
第78回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,517,000	
第95回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,773,000	
第96回政府保証地方公共団体金融機構債券	120,000,000	119,683,200	
第97回政府保証地方公共団体金融機構債券	145,000,000	144,682,450	
第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	213,000,000	211,704,960	
F132回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,414,000	
第163回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	97,495,000	
F305回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	97,629,000	
F143回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	207,378,000	
F159回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,018,000	
F14回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	75,428,000	
F151回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	95,222,000	
第10回株式会社日本政策金融公庫社債(一般担保付)	100,000,000	109,680,000	
第117回都市再生債券	100,000,000	101,104,000	
第2回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	105,519,000	
第6回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	42,254,000	41,692,021	
第7回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	45,064,000	44,575,956	
第97回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	108,716,000	
第102回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,668,000	
第117回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	208,024,000	
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,501,000	67,481,442	
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,126,000	66,910,021	
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,253,000	68,730,666	
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,825,000	67,530,221	
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,973,000	70,111,609	

第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,083,000	71,537,580
第150回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,376,000	75,564,126
第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,108,000	77,583,811
第161回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,370,000	79,887,538
第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,219,000	81,758,218
第170回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,615,000	82,843,505
第171回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,979,000	83,685,868
第172回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,362,000	83,095,042
第173回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,056,000	83,798,909
第174回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,472,000	84,621,175
第175回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,299,000	85,204,791
第183回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,678,000	88,479,807
第184回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	187,992,000	177,088,464
第185回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,788,000	89,883,668
第186回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,021,000	91,617,347
第187回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,313,000	92,024,701
第188回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,618,000	94,375,922
第198回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,463,000	100,079,670
第199回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,894,000	99,917,974
第201回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,160,000
第223回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	96,247,000
第351回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	92,543,000
第1回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	30,597,000	30,349,470
第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	31,247,000	31,012,959
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	32,560,000	32,376,687
第334回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	83,370,000
第356回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	97,295,000
第27回成田国際空港株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	90,586,000
第72回日本学生支援債券	100,000,000	99,893,000
い第866号商工債	100,000,000	99,311,000
い第870号商工債	100,000,000	99,270,000
い第879号商工債	100,000,000	99,467,000
第372回信中金債	100,000,000	99,725,000
第376回信中金債	100,000,000	99,611,000
第385回信中金債	100,000,000	99,362,000
第25回国際協力機構債券	100,000,000	104,892,000
第31回国際協力機構債券	100,000,000	100,592,000
第58回東日本高速道路株式会社社債(一般担保付、独立行政法人)	100,000,000	98,163,000
第85回東日本高速道路株式会社社債(一般担保付、独立行政法人)	100,000,000	95,579,000
第109回東日本高速道路株式会社社債(一般担保付、独立行政法)	100,000,000	99,864,000

	第 8 7 回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,616,000
	第 8 8 回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,568,000
	第 1 0 1 回中日本高速道路株式会社社債(一般担保付、独立行政法)	100,000,000	99,796,000
	第 7 9 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	99,944,000
	第 8 1 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	99,965,000
	第 8 3 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	99,962,000
	第 7 5 回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	100,909,000
	第 9 3 回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	89,883,000
	第 1 0 3 回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	84,365,000
	第 1 6 5 回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券(サステナビリティ)	100,000,000	99,902,000
	特殊債券合計	10,767,106,000	10,613,649,498
社債券	第 3 8 回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債(202)	100,000,000	100,175,000
	第 2 7 回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー期限前償還条項付円	100,000,000	99,577,000
	第 1 7 回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,083,000
	第 6 回フランス電力円貨社債(2023)	100,000,000	98,800,000
	第 3 3 回清水建設株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,049,000
	第 1 3 回大和ハウス工業株式会社無担保社債(特定社債間限定同順)	100,000,000	99,525,000
	第 1 回株式会社日清製粉グループ本社無担保社債	100,000,000	97,478,000
	第 2 2 回キリンホールディングス株式会社無担保社債(社債間限定)	100,000,000	100,257,000
	第 2 7 回味の素株式会社無担保社債	100,000,000	97,837,000
	第 2 7 回株式会社ニチレイ無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,021,000
	第 8 回トヨタ紡織株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,485,000
	第 1 8 回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	101,440,000
	第 1 8 回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	94,042,000
	第 2 9 回北越コーポレーション株式会社無担保社債(社債間限定同)	100,000,000	100,021,000
	第 3 5 回昭和電工株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	93,502,000
	第 1 3 回イビデン株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	99,876,000
	第 5 4 回三井化学株式会社無担保社債	100,000,000	93,948,000
	第 3 回三菱ケミカルグループ株式会社無担保社債(社債間限定同順)	100,000,000	99,978,000
	第 3 回株式会社電通無担保社債	100,000,000	98,903,000

第1回アステラス製薬株式会社無担保社債(社債間限定)	100,000,000	99,896,000	
第20回株式会社オリエンタルランド無担保社債	100,000,000	99,350,000	
第12回Zホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,009,000	
第18回富士フィルムホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	97,836,000	
第10回株式会社資生堂無担保社債	100,000,000	99,836,000	
第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	98,393,000	
第15回旭硝子株式会社無担保社債	100,000,000	99,474,000	
第28回ジェイ エフ イー ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,719,000	
第30回ダイキン工業株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約)	100,000,000	98,521,000	
第46回三菱電機株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,035,000	
第16回日本電産株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	99,363,000	
第19回パナソニック株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約)	100,000,000	96,430,000	
第38回ソニーグループ株式会社無担保社債	100,000,000	99,604,000	
第43回三菱重工工業株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	98,593,000	
第17回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,765,000	
第21回株式会社パン・パシフィック・インターナショナルホール	100,000,000	99,787,000	
第5回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	97,308,000	
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	96,852,000	
第62回住友商事株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	101,044,000	
第97回株式会社クレディセゾン無担保社債(社債間限定同順位特約)	100,000,000	99,992,000	
第17回株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ無担保社債	100,000,000	97,752,000	
第19回三井住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	99,416,000	
第18回NTTファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	97,221,000	
第21回NTTファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,287,000	
第27回NTTファイナンス株式会社無担保社債(社債間限定同順位)	100,000,000	100,125,000	
第29回NTTファイナンス株式会社無担保社債(社債間限定同順位)	100,000,000	100,313,000	
第71回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,313,000	
第29回SBIホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,005,000	
第100回トヨタファイナンス株式会社無担保社債(社債間限定同順位)	100,000,000	100,121,000	

第17回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債(社債)	100,000,000	99,413,000	
第81回アコム株式会社無担保社債	100,000,000	99,019,000	
第84回アコム株式会社無担保社債(特定社債間限定同順位特約付)	100,000,000	99,950,000	
第219回オリックス株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約)	100,000,000	100,021,000	
第220回オリックス株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約)	100,000,000	99,979,000	
第40回株式会社大和証券グループ本社無担保社債(社債間限定同)	100,000,000	100,091,000	
第7回三井住友海上火災保険株式会社無担保社債	100,000,000	99,357,000	
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	99,109,000	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	99,384,000	
第134回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	98,148,000	
第44回相鉄ホールディングス株式会社無担保社債(相模鉄道株式)	100,000,000	99,454,000	
第14回東急株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	97,724,000	
第112回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	100,275,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	83,142,000	
第196回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債(社債間限定同)	100,000,000	97,068,000	
第3回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	95,186,000	
第26回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	109,468,000	
第10回九州旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	82,434,000	
第22回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	98,497,000	
第543回中部電力株式会社社債	100,000,000	99,805,000	
第536回関西電力株式会社社債	100,000,000	96,974,000	
第541回関西電力株式会社社債	100,000,000	95,454,000	
第433回中国電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	99,485,000	
第338回北陸電力株式会社社債	100,000,000	96,606,000	
第531回東北電力株式会社社債	100,000,000	95,676,000	
第503回九州電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	99,696,000	
第375回北海道電力株式会社社債	100,000,000	99,837,000	
第32回沖縄電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	99,913,000	
第28回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,266,000	
第47回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	96,064,000	
第68回東京電力パワーグリッド株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	100,433,000	
第10回株式会社JERA無担保社債	100,000,000	99,927,000	
第70回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	99,495,000	
	100,000,000	83,639,000	

	第49回大阪瓦斯株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）			
	第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	99,249,000	
	社債券合計	8,300,000,000	8,170,595,000	
	合計		194,073,724,793	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## RM先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

## 貸借対照表

（単位：円）

2024年 1月25日現在

資産の部	
流動資産	
預金	235,900,886
コール・ローン	158,483,496
国債証券	126,003,807,741
派生商品評価勘定	1,924,081
未収入金	740,539,104
未収利息	988,457,959
前払費用	92,110,711
流動資産合計	128,221,223,978
資産合計	128,221,223,978
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,749,809,732
前受収益	5,362
未払金	751,008,317
未払解約金	73,641,600
未払利息	429
流動負債合計	5,574,465,440
負債合計	5,574,465,440
純資産の部	
元本等	
元本	144,427,607,778
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	21,780,849,240
元本等合計	122,646,758,538
純資産合計	122,646,758,538
負債純資産合計	128,221,223,978

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

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

## (貸借対照表に関する注記)

2024年 1月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 1月26日
期首元本額	256,025,207,102円
期中追加設定元本額	37,222,209,182円
期中一部解約元本額	148,819,808,506円
期末元本額	144,427,607,778円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	25,875,443,749円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	17,987,639,675円
りそなラップ型ファンド(成長型)	507,355,546円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	7,625,931,294円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	2,329,689,864円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	746,822,738円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	1,284,428,789円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	396,224,169円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	97,494,918円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	126,926,411円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定型)	864,253,774円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定成長型)	528,928,724円
りそな つみたてラップ型ファンド(成長型)	16,981,614円
りそな つみたてリスクコントロールファンド	79,021,402円
ターゲットリターンバランスファンド(目標2%)	12,180,324円
ターゲットリターンバランスファンド(目標3%)	4,678,851円
ターゲットリターンバランスファンド(目標4%)	14,458,765円
ターゲットリターンバランスファンド(目標5%)	3,682,139円
ターゲットリターンバランスファンド(目標6%)	3,223,543円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2065	123,364円
FWりそな円建債券アクティブファンド	724,552,500円
FWりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジあり)	63,772,801,874円
Smart-i 先進国債券インデックス(為替ヘッジあり)	2,844,718,588円
Smart-i 8資産バランス 安定型	2,484,054,499円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	1,897,856,392円
Smart-i 8資産バランス 成長型	520,550,128円
りそなFT 先進国債券インデックス・為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	8,544,134,966円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	437,214,968円
りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	2,587,818,220円
りそなVEI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)	84,088,520円
りそなVEI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)	70,909,331円
りそなVEIグローバル・バランスファンド(成長型)(適格機関投資家専用)	15,957,192円
りそなFT マルチアセットファンド(適格機関投資家専用)	103,690,418円
りそなDAAマルチアセットファンド(適格機関投資家専用)	3,733,145円
りそなマルチアセットファンド(適格機関投資家専用)	419,486,479円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	494,804,931円
りそなDAAファンド202205(適格機関投資家専用)	915,745,974円
2. 計算日における受益権の総数	144,427,607,778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	21,780,849,240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	0.8492円
(10,000口当たり純資産額)	(8,492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 1月25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 1月25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 (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 1月25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 1月25日現在	
	損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		320,372,856
合計		320,372,856

(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 1月25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	631,869,825	-	630,772,464	1,097,361	
	米ドル	319,096,097	-	318,557,966	538,131	
	カナダドル	47,153,952	-	46,851,963	301,989	
	ユーロ	229,304,153	-	229,087,465	216,688	
	英ポンド	36,315,623	-	36,275,070	40,553	
	売建	124,632,608,218	-	129,379,396,508	4,746,788,290	
	米ドル	58,498,327,677	-	61,268,132,446	2,769,804,769	
	カナダドル	2,563,420,293	-	2,625,731,212	62,310,919	
	メキシコペソ	1,092,209,334	-	1,130,338,559	38,129,225	
	ユーロ	40,909,889,784	-	42,054,105,027	1,144,215,243	
	英ポンド	6,674,629,270	-	6,973,857,699	299,228,429	

スウェーデンクローナ	267,464,128	-	267,378,442	85,686
ノルウェークローネ	226,073,236	-	230,333,511	4,260,275
デンマーククローネ	351,376,022	-	361,095,384	9,719,362
ポーランドズロチ	642,668,976	-	655,549,635	12,880,659
オーストラリアドル	1,746,395,626	-	1,759,421,361	13,025,735
ニュージーランドドル	301,187,187	-	304,161,286	2,974,099
シンガポールドル	538,711,911	-	555,164,107	16,452,196
マレーシアリンギット	620,110,472	-	627,792,288	7,681,816
中国元	9,817,725,312	-	10,171,540,570	353,815,258
イスラエルシケル	382,418,990	-	394,794,981	12,375,991
合計	125,264,478,043	-	130,010,168,972	4,747,885,651

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY N/B	980,000.00	956,500.30	
		US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,262,936.10	
		US TREASURY N/B	1,280,000.00	1,272,357.35	
		US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,929,857.00	
		US TREASURY N/B	530,000.00	517,852.08	
		US TREASURY N/B	1,290,000.00	1,246,221.77	
		US TREASURY N/B	1,630,000.00	1,618,618.54	
		US TREASURY N/B	1,750,000.00	1,699,364.57	
		US TREASURY N/B	1,940,000.00	1,873,787.70	
		US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,272,248.04	
		US TREASURY N/B	1,260,000.00	1,211,470.31	
		US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,934,062.50	
		US TREASURY N/B	1,030,000.00	1,005,457.03	

US TREASURY N/B	840,000.00	799,853.90
US TREASURY N/B	1,790,000.00	1,745,949.20
US TREASURY N/B	950,000.00	928,977.53
US TREASURY N/B	1,990,000.00	1,885,758.20
US TREASURY N/B	1,150,000.00	1,138,522.45
US TREASURY N/B	2,620,000.00	2,536,794.53
US TREASURY N/B	1,750,000.00	1,708,266.59
US TREASURY N/B	870,000.00	850,000.19
US TREASURY N/B	2,520,000.00	2,376,871.86
US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,890,240.23
US TREASURY N/B	3,100,000.00	3,028,615.24
US TREASURY N/B	2,120,000.00	2,066,917.19
US TREASURY N/B	690,000.00	649,058.20
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,100,644.53
US TREASURY N/B	1,890,000.00	1,848,065.62
US TREASURY N/B	2,250,000.00	2,194,936.51
US TREASURY N/B	2,980,000.00	2,793,575.40
US TREASURY N/B	600,000.00	601,652.34
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,443,251.95
US TREASURY N/B	3,260,000.00	3,191,170.70
US TREASURY N/B	1,890,000.00	1,838,246.48
US TREASURY N/B	1,120,000.00	1,046,718.74
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,180,757.80
US TREASURY N/B	2,430,000.00	2,371,100.97
US TREASURY N/B	2,520,000.00	2,348,472.64
US TREASURY N/B	910,000.00	906,427.53
US TREASURY N/B	1,190,000.00	1,160,482.41
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,207,984.37
US TREASURY N/B	350,000.00	353,062.50
US TREASURY N/B	2,270,000.00	2,183,456.25
US TREASURY N/B	1,430,000.00	1,431,005.46
US TREASURY N/B	920,000.00	894,484.37
US TREASURY N/B	1,380,000.00	1,281,459.36
US TREASURY N/B	2,600,000.00	2,619,500.00
US TREASURY N/B	1,550,000.00	1,538,072.26
US TREASURY N/B	840,000.00	812,765.62
US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,296,914.06
US TREASURY N/B	1,940,000.00	1,921,168.36
US TREASURY N/B	1,970,000.00	1,904,435.93
US TREASURY N/B	1,590,000.00	1,468,358.78
US TREASURY N/B	2,010,000.00	1,902,198.05
US TREASURY N/B	1,550,000.00	1,538,829.10
US TREASURY N/B	1,020,000.00	982,367.57

US TREASURY N/B	2,340,000.00	2,160,889.45
US TREASURY N/B	1,410,000.00	1,417,766.01
US TREASURY N/B	1,000,000.00	957,304.69
US TREASURY N/B	3,070,000.00	2,845,386.33
US TREASURY N/B	750,000.00	740,859.37
US TREASURY N/B	750,000.00	719,091.79
US TREASURY N/B	2,820,000.00	2,605,525.77
US TREASURY N/B	1,220,000.00	1,148,896.87
US TREASURY N/B	840,000.00	827,580.46
US TREASURY N/B	900,000.00	857,074.22
US TREASURY N/B	1,580,000.00	1,456,223.05
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,992,617.18
US TREASURY N/B	1,150,000.00	1,087,783.20
US TREASURY N/B	1,670,000.00	1,541,325.19
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,206,210.93
US TREASURY N/B	2,600,000.00	2,454,156.25
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,285,351.55
US TREASURY N/B	1,330,000.00	1,241,991.39
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,203,164.06
US TREASURY N/B	1,280,000.00	1,190,600.00
US TREASURY N/B	2,170,000.00	1,985,168.55
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,715,738.27
US TREASURY N/B	860,000.00	804,133.59
US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,466,406.25
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,817,824.21
US TREASURY N/B	2,120,000.00	1,977,976.55
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,564,332.02
US TREASURY N/B	1,640,000.00	1,544,739.05
US TREASURY N/B	1,450,000.00	1,350,878.89
US TREASURY N/B	2,600,000.00	2,395,503.91
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,009,375.00
US TREASURY N/B	640,000.00	597,500.00
US TREASURY N/B	3,300,000.00	3,036,386.72
US TREASURY N/B	2,550,000.00	2,357,604.48
US TREASURY N/B	1,180,000.00	1,115,100.00
US TREASURY N/B	1,000,000.00	912,363.28
US TREASURY N/B	2,060,000.00	1,923,082.42
US TREASURY N/B	1,750,000.00	1,567,070.31
US TREASURY N/B	800,000.00	760,718.75
US TREASURY N/B	650,000.00	577,979.49
US TREASURY N/B	900,000.00	861,416.01
US TREASURY N/B	620,000.00	585,766.79
US TREASURY N/B	1,570,000.00	1,391,964.44

US TREASURY N/B	2,400,000.00	2,285,156.25
US TREASURY N/B	1,230,000.00	1,087,661.12
US TREASURY N/B	1,850,000.00	1,797,390.62
US TREASURY N/B	3,470,000.00	3,045,806.06
US TREASURY N/B	1,140,000.00	1,088,009.76
US TREASURY N/B	2,150,000.00	2,015,876.95
US TREASURY N/B	820,000.00	721,135.54
US TREASURY N/B	1,480,000.00	1,429,500.78
US TREASURY N/B	2,270,000.00	1,981,284.37
US TREASURY N/B	1,890,000.00	1,888,818.75
US TREASURY N/B	2,310,000.00	2,019,986.70
US TREASURY N/B	2,180,000.00	2,178,339.45
US TREASURY N/B	940,000.00	877,982.03
US TREASURY N/B	2,130,000.00	1,866,745.31
US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,386,847.65
US TREASURY N/B	1,680,000.00	1,468,326.56
US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,080,763.66
US TREASURY N/B	2,770,000.00	2,427,158.40
US TREASURY N/B	2,410,000.00	2,354,409.95
US TREASURY N/B	1,650,000.00	1,565,630.86
US TREASURY N/B	2,120,000.00	1,882,535.14
US TREASURY N/B	1,610,000.00	1,602,453.12
US TREASURY N/B	1,940,000.00	1,727,964.05
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,471,787.11
US TREASURY N/B	2,770,000.00	2,461,729.30
US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,366,367.18
US TREASURY N/B	3,390,000.00	3,225,002.32
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,660,273.43
US TREASURY N/B	1,670,000.00	1,638,133.00
US TREASURY N/B	2,570,000.00	2,274,199.01
US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,091,058.59
US TREASURY N/B	3,350,000.00	2,923,791.02
US TREASURY N/B	2,520,000.00	2,391,489.85
US TREASURY N/B	2,390,000.00	2,093,350.59
US TREASURY N/B	700,000.00	708,039.06
US TREASURY N/B	2,400,000.00	2,109,984.38
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,759,062.50
US TREASURY N/B	2,230,000.00	1,968,366.98
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,342,960.94
US TREASURY N/B	2,950,000.00	2,824,336.90
US TREASURY N/B	2,170,000.00	1,923,332.02
US TREASURY N/B	1,990,000.00	1,749,489.83
US TREASURY N/B	2,060,000.00	1,842,171.08

US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,145,783.20
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,168,044.91
US TREASURY N/B	2,130,000.00	1,958,851.17
US TREASURY N/B	2,080,000.00	1,959,018.75
US TREASURY N/B	1,530,000.00	1,404,671.48
US TREASURY N/B	1,630,000.00	1,524,272.85
US TREASURY N/B	1,630,000.00	1,561,457.22
US TREASURY N/B	1,270,000.00	1,177,131.25
US TREASURY N/B	1,770,000.00	1,557,669.13
US TREASURY N/B	1,450,000.00	1,377,953.12
US TREASURY N/B	980,000.00	967,405.47
US TREASURY N/B	1,350,000.00	1,340,824.21
US TREASURY N/B	1,320,000.00	1,164,487.50
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,480,078.12
US TREASURY N/B	1,360,000.00	1,341,539.06
US TREASURY N/B	1,040,000.00	1,005,042.18
US TREASURY N/B	2,610,000.00	2,245,007.81
US TREASURY N/B	1,870,000.00	1,856,048.04
US TREASURY N/B	1,850,000.00	1,798,113.27
US TREASURY N/B	800,000.00	771,906.24
US TREASURY N/B	780,000.00	870,157.03
US TREASURY N/B	3,930,000.00	3,170,711.73
US TREASURY N/B	1,030,000.00	1,007,488.84
US TREASURY N/B	1,560,000.00	1,525,509.36
US TREASURY N/B	960,000.00	952,106.24
US TREASURY N/B	4,610,000.00	3,687,549.78
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,355,046.87
US TREASURY N/B	4,220,000.00	3,417,705.45
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,026,250.00
US TREASURY N/B	1,210,000.00	1,307,083.59
US TREASURY N/B	3,330,000.00	2,735,217.77
US TREASURY N/B	3,100,000.00	2,614,777.33
US TREASURY N/B	4,430,000.00	3,605,691.20
US TREASURY N/B	4,310,000.00	3,518,542.58
US TREASURY N/B	3,780,000.00	3,193,214.04
US TREASURY N/B	3,960,000.00	3,602,362.50
US TREASURY N/B	3,670,000.00	3,296,620.50
US TREASURY N/B	3,610,000.00	3,597,308.61
US TREASURY N/B	4,370,000.00	4,149,622.24
US TREASURY N/B	3,640,000.00	3,417,618.75
US TREASURY N/B	4,050,000.00	3,955,078.12
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,769,820.31
US TREASURY N/B	10,000.00	10,366.01

US TREASURY N/B	730,000.00	789,569.13
US TREASURY N/B	100,000.00	101,248.04
US TREASURY N/B	300,000.00	306,943.35
US TREASURY N/B	60,000.00	54,539.06
US TREASURY N/B	270,000.00	267,062.69
US TREASURY N/B	480,000.00	487,593.74
US TREASURY N/B	520,000.00	519,979.68
US TREASURY N/B	780,000.00	801,389.06
US TREASURY N/B	950,000.00	946,418.94
US TREASURY N/B	740,000.00	455,591.40
US TREASURY N/B	610,000.00	570,123.63
US TREASURY N/B	1,040,000.00	633,100.00
US TREASURY N/B	1,220,000.00	1,193,026.55
US TREASURY N/B	2,130,000.00	1,349,180.27
US TREASURY N/B	530,000.00	549,957.81
US TREASURY N/B	1,910,000.00	1,313,871.08
US TREASURY N/B	1,130,000.00	1,118,523.43
US TREASURY N/B	1,620,000.00	1,181,587.50
US TREASURY N/B	1,080,000.00	984,761.72
US TREASURY N/B	2,010,000.00	1,336,414.44
US TREASURY N/B	1,040,000.00	865,332.81
US TREASURY N/B	2,450,000.00	1,697,007.81
US TREASURY N/B	1,340,000.00	1,112,304.68
US TREASURY N/B	860,000.00	631,965.62
US TREASURY N/B	1,070,000.00	868,204.68
US TREASURY N/B	1,590,000.00	1,338,581.25
US TREASURY N/B	240,000.00	186,492.18
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,455,392.57
US TREASURY N/B	1,560,000.00	1,208,695.31
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,121,578.12
US TREASURY N/B	440,000.00	360,971.87
US TREASURY N/B	1,350,000.00	1,236,990.23
US TREASURY N/B	1,180,000.00	928,235.93
US TREASURY N/B	1,530,000.00	1,400,428.12
US TREASURY N/B	930,000.00	820,488.86
US TREASURY N/B	1,140,000.00	1,117,467.18
US TREASURY N/B	1,060,000.00	951,329.29
US TREASURY N/B	740,000.00	651,489.05
US TREASURY N/B	910,000.00	769,909.76
US TREASURY N/B	1,780,000.00	1,444,164.05
US TREASURY N/B	170,000.00	134,695.11
US TREASURY N/B	1,380,000.00	997,589.05
US TREASURY N/B	1,100,000.00	867,990.23

US TREASURY N/B	390,000.00	300,360.93
US TREASURY N/B	620,000.00	487,450.78
US TREASURY N/B	120,000.00	85,715.62
US TREASURY N/B	1,780,000.00	1,267,624.22
US TREASURY N/B	1,050,000.00	708,934.56
US TREASURY N/B	1,010,000.00	768,803.32
US TREASURY N/B	840,000.00	652,853.90
US TREASURY N/B	950,000.00	737,029.29
US TREASURY N/B	1,530,000.00	1,130,287.50
US TREASURY N/B	1,200,000.00	884,789.06
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,158,427.74
US TREASURY N/B	1,580,000.00	1,247,274.21
US TREASURY N/B	1,460,000.00	1,124,827.34
US TREASURY N/B	1,780,000.00	1,468,430.46
US TREASURY N/B	1,480,000.00	1,137,923.44
US TREASURY N/B	1,290,000.00	967,323.63
US TREASURY N/B	1,500,000.00	984,375.00
US TREASURY N/B	1,590,000.00	1,071,976.75
US TREASURY N/B	1,710,000.00	1,053,486.91
US TREASURY N/B	2,460,000.00	1,232,306.25
US TREASURY N/B	2,920,000.00	1,512,810.94
US TREASURY N/B	2,870,000.00	1,591,953.12
US TREASURY N/B	2,940,000.00	1,740,227.33
US TREASURY N/B	2,840,000.00	1,898,417.96
US TREASURY N/B	3,010,000.00	1,834,571.49
US TREASURY N/B	2,840,000.00	1,673,048.43
US TREASURY N/B	1,860,000.00	1,204,676.95
US TREASURY N/B	2,590,000.00	1,933,748.62
US TREASURY N/B	1,540,000.00	1,180,596.47
US TREASURY N/B	2,800,000.00	2,603,945.31
US TREASURY N/B	2,100,000.00	1,824,087.88
US TREASURY N/B	2,380,000.00	2,068,740.62
US TREASURY N/B	3,150,000.00	2,999,144.53
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,162,906.25
	米ドル 小計	450,990,000.00 404,050,075.09 (59,742,844,102)
カナダドル	GOV OF CANADA	590,000.00 584,632.91
	GOV OF CANADA	600,000.00 579,206.46
	GOV OF CANADA	760,000.00 734,079.21
	GOV OF CANADA	350,000.00 340,365.23
	GOV OF CANADA	660,000.00 652,048.01
	GOV OF CANADA	1,020,000.00 961,723.02
	GOV OF CANADA	470,000.00 460,652.92

	GOV OF CANADA	650,000.00	653,462.44
	GOV OF CANADA	190,000.00	191,766.04
	GOV OF CANADA	1,000,000.00	926,381.48
	GOV OF CANADA	130,000.00	127,456.43
	GOV OF CANADA	730,000.00	691,609.32
	GOV OF CANADA	730,000.00	679,937.95
	GOV OF CANADA	610,000.00	566,912.13
	GOV OF CANADA	650,000.00	596,686.94
	GOV OF CANADA	90,000.00	87,255.12
	GOV OF CANADA	740,000.00	737,262.55
	GOV OF CANADA	280,000.00	263,062.59
	GOV OF CANADA	620,000.00	612,207.61
	GOV OF CANADA	520,000.00	531,722.72
	GOV OF CANADA	480,000.00	532,911.51
	GOV OF CANADA	250,000.00	235,459.58
	GOV OF CANADA	1,260,000.00	1,102,045.30
	GOV OF CANADA	1,020,000.00	837,412.36
	GOV OF CANADA	1,000,000.00	872,111.84
	GOV OF CANADA	1,510,000.00	1,304,989.42
	GOV OF CANADA	980,000.00	875,094.79
	GOV OF CANADA	700,000.00	647,661.16
	GOV OF CANADA	910,000.00	1,072,198.63
	GOV OF CANADA	260,000.00	244,771.43
	GOV OF CANADA	500,000.00	489,941.12
	GOV OF CANADA	250,000.00	288,808.29
	GOV OF CANADA	380,000.00	403,053.31
	GOV OF CANADA	410,000.00	409,336.21
	GOV OF CANADA	380,000.00	333,743.34
	GOV OF CANADA	1,710,000.00	1,260,757.93
	GOV OF CANADA	1,050,000.00	717,979.02
	GOV OF CANADA	470,000.00	406,032.64
	GOV OF CANADA	250,000.00	213,791.51
	カナダドル 小計	25,160,000.00	23,226,530.47 (2,538,659,780)
メキシコペソ	UNITED MEXICAN STATE	5,750,000.00	5,471,355.00
	UNITED MEXICAN STATE	17,830,000.00	16,465,756.62
	UNITED MEXICAN STATE	4,160,000.00	3,902,412.80
	UNITED MEXICAN STATE	14,300,000.00	12,790,063.00
	UNITED MEXICAN STATE	13,110,000.00	12,423,691.50
	UNITED MEXICAN STATE	12,900,000.00	12,583,950.00
	UNITED MEXICAN STATE	16,566,000.00	15,318,911.52
	UNITED MEXICAN STATE	10,060,000.00	8,990,622.00
	UNITED MEXICAN STATE	3,620,000.00	3,253,800.80

	UNITED MEXICAN STATE	3,370,000.00	3,568,021.20
	UNITED MEXICAN STATE	10,570,000.00	9,881,047.40
	UNITED MEXICAN STATE	10,960,000.00	9,408,173.60
	UNITED MEXICAN STATE	9,880,000.00	8,613,976.80
	UNITED MEXICAN STATE	7,030,000.00	6,070,897.10
	メキシコペソ 小計	140,106,000.00	128,742,679.34 (1,104,097,218)
ユーロ	GOV OF AUSTRIA	310,000.00	298,683.76
	GOV OF AUSTRIA	460,000.00	447,692.70
	GOV OF AUSTRIA	470,000.00	490,106.13
	GOV OF AUSTRIA	220,000.00	216,501.89
	GOV OF AUSTRIA	550,000.00	522,585.80
	GOV OF AUSTRIA	530,000.00	496,168.51
	GOV OF AUSTRIA	370,000.00	413,857.95
	GOV OF AUSTRIA	460,000.00	427,738.82
	GOV OF AUSTRIA	280,000.00	247,694.72
	GOV OF AUSTRIA	830,000.00	747,239.87
	GOV OF AUSTRIA	600,000.00	511,935.00
	GOV OF AUSTRIA	570,000.00	471,737.13
	GOV OF AUSTRIA	440,000.00	380,987.20
	GOV OF AUSTRIA	440,000.00	442,393.60
	GOV OF AUSTRIA	490,000.00	468,855.03
	GOV OF AUSTRIA	250,000.00	177,593.25
	GOV OF AUSTRIA	590,000.00	659,018.20
	GOV OF AUSTRIA	280,000.00	168,109.76
	GOV OF AUSTRIA	490,000.00	490,347.90
	GOV OF AUSTRIA	300,000.00	220,211.10
	GOV OF AUSTRIA	110,000.00	85,534.10
	GOV OF AUSTRIA	490,000.00	281,895.28
	GOV OF AUSTRIA	80,000.00	79,743.04
	GOV OF AUSTRIA	180,000.00	204,985.26
	GOV OF AUSTRIA	30,000.00	13,146.60
	GOV OF AUSTRIA	160,000.00	68,558.24
	GOV OF AUSTRIA	240,000.00	176,084.28
	GOV OF AUSTRIA	160,000.00	93,846.08
	GOV OF BELGIUM	830,000.00	805,202.92
	GOV OF BELGIUM	460,000.00	476,942.26
	GOV OF BELGIUM	650,000.00	625,074.45
	GOV OF BELGIUM	630,000.00	594,100.08
	GOV OF BELGIUM	390,000.00	354,751.60
	GOV OF BELGIUM	790,000.00	881,030.12
	GOV OF BELGIUM	690,000.00	640,406.25
	GOV OF BELGIUM	840,000.00	769,538.28

GOV OF BELGIUM	600,000.00	511,479.90
GOV OF BELGIUM	570,000.00	504,936.21
GOV OF BELGIUM	630,000.00	510,909.52
GOV OF BELGIUM	500,000.00	544,900.00
GOV OF BELGIUM	640,000.00	523,827.84
GOV OF BELGIUM	580,000.00	508,207.60
GOV OF BELGIUM	280,000.00	283,083.08
GOV OF BELGIUM	90,000.00	90,538.20
GOV OF BELGIUM	780,000.00	926,992.56
GOV OF BELGIUM	250,000.00	204,602.50
GOV OF BELGIUM	330,000.00	281,913.72
GOV OF BELGIUM	310,000.00	198,843.92
GOV OF BELGIUM	680,000.00	768,798.48
GOV OF BELGIUM	160,000.00	162,834.60
GOV OF BELGIUM	450,000.00	479,139.75
GOV OF BELGIUM	430,000.00	308,737.42
GOV OF BELGIUM	470,000.00	332,947.53
GOV OF BELGIUM	440,000.00	278,977.60
GOV OF BELGIUM	430,000.00	418,232.62
GOV OF BELGIUM	240,000.00	186,007.92
GOV OF BELGIUM	380,000.00	281,974.06
GOV OF BELGIUM	250,000.00	102,753.75
GOV OF FINLAND	150,000.00	152,184.39
GOV OF FINLAND	310,000.00	300,498.81
GOV OF FINLAND	210,000.00	200,326.77
GOV OF FINLAND	230,000.00	214,662.91
GOV OF FINLAND	260,000.00	250,305.38
GOV OF FINLAND	160,000.00	148,569.72
GOV OF FINLAND	280,000.00	281,972.88
GOV OF FINLAND	310,000.00	281,840.11
GOV OF FINLAND	260,000.00	231,393.91
GOV OF FINLAND	200,000.00	167,770.00
GOV OF FINLAND	290,000.00	253,234.67
GOV OF FINLAND	370,000.00	304,154.28
GOV OF FINLAND	190,000.00	171,321.74
GOV OF FINLAND	230,000.00	194,447.54
GOV OF FINLAND	260,000.00	184,195.70
GOV OF FINLAND	80,000.00	76,964.68
GOV OF FINLAND	100,000.00	63,348.90
GOV OF FINLAND	190,000.00	177,526.69
GOV OF FINLAND	230,000.00	143,922.50
GOV OF FINLAND	320,000.00	231,310.72
GOV OF FINLAND	160,000.00	73,746.72

GOV OF FRANCE	1,110,000.00	1,072,433.16
GOV OF FRANCE	1,790,000.00	1,726,612.52
GOV OF FRANCE	1,410,000.00	1,364,082.90
GOV OF FRANCE	1,240,000.00	1,305,406.28
GOV OF FRANCE	1,450,000.00	1,403,969.75
GOV OF FRANCE	1,810,000.00	1,712,142.35
GOV OF FRANCE	1,720,000.00	1,750,225.56
GOV OF FRANCE	1,990,000.00	1,893,956.63
GOV OF FRANCE	1,550,000.00	1,543,851.15
GOV OF FRANCE	1,690,000.00	1,582,666.41
GOV OF FRANCE	1,510,000.00	1,395,831.92
GOV OF FRANCE	1,520,000.00	1,444,712.88
GOV OF FRANCE	2,200,000.00	2,213,745.60
GOV OF FRANCE	1,580,000.00	1,470,365.38
GOV OF FRANCE	3,010,000.00	2,790,038.23
GOV OF FRANCE	1,860,000.00	1,708,826.64
GOV OF FRANCE	400,000.00	403,021.20
GOV OF FRANCE	2,230,000.00	2,543,725.32
GOV OF FRANCE	2,200,000.00	1,976,095.00
GOV OF FRANCE	1,850,000.00	1,594,907.20
GOV OF FRANCE	2,240,000.00	2,227,947.76
GOV OF FRANCE	2,230,000.00	1,868,872.67
GOV OF FRANCE	2,410,000.00	2,229,900.70
GOV OF FRANCE	2,190,000.00	1,780,820.40
GOV OF FRANCE	1,280,000.00	1,024,140.80
GOV OF FRANCE	1,330,000.00	1,634,585.96
GOV OF FRANCE	1,770,000.00	1,667,120.52
GOV OF FRANCE	1,680,000.00	1,708,392.00
GOV OF FRANCE	290,000.00	306,335.90
GOV OF FRANCE	1,790,000.00	1,533,707.80
GOV OF FRANCE	1,130,000.00	1,325,034.61
GOV OF FRANCE	1,820,000.00	1,494,088.96
GOV OF FRANCE	510,000.00	401,097.15
GOV OF FRANCE	1,030,000.00	1,141,965.12
GOV OF FRANCE	1,350,000.00	1,130,554.63
GOV OF FRANCE	910,000.00	603,886.01
GOV OF FRANCE	1,370,000.00	1,611,161.10
GOV OF FRANCE	530,000.00	473,391.23
GOV OF FRANCE	720,000.00	429,645.60
GOV OF FRANCE	1,190,000.00	1,189,827.45
GOV OF FRANCE	1,290,000.00	1,015,272.57
GOV OF FRANCE	1,220,000.00	839,190.42
GOV OF FRANCE	1,270,000.00	683,695.61

GOV OF FRANCE	1,240,000.00	653,196.04
GOV OF FRANCE	810,000.00	755,781.84
GOV OF FRANCE	780,000.00	879,256.56
GOV OF FRANCE	780,000.00	889,446.63
GOV OF FRANCE	660,000.00	442,901.58
GOV OF FRANCE	450,000.00	172,628.10
GOV OF GERMANY	1,190,000.00	1,157,297.01
GOV OF GERMANY	580,000.00	576,008.54
GOV OF GERMANY	890,000.00	858,303.54
GOV OF GERMANY	420,000.00	418,989.20
GOV OF GERMANY	1,730,000.00	1,682,407.70
GOV OF GERMANY	280,000.00	281,225.28
GOV OF GERMANY	970,000.00	926,520.72
GOV OF GERMANY	350,000.00	334,888.40
GOV OF GERMANY	480,000.00	483,392.64
GOV OF GERMANY	1,300,000.00	1,246,207.30
GOV OF GERMANY	1,030,000.00	974,893.97
GOV OF GERMANY	1,030,000.00	968,664.53
GOV OF GERMANY	930,000.00	871,727.35
GOV OF GERMANY	1,100,000.00	1,032,919.80
GOV OF GERMANY	860,000.00	798,339.72
GOV OF GERMANY	960,000.00	1,089,989.28
GOV OF GERMANY	1,170,000.00	1,099,739.16
GOV OF GERMANY	1,370,000.00	1,322,570.60
GOV OF GERMANY	500,000.00	459,084.50
GOV OF GERMANY	890,000.00	1,000,701.93
GOV OF GERMANY	770,000.00	718,454.66
GOV OF GERMANY	670,000.00	667,919.65
GOV OF GERMANY	710,000.00	783,847.31
GOV OF GERMANY	1,110,000.00	1,016,340.42
GOV OF GERMANY	1,050,000.00	1,056,221.25
GOV OF GERMANY	1,050,000.00	944,966.40
GOV OF GERMANY	1,060,000.00	961,735.88
GOV OF GERMANY	1,150,000.00	1,018,862.05
GOV OF GERMANY	980,000.00	972,645.10
GOV OF GERMANY	460,000.00	561,725.91
GOV OF GERMANY	970,000.00	850,011.00
GOV OF GERMANY	1,130,000.00	979,606.04
GOV OF GERMANY	700,000.00	607,517.54
GOV OF GERMANY	330,000.00	333,049.53
GOV OF GERMANY	870,000.00	1,051,569.00
GOV OF GERMANY	1,090,000.00	934,520.22
GOV OF GERMANY	1,090,000.00	923,781.54

GOV OF GERMANY	500,000.00	424,013.00
GOV OF GERMANY	1,430,000.00	1,196,930.02
GOV OF GERMANY	810,000.00	775,518.30
GOV OF GERMANY	1,730,000.00	1,733,229.91
GOV OF GERMANY	1,140,000.00	1,168,261.74
GOV OF GERMANY	950,000.00	1,158,233.35
GOV OF GERMANY	880,000.00	673,022.24
GOV OF GERMANY	830,000.00	616,333.10
GOV OF GERMANY	1,100,000.00	1,284,108.10
GOV OF GERMANY	800,000.00	655,964.00
GOV OF GERMANY	700,000.00	851,144.70
GOV OF GERMANY	840,000.00	1,086,322.44
GOV OF GERMANY	700,000.00	769,483.40
GOV OF GERMANY	1,190,000.00	1,178,105.95
GOV OF GERMANY	1,200,000.00	1,191,396.00
GOV OF GERMANY	1,460,000.00	1,124,401.48
GOV OF GERMANY	1,560,000.00	811,551.00
GOV OF GERMANY	1,430,000.00	708,425.93
GOV OF GERMANY	1,180,000.00	1,004,427.81
GOV OF IRELAND	550,000.00	563,404.05
GOV OF IRELAND	460,000.00	443,911.50
GOV OF IRELAND	280,000.00	260,050.28
GOV OF IRELAND	210,000.00	196,896.38
GOV OF IRELAND	330,000.00	307,387.08
GOV OF IRELAND	410,000.00	407,456.77
GOV OF IRELAND	330,000.00	283,304.57
GOV OF IRELAND	160,000.00	147,786.92
GOV OF IRELAND	390,000.00	320,727.42
GOV OF IRELAND	280,000.00	231,062.77
GOV OF IRELAND	240,000.00	213,423.84
GOV OF IRELAND	160,000.00	123,593.76
GOV OF IRELAND	250,000.00	217,075.87
GOV OF IRELAND	90,000.00	60,698.16
GOV OF IRELAND	190,000.00	190,272.74
GOV OF IRELAND	420,000.00	349,594.56
GOV OF IRELAND	410,000.00	294,517.35
GOV OF ITALY	690,000.00	669,180.63
GOV OF ITALY	1,050,000.00	1,067,938.20
GOV OF ITALY	800,000.00	782,129.38
GOV OF ITALY	660,000.00	644,908.44
GOV OF ITALY	970,000.00	951,501.13
GOV OF ITALY	260,000.00	252,277.22
GOV OF ITALY	680,000.00	684,595.44

GOV OF ITALY	740,000.00	732,685.10
GOV OF ITALY	900,000.00	882,640.06
GOV OF ITALY	730,000.00	735,633.41
GOV OF ITALY	710,000.00	674,375.75
GOV OF ITALY	710,000.00	730,324.46
GOV OF ITALY	1,180,000.00	1,104,382.06
GOV OF ITALY	900,000.00	914,332.50
GOV OF ITALY	880,000.00	851,869.04
GOV OF ITALY	1,010,000.00	987,944.37
GOV OF ITALY	200,000.00	185,412.00
GOV OF ITALY	440,000.00	448,855.61
GOV OF ITALY	1,140,000.00	1,085,477.39
GOV OF ITALY	710,000.00	666,410.97
GOV OF ITALY	600,000.00	564,864.60
GOV OF ITALY	700,000.00	681,233.70
GOV OF ITALY	780,000.00	753,786.54
GOV OF ITALY	860,000.00	797,607.00
GOV OF ITALY	1,010,000.00	1,131,646.42
GOV OF ITALY	650,000.00	639,374.45
GOV OF ITALY	840,000.00	805,108.92
GOV OF ITALY	800,000.00	711,191.20
GOV OF ITALY	800,000.00	807,407.20
GOV OF ITALY	490,000.00	435,950.55
GOV OF ITALY	610,000.00	625,113.59
GOV OF ITALY	860,000.00	916,119.30
GOV OF ITALY	930,000.00	912,972.63
GOV OF ITALY	730,000.00	635,323.38
GOV OF ITALY	820,000.00	798,825.96
GOV OF ITALY	680,000.00	669,138.36
GOV OF ITALY	1,360,000.00	1,496,878.56
GOV OF ITALY	760,000.00	778,185.28
GOV OF ITALY	1,000,000.00	1,006,388.00
GOV OF ITALY	870,000.00	770,781.72
GOV OF ITALY	980,000.00	993,283.90
GOV OF ITALY	590,000.00	504,130.22
GOV OF ITALY	180,000.00	185,365.08
GOV OF ITALY	930,000.00	825,526.59
GOV OF ITALY	860,000.00	718,028.62
GOV OF ITALY	1,330,000.00	1,543,058.02
GOV OF ITALY	810,000.00	653,441.98
GOV OF ITALY	170,000.00	174,800.29
GOV OF ITALY	1,190,000.00	976,816.26
GOV OF ITALY	1,280,000.00	1,104,730.88

GOV OF ITALY	400,000.00	323,228.24
GOV OF ITALY	750,000.00	682,711.80
GOV OF ITALY	1,080,000.00	1,244,664.36
GOV OF ITALY	790,000.00	829,831.80
GOV OF ITALY	850,000.00	760,602.10
GOV OF ITALY	570,000.00	594,647.94
GOV OF ITALY	1,500,000.00	1,641,880.50
GOV OF ITALY	540,000.00	510,752.59
GOV OF ITALY	380,000.00	381,983.22
GOV OF ITALY	390,000.00	294,863.40
GOV OF ITALY	440,000.00	362,331.20
GOV OF ITALY	1,790,000.00	1,782,571.50
GOV OF ITALY	450,000.00	309,033.90
GOV OF ITALY	410,000.00	370,064.36
GOV OF ITALY	630,000.00	546,966.00
GOV OF ITALY	770,000.00	836,530.31
GOV OF ITALY	580,000.00	503,320.23
GOV OF ITALY	1,050,000.00	1,141,402.50
GOV OF ITALY	690,000.00	486,863.31
GOV OF ITALY	280,000.00	283,398.36
GOV OF ITALY	700,000.00	737,377.20
GOV OF ITALY	560,000.00	345,490.98
GOV OF ITALY	790,000.00	669,798.34
GOV OF ITALY	870,000.00	669,448.47
GOV OF ITALY	440,000.00	383,443.28
GOV OF ITALY	580,000.00	535,331.42
GOV OF ITALY	480,000.00	340,469.35
GOV OF ITALY	690,000.00	410,181.54
GOV OF ITALY	320,000.00	207,307.20
GOV OF ITALY	390,000.00	392,809.17
GOV OF ITALY	290,000.00	205,738.18
GOV OF ITALY	260,000.00	154,329.24
GOV OF NETHERLANDS	820,000.00	789,436.96
GOV OF NETHERLANDS	550,000.00	521,845.70
GOV OF NETHERLANDS	680,000.00	647,025.30
GOV OF NETHERLANDS	980,000.00	910,920.96
GOV OF NETHERLANDS	280,000.00	264,277.16
GOV OF NETHERLANDS	680,000.00	756,454.78
GOV OF NETHERLANDS	500,000.00	464,404.00
GOV OF NETHERLANDS	550,000.00	487,546.29
GOV OF NETHERLANDS	380,000.00	337,629.24
GOV OF NETHERLANDS	350,000.00	350,106.75
GOV OF NETHERLANDS	320,000.00	273,031.36

GOV OF NETHERLANDS	580,000.00	482,292.08
GOV OF NETHERLANDS	700,000.00	591,469.49
GOV OF NETHERLANDS	640,000.00	636,006.14
GOV OF NETHERLANDS	200,000.00	198,059.40
GOV OF NETHERLANDS	850,000.00	963,474.91
GOV OF NETHERLANDS	270,000.00	183,788.44
GOV OF NETHERLANDS	670,000.00	475,696.65
GOV OF NETHERLANDS	630,000.00	713,911.71
GOV OF NETHERLANDS	890,000.00	890,229.62
GOV OF NETHERLANDS	740,000.00	355,159.30
GOV OF NETHERLANDS	350,000.00	297,850.35
GOV OF SPAIN	830,000.00	802,645.97
GOV OF SPAIN	660,000.00	647,186.10
GOV OF SPAIN	840,000.00	805,435.84
GOV OF SPAIN	890,000.00	910,288.44
GOV OF SPAIN	1,050,000.00	1,035,961.50
GOV OF SPAIN	570,000.00	537,856.56
GOV OF SPAIN	1,290,000.00	1,263,690.45
GOV OF SPAIN	600,000.00	598,662.60
GOV OF SPAIN	960,000.00	1,029,222.72
GOV OF SPAIN	940,000.00	902,588.94
GOV OF SPAIN	890,000.00	818,314.95
GOV OF SPAIN	1,010,000.00	969,269.73
GOV OF SPAIN	900,000.00	840,175.20
GOV OF SPAIN	880,000.00	837,940.40
GOV OF SPAIN	1,070,000.00	957,127.05
GOV OF SPAIN	1,090,000.00	1,028,698.40
GOV OF SPAIN	940,000.00	884,088.80
GOV OF SPAIN	700,000.00	771,315.30
GOV OF SPAIN	1,120,000.00	1,283,436.00
GOV OF SPAIN	820,000.00	764,326.10
GOV OF SPAIN	1,100,000.00	983,727.80
GOV OF SPAIN	940,000.00	826,451.76
GOV OF SPAIN	930,000.00	802,172.43
GOV OF SPAIN	920,000.00	865,853.40
GOV OF SPAIN	1,030,000.00	921,776.87
GOV OF SPAIN	1,120,000.00	909,697.60
GOV OF SPAIN	690,000.00	569,274.15
GOV OF SPAIN	1,050,000.00	868,234.50
GOV OF SPAIN	910,000.00	1,088,919.65
GOV OF SPAIN	890,000.00	849,660.75
GOV OF SPAIN	930,000.00	926,090.28
GOV OF SPAIN	800,000.00	744,412.80

	GOV OF SPAIN	960,000.00	983,539.29
	GOV OF SPAIN	720,000.00	615,962.16
	GOV OF SPAIN	860,000.00	925,965.44
	GOV OF SPAIN	570,000.00	407,464.50
	GOV OF SPAIN	280,000.00	287,723.57
	GOV OF SPAIN	800,000.00	920,064.00
	GOV OF SPAIN	440,000.00	304,660.40
	GOV OF SPAIN	1,140,000.00	1,289,731.02
	GOV OF SPAIN	350,000.00	224,513.80
	GOV OF SPAIN	520,000.00	496,645.24
	GOV OF SPAIN	630,000.00	755,501.35
	GOV OF SPAIN	700,000.00	606,999.40
	GOV OF SPAIN	710,000.00	584,946.07
	GOV OF SPAIN	880,000.00	469,644.56
	GOV OF SPAIN	700,000.00	460,770.10
	GOV OF SPAIN	570,000.00	508,832.16
	GOV OF SPAIN	290,000.00	138,526.62
	ユーロ 小計	272,770,000.00	254,189,711.58 (40,876,247,519)
英bond	UK TREASURY	1,300,000.00	1,242,826.00
	UK TREASURY	640,000.00	642,115.84
	UK TREASURY	470,000.00	446,406.00
	UK TREASURY	840,000.00	809,030.88
	UK TREASURY	890,000.00	876,868.22
	UK TREASURY	420,000.00	387,655.80
	UK TREASURY	770,000.00	724,339.00
	UK TREASURY	1,020,000.00	924,162.84
	UK TREASURY	950,000.00	951,377.50
	UK TREASURY	790,000.00	721,578.10
	UK TREASURY	580,000.00	586,504.12
	UK TREASURY	780,000.00	671,888.10
	UK TREASURY	810,000.00	827,832.15
	UK TREASURY	500,000.00	452,638.40
	UK TREASURY	580,000.00	634,226.28
	UK TREASURY	950,000.00	805,315.00
	UK TREASURY	590,000.00	501,102.10
	UK TREASURY	750,000.00	596,700.00
	UK TREASURY	620,000.00	652,757.08
	UK TREASURY	1,120,000.00	855,668.80
	UK TREASURY	1,400,000.00	1,119,586.15
	UK TREASURY	860,000.00	880,541.96
	UK TREASURY	1,350,000.00	1,273,599.96
	UK TREASURY	1,010,000.00	759,268.29

	UK TREASURY	570,000.00	588,839.64
	UK TREASURY	780,000.00	529,206.60
	UK TREASURY	1,060,000.00	1,064,833.60
	UK TREASURY	740,000.00	546,581.76
	UK TREASURY	630,000.00	590,562.00
	UK TREASURY	880,000.00	915,833.60
	UK TREASURY	960,000.00	616,416.57
	UK TREASURY	460,000.00	450,984.00
	UK TREASURY	720,000.00	701,601.12
	UK TREASURY	1,180,000.00	717,343.24
	UK TREASURY	750,000.00	748,125.00
	UK TREASURY	840,000.00	695,394.00
	UK TREASURY	730,000.00	624,223.00
	UK TREASURY	640,000.00	314,560.00
	UK TREASURY	640,000.00	608,936.96
	UK TREASURY	760,000.00	425,144.00
	UK TREASURY	340,000.00	197,757.60
	UK TREASURY	600,000.00	568,320.00
	UK TREASURY	780,000.00	310,206.00
	UK TREASURY	840,000.00	406,622.83
	UK TREASURY	400,000.00	347,168.00
	UK TREASURY	860,000.00	434,774.72
	UK TREASURY	900,000.00	776,430.00
	UK TREASURY	540,000.00	279,990.00
	UK TREASURY	790,000.00	747,024.00
	UK TREASURY	540,000.00	284,580.00
	UK TREASURY	500,000.00	454,060.30
	UK TREASURY	760,000.00	223,034.00
	UK TREASURY	430,000.00	389,279.00
	UK TREASURY	530,000.00	335,219.27
	UK TREASURY	570,000.00	465,975.00
	UK TREASURY	690,000.00	316,870.63
	UK TREASURY	400,000.00	145,247.20
	英bond 小計	42,800,000.00	35,165,132.21 (6,608,583,296)
スウェーデンクローナ	GOV OF SWEDEN	3,170,000.00	3,148,237.37
	GOV OF SWEDEN	3,300,000.00	3,169,167.37
	GOV OF SWEDEN	2,790,000.00	2,617,019.69
	GOV OF SWEDEN	2,680,000.00	2,469,122.29
	GOV OF SWEDEN	1,620,000.00	1,391,029.20
	GOV OF SWEDEN	2,320,000.00	2,316,523.99
	GOV OF SWEDEN	1,340,000.00	1,278,871.86
	GOV OF SWEDEN	1,840,000.00	2,089,007.20

スウェーデンクローナ 小計		19,060,000.00	18,478,978.97 (261,477,552)
ノルウェークローネ	GOV OF NORWAY	430,000.00	419,033.53
	GOV OF NORWAY	2,680,000.00	2,563,564.72
	GOV OF NORWAY	1,890,000.00	1,791,825.84
	GOV OF NORWAY	2,110,000.00	1,987,870.66
	GOV OF NORWAY	2,070,000.00	1,889,237.25
	GOV OF NORWAY	2,410,000.00	2,110,843.32
	GOV OF NORWAY	2,150,000.00	1,819,562.20
	GOV OF NORWAY	2,030,000.00	1,820,264.46
GOV OF NORWAY	1,570,000.00	1,496,133.69	
ノルウェークローネ 小計		17,340,000.00	15,898,335.67 (224,325,516)
デンマーククローネ	GOV OF DENMARK	2,500,000.00	2,459,737.50
	GOV OF DENMARK	2,370,000.00	2,210,373.62
	GOV OF DENMARK	2,320,000.00	2,088,709.92
	GOV OF DENMARK	2,640,000.00	2,198,046.99
	GOV OF DENMARK	1,200,000.00	1,175,771.88
	GOV OF DENMARK	4,020,000.00	4,990,705.38
	GOV OF DENMARK	2,280,000.00	1,217,428.80
デンマーククローネ 小計		17,330,000.00	16,340,774.09 (352,470,497)
ポーランドズロチ	GOV OF POLAND	1,760,000.00	1,671,296.00
	GOV OF POLAND	1,510,000.00	1,471,516.14
	GOV OF POLAND	2,250,000.00	2,120,040.00
	GOV OF POLAND	820,000.00	721,723.00
	GOV OF POLAND	1,410,000.00	1,355,660.01
	GOV OF POLAND	2,510,000.00	2,311,787.81
	GOV OF POLAND	1,620,000.00	1,478,582.10
	GOV OF POLAND	780,000.00	800,229.30
	GOV OF POLAND	2,310,000.00	2,043,795.60
	GOV OF POLAND	2,000,000.00	1,561,300.00
	GOV OF POLAND	1,320,000.00	1,013,523.72
	GOV OF POLAND	920,000.00	961,541.68
ポーランドズロチ 小計		19,210,000.00	17,510,995.36 (643,115,819)
オーストラリアドル	GOV OF AUSTRALIA	830,000.00	822,024.83
	GOV OF AUSTRALIA	610,000.00	571,442.66
	GOV OF AUSTRALIA	660,000.00	665,696.72
	GOV OF AUSTRALIA	960,000.00	880,767.50
	GOV OF AUSTRALIA	790,000.00	812,751.92
	GOV OF AUSTRALIA	720,000.00	693,329.18
	GOV OF AUSTRALIA	630,000.00	590,887.82

	GOV OF AUSTRALIA	560,000.00	533,261.59
	GOV OF AUSTRALIA	700,000.00	679,138.51
	GOV OF AUSTRALIA	710,000.00	666,795.53
	GOV OF AUSTRALIA	910,000.00	835,788.66
	GOV OF AUSTRALIA	800,000.00	655,324.41
	GOV OF AUSTRALIA	1,000,000.00	836,838.72
	GOV OF AUSTRALIA	1,210,000.00	959,974.68
	GOV OF AUSTRALIA	1,160,000.00	924,814.32
	GOV OF AUSTRALIA	940,000.00	772,151.95
	GOV OF AUSTRALIA	920,000.00	940,461.81
	GOV OF AUSTRALIA	760,000.00	685,693.36
	GOV OF AUSTRALIA	740,000.00	709,712.34
	GOV OF AUSTRALIA	670,000.00	625,561.79
	GOV OF AUSTRALIA	380,000.00	327,709.59
	GOV OF AUSTRALIA	590,000.00	553,953.14
	GOV OF AUSTRALIA	460,000.00	398,579.60
	GOV OF AUSTRALIA	390,000.00	307,243.94
	GOV OF AUSTRALIA	620,000.00	478,319.26
	GOV OF AUSTRALIA	800,000.00	446,039.23
	GOV OF AUSTRALIA	250,000.00	256,461.00
	オーストラリアドル 小計	19,770,000.00	17,630,724.06 (1,713,177,456)
ニュージーランドドル	GOV OF NEWZEALAND	330,000.00	320,863.77
	GOV OF NEWZEALAND	240,000.00	218,698.57
	GOV OF NEWZEALAND	320,000.00	320,274.20
	GOV OF NEWZEALAND	450,000.00	377,284.93
	GOV OF NEWZEALAND	330,000.00	308,386.62
	GOV OF NEWZEALAND	150,000.00	150,066.55
	GOV OF NEWZEALAND	250,000.00	202,814.13
	GOV OF NEWZEALAND	420,000.00	344,727.72
	GOV OF NEWZEALAND	460,000.00	420,041.33
	GOV OF NEWZEALAND	150,000.00	144,271.43
	GOV OF NEWZEALAND	180,000.00	142,723.78
	GOV OF NEWZEALAND	140,000.00	87,608.79
	GOV OF NEWZEALAND	330,000.00	219,651.84
	ニュージーランドドル 小計	3,750,000.00	3,257,413.66 (294,242,175)
シンガポールドル	GOV OF SINGAPORE	340,000.00	335,410.00
	GOV OF SINGAPORE	300,000.00	285,786.00
	GOV OF SINGAPORE	260,000.00	254,098.00
	GOV OF SINGAPORE	170,000.00	162,112.00
	GOV OF SINGAPORE	410,000.00	416,806.00
	GOV OF SINGAPORE	80,000.00	80,000.00

