

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2024年11月15日提出
【計算期間】	第1期(自 2023年9月25日至 2024年8月15日)
【ファンド名】	S m a r t - i D C 全世界株式インデックス
【発行者名】	りそなアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役 西山 明宏
【本店の所在の場所】	東京都江東区木場一丁目5番65号
【事務連絡者氏名】	塚田 光子
【連絡場所】	東京都江東区木場一丁目5番65号
【電話番号】	03-6704-3821
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

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

ファンドの基本的性格

1) 商品分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

2) 属性区分

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式 一般	年1回	グローバル (含む日本)			
大型株	年2回	日本			
中小型株	年4回	北米	ファミリーファンド	あり	日経225
債券 一般	年6回 (隔月)	欧州			
公債	年12回 (毎月)	アジア			TOPIX
社債	日々	オセアニア			
その他債券 クレジット属性 ()	その他 ()	中南米	ファンド・オブ・ファンズ	なし	その他
不動産投信		アフリカ			(MSCI オール・ カンントリー・ワ ールド・インデ ックス(配当込 み、円換算ベ ース))
その他資産 (投資信託証券(株 式 一般))		中近東 (中東)			
資産複合 ()		エマージング			
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(株式 一般)))と収益の源泉となる資産を示す商品分類上の投資対象資産(株式)とが異なります。

<商品分類の定義>

1. 単位型投信・追加型投信の区分

- (1) 単位型投信：当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行なわれないファンドをいう。
- (2) 追加型投信：一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行なわれ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。

2. 投資対象地域による区分

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

3. 投資対象資産による区分

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

4. 独立した区分

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

<補足として使用する商品分類>

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

<属性区分の定義>

1. 投資対象資産による属性区分

(1) 株式

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

(2) 債券

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

(3) 不動産投信

これ以上の詳細な分類は行なわないものとする。

(4) その他資産

組入れている資産を記載するものとする。

(5) 資産複合

以下の小分類に該当する場合には当該小分類を併記することができる。

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

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

2. 決算頻度による属性区分

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

3. 投資対象地域による属性区分(重複使用可能)

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

- アジア：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- オセアニア：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- 中南米：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- アフリカ：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- 中近東(中東)：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- エマージング：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域(新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
4. 投資形態による属性区分
- ファミリーファンド：目論見書又は投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいう。
- ファンド・オブ・ファンズ：「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいう。
5. 為替ヘッジによる属性区分
- 為替ヘッジあり：目論見書又は投資信託約款において、為替のフルヘッジ又は一部の資産に為替のヘッジを行なう旨の記載があるものをいう。
- 為替ヘッジなし：目論見書又は投資信託約款において、為替のヘッジを行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

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

* MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス(配当込み、円換算ベース)は、MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス(配当込み、米ドルベース)をもとに、委託会社が円換算して計算したものです。MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス(配当込み、米ドルベース)は、MSCI Inc.が開発した、日本を含む世界の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス(配当込み、米ドルベース)は、日本を含む先進国および新興国の大型株、中型株から構成されています。

2

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

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

*1 上場予定、店頭登録予定を含みます。

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

投資対象資産	マザーファンド	対象指数
国内株式	RM MSCI ジャパン・インデックスマザーファンド	MSCI ジャパン・インデックス(配当込み)
先進国株式(除く日本)	RM先進国株式マザーファンド	MSCI-KOKUSAI指数(配当込み、円換算ベース)
新興国株式	RM新興国株式マザーファンド	MSCIエマージング・マーケット指数(配当込み、円換算ベース)

3

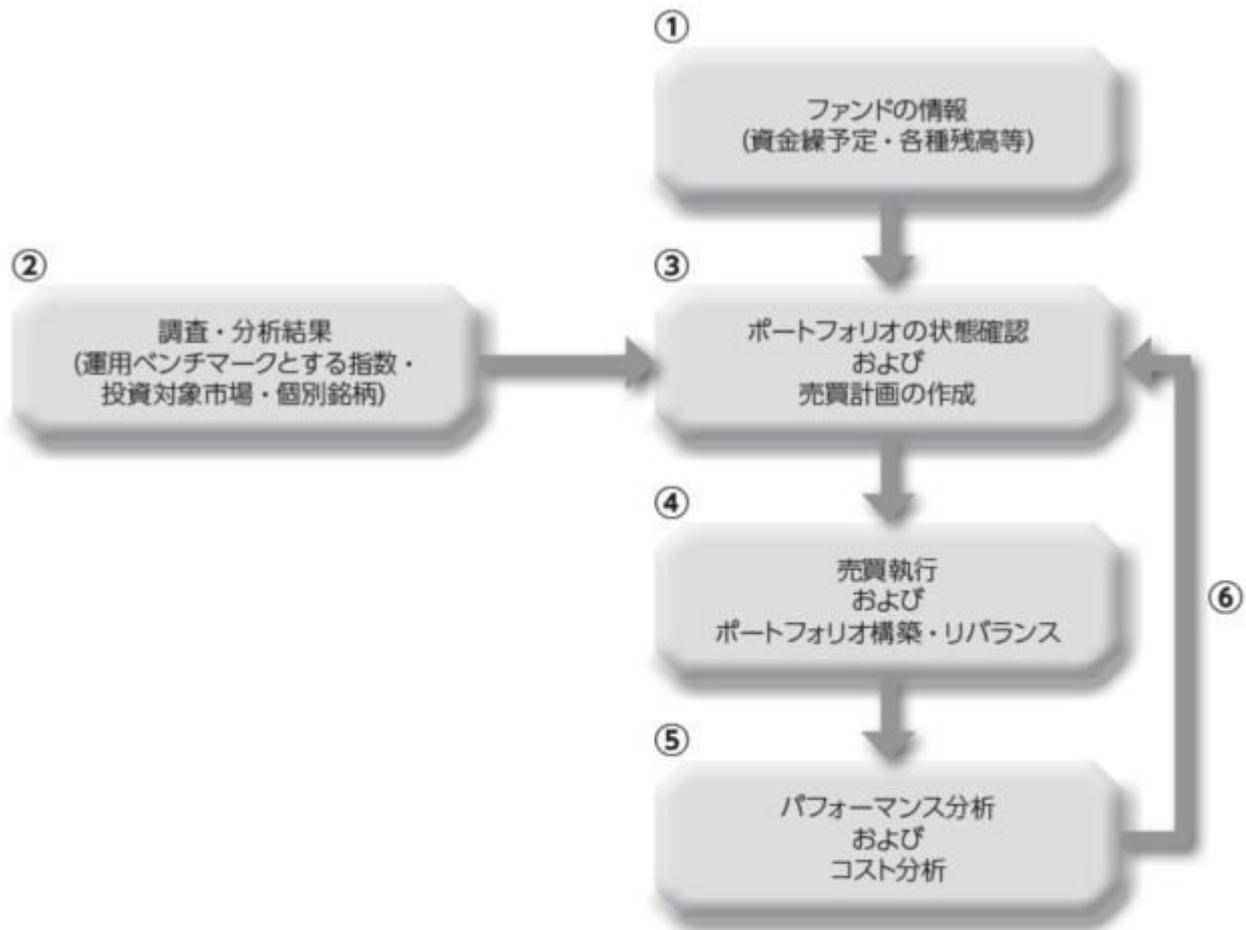
実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

4

購入時手数料のないノーロード型のファンドです。

- 換金時手数料、信託財産留保額もかかりません。

■ 運用プロセスのイメージ



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

※上記の運用プロセスおよびイメージ図は、今後変更になる場合があります。

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

■ ファンドの仕組み

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



■ 主な投資制限

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

■ 分配方針

原則、毎年8月15日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、以下の収益分配方針に基づいて分配を行います。

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

★将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

■ 当ファンドが対象とする指数の著作権等について

MSCI オール・カントリー・ワールド・インデックス(配当込み、円換算ベース)は、MSCI オール・カントリー・ワールド・インデックス(配当込み、米ドルベース)をもとに、委託会社が円換算して計算したものです。MSCI オール・カントリー・ワールド・インデックス(配当込み、米ドルベース)は、MSCI Inc.が開発した、日本を含む世界の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものであり、指数に関する著作権、知的財産権その他の権利はMSCI Inc.に帰属します。

信託金限度額

- ・ 5,000億円を限度として信託金を追加することができます。
- ・ 委託会社は受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

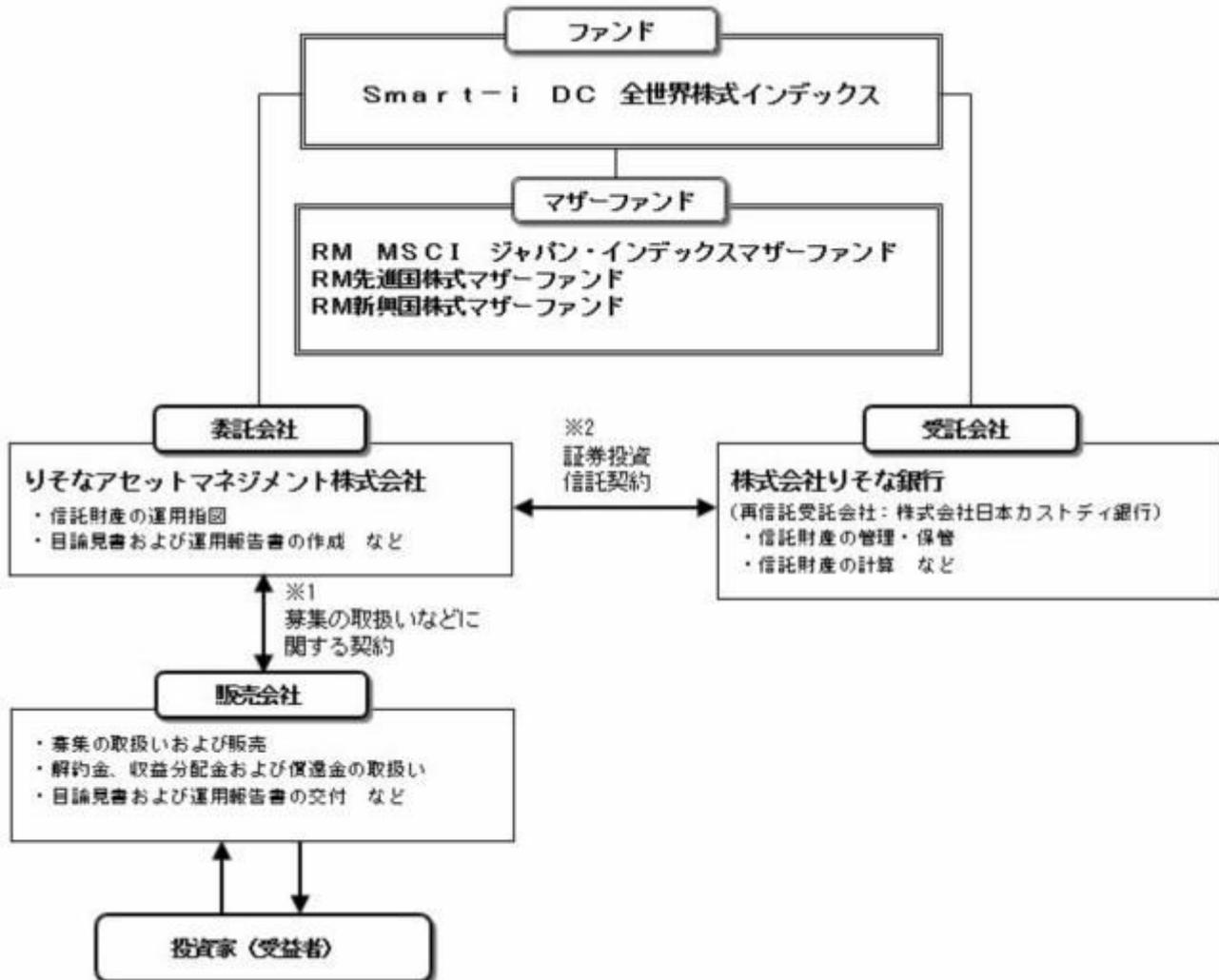
(2) 【ファンドの沿革】

2023年9月25日

- ・ ファンドの信託契約締結、当初自己設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み



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

委託会社の概況（2024年8月末現在）

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

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

2 【投資方針】

(1) 【投資方針】

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

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

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

* 上場予定、店頭登録予定を含みます。

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

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

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

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

（２）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。）
 - イ) 有価証券
 - ロ) デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第21条、第22条、第23条および第24条に定めるものに限ります。）
 - 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、有価証券にかかるものに限ります。）
- 17) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
- 18) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 19) 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）
- 20) 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
- 21) 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって19) の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