	GOV OF SINGAPORE	210,000.00	208,173.00
	GOV OF SINGAPORE	510,000.00	509,643.00
	GOV OF SINGAPORE	330,000.00	329,406.00
	GOV OF SINGAPORE	210,000.00	191,877.00
	GOV OF SINGAPORE	190,000.00	185,687.00
	GOV OF SINGAPORE	300,000.00	311,223.00
	GOV OF SINGAPORE	330,000.00	306,504.00
	GOV OF SINGAPORE	240,000.00	223,200.00
	GOV OF SINGAPORE	190,000.00	184,612.55
	GOV OF SINGAPORE	330,000.00	318,932.88
	GOV OF SINGAPORE	250,000.00	202,782.78
	GOV OF SINGAPORE	290,000.00	236,599.40
	GOV OF SINGAPORE	130,000.00	134,810.00
	シンガポールドル 小計	5,070,000.00	4,877,662.61 (538,396,398)
マレーシアリングgit	GOV OF MALAYSIA	640,000.00	644,331.26
	GOV OF MALAYSIA	1,170,000.00	1,179,992.03
	GOV OF MALAYSIA	340,000.00	346,754.78
	GOV OF MALAYSIA	690,000.00	697,953.28
	GOV OF MALAYSIA	930,000.00	941,200.45
	GOV OF MALAYSIA	130,000.00	131,605.04
	GOV OF MALAYSIA	590,000.00	589,930.00
	GOV OF MALAYSIA	1,470,000.00	1,487,176.95
	GOV OF MALAYSIA	820,000.00	823,783.89
	GOV OF MALAYSIA	370,000.00	384,585.32
	GOV OF MALAYSIA	760,000.00	768,812.73
	GOV OF MALAYSIA	780,000.00	812,052.61
	GOV OF MALAYSIA	1,050,000.00	976,520.61
	GOV OF MALAYSIA	470,000.00	484,173.93
	GOV OF MALAYSIA	530,000.00	519,302.06
	GOV OF MALAYSIA	660,000.00	657,562.89
	GOV OF MALAYSIA	620,000.00	660,976.23
	GOV OF MALAYSIA	800,000.00	798,876.07
	GOV OF MALAYSIA	910,000.00	934,880.40
	GOV OF MALAYSIA	820,000.00	882,863.00
	GOV OF MALAYSIA	800,000.00	878,375.76
	GOV OF MALAYSIA	920,000.00	886,150.56
	GOV OF MALAYSIA	660,000.00	711,468.18
	GOV OF MALAYSIA	510,000.00	563,219.16
	GOV OF MALAYSIA	450,000.00	483,922.62
	GOV OF MALAYSIA	900,000.00	995,983.74
	GOV OF MALAYSIA	1,010,000.00	985,896.18
	GOV OF MALAYSIA	320,000.00	332,092.60

	マレーシアリングット 小計	20,120,000.00	20,560,442.33 (642,260,929)
中国元	GOV OF CHINA	6,420,000.00	6,433,223.91
	GOV OF CHINA	6,900,000.00	6,917,322.45
	GOV OF CHINA	11,910,000.00	11,880,878.14
	GOV OF CHINA	7,880,000.00	7,885,825.68
	GOV OF CHINA	11,670,000.00	11,634,803.14
	GOV OF CHINA	7,220,000.00	7,215,505.33
	GOV OF CHINA	16,500,000.00	16,501,651.65
	GOV OF CHINA	13,160,000.00	13,363,096.96
	GOV OF CHINA	6,650,000.00	6,658,010.59
	GOV OF CHINA	5,130,000.00	5,152,744.87
	GOV OF CHINA	20,990,000.00	21,370,729.21
	GOV OF CHINA	10,240,000.00	10,245,615.61
	GOV OF CHINA	15,840,000.00	16,004,062.80
	GOV OF CHINA	1,800,000.00	1,796,049.49
	GOV OF CHINA	11,000,000.00	11,031,900.00
	GOV OF CHINA	8,250,000.00	8,264,225.47
	GOV OF CHINA	8,300,000.00	8,337,195.62
	GOV OF CHINA	6,720,000.00	6,841,918.26
	GOV OF CHINA	9,840,000.00	9,884,811.36
	GOV OF CHINA	5,160,000.00	5,173,658.00
	GOV OF CHINA	11,890,000.00	12,351,128.68
	GOV OF CHINA	9,610,000.00	9,710,424.50
	GOV OF CHINA	12,660,000.00	13,013,635.57
	GOV OF CHINA	9,400,000.00	9,410,222.50
	GOV OF CHINA	14,780,000.00	15,133,336.59
	GOV OF CHINA	15,100,000.00	15,224,809.05
	GOV OF CHINA	9,780,000.00	9,967,636.13
	GOV OF CHINA	11,940,000.00	12,138,237.43
	GOV OF CHINA	9,420,000.00	9,506,680.95
	GOV OF CHINA	9,500,000.00	9,669,341.30
	GOV OF CHINA	8,950,000.00	9,107,437.65
	GOV OF CHINA	11,250,000.00	11,371,039.87
	GOV OF CHINA	7,270,000.00	7,322,113.53
	GOV OF CHINA	6,000,000.00	6,042,438.60
GOV OF CHINA	10,830,000.00	11,388,601.65	
GOV OF CHINA	9,600,000.00	9,924,267.84	
GOV OF CHINA	4,250,000.00	4,358,296.37	
GOV OF CHINA	8,380,000.00	8,501,639.05	
GOV OF CHINA	6,140,000.00	6,240,936.68	
GOV OF CHINA	6,220,000.00	6,287,304.13	
GOV OF CHINA	5,260,000.00	5,275,424.42	

	GOV OF CHINA	3,900,000.00	3,974,926.41
	GOV OF CHINA	8,260,000.00	8,498,519.06
	GOV OF CHINA	7,230,000.00	7,293,524.94
	GOV OF CHINA	7,290,000.00	7,280,644.15
	GOV OF CHINA	9,200,000.00	9,341,429.76
	GOV OF CHINA	5,410,000.00	6,648,034.13
	GOV OF CHINA	7,500,000.00	8,963,224.50
	GOV OF CHINA	6,070,000.00	6,728,312.74
	GOV OF CHINA	9,990,000.00	11,830,397.76
	GOV OF CHINA	4,170,000.00	4,919,640.48
	GOV OF CHINA	4,500,000.00	5,139,880.20
	GOV OF CHINA	3,610,000.00	3,981,268.64
	GOV OF CHINA	4,220,000.00	4,494,847.75
	GOV OF CHINA	4,360,000.00	4,742,249.92
	中国元 小計	475,520,000.00	488,375,081.47 (10,084,261,707)
イスラエルシュケル	GOV OF ISRAEL	580,000.00	558,801.00
	GOV OF ISRAEL	1,330,000.00	1,296,417.50
	GOV OF ISRAEL	570,000.00	534,802.50
	GOV OF ISRAEL	760,000.00	817,722.00
	GOV OF ISRAEL	1,030,000.00	990,293.50
	GOV OF ISRAEL	930,000.00	868,620.00
	GOV OF ISRAEL	360,000.00	365,850.00
	GOV OF ISRAEL	1,070,000.00	898,051.00
	GOV OF ISRAEL	700,000.00	561,470.00
	GOV OF ISRAEL	940,000.00	658,940.00
	GOV OF ISRAEL	820,000.00	896,588.00
	GOV OF ISRAEL	910,000.00	802,210.50
	GOV OF ISRAEL	370,000.00	252,617.50
		イスラエルシュケル 小計	10,370,000.00
合計			126,003,807,741 (126,003,807,741)

(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 262銘柄	100.0%	47.5%
カナダドル	国債証券 39銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 14銘柄	100.0%	0.9%
ユーロ	国債証券 354銘柄	100.0%	32.4%
英ポンド	国債証券 57銘柄	100.0%	5.2%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.2%

ノルウェークローネ	国債証券	9銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券	7銘柄	100.0%	0.3%
ポーランドズロチ	国債証券	12銘柄	100.0%	0.5%
オーストラリアドル	国債証券	27銘柄	100.0%	1.4%
ニュージーランドドル	国債証券	13銘柄	100.0%	0.2%
シンガポールドル	国債証券	19銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券	28銘柄	100.0%	0.5%
中国元	国債証券	55銘柄	100.0%	8.0%
イスラエルシェケル	国債証券	13銘柄	100.0%	0.3%

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

## R M先進国債券マザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

2024年 1月25日現在

資産の部	
流動資産	
預金	50,657,074
コール・ローン	171,962,476
国債証券	59,992,736,061
派生商品評価勘定	123,572
未収入金	116,191,285
未収利息	456,004,598
前払費用	52,771,274
流動資産合計	60,840,446,340
資産合計	60,840,446,340
負債の部	
流動負債	
未払解約金	178,755,700
未払利息	466
流動負債合計	178,756,166
負債合計	178,756,166
純資産の部	
元本等	
元本	49,531,769,709
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	11,129,920,465
元本等合計	60,661,690,174
純資産合計	60,661,690,174
負債純資産合計	60,840,446,340

### 注記表

#### （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

法	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 1月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 1月26日
期首元本額	44,782,131,861円
期中追加設定元本額	25,995,873,834円
期中一部解約元本額	21,246,235,986円
期末元本額	49,531,769,709円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	2,320,035,109円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	2,304,991,428円
りそなラップ型ファンド(成長型)	715,239,502円
DCりそな グローバルバランス	69,353,282円
つみたてバランスファンド	1,717,895,623円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	1,172,121,436円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	353,960,500円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	112,847,464円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	195,924,521円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	60,247,251円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	14,669,383円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	18,658,414円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定型)	83,070,900円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定成長型)	28,364,385円
りそな つみたてラップ型ファンド(成長型)	17,431,139円
ターゲットリターンバランスファンド(目標2%)	1,481,469円
ターゲットリターンバランスファンド(目標3%)	223,843円
ターゲットリターンバランスファンド(目標4%)	939,104円
ターゲットリターンバランスファンド(目標5%)	372,705円
ターゲットリターンバランスファンド(目標6%)	802,396円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2065	18,301円
FWりそな先進国債券アクティブファンド	53,389,021円
FWりそな先進国+新興国債券アクティブファンド	27,158,382円
FWりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジなし)	34,468,801,890円
Smart-i 先進国債券インデックス(為替ヘッジなし)	2,598,432,672円
Smart-i 8資産バランス 安定型	391,261,549円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	286,756,291円
Smart-i 8資産バランス 成長型	75,642,864円
りそなFT 先進国債券インデックス(適格機関投資家専用)	910,509,674円
りそなVEグローバル・バランスファンド(安定型)(適格機関投資家専用)	3,584,479円
りそなVEグローバル・バランスファンド(安定成長型)(適格機関投資家専用)	4,842,436円
りそなVEグローバル・バランスファンド(成長型)(適格機関投資家専用)	22,456,716円
りそなFT マルチアセットファンド(適格機関投資家専用)	16,181,544円
りそなFT パッシブバランス(適格機関投資家専用)	352,822,553円
りそなマルチアセットファンド(適格機関投資家専用)	14,131,724円
りそなFT パッシブバランス202307(適格機関投資家専用)	1,117,149,759円
2. 計算日における受益権の総数	49,531,769,709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	1.2247円
(10,000口当たり純資産額)	(12,247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 1月25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 1月25日現在

### 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

ん。

### 2. 時価の算定方法

#### 国債証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

#### デリバティブ取引

（その他の注記）の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

#### コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

### 3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、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 1月25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 1月25日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
国債証券		893,434,792
合計		893,434,792

（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 1月25日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	111,565,659	-	111,442,087	123,572
	米ドル	55,652,784	-	55,545,803	106,981
	ユーロ	44,747,356	-	44,732,550	14,806
	中国元	11,165,519	-	11,163,734	1,785
合計		111,565,659	-	111,442,087	123,572

## （注）時価の算定方法

### 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY N/B	400,000.00	390,408.28	
		US TREASURY N/B	860,000.00	835,480.80	
		US TREASURY N/B	560,000.00	556,656.34	
		US TREASURY N/B	700,000.00	675,449.95	
		US TREASURY N/B	430,000.00	420,144.15	
		US TREASURY N/B	550,000.00	531,334.86	
		US TREASURY N/B	770,000.00	764,623.48	
		US TREASURY N/B	730,000.00	708,877.79	
		US TREASURY N/B	930,000.00	898,259.05	
		US TREASURY N/B	340,000.00	332,741.79	
		US TREASURY N/B	960,000.00	923,025.00	
		US TREASURY N/B	850,000.00	848,671.87	
		US TREASURY N/B	590,000.00	570,548.43	
		US TREASURY N/B	250,000.00	244,042.97	
		US TREASURY N/B	1,160,000.00	1,104,560.15	
		US TREASURY N/B	2,120,000.00	2,099,586.71	
		US TREASURY N/B	600,000.00	585,234.37	
		US TREASURY N/B	250,000.00	244,467.77	
		US TREASURY N/B	1,060,000.00	1,004,474.22	
		US TREASURY N/B	400,000.00	396,007.81	
		US TREASURY N/B	570,000.00	551,898.04	
		US TREASURY N/B	880,000.00	859,014.05	
		US TREASURY N/B	240,000.00	234,482.81	
		US TREASURY N/B	850,000.00	801,722.65	
		US TREASURY N/B	900,000.00	879,275.39	
		US TREASURY N/B	290,000.00	282,738.67	
		US TREASURY N/B	650,000.00	611,431.63	
		US TREASURY N/B	780,000.00	762,693.75	
US TREASURY N/B	470,000.00	458,497.84			

US TREASURY N/B	630,000.00	590,588.08
US TREASURY N/B	810,000.00	779,356.05
US TREASURY N/B	820,000.00	802,687.11
US TREASURY N/B	310,000.00	301,511.32
US TREASURY N/B	1,000,000.00	934,570.31
US TREASURY N/B	1,050,000.00	1,057,136.72
US TREASURY N/B	920,000.00	905,247.65
US TREASURY N/B	230,000.00	224,425.19
US TREASURY N/B	1,180,000.00	1,099,681.63
US TREASURY N/B	500,000.00	498,037.11
US TREASURY N/B	570,000.00	555,861.32
US TREASURY N/B	1,270,000.00	1,180,107.81
US TREASURY N/B	1,850,000.00	1,866,187.50
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,250,437.50
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,000,703.12
US TREASURY N/B	480,000.00	466,687.49
US TREASURY N/B	980,000.00	910,021.87
US TREASURY N/B	1,570,000.00	1,581,775.00
US TREASURY N/B	400,000.00	396,921.87
US TREASURY N/B	300,000.00	290,273.43
US TREASURY N/B	1,130,000.00	1,046,794.92
US TREASURY N/B	800,000.00	792,234.37
US TREASURY N/B	330,000.00	319,017.18
US TREASURY N/B	1,320,000.00	1,219,014.83
US TREASURY N/B	1,060,000.00	1,003,149.22
US TREASURY N/B	720,000.00	714,810.93
US TREASURY N/B	350,000.00	337,086.91
US TREASURY N/B	1,360,000.00	1,255,901.56
US TREASURY N/B	310,000.00	311,707.42
US TREASURY N/B	430,000.00	411,641.01
US TREASURY N/B	1,000,000.00	926,835.94
US TREASURY N/B	980,000.00	968,056.25
US TREASURY N/B	450,000.00	431,455.07
US TREASURY N/B	1,000,000.00	923,945.31
US TREASURY N/B	880,000.00	828,712.50
US TREASURY N/B	470,000.00	447,583.20
US TREASURY N/B	1,090,000.00	1,004,609.57
US TREASURY N/B	200,000.00	199,261.71
US TREASURY N/B	450,000.00	425,654.29
US TREASURY N/B	1,880,000.00	1,735,144.53
US TREASURY N/B	520,000.00	490,831.25
US TREASURY N/B	1,050,000.00	959,847.65
US TREASURY N/B	1,130,000.00	1,055,225.77

US TREASURY N/B	320,000.00	297,650.00
US TREASURY N/B	1,030,000.00	942,268.94
US TREASURY N/B	1,090,000.00	1,100,091.01
US TREASURY N/B	400,000.00	374,015.62
US TREASURY N/B	1,310,000.00	1,200,620.12
US TREASURY N/B	1,860,000.00	1,878,418.35
US TREASURY N/B	350,000.00	326,552.73
US TREASURY N/B	1,170,000.00	1,076,628.51
US TREASURY N/B	250,000.00	235,478.51
US TREASURY N/B	850,000.00	859,031.25
US TREASURY N/B	300,000.00	279,492.18
US TREASURY N/B	1,210,000.00	1,114,830.66
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,105,156.25
US TREASURY N/B	440,000.00	410,781.25
US TREASURY N/B	900,000.00	828,105.47
US TREASURY N/B	1,450,000.00	1,340,598.63
US TREASURY N/B	340,000.00	321,300.00
US TREASURY N/B	590,000.00	538,294.33
US TREASURY N/B	470,000.00	438,761.52
US TREASURY N/B	300,000.00	268,640.62
US TREASURY N/B	1,040,000.00	988,934.37
US TREASURY N/B	1,130,000.00	1,004,795.11
US TREASURY N/B	550,000.00	526,420.90
US TREASURY N/B	580,000.00	547,975.39
US TREASURY N/B	1,120,000.00	992,993.74
US TREASURY N/B	660,000.00	628,417.97
US TREASURY N/B	1,180,000.00	1,043,447.26
US TREASURY N/B	490,000.00	476,065.62
US TREASURY N/B	1,100,000.00	965,529.30
US TREASURY N/B	400,000.00	381,757.81
US TREASURY N/B	800,000.00	750,093.75
US TREASURY N/B	410,000.00	360,567.77
US TREASURY N/B	1,050,000.00	1,014,172.85
US TREASURY N/B	810,000.00	706,978.12
US TREASURY N/B	580,000.00	579,637.50
US TREASURY N/B	1,230,000.00	1,075,577.33
US TREASURY N/B	1,360,000.00	1,358,964.06
US TREASURY N/B	690,000.00	644,476.17
US TREASURY N/B	1,180,000.00	1,034,159.37
US TREASURY N/B	740,000.00	733,048.04
US TREASURY N/B	1,040,000.00	908,964.06
US TREASURY N/B	750,000.00	743,129.88
US TREASURY N/B	1,150,000.00	1,007,665.04

US TREASURY N/B	600,000.00	586,160.15
US TREASURY N/B	850,000.00	806,537.11
US TREASURY N/B	1,110,000.00	985,666.99
US TREASURY N/B	550,000.00	547,421.87
US TREASURY N/B	980,000.00	872,889.05
US TREASURY N/B	840,000.00	824,200.77
US TREASURY N/B	1,820,000.00	1,617,453.91
US TREASURY N/B	780,000.00	761,261.71
US TREASURY N/B	1,340,000.00	1,274,779.68
US TREASURY N/B	1,170,000.00	1,037,506.63
US TREASURY N/B	930,000.00	912,253.71
US TREASURY N/B	870,000.00	769,865.03
US TREASURY N/B	900,000.00	896,167.97
US TREASURY N/B	1,090,000.00	951,323.04
US TREASURY N/B	1,170,000.00	1,110,334.57
US TREASURY N/B	1,280,000.00	1,121,125.00
US TREASURY N/B	700,000.00	708,039.06
US TREASURY N/B	920,000.00	808,827.34
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,532,812.50
US TREASURY N/B	1,000,000.00	882,675.78
US TREASURY N/B	430,000.00	444,210.15
US TREASURY N/B	890,000.00	852,088.08
US TREASURY N/B	1,110,000.00	983,824.21
US TREASURY N/B	1,070,000.00	1,083,458.58
US TREASURY N/B	1,020,000.00	896,723.43
US TREASURY N/B	1,190,000.00	1,064,166.79
US TREASURY N/B	1,140,000.00	1,063,562.11
US TREASURY N/B	1,000,000.00	898,496.09
US TREASURY N/B	800,000.00	735,718.75
US TREASURY N/B	790,000.00	744,050.39
US TREASURY N/B	930,000.00	853,819.92
US TREASURY N/B	1,000,000.00	935,136.72
US TREASURY N/B	480,000.00	459,815.62
US TREASURY N/B	570,000.00	528,318.75
US TREASURY N/B	850,000.00	748,033.20
US TREASURY N/B	660,000.00	627,206.25
US TREASURY N/B	710,000.00	700,875.39
US TREASURY N/B	470,000.00	466,805.46
US TREASURY N/B	680,000.00	599,887.50
US TREASURY N/B	840,000.00	828,843.75
US TREASURY N/B	880,000.00	868,054.68
US TREASURY N/B	600,000.00	579,832.03
US TREASURY N/B	770,000.00	662,320.31

US TREASURY N/B	620,000.00	615,374.21	
US TREASURY N/B	600,000.00	583,171.87	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	964,882.81	
US TREASURY N/B	120,000.00	133,870.31	
US TREASURY N/B	1,430,000.00	1,153,719.53	
US TREASURY N/B	900,000.00	880,330.07	
US TREASURY N/B	840,000.00	821,428.12	
US TREASURY N/B	1,410,000.00	1,127,862.29	
US TREASURY N/B	650,000.00	667,887.69	
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,250,812.50	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,457,789.05	
US TREASURY N/B	950,000.00	962,468.75	
US TREASURY N/B	160,000.00	172,837.50	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,478,496.09	
US TREASURY N/B	1,860,000.00	1,568,866.39	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,465,066.40	
US TREASURY N/B	1,930,000.00	1,575,588.67	
US TREASURY N/B	1,920,000.00	1,621,949.99	
US TREASURY N/B	1,840,000.00	1,673,825.00	
US TREASURY N/B	1,650,000.00	1,482,131.83	
US TREASURY N/B	1,850,000.00	1,843,496.09	
US TREASURY N/B	2,060,000.00	1,956,114.83	
US TREASURY N/B	1,890,000.00	1,774,532.81	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,660,156.25	
US TREASURY N/B	1,190,000.00	1,220,772.65	
US TREASURY N/B	80,000.00	82,928.12	
US TREASURY N/B	90,000.00	97,344.14	
US TREASURY N/B	280,000.00	283,494.53	
US TREASURY N/B	100,000.00	102,314.45	
US TREASURY N/B	470,000.00	427,222.65	
US TREASURY N/B	140,000.00	138,476.95	
US TREASURY N/B	190,000.00	193,005.85	
US TREASURY N/B	440,000.00	439,982.81	
US TREASURY N/B	190,000.00	195,210.15	
US TREASURY N/B	210,000.00	209,208.39	
US TREASURY N/B	450,000.00	277,048.82	
US TREASURY N/B	150,000.00	140,194.33	
US TREASURY N/B	1,110,000.00	675,712.50	
US TREASURY N/B	210,000.00	205,357.03	
US TREASURY N/B	1,200,000.00	760,101.56	
US TREASURY N/B	230,000.00	238,660.93	
US TREASURY N/B	1,210,000.00	832,347.65	
US TREASURY N/B	250,000.00	247,460.93	

US TREASURY N/B	1,110,000.00	809,606.25
US TREASURY N/B	230,000.00	209,717.77
US TREASURY N/B	1,340,000.00	890,942.96
US TREASURY N/B	130,000.00	108,166.60
US TREASURY N/B	1,290,000.00	893,526.56
US TREASURY N/B	180,000.00	149,414.06
US TREASURY N/B	840,000.00	617,268.75
US TREASURY N/B	200,000.00	162,281.25
US TREASURY N/B	800,000.00	673,500.00
US TREASURY N/B	200,000.00	155,410.15
US TREASURY N/B	680,000.00	582,157.03
US TREASURY N/B	400,000.00	309,921.87
US TREASURY N/B	800,000.00	747,718.75
US TREASURY N/B	320,000.00	262,524.99
US TREASURY N/B	810,000.00	742,194.13
US TREASURY N/B	590,000.00	464,117.96
US TREASURY N/B	390,000.00	356,971.87
US TREASURY N/B	360,000.00	317,608.59
US TREASURY N/B	190,000.00	186,244.53
US TREASURY N/B	720,000.00	646,185.93
US TREASURY N/B	460,000.00	473,871.87
US TREASURY N/B	410,000.00	360,960.15
US TREASURY N/B	390,000.00	329,961.32
US TREASURY N/B	230,000.00	186,605.46
US TREASURY N/B	380,000.00	301,083.20
US TREASURY N/B	530,000.00	383,132.02
US TREASURY N/B	320,000.00	252,506.24
US TREASURY N/B	610,000.00	469,795.31
US TREASURY N/B	290,000.00	228,001.17
US TREASURY N/B	180,000.00	128,573.43
US TREASURY N/B	460,000.00	327,588.28
US TREASURY N/B	870,000.00	587,402.92
US TREASURY N/B	350,000.00	266,416.99
US TREASURY N/B	540,000.00	419,691.79
US TREASURY N/B	350,000.00	271,537.10
US TREASURY N/B	620,000.00	458,025.00
US TREASURY N/B	770,000.00	567,739.64
US TREASURY N/B	190,000.00	146,734.18
US TREASURY N/B	760,000.00	599,954.68
US TREASURY N/B	1,040,000.00	801,246.87
US TREASURY N/B	830,000.00	684,717.58
US TREASURY N/B	640,000.00	492,074.99
US TREASURY N/B	970,000.00	727,367.38

US TREASURY N/B	200,000.00	131,250.00	
US TREASURY N/B	1,090,000.00	734,877.14	
US TREASURY N/B	1,260,000.00	776,253.51	
US TREASURY N/B	1,060,000.00	530,993.75	
US TREASURY N/B	1,050,000.00	543,990.23	
US TREASURY N/B	1,330,000.00	737,734.37	
US TREASURY N/B	1,680,000.00	994,415.62	
US TREASURY N/B	900,000.00	601,611.32	
US TREASURY N/B	1,380,000.00	841,099.22	
US TREASURY N/B	1,250,000.00	736,376.94	
US TREASURY N/B	1,240,000.00	803,117.96	
US TREASURY N/B	1,050,000.00	783,952.14	
US TREASURY N/B	770,000.00	590,298.23	
US TREASURY N/B	1,270,000.00	1,181,075.19	
US TREASURY N/B	1,250,000.00	1,085,766.60	
US TREASURY N/B	930,000.00	808,373.43	
US TREASURY N/B	1,180,000.00	1,123,489.06	
US TREASURY N/B	600,000.00	634,312.49	
	米ドル 小計	214,700,000.00	192,169,085.74 (28,414,121,017)
カナダドル	GOV OF CANADA	340,000.00	336,907.10
	GOV OF CANADA	200,000.00	193,068.82
	GOV OF CANADA	190,000.00	183,519.80
	GOV OF CANADA	200,000.00	198,227.07
	GOV OF CANADA	230,000.00	223,668.58
	GOV OF CANADA	380,000.00	375,421.58
	GOV OF CANADA	600,000.00	565,719.42
	GOV OF CANADA	160,000.00	156,818.01
	GOV OF CANADA	170,000.00	170,905.55
	GOV OF CANADA	120,000.00	121,115.38
	GOV OF CANADA	350,000.00	324,233.51
	GOV OF CANADA	230,000.00	225,499.84
	GOV OF CANADA	250,000.00	236,852.51
	GOV OF CANADA	250,000.00	232,855.46
	GOV OF CANADA	350,000.00	325,277.45
	GOV OF CANADA	260,000.00	238,674.77
	GOV OF CANADA	170,000.00	164,815.23
	GOV OF CANADA	320,000.00	318,816.24
	GOV OF CANADA	150,000.00	140,926.38
	GOV OF CANADA	290,000.00	286,355.17
	GOV OF CANADA	170,000.00	173,832.43
	GOV OF CANADA	120,000.00	133,227.87
	GOV OF CANADA	130,000.00	122,438.98

	GOV OF CANADA	130,000.00	121,938.80
	GOV OF CANADA	580,000.00	507,290.69
	GOV OF CANADA	670,000.00	550,064.98
	GOV OF CANADA	510,000.00	444,777.03
	GOV OF CANADA	600,000.00	518,538.84
	GOV OF CANADA	310,000.00	276,815.69
	GOV OF CANADA	490,000.00	453,362.81
	GOV OF CANADA	160,000.00	188,518.44
	GOV OF CANADA	470,000.00	442,471.44
	GOV OF CANADA	210,000.00	205,775.26
	GOV OF CANADA	50,000.00	47,823.56
	GOV OF CANADA	120,000.00	138,627.98
	GOV OF CANADA	140,000.00	148,493.32
	GOV OF CANADA	190,000.00	189,692.39
	GOV OF CANADA	260,000.00	228,350.70
	GOV OF CANADA	690,000.00	508,726.88
	GOV OF CANADA	560,000.00	382,922.14
	GOV OF CANADA	170,000.00	146,862.87
	GOV OF CANADA	120,000.00	102,619.92
	カナダドル 小計	12,060,000.00	11,052,850.89 (1,208,076,602)
メキシコペソ	UNITED MEXICAN STATE	3,900,000.00	3,711,006.00
	UNITED MEXICAN STATE	7,930,000.00	7,323,244.53
	UNITED MEXICAN STATE	1,180,000.00	1,106,934.40
	UNITED MEXICAN STATE	5,670,000.00	5,071,304.70
	UNITED MEXICAN STATE	6,280,000.00	5,951,242.00
	UNITED MEXICAN STATE	1,700,000.00	1,650,972.00
	UNITED MEXICAN STATE	5,760,000.00	5,618,880.00
	UNITED MEXICAN STATE	7,760,000.00	7,175,827.20
	UNITED MEXICAN STATE	4,020,000.00	3,592,674.00
	UNITED MEXICAN STATE	2,490,000.00	2,238,111.60
	UNITED MEXICAN STATE	1,470,000.00	1,556,377.20
	UNITED MEXICAN STATE	2,480,000.00	2,318,353.60
	UNITED MEXICAN STATE	6,650,000.00	5,708,426.50
	UNITED MEXICAN STATE	5,050,000.00	4,402,893.00
	UNITED MEXICAN STATE	3,490,000.00	3,013,859.30
	メキシコペソ 小計	65,830,000.00	60,440,106.03 (518,334,349)
ユーロ	GOV OF AUSTRIA	70,000.00	67,444.72
	GOV OF AUSTRIA	310,000.00	301,705.95
	GOV OF AUSTRIA	120,000.00	125,133.48
	GOV OF AUSTRIA	80,000.00	78,727.96
	GOV OF AUSTRIA	380,000.00	361,059.28

GOV OF AUSTRIA	340,000.00	318,296.78
GOV OF AUSTRIA	130,000.00	145,409.55
GOV OF AUSTRIA	220,000.00	204,570.74
GOV OF AUSTRIA	190,000.00	168,078.56
GOV OF AUSTRIA	210,000.00	189,060.69
GOV OF AUSTRIA	60,000.00	60,898.86
GOV OF AUSTRIA	230,000.00	196,241.75
GOV OF AUSTRIA	90,000.00	94,090.50
GOV OF AUSTRIA	260,000.00	215,178.34
GOV OF AUSTRIA	260,000.00	225,128.80
GOV OF AUSTRIA	260,000.00	261,414.40
GOV OF AUSTRIA	160,000.00	153,095.52
GOV OF AUSTRIA	160,000.00	113,659.68
GOV OF AUSTRIA	260,000.00	290,414.80
GOV OF AUSTRIA	100,000.00	60,039.20
GOV OF AUSTRIA	160,000.00	160,113.60
GOV OF AUSTRIA	180,000.00	132,126.66
GOV OF AUSTRIA	80,000.00	62,206.62
GOV OF AUSTRIA	160,000.00	92,047.42
GOV OF AUSTRIA	70,000.00	69,775.16
GOV OF AUSTRIA	80,000.00	91,104.56
GOV OF AUSTRIA	80,000.00	35,057.60
GOV OF AUSTRIA	110,000.00	47,133.79
GOV OF AUSTRIA	84,000.00	61,629.49
GOV OF AUSTRIA	50,000.00	29,326.90
GOV OF BELGIUM	410,000.00	397,750.84
GOV OF BELGIUM	190,000.00	196,997.89
GOV OF BELGIUM	320,000.00	307,728.96
GOV OF BELGIUM	260,000.00	245,184.16
GOV OF BELGIUM	280,000.00	254,693.44
GOV OF BELGIUM	350,000.00	390,329.80
GOV OF BELGIUM	310,000.00	287,718.75
GOV OF BELGIUM	320,000.00	293,157.44
GOV OF BELGIUM	300,000.00	255,739.95
GOV OF BELGIUM	340,000.00	301,190.02
GOV OF BELGIUM	320,000.00	259,509.58
GOV OF BELGIUM	110,000.00	119,878.00
GOV OF BELGIUM	350,000.00	286,468.35
GOV OF BELGIUM	150,000.00	131,433.00
GOV OF BELGIUM	310,000.00	313,413.41
GOV OF BELGIUM	140,000.00	140,837.20
GOV OF BELGIUM	370,000.00	439,727.24
GOV OF BELGIUM	130,000.00	106,393.30

GOV OF BELGIUM	180,000.00	153,771.12
GOV OF BELGIUM	110,000.00	104,052.30
GOV OF BELGIUM	180,000.00	115,457.76
GOV OF BELGIUM	310,000.00	350,481.66
GOV OF BELGIUM	50,000.00	50,885.81
GOV OF BELGIUM	170,000.00	181,008.35
GOV OF BELGIUM	210,000.00	150,778.74
GOV OF BELGIUM	200,000.00	141,679.80
GOV OF BELGIUM	180,000.00	114,127.20
GOV OF BELGIUM	200,000.00	194,526.80
GOV OF BELGIUM	130,000.00	100,754.29
GOV OF BELGIUM	160,000.00	118,725.92
GOV OF BELGIUM	120,000.00	49,321.80
GOV OF FINLAND	100,000.00	101,456.25
GOV OF FINLAND	100,000.00	96,935.10
GOV OF FINLAND	130,000.00	124,011.81
GOV OF FINLAND	40,000.00	37,332.68
GOV OF FINLAND	110,000.00	105,898.43
GOV OF FINLAND	120,000.00	111,427.29
GOV OF FINLAND	70,000.00	70,493.22
GOV OF FINLAND	140,000.00	127,282.63
GOV OF FINLAND	60,000.00	60,695.82
GOV OF FINLAND	150,000.00	133,496.49
GOV OF FINLAND	120,000.00	100,662.00
GOV OF FINLAND	40,000.00	34,928.92
GOV OF FINLAND	140,000.00	115,085.40
GOV OF FINLAND	140,000.00	126,237.07
GOV OF FINLAND	90,000.00	91,148.58
GOV OF FINLAND	90,000.00	76,088.16
GOV OF FINLAND	80,000.00	56,675.60
GOV OF FINLAND	70,000.00	67,344.10
GOV OF FINLAND	50,000.00	31,674.45
GOV OF FINLAND	100,000.00	93,435.10
GOV OF FINLAND	100,000.00	62,575.00
GOV OF FINLAND	90,000.00	65,056.14
GOV OF FINLAND	100,000.00	46,091.70
GOV OF FRANCE	570,000.00	550,708.92
GOV OF FRANCE	1,110,000.00	1,070,692.68
GOV OF FRANCE	800,000.00	773,947.74
GOV OF FRANCE	340,000.00	357,933.98
GOV OF FRANCE	690,000.00	668,095.95
GOV OF FRANCE	820,000.00	775,666.70
GOV OF FRANCE	720,000.00	732,652.56

GOV OF FRANCE	980,000.00	932,702.26
GOV OF FRANCE	810,000.00	806,786.73
GOV OF FRANCE	750,000.00	702,366.75
GOV OF FRANCE	740,000.00	684,050.08
GOV OF FRANCE	740,000.00	703,347.06
GOV OF FRANCE	1,040,000.00	1,046,497.92
GOV OF FRANCE	800,000.00	744,488.80
GOV OF FRANCE	1,360,000.00	1,260,615.28
GOV OF FRANCE	960,000.00	881,975.04
GOV OF FRANCE	620,000.00	624,682.86
GOV OF FRANCE	620,000.00	707,224.08
GOV OF FRANCE	1,100,000.00	988,047.50
GOV OF FRANCE	790,000.00	681,068.48
GOV OF FRANCE	1,060,000.00	1,054,296.71
GOV OF FRANCE	1,090,000.00	913,484.85
GOV OF FRANCE	1,030,000.00	953,028.10
GOV OF FRANCE	1,010,000.00	821,291.60
GOV OF FRANCE	660,000.00	528,072.60
GOV OF FRANCE	620,000.00	761,987.44
GOV OF FRANCE	830,000.00	781,757.08
GOV OF FRANCE	640,000.00	650,816.00
GOV OF FRANCE	270,000.00	285,209.28
GOV OF FRANCE	800,000.00	685,456.00
GOV OF FRANCE	580,000.00	680,106.26
GOV OF FRANCE	840,000.00	689,579.52
GOV OF FRANCE	310,000.00	243,804.15
GOV OF FRANCE	480,000.00	532,177.92
GOV OF FRANCE	540,000.00	452,221.85
GOV OF FRANCE	450,000.00	298,624.95
GOV OF FRANCE	730,000.00	858,501.90
GOV OF FRANCE	290,000.00	259,025.39
GOV OF FRANCE	380,000.00	226,757.40
GOV OF FRANCE	510,000.00	509,926.05
GOV OF FRANCE	550,000.00	432,868.15
GOV OF FRANCE	620,000.00	426,473.82
GOV OF FRANCE	590,000.00	317,622.37
GOV OF FRANCE	560,000.00	294,991.76
GOV OF FRANCE	350,000.00	326,572.40
GOV OF FRANCE	380,000.00	428,355.76
GOV OF FRANCE	380,000.00	433,320.13
GOV OF FRANCE	300,000.00	201,318.90
GOV OF FRANCE	240,000.00	92,068.32
GOV OF GERMANY	640,000.00	622,411.84

GOV OF GERMANY	340,000.00	337,660.18
GOV OF GERMANY	290,000.00	279,671.94
GOV OF GERMANY	360,000.00	359,133.60
GOV OF GERMANY	490,000.00	476,520.10
GOV OF GERMANY	140,000.00	140,612.64
GOV OF GERMANY	580,000.00	554,002.08
GOV OF GERMANY	50,000.00	47,841.20
GOV OF GERMANY	350,000.00	352,473.80
GOV OF GERMANY	650,000.00	623,103.65
GOV OF GERMANY	520,000.00	492,179.48
GOV OF GERMANY	570,000.00	536,057.07
GOV OF GERMANY	440,000.00	412,430.12
GOV OF GERMANY	710,000.00	666,702.78
GOV OF GERMANY	360,000.00	334,188.72
GOV OF GERMANY	140,000.00	158,956.77
GOV OF GERMANY	740,000.00	695,561.52
GOV OF GERMANY	490,000.00	473,036.20
GOV OF GERMANY	550,000.00	504,992.95
GOV OF GERMANY	170,000.00	191,145.31
GOV OF GERMANY	670,000.00	625,148.86
GOV OF GERMANY	420,000.00	418,695.90
GOV OF GERMANY	190,000.00	209,761.95
GOV OF GERMANY	700,000.00	640,935.40
GOV OF GERMANY	350,000.00	352,073.75
GOV OF GERMANY	350,000.00	314,988.80
GOV OF GERMANY	590,000.00	535,305.82
GOV OF GERMANY	670,000.00	593,597.89
GOV OF GERMANY	470,000.00	466,472.65
GOV OF GERMANY	210,000.00	256,440.09
GOV OF GERMANY	650,000.00	569,595.00
GOV OF GERMANY	610,000.00	528,813.88
GOV OF GERMANY	80,000.00	69,430.57
GOV OF GERMANY	120,000.00	121,108.92
GOV OF GERMANY	370,000.00	447,219.00
GOV OF GERMANY	660,000.00	565,856.28
GOV OF GERMANY	590,000.00	500,028.54
GOV OF GERMANY	520,000.00	435,247.28
GOV OF GERMANY	520,000.00	497,863.60
GOV OF GERMANY	820,000.00	821,530.94
GOV OF GERMANY	480,000.00	491,899.68
GOV OF GERMANY	490,000.00	597,404.57
GOV OF GERMANY	400,000.00	305,919.20
GOV OF GERMANY	420,000.00	311,879.40

GOV OF GERMANY	540,000.00	630,380.34
GOV OF GERMANY	410,000.00	336,181.55
GOV OF GERMANY	340,000.00	413,413.14
GOV OF GERMANY	370,000.00	478,499.17
GOV OF GERMANY	330,000.00	362,756.46
GOV OF GERMANY	550,000.00	544,502.75
GOV OF GERMANY	560,000.00	555,984.80
GOV OF GERMANY	690,000.00	531,395.22
GOV OF GERMANY	810,000.00	421,382.25
GOV OF GERMANY	130,000.00	67,962.70
GOV OF GERMANY	470,000.00	232,839.25
GOV OF GERMANY	460,000.00	391,556.60
GOV OF GERMANY	110,000.00	93,810.75
GOV OF IRELAND	200,000.00	204,874.20
GOV OF IRELAND	180,000.00	173,704.50
GOV OF IRELAND	190,000.00	176,462.69
GOV OF IRELAND	150,000.00	140,640.27
GOV OF IRELAND	190,000.00	176,980.44
GOV OF IRELAND	160,000.00	159,007.52
GOV OF IRELAND	140,000.00	120,189.81
GOV OF IRELAND	120,000.00	110,840.19
GOV OF IRELAND	110,000.00	90,461.58
GOV OF IRELAND	130,000.00	107,279.14
GOV OF IRELAND	110,000.00	97,819.26
GOV OF IRELAND	100,000.00	77,246.10
GOV OF IRELAND	130,000.00	112,879.45
GOV OF IRELAND	80,000.00	53,953.92
GOV OF IRELAND	80,000.00	80,114.84
GOV OF IRELAND	180,000.00	149,826.24
GOV OF IRELAND	160,000.00	114,933.60
GOV OF ITALY	440,000.00	426,723.88
GOV OF ITALY	370,000.00	376,321.08
GOV OF ITALY	350,000.00	350,163.45
GOV OF ITALY	350,000.00	342,181.60
GOV OF ITALY	410,000.00	400,624.94
GOV OF ITALY	340,000.00	333,515.86
GOV OF ITALY	280,000.00	271,683.16
GOV OF ITALY	120,000.00	120,810.96
GOV OF ITALY	310,000.00	306,935.65
GOV OF ITALY	320,000.00	313,827.57
GOV OF ITALY	190,000.00	191,466.23
GOV OF ITALY	380,000.00	360,933.50
GOV OF ITALY	530,000.00	545,171.78

GOV OF ITALY	580,000.00	542,831.86
GOV OF ITALY	90,000.00	91,433.25
GOV OF ITALY	440,000.00	425,934.52
GOV OF ITALY	330,000.00	322,793.70
GOV OF ITALY	520,000.00	482,071.20
GOV OF ITALY	130,000.00	132,616.42
GOV OF ITALY	570,000.00	542,738.69
GOV OF ITALY	360,000.00	337,898.52
GOV OF ITALY	430,000.00	404,819.63
GOV OF ITALY	270,000.00	262,761.57
GOV OF ITALY	410,000.00	396,221.13
GOV OF ITALY	230,000.00	213,313.50
GOV OF ITALY	450,000.00	504,198.90
GOV OF ITALY	310,000.00	304,932.43
GOV OF ITALY	500,000.00	479,231.50
GOV OF ITALY	400,000.00	355,595.60
GOV OF ITALY	420,000.00	423,888.78
GOV OF ITALY	250,000.00	222,423.75
GOV OF ITALY	240,000.00	245,946.33
GOV OF ITALY	350,000.00	372,839.25
GOV OF ITALY	440,000.00	431,944.04
GOV OF ITALY	390,000.00	404,626.95
GOV OF ITALY	60,000.00	52,218.36
GOV OF ITALY	330,000.00	321,478.74
GOV OF ITALY	560,000.00	551,055.12
GOV OF ITALY	480,000.00	528,310.08
GOV OF ITALY	330,000.00	337,896.24
GOV OF ITALY	510,000.00	513,257.88
GOV OF ITALY	420,000.00	372,101.52
GOV OF ITALY	330,000.00	334,473.15
GOV OF ITALY	320,000.00	273,426.56
GOV OF ITALY	230,000.00	236,855.38
GOV OF ITALY	500,000.00	443,831.50
GOV OF ITALY	520,000.00	434,156.84
GOV OF ITALY	500,000.00	580,097.00
GOV OF ITALY	420,000.00	338,821.77
GOV OF ITALY	110,000.00	113,106.07
GOV OF ITALY	370,000.00	303,715.98
GOV OF ITALY	520,000.00	448,796.92
GOV OF ITALY	330,000.00	266,663.30
GOV OF ITALY	390,000.00	355,010.13
GOV OF ITALY	340,000.00	391,838.78
GOV OF ITALY	410,000.00	430,672.20

GOV OF ITALY	350,000.00	313,189.10
GOV OF ITALY	320,000.00	333,837.44
GOV OF ITALY	270,000.00	277,682.09
GOV OF ITALY	540,000.00	591,076.98
GOV OF ITALY	260,000.00	245,917.91
GOV OF ITALY	210,000.00	211,095.99
GOV OF ITALY	350,000.00	264,621.00
GOV OF ITALY	320,000.00	263,513.60
GOV OF ITALY	510,000.00	507,883.50
GOV OF ITALY	370,000.00	254,094.54
GOV OF ITALY	220,000.00	198,571.12
GOV OF ITALY	250,000.00	217,050.00
GOV OF ITALY	400,000.00	434,561.20
GOV OF ITALY	260,000.00	225,626.31
GOV OF ITALY	380,000.00	413,079.00
GOV OF ITALY	330,000.00	232,847.67
GOV OF ITALY	200,000.00	202,427.40
GOV OF ITALY	340,000.00	358,154.64
GOV OF ITALY	250,000.00	154,237.04
GOV OF ITALY	330,000.00	279,789.18
GOV OF ITALY	230,000.00	176,980.63
GOV OF ITALY	340,000.00	296,297.08
GOV OF ITALY	330,000.00	304,585.12
GOV OF ITALY	320,000.00	226,979.56
GOV OF ITALY	220,000.00	130,782.52
GOV OF ITALY	140,000.00	90,696.90
GOV OF ITALY	180,000.00	181,296.54
GOV OF ITALY	150,000.00	106,416.30
GOV OF ITALY	110,000.00	65,293.14
GOV OF NETHERLANDS	380,000.00	365,836.64
GOV OF NETHERLANDS	230,000.00	218,226.39
GOV OF NETHERLANDS	340,000.00	323,512.65
GOV OF NETHERLANDS	270,000.00	250,968.00
GOV OF NETHERLANDS	350,000.00	330,346.45
GOV OF NETHERLANDS	210,000.00	233,611.03
GOV OF NETHERLANDS	400,000.00	371,523.20
GOV OF NETHERLANDS	300,000.00	265,934.33
GOV OF NETHERLANDS	130,000.00	115,504.74
GOV OF NETHERLANDS	130,000.00	130,039.65
GOV OF NETHERLANDS	220,000.00	187,709.06
GOV OF NETHERLANDS	360,000.00	299,353.69
GOV OF NETHERLANDS	220,000.00	185,890.41
GOV OF NETHERLANDS	250,000.00	248,439.90

GOV OF NETHERLANDS	210,000.00	207,962.37	
GOV OF NETHERLANDS	330,000.00	374,054.96	
GOV OF NETHERLANDS	190,000.00	129,332.60	
GOV OF NETHERLANDS	310,000.00	220,098.45	
GOV OF NETHERLANDS	330,000.00	373,953.75	
GOV OF NETHERLANDS	70,000.00	74,888.24	
GOV OF NETHERLANDS	370,000.00	370,095.46	
GOV OF NETHERLANDS	320,000.00	153,582.40	
GOV OF NETHERLANDS	160,000.00	136,160.16	
GOV OF SPAIN	330,000.00	319,124.30	
GOV OF SPAIN	420,000.00	411,845.70	
GOV OF SPAIN	410,000.00	393,129.40	
GOV OF SPAIN	410,000.00	419,346.36	
GOV OF SPAIN	480,000.00	473,582.40	
GOV OF SPAIN	420,000.00	396,315.36	
GOV OF SPAIN	420,000.00	411,434.10	
GOV OF SPAIN	590,000.00	588,684.89	
GOV OF SPAIN	360,000.00	385,958.52	
GOV OF SPAIN	310,000.00	297,662.31	
GOV OF SPAIN	510,000.00	468,922.05	
GOV OF SPAIN	550,000.00	527,820.15	
GOV OF SPAIN	330,000.00	308,064.24	
GOV OF SPAIN	440,000.00	418,970.20	
GOV OF SPAIN	590,000.00	527,761.62	
GOV OF SPAIN	450,000.00	424,692.00	
GOV OF SPAIN	480,000.00	451,449.60	
GOV OF SPAIN	360,000.00	396,676.44	
GOV OF SPAIN	410,000.00	469,829.25	
GOV OF SPAIN	410,000.00	382,163.05	
GOV OF SPAIN	180,000.00	185,320.26	
GOV OF SPAIN	460,000.00	411,377.08	
GOV OF SPAIN	430,000.00	378,057.72	
GOV OF SPAIN	450,000.00	388,147.95	
GOV OF SPAIN	420,000.00	395,280.90	
GOV OF SPAIN	440,000.00	393,768.76	
GOV OF SPAIN	490,000.00	397,992.70	
GOV OF SPAIN	420,000.00	346,514.70	
GOV OF SPAIN	390,000.00	322,487.10	
GOV OF SPAIN	390,000.00	466,679.85	
GOV OF SPAIN	480,000.00	458,244.00	
GOV OF SPAIN	420,000.00	418,234.32	
GOV OF SPAIN	280,000.00	260,544.48	
GOV OF SPAIN	550,000.00	563,486.05	

	GOV OF SPAIN	240,000.00	205,320.72
	GOV OF SPAIN	470,000.00	506,050.88
	GOV OF SPAIN	280,000.00	200,158.00
	GOV OF SPAIN	130,000.00	133,585.94
	GOV OF SPAIN	350,000.00	402,528.00
	GOV OF SPAIN	290,000.00	200,798.90
	GOV OF SPAIN	470,000.00	531,731.21
	GOV OF SPAIN	180,000.00	115,464.24
	GOV OF SPAIN	180,000.00	171,915.66
	GOV OF SPAIN	380,000.00	455,699.23
	GOV OF SPAIN	240,000.00	208,114.08
	GOV OF SPAIN	440,000.00	362,501.79
	GOV OF SPAIN	470,000.00	250,832.89
	GOV OF SPAIN	300,000.00	197,472.90
	GOV OF SPAIN	260,000.00	232,098.88
	GOV OF SPAIN	140,000.00	66,874.92
	ユーロ 小計	130,234,000.00	120,972,501.64 (19,453,587,988)
英ポンド	UK TREASURY	430,000.00	411,088.60
	UK TREASURY	250,000.00	250,826.50
	UK TREASURY	370,000.00	351,426.00
	UK TREASURY	250,000.00	240,783.00
	UK TREASURY	580,000.00	571,442.20
	UK TREASURY	460,000.00	424,575.40
	UK TREASURY	250,000.00	235,175.00
	UK TREASURY	590,000.00	534,564.78
	UK TREASURY	510,000.00	510,739.50
	UK TREASURY	240,000.00	219,213.60
	UK TREASURY	280,000.00	283,139.92
	UK TREASURY	300,000.00	258,418.50
	UK TREASURY	470,000.00	480,347.05
	UK TREASURY	320,000.00	289,688.57
	UK TREASURY	140,000.00	153,089.10
	UK TREASURY	550,000.00	466,235.00
	UK TREASURY	270,000.00	229,317.91
	UK TREASURY	350,000.00	278,460.00
	UK TREASURY	280,000.00	294,793.52
	UK TREASURY	560,000.00	427,834.40
	UK TREASURY	580,000.00	463,828.55
	UK TREASURY	480,000.00	491,465.28
	UK TREASURY	580,000.00	547,176.28
	UK TREASURY	380,000.00	285,665.30
	UK TREASURY	200,000.00	208,790.08

	UK TREASURY	220,000.00	227,271.44
	UK TREASURY	430,000.00	291,742.10
	UK TREASURY	270,000.00	271,231.20
	UK TREASURY	400,000.00	295,449.60
	UK TREASURY	470,000.00	440,578.00
	UK TREASURY	280,000.00	291,401.60
	UK TREASURY	340,000.00	218,314.20
	UK TREASURY	330,000.00	323,532.00
	UK TREASURY	240,000.00	233,867.04
	UK TREASURY	290,000.00	176,296.22
	UK TREASURY	450,000.00	448,875.00
	UK TREASURY	140,000.00	143,446.80
	UK TREASURY	380,000.00	314,583.00
	UK TREASURY	360,000.00	307,836.00
	UK TREASURY	320,000.00	157,280.00
	UK TREASURY	300,000.00	285,439.20
	UK TREASURY	350,000.00	195,790.00
	UK TREASURY	210,000.00	122,144.40
	UK TREASURY	220,000.00	208,384.00
	UK TREASURY	340,000.00	135,218.00
	UK TREASURY	430,000.00	208,152.16
	UK TREASURY	240,000.00	208,300.80
	UK TREASURY	320,000.00	161,776.64
	UK TREASURY	510,000.00	439,977.00
	UK TREASURY	240,000.00	124,440.00
	UK TREASURY	310,000.00	293,136.00
	UK TREASURY	340,000.00	179,180.00
	UK TREASURY	280,000.00	254,273.76
	UK TREASURY	400,000.00	117,386.32
	UK TREASURY	180,000.00	162,954.00
	UK TREASURY	290,000.00	183,421.86
	UK TREASURY	270,000.00	220,725.00
	UK TREASURY	290,000.00	133,177.51
	UK TREASURY	200,000.00	72,623.60
	英bond 小計	20,310,000.00	16,756,288.49 (3,149,009,295)
スウェーデンクローナ	GOV OF SWEDEN	1,460,000.00	1,449,976.83
	GOV OF SWEDEN	1,560,000.00	1,498,151.85
	GOV OF SWEDEN	1,400,000.00	1,313,199.83
	GOV OF SWEDEN	1,220,000.00	1,124,003.43
	GOV OF SWEDEN	1,080,000.00	927,352.80
	GOV OF SWEDEN	790,000.00	788,816.35
	GOV OF SWEDEN	930,000.00	887,575.24

	GOV OF SWEDEN	790,000.00	896,910.70
	スウェーデンクローナ 小計	9,230,000.00	8,885,987.03 (125,736,716)
ノルウェークローネ	GOV OF NORWAY	1,080,000.00	1,052,456.32
	GOV OF NORWAY	880,000.00	841,767.52
	GOV OF NORWAY	810,000.00	767,925.36
	GOV OF NORWAY	720,000.00	678,325.53
	GOV OF NORWAY	690,000.00	629,745.75
	GOV OF NORWAY	1,060,000.00	928,420.71
	GOV OF NORWAY	940,000.00	795,529.52
	GOV OF NORWAY	470,000.00	421,440.54
	GOV OF NORWAY	880,000.00	838,597.22
	GOV OF NORWAY	340,000.00	342,848.18
	ノルウェークローネ 小計	7,870,000.00	7,297,056.65 (102,961,469)
デンマーククローネ	GOV OF DENMARK	1,230,000.00	1,210,190.85
	GOV OF DENMARK	1,160,000.00	1,081,870.63
	GOV OF DENMARK	1,050,000.00	945,321.30
	GOV OF DENMARK	1,250,000.00	1,040,741.95
	GOV OF DENMARK	600,000.00	587,885.93
	GOV OF DENMARK	1,920,000.00	2,383,620.48
	GOV OF DENMARK	1,090,000.00	582,016.40
	デンマーククローネ 小計	8,300,000.00	7,831,647.54 (168,928,637)
ポーランドズロチ	GOV OF POLAND	570,000.00	541,272.00
	GOV OF POLAND	820,000.00	799,101.48
	GOV OF POLAND	210,000.00	193,163.38
	GOV OF POLAND	840,000.00	791,481.60
	GOV OF POLAND	910,000.00	800,936.50
	GOV OF POLAND	330,000.00	317,282.13
	GOV OF POLAND	610,000.00	561,828.91
	GOV OF POLAND	700,000.00	638,893.50
	GOV OF POLAND	700,000.00	764,881.38
	GOV OF POLAND	650,000.00	666,857.75
	GOV OF POLAND	940,000.00	831,674.40
	GOV OF POLAND	700,000.00	546,455.00
	GOV OF POLAND	690,000.00	529,796.49
	GOV OF POLAND	560,000.00	585,286.24
		ポーランドズロチ 小計	9,230,000.00
オーストラリアドル	GOV OF AUSTRALIA	350,000.00	346,636.97
	GOV OF AUSTRALIA	380,000.00	355,980.67
	GOV OF AUSTRALIA	380,000.00	383,279.93
	GOV OF AUSTRALIA	450,000.00	412,859.76

	GOV OF AUSTRALIA	400,000.00	411,519.95
	GOV OF AUSTRALIA	310,000.00	298,516.72
	GOV OF AUSTRALIA	310,000.00	290,754.32
	GOV OF AUSTRALIA	290,000.00	276,153.31
	GOV OF AUSTRALIA	340,000.00	329,867.27
	GOV OF AUSTRALIA	310,000.00	291,136.07
	GOV OF AUSTRALIA	480,000.00	440,855.55
	GOV OF AUSTRALIA	490,000.00	401,386.20
	GOV OF AUSTRALIA	320,000.00	267,788.39
	GOV OF AUSTRALIA	570,000.00	452,219.48
	GOV OF AUSTRALIA	490,000.00	390,654.32
	GOV OF AUSTRALIA	510,000.00	418,933.50
	GOV OF AUSTRALIA	420,000.00	429,341.26
	GOV OF AUSTRALIA	420,000.00	378,935.79
	GOV OF AUSTRALIA	350,000.00	335,674.75
	GOV OF AUSTRALIA	330,000.00	308,112.52
	GOV OF AUSTRALIA	250,000.00	215,598.41
	GOV OF AUSTRALIA	250,000.00	234,725.89
	GOV OF AUSTRALIA	170,000.00	147,301.15
	GOV OF AUSTRALIA	260,000.00	204,829.28
	GOV OF AUSTRALIA	250,000.00	192,870.67
	GOV OF AUSTRALIA	360,000.00	200,717.65
	GOV OF AUSTRALIA	140,000.00	143,618.16
	オーストラリアドル 小計	9,580,000.00	8,560,267.94 (831,801,235)
ニュージーランドドル	GOV OF NEWZEALAND	130,000.00	126,400.87
	GOV OF NEWZEALAND	150,000.00	136,686.61
	GOV OF NEWZEALAND	190,000.00	190,162.81
	GOV OF NEWZEALAND	170,000.00	142,529.85
	GOV OF NEWZEALAND	110,000.00	102,795.54
	GOV OF NEWZEALAND	160,000.00	160,070.99
	GOV OF NEWZEALAND	120,000.00	97,350.78
	GOV OF NEWZEALAND	140,000.00	114,909.23
	GOV OF NEWZEALAND	240,000.00	219,151.99
	GOV OF NEWZEALAND	90,000.00	86,562.85
	GOV OF NEWZEALAND	110,000.00	87,220.08
	GOV OF NEWZEALAND	90,000.00	56,319.93
	GOV OF NEWZEALAND	120,000.00	79,873.39
	ニュージーランドドル 小計	1,820,000.00	1,600,034.92 (144,531,154)
シンガポールドル	GOV OF SINGAPORE	220,000.00	217,030.00
	GOV OF SINGAPORE	120,000.00	114,314.40

	GOV OF SINGAPORE	130,000.00	127,049.00
	GOV OF SINGAPORE	110,000.00	104,896.00
	GOV OF SINGAPORE	180,000.00	182,988.00
	GOV OF SINGAPORE	40,000.00	40,000.00
	GOV OF SINGAPORE	90,000.00	89,217.00
	GOV OF SINGAPORE	80,000.00	80,117.60
	GOV OF SINGAPORE	120,000.00	119,916.00
	GOV OF SINGAPORE	130,000.00	129,766.00
	GOV OF SINGAPORE	120,000.00	109,644.00
	GOV OF SINGAPORE	100,000.00	97,730.00
	GOV OF SINGAPORE	110,000.00	114,115.10
	GOV OF SINGAPORE	200,000.00	185,760.00
	GOV OF SINGAPORE	100,000.00	93,000.00
	GOV OF SINGAPORE	110,000.00	106,880.95
	GOV OF SINGAPORE	120,000.00	115,975.59
	GOV OF SINGAPORE	150,000.00	121,669.67
	GOV OF SINGAPORE	80,000.00	65,268.80
	GOV OF SINGAPORE	90,000.00	93,330.00
	シンガポールドル 小計	2,400,000.00	2,308,668.11 (254,830,785)
マレーシアリングット	GOV OF MALAYSIA	250,000.00	251,691.90
	GOV OF MALAYSIA	520,000.00	524,440.90
	GOV OF MALAYSIA	210,000.00	214,172.07
	GOV OF MALAYSIA	280,000.00	283,227.42
	GOV OF MALAYSIA	440,000.00	445,299.14
	GOV OF MALAYSIA	270,000.00	269,967.96
	GOV OF MALAYSIA	500,000.00	505,842.50
	GOV OF MALAYSIA	380,000.00	379,156.03
	GOV OF MALAYSIA	350,000.00	351,615.07
	GOV OF MALAYSIA	180,000.00	187,095.56
	GOV OF MALAYSIA	470,000.00	475,449.97
	GOV OF MALAYSIA	250,000.00	260,273.27
	GOV OF MALAYSIA	430,000.00	399,908.44
	GOV OF MALAYSIA	340,000.00	350,253.48
	GOV OF MALAYSIA	320,000.00	313,540.87
	GOV OF MALAYSIA	190,000.00	189,298.40
	GOV OF MALAYSIA	420,000.00	447,758.08
	GOV OF MALAYSIA	420,000.00	419,409.93
	GOV OF MALAYSIA	220,000.00	226,015.04
	GOV OF MALAYSIA	550,000.00	592,164.21
	GOV OF MALAYSIA	300,000.00	329,390.91
	GOV OF MALAYSIA	450,000.00	433,443.21
	GOV OF MALAYSIA	430,000.00	463,532.29