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

金融商品の指図範囲

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

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

6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの

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

その他の投資対象と指図範囲

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

《参考情報》

投資対象とするマザーファンドの概要

< R M M S C I ジャパン・インデックスマザーファンド >

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

< R M先進国株式マザーファンド >

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、M S C I - K O K U S A I 指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

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

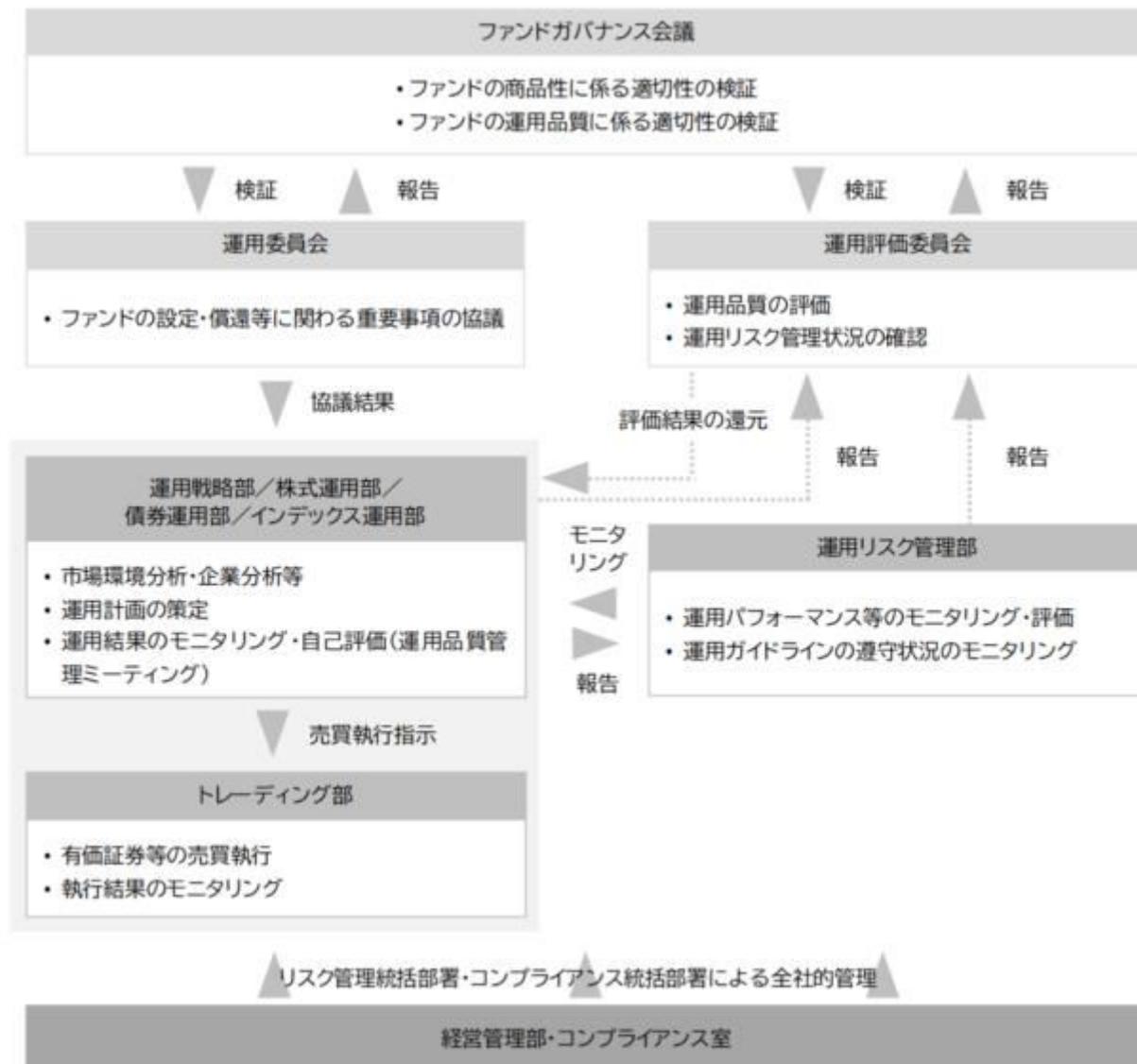
< R M新興国株式マザーファンド >

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、M S C I エマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	次の有価証券を主要投資対象とします。 ・金融商品取引所に上場されているまたは店頭登録されている（上場予定および店頭登録予定を含みます。）新興国株式（*） （*）D R（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。 ・新興国株式の指数を対象指数としたE T F（上場投資信託証券）

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

（3）【運用体制】

ファンドの運用体制は以下のとおりです。



ファンドガバナンス会議は3名程度、運用委員会は5名程度、運用評価委員会は6名程度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8月末現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

(4) 【分配方針】

収益分配方針

原則として毎決算時に以下の収益分配方針に基づいて分配を行います。

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

収益分配金の支払い

< 分配金再投資コース（自動けいぞく投資コース） >

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

< 分配金受取りコース（一般コース） >

毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して5営業日まで）から収益分配金を支払います。支払いは販売会社において行なわれます。

(5) 【投資制限】

約款に定める投資制限

- 1) 株式への実質投資割合には、制限を設けません。
- 2) 新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。
- 3) 投資信託証券(マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 4) 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- 5) デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。
- 6) 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 7) 一般社団法人投資信託協会規則に規定する一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券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権(ホ)に定めるものを除きます。)の行使により取得可能な株券
- 10) 先物取引等の運用指図
 1. 委託者は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとします(以下同じ。))。
 2. 委託者は、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。
 3. 委託者は、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。
- 11) スワップ取引の運用指図
 1. 委託者は、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。
 2. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として、信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
 3. スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。
 4. 委託者は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- 12) 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図
 1. 委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
 2. 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として、信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
 3. 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。
 4. 委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と

認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

- 13) 直物為替先渡取引の運用指図
 1. 委託者は、直物為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
 2. 直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として、信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
 3. 直物為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。
 4. 委託者は、直物為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- 14) 有価証券の貸付けの指図および範囲
 1. 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式、公社債および投資信託証券を次の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。
 イ) 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 ロ) 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
 ハ) 投資信託証券の貸付けは、貸付時点において、貸付投資信託証券の時価合計額が、信託財産で保有する投資信託証券の時価合計額を超えないものとします。
 2. 前記1.に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかにその超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
 3. 委託者は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。
- 15) 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限
 外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。
- 16) 外国為替予約取引の指図および範囲
 委託者は、信託財産に属する外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。
- 17) 資金の借入れ
 1. 委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
 2. 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から、信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間、または解約代金の入金日までの間、もしくは償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。
 3. 収益分配金の再投資にかかる借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
 4. 借入金の利息は信託財産中から支弁します。
- 法令による投資制限
 同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律）
 同一法人の発行する株式について、委託会社が運用の指図を行なう投資信託全体で、当該株式の議決権の過半数を保有することとなる取引は行ないません。

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

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

市場リスク

・株価変動リスク

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

・為替変動リスク

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

信用リスク

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

流動性リスク

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

カントリーリスク

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

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

（その他の留意点）

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

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

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

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

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

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

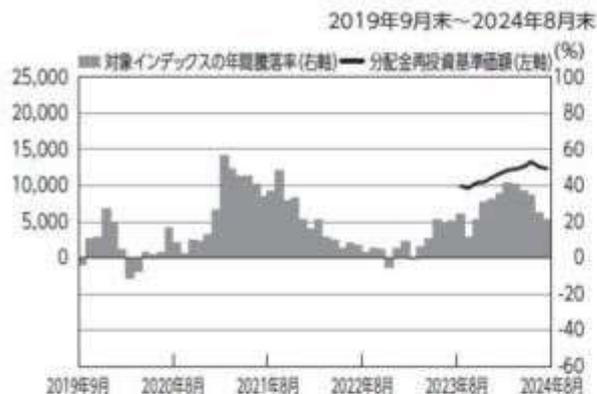
運用評価委員会は、運用実績、流動性リスクを含む運用リスクの状況、主な投資制限等の遵守状況および運用事務状況等を確認することを通じ、信託財産の適切な運用に寄与することを目的に運用部門に対する管理・指導、改善提案等を行います。なお、流動性リスクについては、緊急時対応策の有効性検証結果や流動性リスク管理プロセスの見直し結果についても確認を行います。

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8月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

【参考情報】

ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

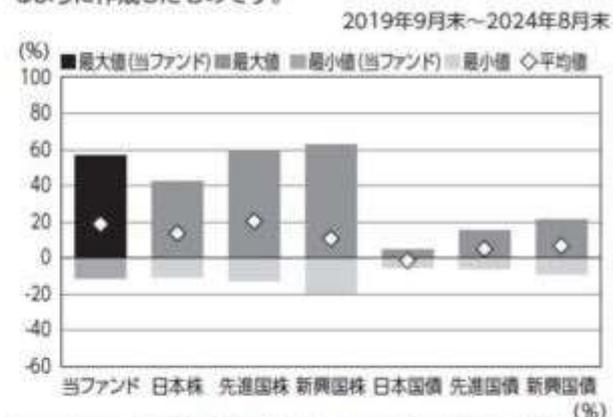


- * 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- * 年間騰落率は、2019年9月から2024年8月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。なお、運用期間が1年未満であるため、対象インデックスの騰落率を表示しております。

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

ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	56.8	42.1	59.8	62.7	4.4	15.3	21.5
最小値	△11.4	△10.4	△12.4	△19.4	△5.5	△6.1	△8.8
平均値	18.8	13.7	20.4	10.7	△1.4	5.1	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9月から2024年8月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。なお、当ファンドの騰落率につきましては、運用期間が1年未満であるため当ファンドの対象インデックスを用いて算出しております。
- * 決算日に対応した数値とは異なります。

各資産クラスの指数

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

○代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

騰落率は、データソースが提供する各指数をもとに株式会社野村総合研究所が計算しており、その内容について、信憑性、正確性、完全性、最新性、網羅性、適時性を含む一切の保証を行いません。また、当該騰落率に関連して資産運用または投資判断をした結果生じた損害等、当該騰落率の利用に起因する損害及び一切の責任について、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により運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した指数です。なお、FTSE世界国債インデックスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利は、FTSE Fixed Income LLCに帰属します。

JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(円ベース)

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金(解約)手数料】

換金手数料
ありません。

信託財産留保額
ありません。

（３）【信託報酬等】

信託報酬

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年0.1375%（税抜0.125%）の率を乗じて得た額とします。

信託報酬の配分

信託報酬の配分（年率）は、以下の通りとします。

信託報酬 = 日々の純資産総額 × 信託報酬率		
委託会社	販売会社	受託会社
0.055%	0.050%	0.020%

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

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

支払時期

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

（４）【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

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

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

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

・公募株式投資信託は税法上、一定の要件を満たした場合に少額投資非課税制度（NISA）の適用対象となります。

・当ファンドは、NISAの「成長投資枠（特定非課税管理勘定）」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。

確定拠出年金の場合

確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会等の場合、所得税および地方税はかかりません。

なお、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されません。

確定拠出年金でない場合

個人受益者の場合

1) 収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については配当所得として、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収（原則として、確定申告は不要です。）が行なわれます。

なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用はありません。）のいずれかを選択することもできます。

2) 解約金および償還金に対する課税

解約時および償還時の差益（譲渡益）*については譲渡所得として、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による申告分離課税の対象となり、確定申告が必要となります。なお、源泉徴

収ありの特定口座（源泉徴収選択口座）を選択している場合は、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収（原則として、確定申告は不要です。）が行なわれます。

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

確定申告等により、解約時および償還時の差損（譲渡損失）については、上場株式等の譲渡益、上場株式等の配当等および特定公社債等の利子所得（申告分離課税を選択したものに限りま。）と損益通算が可能です。また、解約時および償還時の差益（譲渡益）、普通分配金および特定公社債等の利子所得（申告分離課税を選択したものに限りま。）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。確定拠出年金制度を通じて公募株式投資信託などを購入する場合は、NISAをご利用になれません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人受益者の場合

1) 収益分配金、解約金、償還金に対する課税

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

2) 益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

個別元本

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

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

普通分配金と元本払戻金（特別分配金）

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

2) 受益者が収益分配金を受け取る際

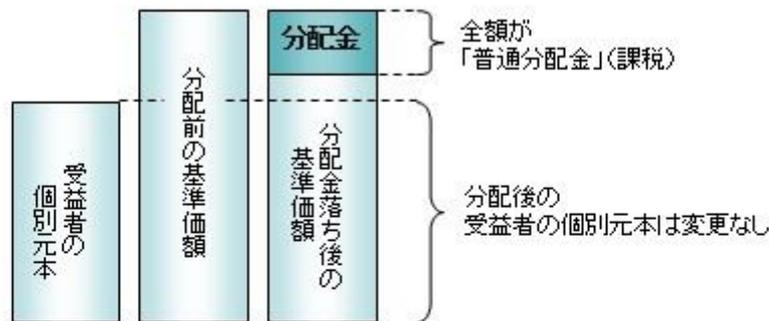
イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

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

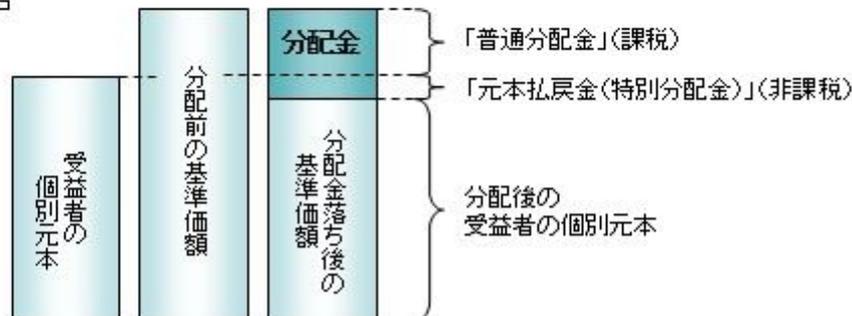
ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

<分配金に関するイメージ図>

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



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

上記は2024年8月末現在のものですので、税法または確定拠出年金法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

【参考情報】ファンドの総経費率

総経費率(①+②)	①	②
	運用管理費用の比率	その他費用の比率
0.20%	0.13%	0.07%

※対象期間は2023年9月25日～2024年8月15日です。

※対象期間中の運用・管理にかかった費用の額(原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。)を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口あたり)を乗じた数で除した値(年率)です。

※その他費用とは監査費用や有価証券の保管費用等です。

※詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

5【運用状況】

【Smart-i DC 全世界株式インデックス】

以下の運用状況は2024年 8月30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	1,180,621,497	99.82
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		2,117,827	0.18
合計(純資産総額)		1,182,739,324	100.00

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	RM先進国株式マザーファンド	317,906,853	3.1126	989,524,924	3.1503	1,001,501,959	84.68
日本	親投資信託受益証券	RM新興国株式マザーファンド	59,538,531	1.9760	117,651,758	1.9747	117,570,737	9.94
日本	親投資信託受益証券	RM M S C I ジャパン・インデックスマザーファンド	41,035,270	1.4404	59,108,195	1.4999	61,548,801	5.20

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.82
合計	99.82

【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 (2024年 8月15日)	1,071	1,071	1.2197	1.2197
2023年 9月末日	0.99		0.9980	
10月末日	0.96		0.9655	
11月末日	1		1.0373	
12月末日	1		1.0528	
2024年 1月末日	1		1.1114	
2月末日	242		1.1666	
3月末日	381		1.2136	
4月末日	436		1.2323	
5月末日	689		1.2586	
6月末日	993		1.3313	
7月末日	1,086		1.2599	
8月末日	1,182		1.2363	

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2023年 9月25日～2024年 8月15日	0.0000

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1期	2023年 9月25日～2024年 8月15日	21.97

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

(4) 【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	2023年 9月25日～2024年 8月15日	975,118,138	96,237,020

(注)第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

(参考)

RM MSCI ジャパン・インデックスマザーファンド

以下の運用状況は2024年 8月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	1,263,817,600	97.50
投資証券	日本	5,016,000	0.39
コール・ローン等・その他資産（負債控除後）		27,455,858	2.12
合計（純資産総額）		1,296,289,458	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	27,155,000	2.09

(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	22,600	3,377.42	76,329,915	2,759.50	62,364,700	4.81
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	2,700	13,661.25	36,885,400	14,200.00	38,340,000	2.96
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	24,400	1,443.39	35,218,900	1,528.00	37,283,200	2.88
日本	株式	日立製作所	電気機器	10,200	2,554.93	26,060,312	3,572.00	36,434,400	2.81
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	3,300	6,421.77	21,191,860	9,047.00	29,855,100	2.30
日本	株式	キーエンス	電気機器	400	67,170.00	26,868,000	69,610.00	27,844,000	2.15
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	2,800	8,211.86	22,993,225	9,550.00	26,740,000	2.06
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	1,000	35,042.00	35,042,000	25,805.00	25,805,000	1.99
日本	株式	信越化学工業	化学	4,000	6,168.39	24,673,564	6,422.00	25,688,000	1.98
日本	株式	第一三共	医薬品	4,100	4,958.94	20,331,665	6,108.00	25,042,800	1.93
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	4,100	4,593.14	18,831,874	5,506.00	22,574,600	1.74
日本	株式	三菱商事	卸売業	7,400	3,014.49	22,307,236	3,013.00	22,296,200	1.72
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	2,600	6,740.66	17,525,736	7,706.00	20,035,600	1.55
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	2,300	8,629.93	19,848,860	8,405.00	19,331,500	1.49
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	400	41,352.50	16,541,000	46,650.00	18,660,000	1.44
日本	株式	任天堂	その他製品	2,300	8,800.30	20,240,706	7,902.00	18,174,600	1.40
日本	株式	三井物産	卸売業	5,700	3,127.11	17,824,578	3,123.00	17,801,100	1.37
日本	株式	KDDI	情報・通信業	3,400	4,517.05	15,357,990	4,911.00	16,697,400	1.29
日本	株式	HOYA	精密機器	800	18,689.11	14,951,295	20,595.00	16,476,000	1.27
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	5,300	2,752.48	14,588,150	3,009.00	15,947,700	1.23
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	9,900	1,717.89	17,007,197	1,588.00	15,721,200	1.21
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	3,500	4,297.28	15,040,508	4,333.00	15,165,500	1.17
日本	株式	三菱重工業	機械	7,100	1,199.61	8,517,255	1,942.50	13,791,750	1.06
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	6,300	1,945.80	12,258,596	2,038.00	12,839,400	0.99
日本	株式	アドバンテスト	電気機器	1,700	6,783.65	11,532,210	6,641.00	11,289,700	0.87
日本	株式	村田製作所	電気機器	3,700	3,016.87	11,162,450	3,033.00	11,222,100	0.87
日本	株式	ダイキン工業	機械	600	21,864.82	13,118,895	18,510.00	11,106,000	0.86
日本	株式	中外製薬	医薬品	1,500	5,722.90	8,584,364	7,384.00	11,076,000	0.85
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	2,600	3,942.58	10,250,716	4,203.00	10,927,800	0.84
日本	株式	キヤノン	電気機器	2,100	4,182.42	8,783,100	5,017.00	10,535,700	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	国内	鉱業	0.35
		建設業	1.38
		食料品	2.74

繊維製品	0.18
化学	5.08
医薬品	5.97
石油・石炭製品	0.56
ゴム製品	0.57
ガラス・土石製品	0.26
鉄鋼	0.69
非鉄金属	0.45
金属製品	0.10
機械	4.53
電気機器	20.40
輸送用機器	9.02
精密機器	2.61
その他製品	2.38
電気・ガス業	1.12
陸運業	1.61
海運業	0.88
空運業	0.15
情報・通信業	6.76
卸売業	6.24
小売業	3.77
銀行業	7.62
証券、商品先物取引業	0.84
保険業	3.96
その他金融業	1.13
不動産業	1.72
サービス業	4.42
投資証券	0.39
合 計	97.88

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	大阪取引所	ミニTOPIX先物	買建	10	日本円	26,320,600	27,155,000	2.09

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

RM先進国株式マザーファンド

以下の運用状況は2024年 8月30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	229,162,510,469	70.14
	カナダ	10,623,352,927	3.25
	パナマ	78,610,822	0.02
	ドイツ	7,558,777,740	2.31
	イタリア	1,833,746,278	0.56
	フランス	9,019,719,772	2.76
	オランダ	5,993,502,257	1.83
	スペイン	2,243,129,599	0.69
	ベルギー	665,205,888	0.20
	オーストリア	166,319,135	0.05
	ルクセンブルク	138,000,041	0.04
	フィンランド	890,018,238	0.27
	アイルランド	5,830,182,487	1.78
	ポルトガル	143,838,586	0.04
	イギリス	12,289,690,761	3.76
	スイス	9,889,602,103	3.03
	スウェーデン	2,849,786,289	0.87
	ノルウェー	502,155,593	0.15
	デンマーク	3,230,017,149	0.99
	ケイマン	429,548,164	0.13
	リベリア	203,196,572	0.06
	オーストラリア	5,924,809,223	1.81
	バミューダ	409,692,730	0.13
	ニュージーランド	227,475,033	0.07
	香港	1,147,261,318	0.35
	シンガポール	914,678,403	0.28
	イスラエル	672,609,464	0.21
	キュラソー	317,438,637	0.10
	ジャージー	734,733,669	0.22
	マン島	27,332,070	0.01
	小計	314,116,941,417	96.14
新株予約権証券	カナダ	0	0.00
投資証券	アメリカ	5,559,724,969	1.70
	カナダ	10,117,327	0.00
	フランス	118,546,849	0.04
	ベルギー	24,281,628	0.01
	イギリス	100,178,510	0.03
	オーストラリア	404,390,416	0.12
	香港	66,014,121	0.02
	シンガポール	77,329,895	0.02
	小計	6,360,583,715	1.95

コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		6,245,789,528	1.91
合計(純資産総額)		326,723,314,660	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	5,239,515,600	1.60
	買建	ドイツ	1,138,418,060	0.35

(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		726,935,908	0.22
	売建		435,104,920	0.13