	GOV OF MALAYSIA	140,000.00	154,609.18
	GOV OF MALAYSIA	280,000.00	301,107.40
	GOV OF MALAYSIA	250,000.00	276,662.15
	GOV OF MALAYSIA	490,000.00	478,306.07
	GOV OF MALAYSIA	210,000.00	217,935.76
	マレーシアリングット 小計	9,540,000.00	9,741,567.21 (304,304,154)
中国元	GOV OF CHINA	3,130,000.00	3,136,447.17
	GOV OF CHINA	4,720,000.00	4,731,849.56
	GOV OF CHINA	5,130,000.00	5,117,456.32
	GOV OF CHINA	3,140,000.00	3,142,321.40
	GOV OF CHINA	3,960,000.00	3,948,056.60
	GOV OF CHINA	4,800,000.00	4,797,011.85
	GOV OF CHINA	2,880,000.00	2,880,288.28
	GOV OF CHINA	2,690,000.00	2,731,514.50
	GOV OF CHINA	4,450,000.00	4,455,360.47
	GOV OF CHINA	7,940,000.00	7,958,337.43
	GOV OF CHINA	2,500,000.00	2,511,084.25
	GOV OF CHINA	4,480,000.00	4,561,260.92
	GOV OF CHINA	3,500,000.00	3,553,034.45
	GOV OF CHINA	1,600,000.00	1,600,877.44
	GOV OF CHINA	3,300,000.00	3,383,413.11
	GOV OF CHINA	4,650,000.00	4,698,162.37
	GOV OF CHINA	4,460,000.00	4,450,211.54
	GOV OF CHINA	7,400,000.00	7,421,460.00
	GOV OF CHINA	320,000.00	327,936.51
	GOV OF CHINA	5,240,000.00	5,249,035.33
	GOV OF CHINA	2,740,000.00	2,752,279.03
	GOV OF CHINA	6,770,000.00	6,892,825.40
	GOV OF CHINA	2,630,000.00	2,641,977.02
	GOV OF CHINA	3,120,000.00	3,128,258.32
	GOV OF CHINA	3,630,000.00	3,770,781.92
	GOV OF CHINA	3,200,000.00	3,233,440.00
	GOV OF CHINA	3,090,000.00	3,123,906.87
	GOV OF CHINA	3,230,000.00	3,320,224.55
	GOV OF CHINA	2,200,000.00	2,340,864.68
	GOV OF CHINA	3,410,000.00	3,413,708.37
	GOV OF CHINA	4,020,000.00	4,036,758.97
	GOV OF CHINA	4,360,000.00	4,464,231.90
	GOV OF CHINA	4,050,000.00	4,083,475.27
	GOV OF CHINA	1,900,000.00	1,983,139.82
	GOV OF CHINA	3,850,000.00	3,923,864.94
	GOV OF CHINA	3,530,000.00	3,693,317.21

	GOV OF CHINA	3,950,000.00	4,015,581.05
	GOV OF CHINA	4,030,000.00	4,067,083.24
	GOV OF CHINA	3,750,000.00	3,816,845.25
	GOV OF CHINA	4,000,000.00	4,070,363.20
	GOV OF CHINA	4,080,000.00	4,123,897.12
	GOV OF CHINA	3,400,000.00	3,424,372.22
	GOV OF CHINA	4,830,000.00	4,864,163.05
	GOV OF CHINA	4,670,000.00	4,910,874.39
	GOV OF CHINA	4,320,000.00	4,465,920.52
	GOV OF CHINA	1,820,000.00	1,866,376.33
	GOV OF CHINA	2,760,000.00	2,800,062.50
	GOV OF CHINA	2,170,000.00	2,205,673.06
	GOV OF CHINA	3,690,000.00	3,729,928.01
	GOV OF CHINA	1,900,000.00	1,905,571.56
	GOV OF CHINA	3,960,000.00	4,036,079.12
	GOV OF CHINA	3,770,000.00	3,878,864.02
	GOV OF CHINA	2,500,000.00	2,521,965.75
	GOV OF CHINA	5,060,000.00	5,053,506.08
	GOV OF CHINA	2,840,000.00	2,883,658.75
	GOV OF CHINA	2,540,000.00	3,121,258.17
	GOV OF CHINA	2,260,000.00	2,700,918.31
	GOV OF CHINA	3,670,000.00	4,068,024.34
	GOV OF CHINA	3,150,000.00	3,730,305.60
	GOV OF CHINA	1,340,000.00	1,580,891.66
	GOV OF CHINA	3,200,000.00	3,655,025.91
	GOV OF CHINA	1,650,000.00	1,819,693.42
	GOV OF CHINA	1,660,000.00	1,768,115.46
	GOV OF CHINA	2,850,000.00	3,099,865.20
	GOV OF CHINA	1,270,000.00	1,333,620.26
	中国元 小計	227,110,000.00	232,976,677.32 (4,810,642,219)
イスラエルシュケル	GOV OF ISRAEL	750,000.00	722,587.50
	GOV OF ISRAEL	50,000.00	48,737.50
	GOV OF ISRAEL	420,000.00	394,065.00
	GOV OF ISRAEL	260,000.00	279,747.00
	GOV OF ISRAEL	560,000.00	538,412.00
	GOV OF ISRAEL	430,000.00	401,620.00
	GOV OF ISRAEL	240,000.00	243,900.00
	GOV OF ISRAEL	750,000.00	629,475.00
	GOV OF ISRAEL	380,000.00	304,798.00
	GOV OF ISRAEL	420,000.00	294,420.00
	GOV OF ISRAEL	370,000.00	404,558.00
	GOV OF ISRAEL	430,000.00	379,066.50

	GOV OF ISRAEL	210,000.00	143,377.50
	イスラエルシュケル 小計	5,270,000.00	4,784,764.00 (191,165,197)
	合計		59,992,736,061 (59,992,736,061)

(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 262銘柄	100.0%	47.5%
カナダドル	国債証券 42銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.9%
ユーロ	国債証券 365銘柄	100.0%	32.4%
英ポンド	国債証券 59銘柄	100.0%	5.2%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.2%
ノルウェークローネ	国債証券 10銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.3%
ポーランドズロチ	国債証券 14銘柄	100.0%	0.5%
オーストラリアドル	国債証券 27銘柄	100.0%	1.4%
ニュージーランドドル	国債証券 13銘柄	100.0%	0.2%
シンガポールドル	国債証券 20銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリンギット	国債証券 28銘柄	100.0%	0.5%
中国元	国債証券 65銘柄	100.0%	8.0%
イスラエルシュケル	国債証券 13銘柄	100.0%	0.3%

(注)時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

#### 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

#### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

#### R M新興国債券マザーファンド

#### 貸借対照表

(単位:円)

2024年 1月25日現在	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	3,438,553
コール・ローン	20,289,793
投資信託受益証券	12,060,155,125
未収入金	19,755,300
未収配当金	254,493,379
流動資産合計	12,358,132,150
資産合計	12,358,132,150
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,976
未払解約金	44,976,600
未払利息	55
流動負債合計	44,981,631

2024年 1月25日現在

負債合計	44,981,631
純資産の部	
元本等	
元本	9,030,880,072
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	3,282,270,447
元本等合計	12,313,150,519
純資産合計	12,313,150,519
負債純資産合計	12,358,132,150

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

2024年 1月25日現在

1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 1月26日
期首元本額	8,512,322,931円
期中追加設定元本額	2,263,121,437円
期中一部解約元本額	1,744,564,296円
期末元本額	9,030,880,072円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	737,683,453円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	975,559,552円
りそなラップ型ファンド(成長型)	644,476,597円
DCりそな グローバルバランス	22,035,060円
つみたてバランスファンド	1,549,019,931円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	326,700,550円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	249,813,371円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	173,857,988円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	91,964,096円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	62,283,165円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	35,621,599円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	83,474,539円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	91,435,082円
九州SDGs・グローバルバランス	29,457,343円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定型)	5,360,190円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定成長型)	46,615,460円
ラップ型ファンド・プラスESG(成長型)	55,511,833円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定型)	24,662,379円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定成長型)	25,596,625円
りそな つみたてラップ型ファンド(成長型)	15,730,284円
ターゲットリターンバランスファンド(目標2%)	440,630円
ターゲットリターンバランスファンド(目標3%)	202,014円
ターゲットリターンバランスファンド(目標4%)	846,757円
ターゲットリターンバランスファンド(目標5%)	336,145円
ターゲットリターンバランスファンド(目標6%)	724,091円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2065	246,661円

FWりそな先進国+新興国債券アクティブファンド	25,246,813円
FWりそな新興国債券インデックスファンド	2,963,289,413円
Smart-i 8資産バランス 安定型	82,969,642円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	277,655,630円
Smart-i 8資産バランス 成長型	390,705,617円
りそなVIGローバル・バランスファンド（安定型）（適格機関投資家専用）	2,418,204円
りそなVIグローバル・バランスファンド（安定成長型）（適格機関投資家専用）	4,366,331円
りそなVIグローバル・バランスファンド（成長型）（適格機関投資家専用）	20,249,164円
りそなFT マルチアセットファンド（適格機関投資家専用）	14,294,203円
りそなDAAマルチアセットファンド（適格機関投資家専用）	29,660円
2. 計算日における受益権の総数	9,030,880,072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	1.3634円
(10,000口当たり純資産額)	(13,634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 1月25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 1月25日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ
2. 時価の算定方法	投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 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 1月25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 1月25日現在	
	損益に含まれた評価差額(円)	
投資信託受益証券		65,327,173
合計		65,327,173

(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 1月25日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	2,950,374	-	2,955,350	4,976
	米ドル	2,950,374	-	2,955,350	4,976
	合計	2,950,374	-	2,955,350	4,976

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

### 附属明細表

#### 第1 有価証券明細表

##### (1) 株式

該当事項はありません。

##### (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	米ドル	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	1,485,047	65,787,582.10	
		VANECK J.P.MORGAN EM LOCAL	630,832	15,777,108.32	
		米ドル 小計	2,115,879	81,564,690.42	(12,060,155,125)
	合計			12,060,155,125	(12,060,155,125)

(注1) 通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位：円）であります。

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

(注3) 券面総額欄の数値は口数を表しております。

### 外貨建有価証券の内訳

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

(注) 時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

#### 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

#### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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国内株式マザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

2024年 1月25日現在	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	957,421,481
株式	136,747,185,170
派生商品評価勘定	38,383,500
未収入金	8,465,964,274
未収配当金	181,122,054
差入委託証拠金	45,503,195
流動資産合計	146,435,579,674
資産合計	146,435,579,674
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	663,300
前受金	38,280,000
未払金	8,067,843,700
未払解約金	525,907,300
未払利息	2,596
流動負債合計	8,632,696,896
負債合計	8,632,696,896
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	70,667,653,425
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	67,135,229,353
元本等合計	137,802,882,778
純資産合計	137,802,882,778
負債純資産合計	146,435,579,674

### 注記表

#### （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

#### （貸借対照表に関する注記）

2024年 1月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 1月26日
期首元本額	36,346,376,657円
期中追加設定元本額	70,732,713,235円
期中一部解約元本額	36,411,436,467円
期末元本額	70,667,653,425円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド（安定型）	2,204,112,729円

りそなラップ型ファンド(安定成長型)	3,317,617,400円
りそなラップ型ファンド(成長型)	4,246,343,169円
DCりそな グローバルバランス	66,131,237円
つみたてバランスファンド	6,836,184,155円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	485,611,037円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	369,049,870円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	253,802,188円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	135,110,655円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	90,393,810円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	51,423,310円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	118,850,166円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定型)	73,778,629円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定成長型)	122,238,685円
りそな つみたてラップ型ファンド(成長型)	124,915,428円
りそな つみたてリスクコントロールファンド	55,756,279円
ターゲットリターンバランスファンド(目標2%)	931,762円
ターゲットリターンバランスファンド(目標3%)	511,794円
ターゲットリターンバランスファンド(目標4%)	2,733,657円
ターゲットリターンバランスファンド(目標5%)	1,438,158円
ターゲットリターンバランスファンド(目標6%)	4,736,607円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2065	349,404円
FWりそな国内株式アクティブファンド	241,310,812円
FWりそな国内株式インデックスファンド	41,305,623,425円
Smart-i TOPIXインデックス	4,174,035,746円
Smart-i 8資産バランス 安定型	122,223,963円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	411,819,118円
Smart-i 8資産バランス 成長型	560,482,872円
TOPIXインデックスファンド(適格機関投資家専用)	496,319,470円
りそなFT TOPIXインデックス(適格機関投資家専用)	919,633,795円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	164,995,672円
りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	1,826,643,789円
りそなVEIグローバル・バランスファンド(安定型)(適格機関投資家専用)	7,722,907円
りそなVEI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)	26,266,068円
りそなVEI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)	60,486,453円
りそなFT マルチアセットファンド(適格機関投資家専用)	74,154,377円
りそなDAAマルチアセットファンド(適格機関投資家専用)	86,008円
りそなFT パッシブバランス(適格機関投資家専用)	273,994,027円
りそなマルチアセットファンド(適格機関投資家専用)	44,268,686円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	26,687,763円
りそなDAAファンド202205(適格機関投資家専用)	345,583,281円
りそなFT パッシブバランス202307(適格機関投資家専用)	753,783,470円
りそなマルチアセットファンド202310(適格機関投資家専用)	269,511,594円
2. 計算日における受益権の総数	70,667,653,425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	1.9500円
(10,000口当たり純資産額)	(19,500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 1月25日現在

#### 1. 金融商品に対する取組方針

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

#### 2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

#### 3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

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

#### 金融商品の時価等に関する事項

2024年 1月25日現在

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

（関連当事者との取引に関する注記）

2024年 1月25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 1月25日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式		21,511,011,574
合計		21,511,011,574

(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 1月25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	873,259,800	-	910,980,000	37,720,200
合計		873,259,800	-	910,980,000	37,720,200

(注) 時価の算定方法

先物取引

国内先物取引について

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

(単位：円)

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	2,000	3,920.00	7,840,000	
ニッセイ	53,400	792.30	42,308,820	
マルハニチロ	7,900	2,953.50	23,332,650	

雪国まいたけ	4,500	956.00	4,302,000
カネコ種苗	1,600	1,446.00	2,313,600
サカタのタネ	6,100	3,715.00	22,661,500
ホクト	4,300	1,778.00	7,645,400
ホクリヨウ	500	1,042.00	521,000
住石ホールディングス	5,300	1,828.00	9,688,400
日鉄鉱業	2,100	5,250.00	11,025,000
三井松島ホールディングス	3,200	2,829.00	9,052,800
I N P E X	197,400	1,989.00	392,628,600
石油資源開発	6,200	6,010.00	37,262,000
K & O エナジーグループ	2,400	2,283.00	5,479,200
ショーボンドホールディングス	7,300	6,664.00	48,647,200
ミライト・ワン	17,600	1,921.00	33,809,600
タマホーム	3,400	4,130.00	14,042,000
サンヨーホームズ	400	755.00	302,000
日本アクア	1,200	981.00	1,177,200
ファーストコーポレーション	800	766.00	612,800
ベステラ	700	1,071.00	749,700
キャンディル	500	586.00	293,000
ダイセキ環境ソリューション	600	1,089.00	653,400
第一カッター興業	1,400	1,425.00	1,995,000
安藤・間	30,900	1,172.00	36,214,800
東急建設	16,700	826.00	13,794,200
コムシスホールディングス	17,000	3,228.00	54,876,000
ピーアールホールディングス	7,800	369.00	2,878,200
高松コンストラクショングループ	4,000	2,929.00	11,716,000
東建コーポレーション	1,500	9,300.00	13,950,000
ソネック	300	948.00	284,400
ヤマウラ	2,700	1,662.00	4,487,400
オリエンタル白石	19,800	366.00	7,246,800
大成建設	34,900	5,387.00	188,006,300
大林組	133,500	1,353.00	180,625,500
清水建設	105,900	1,011.50	107,117,850
飛島建設	3,800	1,474.00	5,601,200
長谷工コーポレーション	34,300	1,906.00	65,375,800
松井建設	3,500	816.00	2,856,000
銭高組	300	4,490.00	1,347,000
鹿島建設	82,800	2,645.00	219,006,000
不動テトラ	2,600	2,363.00	6,143,800
大末建設	800	1,413.00	1,130,400
鉄建建設	2,700	2,085.00	5,629,500
西松建設	7,100	4,054.00	28,783,400
三井住友建設	27,800	404.00	11,231,200

大豊建設	1,300	3,760.00	4,888,000
佐田建設	1,300	683.00	887,900
ナカノフドー建設	1,500	503.00	754,500
奥村組	6,100	5,040.00	30,744,000
東鉄工業	4,600	3,025.00	13,915,000
イチケン	500	2,309.00	1,154,500
富士ピー・エス	900	455.00	409,500
浅沼組	2,800	4,215.00	11,802,000
戸田建設	50,500	936.20	47,278,100
熊谷組	6,200	3,715.00	23,033,000
北野建設	400	3,095.00	1,238,000
植木組	600	1,559.00	935,400
矢作建設工業	5,100	1,439.00	7,338,900
ピーエス三菱	4,700	932.00	4,380,400
日本ハウスホールディングス	8,000	307.00	2,456,000
新日本建設	5,200	1,195.00	6,214,000
東亜道路工業	1,500	7,000.00	10,500,000
日本道路	4,400	2,138.00	9,407,200
東亜建設工業	2,900	3,805.00	11,034,500
日本国土開発	10,600	553.00	5,861,800
若築建設	1,300	3,050.00	3,965,000
東洋建設	9,400	1,301.00	12,229,400
五洋建設	52,900	795.30	42,071,370
世紀東急工業	4,800	1,859.00	8,923,200
福田組	1,400	5,380.00	7,532,000
住友林業	32,300	4,424.00	142,895,200
日本基礎技術	1,300	498.00	647,400
巴コーポレーション	2,600	553.00	1,437,800
大和ハウス工業	103,200	4,512.00	465,638,400
ライト工業	7,700	2,123.00	16,347,100
積水ハウス	113,200	3,385.00	383,182,000
日特建設	3,600	1,155.00	4,158,000
北陸電気工事	2,600	1,176.00	3,057,600
ユアテック	8,200	1,134.00	9,298,800
日本リーテック	2,900	1,253.00	3,633,700
四電工	1,600	3,375.00	5,400,000
中電工	5,800	2,684.00	15,567,200
関電工	23,400	1,433.00	33,532,200
きんでん	26,300	2,419.00	63,619,700
東京エネシス	3,700	1,018.00	3,766,600
トーエネック	1,200	4,610.00	5,532,000
住友電設	3,600	2,842.00	10,231,200
日本電設工業	7,000	2,031.00	14,217,000

エクシオグループ	18,200	3,247.00	59,095,400
新日本空調	2,400	2,487.00	5,968,800
九電工	8,100	5,041.00	40,832,100
三機工業	8,100	1,836.00	14,871,600
日揮ホールディングス	36,900	1,695.00	62,545,500
中外炉工業	1,200	2,648.00	3,177,600
ヤマト	1,700	981.00	1,667,700
太平電業	2,300	4,285.00	9,855,500
高砂熱学工業	10,000	3,340.00	33,400,000
三晃金属工業	300	4,980.00	1,494,000
朝日工業社	1,700	2,990.00	5,083,000
明星工業	7,200	1,170.00	8,424,000
大気社	4,300	4,260.00	18,318,000
ダイダン	4,900	1,672.00	8,192,800
日比谷総合設備	2,700	2,587.00	6,984,900
フィル・カンパニー	600	819.00	491,400
テスホールディングス	8,000	456.00	3,648,000
インフロニア・ホールディングス	43,000	1,568.50	67,445,500
東洋エンジニアリング	5,500	796.00	4,378,000
レイズネクスト	5,400	1,572.00	8,488,800
ニッポン	11,200	2,229.00	24,964,800
日清製粉グループ本社	34,700	2,063.00	71,586,100
日東富士製粉	700	5,090.00	3,563,000
昭和産業	3,600	3,305.00	11,898,000
鳥越製粉	1,900	692.00	1,314,800
中部飼料	5,200	1,117.00	5,808,400
フィード・ワン	5,500	830.00	4,565,000
東洋精糖	400	2,327.00	930,800
日本甜菜製糖	2,200	2,164.00	4,760,800
D M三井製糖ホールディングス	3,700	3,200.00	11,840,000
塩水港精糖	2,700	323.00	872,100
ウェルネオシュガー	1,900	2,325.00	4,417,500
森永製菓	16,000	2,757.00	44,112,000
中村屋	900	3,120.00	2,808,000
江崎グリコ	10,700	4,266.00	45,646,200
名糖産業	1,500	1,717.00	2,575,500
井村屋グループ	2,200	2,427.00	5,339,400
不二家	2,600	2,510.00	6,526,000
山崎製パン	25,100	3,658.00	91,815,800
第一屋製パン	400	642.00	256,800
モロゾフ	1,200	3,865.00	4,638,000
亀田製菓	2,100	4,150.00	8,715,000
寿スピリッツ	17,700	1,982.50	35,090,250

カルビー	17,200	3,022.00	51,978,400
森永乳業	13,100	2,994.50	39,227,950
六甲バター	2,700	1,359.00	3,669,300
ヤクルト本社	53,600	3,230.00	173,128,000
明治ホールディングス	45,900	3,536.00	162,302,400
雪印メグミルク	9,100	2,236.00	20,347,600
プリマハム	5,000	2,388.00	11,940,000
日本ハム	16,100	4,972.00	80,049,200
林兼産業	700	552.00	386,400
丸大食品	3,800	1,632.00	6,201,600
S Foods	4,100	3,315.00	13,591,500
柿安本店	1,500	2,539.00	3,808,500
伊藤ハム米久ホールディングス	5,700	4,105.00	23,398,500
サッポロホールディングス	12,300	6,884.00	84,673,200
アサヒグループホールディングス	86,600	5,474.00	474,048,400
キリンホールディングス	156,100	2,088.50	326,014,850
宝ホールディングス	25,600	1,224.50	31,347,200
オエノンホールディングス	11,200	356.00	3,987,200
養命酒製造	1,200	1,891.00	2,269,200
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	29,400	2,005.50	58,961,700
ライフドリンク カンパニー	600	5,490.00	3,294,000
サントリー食品インターナショナル	26,400	4,817.00	127,168,800
ダイドーグループホールディングス	4,200	2,898.00	12,171,600
伊藤園	12,700	4,304.00	54,660,800
キーコーヒー	4,200	2,102.00	8,828,400
ユニカフェ	700	907.00	634,900
ジャパンフーズ	300	1,264.00	379,200
日清オイリオグループ	5,300	4,420.00	23,426,000
不二製油グループ本社	8,700	2,280.50	19,840,350
かどや製油	300	3,720.00	1,116,000
J - オイルミルズ	4,300	2,029.00	8,724,700
キッコーマン	24,800	9,115.00	226,052,000
味の素	89,100	6,060.00	539,946,000
ブルドックソース	2,000	2,227.00	4,454,000
キューピー	20,100	2,606.50	52,390,650
ハウス食品グループ本社	12,900	3,218.00	41,512,200
カゴメ	16,100	3,165.00	50,956,500
焼津水産化学工業	900	1,202.00	1,081,800
アリアケジャパン	3,700	4,540.00	16,798,000
ピエトロ	300	1,803.00	540,900
エバラ食品工業	900	2,939.00	2,645,100
やまみ	200	3,815.00	763,000
ニチレイ	17,200	3,544.00	60,956,800

東洋水産	18,900	7,863.00	148,610,700
イトアンドホールディングス	1,800	2,102.00	3,783,600
大冷	300	1,938.00	581,400
ヨシムラ・フード・ホールディングス	1,700	1,013.00	1,722,100
日清食品ホールディングス	39,500	4,907.00	193,826,500
永谷園ホールディングス	1,800	2,217.00	3,990,600
一正蒲鉾	900	733.00	659,700
フジッコ	3,800	1,953.00	7,421,400
ロック・フィールド	4,200	1,607.00	6,749,400
日本たばこ産業	227,700	3,811.00	867,764,700
ケンコーマヨネーズ	2,600	1,707.00	4,438,200
わらべや日洋ホールディングス	2,500	2,863.00	7,157,500
なとり	2,400	2,136.00	5,126,400
イフジ産業	400	1,341.00	536,400
ファーマフーズ	5,400	1,010.00	5,454,000
ユーグレナ	23,300	688.00	16,030,400
紀文食品	3,200	1,182.00	3,782,400
ピクルスホールディングス	2,200	1,240.00	2,728,000
ミヨシ油脂	800	1,312.00	1,049,600
理研ビタミン	3,200	2,290.00	7,328,000
片倉工業	3,500	1,704.00	5,964,000
グンゼ	2,700	5,250.00	14,175,000
東洋紡	16,500	1,106.00	18,249,000
ユニチカ	12,300	168.00	2,066,400
富士紡ホールディングス	1,700	3,920.00	6,664,000
倉敷紡績	2,800	3,055.00	8,554,000
シキボウ	1,800	1,204.00	2,167,200
日本毛織	10,100	1,465.00	14,796,500
ダイトウボウ	3,300	92.00	303,600
トーア紡コーポレーション	800	423.00	338,400
ガイドーリミテッド	3,000	469.00	1,407,000
帝国繊維	4,300	2,245.00	9,653,500
帝人	36,600	1,348.50	49,355,100
東レ	255,400	724.60	185,062,840
住江織物	400	2,378.00	951,200
日本フェルト	1,200	436.00	523,200
イチカワ	300	1,804.00	541,200
日東製網	200	1,590.00	318,000
アツギ	1,500	511.00	766,500
ダイニック	700	714.00	499,800
セーレン	7,400	2,484.00	18,381,600
ソトー	700	688.00	481,600
東海染工	200	861.00	172,200

小松マテール	5,500	809.00	4,449,500
ワコールホールディングス	7,800	3,392.00	26,457,600
ホギメディカル	5,000	3,470.00	17,350,000
クラウドシアホールディングス	500	431.00	215,500
T S Iホールディングス	12,400	687.00	8,518,800
マツオカコーポレーション	600	1,630.00	978,000
ワールド	5,400	1,736.00	9,374,400
三陽商会	1,300	2,636.00	3,426,800
ナイガイ	700	268.00	187,600
オンワードホールディングス	22,500	525.00	11,812,500
ルックホールディングス	900	2,523.00	2,270,700
キムラタン	12,800	18.00	230,400
ゴールドウイン	6,800	9,908.00	67,374,400
デサント	6,600	3,670.00	24,222,000
キング	800	700.00	560,000
ヤマトインターナショナル	1,700	307.00	521,900
特種東海製紙	2,100	3,925.00	8,242,500
王子ホールディングス	158,800	577.10	91,643,480
日本製紙	21,500	1,381.00	29,691,500
三菱製紙	2,900	584.00	1,693,600
北越コーポレーション	18,700	1,386.00	25,918,200
中越パルプ工業	900	1,932.00	1,738,800
大王製紙	16,800	1,129.00	18,967,200
阿波製紙	600	487.00	292,200
レンゴー	34,700	954.40	33,117,680
トーモク	2,200	2,382.00	5,240,400
ザ・パック	2,800	3,375.00	9,450,000
北の達人コーポレーション	16,100	244.00	3,928,400
クラレ	55,600	1,537.00	85,457,200
旭化成	257,900	1,110.00	286,269,000
共和レザー	1,200	773.00	927,600
巴川コーポレーション	600	1,098.00	658,800
レゾナック・ホールディングス	36,800	3,017.00	111,025,600
住友化学	282,900	341.10	96,497,190
住友精化	1,800	5,310.00	9,558,000
日産化学	17,900	5,883.00	105,305,700
ラサ工業	1,500	2,364.00	3,546,000
クレハ	8,300	2,895.00	24,028,500
多木化学	1,500	3,135.00	4,702,500
テイカ	3,300	1,411.00	4,656,300
石原産業	6,300	1,556.00	9,802,800
片倉コープアグリ	500	1,134.00	567,000
日本曹達	4,500	5,810.00	26,145,000

東ソー	50,900	1,875.00	95,437,500
トクヤマ	12,300	2,494.50	30,682,350
セントラル硝子	4,100	2,751.00	11,279,100
東亜合成	19,100	1,362.00	26,014,200
大阪ソーダ	2,700	9,860.00	26,622,000
関東電化工業	7,400	893.00	6,608,200
デンカ	13,900	2,572.50	35,757,750
信越化学工業	345,700	5,867.00	2,028,221,900
日本カーバイド工業	1,400	1,525.00	2,135,000
堺化学工業	2,900	1,906.00	5,527,400
第一稀元素化学工業	4,200	993.00	4,170,600
エア・ウォーター	36,000	1,958.50	70,506,000
日本酸素ホールディングス	37,000	3,739.00	138,343,000
日本化学工業	1,400	1,929.00	2,700,600
東邦アセチレン	2,200	376.00	827,200
日本パーカラライジング	17,000	1,177.00	20,009,000
高压ガス工業	5,500	850.00	4,675,000
チタン工業	300	1,130.00	339,000
四国化成ホールディングス	4,900	1,965.00	9,628,500
戸田工業	900	1,545.00	1,390,500
ステラ ケミファ	2,100	3,285.00	6,898,500
保土谷化学工業	1,200	3,595.00	4,314,000
日本触媒	5,600	5,501.00	30,805,600
大日精化工業	2,600	2,739.00	7,121,400
カネカ	9,700	3,623.00	35,143,100
三菱瓦斯化学	28,500	2,422.50	69,041,250
三井化学	31,400	4,398.00	138,097,200
J S R	41,500	4,056.00	168,324,000
東京応化工業	18,200	3,469.00	63,135,800
大阪有機化学工業	3,200	3,045.00	9,744,000
三菱ケミカルグループ	278,700	901.00	251,108,700
K Hネオケム	5,800	2,327.00	13,496,600
ダイセル	49,000	1,456.00	71,344,000
住友ベークライト	5,300	7,591.00	40,232,300
積水化学工業	76,600	2,140.50	163,962,300
日本ゼオン	26,100	1,312.50	34,256,250
アイカ工業	9,600	3,374.00	32,390,400
U B E	18,100	2,421.50	43,829,150
積水樹脂	5,700	2,548.00	14,523,600
タキロンシーアイ	9,700	661.00	6,411,700
旭有機材	2,500	4,050.00	10,125,000
ニチバン	2,100	1,739.00	3,651,900
リケンテクノス	8,200	864.00	7,084,800

大倉工業	1,800	2,609.00	4,696,200
積水化成成品工業	5,400	500.00	2,700,000
群栄化学工業	900	3,325.00	2,992,500
タイガースポリマー	1,000	920.00	920,000
ミライアル	700	1,575.00	1,102,500
ダイキアクシス	900	721.00	648,900
ダイキョーニシカワ	8,400	742.00	6,232,800
竹本容器	800	792.00	633,600
森六ホールディングス	2,000	2,825.00	5,650,000
恵和	2,700	1,418.00	3,828,600
日本化薬	29,100	1,325.00	38,557,500
カーリットホールディングス	4,100	956.00	3,919,600
日本精化	2,500	3,115.00	7,787,500
扶桑化学工業	4,000	4,395.00	17,580,000
トリケミカル研究所	4,600	3,850.00	17,710,000
A D E K A	13,300	2,936.00	39,048,800
日油	11,500	6,775.00	77,912,500
新日本理化	2,900	197.00	571,300
ハリマ化成グループ	2,100	872.00	1,831,200
花王	86,200	5,799.00	499,873,800
第一工業製薬	1,500	1,975.00	2,962,500
石原ケミカル	1,700	2,131.00	3,622,700
日華化学	900	905.00	814,500
ニイタカ	400	1,884.00	753,600
三洋化成工業	2,300	4,290.00	9,867,000
有機合成薬品工業	1,700	284.00	482,800
大日本塗料	4,200	1,080.00	4,536,000
日本ペイントホールディングス	202,400	1,182.50	239,338,000
関西ペイント	37,400	2,516.00	94,098,400
神東塗料	1,700	127.00	215,900
中国塗料	7,800	1,747.00	13,626,600
日本特殊塗料	1,500	1,333.00	1,999,500
藤倉化成	4,400	443.00	1,949,200
太陽ホールディングス	6,600	3,190.00	21,054,000
D I C	14,900	2,842.50	42,353,250
サカタインクス	8,500	1,423.00	12,095,500
a r t i e n c e	8,300	2,761.00	22,916,300
T & K T O K A	3,000	1,407.00	4,221,000
富士フイルムホールディングス	70,800	9,217.00	652,563,600
資生堂	79,700	4,009.00	319,517,300
ライオン	50,000	1,311.00	65,550,000
高砂香料工業	2,900	3,555.00	10,309,500
マンダム	8,200	1,281.00	10,504,200

ミルボン	5,200	3,506.00	18,231,200
ファンケル	16,700	2,312.00	38,610,400
コーセー	7,800	9,581.00	74,731,800
コタ	3,500	1,595.00	5,582,500
シーボン	300	1,500.00	450,000
ポーラ・オルビスホールディングス	19,600	1,542.00	30,223,200
ノエビアホールディングス	3,400	5,220.00	17,748,000
アジュバンホールディングス	500	928.00	464,000
新日本製薬	2,200	1,750.00	3,850,000
I - n e	800	2,438.00	1,950,400
アクシージア	1,900	892.00	1,694,800
エステー	2,900	1,537.00	4,457,300
アグロ カネショウ	1,500	1,386.00	2,079,000
コニシ	11,000	1,372.00	15,092,000
長谷川香料	7,300	3,235.00	23,615,500
小林製薬	11,100	6,657.00	73,892,700
荒川化学工業	3,200	1,058.00	3,385,600
メック	3,100	4,435.00	13,748,500
日本高純度化学	900	2,596.00	2,336,400
タカラバイオ	10,300	1,242.00	12,792,600
J C U	4,300	3,885.00	16,705,500
新田ゼラチン	1,400	775.00	1,085,000
O A Tアグリオ	1,100	1,951.00	2,146,100
デクセリアルズ	9,600	4,404.00	42,278,400
アース製薬	3,500	4,465.00	15,627,500
北興化学工業	3,800	1,046.00	3,974,800
大成ラミック	1,100	3,005.00	3,305,500
クミアイ化学工業	15,200	855.00	12,996,000
日本農薬	7,000	684.00	4,788,000
アキレス	2,400	1,563.00	3,751,200
有沢製作所	6,700	1,094.00	7,329,800
日東電工	24,500	11,350.00	278,075,000
レック	4,900	1,054.00	5,164,600
三光合成	4,800	652.00	3,129,600
きもと	3,500	225.00	787,500
藤森工業	3,000	4,070.00	12,210,000
前澤化成工業	2,500	1,577.00	3,942,500
未来工業	1,400	3,625.00	5,075,000
ウェーブロックホールディングス	800	668.00	534,400
J S P	2,700	1,940.00	5,238,000
エフピコ	7,200	2,875.50	20,703,600
天馬	2,800	2,259.00	6,325,200
信越ポリマー	8,200	1,757.00	14,407,400

東リ	4,700	336.00	1,579,200
ニフコ	11,400	3,851.00	43,901,400
バルカー	3,200	4,415.00	14,128,000
ユニ・チャーム	79,500	5,058.00	402,111,000
ショーエイコーポレーション	700	601.00	420,700
協和キリン	46,100	2,353.50	108,496,350
武田薬品工業	337,900	4,340.00	1,466,486,000
アステラス製薬	334,900	1,701.00	569,664,900
住友ファーマ	28,300	459.00	12,989,700
塩野義製薬	48,100	7,157.00	344,251,700
わかもと製薬	2,200	216.00	475,200
日本新薬	10,000	5,268.00	52,680,000
中外製薬	119,500	5,455.00	651,872,500
科研製薬	6,500	3,497.00	22,730,500
エーザイ	46,400	6,951.00	322,526,400
ロート製薬	37,000	2,983.50	110,389,500
小野薬品工業	81,000	2,620.00	212,220,000
久光製薬	8,500	4,198.00	35,683,000
持田製薬	4,400	3,310.00	14,564,000
参天製薬	69,600	1,473.00	102,520,800
扶桑薬品工業	1,300	2,214.00	2,878,200
日本ケミファ	200	1,611.00	322,200
ツムラ	12,000	2,683.50	32,202,000
キッセイ薬品工業	6,300	3,200.00	20,160,000
生化学工業	6,500	769.00	4,998,500
栄研化学	7,000	1,755.00	12,285,000
鳥居薬品	2,000	3,800.00	7,600,000
JCRファーマ	12,900	1,121.00	14,460,900
東和薬品	5,900	2,514.00	14,832,600
富士製薬工業	2,800	1,923.00	5,384,400
ゼリア新薬工業	5,300	2,033.00	10,774,900
そーせいグループ	12,500	1,513.00	18,912,500
第一三共	332,600	4,300.00	1,430,180,000
杏林製薬	8,300	1,799.00	14,931,700
大幸薬品	7,900	309.00	2,441,100
ダイト	2,900	1,942.00	5,631,800
大塚ホールディングス	79,400	5,757.00	457,105,800
大正製薬ホールディングス	8,000	8,618.00	68,944,000
ペプチドリーム	18,500	1,347.00	24,919,500
セルソース	1,100	1,265.00	1,391,500
あすか製薬ホールディングス	3,900	1,993.00	7,772,700
サワイグループホールディングス	8,700	5,644.00	49,102,800
日本コークス工業	38,700	128.00	4,953,600

ニチレキ	5,000	2,505.00	12,525,000
ユシロ化学工業	2,000	1,860.00	3,720,000
ピーピー・カストロール	800	868.00	694,400
富士石油	11,100	369.00	4,095,900
MORESCO	800	1,482.00	1,185,600
出光興産	212,000	819.50	173,734,000
Eneosホールディングス	604,400	598.20	361,552,080
コスモエネルギーホールディングス	11,300	6,140.00	69,382,000
横浜ゴム	19,300	3,444.00	66,469,200
TOYO TIRE	21,900	2,387.00	52,275,300
ブリヂストン	111,700	6,282.00	701,699,400
住友ゴム工業	37,400	1,647.50	61,616,500
藤倉コンポジット	2,600	1,505.00	3,913,000
オカモト	1,800	5,070.00	9,126,000
フコク	2,000	1,460.00	2,920,000
ニッタ	3,900	3,800.00	14,820,000
住友理工	5,900	1,170.00	6,903,000
三ツ星ベルト	4,600	4,825.00	22,195,000
バンドー化学	5,700	1,760.00	10,032,000
日東紡績	4,800	4,940.00	23,712,000
AGC	34,000	5,425.00	184,450,000
日本板硝子	18,200	590.00	10,738,000
石塚硝子	400	3,325.00	1,330,000
日本山村硝子	800	1,407.00	1,125,600
日本電気硝子	15,600	3,176.00	49,545,600
オハラ	1,800	1,150.00	2,070,000
住友大阪セメント	6,400	3,672.00	23,500,800
太平洋セメント	22,600	2,973.50	67,201,100
日本ヒューム	3,300	909.00	2,999,700
日本コンクリート工業	7,400	462.00	3,418,800
三谷セキサン	1,600	5,090.00	8,144,000
アジアパイルホールディングス	5,400	744.00	4,017,600
東海カーボン	35,200	1,032.00	36,326,400
日本カーボン	2,000	4,465.00	8,930,000
東洋炭素	2,700	5,040.00	13,608,000
ノリタケカンパニーリミテド	2,100	7,620.00	16,002,000
TOTO	25,200	3,970.00	100,044,000
日本碍子	44,400	1,809.00	80,319,600
日本特殊陶業	32,000	3,936.00	125,952,000
ダントーホールディングス	1,400	1,250.00	1,750,000
MARUWA	1,400	29,590.00	41,426,000
品川リフラクトリーズ	4,700	1,949.00	9,160,300
黒崎播磨	800	12,270.00	9,816,000

ヨータイ	2,400	1,467.00	3,520,800
東京窯業	2,300	485.00	1,115,500
ニッカトー	1,000	584.00	584,000
フジインコーポレーテッド	10,300	3,055.00	31,466,500
クニミネ工業	600	1,048.00	628,800
エーアンドエーマテリアル	400	1,329.00	531,600
ニチアス	9,700	3,410.00	33,077,000
ニチハ	4,800	2,971.00	14,260,800
日本製鉄	175,800	3,479.00	611,608,200
神戸製鋼所	79,000	1,973.50	155,906,500
中山製鋼所	9,000	884.00	7,956,000
合同製鐵	2,200	4,940.00	10,868,000
J F E ホールディングス	109,200	2,295.00	250,614,000
東京製鐵	11,000	1,757.00	19,327,000
共英製鋼	4,500	2,097.00	9,436,500
大和工業	7,400	8,066.00	59,688,400
東京鐵鋼	1,700	4,455.00	7,573,500
大阪製鐵	1,800	2,330.00	4,194,000
淀川製鋼所	4,500	3,920.00	17,640,000
中部鋼鈹	2,600	2,427.00	6,310,200
丸一鋼管	12,000	3,804.00	45,648,000
モリ工業	700	4,700.00	3,290,000
大同特殊鋼	24,700	1,500.50	37,062,350
日本高周波鋼業	800	601.00	480,800
日本冶金工業	2,900	4,660.00	13,514,000
山陽特殊製鋼	3,900	2,525.00	9,847,500
愛知製鋼	2,300	3,420.00	7,866,000
日本金属	600	876.00	525,600
大平洋金属	3,300	1,274.00	4,204,200
新日本電工	19,500	289.00	5,635,500
栗本鐵工所	1,800	3,540.00	6,372,000
虹技	300	1,225.00	367,500
日本鑄鐵管	200	1,127.00	225,400
三菱製鋼	2,900	1,594.00	4,622,600
日亜鋼業	2,200	336.00	739,200
日本精線	600	5,120.00	3,072,000
エンビプロ・ホールディングス	2,100	619.00	1,299,900
シンニッタン	2,700	266.00	718,200
新家工業	500	3,040.00	1,520,000
大紀アルミニウム工業所	5,000	1,248.00	6,240,000
日本輕金属ホールディングス	11,500	1,846.00	21,229,000
三井金属鋳業	11,400	4,657.00	53,089,800
東邦亜鉛	2,500	1,160.00	2,900,000

三菱マテリアル	28,100	2,712.50	76,221,250
住友金属鉱山	45,500	4,138.00	188,279,000
DOWAホールディングス	9,700	5,277.00	51,186,900
古河機械金属	5,200	1,895.00	9,854,000
エス・サイエンス	12,400	22.00	272,800
大阪チタニウムテクノロジーズ	6,800	2,623.00	17,836,400
東邦チタニウム	8,100	1,796.00	14,547,600
UACJ	5,500	4,115.00	22,632,500
CKサンエツ	900	3,875.00	3,487,500
古河電気工業	13,100	2,616.50	34,276,150
住友電気工業	146,900	1,933.50	284,031,150
フジクラ	46,300	1,195.00	55,328,500
SWCC	4,400	2,965.00	13,046,000
タツタ電線	6,200	695.00	4,309,000
カナレ電気	400	1,742.00	696,800
平河ヒューテック	2,500	1,414.00	3,535,000
リョービ	4,200	2,672.00	11,222,400
アーレスティ	2,400	732.00	1,756,800
AREホールディングス	14,700	2,020.00	29,694,000
稲葉製作所	1,900	1,516.00	2,880,400
宮地エンジニアリンググループ	2,000	3,465.00	6,930,000
トーカロ	11,300	1,520.00	17,176,000
アルファCo	800	1,489.00	1,191,200
SUMCO	69,800	2,380.50	166,158,900
川田テクノロジーズ	900	7,180.00	6,462,000
RS Technologies	2,600	3,095.00	8,047,000
ジェイテックコーポレーション	300	2,321.00	696,300
信和	1,400	757.00	1,059,800
東洋製罐グループホールディングス	23,400	2,355.00	55,107,000
ホッカカンホールディングス	1,900	1,754.00	3,332,600
コロナ	2,200	961.00	2,114,200
横河ブリッジホールディングス	6,100	2,782.00	16,970,200
駒井ハルテック	400	2,117.00	846,800
高田機工	200	3,575.00	715,000
三和ホールディングス	39,500	2,309.50	91,225,250
文化シャッター	10,300	1,459.00	15,027,700
三協立山	4,500	887.00	3,991,500
アルインコ	3,000	1,046.00	3,138,000
東洋シャッター	500	692.00	346,000
LIXIL	61,300	1,967.00	120,577,100
日本フィルコン	1,400	575.00	805,000
ノーリツ	6,500	1,546.00	10,049,000
長府製作所	3,900	2,068.00	8,065,200

リンナイ	19,200	3,398.00	65,241,600
ダイニチ工業	1,100	704.00	774,400
日東精工	5,700	544.00	3,100,800
三洋工業	300	2,858.00	857,400
岡部	7,000	788.00	5,516,000
ジーテクト	5,000	1,815.00	9,075,000
東プレ	6,900	2,169.00	14,966,100
高周波熱錬	6,100	1,057.00	6,447,700
東京製綱	2,500	1,351.00	3,377,500
サンコール	3,100	475.00	1,472,500
モリテック スチール	1,900	289.00	549,100
パイオラックス	4,900	2,529.00	12,392,100
エイチワン	4,000	820.00	3,280,000
日本発條	34,700	1,218.00	42,264,600
中央発條	2,900	712.00	2,064,800
アドバネクス	300	943.00	282,900
立川ブラインド工業	1,800	1,443.00	2,597,400
三益半導体工業	3,000	3,435.00	10,305,000
日本ドライケミカル	500	2,814.00	1,407,000
日本製鋼所	10,600	2,431.50	25,773,900
三浦工業	16,100	2,770.00	44,597,000
タクマ	13,000	1,748.00	22,724,000
ツガミ	8,500	1,196.00	10,166,000
オークマ	3,400	6,568.00	22,331,200
芝浦機械	3,800	3,575.00	13,585,000
アマダ	61,300	1,591.50	97,558,950
アイダエンジニアリング	8,900	850.00	7,565,000
F U J I	18,100	2,521.00	45,630,100
牧野フライス製作所	4,300	6,050.00	26,015,000
オーエスジー	16,900	2,063.00	34,864,700
ダイジェット工業	200	837.00	167,400
旭ダイヤモンド工業	8,900	882.00	7,849,800
D M G 森精機	23,300	2,952.50	68,793,250
ソディック	9,400	731.00	6,871,400
ディスコ	18,500	41,480.00	767,380,000
日東工器	1,900	1,928.00	3,663,200
日進工具	3,600	1,045.00	3,762,000
パンチ工業	2,100	427.00	896,700
富士ダイス	2,000	695.00	1,390,000
豊和工業	1,200	758.00	909,600
石川製作所	500	1,113.00	556,500
リケンNPR	4,200	2,709.00	11,377,800
東洋機械金属	1,800	736.00	1,324,800

津田駒工業	400	410.00	164,000
エンシュウ	500	697.00	348,500
島精機製作所	6,100	1,525.00	9,302,500
オプトラン	6,300	1,763.00	11,106,900
NCホールディングス	500	1,600.00	800,000
イワキポンプ	2,600	2,173.00	5,649,800
フリー	3,600	1,353.00	4,870,800
ヤマシンフィルタ	9,200	342.00	3,146,400
日阪製作所	4,200	974.00	4,090,800
やまびこ	6,300	1,557.00	9,809,100
野村マイクロ・サイエンス	1,300	14,770.00	19,201,000
平田機工	1,800	6,870.00	12,366,000
P E G A S U S	4,200	449.00	1,885,800
マルマエ	1,700	2,000.00	3,400,000
タツモ	2,300	3,425.00	7,877,500
ナブテスコ	24,100	2,860.50	68,938,050
三井海洋開発	4,900	2,332.00	11,426,800
レオン自動機	4,400	1,527.00	6,718,800
S M C	11,500	83,310.00	958,065,000
ホソカワミクロン	2,500	4,730.00	11,825,000
ユニオンツール	1,700	3,425.00	5,822,500
瑞光	2,800	1,766.00	4,944,800
オイレス工業	5,200	2,128.00	11,065,600
日精エー・エス・ピー機械	1,500	4,320.00	6,480,000
サトーホールディングス	5,500	2,215.00	12,182,500
技研製作所	3,600	2,112.00	7,603,200
日本エアージェット	1,800	1,257.00	2,262,600
カワタ	700	1,125.00	787,500
日精樹脂工業	2,900	1,148.00	3,329,200
オカダアイヨン	700	2,596.00	1,817,200
ワイエイシイホールディングス	1,300	2,550.00	3,315,000
小松製作所	180,200	3,914.00	705,302,800
住友重機械工業	22,700	3,793.00	86,101,100
日立建機	15,300	4,096.00	62,668,800
日工	5,700	727.00	4,143,900
巴工業	1,500	3,705.00	5,557,500
井関農機	3,600	1,143.00	4,114,800
T O W A	4,300	8,110.00	34,873,000
丸山製作所	400	2,671.00	1,068,400
北川鉄工所	1,500	1,528.00	2,292,000
ローツェ	2,000	16,710.00	33,420,000
タカキタ	700	486.00	340,200
クボタ	201,700	2,220.00	447,774,000

荏原実業	2,000	3,045.00	6,090,000
三菱化工機	1,400	3,515.00	4,921,000
月島ホールディングス	5,200	1,364.00	7,092,800
帝国電機製作所	2,700	3,145.00	8,491,500
東京機械製作所	600	470.00	282,000
新東工業	7,800	1,116.00	8,704,800
澁谷工業	3,600	2,525.00	9,090,000
アイチ コーポレーション	5,400	1,080.00	5,832,000
小森コーポレーション	9,500	1,369.00	13,005,500
鶴見製作所	2,900	3,685.00	10,686,500
日本ギア工業	800	516.00	412,800
酒井重工業	500	6,970.00	3,485,000
荏原製作所	15,800	9,484.00	149,847,200
石井鐵工所	200	2,690.00	538,000
西島製作所	3,300	2,465.00	8,134,500
北越工業	3,900	2,705.00	10,549,500
ダイキン工業	45,900	24,000.00	1,101,600,000
オルガノ	4,600	6,290.00	28,934,000
トーヨーカネツ	1,300	4,240.00	5,512,000
栗田工業	21,500	5,520.00	118,680,000
椿本チエイン	5,400	4,210.00	22,734,000
大同工業	900	752.00	676,800
木村化工機	2,900	727.00	2,108,300
アネスト岩田	5,900	1,294.00	7,634,600
ダイフク	64,900	2,973.00	192,947,700
サムコ	1,000	4,770.00	4,770,000
加藤製作所	1,100	1,435.00	1,578,500
油研工業	400	2,262.00	904,800
タダノ	22,100	1,175.50	25,978,550
フジテック	9,000	3,708.00	33,372,000
C K D	10,600	2,691.00	28,524,600
平和	11,400	2,193.00	25,000,200
理想科学工業	3,100	2,815.00	8,726,500
S A N K Y O	8,800	9,280.00	81,664,000
日本金銭機械	4,600	1,588.00	7,304,800
マースグループホールディングス	1,900	2,749.00	5,223,100
フクシマガリレイ	2,500	5,190.00	12,975,000
オーイズミ	800	462.00	369,600
ダイコク電機	1,900	3,740.00	7,106,000
竹内製作所	7,000	4,645.00	32,515,000
アマノ	10,900	3,420.00	37,278,000
J U K I	6,000	451.00	2,706,000
サンデン	3,200	191.00	611,200

ジャノメ	3,900	701.00	2,733,900
マックス	5,400	3,325.00	17,955,000
グローリー	9,200	3,050.00	28,060,000
新晃工業	3,900	3,020.00	11,778,000
大和冷機工業	5,900	1,597.00	9,422,300
セガサミーホールディングス	34,300	2,160.00	74,088,000
T P R	4,900	2,018.00	9,888,200
ツバキ・ナカシマ	7,700	739.00	5,690,300
ホシザキ	22,700	5,340.00	121,218,000
大豊工業	3,300	839.00	2,768,700
日本精工	71,200	796.60	56,717,920
N T N	83,400	268.00	22,351,200
ジェイテクト	34,200	1,310.50	44,819,100
不二越	2,800	3,475.00	9,730,000
日本トムソン	10,500	592.00	6,216,000
T H K	22,200	2,888.50	64,124,700
ユーシン精機	3,000	672.00	2,016,000
前澤給装工業	2,900	1,313.00	3,807,700
イーグル工業	4,200	1,691.00	7,102,200
前澤工業	1,200	1,107.00	1,328,400
日本ピラー工業	3,600	5,020.00	18,072,000
キッツ	12,900	1,216.00	15,686,400
マキタ	43,800	3,982.00	174,411,600
三井E & S	19,100	737.00	14,076,700
日立造船	33,900	920.00	31,188,000
三菱重工業	67,200	9,618.00	646,329,600
I H I	28,600	2,803.00	80,165,800
サノヤスホールディングス	3,100	140.00	434,000
スター精密	7,200	1,801.00	12,967,200
日清紡ホールディングス	28,900	1,209.50	34,954,550
イビデン	20,000	7,886.00	157,720,000
コニカミノルタ	85,900	411.50	35,347,850
ブラザー工業	51,400	2,513.50	129,193,900
ミネベアミツミ	66,900	3,050.00	204,045,000
日立製作所	184,800	11,385.00	2,103,948,000
三菱電機	427,900	2,153.00	921,268,700
富士電機	23,400	7,419.00	173,604,600
東洋電機製造	700	1,109.00	776,300
安川電機	41,800	5,797.00	242,314,600
シンフォニアテクノロジー	4,200	2,340.00	9,828,000
明電舎	7,100	2,677.00	19,006,700
オリジン	500	1,225.00	612,500
山洋電気	1,700	6,540.00	11,118,000

デンヨー	2,900	2,319.00	6,725,100
PHCホールディングス	7,200	1,542.00	11,102,400
KOKUSAI ELECTRIC	14,800	3,915.00	57,942,000
ソシオネクスト	27,900	3,433.00	95,780,700
東芝テック	4,900	3,025.00	14,822,500
芝浦メカトロニクス	2,200	7,570.00	16,654,000
マブチモーター	18,900	2,507.50	47,391,750
ニデック	84,900	5,712.00	484,948,800
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	2,400	361.00	866,400
トレックス・セミコンダクター	2,000	1,868.00	3,736,000
東光高岳	2,300	2,151.00	4,947,300
ダブル・スコープ	11,000	797.00	8,767,000
ダイヘン	3,900	6,990.00	27,261,000
ヤーマン	6,600	1,000.00	6,600,000
JVCケンウッド	30,300	769.00	23,300,700
ミマキエンジニアリング	3,600	936.00	3,369,600
I - P E X	2,700	1,806.00	4,876,200
大崎電気工業	8,400	653.00	5,485,200
オムロン	29,400	6,798.00	199,861,200
日東工業	5,200	3,970.00	20,644,000
I D E C	5,700	3,045.00	17,356,500
正興電機製作所	700	1,076.00	753,200
不二電機工業	400	1,191.00	476,400
ジーエス・ユアサ コーポレーション	15,000	2,093.50	31,402,500
サクサホールディングス	500	2,587.00	1,293,500
メルコホールディングス	1,200	3,335.00	4,002,000
テクノメディカ	900	1,991.00	1,791,900
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	1,400	687.00	961,800
日本電気	50,500	9,380.00	473,690,000
富士通	35,400	20,935.00	741,099,000
沖電気工業	17,400	1,029.00	17,904,600
岩崎通信機	1,000	749.00	749,000
電気興業	1,700	2,338.00	3,974,600
サンケン電気	3,600	7,211.00	25,959,600
ナカヨ	300	1,172.00	351,600
アイホン	2,100	2,951.00	6,197,100
ルネサスエレクトロニクス	250,900	2,689.50	674,795,550
セイコーエプソン	49,300	2,204.00	108,657,200
ワコム	29,200	676.00	19,739,200
アルバック	9,100	7,516.00	68,395,600
アクセル	1,300	2,261.00	2,939,300
E I Z O	2,800	5,170.00	14,476,000
ジャパンディスプレイ	165,700	22.00	3,645,400

日本信号	8,800	939.00	8,263,200
京三製作所	8,100	464.00	3,758,400
能美防災	5,200	2,260.00	11,752,000
ホーチキ	2,900	1,984.00	5,753,600
星和電機	900	481.00	432,900
エレコム	9,200	1,768.00	16,265,600
パナソニック ホールディングス	454,100	1,373.50	623,706,350
シャープ	64,800	1,033.50	66,970,800
アンリツ	27,100	1,365.00	36,991,500
富士通ゼネラル	10,900	2,212.00	24,110,800
ソニーグループ	269,200	14,355.00	3,864,366,000
T D K	60,900	7,366.00	448,589,400
帝国通信工業	1,700	2,060.00	3,502,000
タムラ製作所	15,300	547.00	8,369,100
アルプスアルパイン	34,300	1,273.50	43,681,050
池上通信機	700	912.00	638,400
日本電波工業	4,600	1,263.00	5,809,800
鈴木	2,100	1,183.00	2,484,300
メイコー	3,800	4,295.00	16,321,000
日本トリム	900	3,125.00	2,812,500
ローランド ディー . ジー .	2,100	3,830.00	8,043,000
フォスター電機	2,800	1,119.00	3,133,200
S M K	1,000	2,556.00	2,556,000
ヨコオ	3,400	1,484.00	5,045,600
ティアック	3,300	98.00	323,400
ホシデン	8,700	1,773.00	15,425,100
ヒロセ電機	5,700	17,645.00	100,576,500
日本航空電子工業	9,200	3,110.00	28,612,000
T O A	4,400	1,107.00	4,870,800
マクセル	8,500	1,623.00	13,795,500
古野電気	5,000	2,048.00	10,240,000
スミダコーポレーション	5,100	1,185.00	6,043,500
アイコム	1,500	3,670.00	5,505,000
リオン	1,600	2,421.00	3,873,600
横河電機	42,100	2,963.50	124,763,350
新電元工業	1,500	3,175.00	4,762,500
アズビル	26,200	4,857.00	127,253,400
東亜ディーケーケー	1,000	950.00	950,000
日本光電工業	16,300	4,534.00	73,904,200
チノー	1,600	2,373.00	3,796,800
共和電業	2,000	433.00	866,000
日本電子材料	2,300	1,892.00	4,351,600
堀場製作所	7,300	12,185.00	88,950,500

アドバンテスト	109,100	6,049.00	659,945,900
小野測器	900	475.00	427,500
エスベック	3,000	2,592.00	7,776,000
キーエンス	38,100	65,950.00	2,512,695,000
日置電機	1,800	6,350.00	11,430,000
シスメックス	32,800	7,966.00	261,284,800
日本マイクロニクス	6,800	4,370.00	29,716,000
メガチップス	3,000	5,080.00	15,240,000
O B A R A G R O U P	2,100	4,070.00	8,547,000
澤藤電機	200	1,272.00	254,400
原田工業	900	757.00	681,300
コーセル	4,600	1,499.00	6,895,400
イリソ電子工業	3,500	3,495.00	12,232,500
オブテックスグループ	7,000	1,806.00	12,642,000
千代田インテグレ	1,500	2,812.00	4,218,000
レーザーテック	17,400	41,530.00	722,622,000
スタンレー電気	24,400	2,815.50	68,698,200
ウシオ電機	19,300	2,130.00	41,109,000
岡谷電機産業	1,600	287.00	459,200
ヘリオス テクノ ホールディング	2,100	546.00	1,146,600
エノモト	600	1,624.00	974,400
日本セラミック	3,100	2,697.00	8,360,700
遠藤照明	900	1,433.00	1,289,700
古河電池	2,800	894.00	2,503,200
双信電機	800	310.00	248,000
山一電機	3,400	2,223.00	7,558,200
図研	3,300	4,065.00	13,414,500
日本電子	9,500	7,322.00	69,559,000
カシオ計算機	27,500	1,281.00	35,227,500
ファナック	185,600	4,316.00	801,049,600
日本シイエムケイ	8,100	748.00	6,058,800
エンプラス	1,100	13,060.00	14,366,000
大真空	5,700	911.00	5,192,700
ローム	70,400	2,678.50	188,566,400
浜松ホトニクス	30,500	6,017.00	183,518,500
三井ハイテック	3,400	7,020.00	23,868,000
新光電気工業	12,600	5,553.00	69,967,800
京セラ	236,500	2,217.50	524,438,750
太陽誘電	18,500	3,695.00	68,357,500
村田製作所	346,300	3,061.00	1,060,024,300
双葉電子工業	7,200	533.00	3,837,600
北陸電気工業	800	1,421.00	1,136,800
ニチコン	10,000	1,298.00	12,980,000

日本ケミコン	4,000	1,386.00	5,544,000
K O A	5,800	1,578.00	9,152,400
市光工業	6,900	583.00	4,022,700
小糸製作所	39,400	2,282.50	89,930,500
ミツバ	7,100	1,105.00	7,845,500
S C R E E Nホールディングス	13,000	14,820.00	192,660,000
キャノン電子	4,200	2,027.00	8,513,400
キャノン	189,800	3,769.00	715,356,200
リコー	95,400	1,174.00	111,999,600
象印マホービン	10,300	1,483.00	15,274,900
M U T O Hホールディングス	300	2,174.00	652,200
東京エレクトロン	80,600	28,655.00	2,309,593,000
イノテック	2,500	1,860.00	4,650,000
トヨタ紡織	16,000	2,447.50	39,160,000
芦森工業	400	2,200.00	880,000
ユニプレス	6,800	1,030.00	7,004,000
豊田自動織機	32,500	12,770.00	415,025,000
モリタホールディングス	6,700	1,564.00	10,478,800
三櫻工業	5,800	836.00	4,848,800
デンソー	314,000	2,323.50	729,579,000
東海理化電機製作所	10,700	2,306.00	24,674,200
川崎重工業	31,100	3,263.00	101,479,300
名村造船所	8,300	1,370.00	11,371,000
日本車輛製造	1,300	2,130.00	2,769,000
三菱ロジスネクスト	6,100	1,511.00	9,217,100
近畿車輛	300	1,916.00	574,800
日産自動車	540,700	575.80	311,335,060
いすゞ自動車	110,700	2,063.50	228,429,450
トヨタ自動車	2,090,000	2,964.00	6,194,760,000
日野自動車	57,200	499.60	28,577,120
三菱自動車工業	148,500	461.20	68,488,200
エフテック	1,500	649.00	973,500
レシップホールディングス	900	656.00	590,400
G M B	400	1,253.00	501,200
ファルテック	400	550.00	220,000
武蔵精密工業	9,300	1,689.00	15,707,700
日産車体	4,500	993.00	4,468,500
新明和工業	11,000	1,234.00	13,574,000
極東開発工業	6,300	2,005.00	12,631,500
トビー工業	3,100	2,858.00	8,859,800
ティラド	800	3,635.00	2,908,000
曙ブレーキ工業	23,200	116.00	2,691,200
タチエス	7,000	1,967.00	13,769,000