(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	501,494	27,863.60	13,973,430,799	33,273.59	16,686,506,746	5.11
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	243,075	58,989.47	14,338,865,781	59,819.77	14,540,692,051	4.45
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	846,835	10,413.39	8,818,423,176	17,027.03	14,419,086,644	4.41
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	322,479	23,693.05	7,640,513,563	24,922.97	8,037,136,378	2.46
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	75,461	60,673.78	4,578,504,512	75,038.25	5,662,461,836	1.73
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	202,281	21,921.17	4,434,237,220	23,425.74	4,738,582,922	1.45
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	174,100	22,124.28	3,851,838,723	23,660.32	4,119,261,712	1.26
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	27,822	98,861.04	2,750,512,129	136,140.95	3,787,713,789	1.16
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	152,287	18,840.55	2,869,172,005	22,723.46	3,460,488,162	1.06
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	98,929	25,780.16	2,550,405,528	32,176.00	3,183,140,295	0.97
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	45,615	56,329.13	2,569,453,495	67,819.97	3,093,608,205	0.95
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	98,874	29,207.54	2,887,866,474	29,869.34	2,953,301,519	0.90
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	31,719	73,961.60	2,345,988,178	85,659.33	2,717,028,479	0.83
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	154,569	15,014.06	2,320,708,764	17,105.22	2,643,937,368	0.81
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	110,888	16,543.02	1,834,423,066	19,836.52	2,199,632,252	0.67

アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	54,232	39,480.86	2,141,126,321	39,721.53	2,154,178,340	0.66
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	81,346	22,478.46	1,828,532,835	24,620.34	2,002,766,503	0.61
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	金融サービス	28,604	64,516.66	1,845,434,545	69,619.83	1,991,405,903	0.61
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	82,930	22,787.72	1,889,786,326	23,780.50	1,972,117,197	0.60
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	15,271	103,445.98	1,579,723,595	128,384.02	1,960,552,431	0.60
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	13,769	128,929.76	1,775,233,991	132,042.11	1,818,087,950	0.56
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	一般消費財・サービス流通・小売り	34,178	50,849.77	1,737,943,659	53,150.28	1,816,570,543	0.56
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	60,858	24,140.33	1,469,132,337	28,262.06	1,719,972,691	0.53
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需品流通・小売り	152,402	8,178.28	1,246,386,826	11,065.61	1,686,422,010	0.52
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	14,855	82,354.61	1,223,377,756	100,271.10	1,489,527,250	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	87,309	17,468.38	1,525,147,549	17,008.20	1,484,969,632	0.45
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	141,178	8,672.71	1,224,396,514	10,432.84	1,472,887,486	0.45
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	242,730	4,979.61	1,208,701,356	5,816.61	1,411,867,202	0.43
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	90,436	16,204.81	1,465,498,808	15,563.52	1,407,502,856	0.43
イギリス	株式	ASTRAZENECA PLC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	53,466	20,499.84	1,096,044,659	25,313.51	1,353,412,553	0.41

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率 (%)
株式	国外	エネルギー	4.27
		素材	3.58
		資本財	6.91
		商業・専門サービス	1.59
		運輸	1.57
		自動車・自動車部品	1.53
		耐久消費財・アパレル	1.30
		消費者サービス	1.82
		メディア・娯楽	6.12
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.55
		生活必需品流通・小売り	1.77
		食品・飲料・タバコ	3.16

	家庭用品・パーソナル用品	1.59
	ヘルスケア機器・サービス	4.16
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.14
	銀行	5.55
	金融サービス	6.68
	保険	3.08
	ソフトウェア・サービス	9.45
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.57
	電気通信サービス	1.14
	公益事業	2.65
	半導体・半導体製造装置	8.71
	不動産管理・開発	0.28
新株予約権証券		
投資証券		1.95
合 計		98.09

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	129	米ドル	35,909,577.89	5,199,706,879	36,184,500	5,239,515,600	1.60
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	STX E6002409	買建	270	ユーロ	6,926,416.53	1,111,274,268	7,095,600	1,138,418,060	0.35

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

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	買建	3,680,000.00	531,729,612	532,529,590	0.16
	カナダドル	買建	440,000.00	47,177,500	47,207,302	0.01
	ユーロ	買建	120,000.00	19,242,300	19,242,924	0.01
	スイスフラン	買建	310,000.00	53,137,404	52,952,860	0.02
	スウェーデンクローナ	買建	2,800,000.00	39,743,200	39,661,440	0.01
	デンマーククローネ	買建	820,000.00	17,667,728	17,631,646	0.01
	オーストラリアドル	買建	180,000.00	17,664,120	17,710,146	0.01
	ユーロ	売建	2,000,000.00	321,536,000	320,748,400	0.10
	英ポンド	売建	600,000.00	114,415,200	114,356,520	0.04

(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 8月30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	100,056,039	0.27
	メキシコ	666,934,683	1.81
	ブラジル	1,590,394,246	4.33
	チリ	152,654,017	0.42
	コロンビア	35,227,634	0.10
	ペルー	9,201,912	0.03
	オランダ	20,804,630	0.06
	ルクセンブルク	40,923,739	0.11
	ギリシャ	171,054,002	0.47
	イギリス	58,418,262	0.16
	トルコ	248,688,981	0.68
	チェコ	47,241,990	0.13
	キプロス	0	0.00
	ハンガリー	87,603,375	0.24
	ポーランド	307,356,604	0.84
	ロシア	0	0.00
	ケイマン	5,024,791,334	13.67
	バミューダ	128,810,111	0.35
	香港	262,272,839	0.71
	シンガポール	8,728,828	0.02
	マレーシア	547,596,634	1.49
	タイ	509,922,674	1.39
	フィリピン	205,409,918	0.56
	インドネシア	616,131,481	1.68
	韓国	4,091,213,192	11.13
	台湾	6,465,907,841	17.59
	中国	3,368,182,230	9.16
	インド	7,272,456,442	19.78
	カザフスタン	0	0.00
	カタール	283,973,260	0.77
	エジプト	23,966,369	0.07
	南アフリカ	1,030,115,244	2.80
	英ヴァージン諸島	0	0.00
アラブ首長国連邦	428,125,283	1.16	
クウェート	260,952,549	0.71	
サウジアラビア	1,427,963,346	3.88	
	小計	35,493,079,689	96.54
投資証券	メキシコ	34,684,319	0.09
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		1,236,666,451	3.36
合計（純資産総額）		36,764,430,459	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	1,224,672,064	3.33

(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		1,436,770	0.00
	売建		1,440,738	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	780,500	2,932.28	2,288,646,397	4,274.71	3,336,413,731	9.08
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	207,400	5,299.69	1,099,156,183	7,012.03	1,454,295,437	3.96
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	151,332	8,089.61	1,224,217,437	8,036.40	1,216,164,485	3.31
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	一般消費財・サービス流通・小売り	481,740	1,350.22	650,457,247	1,467.95	707,174,328	1.92
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	96,515	4,722.92	455,833,459	5,292.81	510,836,426	1.39
インド	株式	HDFC BANK LIMITED	銀行	135,205	2,647.24	357,920,595	2,851.07	385,479,866	1.05
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	105,386	2,916.95	307,406,281	3,364.02	354,521,560	0.96
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	165,299	1,758.53	290,684,577	2,126.10	351,443,196	0.96
ケイマン	株式	MEITUAN	消費者サービス	157,810	1,340.01	211,467,168	2,148.54	339,062,518	0.92
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	395,800	477.37	188,945,887	836.35	331,030,081	0.90
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	17,328	15,833.03	274,354,817	18,429.42	319,344,990	0.87
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	3,050,000	85.87	261,927,782	104.54	318,874,755	0.87
ケイマン	株式	PDD HOLDINGS INC	一般消費財・サービス流通・小売り	22,002	19,678.66	432,970,055	13,527.21	297,625,806	0.81
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	47,900	4,341.95	207,979,712	5,666.37	271,419,363	0.74
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	28,549	6,695.34	191,145,533	7,850.53	224,124,838	0.61
インド	株式	BHARTI AIRTEL LTD	電気通信サービス	81,361	2,159.12	175,668,719	2,724.66	221,681,550	0.60
サウジアラビア	株式	AL RAJHI BANK	銀行	62,300	3,388.66	211,113,533	3,405.06	212,135,549	0.58
ケイマン	株式	NU HOLDINGS LTD/CAYMAN ISL-A	銀行	94,270	2,071.05	195,238,272	2,060.50	194,243,712	0.53
中国	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	2,204,000	71.18	156,892,520	85.79	189,088,654	0.51

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	487,600	257.29	125,455,495	350.60	170,953,340	0.46
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	6,622.44	171,733,200	6,526.86	169,254,534	0.46
インドネシア	株式	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	銀行	1,749,800	89.81	157,151,070	96.11	168,182,027	0.46
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	2,522,000	55.10	138,972,576	65.73	165,790,732	0.45
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	26,118.02	146,835,515	29,287.51	164,654,404	0.45
ブラジル	株式	VALE SA	素材	107,404	1,787.98	192,037,111	1,524.74	163,763,746	0.45
ケイマン	株式	JD.COM INC - CL A	一般消費財・サービス流通・小売り	78,360	1,704.43	133,559,761	1,921.99	150,607,528	0.41
サウジアラビア	株式	SAUDI ARABIAN OIL CO	エネルギー	138,400	1,167.55	161,590,042	1,080.26	149,509,022	0.41
インド	株式	AXIS BANK LTD	銀行	72,011	1,858.05	133,800,647	2,045.19	147,276,609	0.40
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	銀行	152,800	835.27	127,629,666	950.33	145,210,470	0.39
ケイマン	株式	NETEASE INC	メディア・娯楽	61,300	2,890.70	177,200,459	2,356.53	144,455,473	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	5.05
		素材	6.34
		資本財	4.74
		商業・専門サービス	0.04
		運輸	1.82
		自動車・自動車部品	3.61
		耐久消費財・アパレル	1.09
		消費者サービス	2.28
		メディア・娯楽	5.74
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.53
		生活必需品流通・小売り	1.27
		食品・飲料・タバコ	2.98
		家庭用品・パーソナル用品	0.74
		ヘルスケア機器・サービス	0.90
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.56
		銀行	17.12
		金融サービス	2.81
		保険	2.77
		ソフトウェア・サービス	2.64
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8.40
電気通信サービス	2.82		
公益事業	2.88		
半導体・半導体製造装置	12.08		

		不動産管理・開発	1.33
投資証券			0.09
合 計			96.64

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	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	154	米ドル	8,275,468.34	1,198,287,816	8,457,680	1,224,672,064	3.33

(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	9,928.29	1,438,129	1,436,770	0.00
	サウジアラビアリアル	売建	37,276.56	1,438,129	1,440,738	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

2024年8月30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)

2024年8月15日	0円
—	—
—	—
—	—
—	—
設定来累計	0円

主要な資産の状況

■ポートフォリオの状況

資産	組入比率
国内株式	5.2%
先物指式	84.7%
新興国株式	9.9%
現金等	0.2%
合計	100.0%

※各資産を主な投資対象とするマザーファンドの組入比率です。

■国・地域別配分

国・地域	組入比率
アメリカ	64.6%
日本	5.1%
カナダ	2.6%
イギリス	2.5%
中国	2.5%
その他	22.7%
合計	100.0%

※国・地域は発行国もしくは投資国を表示しています。

※先物の組入比率は「その他」に含みます。

■組入上位銘柄

	銘柄名	国・地域	業種	組入比率
1	APPLE INC	アメリカ	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.3%
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	ソフトウェア・サービス	3.8%
3	NVIDIA CORP	アメリカ	半導体・半導体製造装置	3.7%
4	AMAZON.COM INC	アメリカ	一般消費財・サービス流通・小売り	2.1%
5	META PLATFORMS INC-CLASS A	アメリカ	メディア・娯楽	1.5%
6	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	メディア・娯楽	1.2%
7	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	メディア・娯楽	1.1%
8	ELI LILLY & CO	アメリカ	医薬品・バイオテクノロジー・サイエンス	1.0%
9	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	半導体・半導体製造装置	0.9%
10	BROADCOM INC	アメリカ	半導体・半導体製造装置	0.9%

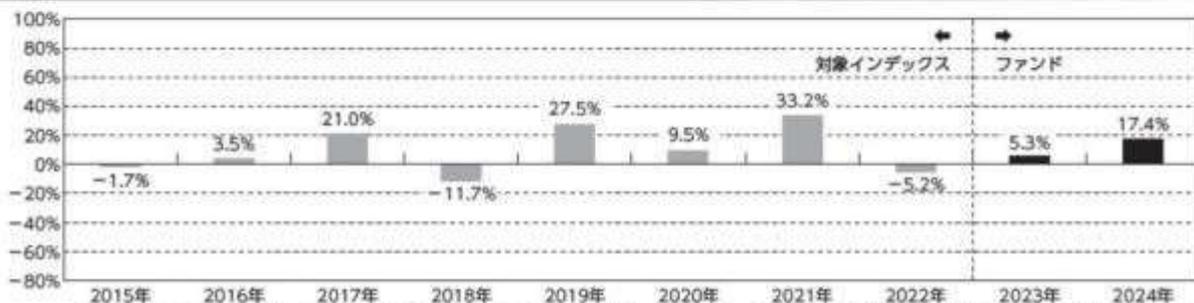
※国・地域は発行国もしくは投資国を表示しています。

※海外株式の業種は世界産業分類基準(GICS)の分類を基準としています。

※国内株式の業種は東証33業種の分類を基準としています。

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

年間収益率の推移(暦年ベース)



・2015年から2022年までは、対象インデックス(MSCI オール・カントリー・ワールド・インデックス(配当込み、円換算ベース))の年間騰落率です。
・対象インデックスはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。
・2023年は9月25日から12月末までの騰落率です。2024年は8月末までの騰落率です。
・年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

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

第2【管理及び運営】

1【申込(販売)手続等】

(1) 申込方法

販売会社所定の方法でお申し込みください。

- (2) コースの選択
 収益分配金の受取方法によって、＜分配金再投資コース（自動けいぞく投資コース）＞と＜分配金受取りコース（一般コース）＞の2通りがあります。ただし、販売会社によって取扱コースは異なります。
 ＜分配金再投資コース（自動けいぞく投資コース）＞
 収益分配金を自動的に再投資するコースです。
 ＜分配金受取りコース（一般コース）＞
 収益分配金を再投資せず、その都度受け取るコースです。
- (3) 申込みの受付
 販売会社の営業日に受け付けます。
- (4) 取扱時間
 原則として、午後3時30分までに、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。
 販売会社によっては異なる場合がありますので、詳しくは販売会社にお問い合わせください。
- (5) 取得申込不可日
 販売会社の営業日であっても、取得申込日が下記のいずれかに該当する場合は、取得の申込みの受付は行ないません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
 ・ニューヨークの銀行の休業日
 ・ニューヨーク証券取引所の休業日
 ・ロンドンの銀行の休業日
 ・ロンドン証券取引所の休業日
 ・香港の銀行の休業日
 ・香港証券取引所の休業日
- (6) 申込金額
 取得申込受付日の翌営業日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額です。
- (7) 申込単位
 販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。
- (8) 申込代金の支払い
 取得申込者は、申込金額を販売会社が指定する日までに販売会社へお支払いください。
- (9) 受付の中止および取消

委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得の申込みの受付を中止すること、および既に受け付けた取得の申込みの受付を取り消すことができます。

金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場をいいます。

2【換金（解約）手続等】

- (1) 解約の受付
 販売会社の営業日に受け付けます。
- (2) 取扱時間
 原則として、午後3時30分までに、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。
 販売会社によっては異なる場合がありますので、詳しくは販売会社にお問い合わせください。
- (3) 解約請求不可日
 販売会社の営業日であっても、解約請求日が下記のいずれかに該当する場合は、解約請求の受付は行ないません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
 ・ニューヨークの銀行の休業日
 ・ニューヨーク証券取引所の休業日
 ・ロンドンの銀行の休業日
 ・ロンドン証券取引所の休業日
 ・香港の銀行の休業日
 ・香港証券取引所の休業日
- (4) 解約制限
 ファンドの規模および商品性格などに基つき、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。
 確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会等の場合、所得税および地方税はかかりません。
 税法または確定拠出年金法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

- (7) 解約単位
販売会社が定める単位とします。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
- (8) 解約代金の支払い
原則として、解約請求受付日から起算して6営業日目からお支払いします。
- (9) 受付の中止および取消
・委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止すること、および既に受け付けた解約請求の受付を取り消すことができます。
・解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日（この計算日が解約請求を受け付けない日であるときは、この計算日以降の最初の解約請求を受け付けることができる日とします。）に解約請求を受け付けたものとして取り扱います。

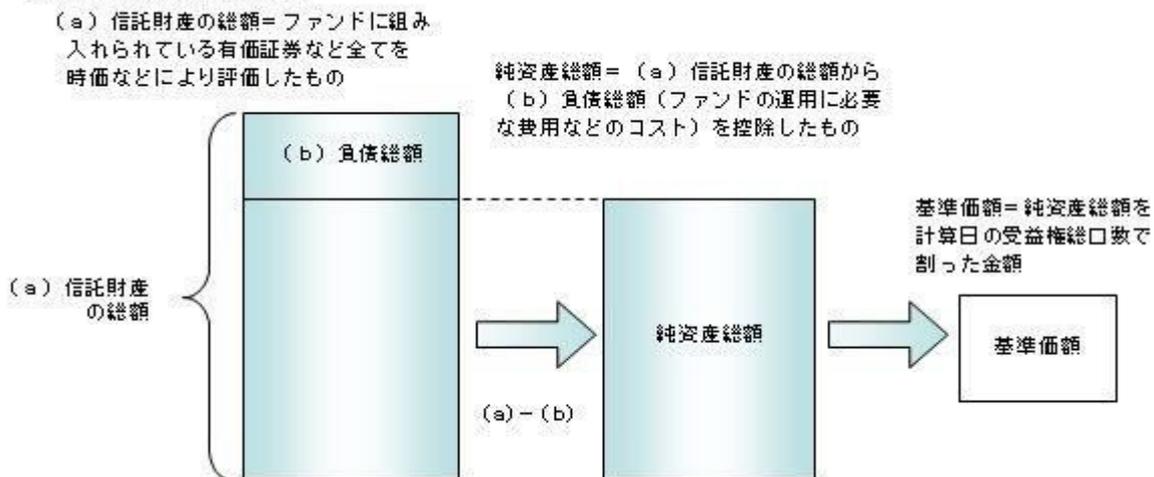
3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額の算出

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

<基準価額算出の流れ>



有価証券などの評価基準

- ・信託財産に属する資産については、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価します。
 - <主な資産の評価方法>
マザーファンド受益証券
基準価額計算日の基準価額で評価します。
国内上場株式
原則として、基準価額計算日におけるわが国の金融商品取引所の最終相場で評価します。
外国株式
原則として、基準価額計算日に知りうる直近の日における外国金融商品市場の最終相場で評価します。
 - ・外貨建資産（外国通貨表示の有価証券、預金その他の資産をいいます。）の円換算については、原則としてわが国における計算日の対顧客相場の仲値によって計算します。
- 基準価額の照会方法
販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

委託会社の照会先

りそなアセットマネジメント株式会社

電話番号：0120-223351

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時）

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

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

無期限とします(2023年9月25日設定)。ただし、約款の規定に基づき、信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4)【計算期間】

毎年8月16日から翌年8月15日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

(5)【その他】

信託の終了(繰上償還)

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

償還金について

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

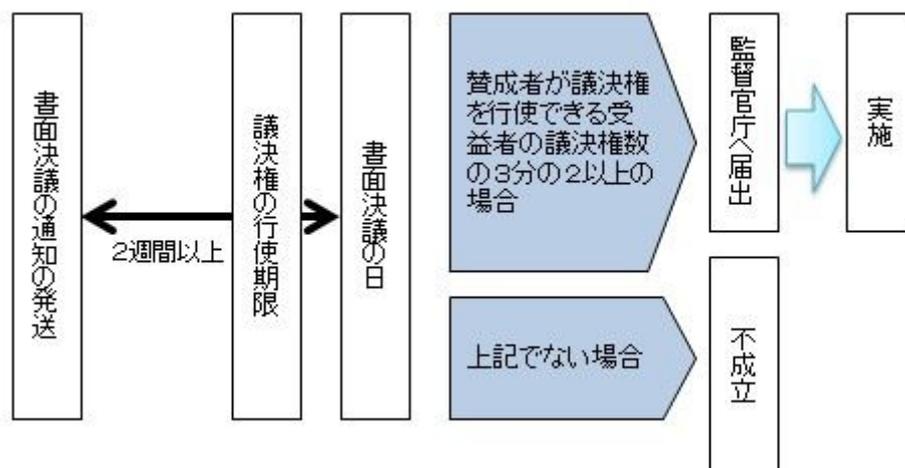
信託約款の変更など

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

書面決議

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

＜書面決議の主な流れ＞



公告

公告は電子公告により行ない、委託会社のホームページに掲載します。

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

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

運用報告書の作成

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

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

関係法人との契約について

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

他の受益者の氏名などの開示の請求の制限

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

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金・償還金受領権

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

(2) 解約請求権

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

(3) 帳簿閲覧権

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

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1期計算期間(2023年 9月25日から2024年 8月15日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

1【財務諸表】

【Smart-i DC 全世界株式インデックス】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 2024年 8月15日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,180,433
親投資信託受益証券	1,070,097,877
未収利息	9
流動資産合計	1,073,278,319
資産合計	1,073,278,319
負債の部	
流動負債	
未払解約金	892,140
未払受託者報酬	62,282
未払委託者報酬	326,968
その他未払費用	18,927
流動負債合計	1,300,317
負債合計	1,300,317
純資産の部	
元本等	
元本	878,881,118
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	193,096,884
（分配準備積立金）	6,079,522
元本等合計	1,071,978,002
純資産合計	1,071,978,002
負債純資産合計	1,073,278,319

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期
	自 2023年 9月25日
	至 2024年 8月15日
営業収益	
受取利息	469
有価証券売買等損益	14,724,823
営業収益合計	14,724,354
営業費用	
支払利息	148
受託者報酬	68,864
委託者報酬	361,279
その他費用	21,018
営業費用合計	451,309
営業利益又は営業損失（ ）	15,175,663
経常利益又は経常損失（ ）	15,175,663
当期純利益又は当期純損失（ ）	15,175,663
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（ ）	3,991,458
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	232,100,825
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	232,100,825
剰余金減少額又は欠損金増加額	19,836,820
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	19,836,820
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	193,096,884

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、設定日（2023年9月25日）から2024年8月15日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第1期 2024年8月15日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	974,118,138円
期中一部解約元本額	96,237,020円
2. 計算期間の末日における受益権の総数	878,881,118口
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.2197円
(10,000口当たり純資産額)	(12,197円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 2023年9月25日 至 2024年8月15日	
分配金の計算過程	
A 費用控除後の配当等収益額	6,079,522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	187,017,362円
D 分配準備積立金額	0円
E 当ファンドの分配対象収益額(E=A+B+C+D)	193,096,884円
F 当ファンドの期末残存口数	878,881,118口
G 10,000口当たり収益分配対象額(G=E/F×10,000)	2,197円
H 10,000口当たり分配金額	0円
I 収益分配金金額(I=F×H/10,000)	0円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

第1期 自 2023年9月25日 至 2024年8月15日	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、株価変動リスク、リートの価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。
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