N O K	14,800	1,948.00	28,830,400
フタバ産業	10,200	903.00	9,210,600
カヤバ	3,700	5,130.00	18,981,000
大同メタル工業	7,400	546.00	4,040,400
プレス工業	15,200	643.00	9,773,600
ミクニ	2,700	482.00	1,301,400
太平洋工業	8,700	1,434.00	12,475,800
河西工業	3,400	187.00	635,800
アイシン	29,400	5,475.00	160,965,000
マツダ	125,900	1,721.50	216,736,850
今仙電機製作所	1,300	634.00	824,200
本田技研工業	928,200	1,593.50	1,479,086,700
スズキ	69,900	6,403.00	447,569,700
S U B A R U	118,000	2,910.50	343,439,000
安永	900	662.00	595,800
ヤマハ発動機	164,500	1,421.50	233,836,750
T B K	2,300	400.00	920,000
エクセディ	6,200	2,815.00	17,453,000
豊田合成	11,100	2,840.00	31,524,000
愛三工業	6,300	1,375.00	8,662,500
盟和産業	300	1,021.00	306,300
日本プラスト	1,800	557.00	1,002,600
ヨロズ	3,600	919.00	3,308,400
エフ・シー・シー	6,700	1,928.00	12,917,600
シマノ	15,500	21,695.00	336,272,500
テイ・エス テック	13,600	1,845.50	25,098,800
ジャムコ	1,600	1,633.00	2,612,800
テルモ	106,400	4,998.00	531,787,200
クリエートメディック	700	899.00	629,300
日機装	8,900	1,073.00	9,549,700
日本エム・ディ・エム	3,000	778.00	2,334,000
島津製作所	50,600	4,128.00	208,876,800
J M S	3,500	527.00	1,844,500
クボテック	600	258.00	154,800
長野計器	2,800	2,286.00	6,400,800
ブイ・テクノロジ	2,000	2,866.00	5,732,000
東京計器	2,900	1,879.00	5,449,100
愛知時計電機	1,600	2,748.00	4,396,800
インターアクション	1,800	1,136.00	2,044,800
オーバル	1,900	558.00	1,060,200
東京精密	7,800	10,150.00	79,170,000
マニー	15,200	2,082.50	31,654,000
ニコン	55,000	1,503.00	82,665,000

トプコン	18,500	1,625.50	30,071,750
オリンパス	234,300	2,196.50	514,639,950
理研計器	2,700	7,460.00	20,142,000
タムロン	2,300	5,640.00	12,972,000
H O Y A	74,900	18,740.00	1,403,626,000
シード	1,100	795.00	874,500
ノーリツ鋼機	3,600	3,370.00	12,132,000
A & D ホロンホールディングス	5,500	2,062.00	11,341,000
朝日インテック	42,500	2,942.00	125,035,000
シチズン時計	35,000	928.00	32,480,000
リズム	500	2,981.00	1,490,500
大研医器	1,800	524.00	943,200
メニコン	13,100	2,260.50	29,612,550
シンシア	200	529.00	105,800
松風	1,700	2,888.00	4,909,600
セイコーグループ	5,300	2,628.00	13,928,400
ニプロ	31,700	1,198.00	37,976,600
K Y O R I T S U	3,200	188.00	601,600
中本ボックス	700	1,720.00	1,204,000
スノーピーク	5,400	889.00	4,800,600
パラマウントベッドホールディングス	7,900	2,706.00	21,377,400
トランザクション	2,500	2,337.00	5,842,500
粧美堂	600	673.00	403,800
ニホンフラッシュ	3,600	938.00	3,376,800
前田工織	3,200	3,165.00	10,128,000
永大産業	2,500	232.00	580,000
アートネイチャー	3,400	806.00	2,740,400
バンダイナムコホールディングス	104,300	3,111.00	324,477,300
アイフィスジャパン	600	608.00	364,800
S H O E I	8,600	2,004.00	17,234,400
フランスベッドホールディングス	4,900	1,395.00	6,835,500
パイロットコーポレーション	5,400	4,137.00	22,339,800
萩原工業	2,500	1,488.00	3,720,000
フジシールインターナショナル	7,700	1,769.00	13,621,300
タカラトミー	17,300	2,508.50	43,397,050
広済堂ホールディングス	8,600	821.00	7,060,600
エステールホールディングス	500	639.00	319,500
タカノ	800	1,033.00	826,400
プロネクサス	3,900	1,308.00	5,101,200
ホクシン	1,500	113.00	169,500
ウッドワン	800	1,045.00	836,000
T O P P A Nホールディングス	46,800	4,151.00	194,266,800
大日本印刷	41,600	4,243.00	176,508,800

共同印刷	1,100	3,365.00	3,701,500
N I S S H A	6,500	1,612.00	10,478,000
光村印刷	200	1,544.00	308,800
T A K A R A & C O M P A N Y	2,400	2,855.00	6,852,000
アシックス	32,400	4,494.00	145,605,600
ツツミ	900	2,170.00	1,953,000
ローランド	2,800	4,940.00	13,832,000
小松ウオール工業	1,600	3,180.00	5,088,000
ヤマハ	24,000	3,300.00	79,200,000
河合楽器製作所	1,200	3,720.00	4,464,000
クリナップ	3,700	736.00	2,723,200
ピジョン	24,200	1,621.00	39,228,200
キングジム	3,400	875.00	2,975,000
リンテック	7,600	2,813.00	21,378,800
イトーキ	7,800	1,506.00	11,746,800
任天堂	240,300	7,972.00	1,915,671,600
三菱鉛筆	5,400	2,065.00	11,151,000
タカラスタANDARD	8,000	1,754.00	14,032,000
コクヨ	15,600	2,396.50	37,385,400
ナカバヤシ	4,100	547.00	2,242,700
グローブライド	3,400	2,112.00	7,180,800
オカムラ	11,500	2,259.00	25,978,500
美津濃	3,800	4,380.00	16,644,000
東京電力ホールディングス	343,100	787.40	270,156,940
中部電力	140,300	1,882.50	264,114,750
関西電力	147,000	1,959.50	288,046,500
中国電力	66,100	1,035.50	68,446,550
北陸電力	38,900	721.80	28,078,020
東北電力	100,200	986.40	98,837,280
四国電力	35,400	1,064.50	37,683,300
九州電力	87,700	1,087.50	95,373,750
北海道電力	36,800	657.50	24,196,000
沖縄電力	9,700	1,161.00	11,261,700
電源開発	31,300	2,435.00	76,215,500
エフオン	2,500	445.00	1,112,500
イーレックス	6,800	760.00	5,168,000
レノバ	10,100	1,192.00	12,039,200
東京瓦斯	80,500	3,297.00	265,408,500
大阪瓦斯	77,100	3,039.00	234,306,900
東邦瓦斯	16,500	2,991.00	49,351,500
北海道瓦斯	2,300	2,284.00	5,253,200
広島ガス	8,000	394.00	3,152,000
西部ガスホールディングス	4,000	1,935.00	7,740,000

静岡ガス	7,600	1,012.00	7,691,200
メタウォーター	4,600	2,181.00	10,032,600
SBSホールディングス	3,400	2,528.00	8,595,200
東武鉄道	41,800	3,950.00	165,110,000
相鉄ホールディングス	13,600	2,771.00	37,685,600
東急	106,700	1,734.50	185,071,150
京浜急行電鉄	47,100	1,293.50	60,923,850
小田急電鉄	62,900	2,273.50	143,003,150
京王電鉄	18,300	4,364.00	79,861,200
京成電鉄	24,500	6,778.00	166,061,000
富士急行	4,700	4,485.00	21,079,500
東日本旅客鉄道	69,900	8,426.00	588,977,400
西日本旅客鉄道	45,200	6,081.00	274,861,200
東海旅客鉄道	146,600	3,644.00	534,210,400
西武ホールディングス	46,000	2,075.00	95,450,000
鴻池運輸	6,500	1,960.00	12,740,000
西日本鉄道	10,200	2,480.50	25,301,100
ハマキョウレックス	3,200	4,150.00	13,280,000
サカイ引越センター	4,200	2,805.00	11,781,000
近鉄グループホールディングス	38,000	4,594.00	174,572,000
阪急阪神ホールディングス	50,700	4,514.00	228,859,800
南海電気鉄道	16,900	2,848.00	48,131,200
京阪ホールディングス	20,900	3,635.00	75,971,500
神戸電鉄	1,000	2,891.00	2,891,000
名古屋鉄道	39,200	2,263.50	88,729,200
山陽電気鉄道	2,900	2,181.00	6,324,900
アルプス物流	3,000	1,825.00	5,475,000
ヤマトホールディングス	48,700	2,589.00	126,084,300
山九	9,700	5,183.00	50,275,100
丸運	1,200	279.00	334,800
丸全昭和運輸	2,300	4,070.00	9,361,000
センコーグループホールディングス	20,100	1,146.00	23,034,600
トナミホールディングス	800	4,795.00	3,836,000
ニッコンホールディングス	12,200	3,118.00	38,039,600
日本石油輸送	200	2,910.00	582,000
福山通運	4,300	4,125.00	17,737,500
セイノーホールディングス	21,400	2,149.00	45,988,600
エスライングループ本社	600	886.00	531,600
神奈川中央交通	1,100	3,050.00	3,355,000
AZ-COM丸和ホールディングス	9,700	1,580.00	15,326,000
C&Fロジホールディングス	3,700	1,726.00	6,386,200
九州旅客鉄道	26,900	3,198.00	86,026,200
SGホールディングス	63,800	1,985.50	126,674,900

NIPPON EXPRESSホールディングス	12,900	8,686.00	112,049,400
日本郵船	108,900	5,108.00	556,261,200
商船三井	82,500	5,232.00	431,640,000
川崎汽船	32,100	7,254.00	232,853,400
NSユナイテッド海運	2,000	5,240.00	10,480,000
明海グループ	2,300	810.00	1,863,000
飯野海運	14,000	1,291.00	18,074,000
共栄タンカー	400	937.00	374,800
乾汽船	4,500	1,127.00	5,071,500
日本航空	93,300	2,838.50	264,832,050
ANAホールディングス	103,400	3,191.00	329,949,400
パスコ	400	1,834.00	733,600
トランコム	1,100	7,190.00	7,909,000
日新	2,900	2,752.00	7,980,800
三菱倉庫	9,300	4,534.00	42,166,200
三井倉庫ホールディングス	3,600	5,000.00	18,000,000
住友倉庫	10,200	2,642.00	26,948,400
澁澤倉庫	1,700	3,155.00	5,363,500
東陽倉庫	600	1,546.00	927,600
日本トランスシティ	7,600	642.00	4,879,200
ケイヒン	400	1,866.00	746,400
中央倉庫	2,000	1,168.00	2,336,000
川西倉庫	400	1,134.00	453,600
安田倉庫	2,600	1,223.00	3,179,800
ファイズホールディングス	300	1,227.00	368,100
東洋埠頭	600	1,393.00	835,800
上組	17,500	3,427.00	59,972,500
サンリツ	500	775.00	387,500
キムラユニティー	1,000	1,476.00	1,476,000
キューソー流通システム	1,500	944.00	1,416,000
東海運	1,200	292.00	350,400
エーアイティー	2,400	1,801.00	4,322,400
内外トランスライン	1,500	2,454.00	3,681,000
日本コンセプト	1,400	1,758.00	2,461,200
NEC ネットズエスアイ	14,900	2,263.00	33,718,700
クロスキャット	2,400	1,170.00	2,808,000
システナ	57,800	306.00	17,686,800
デジタルアーツ	2,400	5,140.00	12,336,000
日鉄ソリューションズ	6,500	4,910.00	31,915,000
キューブシステム	2,000	1,127.00	2,254,000
コア	1,700	1,818.00	3,090,600
手間いらず	600	2,937.00	1,762,200
ラクーンホールディングス	3,200	682.00	2,182,400

ソリトンシステムズ	2,000	1,449.00	2,898,000
ソフトクリエイトホールディングス	3,100	1,769.00	5,483,900
T I S	41,800	3,317.00	138,650,600
テクミラホールディングス	1,000	432.00	432,000
グリー	10,200	589.00	6,007,800
G M Oペパボ	500	1,194.00	597,000
コーエーテクモホールディングス	23,900	1,809.50	43,247,050
三菱総合研究所	1,900	4,855.00	9,224,500
ボルテージ	600	271.00	162,600
電算	200	1,504.00	300,800
A G S	900	844.00	759,600
ファインデックス	3,000	1,041.00	3,123,000
ブレインパッド	2,900	1,232.00	3,572,800
K L a b	7,000	286.00	2,002,000
ポルトウウィンホールディングス	6,500	542.00	3,523,000
ネクソン	85,400	2,420.00	206,668,000
アイスタイル	11,300	427.00	4,825,100
エムアップホールディングス	4,700	1,019.00	4,789,300
エイチーム	2,300	587.00	1,350,100
エニグモ	4,900	368.00	1,803,200
テクノスジャパン	1,900	637.00	1,210,300
e n i s h	2,100	178.00	373,800
コロプラ	14,800	620.00	9,176,000
オルトプラス	1,700	146.00	248,200
ブロードリーフ	18,100	606.00	10,968,600
クロス・マーケティンググループ	1,300	580.00	754,000
デジタルハーツホールディングス	2,400	1,016.00	2,438,400
メディアドゥ	1,700	1,392.00	2,366,400
じげん	11,100	532.00	5,905,200
ブイキューブ	4,600	314.00	1,444,400
エンカレッジ・テクノロジー	500	606.00	303,000
サイバーリンクス	800	810.00	648,000
ディー・エル・イー	1,500	199.00	298,500
フィックスターズ	4,300	1,708.00	7,344,400
C A R T A H O L D I N G S	1,800	1,510.00	2,718,000
オブティム	3,900	963.00	3,755,700
セレス	1,500	1,129.00	1,693,500
S H I F T	2,500	26,740.00	66,850,000
ティーガイア	4,000	1,994.00	7,976,000
セック	400	5,350.00	2,140,000
テクマトリックス	7,000	1,675.00	11,725,000
プロシップ	1,800	1,401.00	2,521,800
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	9,900	2,472.50	24,477,750

GMOペイメントゲートウェイ	7,600	8,796.00	66,849,600
ザッパラス	600	444.00	266,400
システムリサーチ	1,300	3,005.00	3,906,500
インターネットイニシアティブ	18,200	3,058.00	55,655,600
さくらインターネット	4,300	3,990.00	17,157,000
GMOグローバルサイン・ホールディングス	1,200	2,835.00	3,402,000
SRAホールディングス	2,000	3,800.00	7,600,000
システムインテグレータ	600	431.00	258,600
朝日ネット	4,100	627.00	2,570,700
eBASE	5,400	727.00	3,925,800
アバントグループ	4,800	1,460.00	7,008,000
アドソル日進	1,600	1,596.00	2,553,600
ODKソリューションズ	400	600.00	240,000
フリービット	2,000	1,533.00	3,066,000
コムチュア	5,500	1,851.00	10,180,500
アステリア	3,000	615.00	1,845,000
アイル	1,800	3,190.00	5,742,000
マークラインズ	2,100	3,035.00	6,373,500
メディカル・データ・ビジョン	4,600	653.00	3,003,800
gumi	5,600	405.00	2,268,000
ショーケース	500	322.00	161,000
モバイルファクトリー	400	655.00	262,000
テラスカイ	1,600	1,521.00	2,433,600
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	2,200	1,665.00	3,663,000
PCIホールディングス	800	1,016.00	812,800
アイビーシー	300	495.00	148,500
ネオジャパン	1,300	1,071.00	1,392,300
PR TIMES	800	2,153.00	1,722,400
ラクス	18,100	2,434.00	44,055,400
ランドコンピュータ	1,000	940.00	940,000
ダブルスタンダード	1,200	1,679.00	2,014,800
オープンドア	2,200	872.00	1,918,400
マイネット	700	289.00	202,300
アカツキ	1,800	2,742.00	4,935,600
ベネフィットジャパン	100	1,236.00	123,600
Ubicomホールディングス	1,200	1,535.00	1,842,000
カナミックネットワーク	4,100	422.00	1,730,200
ノムラシステムコーポレーション	2,200	115.00	253,000
チェンジホールディングス	8,300	1,416.00	11,752,800
シンクロ・フード	1,300	691.00	898,300
オークネット	1,400	2,066.00	2,892,400
キャピタル・アセット・プランニング	400	764.00	305,600
セグエグループ	700	915.00	640,500

エイトレッド	300	1,430.00	429,000
マクロミル	7,500	793.00	5,947,500
ピーグリー	400	1,317.00	526,800
オロ	1,400	2,930.00	4,102,000
ユーザーローカル	1,400	2,136.00	2,990,400
テモナ	500	258.00	129,000
ニーズウェル	1,200	807.00	968,400
マネーフォワード	8,500	5,498.00	46,733,000
サインポスト	800	559.00	447,200
Sun Asterisk	2,700	1,003.00	2,708,100
プラスアルファ・コンサルティング	2,300	2,656.00	6,108,800
電算システムホールディングス	1,700	2,958.00	5,028,600
Appier Group	13,000	1,813.00	23,569,000
ソルクシーズ	1,700	405.00	688,500
フェイス	600	481.00	288,600
プロトコーポレーション	4,200	1,299.00	5,455,800
ハイマックス	1,200	1,410.00	1,692,000
野村総合研究所	84,600	4,359.00	368,771,400
CEホールディングス	1,100	638.00	701,800
日本システム技術	1,200	3,430.00	4,116,000
インテージホールディングス	4,300	1,701.00	7,314,300
東邦システムサイエンス	1,200	1,320.00	1,584,000
ソースネクスト	17,500	155.00	2,712,500
インフォコム	4,900	2,569.00	12,588,100
シンプレクス・ホールディングス	5,700	2,920.00	16,644,000
HEROZ	1,300	1,715.00	2,229,500
ラクスル	9,200	1,212.00	11,150,400
メルカリ	23,200	2,453.50	56,921,200
I P S	1,100	1,965.00	2,161,500
F I G	2,500	319.00	797,500
システムサポート	1,500	2,020.00	3,030,000
イーソル	2,700	594.00	1,603,800
東海ソフト	300	1,167.00	350,100
ウイングアーク1st	4,000	2,831.00	11,324,000
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	1,000	1,200.00	1,200,000
サーバーワークス	800	3,965.00	3,172,000
東名	200	2,261.00	452,200
ヴィッツ	200	840.00	168,000
トビラシステムズ	600	887.00	532,200
Sansan	12,500	1,385.00	17,312,500
Link-U	500	669.00	334,500
ギフトィ	3,300	1,690.00	5,577,000
メドレー	5,100	4,625.00	23,587,500

ベース	1,300	3,340.00	4,342,000
J M D C	6,500	4,084.00	26,546,000
フォーカスシステムズ	2,600	1,054.00	2,740,400
クレスコ	3,100	1,914.00	5,933,400
フジ・メディア・ホールディングス	36,700	1,750.50	64,243,350
オービック	12,800	23,180.00	296,704,000
ジャストシステム	5,500	3,260.00	17,930,000
T D C ソフト	3,600	2,240.00	8,064,000
L I N E ヤフー	543,400	472.20	256,593,480
トレンドマイクロ	18,000	8,250.00	148,500,000
I D ホールディングス	2,600	1,750.00	4,550,000
日本オラクル	7,300	12,030.00	87,819,000
アルファシステムズ	1,000	3,110.00	3,110,000
フューチャー	8,100	1,787.00	14,474,700
C A C H o l d i n g s	2,000	1,778.00	3,556,000
S B テクノロジー	1,600	2,491.00	3,985,600
トーセ	600	710.00	426,000
オービックビジネスコンサルタント	5,400	6,933.00	37,438,200
アイティフォー	4,900	1,225.00	6,002,500
東計電算	1,100	3,570.00	3,927,000
エクスネット	300	1,123.00	336,900
大塚商会	18,900	6,161.00	116,442,900
サイボウズ	5,300	2,165.00	11,474,500
電通総研	4,600	5,810.00	26,726,000
A C C E S S	4,000	771.00	3,084,000
デジタルガレージ	6,100	3,545.00	21,624,500
E M システムズ	6,400	694.00	4,441,600
ウェザーニューズ	1,200	5,450.00	6,540,000
C I J	6,300	675.00	4,252,500
ビジネスエンジニアリング	600	4,655.00	2,793,000
日本エンタープライズ	2,100	126.00	264,600
WOWOW	2,900	1,137.00	3,297,300
スカラ	3,500	759.00	2,656,500
インテリジェント ウェイブ	1,100	1,053.00	1,158,300
A N Y C O L O R	1,300	3,775.00	4,907,500
I M A G I C A G R O U P	3,800	627.00	2,382,600
ネットワンシステムズ	15,400	2,390.00	36,806,000
システムソフト	13,300	61.00	811,300
アルゴグラフィックス	3,500	3,900.00	13,650,000
マーベラス	6,200	758.00	4,699,600
エイベックス	6,500	1,410.00	9,165,000
B I P R O G Y	12,500	4,325.00	54,062,500
都築電気	2,000	2,206.00	4,412,000

TBSホールディングス	19,200	3,584.00	68,812,800
日本テレビホールディングス	33,800	1,739.00	58,778,200
朝日放送グループホールディングス	3,600	674.00	2,426,400
テレビ朝日ホールディングス	9,300	1,775.00	16,507,500
スカパーJ S A Tホールディングス	29,600	767.00	22,703,200
テレビ東京ホールディングス	2,700	3,140.00	8,478,000
日本BS放送	800	902.00	721,600
ビジョン	5,800	1,196.00	6,936,800
スマートバリュー	500	410.00	205,000
USEN-NEXT HOLDINGS	4,300	4,400.00	18,920,000
ワイヤレスゲート	900	302.00	271,800
日本通信	37,600	231.00	8,685,600
クロップス	300	1,150.00	345,000
日本電信電話	11,355,400	186.30	2,115,511,020
KDDI	295,000	4,903.00	1,446,385,000
ソフトバンク	614,300	1,966.00	1,207,713,800
光通信	3,800	25,795.00	98,021,000
エムティーアイ	2,600	600.00	1,560,000
GMOインターネットグループ	14,100	2,678.50	37,766,850
ファイバーゲート	2,100	962.00	2,020,200
アйдママーケティングコミュニケーション	600	236.00	141,600
KADOKAWA	20,200	3,156.00	63,751,200
学研ホールディングス	6,400	1,041.00	6,662,400
ゼンリン	6,500	877.00	5,700,500
昭文社ホールディングス	900	357.00	321,300
インプレスホールディングス	2,100	175.00	367,500
アイネット	2,300	1,998.00	4,595,400
松竹	2,000	9,616.00	19,232,000
東宝	21,200	4,782.00	101,378,400
東映	1,300	20,600.00	26,780,000
NTTデータグループ	99,800	2,129.50	212,524,100
ピー・シー・エー	2,200	1,242.00	2,732,400
ビジネスブレイン太田昭和	1,500	2,237.00	3,355,500
DTS	8,000	3,620.00	28,960,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	17,400	5,807.00	101,041,800
シーイーシー	4,800	1,731.00	8,308,800
カブコン	34,100	5,573.00	190,039,300
アイ・エス・ビー	2,000	1,572.00	3,144,000
ジャステック	2,300	1,387.00	3,190,100
SCSK	26,700	2,895.00	77,296,500
NSW	1,700	2,910.00	4,947,000
アイネス	3,000	1,614.00	4,842,000
TKC	6,100	3,820.00	23,302,000

富士ソフト	7,700	6,450.00	49,665,000
N S D	13,600	2,778.00	37,780,800
コナミグループ	14,300	8,853.00	126,597,900
福井コンピュータホールディングス	2,400	2,629.00	6,309,600
J B C Cホールディングス	2,500	4,230.00	10,575,000
ミロク情報サービス	3,500	1,847.00	6,464,500
ソフトバンクグループ	188,300	6,667.00	1,255,396,100
高千穂交易	1,100	4,215.00	4,636,500
オルバヘルスケアホールディングス	300	1,841.00	552,300
伊藤忠食品	900	7,500.00	6,750,000
エレマテック	3,600	1,879.00	6,764,400
あらた	6,200	3,245.00	20,119,000
トーメンデバイス	600	5,410.00	3,246,000
東京エレクトロン デバイス	4,000	6,290.00	25,160,000
円谷フィールズホールディングス	6,900	1,774.00	12,240,600
双日	44,800	3,469.00	155,411,200
アルフレッサ ホールディングス	40,400	2,416.00	97,606,400
横浜冷凍	11,000	1,101.00	12,111,000
神栄	300	1,816.00	544,800
ラサ商事	1,400	1,649.00	2,308,600
アルコニックス	5,300	1,395.00	7,393,500
神戸物産	31,200	3,860.00	120,432,000
ハイパー	500	307.00	153,500
あい ホールディングス	6,400	2,519.00	16,121,600
ディーブイエックス	600	1,080.00	648,000
ダイワボウホールディングス	17,800	3,239.00	57,654,200
マクニカホールディングス	9,500	8,347.00	79,296,500
ラクト・ジャパン	1,600	2,186.00	3,497,600
グリムス	1,700	2,113.00	3,592,100
バイタルケーエスケー・ホールディングス	6,100	1,144.00	6,978,400
八洲電機	3,300	1,343.00	4,431,900
メディアスホールディングス	2,600	760.00	1,976,000
レスターホールディングス	3,400	3,105.00	10,557,000
ジオリーブグループ	500	1,374.00	687,000
大光	900	624.00	561,600
O C H Iホールディングス	500	1,569.00	784,500
T O K A Iホールディングス	21,900	984.00	21,549,600
黒谷	600	605.00	363,000
C o m i n i x	400	820.00	328,000
三洋貿易	4,500	1,246.00	5,607,000
ビューティガレージ	1,300	2,199.00	2,858,700
ウイン・パートナーズ	2,600	1,240.00	3,224,000
ミタチ産業	600	1,164.00	698,400

シップヘルスケアホールディングス	14,500	2,316.00	33,582,000
明治電機工業	1,500	1,448.00	2,172,000
デリカフーズホールディングス	1,000	590.00	590,000
スターティアホールディングス	600	1,485.00	891,000
コメダホールディングス	9,900	2,782.00	27,541,800
ピーバンドットコム	300	386.00	115,800
アセンテック	1,500	584.00	876,000
富士興産	600	1,998.00	1,198,800
協栄産業	200	2,838.00	567,600
フルサト・マルカホールディングス	3,600	2,451.00	8,823,600
ヤマエグループホールディングス	2,300	3,275.00	7,532,500
小野建	4,000	1,825.00	7,300,000
南陽	500	2,192.00	1,096,000
佐島電機	2,000	2,461.00	4,922,000
エコートレーディング	400	1,202.00	480,800
伯東	2,300	6,120.00	14,076,000
コンドーテック	3,100	1,246.00	3,862,600
中山福	1,200	375.00	450,000
ナガイレーベン	5,100	2,396.00	12,219,600
三菱食品	3,700	5,030.00	18,611,000
松田産業	3,100	2,705.00	8,385,500
第一興商	15,600	2,068.00	32,260,800
メディバルホールディングス	41,700	2,295.00	95,701,500
S P K	1,800	2,001.00	3,601,800
萩原電気ホールディングス	1,700	5,120.00	8,704,000
アズワン	6,300	5,558.00	35,015,400
スズデン	1,400	2,456.00	3,438,400
尾家産業	500	1,793.00	896,500
シモジマ	2,700	1,312.00	3,542,400
ドウシシャ	3,700	2,224.00	8,228,800
小津産業	500	1,650.00	825,000
高速	2,400	2,244.00	5,385,600
たけびし	1,500	2,010.00	3,015,000
リックス	700	3,730.00	2,611,000
丸文	3,600	1,727.00	6,217,200
ハビネット	3,400	2,878.00	9,785,200
橋本総業ホールディングス	1,600	1,303.00	2,084,800
日本ライフライン	11,800	1,311.00	15,469,800
タカショー	3,500	503.00	1,760,500
I D O M	10,700	852.00	9,116,400
進和	2,500	2,434.00	6,085,000
エスケイジャパン	500	707.00	353,500
ダイترون	1,600	3,000.00	4,800,000

シークス	5,700	1,461.00	8,327,700
田中商事	600	800.00	480,000
オーハシテクニカ	2,100	1,765.00	3,706,500
白銅	1,100	2,480.00	2,728,000
ダイコー通産	200	1,201.00	240,200
伊藤忠商事	270,700	6,667.00	1,804,756,900
丸紅	335,800	2,491.50	836,645,700
高島	1,500	1,283.00	1,924,500
長瀬産業	18,500	2,387.00	44,159,500
蝶理	2,500	2,990.00	7,475,000
豊田通商	35,300	9,653.00	340,750,900
三共生興	5,600	745.00	4,172,000
兼松	16,800	2,264.00	38,035,200
ツカモトコーポレーション	300	1,215.00	364,500
三井物産	303,400	5,928.00	1,798,555,200
日本紙パルプ商事	1,900	5,090.00	9,671,000
カメイ	4,300	1,933.00	8,311,900
東都水産	100	7,050.00	705,000
OUGホールディングス	300	2,473.00	741,900
スターゼン	2,800	2,740.00	7,672,000
山善	12,200	1,289.00	15,725,800
椿本興業	800	6,780.00	5,424,000
住友商事	243,700	3,348.00	815,907,600
内田洋行	1,600	7,640.00	12,224,000
三菱商事	798,000	2,524.00	2,014,152,000
第一実業	3,800	1,890.00	7,182,000
キャノンマーケティングジャパン	9,300	4,386.00	40,789,800
西華産業	1,600	3,085.00	4,936,000
佐藤商事	2,800	1,573.00	4,404,400
菱洋エレクトロ	3,800	3,995.00	15,181,000
東京産業	3,700	751.00	2,778,700
ユアサ商事	3,100	4,905.00	15,205,500
神鋼商事	1,000	5,950.00	5,950,000
トルク	1,200	300.00	360,000
阪和興業	7,200	5,350.00	38,520,000
正栄食品工業	2,700	4,585.00	12,379,500
カナデン	3,000	1,569.00	4,707,000
RYODEN	3,200	2,771.00	8,867,200
岩谷産業	9,200	6,596.00	60,683,200
ナイス	700	1,579.00	1,105,300
ニチモウ	700	2,175.00	1,522,500
極東貿易	2,400	2,154.00	5,169,600
アステナホールディングス	7,600	483.00	3,670,800

三愛オブリ	9,700	1,680.00	16,296,000
稲畑産業	8,000	3,160.00	25,280,000
G S Iクレオス	2,200	2,355.00	5,181,000
明和産業	4,800	666.00	3,196,800
クワザワホールディングス	800	698.00	558,400
ワキタ	6,700	1,560.00	10,452,000
東邦ホールディングス	11,100	3,210.00	35,631,000
サンゲツ	9,300	3,280.00	30,504,000
ミツウロコグループホールディングス	5,100	1,541.00	7,859,100
シナネンホールディングス	1,100	4,065.00	4,471,500
伊藤忠エネクス	10,000	1,583.00	15,830,000
サンリオ	11,400	6,178.00	70,429,200
サンワテクノス	2,100	2,320.00	4,872,000
リョーサン	2,800	5,190.00	14,532,000
新光商事	5,400	1,238.00	6,685,200
トーホー	1,600	2,885.00	4,616,000
三信電気	1,600	2,453.00	3,924,800
東陽テクニカ	4,100	1,466.00	6,010,600
モスフードサービス	5,900	3,400.00	20,060,000
加賀電子	3,700	6,820.00	25,234,000
ソーダニッカ	3,000	1,233.00	3,699,000
立花エレテック	2,700	3,160.00	8,532,000
フォーバル	1,600	1,464.00	2,342,400
P A L T A C	5,400	4,580.00	24,732,000
三谷産業	7,000	370.00	2,590,000
太平洋興発	800	832.00	665,600
西本Wismettacホールディングス	1,000	6,200.00	6,200,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	200	2,309.00	461,800
コア商事ホールディングス	2,300	750.00	1,725,000
K P Pグループホールディングス	10,400	699.00	7,269,600
ヤマタネ	1,800	2,565.00	4,617,000
丸紅建材リース	200	2,830.00	566,000
泉州電業	2,000	3,590.00	7,180,000
トラスコ中山	8,500	2,479.00	21,071,500
オートバックスセブン	14,000	1,591.00	22,274,000
モリト	2,900	1,433.00	4,155,700
加藤産業	5,000	4,745.00	23,725,000
北恵	600	867.00	520,200
イエローハット	6,400	1,820.00	11,648,000
J Kホールディングス	3,100	1,065.00	3,301,500
日伝	2,700	2,770.00	7,479,000
北沢産業	1,300	309.00	401,700
杉本商事	1,900	2,263.00	4,299,700

因幡電機産業	10,400	3,535.00	36,764,000
東テク	1,300	5,060.00	6,578,000
ミスミグループ本社	60,800	2,466.50	149,963,200
アルテック	1,200	250.00	300,000
タキヒヨー	500	1,138.00	569,000
蔵王産業	400	2,494.00	997,600
スズケン	15,300	4,613.00	70,578,900
ジェコス	2,400	1,106.00	2,654,400
グローセル	3,900	674.00	2,628,600
ローソン	8,600	8,266.00	71,087,600
サンエー	3,100	4,570.00	14,167,000
カワチ薬品	3,100	2,818.00	8,735,800
エービーシー・マート	17,600	2,582.00	45,443,200
ハードオフコーポレーション	1,300	1,814.00	2,358,200
アスクル	8,300	2,109.00	17,504,700
ゲオホールディングス	4,500	2,297.00	10,336,500
アダストリア	4,900	3,265.00	15,998,500
ジーフット	1,800	295.00	531,000
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	300	746.00	223,800
くら寿司	4,700	3,850.00	18,095,000
キャンドウ	1,400	2,718.00	3,805,200
I Kホールディングス	700	367.00	256,900
パルグループホールディングス	7,900	2,279.00	18,004,100
エディオン	15,900	1,611.00	25,614,900
サーラコーポレーション	8,500	822.00	6,987,000
ワッツ	1,100	595.00	654,500
ハローズ	1,800	4,450.00	8,010,000
フジオフードグループ本社	4,500	1,442.00	6,489,000
あみやき亭	1,000	4,160.00	4,160,000
ひらまつ	5,300	252.00	1,335,600
大黒天物産	1,200	8,370.00	10,044,000
ハニーズホールディングス	3,200	1,638.00	5,241,600
ファーマライズホールディングス	600	690.00	414,000
アルペン	3,300	2,032.00	6,705,600
ハブ	700	747.00	522,900
クオールホールディングス	5,500	1,758.00	9,669,000
ジinzホールディングス	2,400	4,120.00	9,888,000
ビックカメラ	21,400	1,379.00	29,510,600
D C Mホールディングス	21,300	1,355.00	28,861,500
ペッパーフードサービス	9,300	96.00	892,800
MonotaRO	57,100	1,444.00	82,452,400
東京一番フーズ	500	518.00	259,000
DDグループ	1,400	1,511.00	2,115,400

きちりホールディングス	500	1,040.00	520,000
J.フロント リテイリング	46,200	1,376.50	63,594,300
ドトール・日レスホールディングス	7,100	2,170.00	15,407,000
マツキヨココカラ&カンパニー	73,300	2,699.00	197,836,700
ブロンコビリー	2,400	3,435.00	8,244,000
Z O Z O	25,700	3,300.00	84,810,000
トレジャー・ファクトリー	1,900	1,213.00	2,304,700
物語コーポレーション	6,700	5,140.00	34,438,000
三越伊勢丹ホールディングス	67,800	1,713.00	116,141,400
H a m e e	1,400	1,131.00	1,583,400
マーケットエンタープライズ	200	1,028.00	205,600
ウエルシアホールディングス	20,900	2,358.00	49,282,200
クリエイティブSDホールディングス	6,700	3,165.00	21,205,500
丸善C H Iホールディングス	2,600	329.00	855,400
ミサワ	500	714.00	357,000
ティーライフ	300	1,437.00	431,100
エー・ピーホールディングス	500	961.00	480,500
チムニー	700	1,446.00	1,012,200
シュッピン	3,600	1,052.00	3,787,200
オイシックス・ラ・大地	5,400	1,388.00	7,495,200
ネクステージ	9,200	2,313.00	21,279,600
ジョイフル本田	11,700	1,947.00	22,779,900
鳥貴族ホールディングス	1,500	3,830.00	5,745,000
ホットランド	3,100	1,951.00	6,048,100
すかいらーくホールディングス	55,100	2,380.00	131,138,000
S F Pホールディングス	2,200	2,096.00	4,611,200
綿半ホールディングス	3,100	1,453.00	4,504,300
ヨシックスホールディングス	700	2,975.00	2,082,500
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	11,200	1,019.00	11,412,800
ゴルフダイジェスト・オンライン	1,800	635.00	1,143,000
B E E N O S	1,600	1,507.00	2,411,200
あさひ	3,700	1,294.00	4,787,800
日本調剤	2,700	1,433.00	3,869,100
コスモス薬品	4,000	15,490.00	61,960,000
トーエル	1,000	804.00	804,000
セブン&アイ・ホールディングス	138,800	5,785.00	802,958,000
クリエイティブ・レストランズ・ホールディングス	27,300	1,099.00	30,002,700
ツルハホールディングス	8,500	12,635.00	107,397,500
サンマルクホールディングス	3,200	2,217.00	7,094,400
フェリシモ	500	920.00	460,000
トリドールホールディングス	11,300	4,446.00	50,239,800
T O K Y O B A S E	4,800	330.00	1,584,000

ウイルプラスホールディングス	400	1,017.00	406,800
JMホールディングス	3,000	2,267.00	6,801,000
サツドラホールディングス	1,000	771.00	771,000
アレンザホールディングス	3,000	1,076.00	3,228,000
串カツ田中ホールディングス	1,100	1,864.00	2,050,400
パロックジャパンリミテッド	3,100	819.00	2,538,900
クスリのアオキホールディングス	10,800	3,225.00	34,830,000
力の源ホールディングス	1,800	1,428.00	2,570,400
FOOD & LIFE COMPANIES	21,500	3,008.00	64,672,000
メディカルシステムネットワーク	4,400	614.00	2,701,600
一家ホールディングス	600	697.00	418,200
ジャパンクラフトホールディングス	1,200	166.00	199,200
はるやまホールディングス	1,100	593.00	652,300
ノジマ	11,700	1,902.00	22,253,400
カッパ・クリエイト	6,300	1,736.00	10,936,800
ライトオン	1,700	415.00	705,500
良品計画	44,000	2,328.00	102,432,000
パリミキホールディングス	2,800	522.00	1,461,600
アドヴァングループ	3,800	1,064.00	4,043,200
アルビス	1,300	2,671.00	3,472,300
コナカ	2,400	412.00	988,800
ハウス オブ ローゼ	300	1,611.00	483,300
G-7ホールディングス	4,400	1,254.00	5,517,600
イオン北海道	11,900	950.00	11,305,000
コジマ	6,700	761.00	5,098,700
ヒマラヤ	700	939.00	657,300
コーナン商事	4,900	3,900.00	19,110,000
エコス	1,500	2,459.00	3,688,500
ワタミ	4,300	1,041.00	4,476,300
マルシェ	800	247.00	197,600
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	81,300	3,230.00	262,599,000
西松屋チェーン	7,900	2,130.00	16,827,000
ゼンショーホールディングス	20,500	7,190.00	147,395,000
幸楽苑ホールディングス	3,000	1,223.00	3,669,000
ハークスレイ	800	932.00	745,600
サイゼリヤ	6,000	5,090.00	30,540,000
VTホールディングス	15,300	532.00	8,139,600
魚力	1,400	2,317.00	3,243,800
ポプラ	600	212.00	127,200
フジ・コーポレーション	1,900	1,739.00	3,304,100
ユナイテッドアローズ	4,700	1,942.00	9,127,400
ハイデイ日高	6,000	2,873.00	17,238,000

YU-WA Creation Holdings	1,200	149.00	178,800
コロワイド	17,300	2,309.50	39,954,350
壱番屋	3,200	6,160.00	19,712,000
トップカルチャー	700	157.00	109,900
PLANT	500	1,701.00	850,500
スギホールディングス	8,100	6,757.00	54,731,700
薬王堂ホールディングス	2,000	2,555.00	5,110,000
ヴィア・ホールディングス	3,300	155.00	511,500
スクロール	6,000	1,022.00	6,132,000
ヨンドシーホールディングス	3,800	2,010.00	7,638,000
木曽路	6,100	2,626.00	16,018,600
SRSホールディングス	6,600	1,189.00	7,847,400
千趣会	7,400	315.00	2,331,000
タカキュー	1,400	86.00	120,400
リテールパートナーズ	6,000	1,788.00	10,728,000
上新電機	4,000	2,469.00	9,876,000
日本瓦斯	21,300	2,356.00	50,182,800
ロイヤルホールディングス	7,100	2,593.00	18,410,300
東天紅	200	886.00	177,200
いなげや	3,900	1,281.00	4,995,900
チヨダ	3,800	895.00	3,401,000
ライフコーポレーション	4,200	3,760.00	15,792,000
リンガーハット	5,200	2,403.00	12,495,600
MrMaxHD	5,100	622.00	3,172,200
テンアライド	2,900	311.00	901,900
AOKIホールディングス	8,600	1,186.00	10,199,600
オークワ	5,800	888.00	5,150,400
コメリ	6,200	3,320.00	20,584,000
青山商事	8,600	1,743.00	14,989,800
しまむら	4,700	16,700.00	78,490,000
はせがわ	1,100	368.00	404,800
高島屋	27,800	2,035.00	56,573,000
松屋	6,800	948.00	6,446,400
エイチ・ツー・オー リテイリング	17,800	1,620.00	28,836,000
近鉄百貨店	1,700	2,527.00	4,295,900
丸井グループ	26,700	2,494.00	66,589,800
アクシアル リテイリング	2,700	4,080.00	11,016,000
井筒屋	1,100	356.00	391,600
イオン	136,500	3,457.00	471,880,500
イズミ	7,100	3,440.00	24,424,000
平和堂	6,700	2,183.00	14,626,100
フジ	6,200	1,964.00	12,176,800
ヤオコー	4,600	8,427.00	38,764,200

ゼビオホールディングス	5,500	976.00	5,368,000
ケーズホールディングス	28,500	1,342.00	38,247,000
Olympicグループ	1,000	546.00	546,000
日産東京販売ホールディングス	3,300	463.00	1,527,900
シルバーライフ	800	879.00	703,200
Genky DrugStores	1,800	6,290.00	11,322,000
ナルミヤ・インターナショナル	400	1,241.00	496,400
ブックオフグループホールディングス	2,000	1,288.00	2,576,000
ギフトホールディングス	1,700	2,707.00	4,601,900
アインホールディングス	5,500	4,535.00	24,942,500
元気寿司	2,300	3,625.00	8,337,500
ヤマダホールディングス	123,900	455.00	56,374,500
アークランズ	12,000	1,693.00	20,316,000
ニトリホールディングス	14,700	19,465.00	286,135,500
グルメ杵屋	3,300	1,080.00	3,564,000
愛眼	1,600	188.00	300,800
ケーユーホールディングス	1,900	1,166.00	2,215,400
吉野家ホールディングス	14,800	3,263.00	48,292,400
松屋フーズホールディングス	1,900	5,750.00	10,925,000
サガミホールディングス	6,000	1,518.00	9,108,000
関西フードマーケット	2,700	1,459.00	3,939,300
王将フードサービス	3,000	8,070.00	24,210,000
ミニストップ	2,900	1,535.00	4,451,500
アークス	7,400	2,903.00	21,482,200
パローホールディングス	7,700	2,493.00	19,196,100
ベルク	2,000	6,300.00	12,600,000
大庄	1,700	1,317.00	2,238,900
ファーストリテイリング	18,100	38,960.00	705,176,000
サンドラッグ	13,600	4,484.00	60,982,400
サックスパー ホールディングス	3,400	849.00	2,886,600
ヤマザワ	500	1,272.00	636,000
やまや	500	3,095.00	1,547,500
ペルーナ	9,700	629.00	6,101,300
いよぎんホールディングス	44,600	999.30	44,568,780
しずおかフィナンシャルグループ	83,300	1,343.50	111,913,550
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	31,600	1,039.50	32,848,200
楽天銀行	13,000	2,315.00	30,095,000
京都フィナンシャルグループ	47,500	2,397.50	113,881,250
島根銀行	600	535.00	321,000
じもとホールディングス	1,800	575.00	1,035,000
めぶきフィナンシャルグループ	186,000	444.30	82,639,800
東京きらぼしフィナンシャルグループ	4,800	4,255.00	20,424,000
九州フィナンシャルグループ	72,600	910.10	66,073,260

ゆうちょ銀行	411,900	1,542.50	635,355,750
富山第一銀行	11,900	817.00	9,722,300
コンコルディア・フィナンシャルグループ	201,100	704.00	141,574,400
西日本フィナンシャルホールディングス	21,200	1,714.00	36,336,800
三十三フィナンシャルグループ	3,400	1,909.00	6,490,600
第四北越フィナンシャルグループ	5,900	4,055.00	23,924,500
ひろぎんホールディングス	53,400	989.80	52,855,320
おきなわフィナンシャルグループ	3,200	2,464.00	7,884,800
十六フィナンシャルグループ	4,900	3,965.00	19,428,500
北國フィナンシャルホールディングス	3,900	4,410.00	17,199,000
プロクレアホールディングス	4,300	1,891.00	8,131,300
あいちフィナンシャルグループ	5,800	2,585.00	14,993,000
あおぞら銀行	26,900	3,247.00	87,344,300
三菱UFJフィナンシャル・グループ	2,283,000	1,383.50	3,158,530,500
りそなホールディングス	437,100	810.60	354,313,260
三井住友トラスト・ホールディングス	134,700	2,959.50	398,644,650
三井住友フィナンシャルグループ	266,500	7,645.00	2,037,392,500
千葉銀行	104,500	1,095.00	114,427,500
群馬銀行	72,700	730.30	53,092,810
武蔵野銀行	5,200	2,782.00	14,466,400
千葉興業銀行	6,200	869.00	5,387,800
筑波銀行	16,500	256.00	4,224,000
七十七銀行	10,900	3,610.00	39,349,000
秋田銀行	2,500	1,982.00	4,955,000
山形銀行	4,200	1,111.00	4,666,200
岩手銀行	2,400	2,550.00	6,120,000
東邦銀行	29,700	305.00	9,058,500
東北銀行	1,000	1,186.00	1,186,000
ふくおかフィナンシャルグループ	32,600	3,581.00	116,740,600
スルガ銀行	33,000	852.00	28,116,000
八十二銀行	80,400	807.00	64,882,800
山梨中央銀行	4,200	1,747.00	7,337,400
大垣共立銀行	7,100	1,958.00	13,901,800
福井銀行	3,400	1,704.00	5,793,600
清水銀行	1,500	1,584.00	2,376,000
富山銀行	300	1,734.00	520,200
滋賀銀行	6,200	3,450.00	21,390,000
南都銀行	5,600	2,629.00	14,722,400
百五銀行	35,300	575.00	20,297,500
紀陽銀行	13,400	1,678.00	22,485,200
ほくほくフィナンシャルグループ	23,200	1,576.00	36,563,200
山陰合同銀行	23,500	1,045.00	24,557,500
鳥取銀行	700	1,434.00	1,003,800

百十四銀行	3,700	2,444.00	9,042,800
四国銀行	5,500	1,016.00	5,588,000
阿波銀行	5,300	2,443.00	12,947,900
大分銀行	2,300	2,654.00	6,104,200
宮崎銀行	2,300	2,712.00	6,237,600
佐賀銀行	2,200	1,942.00	4,272,400
琉球銀行	8,000	1,148.00	9,184,000
セブン銀行	117,500	305.00	35,837,500
みずほフィナンシャルグループ	506,000	2,671.50	1,351,779,000
高知銀行	700	969.00	678,300
山口フィナンシャルグループ	36,800	1,383.00	50,894,400
名古屋銀行	2,400	5,470.00	13,128,000
北洋銀行	56,800	368.00	20,902,400
大光銀行	700	1,448.00	1,013,600
愛媛銀行	5,100	1,054.00	5,375,400
トマト銀行	700	1,223.00	856,100
京葉銀行	15,700	716.00	11,241,200
栃木銀行	18,700	312.00	5,834,400
北日本銀行	1,200	2,248.00	2,697,600
東和銀行	6,900	633.00	4,367,700
福島銀行	2,200	237.00	521,400
大東銀行	900	760.00	684,000
トモニホールディングス	35,500	406.00	14,413,000
フィデアホールディングス	3,900	1,595.00	6,220,500
池田泉州ホールディングス	52,000	334.00	17,368,000
F P G	12,700	1,693.00	21,501,100
ジャパンインベストメントアドバイザー	6,100	859.00	5,239,900
マーキュリアホールディングス	1,100	732.00	805,200
S B Iホールディングス	54,900	3,629.00	199,232,100
日本アジア投資	1,500	265.00	397,500
ジャフコ グループ	11,200	1,699.50	19,034,400
大和証券グループ本社	290,400	1,060.50	307,969,200
野村ホールディングス	630,400	757.60	477,591,040
岡三証券グループ	32,900	757.00	24,905,300
丸三証券	12,500	893.00	11,162,500
東洋証券	9,900	324.00	3,207,600
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	44,500	559.00	24,875,500
光世証券	500	590.00	295,000
水戸証券	11,100	472.00	5,239,200
いちよし証券	7,000	778.00	5,446,000
松井証券	18,500	814.00	15,059,000
マネックスグループ	36,700	755.00	27,708,500
極東証券	5,100	1,051.00	5,360,100

岩井コスモホールディングス	4,300	2,112.00	9,081,600
アイザワ証券グループ	5,400	1,232.00	6,652,800
マネーパートナーズグループ	2,200	303.00	666,600
スパークス・グループ	4,200	1,818.00	7,635,600
小林洋行	900	248.00	223,200
かんぽ生命保険	38,200	2,721.00	103,942,200
F P パートナー	700	5,990.00	4,193,000
S O M P O ホールディングス	56,400	7,530.00	424,692,000
アニコム ホールディングス	12,700	587.00	7,454,900
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	83,900	6,025.00	505,497,500
第一生命ホールディングス	183,200	3,181.00	582,759,200
東京海上ホールディングス	370,500	3,820.00	1,415,310,000
T & D ホールディングス	100,700	2,382.00	239,867,400
アドバンスクリエイト	2,200	1,031.00	2,268,200
全国保証	9,800	5,504.00	53,939,200
あんしん保証	900	242.00	217,800
ジェイリース	1,000	2,325.00	2,325,000
イントラスト	800	850.00	680,000
日本モーゲージサービス	1,200	524.00	628,800
C a s a	800	908.00	726,400
S B I アルヒ	3,600	864.00	3,110,400
プレミアグループ	6,300	1,816.00	11,440,800
ネットプロテクションズホールディングス	12,400	177.00	2,194,800
クレディセゾン	23,800	2,779.00	66,140,200
芙蓉総合リース	3,400	13,205.00	44,897,000
みずほリース	6,300	5,290.00	33,327,000
東京センチュリー	28,000	1,624.00	45,472,000
日本証券金融	13,800	1,565.00	21,597,000
アイフル	55,200	371.00	20,479,200
リコーリース	3,600	5,110.00	18,396,000
イオンフィナンシャルサービス	21,500	1,325.00	28,487,500
アコム	66,900	369.80	24,739,620
ジャックス	4,000	5,810.00	23,240,000
オリエントコーポレーション	12,200	1,114.00	13,590,800
オリックス	228,500	2,856.00	652,596,000
三菱H C キャピタル	167,000	1,026.00	171,342,000
九州リースサービス	800	1,128.00	902,400
日本取引所グループ	97,800	3,180.00	311,004,000
イー・ギャランティ	6,100	2,003.00	12,218,300
アサックス	900	731.00	657,900
N E C キャピタルソリューション	1,800	3,730.00	6,714,000
R o b o t H o m e	10,400	174.00	1,809,600
大東建託	13,700	16,125.00	220,912,500

いちご	43,200	373.00	16,113,600
日本駐車場開発	39,700	189.00	7,503,300
スター・マイカ・ホールディングス	4,400	596.00	2,622,400
S R Eホールディングス	1,600	2,779.00	4,446,400
A Dワークスグループ	5,300	228.00	1,208,400
ヒューリック	87,400	1,555.50	135,950,700
野村不動産ホールディングス	20,900	3,973.00	83,035,700
三重交通グループホールディングス	8,000	639.00	5,112,000
サムティ	6,000	2,502.00	15,012,000
ディア・ライフ	6,400	1,014.00	6,489,600
コーセーアールイー	700	1,120.00	784,000
地主	2,900	2,288.00	6,635,200
プレサンスコーポレーション	5,900	1,667.00	9,835,300
T H E グローバル社	1,200	399.00	478,800
ハウスコム	300	919.00	275,700
J P M C	2,200	1,164.00	2,560,800
サンセイランディック	600	1,045.00	627,000
エストラスト	200	643.00	128,600
フージャースホールディングス	5,800	1,132.00	6,565,600
オープンハウスグループ	13,700	4,535.00	62,129,500
東急不動産ホールディングス	112,700	994.50	112,080,150
飯田グループホールディングス	35,900	2,272.00	81,564,800
イーランド	300	1,563.00	468,900
ムゲンエステート	1,400	1,107.00	1,549,800
ビーロット	1,400	1,009.00	1,412,600
ファーストブラザーズ	400	1,280.00	512,000
A n d D oホールディングス	2,300	1,110.00	2,553,000
シーアールイー	2,100	1,441.00	3,026,100
ケイアイスター不動産	1,800	3,540.00	6,372,000
アグレ都市デザイン	400	1,628.00	651,200
グッドコムアセット	3,500	746.00	2,611,000
ジェイ・エス・ビー	1,900	2,569.00	4,881,100
ロードスターキャピタル	2,400	1,978.00	4,747,200
テンポイノベーション	600	1,014.00	608,400
グローバル・リンク・マネジメント	400	2,526.00	1,010,400
フェイスネットワーク	600	1,608.00	964,800
霞ヶ関キャピタル	1,000	10,660.00	10,660,000
パーク24	24,300	1,867.00	45,368,100
パラカ	1,300	1,946.00	2,529,800
ミガロホールディングス	300	1,428.00	428,400
宮越ホールディングス	1,700	1,170.00	1,989,000
三井不動産	173,400	3,665.00	635,511,000
三菱地所	245,000	2,029.00	497,105,000

平和不動産	6,100	3,900.00	23,790,000
東京建物	32,700	2,242.00	73,313,400
京阪神ビルディング	7,000	1,455.00	10,185,000
住友不動産	54,200	4,571.00	247,748,200
テオーシー	6,700	693.00	4,643,100
東京楽天地	600	6,700.00	4,020,000
レオパレス21	37,500	406.00	15,225,000
スターツコーポレーション	5,400	3,055.00	16,497,000
フジ住宅	4,700	711.00	3,341,700
空港施設	5,300	654.00	3,466,200
明和地所	1,900	1,339.00	2,544,100
ゴールドクレスト	3,100	2,321.00	7,195,100
エスリード	1,800	3,645.00	6,561,000
日神グループホールディングス	6,000	521.00	3,126,000
日本エスコン	7,000	972.00	6,804,000
MIRARTHホールディングス	17,200	497.00	8,548,400
AVANTIA	1,200	898.00	1,077,600
イオンモール	19,400	1,792.50	34,774,500
毎日コムネット	800	780.00	624,000
ファースト住建	800	1,110.00	888,000
ランド	205,100	8.00	1,640,800
カチタス	10,100	1,914.00	19,331,400
トーセイ	6,200	2,177.00	13,497,400
穴吹興産	400	2,109.00	843,600
サンフロンティア不動産	5,600	1,762.00	9,867,200
FJネクストホールディングス	3,900	1,194.00	4,656,600
インテリックス	500	561.00	280,500
ランドビジネス	700	267.00	186,900
サンネクスタグループ	600	953.00	571,800
グランディハウス	2,500	652.00	1,630,000
日本空港ビルディング	13,300	5,874.00	78,124,200
明豊ファシリティワークス	1,100	869.00	955,900
LIFULL	13,400	195.00	2,613,000
MIXI	8,400	2,534.00	21,285,600
ジェイエイシーリクルートメント	14,100	678.00	9,559,800
日本M&Aセンターホールディングス	62,300	780.90	48,650,070
メンバーズ	1,300	1,001.00	1,301,300
中広	400	417.00	166,800
UTグループ	5,000	2,420.00	12,100,000
アイティメディア	1,500	1,051.00	1,576,500
ケアネット	6,000	824.00	4,944,000
E・Jホールディングス	2,300	1,733.00	3,985,900
オープンアップグループ	11,700	2,224.00	26,020,800

コシダカホールディングス	11,700	995.00	11,641,500
アルトナー	900	2,307.00	2,076,300
パソナグループ	4,700	2,700.00	12,690,000
C D S	500	1,705.00	852,500
リンクアンドモチベーション	11,300	569.00	6,429,700
エス・エム・エス	13,700	2,620.00	35,894,000
サニーサイドアップグループ	600	589.00	353,400
パーソルホールディングス	398,300	233.90	93,162,370
リニカル	1,400	530.00	742,000
クックパッド	10,700	116.00	1,241,200
エスクリ	900	297.00	267,300
アイ・ケイ・ケイホールディングス	1,100	728.00	800,800
学情	2,000	1,769.00	3,538,000
スタジオアリス	2,000	2,099.00	4,198,000
シミックホールディングス	1,800	2,643.00	4,757,400
エプコ	600	976.00	585,600
N J S	900	2,811.00	2,529,900
総合警備保障	65,400	798.10	52,195,740
カカクコム	25,800	1,700.00	43,860,000
アイロムグループ	1,600	2,062.00	3,299,200
セントケア・ホールディング	2,800	969.00	2,713,200
サイネックス	400	855.00	342,000
ルネサンス	3,000	930.00	2,790,000
ディップ	6,000	2,539.00	15,234,000
デジタルホールディングス	2,000	1,261.00	2,522,000
新日本科学	3,600	1,759.00	6,332,400
キャリアデザインセンター	500	2,104.00	1,052,000
ベネフィット・ワン	13,600	2,133.50	29,015,600
エムスリー	77,300	2,437.00	188,380,100
ツカダ・グローバルホールディング	1,400	389.00	544,600
プラス	200	758.00	151,600
アウトソーシング	23,600	1,743.00	41,134,800
ウェルネット	1,700	571.00	970,700
ワールドホールディングス	1,800	2,999.00	5,398,200
ディー・エヌ・エー	13,900	1,521.50	21,148,850
博報堂D Yホールディングス	49,900	1,120.00	55,888,000
ぐるなび	7,300	277.00	2,022,100
タカミヤ	5,300	489.00	2,591,700
ジャパンベストレスキューシステム	1,800	998.00	1,796,400
ファンコミュニケーションズ	5,500	403.00	2,216,500
ライク	1,500	1,509.00	2,263,500
A o b a - B B T	800	408.00	326,400
エスプール	11,200	328.00	3,673,600

WDBホールディングス	2,000	2,307.00	4,614,000
ティア	1,300	466.00	605,800
CDG	200	1,222.00	244,400
アドウェイズ	5,400	515.00	2,781,000
バリューコマース	3,400	1,586.00	5,392,400
インフォマート	40,600	415.00	16,849,000
JPホールディングス	10,000	461.00	4,610,000
エコナックホールディングス	1,800	135.00	243,000
CLホールディングス	900	944.00	849,600
プレステージ・インターナショナル	18,300	606.00	11,089,800
アミューズ	2,400	1,546.00	3,710,400
ドリームインキュベータ	1,300	3,280.00	4,264,000
クイック	2,700	2,532.00	6,836,400
TAC	1,000	198.00	198,000
電通グループ	38,500	3,948.00	151,998,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	1,300	1,221.00	1,587,300
ぴあ	1,300	3,350.00	4,355,000
イオンファンタジー	1,400	2,494.00	3,491,600
シーティーエス	4,900	698.00	3,420,200
NEXYZ Group	700	731.00	511,700
H.U.グループホールディングス	11,500	2,720.50	31,285,750
アルプス技研	3,700	2,875.00	10,637,500
サニックス	6,300	303.00	1,908,900
日本空調サービス	4,200	839.00	3,523,800
オリエンタルランド	207,100	5,562.00	1,151,890,200
ダスキン	8,700	3,392.00	29,510,400
明光ネットワークジャパン	4,700	724.00	3,402,800
ファルコホールディングス	1,800	2,200.00	3,960,000
秀英予備校	500	302.00	151,000
田谷	400	411.00	164,400
ラウンドワン	36,800	658.00	24,214,400
リゾートトラスト	17,000	2,537.00	43,129,000
ビー・エム・エル	4,800	2,850.00	13,680,000
リソー教育	20,000	242.00	4,840,000
早稲田アカデミー	2,200	1,682.00	3,700,400
ユー・エス・エス	43,900	2,829.00	124,193,100
東京個別指導学院	4,600	447.00	2,056,200
サイバーエージェント	86,500	948.80	82,071,200
楽天グループ	335,300	661.50	221,800,950
クリーク・アンド・リバー社	2,000	1,960.00	3,920,000
SBIグローバルアセットマネジメント	7,700	643.00	4,951,100
テー・オー・ダブリュー	7,700	335.00	2,579,500
山田コンサルティンググループ	1,700	1,763.00	2,997,100