第1期 2024年8月15日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	親投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(関連当事者との取引に関する注記)

第1期
自 2023年 9月25日
至 2024年 8月15日

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）
該当事項はありません。

（その他の注記）
1 有価証券に関する注記
売買目的有価証券

種類	第1期 自 2023年 9月25日 至 2024年 8月15日	
	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	
親投資信託受益証券	13,485,299	
合計	13,485,299	

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 M S C I ジャパン・インデックスマ ザーファンド	37,793,664	54,309,495	
	R M先進国株式マザーファンド	292,155,173	908,105,924	
	R M新興国株式マザーファンド	54,542,095	107,682,458	
合計		384,490,932	1,070,097,877	

(注) 券面総額欄の数値は口数を表しております。

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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

（参考）

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

R M M S C I ジャパン・インデックスマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2024年 8月15日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	36,986,319
株式	1,173,183,720

2024年 8月15日現在

投資証券	5,986,400
派生商品評価勘定	1,376,430
未収配当金	1,452,330
未収利息	111
差入委託証拠金	4,816,103
流動資産合計	1,223,801,413
資産合計	1,223,801,413
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	414,800
前受金	662,250
流動負債合計	1,077,050
負債合計	1,077,050
純資産の部	
元本等	
元本	850,881,454
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	371,842,909
元本等合計	1,222,724,363
純資産合計	1,222,724,363
負債純資産合計	1,223,801,413

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2024年 8月15日現在

1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 9月25日
期首元本額	738,813,462円
期中追加設定元本額	222,037,666円
期中一部解約元本額	109,969,674円
期末元本額	850,881,454円
期末元本の内訳	
Smart-i Select 全世界株式インデックス	181,532,688円
Smart-i DC 全世界株式インデックス	37,793,664円
MSCI ジャパン・インデックスファンド(適格機関投資家専用)	631,555,102円
2. 計算日における受益権の総数	850,881,454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	1.4370円
(10,000口当たり純資産額)	(14,370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 8月15日現在

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

金融商品の時価等に関する事項

2024年 8月15日現在

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ
2. 時価の算定方法
株式、投資証券
（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。
デリバティブ取引
（その他の注記）の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務
これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明
金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、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 8月15日現在

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2024年 8月15日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式		10,466,333
投資証券		116,597
合計		10,349,736

(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 8月15日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	うち1年超		時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引					
	買建	43,229,870	-	44,191,500	961,630	
合計		43,229,870	-	44,191,500	961,630	

(注) 時価の算定方法

先物取引

国内先物取引について

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

(単位：円)

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
INPEX	2,000	2,149.00	4,298,000	
大成建設	400	6,158.00	2,463,200	
大林組	1,400	1,864.00	2,609,600	
鹿島建設	900	2,559.00	2,303,100	
大和ハウス工業	1,200	4,378.00	5,253,600	
積水ハウス	1,300	3,512.00	4,565,600	
ヤクルト本社	500	2,928.00	1,464,000	
明治ホールディングス	500	3,443.00	1,721,500	
アサヒグループホールディングス	1,000	5,203.00	5,203,000	
麒麟ホールディングス	1,600	2,046.50	3,274,400	
サントリー食品インターナショナル	300	4,978.00	1,493,400	
キッコーマン	1,400	1,712.00	2,396,800	
味の素	1,000	5,397.00	5,397,000	
日清食品ホールディングス	400	3,777.00	1,510,800	
日本たばこ産業	2,500	4,141.00	10,352,500	
東レ	2,900	725.10	2,102,790	
旭化成	2,700	997.40	2,692,980	
日産化学	300	4,686.00	1,405,800	
信越化学工業	3,800	6,067.00	23,054,600	
日本酸素ホールディングス	400	4,555.00	1,822,000	
三井化学	400	3,565.00	1,426,000	
三菱ケミカルグループ	2,900	833.00	2,415,700	
積水化学工業	800	2,160.00	1,728,000	
花王	1,000	6,327.00	6,327,000	
日本ペイントホールディングス	2,000	879.40	1,758,800	
富士フイルムホールディングス	2,400	3,526.00	8,462,400	
資生堂	800	3,400.00	2,720,000	
日東電工	300	11,070.00	3,321,000	
ユニ・チャーム	900	4,982.00	4,483,800	
協和キリン	600	3,051.00	1,830,600	
武田薬品工業	3,300	4,292.00	14,163,600	
アステラス製薬	3,800	1,695.50	6,442,900	
塩野義製薬	500	6,422.00	3,211,000	
中外製薬	1,400	6,588.00	9,223,200	
エーザイ	500	5,834.00	2,917,000	

小野薬品工業	800	2,154.50	1,723,600
第一三共	3,900	5,751.00	22,428,900
大塚ホールディングス	900	8,075.00	7,267,500
出光興産	1,900	1,054.00	2,002,600
E N E O Sホールディングス	6,100	725.40	4,424,940
ブリヂストン	1,200	5,834.00	7,000,800
A G C	400	4,594.00	1,837,600
T O T O	300	4,485.00	1,345,500
日本製鉄	1,800	3,234.00	5,821,200
J F Eホールディングス	1,200	1,918.50	2,302,200
住友金属鉱山	500	3,915.00	1,957,500
住友電気工業	1,500	2,383.00	3,574,500
S U M C O	700	1,706.00	1,194,200
ディスコ	200	45,180.00	9,036,000
S M C	100	64,400.00	6,440,000
小松製作所	2,000	4,100.00	8,200,000
日立建機	200	3,456.00	691,200
クボタ	2,100	2,015.00	4,231,500
ダイキン工業	600	17,735.00	10,641,000
ダイフク	600	2,643.00	1,585,800
ホシザキ	200	4,564.00	912,800
マキタ	500	4,437.00	2,218,500
三菱重工業	6,800	1,920.50	13,059,400
イビデン	200	5,060.00	1,012,000
ブラザー工業	500	2,680.00	1,340,000
ミネベアミツミ	800	2,963.00	2,370,400
日立製作所	9,800	3,396.00	33,280,800
三菱電機	4,100	2,301.50	9,436,150
富士電機	300	8,138.00	2,441,400
安川電機	500	4,567.00	2,283,500
ニデック	900	6,054.00	5,448,600
オムロン	400	5,337.00	2,134,800
日本電気	500	12,500.00	6,250,000
富士通	3,700	2,453.50	9,077,950
ルネサスエレクトロニクス	3,200	2,335.00	7,472,000
セイコーエプソン	600	2,591.00	1,554,600
パナソニックホールディングス	4,900	1,114.50	5,461,050
ソニーグループ	2,600	12,880.00	33,488,000
T D K	800	9,594.00	7,675,200
横河電機	500	3,504.00	1,752,000
アドバンテスト	1,600	6,235.00	9,976,000
キーエンス	400	64,420.00	25,768,000
シスメックス	1,100	2,696.00	2,965,600

レーザーテック	200	28,540.00	5,708,000
ファナック	2,000	4,076.00	8,152,000
ローム	700	1,678.50	1,174,950
浜松ホトニクス	300	3,822.00	1,146,600
京セラ	2,700	1,655.50	4,469,850
村田製作所	3,600	2,894.50	10,420,200
小糸製作所	400	1,992.50	797,000
S C R E E Nホールディングス	200	11,045.00	2,209,000
キャノン	2,100	4,673.00	9,813,300
リコー	1,200	1,317.50	1,581,000
東京エレクトロン	1,000	27,620.00	27,620,000
豊田自動織機	300	11,370.00	3,411,000
デンソー	4,000	2,255.50	9,022,000
日産自動車	5,000	435.80	2,179,000
いすゞ自動車	1,200	2,082.50	2,499,000
トヨタ自動車	22,400	2,657.50	59,528,000
アイシン	400	4,987.00	1,994,800
マツダ	1,200	1,225.50	1,470,600
本田技研工業	9,500	1,546.50	14,691,750
スズキ	3,300	1,705.00	5,626,500
S U B A R U	1,300	2,701.50	3,511,950
ヤマハ発動機	1,900	1,238.00	2,352,200
シマノ	200	27,790.00	5,558,000
テルモ	2,800	2,665.00	7,462,000
島津製作所	500	4,491.00	2,245,500
オリンパス	2,400	2,489.50	5,974,800
H O Y A	700	19,575.00	13,702,500
バンダイナムコホールディングス	1,300	2,920.50	3,796,650
T O P P A Nホールディングス	500	4,050.00	2,025,000
大日本印刷	400	4,819.00	1,927,600
アシックス	1,400	2,429.00	3,400,600
任天堂	2,200	7,898.00	17,375,600
東京電力ホールディングス	3,200	675.50	2,161,600
中部電力	1,400	1,725.50	2,415,700
関西電力	1,500	2,460.50	3,690,750
東京瓦斯	800	3,495.00	2,796,000
大阪瓦斯	800	3,359.00	2,687,200
東急	1,100	1,695.00	1,864,500
京成電鉄	300	4,266.00	1,279,800
東日本旅客鉄道	1,900	2,614.00	4,966,600
西日本旅客鉄道	900	2,684.50	2,416,050
東海旅客鉄道	1,600	3,251.00	5,201,600
近鉄グループホールディングス	400	3,271.00	1,308,400

阪急阪神ホールディングス	500	4,146.00	2,073,000
ヤマトホールディングス	500	1,587.00	793,500
S Gホールディングス	700	1,518.00	1,062,600
NIPPON EXPRESSホールディングス	200	6,997.00	1,399,400
日本郵船	1,000	4,929.00	4,929,000
商船三井	700	4,936.00	3,455,200
川崎汽船	800	2,100.50	1,680,400
日本航空	300	2,291.00	687,300
ANAホールディングス	300	2,741.00	822,300
T I S	400	3,250.00	1,300,000
ネクソン	700	2,906.50	2,034,550
野村総合研究所	800	4,658.00	3,726,400
オービック	100	24,645.00	2,464,500
L I N E ヤフー	5,700	376.20	2,144,340
トレンドマイクロ	300	8,200.00	2,460,000
日本オラクル	100	12,500.00	1,250,000
大塚商会	500	3,360.00	1,680,000
日本電信電話	63,200	149.30	9,435,760
K D D I	3,200	4,578.00	14,649,600
ソフトバンク	6,000	1,895.00	11,370,000
光通信	100	28,135.00	2,813,500
東宝	200	5,303.00	1,060,600
N T T データグループ	1,300	1,973.50	2,565,550
カブコン	700	2,982.50	2,087,750
S C S K	300	2,732.50	819,750
コナミグループ	200	11,660.00	2,332,000
ソフトバンクグループ	2,200	8,187.00	18,011,400
神戸物産	300	3,952.00	1,185,600
伊藤忠商事	2,500	7,069.00	17,672,500
丸紅	3,000	2,439.00	7,317,000
豊田通商	1,300	2,648.00	3,442,400
三井物産	5,400	3,031.00	16,367,400
住友商事	2,200	3,378.00	7,431,600
三菱商事	7,100	2,945.50	20,913,050
日本マクドナルドホールディングス	200	6,200.00	1,240,000
M o n o t a R O	500	2,401.00	1,200,500
マツキヨココカラ&カンパニー	700	2,223.50	1,556,450
Z O Z O	300	4,279.00	1,283,700
セブン&アイ・ホールディングス	4,700	1,757.50	8,260,250
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	800	3,672.00	2,937,600
ゼンショーホールディングス	200	6,674.00	1,334,800
イオン	1,400	3,430.00	4,802,000