セントラルスポーツ	1,500	2,506.00	3,759,000
フルキャストホールディングス	3,700	1,797.00	6,648,900
エン・ジャパン	6,400	2,646.00	16,934,400
リソルホールディングス	200	6,020.00	1,204,000
テクノプロ・ホールディングス	22,900	3,514.00	80,470,600
アトラグループ	600	185.00	111,000
アイ・アールジャパンホールディングス	2,000	1,568.00	3,136,000
K e e P e r 技研	2,400	6,410.00	15,384,000
ファーストロジック	500	527.00	263,500
三機サービス	300	1,346.00	403,800
G u n o s y	3,100	676.00	2,095,600
デザインワン・ジャパン	600	142.00	85,200
イー・ガーディアン	1,500	1,614.00	2,421,000
リブセンス	1,000	243.00	243,000
ジャパンマテリアル	12,000	2,540.00	30,480,000
ベクトル	4,800	1,198.00	5,750,400
ウチヤマホールディングス	900	382.00	343,800
チャーム・ケア・コーポレーション	3,300	1,201.00	3,963,300
キャリアリンク	1,400	2,578.00	3,609,200
I B J	3,000	694.00	2,082,000
アサンテ	1,900	1,680.00	3,192,000
バリューHR	3,400	1,460.00	4,964,000
M & A キャピタルパートナーズ	3,200	2,439.00	7,804,800
ライドオンエクスプレスホールディングス	1,600	1,032.00	1,651,200
E R I ホールディングス	600	1,787.00	1,072,200
アビスト	300	3,105.00	931,500
シグマクシス・ホールディングス	5,300	1,361.00	7,213,300
ウィルグループ	3,300	1,199.00	3,956,700
エスクロー・エージェンツ・ジャパン	2,500	141.00	352,500
メドピア	3,400	708.00	2,407,200
レアジョブ	400	915.00	366,000
リクルートホールディングス	289,700	5,914.00	1,713,285,800
エラン	5,200	1,064.00	5,532,800
土木管理総合試験所	1,000	329.00	329,000
日本郵政	459,800	1,420.50	653,145,900
ベルシステム24ホールディングス	4,200	1,765.00	7,413,000
鎌倉新書	3,300	633.00	2,088,900
S M N	400	296.00	118,400
一蔵	300	610.00	183,000
グローバルキッズCOMPANY	400	652.00	260,800
エアトリ	2,900	1,833.00	5,315,700
アトラエ	2,300	681.00	1,566,300
ストライク	1,700	4,560.00	7,752,000

ソラスト	10,800	586.00	6,328,800
セラク	1,200	1,188.00	1,425,600
インソース	8,500	838.00	7,123,000
ベйкаレント・コンサルティング	28,800	3,490.00	100,512,000
Orchestra Holdings	800	1,010.00	808,000
アイモパイル	5,200	446.00	2,319,200
キャリアインデックス	700	208.00	145,600
MS - Japan	1,200	1,232.00	1,478,400
船場	400	870.00	348,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	12,700	2,215.00	28,130,500
フルテック	300	1,161.00	348,300
グリーンズ	800	2,017.00	1,613,600
ツナググループ・ホールディングス	600	880.00	528,000
GameWith	600	334.00	200,400
MS&Consulting	300	617.00	185,100
ウェルビー	2,000	881.00	1,762,000
エル・ティー・エス	500	2,929.00	1,464,500
ミダックホールディングス	2,400	1,940.00	4,656,000
キュービーネットホールディングス	1,900	1,494.00	2,838,600
RPAホールディングス	5,300	251.00	1,330,300
スプリックス	600	826.00	495,600
マネジメントソリューションズ	1,700	3,065.00	5,210,500
プロレド・パートナーズ	1,000	369.00	369,000
and factory	600	336.00	201,600
テノ・ホールディングス	300	509.00	152,700
フロンティア・マネジメント	1,000	1,635.00	1,635,000
ピアラ	400	294.00	117,600
コプロ・ホールディングス	700	1,605.00	1,123,500
ギークス	300	500.00	150,000
アンビスホールディングス	4,200	2,719.00	11,419,800
カーブスホールディングス	10,700	704.00	7,532,800
フォーラムエンジニアリング	5,300	814.00	4,314,200
Fast Fitness Japan	1,300	1,107.00	1,439,100
ダイレクトマーケティングミックス	4,000	451.00	1,804,000
ポピンズ	600	1,156.00	693,600
LITALICO	3,000	1,919.00	5,757,000
コンフィデンス・インターワークス	200	1,610.00	322,000
アドバンテッジリスクマネジメント	1,100	465.00	511,500
リログループ	19,600	1,603.00	31,418,800
東祥	2,700	906.00	2,446,200
ID&Eホールディングス	2,400	3,515.00	8,436,000
ビーウィズ	1,000	1,893.00	1,893,000
TREホールディングス	7,500	1,268.00	9,510,000

人・夢・技術グループ	1,500	1,872.00	2,808,000	
N I S S Oホールディングス	3,400	841.00	2,859,400	
大栄環境	7,100	2,564.00	18,204,400	
日本管財ホールディングス	4,100	2,626.00	10,766,600	
M & A 総研ホールディングス	1,900	4,845.00	9,205,500	
エイチ・アイ・エス	11,400	1,786.00	20,360,400	
ラックランド	1,800	2,633.00	4,739,400	
共立メンテナンス	6,100	5,958.00	36,343,800	
イチネンホールディングス	4,100	1,571.00	6,441,100	
建設技術研究所	2,000	5,940.00	11,880,000	
スペース	2,600	952.00	2,475,200	
燦ホールディングス	3,700	1,113.00	4,118,100	
スバル興業	200	15,580.00	3,116,000	
東京テアトル	800	1,123.00	898,400	
タナベコンサルティンググループ	1,200	1,055.00	1,266,000	
ナガワ	1,200	7,510.00	9,012,000	
東京都競馬	3,300	4,595.00	15,163,500	
常磐興産	800	1,235.00	988,000	
カナモト	6,100	2,904.00	17,714,400	
ニシオホールディングス	3,600	4,060.00	14,616,000	
アゴーラ ホスピタリティー グループ	13,300	23.00	305,900	
トランス・コスモス	4,900	3,130.00	15,337,000	
乃村工藝社	17,100	868.00	14,842,800	
藤田観光	1,600	6,270.00	10,032,000	
K N T - C Tホールディングス	2,300	1,362.00	3,132,600	
トーカイ	3,500	2,102.00	7,357,000	
白洋舎	300	2,792.00	837,600	
セコム	39,800	10,775.00	428,845,000	
セントラル警備保障	2,100	2,535.00	5,323,500	
丹青社	7,600	869.00	6,604,400	
メイテックグループホールディングス	14,100	2,905.00	40,960,500	
応用地質	3,700	2,235.00	8,269,500	
船井総研ホールディングス	8,100	2,629.00	21,294,900	
進学会ホールディングス	500	254.00	127,000	
オオバ	1,400	1,007.00	1,409,800	
いであ	600	1,813.00	1,087,800	
学究社	1,600	2,064.00	3,302,400	
ベネッセホールディングス	12,300	2,620.00	32,226,000	
イオンディライト	4,200	3,750.00	15,750,000	
ナック	1,700	1,065.00	1,810,500	
ダイセキ	8,000	4,275.00	34,200,000	
ステップ	1,400	1,956.00	2,738,400	
合 計	58,935,200		136,747,185,170	

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

## R M先進国株式マザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）

2024年 1月25日現在

資産の部	
流動資産	
預金	1,025,036,541
コール・ローン	9,127,771,878
株式	234,741,212,017
投資証券	4,731,310,414
派生商品評価勘定	33,924,262
未収配当金	164,013,861
差入委託証拠金	853,274,593
流動資産合計	250,676,543,566
資産合計	250,676,543,566
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	25,478
未払解約金	9,321,451,700
未払利息	24,757
流動負債合計	9,321,501,935
負債合計	9,321,501,935
純資産の部	
元本等	
元本	86,355,123,758
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	154,999,917,873
元本等合計	241,355,041,631
純資産合計	241,355,041,631
負債純資産合計	250,676,543,566

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場（計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場）で評価しております。 新株予約権証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場（計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場）で評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場（計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場）で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。 為替予約取引

3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	個別法に基づき、原則としてわが国における計算日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。
4. 収益及び費用の計上基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
5. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>派生商品取引等損益 原則として、約定日基準で計上しております。</p> <p>為替予約取引による為替差損益 原則として、約定日基準で計上しております。</p> <p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産等については、投資信託財産の計算に関する規則第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分して整理する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

2024年 1月25日現在

1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 1月26日
期首元本額	79,601,577,812円
期中追加設定元本額	44,690,198,218円
期中一部解約元本額	37,936,652,272円
期末元本額	86,355,123,758円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド（安定型）	1,456,278,785円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	7,616,076,268円
りそなラップ型ファンド（成長型）	7,055,314,466円
DCりそな グローバルバランス	43,404,283円
つみたてバランスファンド	3,143,853,312円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	1,990,276,653円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	1,517,455,287円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	1,051,925,733円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	555,925,926円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	376,696,466円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	214,260,278円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	498,887,818円
りそな つみたてラップ型ファンド（安定型）	45,979,336円
りそな つみたてラップ型ファンド（安定成長型）	150,192,403円
りそな つみたてラップ型ファンド（成長型）	142,234,145円
りそな つみたてリスクコントロールファンド	29,290,360円
ターゲットリターンバランスファンド（目標2%）	1,092,759円
ターゲットリターンバランスファンド（目標3%）	1,114,483円
ターゲットリターンバランスファンド（目標4%）	6,348,143円
ターゲットリターンバランスファンド（目標5%）	3,102,647円
ターゲットリターンバランスファンド（目標6%）	7,059,029円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2065	1,473,443円
FWりそな先進国株式アクティブファンド	98,485,032円
FWりそな先進国+新興国株式アクティブファンド	79,589,117円
FWりそな先進国株式インデックスファンド	31,664,211,693円
Smart-i 先進国株式インデックス	19,430,583,485円
Smart-i 8資産バランス 安定型	507,857,905円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	1,706,867,198円
Smart-i 8資産バランス 成長型	2,337,385,330円
Smart-i Select 全世界株式インデックス	549,287,026円
Smart-i Select 全世界株式インデックス（除く日本）	224,976,827円
Smart-i DC 全世界株式インデックス	332,526円
Smart-i DC 全世界株式インデックス（除く日本）	352,513円
りそなFT 先進国株式インデックス（適格機関投資家専用）	248,473,705円
りそなDAAファンド（適格機関投資家専用）	112,735,356円
りそなFT RCバランスファンド（適格機関投資家専用）	1,209,457,097円
りそな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）	6,548,148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）	31,173,894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）	256,844,781円
りそなFT マルチアセットファンド（適格機関投資家専用）	118,082,940円
りそなDAAマルチアセットファンド（適格機関投資家専用）	397,009円
りそなFT パッシブバランス（適格機関投資家専用）	446,721,842円

りそなマルチアセットファンド(適格機関投資家専用)	68,700,824円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	141,822,638円
りそなDAAファンド202205(適格機関投資家専用)	236,123,625円
りそなFTパッシブバランス202307(適格機関投資家専用)	969,871,224円
2. 計算日における受益権の総数	86,355,123,758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	2.7949円
(10,000口当たり純資産額)	(27,949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 1月25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 1月25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、新株予約権証券、投資証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 デリバティブ取引 (その他の注記)の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、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 1月25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 1月25日現在	
	損益に含まれた評価差額(円)	
株式	30,816,691,288	
投資証券	129,326,843	
合計	30,687,364,445	

(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 1月25日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 買建	1,825,710,301	-	1,859,286,249	33,575,948
合計		1,825,710,301	-	1,859,286,249	33,575,948

(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 1月25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	218,731,060	-	218,408,224	322,836
	米ドル	161,422,000	-	161,136,669	285,331
	カナダドル	6,601,740	-	6,557,064	44,676
	ユーロ	29,749,705	-	29,743,575	6,130
	英ポンド	8,461,940	-	8,454,741	7,199
	スイスフラン	6,819,710	-	6,840,943	21,233
	スウェーデンクローナ	1,412,200	-	1,414,840	2,640
	デンマーククローネ	1,833,535	-	1,833,237	298
	香港ドル	1,325,520	-	1,323,483	2,037
	シンガポールドル	1,104,710	-	1,103,672	1,038
合計		218,731,060	-	218,408,224	322,836

(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	APA CORP	9,204	31.37	288,729.48	
	BAKER HUGHES COMPANY	28,904	30.04	868,276.16	
	CHENIERE ENERGY INC	6,876	165.33	1,136,809.08	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	3,035	76.44	231,995.40	

CHEVRON CORP	51,533	144.92	7,468,162.36
CONOCOPHILLIPS	34,050	109.67	3,734,263.50
COTERRA ENERGY INC	20,285	25.02	507,530.70
DEVON ENERGY CORP	18,371	41.62	764,601.02
DIAMONDBACK ENERGY INC	4,616	153.20	707,171.20
EOG RESOURCES INC	16,592	112.09	1,859,797.28
EQT CORP	10,599	35.66	377,960.34
EXXON MOBIL CORP	113,749	99.60	11,329,400.40
HALLIBURTON CO	25,732	36.83	947,709.56
HESS CORP	7,898	140.27	1,107,852.46
HF SINCLAIR CORP	4,810	53.19	255,843.90
KINDER MORGAN INC	57,348	16.89	968,607.72
MARATHON OIL CORP	16,626	22.59	375,581.34
MARATHON PETROLEUM CORP	11,397	155.10	1,767,674.70
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	18,967	57.31	1,086,998.77
ONEOK INC	16,641	68.86	1,145,899.26
OVINTIV INC	7,033	42.20	296,792.60
PHILLIPS 66	12,696	133.67	1,697,074.32
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	6,656	222.96	1,484,021.76
SCHLUMBERGER LTD	40,489	51.67	2,092,066.63
TARGA RESOURCES CORP	6,127	83.98	514,545.46
TEXAS PACIFIC LAND CORP	184	1,505.49	277,010.16
VALERO ENERGY CORP	10,082	130.15	1,312,172.30
WILLIAMS COS INC	34,746	34.03	1,182,406.38
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	6,339	257.16	1,630,137.24
ALBEMARLE CORP	3,181	121.69	387,095.89
AMCOR PLC	41,849	9.31	389,614.19
AVERY DENNISON CORP	2,331	198.46	462,610.26
BALL CORP	9,110	55.87	508,975.70
CELANESE CORP	2,671	143.30	382,754.30
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	5,582	76.77	428,530.14
CLEVELAND-CLIFFS INC	14,637	18.27	267,417.99
CORTEVA INC	19,337	45.41	878,093.17
CROWN HOLDINGS INC	3,413	89.99	307,135.87
DOW INC	20,126	53.09	1,068,489.34
DUPONT DE NEMOURS INC	12,505	64.20	802,821.00
EASTMAN CHEMICAL CO	3,561	83.80	298,411.80
ECOLAB INC	7,326	196.62	1,440,438.12
FMC CORP	3,105	57.01	177,016.05
FREEMPORT-MCMORAN INC	40,921	39.72	1,625,382.12
INTERNATIONAL PAPER CO	9,874	36.18	357,241.32
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	6,933	79.04	547,984.32
LINDE PLC	13,868	401.28	5,564,951.04

LYONDELLBASELL INDU-CL A	7,041	93.42	657,770.22
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,773	494.68	877,067.64
MOSAIC CO/THE	8,511	31.96	272,011.56
NEWMONT CORP	32,969	34.44	1,135,452.36
NUCOR CORP	7,112	172.63	1,227,744.56
PACKAGING CORP OF AMERICA	2,403	165.01	396,519.03
PPG INDUSTRIES INC	6,417	141.03	904,989.51
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	1,573	280.98	441,981.54
RPM INTERNATIONAL INC	3,503	106.52	373,139.56
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,962	301.06	2,095,979.72
STEEL DYNAMICS INC	4,203	116.54	489,817.62
VULCAN MATERIALS CO	3,812	219.80	837,877.60
WESTLAKE CORP	1,041	136.64	142,242.24
WESTROCK CO	7,139	40.80	291,271.20
3M CO	15,776	93.24	1,470,954.24
AECOM	3,727	88.17	328,609.59
AERCAP HOLDINGS NV	5,527	75.52	417,399.04
ALLEGION PLC	2,487	122.93	305,726.91
AMETEK INC	6,622	162.74	1,077,664.28
AXON ENTERPRISE INC	2,064	251.24	518,559.36
BOEING CO/THE	16,319	214.13	3,494,387.47
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	3,334	165.32	551,176.88
CARLISLE COS INC	1,453	302.19	439,082.07
CARRIER GLOBAL CORP	23,987	54.97	1,318,565.39
CATERPILLAR INC	14,518	290.68	4,220,092.24
CNH INDUSTRIAL NV	25,382	11.83	300,269.06
CUMMINS INC	4,071	235.80	959,941.80
DEERE & CO	7,795	388.41	3,027,655.95
DOVER CORP	3,781	148.01	559,625.81
EATON CORP PLC	11,372	241.57	2,747,134.04
EMERSON ELECTRIC CO	16,347	94.39	1,542,993.33
FASTENAL CO	16,402	68.84	1,129,113.68
FERGUSON PLC	5,853	187.05	1,094,803.65
FORTIVE CORP	9,516	73.74	701,709.84
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS I	3,833	75.90	290,924.70
GENERAL DYNAMICS CORP	6,634	261.18	1,732,668.12
GENERAL ELECTRIC CO	30,977	129.93	4,024,841.61
GRACO INC	4,552	84.04	382,550.08
HEICO CORP	1,073	179.20	192,281.60
HEICO CORP-CLASS A	1,964	140.32	275,588.48
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	18,900	199.87	3,777,543.00
HOWMET AEROSPACE INC	10,616	56.34	598,105.44
HUBBELL INC	1,422	328.16	466,643.52

HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,111	253.64	281,794.04
IDEX CORP	2,200	205.69	452,518.00
ILLINOIS TOOL WORKS	8,628	258.60	2,231,200.80
INGERSOLL-RAND INC	11,631	78.84	916,988.04
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	4,700	40.65	191,055.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	19,527	55.02	1,074,375.54
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	5,426	204.25	1,108,260.50
LENNOX INTERNATIONAL INC	876	432.69	379,036.44
LOCKHEED MARTIN CORP	6,362	431.65	2,746,157.30
MASCO CORP	5,980	65.47	391,510.60
NORDSON CORP	1,493	251.05	374,817.65
NORTHROP GRUMMAN CORP	4,104	463.92	1,903,927.68
OTIS WORLDWIDE CORP	11,825	88.01	1,040,718.25
OWENS CORNING	2,541	146.85	373,145.85
PACCAR INC	14,963	100.83	1,508,719.29
PARKER HANNIFIN CORP	3,671	464.88	1,706,574.48
PENTAIR PLC	4,364	70.69	308,491.16
QUANTA SERVICES INC	4,180	193.28	807,910.40
ROCKWELL AUTOMATION INC	3,300	300.35	991,155.00
RTX CORP	41,441	89.49	3,708,555.09
SMITH (A.O.) CORP	3,305	80.33	265,490.65
SNAP-ON INC	1,540	286.28	440,871.20
STANLEY BLACK & DECKER INC	4,061	92.89	377,226.29
TEXTRON INC	5,445	85.55	465,819.75
TORO CO	2,938	93.54	274,820.52
TRANE TECHNOLOGIES PLC	6,530	251.13	1,639,878.90
TRANSDIGM GROUP INC	1,577	1,059.92	1,671,493.84
UNITED RENTALS INC	1,959	576.90	1,130,147.10
VERTIV HOLDINGS CO	9,385	52.82	495,715.70
WABTEC CORP	4,863	129.50	629,758.50
WATSCO INC	883	387.31	341,994.73
WW GRAINGER INC	1,291	871.24	1,124,770.84
XYLEM INC	6,944	111.70	775,644.80
AUTOMATIC DATA PROCESSING	11,731	238.44	2,797,139.64
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	3,796	129.15	490,253.40
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	3,189	206.07	657,157.23
CERIDIAN HCM HOLDING INC	4,446	68.67	305,306.82
CINTAS CORP	2,618	597.95	1,565,433.10
COPART INC	24,655	48.65	1,199,465.75
EQUIFAX INC	3,523	247.42	871,660.66
JACOBS SOLUTIONS INC	3,361	134.09	450,676.49
LEIDOS HOLDINGS INC	3,453	110.16	380,382.48
PAYCHEX INC	9,307	121.89	1,134,430.23

PAYCOM SOFTWARE INC	1,637	193.42	316,628.54
PAYLOCITY HOLDING CORP	1,263	158.04	199,604.52
REPUBLIC SERVICES INC	6,342	169.34	1,073,954.28
ROBERT HALF INC	2,833	81.09	229,727.97
ROLLINS INC	7,960	43.29	344,588.40
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	5,673	60.94	345,712.62
TRANSUNION	5,814	69.57	404,479.98
VERALTO CORP	6,200	76.26	472,812.00
VERISK ANALYTICS INC	4,157	244.65	1,017,010.05
WASTE CONNECTIONS INC	7,378	151.80	1,119,980.40
WASTE MANAGEMENT INC	11,548	183.80	2,122,522.40
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	3,329	85.57	284,862.53
CSX CORP	57,271	34.39	1,969,549.69
DELTA AIR LINES INC	3,957	38.19	151,117.83
EXPEDITORS INTL WASH INC	4,290	127.18	545,602.20
FEDEX CORP	6,826	249.73	1,704,656.98
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	46,934	3.17	148,780.78
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	2,293	203.71	467,107.03
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	4,870	56.98	277,492.60
NORFOLK SOUTHERN CORP	6,494	237.07	1,539,532.58
OLD DOMINION FREIGHT LINE	2,822	391.68	1,105,320.96
SOUTHWEST AIRLINES CO	3,155	31.11	98,152.05
U-HAUL HOLDING CO	2,277	63.47	144,521.19
UBER TECHNOLOGIES INC	52,372	63.76	3,339,238.72
UNION PACIFIC CORP	17,343	242.33	4,202,729.19
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	20,599	156.58	3,225,391.42
APTIV PLC	7,761	83.08	644,783.88
BORGWARNER INC	6,496	33.27	216,121.92
FORD MOTOR CO	113,010	11.03	1,246,500.30
GENERAL MOTORS CO	39,510	34.70	1,370,997.00
LEAR CORP	1,641	130.39	213,969.99
LUCID GROUP INC	24,463	2.82	68,985.66
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	17,047	15.34	261,500.98
TESLA INC	81,128	207.83	16,860,832.24
DECKERS OUTDOOR CORP	699	750.62	524,683.38
DR HORTON INC	8,734	139.21	1,215,860.14
GARMIN LTD	4,463	125.11	558,365.93
HASBRO INC	3,664	48.12	176,311.68
LENNAR CORP-A	7,195	145.12	1,044,138.40
LULULEMON ATHLETICA INC	3,304	474.84	1,568,871.36
NIKE INC -CL B	34,873	100.76	3,513,803.48
NVR INC	88	6,857.43	603,453.84
PULTEGROUP INC	6,015	102.36	615,695.40

VF CORP	8,818	16.81	148,230.58
AIRBNB INC-CLASS A	12,166	141.19	1,717,717.54
BOOKING HOLDINGS INC	1,015	3,496.75	3,549,201.25
CAESARS ENTERTAINMENT INC	6,097	44.09	268,816.73
CARNIVAL CORP	29,139	16.08	468,555.12
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	787	2,334.80	1,837,487.60
DARDEN RESTAURANTS INC	3,473	161.66	561,445.18
DOMINO'S PIZZA INC	1,009	421.77	425,565.93
DOORDASH INC - A	7,356	107.12	787,974.72
DRAFTKINGS INC-CL A	10,834	38.46	416,675.64
EXPEDIA GROUP INC	3,721	148.57	552,828.97
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	7,471	187.57	1,401,335.47
HYATT HOTELS CORP - CL A	1,264	130.76	165,280.64
LAS VEGAS SANDS CORP	10,956	49.64	543,855.84
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	7,234	237.87	1,720,751.58
MCDONALD'S CORP	20,709	300.44	6,221,811.96
MGM RESORTS INTERNATIONAL	7,436	42.86	318,706.96
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	6,981	125.49	876,045.69
STARBUCKS CORP	32,600	92.04	3,000,504.00
VAIL RESORTS INC	1,148	224.51	257,737.48
WYNN RESORTS LTD	2,915	94.29	274,855.35
YUM! BRANDS INC	8,023	129.44	1,038,497.12
ALPHABET INC-CL A	168,448	148.70	25,048,217.60
ALPHABET INC-CL C	148,242	150.35	22,288,184.70
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	2,803	371.39	1,041,006.17
COMCAST CORP-CLASS A	117,138	43.80	5,130,644.40
ELECTRONIC ARTS INC	7,415	137.86	1,022,231.90
FOX CORP - CLASS A	7,650	31.41	240,286.50
FOX CORP- CLASS B	2,680	29.06	77,880.80
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	11,702	32.23	377,155.46
LIBERTY BROADBAND-C	3,126	78.16	244,328.16
LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	5,771	68.26	393,928.46
LIBERTY MEDIA CORP-LIBER-NEW	3,736	31.14	116,339.04
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	4,305	89.35	384,651.75
MATCH GROUP INC	8,454	36.94	312,290.76
META PLATFORMS INC-CLASS A	63,104	390.70	24,654,732.80
NETFLIX INC	12,605	544.87	6,868,086.35
NEWS CORP - CLASS A	9,625	24.63	237,063.75
OMNICOM GROUP	5,781	89.15	515,376.15
PARAMOUNT GLOBAL	13,751	13.36	183,713.36
PINTEREST INC- CLASS A	16,150	36.52	589,798.00
ROBLOX CORP -CLASS A	11,628	40.82	474,654.96
ROKU INC	3,276	88.23	289,041.48

SEA LTD-ADR	10,890	39.26	427,541.40
SIRIUS XM HOLDINGS INC	18,628	5.42	100,963.76
SNAP INC - A	28,084	16.32	458,330.88
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	4,914	165.90	815,232.60
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	12,897	69.65	898,276.05
WALT DISNEY CO/THE	52,087	93.50	4,870,134.50
WARNER BROS DISCOVERY INC	62,552	10.41	651,166.32
AMAZON.COM INC	263,558	156.87	41,344,343.46
AUTOZONE INC	511	2,751.62	1,406,077.82
BATH & BODY WORKS INC	5,832	41.14	239,928.48
BEST BUY CO INC	5,706	73.33	418,420.98
BURLINGTON STORES INC	1,834	190.83	349,982.22
CARMAX INC	4,798	67.45	323,625.10
DICK'S SPORTING GOODS INC	1,663	150.79	250,763.77
EBAY INC	15,410	41.61	641,210.10
ETSY INC	3,342	68.32	228,325.44
GENUINE PARTS CO	3,804	141.67	538,912.68
GLOBAL-E ONLINE LTD	2,458	37.09	91,167.22
HOME DEPOT INC	28,411	347.27	9,866,287.97
LKQ CORP	7,165	47.46	340,050.90
LOWE'S COS INC	16,433	210.55	3,459,968.15
MERCADOLIBRE INC	1,287	1,762.70	2,268,594.90
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	1,722	1,018.45	1,753,770.90
POOL CORP	1,138	380.90	433,464.20
ROSS STORES INC	9,702	138.73	1,345,958.46
TJX COMPANIES INC	32,596	94.95	3,094,990.20
TRACTOR SUPPLY COMPANY	2,960	226.03	669,048.80
ULTA BEAUTY INC	1,348	478.77	645,381.96
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	10,094	21.83	220,352.02
COSTCO WHOLESALE CORP	12,583	686.51	8,638,355.33
DOLLAR GENERAL CORP	6,331	130.67	827,271.77
DOLLAR TREE INC	6,035	130.16	785,515.60
KROGER CO	19,694	46.10	907,893.40
SYSCO CORP	14,497	74.99	1,087,130.03
TARGET CORP	13,200	139.20	1,837,440.00
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	19,846	22.37	443,955.02
WALMART INC	42,091	160.50	6,755,605.50
ALTRIA GROUP INC	50,686	39.93	2,023,891.98
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	15,409	52.63	810,975.67
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	9,052	54.56	493,877.12
BUNGE GLOBAL SA	3,961	89.11	352,964.71
CAMPBELL SOUP CO	5,192	44.12	229,071.04
CELSIUS HOLDINGS INC	4,118	52.87	217,718.66

COCA-COLA CO/THE	116,789	58.91	6,880,039.99
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	5,522	67.55	373,011.10
CONAGRA BRANDS INC	12,600	29.41	370,566.00
CONSTELLATION BRANDS INC-A	4,744	247.41	1,173,713.04
DARLING INGREDIENTS INC	4,506	42.29	190,558.74
GENERAL MILLS INC	16,709	63.64	1,063,360.76
HERSHEY CO/THE	4,323	189.31	818,387.13
HORMEL FOODS CORP	7,411	30.40	225,294.40
JM SMUCKER CO/THE	3,098	129.74	401,934.52
KELLANOVA	7,243	53.47	387,283.21
KEURIG DR PEPPER INC	30,163	31.14	939,275.82
KRAFT HEINZ CO/THE	24,756	36.82	911,515.92
LAMB WESTON HOLDINGS INC	3,850	105.85	407,522.50
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	6,780	65.78	445,988.40
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	5,126	61.11	313,249.86
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	38,786	73.95	2,868,224.70
MONSTER BEVERAGE CORP	22,530	55.07	1,240,727.10
PEPSICO INC	39,091	165.60	6,473,469.60
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	44,191	90.88	4,016,078.08
TYSON FOODS INC-CL A	7,546	53.18	401,296.28
CHURCH & DWIGHT CO INC	6,583	97.10	639,209.30
CLOROX COMPANY	3,403	139.73	475,501.19
COLGATE-PALMOLIVE CO	22,379	80.08	1,792,110.32
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	6,647	126.16	838,585.52
KENVUE INC	49,270	20.43	1,006,586.10
KIMBERLY-CLARK CORP	9,659	118.04	1,140,148.36
PROCTER & GAMBLE CO/THE	66,925	152.12	10,180,631.00
ABBOTT LABORATORIES	49,345	110.77	5,465,945.65
ALIGN TECHNOLOGY INC	1,957	257.07	503,085.99
BAXTER INTERNATIONAL INC	13,900	37.88	526,532.00
BECTON DICKINSON AND CO	8,283	234.57	1,942,943.31
BOSTON SCIENTIFIC CORP	41,744	59.92	2,501,300.48
CARDINAL HEALTH INC	6,878	104.36	717,788.08
CENCORA INC	4,900	217.38	1,065,162.00
CENTENE CORP	15,519	75.48	1,171,374.12
CIGNA GROUP/THE	8,437	304.50	2,569,066.50
COOPER COS INC/THE	1,338	379.93	508,346.34
CVS HEALTH CORP	36,601	74.19	2,715,428.19
DAVITA INC	1,655	104.46	172,881.30
DEXCOM INC	11,102	127.42	1,414,616.84
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	17,413	72.54	1,263,139.02
ELEVANCE HEALTH INC	6,712	473.67	3,179,273.04
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES I	11,782	71.55	843,002.10

HCA HEALTHCARE INC	5,832	278.93	1,626,719.76
HENRY SCHEIN INC	3,593	73.26	263,223.18
HOLOGIC INC	7,116	74.09	527,224.44
HUMANA INC	3,543	402.40	1,425,703.20
IDEXX LABORATORIES INC	2,379	520.21	1,237,579.59
INSULET CORP	1,978	201.19	397,953.82
INTUITIVE SURGICAL INC	10,003	370.07	3,701,810.21
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	2,566	223.35	573,116.10
MCKESSON CORP	3,853	485.00	1,868,705.00
MEDTRONIC PLC	37,893	84.72	3,210,294.96
MOLINA HEALTHCARE INC	1,686	366.35	617,666.10
QUEST DIAGNOSTICS INC	3,266	127.76	417,264.16
RESMED INC	4,245	171.78	729,206.10
STERIS PLC	2,665	214.85	572,575.25
STRYKER CORP	9,737	307.75	2,996,561.75
TELEFLEX INC	1,243	241.96	300,756.28
UNITEDHEALTH GROUP INC	26,306	513.23	13,501,028.38
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	1,578	153.35	241,986.30
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	4,169	209.09	871,696.21
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	6,028	120.52	726,494.56
ABBVIE INC	50,142	164.22	8,234,319.24
AGILENT TECHNOLOGIES INC	8,380	129.78	1,087,556.40
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	3,600	185.20	666,720.00
AMGEN INC	15,210	305.50	4,646,655.00
AVANTOR INC	17,912	22.07	395,317.84
BIO-RAD LABORATORIES-A	545	316.56	172,525.20
BIO-TECHNE CORP	4,760	71.06	338,245.60
BIOGEN INC	4,150	247.16	1,025,714.00
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	4,978	92.31	459,519.18
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	59,475	50.24	2,988,024.00
CATALENT INC	5,423	49.66	269,306.18
CHARLES RIVER LABORATORIES	1,351	213.11	287,911.61
DANAHER CORP	19,947	228.61	4,560,083.67
ELI LILLY & CO	22,910	633.70	14,518,067.00
EXACT SCIENCES CORP	5,434	64.22	348,971.48
GILEAD SCIENCES INC	35,469	79.53	2,820,849.57
ILLUMINA INC	4,250	141.01	599,292.50
INCYTE CORP	5,518	60.84	335,715.12
IQVIA HOLDINGS INC	5,243	212.88	1,116,129.84
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	1,672	123.14	205,890.08
JOHNSON & JOHNSON	68,386	158.96	10,870,638.56
MERCK & CO. INC.	72,083	118.88	8,569,227.04
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	591	1,204.81	712,042.71

MODERNA INC	9,278	101.11	938,098.58
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	2,714	140.11	380,258.54
PFIZER INC	160,550	28.33	4,548,381.50
REGENERON PHARMACEUTICALS	3,039	948.24	2,881,701.36
REPLIGEN CORP	1,593	181.75	289,527.75
REVVITY INC	3,596	106.91	384,448.36
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	9,995	29.08	290,654.60
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	29,745	11.97	356,047.65
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	10,969	539.99	5,923,150.31
UNITED THERAPEUTICS CORP	1,321	218.81	289,048.01
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	7,346	427.56	3,140,855.76
VIATRIS INC	34,753	11.72	407,305.16
WATERS CORP	1,566	312.42	489,249.72
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	1,991	348.71	694,281.61
ZOETIS INC	13,113	186.07	2,439,935.91
BANK OF AMERICA CORP	203,118	32.98	6,698,831.64
CITIGROUP INC	54,762	53.26	2,916,624.12
CITIZENS FINANCIAL GROUP	13,580	33.68	457,374.40
FIFTH THIRD BANCORP	19,507	34.70	676,892.90
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	293	1,423.62	417,120.66
HUNTINGTON BANCSHARES INC	38,289	13.08	500,820.12
JPMORGAN CHASE & CO	82,493	170.50	14,065,056.50
KEYCORP	25,737	14.44	371,642.28
M & T BANK CORP	4,757	142.68	678,728.76
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	11,342	150.23	1,703,908.66
REGIONS FINANCIAL CORP	24,798	19.25	477,361.50
TRUIST FINANCIAL CORP	37,970	37.55	1,425,773.50
US BANCORP	43,651	42.48	1,854,294.48
WELLS FARGO & CO	103,948	49.49	5,144,386.52
ALLY FINANCIAL INC	8,203	36.48	299,245.44
AMERICAN EXPRESS CO	17,830	185.82	3,313,170.60
AMERIPRISE FINANCIAL INC	2,945	389.46	1,146,959.70
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	11,387	98.08	1,116,836.96
ARES MANAGEMENT CORP - A	4,738	117.47	556,572.86
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	22,321	54.91	1,225,646.11
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	37,149	376.59	13,989,941.91
BLACKROCK INC	4,252	785.75	3,341,009.00
BLACKSTONE INC	20,243	120.63	2,441,913.09
BLOCK INC	15,782	62.57	987,479.74
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	10,920	131.09	1,431,502.80
CARLYLE GROUP INC/THE	6,287	39.73	249,782.51
CBOE GLOBAL MARKETS INC	2,873	188.80	542,422.40
CME GROUP INC	10,268	204.27	2,097,444.36

COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	4,943	121.34	599,783.62
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	6,902	101.22	698,620.44
EQUITABLE HOLDINGS INC	9,273	33.21	307,956.33
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,023	470.85	481,679.55
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	17,016	61.06	1,038,996.96
FISERV INC	17,386	140.00	2,434,040.00
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	2,038	287.40	585,721.20
FRANKLIN RESOURCES INC	7,382	26.88	198,428.16
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	1,496	49.11	73,468.56
GLOBAL PAYMENTS INC	7,473	130.01	971,564.73
GOLDMAN SACHS GROUP INC	9,387	379.40	3,561,427.80
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	16,335	127.04	2,075,198.40
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	2,076	166.63	345,923.88
KKR & CO INC	16,466	83.34	1,372,276.44
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	2,100	242.07	508,347.00
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,139	274.89	313,099.71
MASTERCARD INC-CLASS A	23,901	438.70	10,485,368.70
MOODY'S CORP	4,718	389.94	1,839,736.92
MORGAN STANLEY	35,406	87.57	3,100,503.42
MSCI INC	2,267	558.46	1,266,028.82
NASDAQ INC	9,140	58.20	531,948.00
NORTHERN TRUST CORP	5,559	80.88	449,611.92
PAYPAL HOLDINGS INC	29,803	63.02	1,878,185.06
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	5,484	112.53	617,114.52
ROBINHOOD MARKETS INC - A	11,055	10.81	119,504.55
S&P GLOBAL INC	9,261	445.90	4,129,479.90
SCHWAB (CHARLES) CORP	42,887	63.48	2,722,466.76
SEI INVESTMENTS COMPANY	2,972	64.59	191,961.48
STATE STREET CORP	9,083	73.84	670,688.72
SYNCHRONY FINANCIAL	11,238	37.97	426,706.86
T ROWE PRICE GROUP INC	6,092	109.75	668,597.00
TOAST INC-CLASS A	8,567	16.29	139,556.43
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	2,965	97.82	290,036.30
VISA INC-CLASS A SHARES	45,636	271.65	12,397,019.40
AFLAC INC	16,142	85.00	1,372,070.00
ALLSTATE CORP	7,492	157.42	1,179,390.64
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	2,173	120.32	261,455.36
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	20,359	69.16	1,408,028.44
AON PLC	5,791	304.06	1,760,811.46
ARCH CAPITAL GROUP LTD	10,718	80.13	858,833.34
ARTHUR J GALLAGHER & CO	6,160	239.07	1,472,671.20
ASSURANT INC	1,479	169.59	250,823.61
BROWN & BROWN INC	6,984	77.60	541,958.40

CHUBB LTD	11,701	241.58	2,826,727.58
CINCINNATI FINANCIAL CORP	4,189	112.95	473,147.55
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	663	338.55	224,458.65
EVEREST GROUP LTD	1,143	375.01	428,636.43
FNF GROUP	6,744	49.53	334,030.32
GLOBE LIFE INC	2,856	122.04	348,546.24
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	8,392	86.42	725,236.64
LOEWS CORP	5,561	73.09	406,453.49
MARKEL GROUP INC	332	1,468.78	487,634.96
MARSH & MCLENNAN COS	14,070	198.69	2,795,568.30
METLIFE INC	18,295	69.68	1,274,795.60
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	6,997	79.90	559,060.30
PROGRESSIVE CORP	16,671	178.36	2,973,439.56
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	10,404	104.79	1,090,235.16
TRAVELERS COS INC/THE	6,550	210.98	1,381,919.00
WILLIS TOWERS WATSON PLC	3,017	250.99	757,236.83
WR BERKLEY CORP	5,648	77.69	438,793.12
ACCENTURE PLC-CL A	17,833	368.90	6,578,593.70
ADOBE INC	12,934	606.48	7,844,212.32
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	4,382	123.76	542,316.32
ANSYS INC	2,490	339.57	845,529.30
ASPEN TECHNOLOGY INC	677	204.79	138,642.83
ATLASSIAN CORP-CL A	4,441	243.08	1,079,518.28
AUTODESK INC	6,103	252.66	1,541,983.98
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	5,957	50.52	300,947.64
BILL HOLDINGS INC	2,332	73.17	170,632.44
CADENCE DESIGN SYS INC	7,745	294.91	2,284,077.95
CHECK POINT SOFTWARE TECH	2,485	157.34	390,989.90
CLOUDFLARE INC - CLASS A	8,004	82.33	658,969.32
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	14,450	76.95	1,111,927.50
CONFLUENT INC-CLASS A	4,264	22.27	94,959.28
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	6,447	300.28	1,935,905.16
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,262	231.72	292,430.64
DATADOG INC - CLASS A	7,285	122.58	892,995.30
DOCUSIGN INC	5,725	62.47	357,640.75
DROPBOX INC-CLASS A	6,720	32.40	217,728.00
DYNATRACE INC	6,741	58.65	395,359.65
EPAM SYSTEMS INC	1,534	288.33	442,298.22
FAIR ISAAC CORP	675	1,275.55	860,996.25
FORTINET INC	19,090	66.11	1,262,039.90
GARTNER INC	2,257	463.08	1,045,171.56
GEN DIGITAL INC	16,224	23.50	381,264.00
GODADDY INC - CLASS A	4,144	108.35	449,002.40

HUBSPOT INC	1,364	585.70	798,894.80
INTL BUSINESS MACHINES CORP	25,903	173.93	4,505,308.79
INTUIT INC	7,967	636.18	5,068,446.06
MANHATTAN ASSOCIATES INC	1,676	221.15	370,647.40
MICROSOFT CORP	200,291	402.56	80,629,144.96
MONDAY.COM LTD	726	209.71	152,249.46
MONGODB INC	2,047	410.11	839,495.17
OKTA INC	4,195	85.06	356,826.70
ORACLE CORP	46,721	114.31	5,340,677.51
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	52,921	16.75	886,426.75
PALO ALTO NETWORKS INC	8,783	340.24	2,988,327.92
PTC INC	3,246	178.71	580,092.66
ROPER TECHNOLOGIES INC	3,045	547.77	1,667,959.65
SALESFORCE INC	27,641	276.88	7,653,240.08
SERVICENOW INC	5,809	763.42	4,434,706.78
SNOWFLAKE INC-CLASS A	8,000	203.81	1,630,480.00
SPLUNK INC	4,362	153.25	668,476.50
SYNOPSYS INC	4,333	540.46	2,341,813.18
TWILIO INC - A	5,166	72.80	376,084.80
TYLER TECHNOLOGIES INC	1,216	439.29	534,176.64
UIPATH INC - CLASS A	9,453	22.63	213,921.39
UNITY SOFTWARE INC	7,208	33.03	238,080.24
VERISIGN INC	2,679	203.98	546,462.42
WIX.COM LTD	1,473	128.50	189,280.50
WORKDAY INC-CLASS A	5,906	295.50	1,745,223.00
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	6,246	69.04	431,223.84
ZSCALER INC	2,546	241.38	614,553.48
AMPHENOL CORP-CL A	17,066	100.66	1,717,863.56
APPLE INC	443,671	194.50	86,294,009.50
ARISTA NETWORKS INC	7,521	262.47	1,974,036.87
CDW CORP/DE	3,865	226.33	874,765.45
CISCO SYSTEMS INC	115,198	51.31	5,910,809.38
CORNING INC	23,448	30.37	712,115.76
DELL TECHNOLOGIES -C	6,963	83.71	582,872.73
F5 INC	1,530	181.33	277,434.90
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	35,054	15.76	552,451.04
HP INC	25,711	29.56	760,017.16
JABIL INC	3,820	123.93	473,412.60
JUNIPER NETWORKS INC	9,736	37.19	362,081.84
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	4,836	155.22	750,643.92
MOTOROLA SOLUTIONS INC	4,782	328.35	1,570,169.70
NETAPP INC	6,083	88.69	539,501.27
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	5,475	89.17	488,205.75

SUPER MICRO COMPUTER INC	1,390	470.19	653,564.10
TE CONNECTIVITY LTD	9,013	143.63	1,294,537.19
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	1,279	417.92	534,519.68
TRIMBLE INC	7,523	50.74	381,717.02
WESTERN DIGITAL CORP	9,457	58.03	548,789.71
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	1,301	254.17	330,675.17
AT&T INC	203,535	16.68	3,394,963.80
LIBERTY GLOBAL LTD-C	6,233	20.69	128,960.77
T-MOBILE US INC	15,090	162.00	2,444,580.00
VERIZON COMMUNICATIONS INC	119,576	41.28	4,936,097.28
AES CORP	17,804	16.50	293,766.00
ALLIANT ENERGY CORP	7,358	48.14	354,214.12
AMEREN CORPORATION	7,154	68.36	489,047.44
AMERICAN ELECTRIC POWER	14,773	76.99	1,137,373.27
AMERICAN WATER WORKS CO INC	5,620	121.94	685,302.80
ATMOS ENERGY CORP	4,322	110.89	479,266.58
CENTERPOINT ENERGY INC	17,191	27.14	466,563.74
CMS ENERGY CORP	7,946	55.61	441,877.06
CONSOLIDATED EDISON INC	9,924	88.32	876,487.68
CONSTELLATION ENERGY	9,236	115.67	1,068,328.12
DOMINION ENERGY INC	24,011	44.15	1,060,085.65
DTE ENERGY COMPANY	5,615	102.36	574,751.40
DUKE ENERGY CORP	21,996	94.54	2,079,501.84
EDISON INTERNATIONAL	11,054	65.18	720,499.72
ENERGY CORP	5,760	97.20	559,872.00
ESSENTIAL UTILITIES INC	7,595	35.78	271,749.10
EVERGY INC	6,943	49.35	342,637.05
EVERSOURCE ENERGY	9,502	53.16	505,126.32
EXELON CORP	28,586	34.08	974,210.88
FIRSTENERGY CORP	14,826	35.96	533,142.96
NEXTERA ENERGY INC	58,408	57.01	3,329,840.08
NISOURCE INC	11,765	25.18	296,242.70
NRG ENERGY INC	6,483	52.03	337,310.49
P G & E CORP	58,233	16.53	962,591.49
PPL CORP	20,210	25.44	514,142.40
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	14,372	56.98	818,916.56
SEMPRA	18,024	70.11	1,263,662.64
SOUTHERN CO/THE	31,121	68.20	2,122,452.20
VISTRA CORP	8,462	39.23	331,964.26
WEC ENERGY GROUP INC	9,103	79.06	719,683.18
XCEL ENERGY INC	15,855	58.22	923,078.10
ADVANCED MICRO DEVICES	45,878	178.29	8,179,588.62
ANALOG DEVICES INC	14,170	198.30	2,809,911.00

	APPLIED MATERIALS INC	23,773	174.14	4,139,830.22
	BROADCOM INC	12,597	1,253.87	15,795,000.39
	ENPHASE ENERGY INC	3,595	108.07	388,511.65
	ENTEGRIS INC	4,091	123.19	503,970.29
	FIRST SOLAR INC	2,665	148.87	396,738.55
	INTEL CORP	118,953	49.09	5,839,402.77
	KLA CORP	3,878	638.45	2,475,909.10
	LAM RESEARCH CORP	3,759	848.16	3,188,233.44
	LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	3,791	68.84	260,972.44
	MARVELL TECHNOLOGY INC	24,569	72.28	1,775,847.32
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	15,514	90.56	1,404,947.84
	MICRON TECHNOLOGY INC	31,224	88.08	2,750,209.92
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	1,298	632.00	820,336.00
	NVIDIA CORP	70,093	613.62	43,010,466.66
	NXP SEMICONDUCTORS NV	7,343	221.69	1,627,869.67
	ON SEMICONDUCTOR CORP	12,324	75.15	926,148.60
	QORVO INC	2,616	105.96	277,191.36
	QUALCOMM INC	31,706	154.37	4,894,455.22
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	4,344	107.80	468,283.20
	TERADYNE INC	4,423	110.67	489,493.41
	TEXAS INSTRUMENTS INC	25,798	170.07	4,387,465.86
	CBRE GROUP INC - A	8,543	85.85	733,416.55
	COSTAR GROUP INC	11,909	83.76	997,497.84
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	20,100	3.19	64,119.00
	ZILLOW GROUP INC - C	4,581	54.34	248,931.54
	米ドル 小計	9,580,973		1,193,619,087.67 (176,488,518,302)
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	16,999	21.35	362,928.65
	CAMECO CORP	12,478	64.17	800,713.26
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	31,083	85.33	2,652,312.39
	CENOVUS ENERGY INC	38,211	20.89	798,227.79
	ENBRIDGE INC	60,553	48.03	2,908,360.59
	IMPERIAL OIL LTD	5,025	75.23	378,030.75
	KEYERA CORP	7,989	32.91	262,917.99
	MEG ENERGY CORP	8,433	24.64	207,789.12
	PARKLAND CORP	4,484	47.14	211,375.76
	PEMBINA PIPELINE CORP	14,460	46.26	668,919.60
	SUNCOR ENERGY INC	37,176	43.05	1,600,426.80
	TC ENERGY CORP	29,422	51.99	1,529,649.78
	TOURMALINE OIL CORP	8,465	58.50	495,202.50
	AGNICO EAGLE MINES LTD	14,250	66.22	943,635.00
	BARRICK GOLD CORP	50,465	21.02	1,060,774.30
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	4,929	57.71	284,452.59

FIRST QUANTUM MINERALS LTD	14,762	12.43	183,491.66
FRANCO-NEVADA CORP	5,544	145.52	806,762.88
IVANHOE MINES LTD-CL A	20,246	14.33	290,125.18
KINROSS GOLD CORP	35,977	7.33	263,711.41
LUNDIN MINING CORP	18,302	10.99	201,138.98
NUTRIEN LTD	14,240	69.19	985,265.60
PAN AMERICAN SILVER CORP	12,800	18.55	237,440.00
TECK RESOURCES LTD-CLS B	12,339	54.04	666,799.56
WEST FRASER TIMBER CO LTD	1,908	108.52	207,056.16
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	12,264	62.22	763,066.08
CAE INC	8,986	27.45	246,665.70
STANTEC INC	3,137	108.14	339,235.18
TOROMONT INDUSTRIES LTD	2,701	115.44	311,803.44
WSP GLOBAL INC	3,459	192.95	667,414.05
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	10,091	23.02	232,294.82
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	6,180	45.18	279,212.40
RB GLOBAL INC	5,059	83.29	421,364.11
THOMSON REUTERS CORP	4,276	202.49	865,847.24
AIR CANADA	5,799	18.38	106,585.62
CANADIAN NATL RAILWAY CO	15,915	166.39	2,648,096.85
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	26,597	105.44	2,804,387.68
TFI INTERNATIONAL INC	2,185	180.91	395,288.35
MAGNA INTERNATIONAL INC	7,184	74.42	534,633.28
BRP INC/CA- SUB VOTING	766	90.16	69,062.56
GILDAN ACTIVEWEAR INC	5,096	43.50	221,676.00
RESTAURANT BRANDS INTERN	8,009	103.00	824,927.00
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	1,869	147.28	275,266.32
DOLLARAMA INC	7,647	100.14	765,770.58
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	22,187	81.36	1,805,134.32
EMPIRE CO LTD 'A'	3,510	35.66	125,166.60
LOBLAW COMPANIES LTD	4,129	134.39	554,896.31
METRO INC	6,425	70.88	455,404.00
WESTON (GEORGE) LTD	1,755	172.49	302,719.95
SAPUTO INC	6,950	28.37	197,171.50
BANK OF MONTREAL	20,531	130.04	2,669,851.24
BANK OF NOVA SCOTIA	34,357	61.67	2,118,796.19
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	26,384	61.47	1,621,824.48
NATIONAL BANK OF CANADA	9,078	102.26	928,316.28
ROYAL BANK OF CANADA	39,662	132.34	5,248,869.08
TORONTO-DOMINION BANK	51,739	82.29	4,257,602.31
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	9,424	53.52	504,372.48
BROOKFIELD CORP	39,864	54.42	2,169,398.88
IGM FINANCIAL INC	1,623	36.38	59,044.74

	ONEX CORPORATION	2,236	103.10	230,531.60
	TMX GROUP LTD	9,244	33.98	314,111.12
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	618	1,329.58	821,680.44
	GREAT-WEST LIFECO INC	7,067	43.84	309,817.28
	IA FINANCIAL CORP INC	3,354	91.60	307,226.40
	INTACT FINANCIAL CORP	5,126	208.25	1,067,489.50
	MANULIFE FINANCIAL CORP	52,123	29.24	1,524,076.52
	POWER CORP OF CANADA	15,664	39.50	618,728.00
	SUN LIFE FINANCIAL INC	16,885	69.17	1,167,935.45
	CGI INC	5,691	146.25	832,308.75
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	575	3,657.15	2,102,861.25
	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	2,753	120.63	332,094.39
	OPEN TEXT CORP	7,726	56.68	437,909.68
	SHOPIFY INC - CLASS A	34,263	109.25	3,743,232.75
	BCE INC	1,259	55.04	69,295.36
	QUEBECOR INC -CL B	4,795	32.72	156,892.40
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	9,507	64.04	608,828.28
	TELUS CORP	14,385	24.50	352,432.50
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	20,954	7.90	165,536.60
	ALTAGAS LTD	7,887	28.20	222,413.40
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	3,622	38.08	137,925.76
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	4,470	31.00	138,570.00
	EMERA INC	7,779	48.26	375,414.54
	FORTIS INC	13,157	53.36	702,057.52
	HYDRO ONE LTD	9,349	39.27	367,135.23
	NORTHLAND POWER INC	9,030	24.80	223,944.00
	FIRSTSERVICE CORP	1,231	220.93	271,964.83
	カナダドル 小計	1,166,128		72,401,087.47 (7,913,438,860)
ユーロ	ENI SPA	67,710	14.49	981,117.90
	GALP ENERGIA SGPS SA	15,142	14.16	214,410.72
	NESTE OYJ	10,953	32.14	352,029.42
	OMV AG	4,120	38.80	159,856.00
	REPSOL SA	33,572	13.15	441,471.80
	TENARIS SA	14,065	14.98	210,693.70
	TOTALENERGIES SE	65,169	58.86	3,835,847.34
	AIR LIQUIDE SA	14,917	172.46	2,572,585.82
	AKZO NOBEL	4,402	70.74	311,397.48
	ARCELORMITTAL	13,149	25.42	334,313.32
	ARKEMA	1,842	100.35	184,844.70
	BASF SE	25,680	43.78	1,124,270.40
	COVESTRO AG	5,325	47.82	254,641.50
	DSM-FIRMENICH AG	5,414	91.20	493,756.80

EVONIK INDUSTRIES AG	5,594	17.04	95,349.73
HEIDELBERG MATERIALS AG	4,145	82.98	343,952.10
OCI NV	1,927	25.18	48,521.86
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	7,200	34.65	249,480.00
STORA ENSO OYJ-R SHS	16,656	11.71	195,041.76
SYENSQO SA	2,583	80.65	208,318.95
SYMRISE AG	3,729	92.70	345,678.30
UMICORE	6,087	21.64	131,722.68
UPM-KYMMENE OYJ	15,435	33.76	521,085.60
VOESTALPINE AG	3,524	27.90	98,319.60
WACKER CHEMIE AG	498	101.35	50,472.30
(Right)ACS ACTIVIDADES DE CONS-RTS	5,784	0.46	2,689.56
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	5,784	39.66	229,393.44
AIRBUS SE	16,905	146.74	2,480,639.70
ALSTOM	7,670	11.25	86,325.85
BOUYGUES SA	5,825	35.05	204,166.25
BRENTAG SE	4,188	79.76	334,034.88
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	13,134	63.40	832,695.60
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	14,911	32.35	482,370.85
DASSAULT AVIATION SA	468	173.40	81,151.20
EIFFAGE	2,234	98.96	221,076.64
FERROVIAL SE	13,882	34.90	484,481.80
GEA GROUP AG	5,204	35.96	187,135.84
IMCD NV	1,562	142.05	221,882.10
KINGSPAN GROUP PLC	4,208	73.76	310,382.08
KNORR-BREMSE AG	2,028	57.48	116,569.44
KONE OYJ-B	9,939	44.53	442,583.67
LEGRAND SA	7,224	90.62	654,638.88
LEONARDO SPA	11,946	16.36	195,436.56
METSO CORPORATION	20,109	9.41	189,225.69
MTU AERO ENGINES AG	1,567	217.70	341,135.90
PRYSMIAN SPA	7,461	40.78	304,259.58
RATIONAL AG	150	717.00	107,550.00
RHEINMETALL AG	1,200	331.70	398,040.00
SAFRAN SA	9,773	171.36	1,674,701.28
SCHNEIDER ELECTRIC SE	15,512	182.50	2,830,940.00
SIEMENS AG-REG	21,677	167.50	3,630,897.50
SIEMENS ENERGY AG	13,258	13.56	179,844.77
THALES SA	3,072	134.50	413,184.00
VINCI SA	14,513	117.42	1,704,116.46
WARTSILA OYJ ABP	15,672	13.38	209,691.36
BUREAU VERITAS SA	9,548	24.45	233,448.60
RANDSTAD NV	3,070	52.38	160,806.60

TELEPERFORMANCE	1,798	153.20	275,453.60
WOLTERS KLUWER	7,147	139.20	994,862.40
ADP	1,006	120.60	121,323.60
AENA SME SA	2,200	161.75	355,850.00
DEUTSCHE GROUP AG	28,530	44.97	1,283,136.75
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	15,976	7.68	122,775.56
GETLINK	10,511	16.19	170,225.64
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	9,285	93.55	868,611.75
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	1,607	87.60	140,773.20
CONTINENTAL AG	2,802	72.88	204,209.76
DR ING HC F PORSCHE AG	3,475	75.34	261,806.50
FERRARI NV	3,632	309.20	1,123,014.40
MERCEDES-BENZ GROUP AG	23,136	60.73	1,405,049.28
MICHELIN(CGDE)	19,791	30.84	610,354.44
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	3,959	45.61	180,569.99
RENAULT SA	5,408	34.80	188,225.44
STELLANTIS NV	63,669	19.56	1,245,620.31
VOLKSWAGEN AG	591	127.60	75,411.60
VOLKSWAGEN AG-PREF	6,053	116.00	702,148.00
ADIDAS AG	4,718	166.14	783,848.52
HERMES INTERNATIONAL	907	1,831.80	1,661,442.60
KERING	2,155	364.75	786,036.25
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	7,857	683.40	5,369,473.80
MONCLER SPA	5,451	51.96	283,233.96
PUMA SE	2,836	38.49	109,157.64
SEB SA	417	106.40	44,368.80
ACCOR SA	6,007	36.20	217,453.40
AMADEUS IT GROUP SA	12,929	64.84	838,316.36
DELIVERY HERO SE	4,095	23.47	96,130.12
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	2,283	36.20	82,644.60
SODEXO	2,449	100.95	247,226.55
BOLLORE SE	14,850	5.84	86,724.00
PUBLICIS GROUPE	6,295	88.76	558,744.20
SCOUT24 SE	2,465	66.80	164,662.00
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	22,291	27.47	612,333.77
VIVENDI	20,767	9.97	207,088.52
D'IETEREN GROUP	470	184.20	86,574.00
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	31,272	39.01	1,219,920.72
PROSUS NV	42,105	27.98	1,178,097.90
ZALANDO SE	5,907	18.20	107,536.93
CARREFOUR SA	15,170	15.86	240,672.05
HELLOFRESH SE	5,039	12.97	65,355.83
JERONIMO MARTINS	6,820	21.02	143,356.40

KESKO OYJ-B SHS	7,834	17.13	134,196.42
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N.V.	27,899	25.95	724,118.54
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	25,087	57.76	1,449,025.12
DANONE	18,495	61.35	1,134,668.25
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	20,931	9.02	188,797.62
HEINEKEN HOLDING NV	3,344	75.85	253,642.40
HEINEKEN NV	8,349	90.74	757,588.26
JDE PEET'S BV	3,184	22.42	71,385.28
KERRY GROUP PLC-A	4,388	79.70	349,723.60
LOTUS BAKERIES	11	7,820.00	86,020.00
PERNOD RICARD SA	5,898	144.05	849,606.90
REMY COINTREAU	644	88.00	56,672.00
BEIERSDORF AG	2,823	132.40	373,765.20
HENKEL AG & CO KGAA	2,848	63.76	181,588.48
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	4,445	71.44	317,550.80
L'OREAL	6,864	429.00	2,944,656.00
AMPLIFON SPA	3,038	29.88	90,775.44
BIOMERIEUX	820	103.50	84,870.00
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	869	98.00	85,162.00
DIASORIN ITALIA SPA	614	84.48	51,870.72
ESSILORLUXOTTICA	8,437	177.56	1,498,073.72
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	5,474	36.83	201,607.42
FRESENIUS SE & CO KGAA	11,575	26.57	307,547.75
KONINKLIJKE PHILIPS NV	21,802	21.13	460,676.26
SIEMENS HEALTHINEERS AG	7,641	51.20	391,219.20
ARGENX SE	1,740	336.80	586,032.00
BAYER AG-REG	28,356	32.62	925,114.50
EUROFINS SCIENTIFIC	4,329	56.74	245,627.46
GRIFOLS SA	8,799	9.49	83,555.30
IPSEN	693	107.80	74,705.40
MERCK KGAA	3,494	146.85	513,093.90
ORION OYJ-CLASS B	2,913	43.60	127,006.80
QIAGEN N.V.	6,261	40.52	253,695.72
RECORDATI SPA	3,050	49.94	152,317.00
SANOFI	32,407	92.55	2,999,267.85
SARTORIUS AG-VORZUG	784	300.00	235,200.00
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	663	221.30	146,721.90
UCB SA	3,855	86.84	334,768.20
ABN AMRO BANK NV-CVA	13,957	13.60	189,884.98
AIB GROUP PLC	51,212	4.01	205,667.39
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	170,067	8.22	1,398,971.14
BANCO BPM SPA	35,886	4.95	177,958.67
BANCO SANTANDER SA	460,979	3.72	1,718,760.20