ニトリホールディングス	200	19,360.00	3,872,000	
ファーストリテイリング	400	41,210.00	16,484,000	
しずおかフィナンシャルグループ	900	1,333.50	1,200,150	
ゆうちょ銀行	3,100	1,411.00	4,374,100	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	2,200	832.30	1,831,060	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	23,500	1,503.00	35,320,500	
りそなホールディングス	4,500	986.80	4,440,600	
三井住友トラスト・ホールディングス	1,400	3,546.00	4,964,400	
三井住友フィナンシャルグループ	2,600	9,699.00	25,217,400	
千葉銀行	1,100	1,197.00	1,316,700	
みずほフィナンシャルグループ	5,100	3,041.00	15,509,100	
SBIホールディングス	600	3,505.00	2,103,000	
大和証券グループ本社	2,800	1,076.00	3,012,800	
野村ホールディングス	6,400	817.30	5,230,720	
かんぽ生命保険	400	2,823.00	1,129,200	
SOMPOホールディングス	1,900	3,276.00	6,224,400	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	2,700	3,254.00	8,785,800	
第一生命ホールディングス	1,900	4,034.00	7,664,600	
東京海上ホールディングス	4,000	5,393.00	21,572,000	
T&Dホールディングス	1,000	2,411.00	2,411,000	
オリックス	2,400	3,406.00	8,174,400	
三菱HCキャピタル	1,700	1,047.50	1,780,750	
日本取引所グループ	1,000	3,411.00	3,411,000	
大東建託	100	17,040.00	1,704,000	
ヒューリック	800	1,413.50	1,130,800	
野村不動産ホールディングス	200	4,002.00	800,400	
三井不動産	5,600	1,470.50	8,234,800	
三菱地所	2,400	2,338.00	5,611,200	
住友不動産	600	4,613.00	2,767,800	
エムスリー	900	1,246.00	1,121,400	
電通グループ	400	4,250.00	1,700,000	
オリエンタルランド	2,300	3,882.00	8,928,600	
楽天グループ	3,200	864.90	2,767,680	
リクルートホールディングス	3,100	8,286.00	25,686,600	
日本郵政	4,400	1,427.50	6,281,000	
セコム	400	9,576.00	3,830,400	
合 計	429,000		1,173,183,720	

(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	日本プロロジスリート投資法人	5	1,331,000	
	野村不動産マスターファンド投資法人	8	1,178,400	

	日本ビルファンド投資法人	3	1,833,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	3	1,644,000	
	合計	19	5,986,400	

(注) 券面総額欄の数値は口数を表しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

R M先進国株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2024年 8月15日現在

資産の部	
流動資産	
預金	4,413,971,831
コール・ローン	1,048,107,328
株式	302,459,773,850
投資証券	6,117,389,899
派生商品評価勘定	97,442,866
未収入金	1,658,839,636
未収配当金	230,821,604
未収利息	3,158
差入委託証拠金	1,994,690,412
流動資産合計	318,021,040,584
資産合計	318,021,040,584
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	42,815,108
未払解約金	46,150,000
流動負債合計	88,965,108
負債合計	88,965,108
純資産の部	
元本等	
元本	102,284,781,644
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	215,647,293,832
元本等合計	317,932,075,476
純資産合計	317,932,075,476
負債純資産合計	318,021,040,584

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

法	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 場で評価しております。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換 算基準	為替予約取引 個別法に基づき、原則としてわが国における計算日の対顧客先物相場の仲値で評価 しております。
4. 収益及び費用の計上基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則としてわが国における計 算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
5. その他財務諸表作成のための基礎と なる事項	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。 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 8月15日現在

1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 9月25日
期首元本額	85,186,855,364円
期中追加設定元本額	52,434,266,339円
期中一部解約元本額	35,336,340,059円
期末元本額	102,284,781,644円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	1,750,963,852円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	8,808,742,088円
りそなラップ型ファンド(成長型)	8,886,552,967円
DCりそな グローバルバランス	57,893,582円
つみたてバランスファンド	3,482,591,258円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	1,826,286,277円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	1,615,996,292円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	1,138,690,546円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	615,984,946円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	426,967,017円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	239,732,723円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	621,958,300円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定型)	124,844,445円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定成長型)	308,417,614円
りそな つみたてラップ型ファンド(成長型)	320,487,998円
りそな つみたてリスクコントロールファンド	26,971,873円
ターゲットリターンバランスファンド(目標2%)	5,088,136円
ターゲットリターンバランスファンド(目標3%)	5,170,501円
ターゲットリターンバランスファンド(目標4%)	26,233,244円
ターゲットリターンバランスファンド(目標5%)	13,461,506円
ターゲットリターンバランスファンド(目標6%)	30,045,595円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2065	5,946,393円
りそな先進国株式インデックス	239,579,601円
FWりそな先進国株式アクティブファンド	34,969,780円
FWりそな先進国+新興国株式アクティブファンド	79,257,926円
FWりそな先進国株式インデックスファンド	34,985,084,599円
Smart-i 先進国株式インデックス	25,804,034,423円
Smart-i 8資産バランス 安定型	517,720,548円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	1,836,053,807円
Smart-i 8資産バランス 成長型	2,621,746,150円
Smart-i Select 全世界株式インデックス	1,427,125,681円
Smart-i Select 全世界株式インデックス(除く日 本)	461,363,152円
Smart-i DC 全世界株式インデックス	292,155,173円
Smart-i DC 全世界株式インデックス(除く日本)	2,939,827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)	57,100,476円
りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	639,681,467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)	3,960,524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)	29,026,732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）	254,971,808円
りそなF T パッシブバランス（適格機関投資家専用）	628,902,125円
りそなマルチアセットファンド（適格機関投資家専用）	79,121,636円
りそなD A Aファンド（適格機関投資家専用）	205,914,428円
りそなF T パッシブバランス（適格機関投資家専用）	39,137,811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）	118,719,564円
りそなF T パッシブバランス2 0 2 3 0 7（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	102,284,781,644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	3.1083円
(10,000口当たり純資産額)	(31,083円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2024年 8月15日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、株価変動リスク、リートの価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

金融商品の時価等に関する事項

2024年 8月15日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ
2. 時価の算定方法	株式、新株予約権証券、投資証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 デリバティブ取引 (その他の注記)の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

2024年 8月15日現在	
該当事項はありません。	

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2024年 8月15日現在	
	損益に含まれた評価差額(円)	
株式	23,409,646,189	
投資証券	530,421,740	
合計	23,940,067,929	

(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 8月15日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	9,456,449,587	-	9,506,737,019	50,287,432
	合計	9,456,449,587	-	9,506,737,019	50,287,432

(注) 時価の算定方法

先物取引

外国先物取引について

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

(通貨関連)

(2024年 8月15日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	2,835,331,458	-	2,839,671,784	4,340,326
	米ドル	2,237,976,878	-	2,242,069,598	4,092,720
	カナダドル	115,824,416	-	116,015,684	191,268
	ユーロ	213,800,250	-	214,088,562	288,312
	英ポンド	113,486,760	-	113,372,700	114,060
	スイスフラン	91,785,010	-	91,946,092	161,082
	オーストラリアドル	62,458,144	-	62,179,148	278,996
	合計	2,835,331,458	-	2,839,671,784	4,340,326

(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	12,333	28.95	357,040.35	
	BAKER HUGHES COMPANY	34,470	34.75	1,197,832.50	
	CHENIERE ENERGY INC	7,641	184.12	1,406,860.92	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	3,774	72.17	272,369.58	

CHEVRON CORP	58,605	144.67	8,478,385.35
CHORD ENERGY CORP	2,031	152.79	310,316.49
CONOCOPHILLIPS	39,214	109.33	4,287,266.62
COTERRA ENERGY INC	25,447	23.94	609,201.18
DEVON ENERGY CORP	21,687	44.49	964,854.63
DIAMONDBACK ENERGY INC	5,837	196.45	1,146,678.65
EOG RESOURCES INC	19,283	126.54	2,440,070.82
EQT CORP	19,126	31.48	602,086.48
EXXON MOBIL CORP	149,917	118.95	17,832,627.15
HALLIBURTON CO	30,711	30.87	948,048.57
HESS CORP	9,384	134.14	1,258,769.76
HF SINCLAIR CORP	4,810	47.48	228,378.80
KINDER MORGAN INC	68,695	20.96	1,439,847.20
MARATHON OIL CORP	19,081	27.65	527,589.65
MARATHON PETROLEUM CORP	11,967	179.05	2,142,691.35
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	22,859	56.94	1,301,591.46
ONEOK INC	20,010	86.34	1,727,663.40
OVINTIV INC	9,881	42.49	419,843.69
PHILLIPS 66	14,206	137.70	1,956,166.20
SCHLUMBERGER LTD	47,295	43.78	2,070,575.10
TARGA RESOURCES CORP	6,831	140.16	957,432.96
TEXAS PACIFIC LAND CORP	652	819.30	534,183.60
VALERO ENERGY CORP	10,942	147.82	1,617,446.44
WILLIAMS COS INC	41,792	43.39	1,813,354.88
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	7,351	276.49	2,032,477.99
ALBEMARLE CORP	4,302	72.85	313,400.70
AMCOR PLC	48,269	10.66	514,547.54
AVERY DENNISON CORP	2,642	208.95	552,045.90
BALL CORP	10,271	62.20	638,856.20
CELANESE CORP	3,795	125.74	477,183.30
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	6,308	80.55	508,109.40
CLEVELAND-CLIFFS INC	17,775	12.55	223,076.25
CORTEVA INC	24,018	51.99	1,248,695.82
CRH PLC	22,712	83.35	1,893,045.20
CROWN HOLDINGS INC	4,133	86.72	358,413.76
DOW INC	24,165	52.76	1,274,945.40
DUPONT DE NEMOURS INC	13,764	78.75	1,083,915.00
EASTMAN CHEMICAL CO	4,305	95.61	411,601.05
ECOLAB INC	8,517	239.47	2,039,565.99
FREEMPORT-MCMORAN INC	47,489	41.91	1,990,263.99
INTERNATIONAL PAPER CO	11,466	46.12	528,811.92
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	8,604	96.71	832,092.84
LINDE PLC	16,072	451.18	7,251,364.96

LYONDELLBASELL INDU-CL A	8,494	96.19	817,037.86
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,098	525.45	1,102,394.10
MOSAIC CO/THE	11,098	27.64	306,748.72
NEWMONT CORP	38,088	49.14	1,871,644.32
NUCOR CORP	7,947	141.26	1,122,593.22
PACKAGING CORP OF AMERICA	3,112	194.34	604,786.08
PPG INDUSTRIES INC	8,108	119.87	971,905.96
RELIANCE INC	1,941	280.14	543,751.74
RPM INTERNATIONAL INC	4,084	115.42	471,375.28
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	8,011	352.15	2,821,073.65
SMURFIT WESTROCK PLC	17,166	41.21	707,410.86
STEEL DYNAMICS INC	5,179	115.05	595,843.95
VULCAN MATERIALS CO	4,549	242.50	1,103,132.50
WESTLAKE CORP	1,041	144.68	150,611.88
3M CO	18,349	126.17	2,315,093.33
AECOM	4,502	95.44	429,670.88
AERCAP HOLDINGS NV	6,881	93.04	640,208.24
ALLEGION PLC	2,932	131.09	384,355.88
AMETEK INC	7,820	161.48	1,262,773.60
AXON ENTERPRISE INC	2,311	370.57	856,387.27
BOEING CO/THE	19,293	168.50	3,250,870.50
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	4,170	160.60	669,702.00
CARLISLE COS INC	1,607	396.48	637,143.36
CARRIER GLOBAL CORP	27,740	65.68	1,821,963.20
CATERPILLAR INC	16,653	337.59	5,621,886.27
CNH INDUSTRIAL NV	26,880	9.67	259,929.60
CUMMINS INC	4,547	291.99	1,327,678.53
DEERE & CO	8,800	351.28	3,091,264.00
DOVER CORP	4,725	176.82	835,474.50
EATON CORP PLC	13,317	298.30	3,972,461.10
EMCOR GROUP INC	1,586	365.35	579,445.10
EMERSON ELECTRIC CO	18,972	103.49	1,963,412.28
FASTENAL CO	19,673	66.27	1,303,729.71
FORTIVE CORP	11,453	68.73	787,164.69
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS I	3,833	75.30	288,624.90
GE VERNOVA INC	9,395	184.16	1,730,183.20
GENERAL DYNAMICS CORP	7,729	293.73	2,270,239.17
GENERAL ELECTRIC CO	36,464	167.95	6,124,128.80
GRACO INC	5,379	80.57	433,386.03
HEICO CORP	1,258	236.89	298,007.62
HEICO CORP-CLASS A	2,341	184.76	432,523.16
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	21,728	197.60	4,293,452.80
HOWMET AEROSPACE INC	13,203	93.88	1,239,497.64