BANK OF IRELAND GROUP PLC	30,522	8.23	251,440.23
BNP PARIBAS	29,923	61.99	1,854,926.77
CAIXABANK S.A	118,777	3.93	467,506.27
COMMERZBANK AG	29,203	10.79	315,100.37
CREDIT AGRICOLE SA	29,943	13.38	400,637.34
ERSTE GROUP BANK AG	9,433	39.88	376,188.04
FINECOBANK SPA	17,182	13.74	236,166.59
ING GROEP NV-CVA	103,461	13.04	1,349,752.20
INTESA SANPAOLO	443,944	2.83	1,258,359.26
KBC GROEP NV	7,180	60.50	434,390.00
MEDIOBANCA SPA	14,388	12.09	173,950.92
NORDEA BANK ABP	91,496	11.26	1,030,793.93
SOCIETE GENERALE SA	21,270	23.68	503,673.60
UNICREDIT SPA	45,891	26.99	1,238,827.54
ADYEN NV	594	1,183.60	703,058.40
AMUNDI SA	1,142	63.80	72,859.60
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	53,160	12.16	646,638.24
DEUTSCHE BOERSE AG	5,487	186.75	1,024,697.25
EDENRED	7,302	55.96	408,619.92
EURAZEO	846	75.80	64,126.80
EURONEXT NV	2,215	80.80	178,972.00
EXOR NV	2,777	87.26	242,321.02
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	2,398	69.68	167,092.64
NEXI SPA	14,056	7.37	103,648.94
SOFINA	272	218.40	59,404.80
WORLDLINE SA	6,107	14.15	86,444.58
AEGON LTD	50,940	5.62	286,690.32
AGEAS	4,697	39.22	184,216.34
ALLIANZ SE-REG	11,511	248.50	2,860,483.50
ASR NEDERLAND NV	4,312	43.73	188,563.76
ASSICURAZIONI GENERALI	27,355	20.41	558,315.55
AXA SA	51,563	30.94	1,595,359.22
HANNOVER RUECK SE	1,645	227.10	373,579.50
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	3,914	396.40	1,551,509.60
NN GROUP NV	8,494	37.82	321,243.08
POSTE ITALIANE SPA	12,729	10.31	131,235.99
SAMPO OYJ-A SHS	13,100	38.31	501,926.50
TALANX AG	1,722	66.35	114,254.70
BECHTLE AG	2,142	48.64	104,186.88
CAPGEMINI SA	4,451	203.80	907,113.80
DASSAULT SYSTEMES SE	19,170	47.48	910,287.45
NEMETSCHEK SE	1,486	86.38	128,360.68
SAP SE	29,733	160.76	4,779,877.08

	NOKIA OYJ	146,126	3.14	460,150.77
	CELLNEX TELECOM SA	15,557	34.70	539,827.90
	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	92,722	23.26	2,156,713.72
	ELISA OYJ	4,366	43.52	190,008.32
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	9,768	11.15	108,913.20
	KONINKLIJKE KPN NV	99,734	3.14	313,862.89
	ORANGE	51,043	11.25	574,437.92
	TELECOM ITALIA SPA	282,105	0.28	80,174.24
	TELEFONICA SA	141,116	3.81	538,075.30
	ACCIONA SA	678	120.60	81,766.80
	CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVA	1,625	24.20	39,325.00
	E.ON SE	65,153	12.42	809,526.02
	EDP RENOVAVEIS SA	7,288	15.58	113,547.04
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	92,757	4.23	393,196.92
	ELIA GROUP SA/NV	575	108.60	62,445.00
	ENAGAS SA	6,843	15.27	104,526.82
	ENDESA SA	8,910	18.70	166,661.55
	ENEL SPA	232,853	6.31	1,470,699.54
	ENGIE	52,643	15.26	803,753.32
	FORTUM OYJ	10,734	12.60	135,302.07
	IBERDROLA SA	175,180	11.12	1,948,877.50
	NATURGY ENERGY GROUP SA	3,070	25.56	78,469.20
	REDEIA CORP SA	13,475	14.98	201,922.87
	RWE AG	17,380	36.72	638,193.60
	SNAM SPA	53,892	4.62	249,358.28
	TERNA SPA	38,984	7.70	300,332.73
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	18,656	29.13	543,449.28
	VERBUND AG	1,686	75.15	126,702.90
	ASM INTERNATIONAL NV	1,352	525.80	710,881.60
	ASML HOLDING NV	11,453	775.80	8,885,237.40
	BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	2,064	147.15	303,717.60
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	37,425	34.90	1,306,319.62
	STMICROELECTRONICS NV	19,563	42.61	833,579.43
	LEG IMMOBILIEN SE	2,018	74.34	150,018.12
	VONOVIA SE	21,981	27.52	604,917.12
	ユーロ 小計	5,165,914		137,809,345.58 (22,161,120,862)
英ポンド	BP PLC	486,185	4.52	2,202,174.95
	SHELL PLC-NEW	188,121	23.79	4,475,398.59
	ANGLO AMERICAN PLC	36,619	18.60	681,406.35
	ANTOFAGASTA PLC	9,832	16.82	165,374.24
	CRH PLC	20,260	54.46	1,103,359.60
	CRODA INTERNATIONAL PLC	4,351	45.35	197,317.85

ENDEAVOUR MINING PLC	5,026	14.37	72,223.62
GLENCORE PLC	299,354	4.17	1,248,605.53
MONDI PLC	11,896	14.29	170,053.32
RIO TINTO PLC	32,132	54.94	1,765,332.08
ASHTED GROUP PLC	12,678	48.64	616,657.92
BAE SYSTEMS PLC	87,291	11.76	1,026,978.61
BUNZL PLC	9,080	31.57	286,655.60
DCC PLC	2,603	57.08	148,579.24
MELROSE INDUSTRIES PLC	37,196	5.91	219,977.14
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	242,892	3.07	745,921.33
SMITHS GROUP PLC	8,753	16.50	144,468.26
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	2,317	96.80	224,285.60
EXPERIAN PLC	26,424	32.46	857,723.04
INTERTEK GROUP PLC	5,038	43.90	221,168.20
RELX PLC	53,930	32.63	1,759,735.90
RENTOKIL INITIAL PLC	68,450	3.93	269,076.95
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	27,219	5.34	145,512.77
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	2,907	47.77	138,867.39
BURBERRY GROUP PLC	10,857	12.90	140,109.58
PERSIMMON PLC	8,500	14.54	123,590.00
TAYLOR WIMPEY PLC	102,300	1.44	147,618.90
COMPASS GROUP PLC	49,083	21.20	1,040,559.60
ENTAIN PLC	16,920	9.75	164,970.00
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	5,088	158.90	808,483.20
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	4,829	74.46	359,567.34
PEARSON PLC	18,520	9.53	176,606.72
WHITBREAD PLC	6,021	36.09	217,297.89
AUTO TRADER GROUP PLC	29,003	7.30	211,837.91
INFORMA PLC	36,756	7.62	280,080.72
WPP PLC	31,267	7.54	235,878.24
JD SPORTS FASHION PLC	67,369	1.16	78,720.67
KINGFISHER PLC	48,904	2.25	110,278.52
NEXT PLC	3,213	83.86	269,442.18
OCADO GROUP PLC	16,747	5.76	96,529.70
SAINSBURY (J) PLC	52,374	2.83	148,532.66
TESCO PLC	193,731	2.98	578,868.22
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	10,301	23.25	239,498.25
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	60,854	23.13	1,407,857.29
COCA-COLA HBC AG-DI	5,331	23.13	123,306.03
DIAGEO PLC	64,265	26.99	1,734,833.67
IMPERIAL BRANDS PLC	23,388	19.16	448,231.02
HALEON PLC	159,842	3.13	500,864.90
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	20,515	55.14	1,131,197.10

	UNILEVER PLC	71,176	37.24	2,650,594.24
	NMC HEALTH PLC	438	0.00	0.00
	SMITH & NEPHEW PLC	25,100	10.80	271,205.50
	ASTRAZENECA PLC	44,076	104.54	4,607,705.04
	GSK PLC	116,851	15.54	1,816,799.34
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	4,453	19.48	86,744.44
	BARCLAYS PLC	433,957	1.47	639,392.24
	HSBC HOLDINGS PLC	554,151	6.04	3,352,059.39
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,820,815	0.42	767,564.56
	NATWEST GROUP PLC	158,355	2.17	344,580.48
	STANDARD CHARTERED PLC	61,177	6.09	372,812.63
	3I GROUP PLC	28,145	23.58	663,659.10
	ABRDN PLC	51,021	1.75	89,286.75
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	11,463	7.46	85,536.90
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	11,950	90.70	1,083,865.00
	M&G PLC	53,635	2.24	120,464.21
	SCHRODERS PLC	19,357	4.19	81,144.54
	ST JAMES'S PLACE PLC	12,910	6.76	87,271.60
	WISE PLC - A	16,616	8.44	140,305.50
	ADMIRAL GROUP PLC	7,507	25.02	187,825.14
	AVIVA PLC	80,281	4.36	350,025.16
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	163,168	2.53	413,467.71
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	16,924	5.10	86,346.24
	PRUDENTIAL PLC	74,924	8.33	624,566.46
	SAGE GROUP PLC/THE	27,848	11.52	320,808.96
	HALMA PLC	10,535	21.58	227,345.30
	BT GROUP PLC	167,081	1.16	194,148.12
	VODAFONE GROUP PLC	670,239	0.68	461,861.69
	CENTRICA PLC	162,387	1.44	234,486.82
	NATIONAL GRID PLC	105,833	10.33	1,093,784.05
	SEVERN TRENT PLC	8,461	25.13	212,624.93
	SSE PLC	29,718	17.40	517,093.20
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	18,553	10.31	191,374.19
	英ポンド 小計	7,765,637		52,038,363.82 (9,779,569,712)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	4,450	11.10	49,395.00
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	185	644.00	119,140.00
	GIVAUDAN-REG	265	3,317.00	879,005.00
	HOLCIM LTD	14,961	63.90	956,007.90
	SIG GROUP AG	8,857	18.47	163,588.79
	SIKA AG-REG	4,372	235.30	1,028,731.60
	ABB LTD-REG	45,761	36.28	1,660,209.08
	GEBERIT AG-REG	976	497.80	485,852.80

	SCHINDLER HOLDING AG-REG	620	199.60	123,752.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,097	208.10	228,285.70	
	VAT GROUP AG	716	411.40	294,562.40	
	ADECCO SA-REG	4,419	36.96	163,326.24	
	SGS SA-REG	4,000	75.58	302,320.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	1,539	285.70	439,692.30	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	14,958	121.40	1,815,901.20	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	867	197.85	171,535.95	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	959	37.85	36,298.15	
	AVOLTA AG	3,059	31.12	95,196.08	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	90	1,258.00	113,220.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	27	10,950.00	295,650.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	3	109,200.00	327,600.00	
	NESTLE SA-REG	75,907	95.32	7,235,455.24	
	ALCON INC	14,379	66.48	955,915.92	
	SONOVA HOLDING AG-REG	1,404	274.20	384,976.80	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	3,272	131.80	431,249.60	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	580	55.15	31,987.00	
	LONZA GROUP AG-REG	2,145	381.40	818,103.00	
	NOVARTIS AG-REG	58,281	93.53	5,451,021.93	
	ROCHE HOLDING AG-BR	863	262.80	226,796.40	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	19,981	245.15	4,898,342.15	
	SANDOZ GROUP AG	10,872	29.45	320,180.40	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	737	109.90	80,996.30	
	JULIUS BAER GROUP LTD	6,477	46.13	298,784.01	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	656	1,127.50	739,640.00	
	UBS GROUP AG-REG	93,856	25.57	2,399,897.92	
	BALOISE HOLDING AG - REG	1,130	136.60	154,358.00	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	1,070	123.30	131,931.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	858	604.40	518,575.20	
	SWISS RE AG	8,683	98.76	857,533.08	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	4,181	441.40	1,845,493.40	
	TEMENOS GROUP AG-REG	1,696	87.14	147,789.44	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	4,494	75.20	337,948.80	
	SWISSCOM AG-REG	760	515.00	391,400.00	
	BKW AG	522	136.70	71,357.40	
	SWISS PRIME SITE-REG	2,082	87.95	183,111.90	
	スイスフラン 小計	427,067		38,662,115.08 (6,612,768,163)	
スウェーデンク ローナ	BOLIDEN AB	8,974	281.80	2,528,873.20	
	HOLMEN AB-B SHARES	2,814	411.30	1,157,398.20	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	17,171	140.10	2,405,657.10	
	ALFA LAVAL AB	7,597	375.10	2,849,634.70	

ASSA ABLOY AB-B	29,041	284.20	8,253,452.20		
ATLAS COPCO AB-A SHS	77,243	170.90	13,200,828.70		
ATLAS COPCO AB-B SHS	45,487	148.20	6,741,173.40		
BEIJER REF AB	10,131	126.00	1,276,506.00		
EPIROC AB-A	17,281	187.50	3,240,187.50		
EPIROC AB-B	10,209	167.00	1,704,903.00		
HUSQVARNA AB-B SHS	8,099	79.10	640,630.90		
INDUTRADE AB	7,147	247.40	1,768,167.80		
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	2,737	258.00	706,146.00		
LIFCO AB-B SHS	8,063	251.60	2,028,650.80		
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	42,668	61.40	2,619,815.20		
SAAB AB-B	2,409	681.60	1,641,974.40		
SANDVIK AB	29,539	212.40	6,274,083.60		
SKANSKA AB-B SHS	8,250	173.00	1,427,250.00		
SKF AB-B SHARES	9,296	196.15	1,823,410.40		
VOLVO AB-A SHS	5,298	256.40	1,358,407.20		
VOLVO AB-B SHS	43,501	250.10	10,879,600.10		
SECURITAS AB-B SHS	17,598	101.05	1,778,277.90		
VOLVO CAR AB-B	10,746	26.72	287,133.12		
EVOLUTION AB	4,992	1,230.00	6,140,160.00		
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	18,218	163.22	2,973,541.96		
ESSITY AKTIEBOLAG-B	17,758	246.10	4,370,243.80		
GETINGE AB-B SHS	6,454	221.30	1,428,270.20		
SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	5,811	290.80	1,689,838.80		
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	45,806	142.90	6,545,677.40		
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	42,388	110.80	4,696,590.40		
SWEDBANK AB - A SHARES	23,817	201.70	4,803,888.90		
EQT AB	10,109	274.20	2,771,887.80		
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	3,567	323.90	1,155,351.30		
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	3,625	323.90	1,174,137.50		
INVESTOR AB-B SHS	49,865	241.25	12,029,931.25		
LUNDBERGS AB-B SHS	1,611	531.40	856,085.40		
ERICSSON LM-B SHS	85,986	60.40	5,193,554.40		
HEXAGON AB-B SHS	57,185	114.20	6,530,527.00		
TELE2 AB-B SHS	19,254	87.02	1,675,483.08		
TELIA CO AB	75,050	26.89	2,018,094.50		
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	17,865	65.68	1,173,373.20		
SAGAX AB-B	5,246	247.20	1,296,811.20		
スウェーデンクローナ 小計	915,906		145,115,609.51 (2,053,385,874)		
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	8,475	271.60	2,301,810.00	
	EQUINOR ASA	26,070	296.15	7,720,630.50	
	NORSK HYDRO ASA	39,706	62.24	2,471,301.44	

	YARA INTERNATIONAL ASA	4,955	344.90	1,708,979.50	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	1,670	526.50	879,255.00	
	ADEVINTA ASA	9,112	112.60	1,026,011.20	
	MOWI ASA	15,441	194.70	3,006,362.70	
	ORKLA ASA	18,647	83.36	1,554,413.92	
	SALMAR ASA	2,244	594.20	1,333,384.80	
	DNB BANK ASA	26,921	214.30	5,769,170.30	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	4,317	175.60	758,065.20	
	TELENOR ASA	17,808	120.75	2,150,316.00	
	ノルウェークローネ 小計	175,366		30,679,700.56 (432,890,574)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	3,077	543.80	1,673,272.60	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	5,223	357.20	1,865,655.60	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	229	1,824.50	417,810.50	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	29,352	196.46	5,766,493.92	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	78	12,750.00	994,500.00	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-B	146	12,975.00	1,894,350.00	
	DSV A/S	5,385	1,228.50	6,615,472.50	
	PANDORA A/S	2,489	989.00	2,461,621.00	
	CARLSBERG AS-B	2,655	877.20	2,328,966.00	
	COLOPLAST-B	3,785	769.40	2,912,179.00	
	DEMANT A/S	3,200	308.80	988,160.00	
	GENMAB A/S	1,795	1,886.50	3,386,267.50	
	NOVO NORDISK A/S-B	92,752	725.00	67,245,200.00	
	DANSKE BANK A/S	19,131	188.50	3,606,193.50	
	TRYG A/S	10,027	142.20	1,425,839.40	
ORSTED A/S	5,698	385.20	2,194,869.60		
	デンマーククローネ 小計	185,022		105,776,851.12 (2,281,606,678)	
オーストラリアドル	AMPOL LTD	6,343	35.32	224,034.76	
	SANTOS LTD	85,587	7.61	651,317.07	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	53,976	30.97	1,671,636.72	
	BHP GROUP LTD	143,932	46.86	6,744,653.52	
	BLUESCOPE STEEL LTD	13,389	22.81	305,403.09	
	FORTESCUE LTD	48,247	28.39	1,369,732.33	
	IGO LTD	16,726	7.45	124,608.70	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	12,919	55.98	723,205.62	
	MINERAL RESOURCES LTD	4,720	55.47	261,818.40	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	32,470	12.81	415,940.70	
	ORICA LTD	13,514	15.88	214,602.32	
	PILBARA MINERALS LTD	79,307	3.46	274,402.22	
	RIO TINTO LTD	10,575	129.02	1,364,386.50	
SOUTH32 LTD	133,593	3.34	446,200.62		

REECE LTD	5,105	22.27	113,688.35	
BRAMBLES LTD	38,743	14.72	570,296.96	
COMPUTERSHARE LTD	15,873	25.59	406,190.07	
AURIZON HOLDINGS LTD	45,292	3.70	167,580.40	
QANTAS AIRWAYS LTD	17,415	5.44	94,737.60	
TRANSURBAN GROUP	88,302	13.14	1,160,288.28	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	16,691	43.51	726,225.41	
IDP EDUCATION LTD	6,171	20.12	124,160.52	
LOTTERY CORP LTD/THE	59,224	4.85	287,236.40	
CAR GROUP LTD	10,658	32.74	348,942.92	
REA GROUP LTD	1,458	182.37	265,895.46	
SEEK LTD	10,021	25.50	255,535.50	
WESFARMERS LTD	32,373	57.50	1,861,447.50	
COLES GROUP LTD	34,879	15.72	548,297.88	
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	40,049	5.46	218,667.54	
WOOLWORTHS GROUP LTD	35,019	36.19	1,267,337.61	
TREASURY WINE ESTATES LTD	27,686	10.28	284,612.08	
COCHLEAR LTD	1,833	297.79	545,849.07	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	5,971	51.59	308,043.89	
SONIC HEALTHCARE LTD	12,546	31.47	394,822.62	
CSL LTD	13,728	291.40	4,000,339.20	
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	85,299	26.59	2,268,100.41	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	47,565	114.70	5,455,705.50	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	88,803	31.87	2,830,151.61	
WESTPAC BANKING CORP	99,597	23.56	2,346,505.32	
ASX LTD	5,710	66.32	378,687.20	
MACQUARIE GROUP LTD	10,472	186.98	1,958,054.56	
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	6,799	33.20	225,726.80	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	67,809	5.90	400,073.10	
MEDIBANK PRIVATE LTD	87,487	3.69	322,827.03	
QBE INSURANCE GROUP LTD	39,069	15.58	608,695.02	
SUNCORP GROUP LTD	35,184	14.13	497,149.92	
WISETECH GLOBAL LTD	4,798	74.90	359,370.20	
XERO LTD	4,386	113.00	495,618.00	
TELSTRA GROUP LTD	101,989	4.00	407,956.00	
APA GROUP	37,178	8.22	305,603.16	
ORIGIN ENERGY LTD	48,740	8.27	403,079.80	
オーストラリアドル 小計	1,945,220		48,005,441.46 (4,664,688,746)	
ニュージーランドドル				
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	38,815	8.58	333,032.70	
EBOS GROUP LTD	4,341	36.65	159,097.65	
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	16,964	23.95	406,287.80	
SPARK NEW ZEALAND LTD	52,094	5.31	276,619.14	

	MERCURY NZ LTD	18,009	6.49	116,878.41	
	MERIDIAN ENERGY LTD	33,959	5.65	191,868.35	
	ニュージーランドドル 小計	164,182		1,483,784.05 (134,030,213)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	82,500	39.60	3,267,000.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	38,500	89.20	3,434,200.00	
	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	52,000	7.30	379,600.00	
	MTR CORP	44,500	26.55	1,181,475.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	24,000	12.62	302,880.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	62,000	40.30	2,498,600.00	
	SANDS CHINA LTD	70,200	21.55	1,512,810.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	45,800	11.54	528,532.00	
	WH GROUP LTD	210,000	4.88	1,024,800.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	94,500	19.02	1,797,390.00	
	HANG SENG BANK LTD	22,500	83.45	1,877,625.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	35,300	239.20	8,443,760.00	
	AIA GROUP LTD	329,600	62.90	20,731,840.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	69,000	9.39	647,910.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD (CKI)	11,900	45.70	543,830.00	
	CLP HOLDINGS LTD	51,000	60.90	3,105,900.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	311,717	5.53	1,723,795.01	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	42,500	45.50	1,933,750.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	55,500	35.55	1,973,025.00	
	ESR GROUP LTD	70,200	10.58	742,716.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	45,000	9.57	430,650.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	32,916	21.20	697,819.20	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	38,000	10.40	395,200.00	
	SINO LAND CO	106,000	8.04	852,240.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	45,700	75.95	3,470,915.00		
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	13,700	62.10	850,770.00		
SWIRE PROPERTIES LTD	21,400	15.26	326,564.00		
WHARF HOLDINGS LTD	32,000	23.35	747,200.00		
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	40,000	23.25	930,000.00		
	香港ドル 小計	2,097,933		66,352,796.21 (1,254,731,376)	
シンガポールドル	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	2,400	27.03	64,872.00	
	KEPPEL LTD	47,000	6.86	322,420.00	
	SEATRUM LTD	1,253,142	0.10	132,833.05	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	33,900	3.87	131,193.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	37,300	6.53	243,569.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	178,600	0.98	175,028.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	45,400	3.29	149,366.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	51,700	31.84	1,646,128.00	

	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	97,000	12.90	1,251,300.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	34,800	27.90	970,920.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	24,000	9.70	232,800.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	241,800	2.42	585,156.00	
	SEBICORP INDUSTRIES LTD	25,700	5.39	138,523.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	82,600	2.94	242,844.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	20,000	6.28	125,600.00	
	UOL GROUP LTD	9,400	6.27	58,938.00	
	シンガポールドル 小計	2,184,742		6,471,490.05 (714,323,071)	
イスラエルシュケル	ICL GROUP LTD	24,131	17.00	410,227.00	
	ELBIT SYSTEMS LTD	724	752.00	544,448.00	
	BANK HAPOALIM BM	35,677	31.03	1,107,057.31	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	46,176	27.47	1,268,454.72	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	34,303	17.40	596,872.20	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	4,617	132.40	611,290.80	
	NICE SYSTEMS LTD	1,914	809.90	1,550,148.60	
	AZRIELI GROUP	723	238.40	172,363.20	
	イスラエルシュケル 小計	148,265		6,260,861.83 (250,139,586)	
	合 計	31,922,355		234,741,212,017 (234,741,212,017)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

## (2)株式以外の有価証券

種 類	通貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
新株予約権証券	カナダドル	(WRT)CONSTELLATION SOFTWARE INC	497.00	0.00	
		カナダドル 小計	497.00	0.00 (0)	
		新株予約権証券合計		0 (0)	
投資証券	米ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	4,491	542,378.07	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	8,191	287,012.64	
		AMERICAN TOWER CORP	13,280	2,612,972.80	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	14,925	290,291.25	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	3,860	679,475.80	
		BOSTON PROPERTIES INC	3,897	274,582.62	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	2,862	279,273.96	
		CROWN CASTLE INC	12,406	1,309,577.36	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	8,670	1,195,853.10	
		EQUINIX INC	2,669	2,122,442.18	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	5,137	336,730.35	
		EQUITY RESIDENTIAL	9,814	576,670.64	

	ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,729	405,727.14
	EXTRA SPACE STORAGE INC	6,069	891,596.79
	GAMING AND LEISURE PROPRTIE	7,625	349,987.50
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	15,625	298,906.25
	HOST HOTELS & RESORTS INC	20,316	395,349.36
	INVITATION HOMES INC	17,695	586,058.40
	IRON MOUNTAIN INC	7,969	534,002.69
	KIMCO REALTY CORP	19,501	394,115.21
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	3,188	427,383.28
	PROLOGIS INC	26,300	3,299,072.00
	PUBLIC STORAGE	4,527	1,306,990.17
	REALTY INCOME CORP	24,697	1,358,088.03
	REGENCY CENTERS CORP	4,747	295,310.87
	SBA COMMUNICATIONS CORP	2,950	670,476.00
	SIMON PROPERTY GROUP INC	9,361	1,324,487.89
	SUN COMMUNITIES INC	3,399	423,753.33
	UDR INC	9,434	346,322.14
	VENTAS INC	10,931	519,769.05
	VICI PROPERTIES INC	29,114	883,318.76
	WELLTOWER INC	14,841	1,293,096.33
	WEYERHAEUSER CO	21,072	698,115.36
	WP CAREY INC	5,737	365,504.27
	米ドル 小計	357,029	27,574,691.59 (4,077,193,898)
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	1,821	85,113.54
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	2,998	55,882.72
	カナダドル 小計	4,819	140,996.26 (15,410,891)
ユーロ	COVIVIO	968	44,605.44
	GECINA SA	1,560	163,020.00
	KLEPIERRE	7,298	171,794.92
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	3,132	208,841.76
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	4,126	108,513.80
	ユーロ 小計	17,084	696,775.92 (112,048,535)
英ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	22,154	145,330.24
	SEGRO PLC	34,080	289,611.84
	英ポンド 小計	56,234	434,942.08 (81,738,665)
オーストラリアドル	DEXUS/AU	33,935	250,779.65
	GOODMAN GROUP	48,821	1,208,807.96
	GPT GROUP	65,528	291,599.60
	MIRVAC GROUP	109,547	230,048.70

	SCENTRE GROUP	149,154	435,529.68
	STOCKLAND	75,930	331,054.80
	VICINITY CENTRES	97,692	192,941.70
	オーストラリアドル 小計	580,607	2,940,762.09 (285,753,852)
香港ドル	LINK REIT	78,700	3,116,520.00
	香港ドル 小計	78,700	3,116,520.00 (58,933,393)
シンガポールドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	106,100	315,117.00
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	151,663	304,842.63
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	110,100	179,463.00
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA	73,900	108,633.00
	シンガポールドル 小計	441,763	908,055.63 (100,231,180)
	投資証券合計		4,731,310,414 (4,731,310,414)
	合計		4,731,310,414 (4,731,310,414)

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

#### 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入新株予約権 証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式 588銘柄	97.7%			73.7%
	投資証券 34銘柄			2.3%	1.7%
カナダドル	株式 86銘柄	99.8%			3.3%
	新株予約権 証券 1銘柄				
	投資証券 2銘柄			0.2%	0.0%
ユーロ	株式 221銘柄	99.5%			9.3%
	投資証券 5銘柄			0.5%	0.0%
英ポンド	株式 82銘柄	99.2%			4.1%
	投資証券 2銘柄			0.8%	0.0%
スイスフラン	株式 45銘柄	100.0%			2.8%
スウェーデンクローナ	株式 42銘柄	100.0%			0.9%
ノルウェークローネ	株式 12銘柄	100.0%			0.2%
デンマーククローネ	株式 16銘柄	100.0%			1.0%
オーストラリアドル	株式 51銘柄	94.2%			1.9%
	投資証券 7銘柄			5.8%	0.1%
ニュージーランドドル	株式 6銘柄	100.0%			0.1%
香港ドル	株式 29銘柄	95.5%			0.5%
	投資証券 1銘柄			4.5%	0.0%
シンガポールドル	株式 16銘柄	87.7%			0.3%
	投資証券 4銘柄			12.3%	0.0%

イスラエルシュケル	株式	8銘柄	100.0%		0.1%
-----------	----	-----	--------	--	------

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

## R M新興国株式マザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

2024年 1月25日現在

資産の部	
流動資産	
預金	651,922,780
コール・ローン	93,181,002
株式	30,364,860,375
投資証券	41,698,072
派生商品評価勘定	9,718,067
未収入金	117,588,700
未収配当金	23,172,328
差入委託証拠金	657,589,911
流動資産合計	31,959,731,235
資産合計	31,959,731,235
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	13,329,885
未払金	40,860,567
未払解約金	5,221,900
未払利息	252
流動負債合計	59,412,604
負債合計	59,412,604
純資産の部	
元本等	
元本	17,965,166,119
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	13,935,152,512
元本等合計	31,900,318,631
純資産合計	31,900,318,631
負債純資産合計	31,959,731,235

### 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 1月25日現在

1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 1月26日
期首元本額	13,107,003,203円
期中追加設定元本額	6,709,374,769円
期中一部解約元本額	1,851,211,853円
期末元本額	17,965,166,119円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	572,041,338円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	2,532,894,373円
りそなラップ型ファンド(成長型)	2,489,470,479円
DCりそな グローバルバランス	17,083,870円
つみたてバランスファンド	1,201,105,702円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	506,268,455円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	393,997,871円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	274,199,522円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	144,442,806円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	98,210,394円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	56,096,691円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	130,397,827円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	141,112,436円
九州SDGs・グローバルバランス	71,299,628円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定型)	4,155,712円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定成長型)	106,467,505円
ラップ型ファンド・プラスESG(成長型)	211,979,937円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定型)	19,277,828円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定成長型)	51,425,541円
りそな つみたてラップ型ファンド(成長型)	55,016,506円
りそな つみたてリスクコントロールファンド	2,500,771円
ターゲットリターンバランスファンド(目標2%)	344,464円
ターゲットリターンバランスファンド(目標3%)	289,685円
ターゲットリターンバランスファンド(目標4%)	1,871,752円
ターゲットリターンバランスファンド(目標5%)	985,368円
ターゲットリターンバランスファンド(目標6%)	2,496,512円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2065	387,939円
FWりそな先進国+新興国株式アクティブファンド	92,783,002円
FWりそな新興国株式インデックスファンド	4,398,066,355円
Smart-i 新興国株式インデックス	2,937,033,115円
Smart-i 8資産バランス 安定型	127,390,658円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	435,061,223円
Smart-i 8資産バランス 成長型	610,710,464円
Smart-i Select 全世界株式インデックス	102,197,596円
Smart-i Select 全世界株式インデックス(除く日本)	41,766,742円
Smart-i DC 全世界株式インデックス	61,873円
Smart-i DC 全世界株式インデックス(除く日本)	65,301円
りそなVIグローバル・バランスファンド(安定型)(適格機関投資家専用)	1,874,872円
りそなVIグローバル・バランスファンド(安定成長型)(適格機関投資家専用)	9,567,235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)	97,443,588円
りそなFT マルチアセットファンド(適格機関投資家専用)	25,226,638円
りそなDAAマルチアセットファンド(適格機関投資家専用)	96,545円
2. 計算日における受益権の総数	17,965,166,119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	1.7757円
(10,000口当たり純資産額)	(17,757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 1月25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 1月25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 1月25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 1月25日現在	
	損益に含まれた評価差額(円)	
株式	387,533,911	
投資証券	2,474,060	
合計	385,059,851	

(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 1月25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	1,507,655,229	-	1,504,349,819	3,305,410

合計	1,507,655,229	-	1,504,349,819	3,305,410
----	---------------	---	---------------	-----------

(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 1月25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	221,302,593	-	220,996,185	306,408
	米ドル	221,302,593	-	220,996,185	306,408
	合計	221,302,593	-	220,996,185	306,408

(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	36,100	1.63	58,951.30	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	1,600	0.00	0.00	
	SURGUTNEFTEGAS-SP ADR	13,769	0.00	0.00	
	TATNEFT PAO-SPONSORED ADR	4,090	0.00	0.00	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	6,983	14.38	100,415.54	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	11,117	0.00	0.00	
	NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR	2,773	0.00	0.00	
	PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	2,330	0.00	0.00	
	PHOSAGRO PJSC(BLOCKED)-GDR	15	0.00	0.00	
	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	5,948	0.00	0.00	
	POLYUS PJSC-REG S-GDR	1,288	0.00	0.00	
	SEVERSTAL - GDR REG S	3,862	0.00	0.00	
	SOUTHERN COPPER CORP	2,576	83.25	214,452.00	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	12,920	17.48	225,841.60	
	NIO INC - ADR	41,980	6.07	254,818.60	

	H WORLD GROUP LTD	6,391	33.30	212,820.30	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	12,989	11.30	146,775.70	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	12,569	37.09	466,184.21	
	AUTOHOME INC-ADR	2,118	24.70	52,314.60	
	IQIYI INC-ADR	13,465	3.67	49,416.55	
	JOYY INC	1,406	31.82	44,738.92	
	KANZHUN LTD	7,094	13.94	98,890.36	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	22,683	8.94	202,786.02	
	VK CO LTD	2,211	0.00	0.00	
	WEIBO CORP-SPON ADR	2,566	8.67	22,247.22	
	PDD HOLDINGS INC	18,115	144.50	2,617,617.50	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	10,746	16.42	176,449.32	
	X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	2,296	0.00	0.00	
	LEGEND BIOTECH CORP-ADR	2,140	60.10	128,614.00	
	COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	165,020	1.09	180,201.84	
	CREDICORP LTD	2,005	148.71	298,163.55	
	TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	2,188	0.00	0.00	
	LUFAX HOLDING LTD-ADR	7,328	2.46	18,026.88	
	QIFU TECHNOLOGY INC	3,999	15.09	60,344.91	
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	20,088	2.00	40,316.61	
	DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	2,051	19.63	40,261.13	
	KE HOLDINGS INC	20,341	14.39	292,706.99	
	米ドル 小計	487,160		6,003,355.65 (887,656,166)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-CPO	470,100	13.34	6,271,134.00	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	95,400	87.31	8,329,374.00	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	5,350	221.86	1,186,951.00	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	27,700	33.17	918,809.00	
	ALFA S.A.B. -A	87,800	13.17	1,156,326.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	17,700	163.79	2,899,083.00	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	11,960	259.46	3,103,141.60	
	GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	6,130	475.40	2,914,202.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL CENT	8,600	152.88	1,314,768.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	5,980	168.43	1,007,211.40	
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	159,700	66.75	10,659,975.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	16,100	181.05	2,914,905.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	14,350	155.11	2,225,828.50	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	59,300	228.87	13,571,991.00	
	GRUMA S.A.B. -B	5,455	300.12	1,637,154.60	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	37,700	77.55	2,923,635.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	51,200	37.01	1,894,912.00	
	BANCO DEL BAJIO SA	22,200	63.53	1,410,366.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	79,000	168.31	13,296,490.00	

	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	54,000	48.65	2,627,100.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	574,400	15.49	8,897,456.00	
	メキシコペソ 小計	1,810,125		91,160,813.10 (781,795,133)	
ブラジルリアル	COSAN SA	34,500	18.44	636,180.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	113,000	39.24	4,434,120.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	144,500	37.88	5,473,660.00	
	PRIO SA	24,800	44.60	1,106,080.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	20,900	27.82	581,438.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	23,200	17.82	413,424.00	
	GERDAU SA-PREF	36,695	21.72	797,015.40	
	KLABIN SA - UNIT	22,300	21.76	485,248.00	
	SUZANO SA	24,507	51.87	1,271,178.09	
	VALE SA	103,404	69.90	7,227,939.60	
	WEG SA	51,500	33.47	1,723,705.00	
	CCR SA	26,700	13.34	356,178.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	26,510	58.63	1,554,281.30	
	RUMO SA	40,700	22.51	916,157.00	
	LOJAS RENNER S.A.	30,720	15.80	485,376.00	
	MAGAZINE LUIZA SA	86,300	1.92	165,696.00	
	VIBRA ENERGIA SA	33,500	23.36	782,560.00	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	19,100	10.90	208,190.00	
	RAIA DROGASIL SA	37,676	25.99	979,199.24	
	SENDAS DISTRIBUIDORA SA	41,700	13.35	556,695.00	
	AMBEV SA	144,700	13.20	1,910,040.00	
	JBS SA	21,300	24.17	514,821.00	
	NATURA &CO HOLDING SA	28,800	16.35	470,880.00	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	150,892	3.96	597,532.32	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	18,200	27.38	498,316.00	
	HYPERA SA	13,100	32.21	421,951.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	42,615	13.73	585,103.95	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	161,636	15.32	2,476,263.52	
	BANCO DO BRASIL S.A.	26,200	56.65	1,484,230.00	
	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	11,700	29.50	345,150.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	147,100	32.40	4,766,040.00	
	ITAUSA SA	162,928	9.96	1,622,762.88	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	178,000	13.63	2,426,140.00	
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	36,400	37.38	1,360,632.00		
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	22,000	34.24	753,280.00		
TOTVS SA	16,400	30.91	506,924.00		
TELEFONICA BRASIL S.A.	11,000	50.72	557,920.00		
TIM SA	24,000	17.43	418,320.00		
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	7,100	46.01	326,671.00		

	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	37,200	41.07	1,527,804.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	44,134	11.60	511,954.40	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	10,300	76.40	786,920.00	
	COMPANHIA PARANAENSE DE ENER	28,200	9.98	281,436.00	
	CPFL ENERGIA SA	7,200	36.10	259,920.00	
	ENERGISA SA-UNITS	6,100	49.31	300,791.00	
	ENEVA SA	22,700	12.98	294,646.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	6,275	41.34	259,408.50	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	32,200	34.03	1,095,766.00	
	ブラジルリアル 小計	2,360,592		57,515,944.20 (1,722,878,605)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	12,153	6,195.00	75,287,835.00	
	EMPRESAS CMPC SA	33,869	1,640.00	55,545,160.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	4,419	44,900.00	198,413,100.00	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES	466,759	67.80	31,646,260.20	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	5,527,400	11.25	62,183,250.00	
	FALABELLA SA	29,867	2,140.00	63,915,380.00	
	CENCOSUD SA	35,890	1,625.00	58,321,250.00	
	BANCO DE CHILE	1,244,596	100.56	125,156,573.76	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	2,535	23,845.00	60,447,075.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	2,112,585	42.45	89,679,233.25	
	ENEL AMERICAS SA	715,157	95.00	67,939,915.00	
	ENEL CHILE SA	827,632	54.40	45,023,180.80	
	チリペソ 小計	11,012,862		933,558,213.01 (151,533,302)	
コロンビアペソ	BANCOLOMBIA SA	8,656	33,580.00	290,668,480.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	13,694	30,700.00	420,405,800.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	12,989	16,740.00	217,435,860.00	
	コロンビアペソ 小計	35,339		928,510,140.00 (35,043,829)	
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	2,267	25.88	58,669.96	
	MYTILINEOS S.A.	3,099	39.46	122,286.54	
	OPAP SA	4,870	16.32	79,478.40	
	JUMBO SA	3,761	27.00	101,547.00	
	ALPHA SERVICES AND HOLDINGS	65,690	1.60	105,104.00	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	74,565	1.75	131,197.11	
	NATIONAL BANK OF GREECE	24,364	6.87	167,380.68	
	PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS S	20,288	3.44	69,790.72	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	6,206	13.32	82,663.92	
	PUBLIC POWER CORP	5,654	12.52	70,788.08	
	ユーロ 小計	210,764		988,906.41 (159,026,039)	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	27,711	142.50	3,948,817.50	

	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	51,409	42.38	2,178,713.42	
	HEKTAS TICARET T.A.S	35,672	17.06	608,564.32	
	KOZA ALTIN ISLETMELERI AS	25,931	19.93	516,804.83	
	SASA POLYESTER SANAYI	43,418	36.76	1,596,045.68	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	45,551	48.40	2,204,668.40	
	KOC HOLDING AS	21,761	153.40	3,338,137.40	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	50,028	47.72	2,387,336.16	
	PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS	1,253	721.50	904,039.50	
	TURK HAVA YOLLARI AO	16,774	251.00	4,210,274.00	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	1,780	827.50	1,472,950.00	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	3,208	235.00	753,880.00	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	13,195	367.75	4,852,461.25	
	AKBANK T.A.S.	102,391	40.40	4,136,596.40	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	30,648	69.05	2,116,244.40	
	TURKIYE IS BANKASI-C	114,805	24.88	2,856,348.40	
	YAPI VE KREDI BANKASI	92,810	21.90	2,032,539.00	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	41,740	66.00	2,754,840.00	
	トルコリラ 小計	720,085		42,869,260.66 (209,643,545)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	2,117	746.50	1,580,340.50	
	MONETA MONEY BANK AS	12,265	97.20	1,192,158.00	
	CEZ AS	4,830	877.00	4,235,910.00	
	チェココルナ 小計	19,212		7,008,408.50 (45,380,846)	
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	14,869	2,858.00	42,495,602.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	3,960	9,545.00	37,798,200.00	
	OTP BANK PLC	7,341	16,735.00	122,851,635.00	
	ハンガリーフォリント 小計	26,170		203,145,437.00 (84,336,234)	
ポーランドズロ チ	ORLEN SA	17,899	60.71	1,086,648.29	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	3,988	113.00	450,644.00	
	BUDIMEX	397	650.00	258,050.00	
	LPP SA	32	15,130.00	484,160.00	
	CD PROJEKT SA	1,602	105.50	169,011.00	
	CYFROWY POLSAT SA	8,679	11.07	96,119.92	
	ALLEGRO.EU SA	15,711	30.52	479,499.72	
	PEPCO GROUP NV	5,086	22.12	112,502.32	
	DINO POLSKA SA	1,568	419.00	656,992.00	
	BANK PEKAO SA	5,778	147.00	849,366.00	
	MBANK SA	464	498.10	231,118.40	
	PKO BANK POLSKI SA	26,887	48.72	1,309,934.64	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	977	461.60	450,983.20	
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	17,639	46.52	820,566.28		

	PGE SA	29,021	8.28	240,293.88	
	ポーランドズロチ 小計	135,728		7,695,889.65 (282,642,321)	
ロシアグループ	GAZPROM PJSC	209,472	0.00	0.00	
	LUKOIL PJSC	7,345	0.00	0.00	
	ROSNEFT OIL CO PJSC	20,180	0.00	0.00	
	SURGUTNEFTEGAS-PREFERENCE	131,600	0.00	0.00	
	ALROSA PJSC	46,260	0.00	0.00	
	UNITED CO RUSAL INTERNATIONA	55,000	0.00	0.00	
	YANDEX NV-A	5,354	0.00	0.00	
	OZON HOLDINGS PLC - ADR	920	0.00	0.00	
	MAGNIT PJSC	1,334	0.00	0.00	
	SBERBANK OF RUSSIA PJSC	190,680	0.00	0.00	
	VTB BANK PJSC	65,736,000	0.00	0.00	
	MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ	22,980	0.00	0.00	
	MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JO	16,768	0.00	0.00	
	INTER RAO UES PJSC	725,000	0.00	0.00	
	ロシアグループ 小計	67,168,893		0.00 (0)	
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO-H	58,000	7.69	446,020.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	50,000	7.03	351,500.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	748,000	3.86	2,887,280.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	102,000	28.50	2,907,000.00	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	38,000	7.65	290,700.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	638,000	5.25	3,349,500.00	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO-H	69,000	15.66	1,080,540.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	110,000	3.51	386,100.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	34,500	16.12	556,140.00	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	82,500	5.70	470,250.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	126,000	2.81	354,060.00	
	CMOC GROUP LTD-H	105,000	4.21	442,050.00	
	GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD-H	11,440	24.15	276,276.00	
	JIANGXI COPPER CO LTD-H	39,000	10.76	419,640.00	
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	69,000	3.13	215,970.00	
	SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	20,500	11.66	239,030.00	
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	39,000	7.83	305,370.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	166,000	11.56	1,918,960.00	
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	83,000	2.88	239,040.00	
	BOC AVIATION LTD	6,100	59.10	360,510.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	68,000	3.14	213,520.00		
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	113,000	3.37	380,810.00		
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	68,000	8.12	552,160.00		
CITIC LTD	178,000	7.24	1,288,720.00		

CRRCCORP LTD - H	118,000	3.38	398,840.00
FOSUN INTERNATIONAL LTD	72,500	4.32	313,200.00
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	23,000	17.50	402,500.00
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	37,000	5.73	212,010.00
SINOTRUK HONG KONG LTD	22,500	17.52	394,200.00
WEICHAIPOWER CO LTD-H	55,000	13.28	730,400.00
ZHUZHOU CRRCCORP TIMES ELECTRI-H	13,800	19.18	264,684.00
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL LIMITED	122,000	2.70	329,400.00
AIR CHINA LTD-H	42,000	4.66	195,720.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	48,000	10.36	497,280.00
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	46,000	3.13	143,980.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	83,700	8.22	688,014.00
COSCO SHIPPING PORTS LTD	46,000	5.46	251,160.00
JD LOGISTICS INC	63,100	7.68	484,608.00
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	42,000	7.62	320,040.00
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	3,500	120.10	420,350.00
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	58,000	5.92	343,360.00
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	104,000	4.44	461,760.00
BYD CO LTD-H	31,500	199.40	6,281,100.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	70,000	3.11	217,700.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	18,800	35.40	665,520.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	186,000	7.92	1,473,120.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	64,000	8.54	546,560.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	92,000	3.23	297,160.00
LI AUTO INC-CLASS A	34,788	111.90	3,892,777.20
MINTH GROUP LTD	22,000	12.44	273,680.00
XPENG INC-CLASS A SHARES	33,164	37.20	1,233,700.80
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	38,000	11.84	449,920.00
ZHEJIANG LEAPMOTOR TECHNOLOG	17,100	21.10	360,810.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	38,800	69.90	2,712,120.00
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	110,000	3.56	391,600.00
HAIER SMART HOME CO LTD-H	74,000	22.20	1,642,800.00
LI NING CO LTD	75,500	16.64	1,256,320.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	25,200	72.20	1,819,440.00
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	41,500	4.09	169,735.00
EAST BUY HOLDING LTD	14,500	26.40	382,800.00
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	49,000	13.22	647,780.00
MEITUAN	153,810	70.30	10,812,843.00
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	45,610	58.50	2,668,185.00
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LT	41,200	16.16	665,792.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	34,000	8.11	275,740.00
TRIP.COM GROUP LTD	16,660	285.40	4,754,764.00
BAIDU INC-CLASS A	68,280	105.10	7,176,228.00

BILIBILI INC-CLASS Z	5,877	80.10	470,747.70
CHINA LITERATURE LTD	12,200	28.25	344,650.00
CHINA RUYI HOLDINGS LIMITED	180,000	1.63	293,400.00
KINGSOFT CORP LTD	31,200	21.30	664,560.00
KUAISHOU TECHNOLOGY	70,600	44.65	3,152,290.00
NETEASE INC	58,600	155.80	9,129,880.00
TENCENT HOLDINGS LTD	202,000	281.80	56,923,600.00
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	493,240	72.60	35,809,224.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-H	3,200	70.10	224,320.00
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	57,400	11.10	637,140.00
JD.COM INC - CL A	71,160	90.40	6,432,864.00
MINISO GROUP HOLDING LTD	10,892	40.95	446,027.40
POP MART INTERNATIONAL GROUP	15,000	18.70	280,500.00
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	66,000	5.35	353,100.00
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	29,000	14.74	427,460.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	180,000	3.25	585,000.00
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	31,500	29.10	916,650.00
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	20,400	13.94	284,376.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	3,100	102.73	318,463.00
CHINA FEIHE LTD	115,000	3.74	430,100.00
CHINA MENGNIU DAIRY CO	97,000	17.02	1,650,940.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	50,000	29.25	1,462,500.00
NONGFU SPRING CO LTD-H	61,200	41.00	2,509,200.00
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	60,000	5.46	327,600.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	60,000	7.34	440,400.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	18,000	43.85	789,300.00
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	47,000	4.56	214,320.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	143,000	4.37	624,910.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	21,500	25.75	553,625.00
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	9,000	23.25	209,250.00
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	10,800	28.50	307,800.00
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	24,200	6.34	153,428.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	77,200	5.65	436,180.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	21,500	10.94	235,210.00
SINOPHARM GROUP CO-H	41,600	19.06	792,896.00
3SBIO INC	52,500	6.03	316,575.00
AKESO INC	15,000	42.95	644,250.00
BEIGENE LTD	20,996	97.20	2,040,811.20
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	40,000	11.94	477,600.00
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	43,500	4.78	207,930.00
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	90,000	2.98	268,200.00
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	276,000	5.92	1,633,920.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	36,000	16.26	585,360.00

HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	38,000	12.22	464,360.00
INNOVENT BIOLOGICS INC	37,500	35.70	1,338,750.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	14,000	14.56	203,840.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	307,250	2.93	900,242.50
WUXI APPTTEC CO LTD-H	10,168	79.15	804,797.20
WUXI BIOLOGICS (CAYMAN) INC.	116,500	29.40	3,425,100.00
ZAI LAB LTD	27,130	17.92	486,169.60
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	836,000	2.98	2,491,280.00
BANK OF CHINA LTD-H	2,405,000	2.94	7,070,700.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	264,000	4.61	1,217,040.00
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	269,000	3.80	1,022,200.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	2,912,000	4.58	13,336,960.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	69,000	2.28	157,320.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	118,000	27.70	3,268,600.00
CHINA MINSHENG BANKING-H	171,600	2.60	446,160.00
IND & COMM BK OF CHINA-H	1,971,000	3.74	7,371,540.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	239,000	3.67	877,130.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	382,000	0.72	275,040.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	101,000	3.93	396,930.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	47,600	9.92	472,192.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	53,000	16.00	848,000.00
FAR EAST HORIZON LTD	64,000	6.14	392,960.00
GF SECURITIES CO LTD-H	26,800	8.15	218,420.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	86,400	3.85	332,640.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	35,800	9.86	352,988.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	225,000	9.03	2,031,750.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	79,800	14.02	1,118,796.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	43,000	6.30	270,900.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	25,800	13.80	356,040.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	264,000	2.44	644,160.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	208,000	10.00	2,080,000.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	203,000	33.00	6,699,000.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	19,800	13.54	268,092.00
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	80,000	5.13	410,400.00
GDS HOLDINGS LTD-CL A	25,524	6.27	160,035.48
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	90,000	9.46	851,400.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	22,500	20.50	461,250.00
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	24,500	30.10	737,450.00
KINGBOARD HOLDINGS LTD	19,000	15.30	290,700.00
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	24,000	5.60	134,400.00
LENOVO GROUP LTD	220,000	10.04	2,208,800.00
SUNNY OPTICAL TECH	20,800	59.80	1,243,840.00
XIAOMI CORP-CLASS B	464,800	13.70	6,367,760.00

ZTE CORP-H	18,800	14.92	280,496.00		
CHINA TOWER CORP LTD-H	1,336,000	0.76	1,015,360.00		
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	14,500	27.80	403,100.00		
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	122,000	1.86	226,920.00		
CGN POWER CO LTD-H	324,000	2.22	719,280.00		
CHINA GAS HOLDINGS LTD	90,400	7.15	646,360.00		
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	88,000	4.71	414,480.00		
CHINA POWER INTERNATIONAL	158,000	2.98	470,840.00		
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	28,200	21.60	609,120.00		
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	60,000	16.04	962,400.00		
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	24,500	55.20	1,352,400.00		
GUANGDONG INVESTMENT LTD	92,000	5.80	533,600.00		
HUANENG POWER INTL INC-H	114,000	4.44	506,160.00		
KUNLUN ENERGY CO LTD	118,000	6.80	802,400.00		
FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	11,000	15.84	174,240.00		
GCL TECHNOLOGY HOLDINGS LTD	658,000	1.09	717,220.00		
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	21,000	16.76	351,960.00		
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	150,000	4.21	631,500.00		
C&D INTERNATIONAL INVESTMENT	26,000	13.20	343,200.00		
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	119,000	11.78	1,401,820.00		
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	40,000	4.89	195,600.00		
CHINA RESOURCES LAND LTD	96,000	23.00	2,208,000.00		
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	24,400	23.05	562,420.00		
CHINA VANKE CO LTD-H	76,300	6.14	468,482.00		
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	66,000	8.89	586,740.00		
YUEXIU PROPERTY CO LTD	50,800	4.70	238,760.00		
香港ドル 小計	24,978,089		304,186,395.08 (5,752,164,730)		
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	95,700	1.86	178,002.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	10,900	21.38	233,042.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	79,900	6.75	539,325.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	102,800	4.85	498,580.00	
	GAMUDA BHD	68,500	4.96	339,760.00	
	SIME DARBY BERHAD	99,700	2.50	249,250.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	28,000	7.61	213,080.00	
	MISC BHD	36,800	7.32	269,376.00	
	GENTING BHD	57,900	4.70	272,130.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	91,400	2.69	245,866.00	
	MR DIY GROUP M BHD	92,550	1.43	132,346.50	
	IOI CORP BHD	69,200	4.01	277,492.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	16,500	22.70	374,550.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	2,600	119.50	310,700.00	
	PPB GROUP BERHAD	23,120	14.72	340,326.40	

	QL RESOURCES BHD	30,350	5.86	177,851.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	63,000	4.38	275,940.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	59,200	6.07	359,344.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	64,100	4.25	272,425.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	198,700	6.12	1,216,044.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	16,200	19.18	310,716.00	
	MALAYAN BANKING BHD	156,700	9.10	1,425,970.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	444,600	4.37	1,942,902.00	
	RHB BANK BHD	39,200	5.61	219,912.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	72,600	2.63	190,938.00	
	CELCOMDIGI BHD	113,500	4.25	482,375.00	
	MAXIS BHD	64,700	3.82	247,154.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	36,600	5.92	216,672.00	
	PETRONAS GAS BHD	22,900	17.64	403,956.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	82,400	10.52	866,848.00	
	INARI AMERTRON BHD	74,800	3.21	240,108.00	
	マレーシアリングット 小計	2,415,120		13,322,980.90 (416,179,280)	
タイパーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	303,700	6.45	1,958,865.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	42,700	149.00	6,362,300.00	
	PTT PCL-NVDR	289,900	34.25	9,929,075.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	31,600	53.25	1,682,700.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	53,800	24.20	1,301,960.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	75,500	35.00	2,642,500.00	
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	32,200	31.75	1,022,350.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	24,600	270.00	6,642,000.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	131,800	60.25	7,940,950.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	234,600	7.40	1,736,040.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	207,000	6.85	1,417,950.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	190,600	3.90	743,340.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	95,600	29.00	2,772,400.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	64,225	35.00	2,247,875.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	204,100	10.80	2,204,280.00	
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	85,300	18.50	1,578,050.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	36,100	24.70	891,670.00	
	CP ALL PCL-NVDR	179,200	53.00	9,497,600.00	
	CP AXTRA PCL-NVDR	59,000	29.50	1,740,500.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	132,600	17.80	2,360,280.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	31,400	21.70	681,380.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	344,000	27.75	9,546,000.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	16,900	240.00	4,056,000.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	19,100	122.00	2,330,200.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	123,600	16.50	2,039,400.00	

	SCB X PCL-NVDR	21,200	104.50	2,215,400.00	
	TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR	685,400	1.79	1,226,866.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	38,400	44.75	1,718,400.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	16,300	42.75	696,825.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	96,000	85.25	8,184,000.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	36,500	216.00	7,884,000.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	28,600	73.50	2,102,100.00	
	TRUE CORP PCL/NEW-NVDR	327,315	5.85	1,914,792.75	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	48,000	38.25	1,836,000.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	21,300	50.00	1,065,000.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	81,400	44.00	3,581,600.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	57,400	66.75	3,831,450.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	298,900	7.80	2,331,420.00	
	タイパーツ 小計	4,765,840		123,913,518.75 (511,762,832)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	51,250	49.15	2,518,937.50	
	AYALA CORPORATION	7,910	693.00	5,481,630.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	72,731	38.70	2,814,689.70	
	SM INVESTMENTS CORP	6,870	900.00	6,183,000.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	32,380	246.00	7,965,480.00	
	JOLLIBEE FOODS CORP	15,800	270.00	4,266,000.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	24,530	112.40	2,757,172.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	54,578	109.60	5,981,748.80	
	BDO UNIBANK INC	74,086	144.80	10,727,652.80	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	45,472	58.00	2,637,376.00	
	PLDT INC	2,745	1,282.00	3,519,090.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	7,490	383.00	2,868,670.00	
	AYALA LAND INC	222,200	34.50	7,665,900.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	301,900	33.50	10,113,650.00	
	フィリピンペソ 小計	919,942		75,500,996.80 (198,190,116)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY TBK PT	481,600	2,340.00	1,126,944,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	45,500	22,550.00	1,026,025,000.00	
	AMMAN MINERAL INTERNASIONAL	187,400	7,500.00	1,405,500,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK	175,600	1,535.00	269,546,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	909,184	1,080.00	981,918,720.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	89,700	7,775.00	697,417,500.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	292,209	2,710.00	791,886,390.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	101,289	6,025.00	610,266,225.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	564,100	5,075.00	2,862,807,500.00	
	GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT	26,963,000	84.00	2,264,892,000.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	556,700	2,670.00	1,486,389,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	254,200	4,600.00	1,169,320,000.00	

	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	75,400	11,400.00	859,560,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	117,600	6,450.00	758,520,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	202,200	3,200.00	647,040,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	730,700	1,595.00	1,165,466,500.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	1,682,000	9,525.00	16,021,050,000.00	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	1,133,100	6,400.00	7,251,840,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	414,600	5,475.00	2,269,935,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	2,068,445	5,650.00	11,686,714,250.00	
	SARANA MENARA NUSANTARA PT	685,000	965.00	661,025,000.00	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	1,503,900	3,970.00	5,970,483,000.00	
	インドネシアルピア 小計	39,233,427		61,984,546,085.00 (588,853,187)	
韓国ウォン	HD HYUNDAI	1,185	67,200.00	79,632,000.00	
	S-OIL CORP	1,463	66,000.00	96,558,000.00	
	SK INNOVATION CO LTD	1,895	112,100.00	212,429,500.00	
	ECOPRO CO LTD	583	506,000.00	294,998,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORP	3,826	33,750.00	129,127,500.00	
	HYUNDAI STEEL CO	3,107	32,650.00	101,443,550.00	
	KOREA ZINC CO LTD	231	460,500.00	106,375,500.00	
	KUM YANG CO LTD	942	79,000.00	74,418,000.00	
	KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	458	112,500.00	51,525,000.00	
	LG CHEM LTD	1,534	400,500.00	614,367,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	197	266,000.00	52,402,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORP	705	128,700.00	90,733,500.00	
	POSCO HOLDINGS INC	2,193	400,000.00	877,200,000.00	
	SK IE TECHNOLOGY CO LTD	775	77,400.00	59,985,000.00	
	SKC CO LTD	602	75,500.00	45,451,000.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	1,487	45,600.00	67,807,200.00	
	DOOSAN ENERBILITY	13,577	14,860.00	201,754,220.00	
	ECOPRO BM CO LTD	1,505	239,000.00	359,695,000.00	
	GS HOLDINGS	1,411	41,200.00	58,133,200.00	
	HANWHA AEROSPACE CO LTD	1,187	141,700.00	168,197,900.00	
	HANWHA OCEAN CO LTD	1,265	21,900.00	27,703,500.00	
	HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	607	117,400.00	71,261,800.00	
	HD KOREA SHIPBUILDING & OFFS	1,242	111,400.00	138,358,800.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONST	2,829	31,400.00	88,830,600.00	
	HYUNDAI MIPO DOCKYARD	938	69,600.00	65,284,800.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	2,505	54,000.00	135,270,000.00	
	L&F CO LTD	821	177,000.00	145,317,000.00	
	LG CORP	2,799	73,000.00	204,327,000.00	
	LG ENERGY SOLUTION	1,435	380,500.00	546,017,500.00	
	POSCO FUTURE M CO LTD	962	261,000.00	251,082,000.00	
	POSCO INTERNATIONAL CORP	1,476	49,850.00	73,578,600.00	

SAMSUNG C&T CORP	2,417	117,400.00	283,755,800.00
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	4,565	24,250.00	110,701,250.00
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	19,155	7,480.00	143,279,400.00
SK	1,030	158,000.00	162,740,000.00
SK SQUARE CO LTD	3,018	50,100.00	151,201,800.00
HMM CO LTD	7,839	20,000.00	156,780,000.00
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	524	168,500.00	88,294,000.00
KOREAN AIR LINES CO LTD	6,186	22,300.00	137,947,800.00
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	1,948	47,200.00	91,945,600.00
HANON SYSTEMS	6,426	6,120.00	39,327,120.00
HYUNDAI MOBIS CO LTD	1,766	204,500.00	361,147,000.00
HYUNDAI MOTOR CO	4,192	185,000.00	775,520,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	1,138	111,400.00	126,773,200.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	533	109,800.00	58,523,400.00
KIA CORP	7,972	87,900.00	700,738,800.00
COWAY CO LTD	1,947	56,400.00	109,810,800.00
F&F CO LTD / NEW	518	71,800.00	37,192,400.00
LG ELECTRONICS INC	3,336	93,900.00	313,250,400.00
KANGWON LAND INC	3,072	15,100.00	46,387,200.00
HYBE CO LTD	687	222,000.00	152,514,000.00
JYP ENTERTAINMENT CORP	810	84,200.00	68,202,000.00
KAKAO CORP	9,494	56,700.00	538,309,800.00
KRAFTON INC	872	207,500.00	180,940,000.00
NAVER CORP	3,994	218,000.00	870,692,000.00
NCSOFT CORP	383	190,800.00	73,076,400.00
NETMARBLE CORPORATION	904	57,200.00	51,708,800.00
PEARL ABYSS CORP	960	33,400.00	32,064,000.00
HOTEL SHILLA CO LTD	885	59,400.00	52,569,000.00
CJ CHEILJEDANG CORP	221	284,500.00	62,874,500.00
KT&G CORP	3,047	85,900.00	261,737,300.00
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	591	92,400.00	54,608,400.00
AMOREPACIFIC CORP	788	138,500.00	109,138,000.00
LG H&H	260	317,500.00	82,550,000.00
HLB INC	3,798	49,500.00	188,001,000.00
CELLTRION INC	4,583	180,700.00	828,148,100.00
CELLTRION PHARM INC	718	102,400.00	73,523,200.00
HANMI PHARM CO LTD	218	325,000.00	70,850,000.00
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	514	788,000.00	405,032,000.00
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	1,117	90,000.00	100,530,000.00
SK BIOSCIENCE CO LTD	710	63,400.00	45,014,000.00
YUHAN CORP	1,602	59,500.00	95,319,000.00
HANA FINANCIAL GROUP	9,043	43,600.00	394,274,800.00
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	8,613	11,870.00	102,236,310.00

	KAKAOBANK CORP	5,191	29,200.00	151,577,200.00	
	KB FINANCIAL GROUP INC	11,689	52,100.00	608,996,900.00	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	13,377	40,050.00	535,748,850.00	
	WOORI FINANCIAL GROUP INC	17,430	13,000.00	226,590,000.00	
	KAKAOPAY CORP	730	52,200.00	38,106,000.00	
	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	1,162	57,600.00	66,931,200.00	
	MERITZ FINANCIAL GROUP INC	3,040	61,900.00	188,176,000.00	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	9,715	6,790.00	65,964,850.00	
	NH INVESTMENT & SECURITIES C	5,547	9,990.00	55,414,530.00	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	1,943	35,750.00	69,462,250.00	
	DB INSURANCE CO LTD	1,260	79,700.00	100,422,000.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	967	237,000.00	229,179,000.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	2,205	62,600.00	138,033,000.00	
	POSCO DX CO LTD	1,565	54,100.00	84,666,500.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	1,229	158,600.00	194,919,400.00	
	COSMOAM&T CO LTD	779	130,800.00	101,893,200.00	
	LG DISPLAY CO LTD	5,817	13,740.00	79,925,580.00	
	LG INNOTEK CO LTD	384	213,500.00	81,984,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	1,693	145,800.00	246,839,400.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	144,760	74,000.00	10,712,240,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	25,017	60,600.00	1,516,030,200.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	1,680	354,000.00	594,720,000.00	
	KT CORP	1,598	33,700.00	53,852,600.00	
	LG UPLUS CORP	6,485	9,830.00	63,747,550.00	
	SK TELECOM	1,621	49,200.00	79,753,200.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	7,197	18,390.00	132,352,830.00	
	HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD	1,237	59,200.00	73,230,400.00	
	SK HYNIX INC	16,574	141,500.00	2,345,221,000.00	
	韓国ウォン 小計	480,028		33,114,470,890.00 (3,675,706,268)	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	31,000	73.00	2,263,000.00	
	ASIA CEMENT CORP	69,000	39.90	2,753,100.00	
	CHINA STEEL CORP	344,000	25.15	8,651,600.00	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	110,000	56.80	6,248,000.00	
	FORMOSA PLASTICS CORP	110,000	72.10	7,931,000.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	137,000	60.70	8,315,900.00	
	TAIWAN CEMENT	201,917	32.60	6,582,494.20	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	4,200	983.00	4,128,600.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	92,000	30.60	2,815,200.00	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	2,000	1,325.00	2,650,000.00	
	WALSIN LIHWA CORP	95,000	36.30	3,448,500.00	
	CHINA AIRLINES LTD	75,000	20.55	1,541,250.00	
	EVA AIRWAYS CORP	86,000	31.05	2,670,300.00	

EVERGREEN MARINE CORP LTD	31,420	153.50	4,822,970.00
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	55,000	29.75	1,636,250.00
WAN HAI LINES LTD	18,650	50.50	941,825.00
YANG MING MARINE TRANSPORT	57,000	49.80	2,838,600.00
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	53,000	44.15	2,339,950.00
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	5,420	541.00	2,932,220.00
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	15,289	161.50	2,469,173.50
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	5,000	331.50	1,657,500.00
POU CHEN	61,000	31.00	1,891,000.00
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	9,160	641.00	5,871,560.00
MOMO.COM INC	2,200	450.50	991,100.00
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	16,000	264.00	4,224,000.00
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	149,000	71.30	10,623,700.00
PHARMAESSENTIA CORP	7,000	320.50	2,243,500.00
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	155,046	17.45	2,705,552.70
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	536,000	28.00	15,008,000.00
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	433,197	24.65	10,678,306.05
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	315,723	26.60	8,398,231.80
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	259,430	21.40	5,551,802.00
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	349,502	37.85	13,228,650.70
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	332,350	18.90	6,281,415.00
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	333,055	17.20	5,728,546.00
TAIWAN BUSINESS BANK	176,128	13.20	2,324,889.60
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	317,978	25.50	8,108,439.00
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	122,000	44.35	5,410,700.00
CHAILEASE HOLDING CO LTD	48,009	178.00	8,545,602.00
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	316,208	26.60	8,411,132.80
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	290,000	44.20	12,818,000.00
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	479,000	12.10	5,795,900.00
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	237,766	64.40	15,312,130.40
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	366,835	8.51	3,121,765.85
ACCTON TECHNOLOGY CORP	16,000	522.00	8,352,000.00
ACER INC	94,000	47.35	4,450,900.00
ADVANTECH CO LTD	14,427	338.50	4,883,539.50
ASUSTEK COMPUTER INC	22,000	455.00	10,010,000.00
AUO CORP	214,200	18.95	4,059,090.00
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	16,000	195.50	3,128,000.00
COMPAL ELECTRONICS	121,000	36.85	4,458,850.00
DELTA ELECTRONICS INC	59,000	289.00	17,051,000.00
E INK HOLDINGS INC	27,000	193.50	5,224,500.00
GIGABYTE TECHNOLOGY CO LTD	17,000	293.50	4,989,500.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	378,800	100.50	38,069,400.00
INNOLUX CORP	241,751	16.65	4,025,154.15

INVENTEC CORP	87,000	56.50	4,915,500.00	
LARGAN PRECISION CO LTD	2,900	2,535.00	7,351,500.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	63,000	112.00	7,056,000.00	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	21,000	183.00	3,843,000.00	
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	6,000	225.50	1,353,000.00	
PEGATRON CORP	64,000	86.10	5,510,400.00	
QUANTA COMPUTER INC	82,000	250.00	20,500,000.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	34,000	72.60	2,468,400.00	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	41,000	169.50	6,949,500.00	
WISTRON CORP	73,000	116.00	8,468,000.00	
WIWYNN CORP	3,000	2,125.00	6,375,000.00	
WPG HOLDINGS LTD	47,960	89.90	4,311,604.00	
YAGEO CORPORATION	10,524	553.00	5,819,772.00	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	18,000	101.00	1,818,000.00	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	116,000	120.00	13,920,000.00	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	55,000	79.30	4,361,500.00	
TAIWAN MOBILE CO LTD	54,000	97.30	5,254,200.00	
ALCHIP TECHNOLOGIES LTD	2,300	3,680.00	8,464,000.00	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	93,000	134.00	12,462,000.00	
EEMORY TECHNOLOGY INC	1,800	2,575.00	4,635,000.00	
GLOBAL UNICHIP CORP	2,800	1,660.00	4,648,000.00	
GLOBALWAFERS CO LTD	6,000	592.00	3,552,000.00	
MEDIATEK INC	45,800	936.00	42,868,800.00	
NANYA TECHNOLOGY CORP	39,000	71.60	2,792,400.00	
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	18,000	526.00	9,468,000.00	
PARADE TECHNOLOGIES LTD	2,600	1,130.00	2,938,000.00	
POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU	96,000	27.90	2,678,400.00	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	14,000	448.50	6,279,000.00	
SILERGY CORP	10,640	400.50	4,261,320.00	
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	746,000	627.00	467,742,000.00	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	342,000	50.60	17,305,200.00	
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	29,000	75.00	2,175,000.00	
WINBOND ELECTRONICS CORP	99,000	27.90	2,762,100.00	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	44,647	36.00	1,607,292.00	
新台湾ドル 小計	10,502,632		1,058,527,178.25 (4,989,156,149)	
インドルピー				
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	24,027	477.15	11,464,483.05	
COAL INDIA LTD	47,308	382.60	18,100,040.80	
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	18,914	452.55	8,559,530.70	
INDIAN OIL CORP LTD	87,227	143.45	12,512,713.15	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	90,913	234.35	21,305,461.55	
PETRONET LNG LTD	18,996	260.30	4,944,658.80	
RELIANCE INDUSTRIES LTD	92,326	2,687.75	248,149,206.50	

AMBUJA CEMENTS LTD	17,208	527.45	9,076,359.60
APL APOLLO TUBES LTD	4,859	1,502.00	7,298,218.00
ASIAN PAINTS LTD	11,749	2,999.45	35,240,538.05
BERGER PAINTS INDIA LTD	7,891	562.55	4,439,082.05
GRASIM INDUSTRIES LTD	8,176	2,071.30	16,934,948.80
HINDALCO INDUSTRIES LTD	36,283	565.15	20,505,337.45
JINDAL STEEL & POWER LTD	10,594	706.30	7,482,542.20
JSW STEEL LTD	17,850	812.20	14,497,770.00
PI INDUSTRIES LTD	2,601	3,282.70	8,538,302.70
PIDILITE INDUSTRIES LTD	4,189	2,592.05	10,858,097.45
SHREE CEMENT LTD	251	27,635.15	6,936,422.65
SRF LTD	4,133	2,284.95	9,443,698.35
SUPREME INDUSTRIES LTD	1,757	4,103.55	7,209,937.35
TATA STEEL LTD	225,245	135.15	30,441,861.75
ULTRATECH CEMENT LTD	3,540	9,990.50	35,366,370.00
UPL LTD	13,811	545.75	7,537,353.25
VEDANTA LTD	29,237	262.55	7,676,174.35
ABB INDIA LTD	1,585	4,731.25	7,499,031.25
ADANI ENTERPRISES LTD	4,823	2,903.45	14,003,339.35
ASHOK LEYLAND LTD	43,004	170.60	7,336,482.40
ASTRAL LTD	3,580	1,827.85	6,543,703.00
BHARAT ELECTRONICS LTD	113,007	189.25	21,386,574.75
CG POWER AND INDUSTRIAL SOLU	19,948	449.35	8,963,633.80
CUMMINS INDIA LTD	4,109	2,170.80	8,919,817.20
HAVELLS INDIA LTD	7,120	1,305.60	9,295,872.00
HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	5,829	2,931.45	17,087,422.05
LARSEN & TOUBRO LTD	20,521	3,589.20	73,653,973.20
POLYCAB INDIA LTD	1,305	4,361.70	5,692,018.50
SIEMENS LTD	2,800	4,199.00	11,757,200.00
SUZLON ENERGY LTD	270,753	41.20	11,155,023.60
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	6,472	970.60	6,281,723.20
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	16,262	1,120.60	18,223,197.20
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	7,859	841.10	6,610,204.90
INTERGLOBE AVIATION LTD	4,271	2,910.15	12,429,250.65
BAJAJ AUTO LTD	1,903	7,212.85	13,726,053.55
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	2,334	2,714.55	6,335,759.70
BHARAT FORGE LTD	8,017	1,215.80	9,747,068.60
EICHER MOTORS LTD	4,293	3,635.00	15,605,055.00
HERO MOTOCORP LTD	3,456	4,433.65	15,322,694.40
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	28,446	1,628.10	46,312,932.60
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	4,149	9,988.20	41,441,041.80
MRF LTD	54	139,771.05	7,547,636.70
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN	71,452	110.00	7,859,720.00

SONA BLW PRECISION FORGINGS	13,869	585.70	8,123,073.30
TATA MOTORS LTD	50,705	810.90	41,116,684.50
TATA MOTORS LTD-A-DVR	13,696	537.65	7,363,654.40
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LT	3,365	4,006.20	13,480,863.00
TVS MOTOR CO LTD	7,088	2,000.95	14,182,733.60
PAGE INDUSTRIES LTD	196	36,562.75	7,166,299.00
TITAN CO LTD	10,865	3,767.85	40,937,690.25
INDIAN HOTELS CO LTD	27,730	480.35	13,320,105.50
JUBILANT FOODWORKS LTD	13,667	525.50	7,182,008.50
ZOMATO LTD	151,450	136.20	20,627,490.00
INFO EDGE INDIA LTD	2,245	5,021.95	11,274,277.75
TRENT LTD	5,397	3,222.75	17,393,181.75
AVENUE SUPERMARTS LTD	5,012	3,727.75	18,683,483.00
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	3,364	5,142.25	17,298,529.00
ITC LTD	91,548	463.60	42,441,652.80
MARICO LTD	15,967	529.65	8,456,921.55
NESTLE INDIA LTD	10,383	2,513.95	26,102,342.85
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	17,891	1,159.00	20,735,669.00
UNITED SPIRITS LTD	9,408	1,112.20	10,463,577.60
VARUN BEVERAGES LTD	14,101	1,266.35	17,856,801.35
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	4,259	2,518.20	10,725,013.80
DABUR INDIA LTD	17,113	536.60	9,182,835.80
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	12,732	1,163.35	14,811,772.20
HINDUSTAN UNILEVER LTD	25,059	2,441.65	61,185,307.35
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	3,128	6,213.35	19,435,358.80
MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	23,433	737.05	17,271,292.65
AUROBINDO PHARMA LTD	7,383	1,160.10	8,565,018.30
CIPLA LTD	15,439	1,417.35	21,882,466.65
DIVI'S LABORATORIES LTD	3,794	3,643.55	13,823,628.70
DR. REDDY'S LABORATORIES	3,399	5,902.10	20,061,237.90
LUPIN LTD	6,138	1,449.20	8,895,189.60
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	29,388	1,382.10	40,617,154.80
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	3,339	2,507.05	8,371,039.95
AU SMALL FINANCE BANK LTD	5,313	737.25	3,917,009.25
AXIS BANK LTD	69,317	1,059.15	73,417,100.55
BANDHAN BANK LTD	19,777	224.40	4,437,958.80
BANK OF BARODA	27,026	228.65	6,179,494.90
HDFC BANK LIMITED	85,145	1,455.90	123,962,605.50
ICICI BANK LTD	157,276	999.20	157,150,179.20
IDFC FIRST BANK LTD	94,716	79.60	7,539,393.60
INDUSIND BANK LTD	8,222	1,490.85	12,257,768.70
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	33,252	1,788.60	59,474,527.20
STATE BANK OF INDIA	54,459	618.30	33,671,999.70

YES BANK LTD	387,272	24.70	9,565,618.40
BAJAJ FINANCE LTD	8,323	7,055.30	58,721,261.90
BAJAJ FINSERV LTD	11,093	1,620.85	17,980,089.05
BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMEN	806	8,190.95	6,601,905.70
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	13,260	1,245.80	16,519,308.00
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	2,370	3,435.75	8,142,727.50
JIO FINANCIAL SERVICES LTD	91,822	239.75	22,014,324.50
MUTHOOT FINANCE LTD	3,756	1,403.75	5,272,485.00
ONE 97 COMMUNICATIONS LTD	6,527	753.75	4,919,726.25
POWER FINANCE CORPORATION	44,201	421.75	18,641,771.75
REC LTD	41,530	467.50	19,415,275.00
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	7,713	746.95	5,761,225.35
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	8,326	2,302.45	19,170,198.70
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	29,778	581.65	17,320,373.70
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	6,992	1,508.50	10,547,432.00
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	8,896	488.55	4,346,140.80
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	13,078	1,410.55	18,447,172.90
HCL TECHNOLOGIES LTD	28,927	1,576.40	45,600,522.80
INFOSYS LTD	100,802	1,675.40	168,883,670.80
LTIMINDTREE LTD	2,579	5,619.55	14,492,819.45
MPHASIS LTD	2,620	2,565.75	6,722,265.00
PERSISTENT SYSTEMS LTD	1,445	8,475.80	12,247,531.00
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	27,802	3,841.80	106,809,723.60
TATA ELXSI LTD	1,069	7,768.45	8,304,473.05
TECH MAHINDRA LTD	16,514	1,407.95	23,250,886.30
WIPRO LTD	37,402	478.05	17,880,026.10
BHARTI AIRTEL LTD	68,294	1,189.95	81,266,445.30
TATA COMMUNICATIONS LTD	3,349	1,728.65	5,789,248.85
ADANI GREEN ENERGY LTD	8,848	1,641.35	14,522,664.80
ADANI POWER LTD	24,069	519.95	12,514,676.55
GAIL INDIA LTD	73,428	164.55	12,082,577.40
INDRAPRASTHA GAS LTD	11,620	434.90	5,053,538.00
NTPC LTD	133,376	308.85	41,193,177.60
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	142,410	246.20	35,061,342.00
TATA POWER CO LTD	45,307	356.95	16,172,333.65
DLF LTD	19,595	747.40	14,645,303.00
GODREJ PROPERTIES LTD	3,754	2,266.40	8,508,065.60
MACROTECH DEVELOPERS LTD	7,189	1,061.15	7,628,607.35
インドルピー 小計	4,059,633		2,998,314,865.25 (5,366,983,608)
カタールリアル			
QATAR FUEL QSC	16,008	15.88	254,207.04
QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	68,061	3.70	251,893.76
MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	157,972	1.72	271,869.81

	INDUSTRIES QATAR	47,498	12.25	581,850.50
	COMMERCIAL BANK PQSC	104,492	5.64	589,334.88
	DUKHAN BANK	47,311	4.01	189,717.11
	MASRAF AL RAYAN	156,266	2.49	389,414.87
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	33,084	10.75	355,653.00
	QATAR ISLAMIC BANK	51,255	19.81	1,015,361.55
	QATAR NATIONAL BANK	140,685	16.09	2,263,621.65
	OOREDOO QPSC	24,164	10.82	261,454.48
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	15,660	17.70	277,182.00
	BARWA REAL ESTATE CO	60,279	2.89	174,507.70
	カタールリアル 小計	922,735		6,876,068.35 (279,443,417)
南 ア フリ カ ラ ン ド	EXXARO RESOURCES LTD	7,793	196.08	1,528,051.44
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	1,807	841.76	1,521,060.32
	ANGLOGOLD ASHANTI PLC	12,308	332.00	4,086,256.00
	GOLD FIELDS LTD	27,631	261.00	7,211,691.00
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	15,256	113.44	1,730,640.64
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	28,030	77.00	2,158,310.00
	KUMBA IRON ORE LTD	1,694	567.33	961,057.02
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	9,656	136.49	1,317,947.44
	SASOL LTD	18,654	161.52	3,012,994.08
	SIBANYE STILLWATER LTD	95,224	22.55	2,147,301.20
	BIDVEST GROUP LTD	8,221	245.11	2,015,049.31
	NASPERS LTD-N SHS	5,667	3,190.00	18,077,730.00
	PEPKOR HOLDINGS LTD	52,043	18.68	972,163.24
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	27,276	67.97	1,853,949.72
	BID CORP LTD	10,565	439.60	4,644,374.00
	CLICKS GROUP LTD	6,931	300.00	2,079,300.00
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	14,682	264.55	3,884,123.10
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	11,723	187.50	2,198,062.50
	ABSA GROUP LTD	26,797	158.95	4,259,383.15
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	2,686	2,046.92	5,498,027.12
	NEDBANK GROUP LTD	12,732	216.41	2,755,332.12
	STANDARD BANK GROUP LTD	40,822	198.38	8,098,268.36
	FIRSTRAND LTD	154,303	68.07	10,503,405.21
	REINET INVESTMENTS SCA	4,626	481.75	2,228,575.50
	REMGRO LTD	14,915	156.63	2,336,136.45
	DISCOVERY LTD	16,635	135.02	2,246,057.70
OLD MUTUAL LTD	159,908	12.32	1,970,066.56	
OUTSURANCE GROUP LTD	22,382	41.73	934,000.86	
SANLAM LTD	54,894	71.80	3,941,389.20	
MTN GROUP LTD	49,438	104.79	5,180,608.02	
VODACOM GROUP LTD	19,783	105.26	2,082,358.58	

	NEPI ROCKCASTLE N.V.	14,368	123.66	1,776,746.88	
	南アフリカランド 小計	949,450		115,210,416.72 (900,945,458)	
アラブディルハム	MULTIPLY GROUP	109,599	2.99	327,701.01	
	AMERICANA RESTAURANTS INTERN	70,134	3.30	231,442.20	
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	88,102	3.54	311,881.08	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	90,397	9.18	829,844.46	
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	44,112	11.18	493,172.16	
	DUBAI ISLAMIC BANK	80,564	6.29	506,747.56	
	EMIRATES NBD PJSC	58,262	18.55	1,080,760.10	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	134,879	15.44	2,082,531.76	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	106,140	20.26	2,150,396.40	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	125,204	5.08	636,036.32	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	205,154	7.40	1,518,139.60	
	アラブディルハム 小計	1,112,547		10,168,652.65 (410,101,761)	
クウェートディナール	AGILITY	45,725	0.57	26,246.15	
	BOUBYAN BANK K.S.C	38,661	0.64	24,859.02	
	GULF BANK	55,027	0.29	16,453.07	
	KUWAIT FINANCE HOUSE	247,276	0.78	194,111.66	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	229,239	0.98	225,341.93	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	64,626	0.52	34,187.15	
	MABANEE CO KPSC	20,333	0.78	16,042.73	
	クウェートディナール 小計	700,887		537,241.71 (258,665,766)	
オフショア人民元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	18,900	6.50	122,850.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	66,700	5.46	364,182.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	11,500	34.61	398,015.00	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-A	8,100	13.22	107,082.00	
	GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	9,700	7.11	68,967.00	
	INNER MONGOLIA DIAN TOU EN-A	2,700	14.19	38,313.00	
	JIZHONG ENERGY RESOURCES-A	4,900	7.30	35,770.00	
	OFFSHORE OIL ENGINEERING-A	10,500	5.50	57,750.00	
	PETROCHINA CO LTD-A	46,600	7.26	338,316.00	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	19,600	23.33	457,268.00	
	SHAN XI HUA YANG GROUP NEW-A	5,100	9.58	48,858.00	
	SHANXI COKING COAL ENERGY-A	12,420	10.14	125,938.80	
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	6,500	22.45	145,925.00	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO-A	6,736	21.56	145,228.16	
	YANTAI JEREH OILFIELD-A	900	26.53	23,877.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	23,100	5.27	121,737.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	9,900	22.13	219,087.00	
ANHUI HONGLU STEEL CONSTRU-A	650	17.36	11,284.00		

ASIA-POTASH INTERNATIONAL-A	1,500	21.68	32,520.00
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	50,000	5.89	294,500.00
CANMAX TECHNOLOGIES CO LTD-A	1,040	22.68	23,587.20
CHENGXIN LITHIUM GROUP CO-A	1,400	23.14	32,396.00
CHINA JUSHI CO LTD -A	7,414	9.03	66,948.42
CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	5,700	17.56	100,092.00
CHINA RARE EARTH RESOURCES-A	1,900	23.77	45,163.00
CMOC GROUP LTD-A	28,400	5.22	148,248.00
CNGR ADVANCED MATERIAL CO -A	600	46.88	28,128.00
DO-FLUORIDE NEW MATERIALS -A	2,100	13.12	27,552.00
GANFENG LITHIUM GROUP CO L-A	2,740	39.98	109,545.20
GEM CO LTD-A	10,800	4.87	52,596.00
GUANGDONG HEC TECHNOLOGY H-A	6,300	6.54	41,202.00
GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	4,180	21.50	89,870.00
HANGZHOU OXYGEN PLANT GROU-A	2,000	24.60	49,200.00
HENAN SHENHUO COAL & POWER-A	3,500	15.89	55,615.00
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	14,520	12.00	174,240.00
HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	1,950	6.43	12,538.50
HESTEEL CO LTD-A	1,500	2.05	3,075.00
HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A	1,400	47.86	67,004.00
HUAFON CHEMICAL CO LTD -A	15,600	6.29	98,124.00
HUAI BEI MINING HOLDINGS CO-A	3,700	16.99	62,863.00
HUBEI FEILIHUA QUARTZ GLAS-A	1,000	27.35	27,350.00
HUBEI XINGFA CHEMICALS GRP-A	1,900	17.38	33,022.00
HUNAN VALIN STEEL CO LTD -A	14,600	5.09	74,314.00
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	73,300	1.42	104,086.00
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	15,700	3.53	55,421.00
INNER MONGOLIA YUAN XING-A	5,900	5.24	30,916.00
JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	13,900	9.82	136,498.00
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	390	54.09	21,095.10
JIANGSU YOKE TECHNOLOGY-A	500	43.30	21,650.00
JIANGXI COPPER CO LTD-A	6,500	17.50	113,750.00
JINDUICHENG MOLYBDENUM CO -A	6,700	9.09	60,903.00
LB GROUP CO LTD-A	4,500	15.80	71,100.00
LUXI CHEMICAL GROUP CO LT-A	1,900	9.25	17,575.00
NINGBO SHANSHAN CO LTD-A	2,300	11.37	26,151.00
NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	11,900	13.80	164,220.00
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	18,100	2.85	51,585.00
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY-A	15,300	14.90	227,970.00
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	24,750	9.50	235,125.00
SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A	8,090	14.14	114,392.60
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	6,368	20.29	129,206.72
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	3,520	24.95	87,824.00

SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	36,900	2.89	106,641.00
SHANDONG SUN PAPER INDUSTR-A	8,800	12.05	106,040.00
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	4,408	18.63	82,121.04
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	3,700	5.74	21,238.00
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	4,800	3.55	17,040.00
SHENGHE RESOURCES HOLDINGS-A	1,700	8.57	14,569.00
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	1,080	41.85	45,198.00
SHENZHEN DYNANONIC CO LTD-A	320	49.14	15,724.80
SHENZHEN SENIOR TECHNOLOGY-A	1,798	11.99	21,558.02
SHENZHEN YUTO PACKAGING TE-A	1,700	24.70	41,990.00
SICHUAN HEBANG BIOTECHNOL- A	14,200	2.32	32,944.00
SINOMA SCIENCE&TECHNOLOGY -A	2,200	14.35	31,570.00
SINOMINE RESOURCE GROUP CO-A	980	36.70	35,966.00
SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A	600	2.63	1,578.00
SKSHU PAINT CO LTD-A	784	39.46	30,936.64
SUNRESIN NEW MATERIALS CO -A	1,200	46.30	55,560.00
TANGSHAN JIDONG CEMENT INV-A	3,700	5.82	21,534.00
TIANQI LITHIUM CORP-A	4,100	55.30	226,730.00
TIANSHAN ALUMINUM GROUP CO-A	7,500	5.43	40,725.00
TONGKUN GROUP CO LTD-A	7,600	12.72	96,672.00
TONGLING NONFERROUS METALS-A	39,900	3.01	120,099.00
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	5,500	70.30	386,650.00
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	640	22.77	14,572.80
WESTERN MINING CO -A	3,300	14.04	46,332.00
WESTERN SUPERCONDUCTING TE-A	560	38.22	21,403.20
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD-A	1,200	16.21	19,452.00
YINTAI GOLD CO LTD-A	8,780	13.78	120,988.40
YONGXING SPECIAL MATERIALS-A	910	51.54	46,901.40
YUNNAN ALUMINIUM CO LTD-A	7,300	10.54	76,942.00
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	1,400	48.76	68,264.00
YUNNAN TIN CO LTD-A	3,500	13.17	46,095.00
YUNNAN YUNTIANHUA CO-A	1,500	15.32	22,980.00
ZANGGE MINING CO LTD-A	3,300	25.70	84,810.00
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	2,708	27.88	75,499.04
ZHEJIANG JUHUA CO-A	5,700	15.48	88,236.00
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	6,700	7.73	51,791.00
ZHONGJIN GOLD CORP-A	10,000	8.95	89,500.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	36,000	11.72	421,920.00
AECC AERO-ENGINE CONTROL-A	1,000	16.10	16,100.00
AECC AVIATION POWER CO-A	4,600	32.55	149,730.00
AVICOPTER PLC-A	500	34.11	17,055.00
BEIJING EASPRING MATERIAL-A	700	34.35	24,045.00
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	3,700	26.64	98,568.00

BEIJING UNITED INFORMATION-A	841	19.98	16,803.18
CHINA BAOAN GROUP-A	4,500	11.64	52,380.00
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	10,300	29.36	302,408.00
CHINA ENERGY ENGINEERING COR	52,300	2.10	109,830.00
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	9,700	6.21	60,237.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	47,100	6.03	284,013.00
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	73,200	4.87	356,484.00
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	7,860	153.48	1,206,352.80
COSCO SHIPPING DEVELOPMENT CO	18,400	2.35	43,240.00
CRRC CORP LTD-A	54,700	5.39	294,833.00
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	4,400	14.05	61,820.00
EVE ENERGY CO LTD-A	5,820	38.07	221,567.40
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	417	4.64	1,934.88
FAW JIEFANG GROUP CO LTD-A	3,200	7.95	25,440.00
GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A	600	71.60	42,960.00
GOLDWIND SCIENCE &TECHNOL-A	3,400	7.30	24,820.00
GONEO GROUP CO LTD	800	93.03	74,424.00
GOODWE TECHNOLOGIES CO LTD-A	280	120.85	33,838.00
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	3,900	19.07	74,373.00
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	1,680	23.84	40,051.20
HOYMILES POWER ELECTRONICS-A	298	233.05	69,448.90
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	2,436	52.95	128,986.20
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	5,300	12.26	64,978.00
JIANGXI SPECIAL ELECTRIC -A	2,500	10.85	27,125.00
KEDA INDUSTRIAL GROUP CO LTD	2,800	11.57	32,396.00
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A	2,200	12.77	28,094.00
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	39,700	3.11	123,467.00
MING YANG SMART ENERGY GRO-A	4,300	10.51	45,193.00
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	14,782	20.66	305,396.12
NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO -A	540	82.25	44,415.00
NINGBO ORIENT WIRES & CABL-A	1,000	38.27	38,270.00
NINGBO RONBAY NEW ENERGY T-A	450	32.76	14,742.00
NORTH INDUSTRIES GROUP RED-A	2,400	11.88	28,512.00
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	49,100	4.73	232,243.00
PYLON TECHNOLOGIES CO LTD-A	200	99.30	19,860.00
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	19,400	13.16	255,304.00
SHANGHAI CONSTRUCTION GROU-A	5,600	2.32	12,992.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	24,000	3.99	95,760.00
SHANXI COAL INTERNATIONAL -A	4,500	16.79	75,555.00
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	2,400	55.50	133,200.00
SICHUAN ROAD&BRIDGE GROUP-A	13,860	7.45	103,257.00
SIEYUAN ELECTRIC CO LTD-A	1,500	51.13	76,695.00
SINOMA INTERNATIONAL ENGIN-A	5,500	10.48	57,640.00

SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	3,300	89.20	294,360.00
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	1,300	12.75	16,575.00
TBEA CO LTD-A	10,920	14.31	156,265.20
TITAN WIND ENERGY SUZHOU-A	2,800	9.83	27,524.00
WEICHAJ POWER CO LTD-A	16,100	14.70	236,670.00
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	20,700	5.44	112,608.00
XIAMEN C & D INC-A	4,400	9.68	42,592.00
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	4,100	20.12	82,492.00
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	420	52.25	21,945.00
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	3,800	23.15	87,970.00
ZHEJIANG WEIXING NEW BUILD-A	1,300	13.54	17,602.00
ZHUZHOU CRRR TIMES ELECTRI-A	800	33.40	26,720.00
ZHUZHOU KIBING GROUP CO LT-A	4,000	6.18	24,720.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	15,500	7.21	111,755.00
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	1,800	32.81	59,058.00
ZHEFU HOLDING GROUP CO LTD-A	5,300	3.20	16,960.00
ZHEJIANG WEIMING ENVIRONME-A	2,340	16.72	39,124.80
AIR CHINA LTD-A	23,900	7.20	172,080.00
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	98,800	4.84	478,192.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	46,700	3.80	177,460.00
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	17,600	5.90	103,840.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	28,670	9.74	279,245.80
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	34,900	7.39	257,911.00
HAINAN AIRLINES HOLDING CO-A	81,700	1.38	112,746.00
JUNEYAO AIRLINES CO LTD-A	3,500	12.68	44,380.00
LIAONING PORT CO LTD-A	21,900	1.38	30,222.00
S F HOLDING CO LTD-A	8,600	37.73	324,478.00
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	2,100	33.52	70,392.00
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	8,900	5.38	47,882.00
SPRING AIRLINES CO LTD-A	1,900	53.73	102,087.00
YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	7,400	11.96	88,504.00
YUNDA HOLDING CO LTD-A	4,870	6.64	32,336.80
BETHEL AUTOMOTIVE SAFETY S-A	900	57.61	51,849.00
BYD CO LTD -A	3,600	188.70	679,320.00
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	700	132.40	92,680.00
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	17,126	13.81	236,510.06
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	3,400	37.42	127,228.00
GREAT WALL MOTOR CO LTD-A	6,400	22.15	141,760.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A	6,900	8.26	56,994.00
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	7,100	16.42	116,582.00
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	1,000	97.90	97,900.00
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	1,200	15.86	19,032.00
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	1,900	56.44	107,236.00

SAIC MOTOR CORP LTD-A	18,010	13.51	243,315.10
SAILUN GROUP CO LTD-A	9,500	11.60	110,200.00
SERES GROUP CO L-A	3,100	62.02	192,262.00
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	1,300	19.90	25,870.00
SHENZHEN KEDALI INDUSTRY C-A	400	71.20	28,480.00
BEIJING ROBOROCK TECHNOLOG-A	280	288.00	80,640.00
ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A	600	37.02	22,212.00
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	4,600	33.65	154,790.00
HAIER SMART HOME CO LTD-A	14,000	21.98	307,720.00
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	1,000	20.56	20,560.00
JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	1,040	33.58	34,923.20
OPPEIN HOME GROUP INC-A	1,040	62.60	65,104.00
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	1,700	50.50	85,850.00
BTG HOTELS GROUP CO LTD-A	1,600	14.60	23,360.00
OFFCN EDUCATION TECHNOLOGY-A	10,200	4.10	41,820.00
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	1,700	27.55	46,835.00
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	5,080	9.75	49,530.00
37 INTERACTIVE ENTERTAINME-A	3,900	18.56	72,384.00
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	1,300	8.06	10,478.00
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	23,800	5.93	141,134.00
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY XI	100	201.63	20,163.00
GIANT NETWORK GROUP CO LTD-A	4,100	9.93	40,713.00
KUNLUN TECH CO LTD-A	2,500	35.53	88,825.00
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	3,110	22.60	70,286.00
PEOPLE.CN CO LTD-A	2,000	23.33	46,660.00
PERFECT WORLD CO LTD-A	4,450	10.41	46,324.50
WANDA FILM HOLDING CO LTD-A	4,500	11.85	53,325.00
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	17,100	4.84	82,764.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	3,400	81.93	278,562.00
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	5,000	6.24	31,200.00
WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A	6,000	4.24	25,440.00
ZHEJIANG CHINA COMMODITIES-A	13,000	7.23	93,990.00
DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	1,036	23.86	24,718.96
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	2,164	38.70	83,746.80
YONGHUI SUPERSTORES COMPANY LIMITED	20,400	2.61	53,244.00
ANGEL YEAST CO LTD-A	700	32.60	22,820.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	800	207.83	166,264.00
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	500	39.98	19,990.00
ANHUI YINGJIA DISTILLERY C-A	1,600	55.55	88,880.00
ANJOY FOODS GROUP CO LTD	400	80.40	32,160.00
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	6,600	5.01	33,066.00
BEIJING YANJING BREWERY CO-A	3,900	7.81	30,459.00
CHONGQING BREWERY CO-A	800	58.55	46,840.00

EASTROC BEVERAGE GROUP CO -A	500	162.70	81,350.00
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	8,170	35.63	291,097.10
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	900	15.17	13,653.00
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	2,800	39.80	111,440.00
HEBEI YANGYUAN ZHIHUI BEVERA	2,600	22.00	57,200.00
HEILONGJIANG AGRICULTURE-A	2,500	11.35	28,375.00
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	7,400	27.42	202,908.00
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	11,500	26.80	308,200.00
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	2,000	42.12	84,240.00
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	2,700	94.84	256,068.00
JIUGUI LIQUOR CO LTD-A	400	65.68	26,272.00
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	300	24.45	7,335.00
JUEWEI FOOD CO LTD-A	300	22.24	6,672.00
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	2,300	1,626.00	3,739,800.00
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	3,100	151.74	470,394.00
MEIHUA HOLDINGS GROUP CO -A	5,400	10.07	54,378.00
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	9,416	35.87	337,751.92
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	7,600	8.30	63,080.00
SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT-A	1,372	22.43	30,773.96
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	2,120	200.72	425,526.40
SHEDE SPIRITS CO LTD-A	700	87.61	61,327.00
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	400	49.56	19,824.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-A	1,500	69.19	103,785.00
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	15,260	18.69	285,209.40
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	7,100	128.05	909,155.00
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	2,200	30.16	66,352.00
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	1,100	12.83	14,113.00
BY-HEALTH CO LTD-A	1,300	15.65	20,345.00
YUNNAN BOTANEE BIO-TECHNOL-A	400	63.41	25,364.00
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	17,368	14.01	243,325.68
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD-A	1,000	46.60	46,600.00
CHINA MEHECO CO LTD -A	2,240	10.18	22,803.20
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	3,300	27.33	90,189.00
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	700	54.05	37,835.00
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	2,940	32.88	96,667.20
IRAY TECHNOLOGY CO LTD-A	280	254.20	71,176.00
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A	3,000	33.68	101,040.00
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	8,344	6.84	57,072.96
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	1,900	13.59	25,821.00
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	8,380	4.89	40,978.20
OVCTEK CHINA INC-A	920	18.93	17,415.60
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	4,400	16.00	70,400.00
SHANGHAI UNITED IMAGING HE-A	1,800	136.95	246,510.00

SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	2,300	283.00	650,900.00
SHENZHEN NEW INDUSTRIES BI-A	2,400	76.37	183,288.00
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	300	66.40	19,920.00
APELOA PHARMACEUTICAL CO-A	900	13.29	11,961.00
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	680	96.55	65,654.00
BEIJING TIAN TAN BIOLOGICAL-A	3,300	27.17	89,661.00
BEIJING TONGRENTANG CO-A	2,300	51.02	117,346.00
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	2,415	62.00	149,730.00
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	300	41.60	12,480.00
BGI GENOMICS CO LTD-A	300	41.28	12,384.00
BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY COR-A	800	67.30	53,840.00
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	700	123.35	86,345.00
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	1,500	52.15	78,225.00
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	4,050	49.31	199,705.50
CSPC INNOVATION PHARMACEUT-A	2,900	34.82	100,978.00
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	1,200	50.06	60,072.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	300	47.80	14,340.00
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	4,680	18.53	86,720.40
HUBEI JUMPCAN PHARMACEUT-A	1,300	30.98	40,274.00
HUMANWELL HEALTHCARE GROUP-A	3,800	21.15	80,370.00
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	600	309.45	185,670.00
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	13,116	40.52	531,460.32
JOINCARE PHARMACEUTICAL GR-A	1,600	11.26	18,016.00
LIVZON PHARMACEUTICAL GROU-A	500	34.85	17,425.00
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	1,098	14.11	15,492.78
PHARMARON BEIJING CO LTD-A	3,675	24.76	90,993.00
SHANDONG BUCHANG PHARMACEU-A	260	15.50	4,030.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	3,600	22.72	81,792.00
SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCE-A	835	31.93	26,661.55
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	10,500	6.70	70,350.00
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	960	23.36	22,425.60
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	1,700	27.77	47,209.00
SHIJIAZHANG YILING PHARMA-A	2,600	21.89	56,914.00
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	2,400	24.54	58,896.00
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	3,000	19.11	57,330.00
WUXI APPTEC CO LTD-A	4,728	74.00	349,872.00
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	2,960	48.33	143,056.80
ZHANGZHOU PIENZHEHUANG PHA-A	1,100	225.23	247,753.00
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	1,210	12.55	15,185.50
ZHEJIANG JIUZHOU PHARMACEU-A	1,300	19.93	25,909.00
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	5,463	16.32	89,156.16
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	149,700	3.75	561,375.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	52,200	4.87	254,214.00

BANK OF CHANGSHA CO LTD-A	7,500	7.08	53,100.00
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	5,400	12.11	65,394.00
BANK OF CHINA LTD-A	75,900	4.10	311,190.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	77,900	5.84	454,936.00
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	13,000	10.56	137,280.00
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	40,100	7.10	284,710.00
BANK OF NANJING CO LTD -A	27,300	7.97	217,581.00
BANK OF NINGBO CO LTD -A	13,900	19.70	273,830.00
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	24,610	6.30	155,043.00
BANK OF SUZHOU CO LTD-A	5,100	7.00	35,700.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	20,400	6.64	135,456.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	78,400	3.02	236,768.00
CHINA MERCHANTS BANK-A	37,400	30.09	1,125,366.00
CHINA MINSHENG BANKING-A	67,800	3.83	259,674.00
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	60,270	2.64	159,112.80
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-A	26,300	4.19	110,197.00
CNPC CAPITAL CO LTD-A	10,900	5.59	60,931.00
HUAXIA BANK CO LTD-A	24,300	5.88	142,884.00
IND & COMM BK OF CHINA-A	110,700	4.97	550,179.00
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	40,800	15.30	624,240.00
PING AN BANK CO LTD-A	34,400	9.33	320,952.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	63,800	4.48	285,824.00
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	59,300	6.71	397,903.00
SHANGHAI RURAL COMMERCIAL -A	28,600	6.26	179,036.00
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A	13,900	3.15	43,785.00
BOC INTERNATIONAL CHINA CO-A	3,000	9.87	29,610.00
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	8,800	7.38	64,944.00
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	6,800	5.09	34,612.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-A	8,000	11.40	91,200.00
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	12,900	7.48	96,492.00
CHINA INTERNATIONAL CAPTAL-A	6,000	33.44	200,640.00
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	11,900	13.24	157,556.00
CITIC SECURITIES CO-A	21,500	20.52	441,180.00
CSC FINANCIAL CO LTD-A	7,500	22.76	170,700.00
DONGXING SECURITIES CO LT-A	6,200	7.79	48,298.00
EAST MONEY INFORMATION CO-A	27,812	13.27	369,065.24
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	6,600	15.99	105,534.00
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	500	5.50	2,750.00
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	17,000	7.38	125,460.00
GF SECURITIES CO LTD-A	9,500	13.93	132,335.00
GUANGZHOU YUEXIU CAPITAL H-A	4,374	5.90	25,806.60
GUOLIAN SECURITIES CO LTD-A	2,200	10.39	22,858.00
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	11,300	8.14	91,982.00

GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	18,000	14.74	265,320.00
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	9,500	6.56	62,320.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	18,700	9.20	172,040.00
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	1,000	129.35	129,350.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	13,100	14.16	185,496.00
HUAXI SECURITIES CO LTD-A	300	8.04	2,412.00
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	16,300	5.59	91,117.00
NANJING SECURITIES CO LTD	7,600	7.80	59,280.00
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	21,600	8.69	187,704.00
SDIC CAPITAL CO LTD-A	11,000	6.65	73,150.00
SHANXI SECURITIES CO LTD-A	400	5.14	2,056.00
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	45,600	4.32	196,992.00
SINOLINK SECURITIES CO LTD-A	7,700	8.60	66,220.00
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	9,700	7.02	68,094.00
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	3,800	3.89	14,782.00
WESTERN SECURITIES CO LTD-A	10,000	6.10	61,000.00
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	6,000	10.00	60,000.00
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD-A	10,500	6.69	70,245.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	4,500	26.95	121,275.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	14,700	22.90	336,630.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	3,800	29.49	112,062.00
PICC HOLDING CO-A	15,500	4.89	75,795.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	20,900	40.17	839,553.00
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	11,700	7.70	90,090.00
BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	800	239.40	191,520.00
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	4,674	7.92	37,018.08
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	1,170	27.25	31,882.50
DHC SOFTWARE CO LTD -A	400	5.32	2,128.00
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	3,073	24.50	75,288.50
IFLYTEK CO LTD - A	6,100	42.40	258,640.00
NAVINFO CO LTD-A	4,800	7.49	35,952.00
QI AN XIN TECHNOLOGY GROUP-A	1,252	33.52	41,967.04
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	900	61.05	54,945.00
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	2,995	43.32	129,743.40
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	900	57.48	51,732.00
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	5,908	12.67	74,854.36
AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A	2,300	19.12	43,976.00
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	83,900	3.66	307,074.00
CETC CYBERSPACE SECURITY T-A	1,300	17.60	22,880.00
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	4,500	24.79	111,555.00
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	6,700	8.72	58,424.00
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-A	11,000	4.22	46,420.00
CHINA ZHENHUA GROUP SCIENC-A	1,200	47.74	57,288.00

FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	27,800	14.50	403,100.00
GOERTEK INC -A	6,100	17.34	105,774.00
GRG BANKING EQUIPMENT CO -A	2,200	9.97	21,934.00
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	22,300	5.17	115,291.00
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICAT-A	7,600	10.92	82,992.00
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	1,500	38.96	58,440.00
HENGDIAN GROUP DMEGC -A	2,700	13.81	37,287.00
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO-A	3,700	11.12	41,144.00
HUAGONG TECH CO LTD-A	2,700	27.84	75,168.00
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	2,400	31.93	76,632.00
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	9,600	11.63	111,648.00
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	12,833	29.05	372,798.65
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	1,576	105.45	166,189.20
NINESTAR CORP-A	1,800	19.40	34,920.00
RAYTRON TECHNOLOGY CO LTD-A	700	36.47	25,529.00
SHANGHAI BOCHU ELECTRONIC-A	280	249.10	69,748.00
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	7,200	15.83	113,976.00
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	780	56.56	44,116.80
SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY-A	3,500	12.63	44,205.00
SHENZHEN SUNLORD ELECTRONI-A	800	23.44	18,752.00
SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	1,794	139.46	250,191.24
SUPCON TECHNOLOGY CO LTD-A	870	37.68	32,781.60
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	3,300	14.56	48,048.00
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	31,790	4.27	135,743.30
TIANJIN712 COMMUNICATION &-A	700	26.18	18,326.00
TIANMA MICROELECTRONICS-A	2,400	8.95	21,480.00
UNISPLENDOR CORP LTD-A	4,876	17.24	84,062.24
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	2,700	36.15	97,605.00
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	3,464	6.10	21,130.40
WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHA-A	5,860	22.55	132,143.00
XIAMEN FARATRONIC CO LTD-A	400	99.88	39,952.00
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	2,240	27.20	60,928.00
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	6,300	16.84	106,092.00
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	1,700	113.70	193,290.00
ZTE CORP-A	6,400	24.02	153,728.00
CHINA UNITED NETWORK-A	59,700	4.12	245,964.00
CECEP SOLAR ENERGY CO LT-A	6,500	5.10	33,150.00
CECEP WIND POWER CORP-A	7,900	2.80	22,120.00
CGN POWER CO LTD-A	40,600	3.41	138,446.00
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	32,500	7.98	259,350.00
CHINA THREE GORGES RENEWAB-A	64,100	4.36	279,476.00
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	44,900	23.85	1,070,865.00
DATANG INTL POWER GEN CO-A	20,000	2.37	47,400.00

ENN NATURAL GAS CO LTD-A	4,800	17.28	82,944.00
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	31,000	4.16	128,960.00
HUADIAN POWER INTL CORP-A	12,500	5.60	70,000.00
HUANENG POWER INTL INC-A	18,200	8.45	153,790.00
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	13,800	13.20	182,160.00
SHANGHAI ELECTRIC POWER CO-A	7,100	7.79	55,309.00
SHENERGY COMPANY LIMITED	9,900	6.89	68,211.00
SHENZHEN ENERGY GROUP CO L-A	11,600	6.06	70,296.00
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A	12,900	14.61	188,469.00
ZHEJIANG ZHENENG ELECTRIC-A	21,300	5.00	106,500.00
3PEAK INC-A	200	109.51	21,902.00
ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	1,543	132.00	203,676.00
AMLOGIC SHANGHAI INC-A	600	48.55	29,130.00
CAMBRICON TECHNOLOGIES-A	800	131.60	105,280.00
CHINA RESOURCES MICROELECT-A	2,200	40.60	89,320.00
FLAT GLASS GROUP CO LTD-A	2,300	25.10	57,730.00
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR I-A	1,356	72.10	97,767.60
HANGZHOU CHANG CHUAN TECHN-A	1,300	29.60	38,480.00
HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	5,652	25.36	143,334.72
HANGZHOU LION ELECTRONICS -A	1,000	23.58	23,580.00
HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	2,000	20.29	40,580.00
HOYUAN GREEN ENERGY CO LTD	978	29.66	29,007.48
HYGON INFORMATION TECHNOLO-A	4,200	72.90	306,180.00
INGENIC SEMICONDUCTOR CO -A	1,200	51.93	62,316.00
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	9,612	20.98	201,659.76
JCET GROUP CO LTD-A	3,800	24.51	93,138.00
JIANGSU PACIFIC QUARTZ CO -A	700	78.19	54,733.00
JINKO SOLAR CO LTD-A	13,400	9.19	123,146.00
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	12,936	21.78	281,746.08
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A	3,314	51.97	172,228.58
NATIONAL SILICON INDUSTRY -A	5,600	15.19	85,064.00
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	900	252.12	226,908.00
PIOTECH INC-A	296	172.59	51,086.64
RISEN ENERGY CO LTD-A	2,400	16.17	38,808.00
SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	9,900	12.45	123,255.00
SG MICRO CORP-A	1,007	65.99	66,451.93
SHANGHAI AIKO SOLAR ENERGY-A	3,220	18.16	58,475.20
SHANGHAI FUDAN MICROELE-DO-A	800	30.17	24,136.00
SHENZHEN SC NEW ENERGY TEC-A	300	66.25	19,875.00
STARPOWER SEMICONDUCTOR LT-A	200	163.06	32,612.00
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	409	121.17	49,558.53
TCL ZHONGHUAN RENEWABLE EN-A	8,075	15.33	123,789.75
TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	1,900	7.10	13,490.00

	TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	3,200	20.92	66,944.00	
	TONGWEI CO LTD-A	10,500	25.99	272,895.00	
	TRINA SOLAR CO LTD-A	3,200	26.48	84,736.00	
	UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	1,819	57.56	104,701.64	
	VERISILICON MICROELECTRONI-A	1,000	39.41	39,410.00	
	WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	2,185	89.30	195,120.50	
	WUXI AUTOWELL TECHNOLOGY C-A	580	83.36	48,348.80	
	XINJIANG DAQO NEW ENERGY C-A	3,600	27.24	98,064.00	
	YANGZHOU YANGJIE ELECTRONI-A	700	39.13	27,391.00	
	ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	3,900	37.38	145,782.00	
	CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	19,800	8.38	165,924.00	
	CHINA VANKE CO LTD -A	16,400	9.41	154,324.00	
	HAINAN AIRPORT INFRASTRUCT-A	21,800	3.54	77,172.00	
	HANGZHOU BINJIANG REAL EST-A	5,600	6.64	37,184.00	
	POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	26,600	8.98	238,868.00	
	SHANGHAI LINGANG HOLDINGS-A	7,280	9.83	71,562.40	
	SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	24,900	2.91	72,459.00	
	YOUNGOR FASHION CO LTD	14,000	6.59	92,260.00	
	オフショア人民元 小計	5,094,759		63,270,630.73 (1,306,918,148)	
サウジアラビア リアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	14,462	9.22	133,339.64	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	81,049	31.70	2,569,253.30	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	3,568	37.65	134,335.20	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	8,294	11.70	97,039.80	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	6,803	129.80	883,029.40	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	10,211	30.75	313,988.25	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	39,602	46.75	1,851,393.50	
	SAUDI ARAMCO BASE OIL CO	1,374	148.60	204,176.40	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	27,526	79.30	2,182,811.80	
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	13,346	20.10	268,254.60	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	26,793	9.67	259,088.31	
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	7,669	37.95	291,038.55	
	SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	1,076	217.00	233,492.00	
	JARIR MARKETING CO	19,801	15.20	300,975.20	
	NAHDI MEDICAL CO	1,469	142.80	209,773.20	
	ALMARAI CO	6,924	58.80	407,131.20	
	SAVOLA	8,665	45.40	393,391.00	
	DALLAH HEALTHCARE CO	835	170.00	141,950.00	
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	2,693	295.60	796,050.80	
	MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	2,644	123.20	325,740.80	
	AL RAJHI BANK	59,527	87.90	5,232,423.30	
	ALINMA BANK	29,985	43.35	1,299,849.75	
	ARAB NATIONAL BANK	19,226	25.55	491,224.30	

BANK AL-JAZIRA	11,133	19.40	215,980.20	
BANK ALBILAD	15,360	46.45	713,472.00	
BANQUE SAUDI FRANSI	18,465	41.40	764,451.00	
RIYAD BANK	44,963	30.60	1,375,867.80	
SAUDI AWWAL BANK	29,111	37.20	1,082,929.20	
SAUDI INVESTMENT BANK/THE	13,432	16.44	220,822.08	
THE SAUDI NATIONAL BANK	89,368	43.15	3,856,229.20	
SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING	1,363	217.20	296,043.60	
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	2,528	221.60	560,204.80	
CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	2,529	125.20	316,630.80	
ARABIAN INTERNET & COMMUNICA	788	337.80	266,186.40	
ELM CO	746	927.20	691,691.20	
ETIHAD ETISALAT CO	10,475	52.50	549,937.50	
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	13,459	13.60	183,042.40	
SAUDI TELECOM CO	60,898	42.40	2,582,075.20	
ACWA POWER CO	2,657	245.20	651,496.40	
POWER & WATER UTILITY CO FOR	2,042	64.50	131,709.00	
SAUDI ELECTRICITY CO	26,234	19.04	499,495.36	
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	14,772	13.82	204,149.04	
サウジアラビアリアル 小計	753,865		34,182,163.48 (1,349,853,635)	
合計	180,875,884		30,364,860,375 (30,364,860,375)	

(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	2,669,754.00	
		OPERADORA DE SITES MEX- A-1	33,000	654,060.00	
		PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA	20,800	1,538,368.00	
		メキシコペソ 小計	143,600	4,862,182.00 (41,698,072)	
	合計		41,698,072 (41,698,072)		

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

## 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式 37銘柄	100.0%		2.9%
メキシコペソ	株式 21銘柄	94.9%		2.6%
	投資証券 3銘柄		5.1%	0.1%
ブラジルリアル	株式 48銘柄	100.0%		5.7%

チリペソ	株式	12銘柄	100.0%		0.5%
コロンビアペソ	株式	3銘柄	100.0%		0.1%
ユーロ	株式	10銘柄	100.0%		0.5%
トルコリラ	株式	18銘柄	100.0%		0.7%
チェココルナ	株式	3銘柄	100.0%		0.1%
ハンガリーフォリント	株式	3銘柄	100.0%		0.3%
ポーランドズロチ	株式	15銘柄	100.0%		0.9%
ロシアルーブル	株式	14銘柄			
香港ドル	株式	179銘柄	100.0%		18.9%
マレーシアリンギット	株式	31銘柄	100.0%		1.4%
タイバーツ	株式	38銘柄	100.0%		1.7%
フィリピンペソ	株式	14銘柄	100.0%		0.7%
インドネシアルピア	株式	22銘柄	100.0%		1.9%
韓国ウォン	株式	102銘柄	100.0%		12.1%
新台湾ドル	株式	90銘柄	100.0%		16.4%
インドルピー	株式	131銘柄	100.0%		17.7%
カタールリアル	株式	13銘柄	100.0%		0.9%
南アフリカランド	株式	32銘柄	100.0%		3.0%
アラブディルハム	株式	11銘柄	100.0%		1.3%
クウェートディナール	株式	7銘柄	100.0%		0.9%
オフショア人民元	株式	509銘柄	100.0%		4.3%
サウジアラビアリアル	株式	42銘柄	100.0%		4.4%

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

## R M国内リートマザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

2024年 1月25日現在	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	1,508,818,921
投資証券	49,756,411,050
派生商品評価勘定	1,343,400
未収入金	1,977,200
未収配当金	352,332,338
差入委託証拠金	38,780,114
流動資産合計	51,659,663,023
資産合計	51,659,663,023
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,723,830
前受金	5,286,000
未払解約金	1,168,173,600
未払利息	4,092
流動負債合計	1,175,187,522
負債合計	1,175,187,522

2024年 1月25日現在

純資産の部	
元本等	
元本	35,360,404,912
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	15,124,070,589
元本等合計	50,484,475,501
純資産合計	50,484,475,501
負債純資産合計	51,659,663,023

## 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 1月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 1月26日
期首元本額	24,532,566,630円
期中追加設定元本額	24,224,409,175円
期中一部解約元本額	13,396,570,893円
期末元本額	35,360,404,912円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	828,798,328円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	1,277,042,223円
りそなラップ型ファンド(成長型)	1,790,814,999円
DCりそな グローバルバランス	30,717,803円
つみたてバランスファンド	2,948,671,698円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	310,531,575円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	238,216,315円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	166,333,907円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	87,270,876円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	59,580,643円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	34,076,321円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	79,218,671円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	131,268,307円
九州SDGs・グローバルバランス	54,989,214円
りそな国内リートインデックス(ラップ専用)	2,630,988,762円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定型)	6,016,932円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定成長型)	84,590,123円
ラップ型ファンド・プラスESG(成長型)	83,806,666円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定型)	27,999,320円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定成長型)	49,718,283円
りそな つみたてラップ型ファンド(成長型)	53,031,452円
りそな つみたてリスクコントロールファンド	8,277,781円
ターゲットリターンバランスファンド(目標2%)	415,903円
ターゲットリターンバランスファンド(目標3%)	190,669円
ターゲットリターンバランスファンド(目標4%)	1,216,530円
ターゲットリターンバランスファンド(目標5%)	642,062円
ターゲットリターンバランスファンド(目標6%)	2,130,460円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2065	235,839円
りそなJリートインデックス(年1回決算型)	671,068円
りそなJリートインデックス(年4回決算型)	5,494,953円
FWりそな国内リートインデックスオープン	8,280,182,868円
FWりそな国内リートインデックスファンド	7,587,604,403円

Smart-i リートインデックス	3,279,141,464円
Smart-i 8資産バランス 安定型	78,601,072円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	263,823,648円
Smart-i 8資産バランス 成長型	370,574,947円
J-REITインデックスファンド（適格機関投資家専用）	2,969,850,664円
りそなDAAファンド（適格機関投資家専用）	192,358,703円
りそなVIグローバル・バランスファンド（安定型）（適格機関投資家専用）	2,715,554円
りそなVIグローバル・バランスファンド（安定成長型）（適格機関投資家専用）	10,834,218円
りそなVIグローバル・バランスファンド（成長型）（適格機関投資家専用）	24,692,670円
りそなDAAマルチアセットファンド（適格機関投資家専用）	28,046円
りそなマルチアセットファンド（適格機関投資家専用）	12,060,625円
りそなDAAファンド（適格機関投資家専用）	17,894,606円
J-REITインデックスファンド202102（適格機関投資家専用）	133,840,674円
りそなDAAファンド202205（適格機関投資家専用）	402,895,432円
りそなFT グローバルリートファンド202307（適格機関投資家専用）	489,477,796円
りそなマルチアセットファンド202310（適格機関投資家専用）	250,869,839円
2. 計算日における受益権の総数	35,360,404,912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	1.4277円
(10,000口当たり純資産額)	(14,277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 1月25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 1月25日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ
2. 時価の算定方法	投資証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 デリバティブ取引 (その他の注記)の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 1月25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 1月25日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
投資証券	776,465,738	
合計	776,465,738	

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

## 2 デリバティブ取引に関する注記

(投資証券関連)

(2024年 1月25日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	うち1年超		時価	評価損益
市場取引	不動産投信指数先物取引 買建	649,242,930	-		648,862,500	380,430
	合計	649,242,930	-		648,862,500	380,430

(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	983	119,237,900	
	サンケイリアルエステート投資法人	1,549	141,423,700	
	S O S i L A 物流リート投資法人	2,412	287,751,600	
	東海道リート投資法人	719	92,032,000	
	日本アコモデーションファンド投資法人	1,670	1,017,030,000	
	森ヒルズリート投資法人	5,686	793,197,000	
	産業ファンド投資法人	7,377	1,023,927,600	
	アドバンス・レジデンス投資法人	4,744	1,558,404,000	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	2,537	1,035,096,000	
	G L P 投資法人	16,333	2,182,088,800	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	2,378	752,637,000	
	日本プロロジスリート投資法人	8,423	2,292,740,600	
	星野リゾート・リート投資法人	892	469,192,000	
	O n e リート投資法人	843	228,200,100	
	イオンリート投資法人	5,931	839,236,500	
	ヒューリックリート投資法人	4,524	708,458,400	
	日本リート投資法人	1,571	536,496,500	

積水ハウス・リート投資法人	14,529	1,133,262,000	
トーセイ・リート投資法人	1,018	142,520,000	
ヘルスケア&メディカル投資法人	1,192	162,588,800	
サムティ・レジデンシャル投資法人	1,317	145,923,600	
野村不動産マスターファンド投資法人	15,636	2,501,760,000	
いちごホテルリート投資法人	801	96,360,300	
ラサールロジポート投資法人	6,181	922,205,200	
スターアジア不動産投資法人	7,452	444,884,400	
マリモ地方創生リート投資法人	745	92,529,000	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	2,011	929,082,000	
大江戸温泉リート投資法人	739	54,759,900	
投資法人みらい	6,635	299,570,250	
三菱地所物流リート投資法人	1,670	627,920,000	
C R E ロジスティクスファンド投資法人	2,081	318,184,900	
ザイマックス・リート投資法人	784	93,688,000	
タカラレーベン不動産投資法人	2,293	238,930,600	
アドバンス・ロジスティクス投資法人	2,119	269,748,700	
日本ビルファンド投資法人	5,641	3,333,831,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	4,967	2,791,454,000	
日本都市ファンド投資法人	23,176	2,315,282,400	
オリックス不動産投資法人	9,634	1,628,146,000	
日本プライムリアルティ投資法人	3,307	1,162,410,500	
N T T 都市開発リート投資法人	4,902	618,142,200	
東急リアル・エステート投資法人	3,242	573,509,800	
グローバル・ワン不動産投資法人	3,570	391,272,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	10,816	1,623,481,600	
森トラストリート投資法人	9,320	689,680,000	
インヴィンシブル投資法人	23,411	1,430,412,100	
フロンティア不動産投資法人	1,794	787,566,000	
平和不動産リート投資法人	3,613	496,787,500	
日本ロジスティクスファンド投資法人	3,097	873,044,300	
福岡リート投資法人	2,501	430,422,100	
K D X 不動産投資法人	13,914	2,277,721,800	
いちごオフィスリート投資法人	3,962	325,280,200	
大和証券オフィス投資法人	1,002	619,236,000	
阪急阪神リート投資法人	2,305	330,998,000	
スタートプロシード投資法人	838	169,359,800	
大和ハウスリート投資法人	7,288	1,848,965,600	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	16,186	1,218,805,800	
大和証券リビング投資法人	7,120	758,992,000	
ジャパンエクセレント投資法人	4,202	510,543,000	
合計	305,583	49,756,411,050	

(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 1月25日現在	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	377,254,763
コール・ローン	45,421,637
株式	576,188,854
投資証券	65,467,872,891
未収入金	1,114,564,300
未収配当金	86,873,494
流動資産合計	67,668,175,939
資産合計	
67,668,175,939	
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,830,442
未払金	1,315,601,189
未払解約金	100,217,700
未払利息	123
流動負債合計	1,417,649,454
負債合計	
1,417,649,454	
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	41,161,930,061
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	25,088,596,424
元本等合計	66,250,526,485
純資産合計	
66,250,526,485	
負債純資産合計	
67,668,175,939	

## 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 1月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 1月26日
期首元本額	22,031,677,932円
期中追加設定元本額	32,300,080,777円
期中一部解約元本額	13,169,828,648円
期末元本額	41,161,930,061円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	1,120,847,668円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	1,935,784,217円
りそなラップ型ファンド(成長型)	2,818,783,715円
DCりそな グローバルバランス	28,211,140円
つみたてバランスファンド	1,302,925,339円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	568,043,508円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	421,802,207円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	293,515,858円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	154,617,802円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	105,145,520円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	60,052,549円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	140,846,519円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	231,164,106円
九州SDGs・グローバルバランス	95,523,097円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定型)	8,139,883円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定成長型)	126,613,862円
ラップ型ファンド・プラスESG(成長型)	120,809,761円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定型)	37,342,062円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定成長型)	75,285,512円
りそな つみたてラップ型ファンド(成長型)	86,098,603円
りそな つみたてリスクコントロールファンド	2,669,827円
ターゲットリターンバランスファンド(目標2%)	741,655円
ターゲットリターンバランスファンド(目標3%)	340,086円
ターゲットリターンバランスファンド(目標4%)	2,188,514円
ターゲットリターンバランスファンド(目標5%)	1,146,783円
ターゲットリターンバランスファンド(目標6%)	3,777,473円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2065	418,734円
FWりそな先進国リートインデックスオープン	13,725,694,616円
FWりそな先進国リートインデックスファンド	12,583,631,980円
Smart-i 先進国リートインデックス	2,975,877,913円
Smart-i 8資産バランス 安定型	139,502,908円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	484,431,682円
Smart-i 8資産バランス 成長型	659,645,282円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	156,299,096円
りそなVIグローバル・バランスファンド(安定型)(適格機関投資家専用)	3,671,649円
りそなVIグローバル・バランスファンド(安定成長型)(適格機関投資家専用)	8,220,943円
りそなVIグローバル・バランスファンド(成長型)(適格機関投資家専用)	131,227,062円
りそなDAAマルチアセットファンド(適格機関投資家専用)	103,041円
りそなマルチアセットファンド(適格機関投資家専用)	10,484,631円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	31,968,287円
りそなDAAファンド202205(適格機関投資家専用)	327,368,792円
りそなFT グローバルリートファンド202307(適格機関投資家専用)	180,966,179円
2. 計算日における受益権の総数	41,161,930,061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	1.6095円
(10,000口当たり純資産額)	(16,095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 1月25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 1月25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 1月25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 1月25日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式		16,489,010
投資証券		576,943,246
合計		560,454,236

(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 1月25日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	うち1年超		時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引					
	買建	1,053,637,587	-	1,051,807,145	1,830,442	
	米ドル	940,736,992	-	939,207,825	1,529,167	
	カナダドル	18,684,530	-	18,578,348	106,182	
	ユーロ	38,681,784	-	38,589,912	91,872	
	英ポンド	55,534,281	-	55,431,060	103,221	
合計		1,053,637,587	-	1,051,807,145	1,830,442	

(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	90,324	28.46	2,570,621.04	
	BROADSTONE NET LEASE INC-A	63,651	16.43	1,045,785.93	
米ドル 小計		153,975		3,616,406.97 (534,721,934)	
オーストラリアドル	CENTURIA CAPITAL GROUP	262,613	1.62	426,746.12	
オーストラリアドル 小計		262,613		426,746.12 (41,466,920)	
合計		416,588		576,188,854 (576,188,854)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。

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

## (2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	ACADIA REALTY TRUST	32,484	557,425.44	
		AGREE REALTY CORP	34,097	2,015,132.70	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	23,955	426,159.45	
		ALEXANDER'S INC	738	169,046.28	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	52,981	6,398,515.37	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	4,715	74,402.70	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	16,085	375,102.20	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	107,758	3,775,840.32	
		APARTMENT INCOME REIT CO	49,862	1,667,385.28	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	46,456	355,852.96	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	72,345	1,170,542.10	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	21,510	259,410.60	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	12,741	17,964.81	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	48,090	8,465,282.70	
		BOSTON PROPERTIES INC	48,949	3,448,946.54	

BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	21,236	48,418.08	
BRANDYWINE REALTY TRUST	55,308	277,646.16	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	101,944	2,280,487.28	
BRT APARTMENTS CORP	3,225	56,760.00	
CAMDEN PROPERTY TRUST	36,178	3,530,249.24	
CARETRUST REIT INC	39,521	843,773.35	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	8,439	199,919.91	
CENTERSPACE	4,785	268,199.25	
CHATHAM LODGING TRUST	17,055	181,806.30	
CITY OFFICE REIT INC	14,501	79,030.45	
CLIPPER REALTY INC	2,188	11,071.28	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	8,866	228,654.14	
COPT DEFENSE PROPERTIES	38,308	931,650.56	
COUSINS PROPERTIES INC	51,579	1,183,738.05	
CTO REALTY GROWTH INC	6,920	114,941.20	
CUBESMART	76,257	3,424,701.87	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	71,232	647,498.88	
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	235,700	150,848.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	102,534	14,142,514.62	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	71,250	203,062.50	
DOUGLAS EMMETT INC	56,808	816,899.04	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	82,000	0.00	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	31,734	402,069.78	
EASTGROUP PROPERTIES INC	15,701	2,793,364.91	
ELME COMMUNITIES	30,001	440,114.67	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	44,714	449,822.84	
EPR PROPERTIES	25,615	1,137,818.30	
EQUINIX INC	31,782	25,273,682.04	
EQUITY COMMONWEALTH	35,279	677,356.80	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	63,145	4,139,154.75	
EQUITY RESIDENTIAL	117,024	6,876,330.24	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	52,989	1,306,178.85	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	21,741	5,101,743.06	
EXTRA SPACE STORAGE INC	71,559	10,512,732.69	
FARMLAND PARTNERS INC	15,087	175,914.42	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	24,909	2,521,538.07	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	44,836	2,330,575.28	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	30,839	724,099.72	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	33,544	82,518.24	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	90,494	4,153,674.60	
GETTY REALTY CORP	16,148	443,747.04	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	13,837	184,170.47	
GLADSTONE LAND CORP	11,212	154,501.36	

GLOBAL MEDICAL REIT INC	21,276	215,525.88	
GLOBAL NET LEASE INC	66,358	581,959.66	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	129,163	2,093,732.23	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	185,385	3,546,415.05	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	36,008	801,178.00	
HOST HOTELS & RESORTS INC	239,042	4,651,757.32	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	41,582	358,852.66	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	76,299	1,162,033.77	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	17,584	69,280.96	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	9,333	872,168.85	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	22,972	576,597.20	
INVITATION HOMES INC	194,819	6,452,405.28	
IRON MOUNTAIN INC	98,932	6,629,433.32	
JBG SMITH PROPERTIES	29,625	491,478.75	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	274,900	90,717.00	
KILROY REALTY CORP	36,248	1,401,347.68	
KIMCO REALTY CORP	225,313	4,553,575.73	
KITE REALTY GROUP TRUST	74,465	1,603,976.10	
LTC PROPERTIES INC	14,102	444,213.00	
LXP INDUSTRIAL TRUST	97,198	902,969.42	
MACERICH CO/THE	73,209	1,194,038.79	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	635,700	42,591.90	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	198,881	652,329.68	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	39,524	5,298,587.44	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	25,731	977,006.07	
NATL HEALTH INVESTORS INC	14,395	776,754.20	
NET LEASE OFFICE PROPERTY	5,087	123,715.84	
NETSTREIT CORP	22,376	404,781.84	
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES	11,712	78,704.64	
NEXPOINT RESIDENTIAL	7,918	255,513.86	
NNN REIT INC	61,858	2,543,600.96	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	17,029	59,942.08	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	83,066	2,390,639.48	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	5,669	119,049.00	
ORION OFFICE REIT INC	19,499	102,369.75	
PARAMOUNT GROUP INC	52,963	262,166.85	
PARK HOTELS & RESORTS INC	71,395	1,098,769.05	
PEAKSTONE REALTY TRUST	11,731	185,349.80	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	40,969	636,658.26	
PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	40,607	1,430,584.61	
PHYSICIANS REALTY TRUST	81,041	1,026,789.47	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	40,404	293,333.04	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	11,658	262,654.74	

	POSTAL REALTY TRUST INC- A	6,456	92,320.80
	PRIME US REIT	183,100	35,521.40
	PROLOGIS INC	312,774	39,234,370.56
	PUBLIC STORAGE	53,588	15,471,391.48
	REALTY INCOME CORP	281,567	15,483,369.33
	REGENCY CENTERS CORP	55,676	3,463,603.96
	RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	42,848	592,587.84
	REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	71,514	3,829,574.70
	RLJ LODGING TRUST	51,426	592,427.52
	RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	20,257	2,211,861.83
	SABRA HEALTH CARE REIT INC	78,570	1,037,909.70
	SAFEHOLD INC	15,004	307,431.96
	SAUL CENTERS INC	4,442	173,548.94
	SERVICE PROPERTIES TRUST	56,152	430,124.32
	SIMON PROPERTY GROUP INC	110,458	15,628,702.42
	SITE CENTERS CORP	59,750	810,210.00
	SL GREEN REALTY CORP	21,922	999,862.42
	STAG INDUSTRIAL INC	61,548	2,308,665.48
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	34,205	226,095.05
	SUN COMMUNITIES INC	42,151	5,254,965.17
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	70,030	729,712.60
	TANGER INC	34,991	968,900.79
	TERRENO REALTY CORP	28,457	1,701,728.60
	UDR INC	102,528	3,763,802.88
	UMH PROPERTIES INC	20,336	311,750.88
	UNITI GROUP INC	79,038	420,086.97
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	4,387	181,709.54
	URBAN EDGE PROPERTIES	39,942	690,996.60
	VENTAS INC	136,285	6,480,351.75
	VERIS RESIDENTIAL INC	26,566	414,429.60
	VICI PROPERTIES INC	350,343	10,629,406.62
	VORNADO REALTY TRUST	54,307	1,503,760.83
	WELLTOWER INC	187,386	16,326,942.18
	WHITESTONE REIT	15,983	200,586.65
	WP CAREY INC	74,090	4,720,273.90
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	34,876	462,804.52
	米ドル 小計	8,786,769	344,087,326.74 (50,876,752,131)
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	21,766	446,638.32
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	20,272	138,863.20
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	7,864	564,242.00
	BSR REAL ESTATE INVESTMENT T	6,564	103,645.56
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	14,969	47,002.66

	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	27,972	1,307,411.28
	CHOICE PROPERTIES REIT	55,067	790,762.12
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	18,269	250,285.30
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	16,751	247,747.29
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	45,749	618,983.97
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	5,350	58,636.00
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	34,831	536,745.71
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	10,319	773,925.00
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	42,332	423,743.32
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	23,103	304,728.57
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	18,513	342,675.63
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	5,378	88,199.20
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	6,979	105,941.22
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	12,242	102,343.12
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	41,452	210,576.16
	PRIMARIS REIT	16,503	229,721.76
	PRO REAL ESTATE INVESTMENT T	8,626	47,960.56
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	50,264	936,920.96
	SLATE GROCERY REIT	10,423	131,955.18
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	24,386	608,430.70
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	2,814	26,226.48
	カナダドル 小計	548,758	9,444,311.27 (1,032,263,221)
ユーロ	AEDIFICA	16,212	950,833.80
	ALTAREA	1,602	130,402.80
	CARE PROPERTY INVEST	12,957	165,590.46
	CARMILA	18,403	298,128.60
	COFINIMMO	12,555	843,696.00
	COVIVIO	16,136	743,546.88
	CROMWELL REIT EUR	96,840	135,576.00
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	14,968	314,328.00
	GECINA SA	17,444	1,822,898.00
	HAMBORNER REIT AG	25,326	168,164.64
	ICADE	10,496	346,997.76
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	14,471	32,415.04
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	94,583	551,418.89
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	9,013	187,470.40
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	148,220	173,417.40
	KLEPIERRE	66,302	1,560,749.08
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	16,228	101,262.72
	MERCIALYS	31,308	338,752.56
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	113,725	1,074,701.25
	MONTEA NV	5,172	416,346.00

	NSI NV	6,467	120,286.20
	RETAIL ESTATES	3,914	239,928.20
	SHURGARD SELF STORAGE LTD	10,255	429,735.77
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	34,457	2,297,592.76
	VASTNED RETAIL NV	6,207	128,174.55
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	58,913	1,549,411.90
	WERELDHAVE NV	12,895	180,401.05
	XIOR STUDENT HOUSING NV	9,682	270,127.80
	ユーロ 小計	884,751	15,572,354.51 (2,504,190,328)
英債券	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	141,815	76,296.47
	AEW UK REIT PLC	60,678	57,826.13
	ASSURA PLC	1,012,041	451,775.10
	BALANCED COMM PROPERTY TRUST	225,374	165,649.89
	BIG YELLOW GROUP PLC	66,842	730,583.06
	BRITISH LAND CO PLC	318,557	1,190,128.95
	CLS HOLDINGS PLC	43,072	41,435.26
	CUSTODIAN PROPERTY INCOME REIT PLC	153,661	108,484.66
	DERWENT LONDON PLC	38,187	805,745.70
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	212,261	195,704.64
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	87,118	359,797.34
	HAMMERSON PLC	1,314,992	346,105.89
	HELICAL PLC	33,175	71,492.12
	HOME REIT PLC	147,401	56,086.08
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	142,814	124,248.18
	INTU PROPERTIES PLC	117,549	0.00
	LAND SECURITIES GROUP PLC	254,930	1,672,340.80
	LIFE SCIENCE REIT PLC	113,860	68,088.28
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	370,614	689,712.65
	LXI REIT PLC	583,558	599,897.62
	NEWRIVER REIT PLC	107,134	83,457.38
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	190,871	124,257.02
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	455,286	437,302.20
	PRS REIT PLC/THE	171,235	147,947.04
	REGIONAL REIT LTD	151,551	45,237.97
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	72,191	582,581.37
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	158,292	69,648.48
	SEGRO PLC	415,782	3,533,315.43
	SHAFTESBURY CAPITAL PLC	663,699	866,127.19
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	425,690	340,552.00
	TARGET HEALTHCARE REIT PLC	198,609	166,632.95
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	106,966	65,035.32
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	645,764	1,027,410.52

	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	271,335	166,328.35
	UNITE GROUP PLC	134,473	1,337,333.98
	URBAN LOGISTICS REIT PLC	149,639	183,158.13
	WAREHOUSE REIT PLC	145,941	123,320.14
	WORKSPACE GROUP PLC	46,189	242,030.36
	英ボンド 小計	9,949,146	17,353,074.65 (3,261,163,318)
オーストラリアドル	ABACUS GROUP	160,679	169,516.34
	ABACUS STORAGE KING	177,394	188,037.64
	ARENA REIT	117,618	417,543.90
	BWP TRUST	162,956	554,050.40
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	174,961	558,125.59
	CENTURIA OFFICE REIT	150,261	192,334.08
	CHARTER HALL GROUP	161,068	1,857,114.04
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	219,331	791,784.91
	CHARTER HALL RETAIL REIT	169,907	611,665.20
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	117,508	329,022.40
	CROMWELL PROPERTY GROUP	434,682	169,525.98
	DEXUS INDUSTRIA REIT	71,835	195,391.20
	DEXUS/AU	365,642	2,702,094.38
	GDI PROPERTY GROUP	181,458	119,762.28
	GOODMAN GROUP	585,336	14,492,919.36
	GPT GROUP	650,856	2,896,309.20
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	88,398	205,083.36
	HEALTHCO REIT	164,038	213,249.40
	HMC CAPITAL LTD	84,103	492,843.58
	HOMEKO DAILY NEEDS REIT	613,963	761,314.12
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	67,652	194,837.76
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	127,067	551,470.78
	MIRVAC GROUP	1,340,751	2,815,577.10
	NATIONAL STORAGE REIT	427,576	957,770.24
	REGION RE LTD	383,362	839,562.78
	RURAL FUNDS GROUP	133,000	269,990.00
	SCENTRE GROUP	1,760,410	5,140,397.20
	STOCKLAND	810,123	3,532,136.28
	VICINITY CENTRES	1,314,981	2,597,087.47
	WAYPOINT REIT	220,148	519,549.28
	オーストラリアドル 小計	11,437,064	45,336,066.25 (4,405,305,557)
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	285,348	329,576.94
	GOODMAN PROPERTY TRUST	358,168	780,806.24
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	549,384	472,470.24
	PRECINCT PROPERTIES GROUP	457,549	555,922.03

	ニュージーランドドル 小計	1,650,449	2,138,775.45 (193,195,586)
香港ドル	CHAMPION REIT	589,000	1,148,550.00
	FORTUNE REIT	496,000	2,266,720.00
	LINK REIT	868,100	34,376,760.00
	PROSPERITY REIT	431,000	568,920.00
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	345,000	676,200.00
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	795,000	882,450.00
	香港ドル 小計	3,524,100	39,919,600.00 (754,879,636)
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LT	230,600	304,392.00
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	1,207,200	3,585,384.00
	CAPITALAND ASCOTT TRUST	847,296	800,694.72
	CAPITALAND CHINA TRUST	376,200	321,651.00
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	1,716,632	3,450,430.32
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	210,600	219,024.00
	EC WORLD REIT	50,000	14,000.00
	ESR-LOGOS REIT	1,970,050	630,416.00
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	366,500	230,895.00
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	365,700	833,796.00
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL	995,779	1,125,230.27
	KEPPEL DC REIT	458,900	848,965.00
	KEPPEL REIT	765,300	707,902.50
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	556,500	347,812.50
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	703,600	1,737,892.00
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,129,900	1,841,737.00
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	788,300	1,158,801.00
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	131,100	478,515.00
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT	188,100	126,967.50
	SPH REIT	401,800	345,548.00
STARHILL GLOBAL REIT	497,800	256,367.00	
SUNTEC REIT	764,000	939,720.00	
	シンガポールドル 小計	14,721,857	20,306,140.81 (2,241,391,822)
韓国ウォン	D&D PLATFORM REIT CO LTD	15,215	48,535,850.00
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	57,259	206,991,285.00
	JR REIT XXVII	58,946	238,436,570.00
	KORAMCO LIFE INFRA REIT	14,612	74,082,840.00
	LOTTE REIT CO LTD	44,180	132,760,900.00
	NH ALL-ONE REIT CO LTD	11,869	38,930,320.00
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	26,417	172,503,010.00
	SK REITS CO LTD	37,003	139,316,295.00
	韓国ウォン 小計	265,501	1,051,557,070.00

				(116,722,834)
イスラエルシェケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD		237,765	426,550.41
	REIT 1 LTD		62,291	1,027,801.50
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT		75,019	598,276.52
イスラエルシェケル 小計			375,075	2,052,628.43 (82,008,458)
合計				65,467,872,891 (65,467,872,891)

(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 137銘柄		99.0%	77.0%
カナダドル	投資証券 26銘柄		100.0%	1.6%
ユーロ	投資証券 28銘柄		100.0%	3.8%
英ポンド	投資証券 38銘柄		100.0%	4.9%
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%	6.7%
ニュージーランドドル	投資証券 4銘柄		100.0%	0.3%
香港ドル	投資証券 6銘柄		100.0%	1.1%
シンガポールドル	投資証券 22銘柄		100.0%	3.4%
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。

**【中間財務諸表】**

りそなラップ型ファンド（安定型）  
りそなラップ型ファンド（安定成長型）  
りそなラップ型ファンド（成長型）

- （１） 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）ならびに同規則第38条の3および第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- （２） 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第9期中間計算期間（2024年 1月26日から2024年 7月25日まで）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

## 【りそなラップ型ファンド（安定型）】

## （１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第8期 2024年 1月25日現在	第9期中間計算期間末 2024年 7月25日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	350,049,426	343,831,045
親投資信託受益証券	50,813,341,229	48,059,345,038
未収入金	2,979,000,000	-
未収利息	-	94
流動資産合計	54,142,390,655	48,403,176,177
資産合計	54,142,390,655	48,403,176,177
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払金	2,967,000,000	-
未払解約金	70,595,343	58,319,128
未払受託者報酬	11,390,249	10,930,161
未払委託者報酬	159,463,373	153,022,197
未払利息	949	-
その他未払費用	1,736,924	1,666,761
流動負債合計	3,210,186,838	223,938,247
負債合計	3,210,186,838	223,938,247
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	46,973,610,759	43,603,388,248
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	3,958,593,058	4,575,849,682
（分配準備積立金）	3,197,334,586	2,866,578,212
元本等合計	50,932,203,817	48,179,237,930
純資産合計	50,932,203,817	48,179,237,930
負債純資産合計	54,142,390,655	48,403,176,177

## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第8期中間計算期間 自 2023年 1月26日 至 2023年 7月25日	第9期中間計算期間 自 2024年 1月26日 至 2024年 7月25日
<b>営業収益</b>		
受取利息	-	8,267
有価証券売買等損益	1,859,775,380	1,133,003,809
営業収益合計	1,859,775,380	1,133,012,076
<b>営業費用</b>		
支払利息	119,000	25,595
受託者報酬	11,472,741	10,930,161
委託者報酬	160,618,396	153,022,197
その他費用	1,756,523	1,666,761
営業費用合計	173,966,660	165,644,714
営業利益又は営業損失（ ）	1,685,808,720	967,367,362
経常利益又は経常損失（ ）	1,685,808,720	967,367,362
中間純利益又は中間純損失（ ）	1,685,808,720	967,367,362
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	29,267,962	91,134,378
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	2,035,152,758	3,958,593,058
剰余金増加額又は欠損金減少額	77,972,983	159,155,202
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	77,972,983	159,155,202
剰余金減少額又は欠損金増加額	108,996,291	418,131,562
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	108,996,291	418,131,562
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	3,660,670,208	4,575,849,682

## (3) 【中間注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (中間貸借対照表に関する注記)

第8期 2024年 1月25日現在	第9期中間計算期間末 2024年 7月25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 50,702,808,263円	期首元本額 46,973,610,759円
期中追加設定元本額 2,801,853,137円	期中追加設定元本額 1,579,874,100円
期中一部解約元本額 6,531,050,641円	期中一部解約元本額 4,950,096,611円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 46,973,610,759口	2. 中間計算期間の末日における受益権の総数 43,603,388,248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 1.0843円	3. 中間計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1.1049円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,843円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (11,049円)

## (中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

第8期 2024年 1月25日現在	第9期中間計算期間末 2024年 7月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額 中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。	2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 同左
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 同左

## (重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

## デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

## 【りそなラップ型ファンド（安定成長型）】

## （１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第8期 2024年 1月25日現在	第9期中間計算期間末 2024年 7月25日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	801,814,358	806,379,816
親投資信託受益証券	67,440,392,376	80,813,002,310
未収入金	4,137,000,000	-
未収利息	-	220
流動資産合計	72,379,206,734	81,619,382,346
資産合計	72,379,206,734	81,619,382,346
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払金	4,227,000,000	-
未払解約金	243,465,670	89,828,899
未払受託者報酬	14,068,641	16,530,871
未払委託者報酬	337,647,319	396,740,721
未払利息	2,174	-
その他未払費用	2,145,391	2,520,870
流動負債合計	4,824,329,195	505,621,361
負債合計	4,824,329,195	505,621,361
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	49,607,241,957	56,121,338,138
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	17,947,635,582	24,992,422,847
（分配準備積立金）	8,283,326,482	7,666,340,114
元本等合計	67,554,877,539	81,113,760,985
純資産合計	67,554,877,539	81,113,760,985
負債純資産合計	72,379,206,734	81,619,382,346

## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第8期中間計算期間 自 2023年 1月26日 至 2023年 7月25日	第9期中間計算期間 自 2024年 1月26日 至 2024年 7月25日
<b>営業収益</b>		
受取利息	-	20,011
有価証券売買等損益	5,509,954,107	4,641,609,934
営業収益合計	5,509,954,107	4,641,629,945
<b>営業費用</b>		
支払利息	186,004	60,642
受託者報酬	12,706,009	16,530,871
委託者報酬	304,944,196	396,740,721
その他費用	1,948,177	2,520,870
営業費用合計	319,784,386	415,853,104
営業利益又は営業損失（ ）	5,190,169,721	4,225,776,841
経常利益又は経常損失（ ）	5,190,169,721	4,225,776,841
中間純利益又は中間純損失（ ）	5,190,169,721	4,225,776,841
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	166,092,779	241,610,180
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	9,362,337,153	17,947,635,582
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,003,910,656	4,552,515,696
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,003,910,656	4,552,515,696
剰余金減少額又は欠損金増加額	676,393,944	1,491,895,092
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	676,393,944	1,491,895,092
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	14,713,930,807	24,992,422,847

## (3) 【中間注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (中間貸借対照表に関する注記)

第8期 2024年 1月25日現在		第9期中間計算期間末 2024年 7月25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	46,614,012,158円	期首元本額	49,607,241,957円
期中追加設定元本額	10,746,713,419円	期中追加設定元本額	10,590,754,744円
期中一部解約元本額	7,753,483,620円	期中一部解約元本額	4,076,658,563円
2. 計算期間の末日における受益権の総数	49,607,241,957口	2. 中間計算期間の末日における受益権の総数	56,121,338,138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	1.3618円	3. 中間計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1.4453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)	(13,618円)	(10,000口当たり純資産額)	(14,453円)

## (中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

第8期 2024年 1月25日現在		第9期中間計算期間末 2024年 7月25日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	親投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。	2. 時価の算定方法	親投資信託受益証券 同左
	コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。		コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	同左

## (重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

## デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

## 【りそなラップ型ファンド（成長型）】

## （１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第8期 2024年 1月25日現在	第9期中間計算期間末 2024年 7月25日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	558,631,823	595,819,013
親投資信託受益証券	44,507,738,958	57,806,542,108
未収入金	2,543,000,000	-
未収利息	-	163
流動資産合計	47,609,370,781	58,402,361,284
資産合計	47,609,370,781	58,402,361,284
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払金	2,612,000,000	-
未払解約金	60,121,635	39,922,484
未払受託者報酬	8,971,386	11,492,763
未払委託者報酬	237,741,781	304,558,189
未払利息	1,515	-
その他未払費用	1,368,048	1,752,559
流動負債合計	2,920,204,365	357,725,995
負債合計	2,920,204,365	357,725,995
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	23,680,359,231	27,849,233,438
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	21,008,807,185	30,195,401,851
（分配準備積立金）	9,837,977,059	9,226,466,479
元本等合計	44,689,166,416	58,044,635,289
純資産合計	44,689,166,416	58,044,635,289
負債純資産合計	47,609,370,781	58,402,361,284

## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第8期中間計算期間 自 2023年 1月26日 至 2023年 7月25日	第9期中間計算期間 自 2024年 1月26日 至 2024年 7月25日
<b>営業収益</b>		
受取利息	-	15,194
有価証券売買等損益	5,273,000,893	5,135,803,150
営業収益合計	5,273,000,893	5,135,818,344
<b>営業費用</b>		
支払利息	126,615	40,667
受託者報酬	7,793,868	11,492,763
委託者報酬	206,537,549	304,558,189
その他費用	1,196,016	1,752,559
営業費用合計	215,654,048	317,844,178
営業利益又は営業損失（ ）	5,057,346,845	4,817,974,166
経常利益又は経常損失（ ）	5,057,346,845	4,817,974,166
中間純利益又は中間純損失（ ）	5,057,346,845	4,817,974,166
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	326,681,831	218,250,998
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	11,899,696,128	21,008,807,185
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,862,962,629	6,048,385,782
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,862,962,629	6,048,385,782
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,743,269,218	1,461,514,284
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,743,269,218	1,461,514,284
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	16,750,054,553	30,195,401,851

## （ 3 ） 【 中間注記表 】

## （ 重要な会計方針に係る事項に関する注記 ）

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

## （ 中間貸借対照表に関する注記 ）

第8期 2024年 1月25日現在	第9期中間計算期間末 2024年 7月25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 22,124,292,205円	期首元本額 23,680,359,231円
期中追加設定元本額 6,766,220,056円	期中追加設定元本額 5,799,162,483円
期中一部解約元本額 5,210,153,030円	期中一部解約元本額 1,630,288,276円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 23,680,359,231口	2. 中間計算期間の末日における受益権の総数 27,849,233,438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 1.8872円	3. 中間計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 2.0842円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (18,872円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (20,842円)

## （ 中間損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

該当事項はありません。

## （ 金融商品に関する注記 ）

## 金融商品の時価等に関する事項

第8期 2024年 1月25日現在	第9期中間計算期間末 2024年 7月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額 中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 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。	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 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。	3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 同左

## （ 重要な後発事象に関する注記 ）

該当事項はありません。

## （ その他の注記 ）

## デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

## （ 参考 ）

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

なお、以下に記載した状況は監査意見の対象外となっております。

## RM国内債券マザーファンド

## 貸借対照表

（ 単位：円 ）

2024年 7月25日現在	
資産の部	
流動資産	
金銭信託	859,706

2024年 7月25日現在

コール・ローン	1,167,958,118
国債証券	194,157,643,930
地方債証券	10,966,473,165
特殊債券	11,017,214,751
社債券	9,751,901,000
未収利息	311,773,150
前払費用	38,473,152
流動資産合計	227,412,296,972
資産合計	227,412,296,972
負債の部	
流動負債	
未払金	200,000,000
未払解約金	339,190,800
流動負債合計	539,190,800
負債合計	539,190,800
純資産の部	
元本等	
元本	233,807,595,511
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	6,934,489,339
元本等合計	226,873,106,172
純資産合計	226,873,106,172
負債純資産合計	227,412,296,972

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

2024年 7月25日現在

1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 1月26日
期首元本額	196,635,848,934円
期中追加設定元本額	84,424,835,564円
期中一部解約元本額	47,253,088,987円
期末元本額	233,807,595,511円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド（安定型）	12,597,817,109円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	13,810,121,599円
りそなラップ型ファンド（成長型）	4,113,291,973円
DCりそな グローバルバランス	1,140,327,656円
つみたてバランスファンド	11,441,546,985円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	7,722,432,789円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	2,440,659,038円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	760,915,548円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	1,433,851,246円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	432,723,900円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	100,019,168円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	122,514,758円
りそな つみたてラップ型ファンド（安定型）	862,512,016円
りそな つみたてラップ型ファンド（安定成長型）	566,549,422円
りそな つみたてラップ型ファンド（成長型）	158,168,547円
りそな つみたてリスクコントロールファンド	292,279,507円
ターゲットリターンバランスファンド（目標2%）	40,731,155円
ターゲットリターンバランスファンド（目標3%）	17,421,728円
ターゲットリターンバランスファンド（目標4%）	49,397,215円
ターゲットリターンバランスファンド（目標5%）	12,160,984円
ターゲットリターンバランスファンド（目標6%）	8,283,844円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2065	351,505円
FWりそな円建債券アクティブファンド	132,988,136円

FWりそな国内債券インデックスファンド	139,236,259,608円
Smart-i 国内債券インデックス	16,489,444,312円
Smart-i 8資産バランス 安定型	2,601,503,292円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	2,030,663,094円
Smart-i 8資産バランス 成長型	514,176,513円
りそなFT 国内債券インデックス(適格機関投資家専用)	8,065,233,859円
りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	5,765,424,513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)	34,409,729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)	43,966,558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)	85,742,115円
りそなマルチアセットファンド(適格機関投資家専用)	440,480,011円
りそなFT パッシブバランス(適格機関投資家専用)	243,226,079円
2. 計算日における受益権の総数	233,807,595,511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	6,934,489,339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	0.9703円
(10,000口当たり純資産額)	(9,703円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2024年 7月25日現在

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

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

RM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)

貸借対照表

(単位:円)

2024年 7月25日現在

資産の部	
流動資産	
預金	72,821,972
コール・ローン	380,817,113
国債証券	133,918,643,945
派生商品評価勘定	5,658,625,355
未収入金	6,294,161
未収利息	966,603,732
前払費用	238,992,039
流動資産合計	141,242,798,317
資産合計	141,242,798,317
負債の部	
流動負債	
未払金	5,655,223
未払解約金	148,705,400
流動負債合計	154,360,623

2024年 7月25日現在

負債合計	154,360,623
純資産の部	
元本等	
元本	167,634,852,975
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	26,546,415,281
元本等合計	141,088,437,694
純資産合計	141,088,437,694
負債純資産合計	141,242,798,317

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

2024年 7月25日現在

1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 1月26日
期首元本額	144,427,607,778円
期中追加設定元本額	78,906,309,087円
期中一部解約元本額	55,699,063,890円
期末元本額	167,634,852,975円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	25,023,844,576円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	22,294,485,634円
りそなラップ型ファンド(成長型)	697,393,674円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	8,901,174,384円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	2,813,015,533円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	877,046,090円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	1,652,631,977円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	498,521,021円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	115,018,578円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	141,338,785円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定型)	1,721,551,297円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定成長型)	948,177,006円
りそな つみたてラップ型ファンド(成長型)	41,099,566円
りそな つみたてリスクコントロールファンド	157,469,928円
ターゲットリターンバランスファンド(目標2%)	46,924,864円
ターゲットリターンバランスファンド(目標3%)	20,077,584円
ターゲットリターンバランスファンド(目標4%)	56,908,454円
ターゲットリターンバランスファンド(目標5%)	14,014,730円
ターゲットリターンバランスファンド(目標6%)	9,546,702円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2065	405,092円
FWりそな円建債券アクティブファンド	378,070,499円
FWりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジあり)	69,007,053,755円
Smart-i 先進国債券インデックス(為替ヘッジあり)	19,258,970,635円
Smart-i 8資産バランス 安定型	2,989,609,543円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	2,340,662,599円
Smart-i 8資産バランス 成長型	592,338,291円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	512,724,833円
りそなFTRCバランスファンド(適格機関投資家専用)	3,123,798,972円

りそなV I 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)	68,039,042円
りそなV I グローバル・バランスファンド(安定成長型)(適格機関投資家専用)	67,105,405円
りそなV I グローバル・バランスファンド(成長型)(適格機関投資家専用)	16,979,505円
りそなマルチアセットファンド(適格機関投資家専用)	507,496,806円
りそなD A A ファンド(適格機関投資家専用)	1,675,337,418円
りそなD A A ファンド2 0 2 2 0 5(適格機関投資家専用)	1,066,020,197円
2. 計算日における受益権の総数	167,634,852,975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	26,546,415,281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	0.8416円
(10,000口当たり純資産額)	(8,416円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2024年 7月25日現在

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

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

デリバティブ取引に関する注記

(通貨関連)

(2024年 7月25日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	売建	139,856,829,129	-	134,198,203,774	5,658,625,355
	米ドル	66,022,124,561	-	63,034,647,258	2,987,477,303
	カナダドル	2,826,110,839	-	2,682,025,870	144,084,969
	メキシコペソ	1,095,448,789	-	1,056,819,384	38,629,405
	ユーロ	42,677,807,669	-	41,283,710,624	1,394,097,045
	英ポンド	7,326,941,495	-	7,148,674,637	178,266,858
	スウェーデンク ローナ	226,796,595	-	213,997,963	12,798,632
	ノルウェークロー ネ	226,055,079	-	208,926,607	17,128,472
	デンマーククロー ネ	366,651,298	-	354,633,186	12,018,112
	ポーランドズロチ	771,384,547	-	749,240,382	22,144,165
	オーストラリアド ル	1,811,714,491	-	1,712,444,181	99,270,310
	ニュージーランド ドル	349,379,405	-	325,852,618	23,526,787
	シンガポールドル	548,381,882	-	529,215,386	19,166,496

マレーシアリン ギット	660,858,716	-	636,909,972	23,948,744
中国元	14,508,845,424	-	13,831,360,803	677,484,621
イスラエルシケ ル	438,328,339	-	429,744,903	8,583,436
合計	139,856,829,129	-	134,198,203,774	5,658,625,355

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## R M先進国債券マザーファンド

### 貸借対照表

(単位：円)

2024年 7月25日現在

資産の部	
流動資産	
預金	39,190,235
コール・ローン	48,594,171
国債証券	33,147,505,575
未収利息	277,451,571
前払費用	28,472,626
流動資産合計	33,541,214,178
資産合計	33,541,214,178
負債の部	
流動負債	
未払解約金	30,725,300
流動負債合計	30,725,300
負債合計	30,725,300
純資産の部	
元本等	
元本	26,062,814,151
剰余金	
剰余金又は欠損金 ( )	7,447,674,727
元本等合計	33,510,488,878
純資産合計	33,510,488,878
負債純資産合計	33,541,214,178

### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額、又は価格情報会社の提供する価額で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則としてわが国における計算日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。

3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
4. 収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 原則として、約定日基準で計上しております。
5. その他財務諸表作成のための重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産等については、投資信託財産の計算に関する規則第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分して整理する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。

## (貸借対照表に関する注記)

2024年 7月25日現在

1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 1月26日
期首元本額	49,531,769,709円
期中追加設定元本額	4,609,563,080円
期中一部解約元本額	28,078,518,638円
期末元本額	26,062,814,151円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	910,476,662円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	1,235,425,998円
りそなラップ型ファンド(成長型)	897,064,226円
DCりそな グローバルバランス	30,122,635円
つみたてバランスファンド	2,061,436,237円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	1,249,270,155円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	382,510,622円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	119,148,254円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	229,909,268円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	70,122,483円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	15,645,875円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	18,728,271円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定型)	63,016,885円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定成長型)	48,338,175円
りそな つみたてラップ型ファンド(成長型)	32,105,197円
ターゲットリターンバランスファンド(目標2%)	3,248,114円
ターゲットリターンバランスファンド(目標3%)	947,059円
ターゲットリターンバランスファンド(目標4%)	3,684,864円
ターゲットリターンバランスファンド(目標5%)	1,494,910円
ターゲットリターンバランスファンド(目標6%)	2,913,526円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2065	51,359円
FWりそな先進国債券アクティブファンド	2,338,103円
FWりそな先進国+新興国債券アクティブファンド	3,934,743円
FWりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジなし)	9,886,664,202円
Smart-i 先進国債券インデックス(為替ヘッジなし)	5,012,068,982円
Smart-i 8資産バランス 安定型	414,549,588円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	322,738,364円
Smart-i 8資産バランス 成長型	77,786,154円
りそなFT 先進国債券インデックス(適格機関投資家専用)	960,067,275円
りそなVEI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)	2,036,529円
りそなVEIグローバル・バランスファンド(安定成長型)(適格機関投資家専用)	4,258,971円
りそなVEIグローバル・バランスファンド(成長型)(適格機関投資家専用)	21,913,526円
りそなFT パッシブバランス (適格機関投資家専用)	592,058,033円
りそなマルチアセットファンド(適格機関投資家専用)	18,971,699円
りそなFT パッシブバランス (適格機関投資家専用)	253,688,165円
りそなFT パッシブバランス202307(適格機関投資家専用)	1,114,079,042円
2. 計算日における受益権の総数	26,062,814,151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	1.2858円
(10,000口当たり純資産額)	(12,858円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

2024年 7月25日現在

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

## 2. 時価の算定方法

## 国債証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

## コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

## 3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

## R M新興国債券マザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）

2024年 7月25日現在

資産の部	
流動資産	
預金	58,219,713
コール・ローン	30,356,708
投資信託受益証券	11,287,126,825
未収配当金	317,736,841
未収利息	8
流動資産合計	11,693,440,095
資産合計	11,693,440,095
負債の部	
流動負債	
未払金	45,082,620
未払解約金	2,216,900
流動負債合計	47,299,520
負債合計	47,299,520
純資産の部	
元本等	
元本	8,279,057,344
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	3,367,083,231
元本等合計	11,646,140,575
純資産合計	11,646,140,575
負債純資産合計	11,693,440,095

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

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25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 1月26日
期首元本額	9,030,880,072円
期中追加設定元本額	1,343,393,506円
期中一部解約元本額	2,095,216,234円
期末元本額	8,279,057,344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	1,890,728,685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)	8,508,012円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定成長型)	88,635,334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)	45,971,861円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定成長型)	44,228,950円
りそな つみたてラップ型ファンド(成長型)	29,377,888円
ターゲットリターンバランスファンド(目標2%)	1,603,488円
ターゲットリターンバランスファンド(目標3%)	868,644円
ターゲットリターンバランスファンド(目標4%)	3,379,669円
ターゲットリターンバランスファンド(目標5%)	1,367,778円
ターゲットリターンバランスファンド(目標6%)	2,665,968円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2065	1,050,861円
FWりそな先進国+新興国債券アクティブファンド	1,332,782円
FWりそな新興国債券インデックスファンド	1,202,039,611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VIGlobal・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VIGlobal・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VIGlobal・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	8,279,057,344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	1.4067円
(10,000口当たり純資産額)	(14,067円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

2024年 7月25日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	
投資信託受益証券	
(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。	
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	
これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	
金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	

（重要な後発事象に関する注記）  
該当事項はありません。

（その他の注記）  
デリバティブ取引に関する注記  
該当事項はありません。

## R M国内株式マザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

2024年 7月25日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	842,352,762
株式	137,289,810,650
未収配当金	173,190,801
未収利息	230
差入委託証拠金	18,382,940
流動資産合計	138,323,737,383
資産合計	138,323,737,383
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	11,487,700
前受金	1,190,000
未払金	261,761,100
未払解約金	401,730,700
流動負債合計	676,169,500
負債合計	676,169,500
純資産の部	
元本等	
元本	65,181,748,145
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	72,465,819,738
元本等合計	137,647,567,883
純資産合計	137,647,567,883
負債純資産合計	138,323,737,383

### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

2024年 7月25日現在

1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 1月26日
期首元本額	70,667,653,425円
期中追加設定元本額	28,723,111,114円
期中一部解約元本額	34,209,016,394円
期末元本額	65,181,748,145円

期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド（安定型）	754,040,467円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	2,961,642,426円
りそなラップ型ファンド（成長型）	3,097,837,920円
DCりそな グローバルバランス	25,095,611円
つみたてバランスファンド	7,521,329,971円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	425,487,198円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	380,248,622円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	277,693,757円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	142,913,852円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	101,019,779円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	60,275,762円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	153,779,369円
りそな つみたてラップ型ファンド（安定型）	52,850,524円
りそな つみたてラップ型ファンド（安定成長型）	114,286,191円
りそな つみたてラップ型ファンド（成長型）	112,774,092円
りそな つみたてリスクコントロールファンド	77,096,972円
ターゲットリターンバランスファンド（目標2%）	3,673,543円
ターゲットリターンバランスファンド（目標3%）	2,748,626円
ターゲットリターンバランスファンド（目標4%）	11,566,002円
ターゲットリターンバランスファンド（目標5%）	5,459,145円
ターゲットリターンバランスファンド（目標6%）	14,272,683円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2065	1,372,997円
りそなTOPIXインデックス	38,385,105円
FWりそな国内株式アクティブファンド	28,100,394円
FWりそな国内株式インデックスファンド	34,925,511,618円
Smart-i TOPIXインデックス	6,695,476,763円
Smart-i 8資産バランス 安定型	120,230,008円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	434,315,160円
Smart-i 8資産バランス 成長型	658,454,705円
TOPIXインデックスファンド（適格機関投資家専用）	369,023,914円
りそなFT TOPIXインデックス（適格機関投資家専用）	1,462,533,959円
りそなDAAファンド（適格機関投資家専用）	136,041,437円
りそなFT RCバランスファンド（適格機関投資家専用）	1,528,250,484円
りそなVIグローバル・バランスファンド（安定型）（適格機関投資家専用）	3,495,682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）	12,248,102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）	22,814,017円
りそなFT パッシブバランス（適格機関投資家専用）	447,434,014円
りそなマルチアセットファンド（適格機関投資家専用）	51,556,335円
りそなDAAファンド（適格機関投資家専用）	62,066,114円
りそなFT パッシブバランス（適格機関投資家専用）	76,649,362円
りそなマルチアセットファンド（適格機関投資家専用）	251,607,493円
りそなDAAファンド202205（適格機関投資家専用）	282,847,857円
りそなFT パッシブバランス202307（適格機関投資家専用）	752,047,294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）	277,362,842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）	247,829,977円
2. 計算日における受益権の総数	65,181,748,145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	2.1118円
(10,000口当たり純資産額)	(21,118円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

### （金融商品に関する注記）

#### 金融商品の時価等に関する事項

2024年 7月25日現在

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

## 3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

（株式関連）

（2024年 7月25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	389,837,700	-	378,350,000	11,487,700
	合計	389,837,700	-	378,350,000	11,487,700

## （注）時価の算定方法

先物取引

国内先物取引について

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## R M先進国株式マザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）

2024年 7月25日現在

資産の部	
流動資産	
預金	5,382,325,042
コール・ローン	953,465,261
株式	318,494,531,962
投資証券	6,213,093,100
派生商品評価勘定	677,864
未収配当金	207,023,713
未収利息	261
差入委託証拠金	2,429,766,207
流動資産合計	333,680,883,410
資産合計	333,680,883,410
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	277,031,877
未払金	19,085,392
未払解約金	711,357,400
流動負債合計	1,007,474,669
負債合計	1,007,474,669
純資産の部	
元本等	
元本	103,360,765,370
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	229,312,643,371
元本等合計	332,673,408,741
純資産合計	332,673,408,741
負債純資産合計	333,680,883,410

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

2024年 7月25日現在

1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 1月26日
期首元本額	86,355,123,758円
期中追加設定元本額	35,416,899,898円
期中一部解約元本額	18,411,258,286円
期末元本額	103,360,765,370円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	2,281,514,548円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	9,454,823,376円
りそなラップ型ファンド(成長型)	9,400,908,631円
DCりそな グローバルバランス	75,644,841円
つみたてバランスファンド	3,297,985,372円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	1,805,506,288円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	1,505,653,124円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	1,080,394,876円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	559,248,653円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	400,868,217円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	237,540,427円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	609,637,327円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定型)	159,943,539円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定成長型)	325,695,812円
りそな つみたてラップ型ファンド(成長型)	331,268,280円
りそな つみたてリスクコントロールファンド	39,241,779円
ターゲットリターンバランスファンド(目標2%)	4,324,880円
ターゲットリターンバランスファンド(目標3%)	3,986,337円
ターゲットリターンバランスファンド(目標4%)	22,883,602円
ターゲットリターンバランスファンド(目標5%)	11,922,656円
ターゲットリターンバランスファンド(目標6%)	26,414,223円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2065	5,431,270円
りそな先進国株式インデックス	236,542,958円
FWりそな先進国株式アクティブファンド	66,477,874円
FWりそな先進国+新興国株式アクティブファンド	47,444,227円

FWりそな先進国株式インデックスファンド	34,865,427,471円
Smart-i 先進国株式インデックス	25,522,328,647円
Smart-i 8資産バランス 安定型	480,547,813円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	1,713,540,457円
Smart-i 8資産バランス 成長型	2,587,109,116円
Smart-i Select 全世界株式インデックス	1,349,469,544円
Smart-i Select 全世界株式インデックス（除く日本）	434,773,135円
Smart-i DC 全世界株式インデックス	274,481,040円
Smart-i DC 全世界株式インデックス（除く日本）	2,874,904円
りそなFT 先進国株式インデックス（適格機関投資家専用）	617,879,878円
りそなDAAファンド（適格機関投資家専用）	84,598,675円
りそなFT RCバランスファンド（適格機関投資家専用）	951,200,478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）	6,606,236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）	31,477,169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）	264,113,745円
りそなFT パッシブバランス（適格機関投資家専用）	638,442,501円
りそなマルチアセットファンド（適格機関投資家専用）	69,831,412円
りそなDAAファンド（適格機関投資家専用）	303,152,034円
りそなFT パッシブバランス（適格機関投資家専用）	26,409,096円
りそなDAAファンド202205（適格機関投資家専用）	175,891,527円
りそなFT パッシブバランス202307（適格機関投資家専用）	969,307,375円
2. 計算日における受益権の総数	103,360,765,370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	3.2186円
(10,000口当たり純資産額)	(32,186円)

（注） は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

2024年 7月25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、新株予約権証券、投資証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 デリバティブ取引 （その他の注記）のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

（株式関連）

（2024年 7月25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	8,371,546,131	-	8,099,054,217	272,491,914
	合計	8,371,546,131	-	8,099,054,217	272,491,914

（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25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	388,008,137	-	384,146,038	3,862,099
	米ドル	133,316,451	-	133,322,628	6,177
	カナダドル	31,637,088	-	31,070,200	566,888
	ユーロ	168,669,880	-	166,167,010	2,502,870
	スイスフラン	24,456,838	-	24,260,250	196,588
	スウェーデンクローナ	7,222,400	-	7,112,500	109,900
	デンマーククローネ	5,207,890	-	5,120,375	87,515
	オーストラリアドル	17,497,590	-	17,093,075	404,515
	合計	388,008,137	-	384,146,038	3,862,099

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## R M新興国株式マザーファンド

### 貸借対照表

(単位：円)

2024年 7月25日現在

資産の部	
流動資産	
預金	754,445,257
コール・ローン	48,627,144
株式	36,311,191,105
投資証券	34,089,634
派生商品評価勘定	8,306
未収入金	448,392
未収配当金	184,523,514
未収利息	13
差入委託証拠金	576,878,616
流動資産合計	37,910,211,981
資産合計	
37,910,211,981	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	41,689,839
未払金	20,066,470
未払解約金	1,351,800
流動負債合計	63,108,109

2024年 7月25日現在

負債合計	63,108,109
純資産の部	
元本等	
元本	18,379,354,486
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	19,467,749,386
元本等合計	37,847,103,872
純資産合計	37,847,103,872
負債純資産合計	37,910,211,981

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

2024年 7月25日現在

1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 1月26日
期首元本額	17,965,166,119円
期中追加設定元本額	2,584,400,144円
期中一部解約元本額	2,170,211,777円
期末元本額	18,379,354,486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)	2,862,182,740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	1,283,376,282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	159,004,303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)	5,729,863円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定成長型)	170,512,123円
ラップ型ファンド・プラスESG(成長型)	346,061,040円

りそな つみたてラップ型ファンド（安定型）	31,324,916円
りそな つみたてラップ型ファンド（安定成長型）	85,504,693円
りそな つみたてラップ型ファンド（成長型）	102,792,054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%）	1,088,534円
ターゲットリターンバランスファンド（目標3%）	1,110,396円
ターゲットリターンバランスファンド（目標4%）	6,898,581円
ターゲットリターンバランスファンド（目標5%）	3,786,792円
ターゲットリターンバランスファンド（目標6%）	8,898,458円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2065	1,436,905円
りそな新興国株式インデックス	10,058,246円
FWりそな先進国+新興国株式アクティブファンド	62,768,201円
FWりそな新興国株式インデックスファンド	4,103,929,089円
Smart-i 新興国株式インデックス	3,440,281,378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	252,795,857円
Smart-i Select 全世界株式インデックス（除く日本）	81,300,011円
Smart-i DC 全世界株式インデックス	51,399,432円
Smart-i DC 全世界株式インデックス（除く日本）	537,550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	18,379,354,486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	2.0592円
(10,000口当たり純資産額)	(20,592円)

（注） は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

2024年 7月25日現在

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

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

（株式関連）

（2024年 7月25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	1,581,276,141	-	1,540,312,567	40,963,574
	合計	1,581,276,141	-	1,540,312,567	40,963,574

（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25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	85,200,503	-	84,476,173	724,330
	米ドル	85,200,503	-	84,476,173	724,330
	売建	471,623	-	465,252	6,371
	オフショア人民元	471,623	-	465,252	6,371
合計		85,672,126	-	84,941,425	717,959

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## R M国内リートマザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

2024年 7月25日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	529,647,972
投資証券	63,756,249,300
未収配当金	428,206,522
未収利息	145
差入委託証拠金	42,127,029
流動資産合計	64,756,230,968
資産合計	64,756,230,968
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,852,580
前受金	1,228,700
未払金	109,953,901
未払解約金	73,915,400
流動負債合計	187,950,581
負債合計	187,950,581
純資産の部	
元本等	
元本	46,818,855,060
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	17,749,425,327
元本等合計	64,568,280,387

2024年 7月25日現在

純資産合計	64,568,280,387
負債純資産合計	64,756,230,968

## 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25日現在

1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 1月26日
期首元本額	35,360,404,912円
期中追加設定元本額	20,256,909,638円
期中一部解約元本額	8,798,459,490円
期末元本額	46,818,855,060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	3,946,906,580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)	4,464,515,695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)	202,404,905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)	71,854,983円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定成長型)	77,428,036円
りそな つみたてラップ型ファンド(成長型)	87,811,818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%)	1,662,741円
ターゲットリターンバランスファンド(目標3%)	1,265,576円
ターゲットリターンバランスファンド(目標4%)	6,056,120円
ターゲットリターンバランスファンド(目標5%)	2,875,662円
ターゲットリターンバランスファンド(目標6%)	7,530,508円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2065	1,088,952円
りそなJリートインデックス(年1回決算型)	92,586,995円
りそなJリートインデックス(年4回決算型)	115,218,318円
FWりそな国内リートインデックスオープン	9,415,963,950円
FWりそな国内リートインデックスファンド	9,619,339,643円
Smart-i Jリートインデックス	3,656,014,980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)	5,298,897,370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V I 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V I グローバル・バランスファンド（安定成長型）（適格機関投資家専用）	10,275,928円
りそなV I グローバル・バランスファンド（成長型）（適格機関投資家専用）	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D A A 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 - R E I T 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D A A ファンド202205（適格機関投資家専用）	371,840,801円
りそなF T グローバルリートファンド202307（適格機関投資家専用）	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	46,818,855,060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	1.3791円
(10,000口当たり純資産額)	(13,791円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2024年 7月25日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	
投資証券	(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。
デリバティブ取引	(その他の注記)のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

デリバティブ取引に関する注記

(投資証券関連)

(2024年 7月25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	-	758,464,000	2,852,580
	合計	761,316,580	-	758,464,000	2,852,580

(注) 時価の算定方法

先物取引

国内先物取引について

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

R M先進国リートマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2024年 7月25日現在

資産の部	
流動資産	
預金	312,262,759
コール・ローン	82,520,413
株式	653,778,810
投資証券	75,839,549,473
派生商品評価勘定	847
未収配当金	137,564,926
未収利息	22
流動資産合計	77,025,677,250
資産合計	77,025,677,250
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,136,033
未払解約金	9,025,600
流動負債合計	10,161,633
負債合計	10,161,633
純資産の部	
元本等	
元本	42,792,057,333
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	34,223,458,284
元本等合計	77,015,515,617
純資産合計	77,015,515,617
負債純資産合計	77,025,677,250

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

2024年 7月25日現在

1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 1月26日
期首元本額	41,161,930,061円
期中追加設定元本額	11,025,219,986円
期中一部解約元本額	9,395,092,714円
期末元本額	42,792,057,333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	122,070,288円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	71,816,625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	90,829,667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）	197,460,750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）	63,576,172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%）	1,891,086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%）	4,285,655円
ターゲットリターンバランスファンド（目標6%）	11,210,143円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2065	1,620,643円
FWりそな先進国リートインデックスオープン	14,211,056,059円
FWりそな先進国リートインデックスファンド	13,706,459,663円
Smart-i 先進国リートインデックス	3,315,413,669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VEグローバル・バランスファンド（安定型）（適格機関投資家専用）	2,196,248円
りそなVEグローバル・バランスファンド（安定成長型）（適格機関投資家専用）	4,653,837円
りそなVEグローバル・バランスファンド（成長型）（適格機関投資家専用）	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 グローバルリートファンド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	42,792,057,333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	1.7998円
(10,000口当たり純資産額)	(17,998円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

### (金融商品に関する注記)

#### 金融商品の時価等に関する事項

2024年 7月25日現在

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

### (重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

（その他の注記）  
デリバティブ取引に関する注記  
（通貨関連）

（2024年 7月25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	88,782,286	-	87,647,100	1,135,186
	米ドル	80,241,541	-	79,239,297	1,002,244
	ユーロ	5,068,551	-	4,985,064	83,487
	シンガポールドル	3,472,194	-	3,422,739	49,455
	合計	88,782,286	-	87,647,100	1,135,186

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2024年 7月31日現在です。

## 【りそなラップ型ファンド（安定型）】

## 【純資産額計算書】

資産総額	51,121,344,122円
負債総額	2,758,724,614円
純資産総額（ - ）	48,362,619,508円
発行済口数	43,569,830,172口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1100円

## 【りそなラップ型ファンド（安定成長型）】

## 【純資産額計算書】

資産総額	86,587,490,422円
負債総額	4,820,045,734円
純資産総額（ - ）	81,767,444,688円
発行済口数	56,387,272,682口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4501円

## 【りそなラップ型ファンド（成長型）】

## 【純資産額計算書】

資産総額	61,832,220,092円
負債総額	3,318,814,939円
純資産総額（ - ）	58,513,405,153円
発行済口数	28,001,967,188口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0896円

（参考）

## R M国内債券マザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	226,803,071,228円
負債総額	824,488,000円
純資産総額（ - ）	225,978,583,228円
発行済口数	232,892,621,080口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9703円

## R M先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

## 純資産額計算書

資産総額	141,987,127,147円
------	------------------

負債総額	740,020,823円
純資産総額（ - ）	141,247,106,324円
発行済口数	166,798,470,951口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8468円

## R M先進国債券マザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	33,571,302,158円
負債総額	13,663,200円
純資産総額（ - ）	33,557,638,958円
発行済口数	26,089,280,074口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2863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国内株式マザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	163,462,964,616円
負債総額	10,326,088,179円
純資産総額（ - ）	153,136,876,437円
発行済口数	70,325,706,247口
1口当たり純資産額（ / ）	2.1775円

## R M先進国株式マザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	333,460,428,048円
負債総額	9,099,582,572円
純資産総額（ - ）	324,360,845,476円
発行済口数	101,196,167,089口
1口当たり純資産額（ / ）	3.2053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わないものとします。
- (5) 受益権の再分割  
委託会社は、受託会社と協議のうえ、社債、株式等の振替に関する法律に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。
- (6) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて  
振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、解約請求の受付、解約金および償還金の支払いなどについては、約款の規定によるほか、民法その他の法令などにしたがって取り扱われます。

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

###### (1) 資本金の額

2024年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) 通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関

係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下（４）、（５）において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または金融デリバティブ取引を行なうこと。

- (4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。
- (5) 上記（３）、（４）に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であつて、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	
PayPay証券株式会社	100百万円	
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	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社関西みらい銀行	38,971百万円	
株式会社京葉銀行	49,759百万円	
株式会社埼玉りそな銀行	70,000百万円	
株式会社三十三銀行	37,461百万円	
株式会社七十七銀行	24,658百万円	
株式会社十六銀行	36,839百万円	
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	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。
株式会社りそな銀行	279,928百万円	

## 2【関係業務の概要】

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

## 3【資本関係】

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

## 第3【その他】

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

## 独立監査人の監査報告書

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4月10日

りそなアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 松崎 雅則  
業務執行社員

### 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているりそなラップ型ファンド（安定型）の2023年1月26日から2024年1月25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、りそなラップ型ファンド（安定型）の2024年1月25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4月10日

りそなアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 松崎 雅則  
業務執行社員

### 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているりそなラップ型ファンド（安定成長型）の2023年1月26日から2024年1月25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、りそなラップ型ファンド（安定成長型）の2024年1月25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4月10日

りそなアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 松崎 雅則  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているりそなラップ型ファンド（成長型）の2023年1月26日から2024年1月25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、りそなラップ型ファンド（成長型）の2024年1月25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。

# 独立監査人の中間監査報告書

2024年10月9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

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているりそなラップ型ファンド（安定型）の2024年1月26日から2024年7月25日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、りそなラップ型ファンド（安定型）の2024年7月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2024年1月26日から2024年7月25日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の中間監査報告書

2024年10月9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

### 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているりそなラップ型ファンド（安定成長型）の2024年1月26日から2024年7月25日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、りそなラップ型ファンド（安定成長型）の2024年7月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2024年1月26日から2024年7月25日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

### 中間監査意見の根拠

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

### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

### 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の中間監査報告書

2024年10月9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

### 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているりそなラップ型ファンド（成長型）の2024年1月26日から2024年7月25日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、りそなラップ型ファンド（成長型）の2024年7月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2024年1月26日から2024年7月25日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

### 中間監査意見の根拠

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

### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

### 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。