HUBBELL INC	1,826	379.68	693,295.68
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,328	266.63	354,084.64
IDEX CORP	2,474	193.31	478,248.94
ILLINOIS TOOL WORKS	9,923	238.66	2,368,223.18
INGERSOLL-RAND INC	13,654	91.03	1,242,923.62
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	4,800	36.76	176,448.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	23,364	68.50	1,600,434.00
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	6,522	226.06	1,474,363.32
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,116	577.10	644,043.60
LOCKHEED MARTIN CORP	7,206	563.22	4,058,563.32
MASCO CORP	7,356	75.49	555,304.44
NORDSON CORP	1,788	236.49	422,844.12
NORTHROP GRUMMAN CORP	4,671	505.00	2,358,855.00
OTIS WORLDWIDE CORP	13,928	92.11	1,282,908.08
OWENS CORNING	2,922	158.54	463,253.88
PACCAR INC	17,942	93.69	1,680,985.98
PARKER HANNIFIN CORP	4,263	578.39	2,465,676.57
PENTAIR PLC	5,456	83.13	453,557.28
QUANTA SERVICES INC	4,949	263.47	1,303,913.03
ROCKWELL AUTOMATION INC	3,725	261.17	972,858.25
RTX CORP	44,320	117.65	5,214,248.00
SMITH (A.O.) CORP	4,126	79.76	329,089.76
SNAP-ON INC	1,738	273.23	474,873.74
STANLEY BLACK & DECKER INC	4,916	95.40	468,986.40
TEXTRON INC	6,118	85.99	526,086.82
TORO CO	3,740	88.34	330,391.60
TRANE TECHNOLOGIES PLC	7,542	345.72	2,607,420.24
TRANSDIGM GROUP INC	1,846	1,248.36	2,304,472.56
UNITED RENTALS INC	2,303	702.19	1,617,143.57
VERTIV HOLDINGS CO	12,198	80.16	977,791.68
WABTEC CORP	6,042	156.08	943,035.36
WATSCO INC	1,117	475.07	530,653.19
WW GRAINGER INC	1,519	952.70	1,447,151.30
XYLEM INC	8,195	131.49	1,077,560.55
AUTOMATIC DATA PROCESSING	13,639	262.82	3,584,601.98
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	4,270	147.98	631,874.60
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	4,044	209.65	847,824.60
CERIDIAN HCM HOLDING INC	4,446	54.06	240,350.76
CINTAS CORP	3,021	763.16	2,305,506.36
COPART INC	29,669	50.99	1,512,822.31
EQUIFAX INC	4,025	296.38	1,192,929.50
JACOBS SOLUTIONS INC	4,308	144.99	624,616.92
LEIDOS HOLDINGS INC	4,460	147.34	657,136.40

PAYCHEX INC	11,119	125.10	1,390,986.90
PAYCOM SOFTWARE INC	1,636	155.17	253,858.12
PAYLOCITY HOLDING CORP	1,659	151.43	251,222.37
REPUBLIC SERVICES INC	7,559	202.45	1,530,319.55
ROLLINS INC	9,190	48.50	445,715.00
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	7,407	71.40	528,859.80
TRANSUNION	6,662	91.37	608,706.94
VERALTO CORP	8,251	108.51	895,316.01
VERISK ANALYTICS INC	4,899	268.59	1,315,822.41
WASTE CONNECTIONS INC	8,473	181.56	1,538,357.88
WASTE MANAGEMENT INC	13,303	206.35	2,745,074.05
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	4,203	97.79	411,011.37
CSX CORP	65,310	33.36	2,178,741.60
DELTA AIR LINES INC	5,589	38.69	216,238.41
EXPEDITORS INTL WASH INC	4,779	119.33	570,278.07
FEDEX CORP	7,801	283.33	2,210,257.33
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	71,513	3.37	240,998.81
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	2,597	163.63	424,947.11
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	4,870	52.10	253,727.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	7,558	241.97	1,828,809.26
OLD DOMINION FREIGHT LINE	6,764	193.00	1,305,452.00
SOUTHWEST AIRLINES CO	4,272	25.38	108,423.36
U-HAUL HOLDING CO	3,337	63.28	211,165.36
UBER TECHNOLOGIES INC	62,544	71.93	4,498,789.92
UNION PACIFIC CORP	20,364	241.22	4,912,204.08
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	24,286	126.42	3,070,236.12
APTIV PLC	9,500	66.98	636,310.00
FORD MOTOR CO	133,809	10.18	1,362,175.62
GENERAL MOTORS CO	38,247	43.61	1,667,951.67
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	23,390	13.25	309,917.50
TESLA INC	95,807	201.38	19,293,613.66
DECKERS OUTDOOR CORP	864	919.37	794,335.68
DR HORTON INC	10,250	174.21	1,785,652.50
GARMIN LTD	4,990	170.00	848,300.00
LENNAR CORP-A	8,425	169.12	1,424,836.00
LULULEMON ATHLETICA INC	3,736	240.49	898,470.64
NIKE INC -CL B	40,307	78.52	3,164,905.64
NVR INC	108	8,571.48	925,719.84
PULTEGROUP INC	7,229	121.87	880,998.23
AIRBNB INC-CLASS A	14,685	116.24	1,706,984.40
BOOKING HOLDINGS INC	1,139	3,572.58	4,069,168.62
CAESARS ENTERTAINMENT INC	7,480	34.78	260,154.40
CARNIVAL CORP	32,823	14.76	484,467.48

CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	45,901	51.65	2,370,786.65
DARDEN RESTAURANTS INC	3,867	140.82	544,550.94
DOMINO'S PIZZA INC	1,132	442.24	500,615.68
DOORDASH INC - A	9,372	126.93	1,189,587.96
DRAFTKINGS INC-CL A	15,097	32.06	484,009.82
EXPEDIA GROUP INC	4,600	129.03	593,538.00
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	8,635	207.79	1,794,266.65
HYATT HOTELS CORP - CL A	1,264	138.79	175,430.56
LAS VEGAS SANDS CORP	12,183	39.50	481,228.50
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	8,172	217.10	1,774,141.20
MCDONALD'S CORP	24,061	271.15	6,524,140.15
MGM RESORTS INTERNATIONAL	7,471	38.08	284,495.68
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	8,411	152.71	1,284,443.81
STARBUCKS CORP	37,684	93.90	3,538,527.60
WYNN RESORTS LTD	3,643	74.04	269,727.72
YUM! BRANDS INC	9,522	137.26	1,306,989.72
ALPHABET INC-CL A	196,967	160.37	31,587,597.79
ALPHABET INC-CL C	170,575	162.03	27,638,267.25
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	3,080	351.22	1,081,757.60
COMCAST CORP-CLASS A	131,980	39.01	5,148,539.80
ELECTRONIC ARTS INC	8,666	146.46	1,269,222.36
FOX CORP - CLASS A	7,650	39.06	298,809.00
FOX CORP- CLASS B	4,137	36.33	150,297.21
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	13,863	30.53	423,237.39
LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	6,704	77.21	517,615.84
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	4,996	93.49	467,076.04
MATCH GROUP INC	8,454	34.17	288,873.18
META PLATFORMS INC-CLASS A	73,238	526.76	38,578,848.88
NETFLIX INC	14,445	661.68	9,557,967.60
NEWS CORP - CLASS A	13,495	27.32	368,683.40
OMNICOM GROUP	6,393	94.45	603,818.85
PARAMOUNT GLOBAL	19,631	10.23	200,825.13
PINTEREST INC- CLASS A	20,074	29.28	587,766.72
ROBLOX CORP -CLASS A	16,525	39.09	645,962.25
ROKU INC	4,368	56.22	245,568.96
SEA LTD-ADR	12,848	76.80	986,726.40
SNAP INC - A	33,029	9.03	298,251.87
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	5,265	144.91	762,951.15
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	15,112	98.69	1,491,403.28
WALT DISNEY CO/THE	61,093	86.30	5,272,325.90
WARNER BROS DISCOVERY INC	74,691	6.96	519,849.36
AMAZON.COM INC	313,056	170.10	53,250,825.60
AUTOZONE INC	593	3,196.42	1,895,477.06

BATH & BODY WORKS INC	7,310	31.40	229,534.00
BEST BUY CO INC	6,541	82.91	542,314.31
BURLINGTON STORES INC	2,137	255.45	545,896.65
CARMAX INC	5,758	77.45	445,957.10
DICK'S SPORTING GOODS INC	1,942	213.82	415,238.44
EBAY INC	16,725	55.76	932,586.00
ETSY INC	4,170	51.50	214,755.00
FERGUSON ENTERPRISES INC	6,854	204.11	1,398,969.94
GENUINE PARTS CO	4,549	137.19	624,077.31
GLOBAL-E ONLINE LTD	3,481	31.53	109,755.93
HOME DEPOT INC	33,098	355.66	11,771,634.68
LKQ CORP	9,775	39.39	385,037.25
LOWE'S COS INC	19,064	237.64	4,530,368.96
MERCADOLIBRE INC	1,515	1,898.57	2,876,333.55
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	1,959	1,129.22	2,212,141.98
POOL CORP	1,306	344.04	449,316.24
ROSS STORES INC	11,284	141.34	1,594,880.56
TJX COMPANIES INC	37,738	109.08	4,116,461.04
TRACTOR SUPPLY COMPANY	3,721	262.29	975,981.09
ULTA BEAUTY INC	1,630	329.05	536,351.50
WILLIAMS-SONOMA INC	3,970	138.62	550,321.40
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	10,094	20.26	204,504.44
COSTCO WHOLESALE CORP	14,810	862.71	12,776,735.10
DOLLAR GENERAL CORP	7,628	116.54	888,967.12
DOLLAR TREE INC	6,718	92.37	620,541.66
KROGER CO	23,403	52.70	1,233,338.10
SYSCO CORP	17,200	76.01	1,307,372.00
TARGET CORP	15,308	135.76	2,078,214.08
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	22,735	10.43	237,126.05
WALMART INC	147,950	68.66	10,158,247.00
ALTRIA GROUP INC	56,976	51.19	2,916,601.44
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	17,062	58.38	996,079.56
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	6,297	44.51	280,279.47
BUNGE GLOBAL SA	4,578	95.76	438,389.28
CAMPBELL SOUP CO	6,726	49.63	333,811.38
CELSIUS HOLDINGS INC	4,728	39.23	185,479.44
COCA-COLA CO/THE	136,633	68.58	9,370,291.14
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	6,474	75.65	489,758.10
CONAGRA BRANDS INC	15,050	30.82	463,841.00
CONSTELLATION BRANDS INC-A	5,635	241.08	1,358,485.80
GENERAL MILLS INC	19,362	70.40	1,363,084.80
HERSHEY CO/THE	5,069	200.61	1,016,892.09
HORMEL FOODS CORP	10,515	32.26	339,213.90

JM SMUCKER CO/THE	3,831	119.71	458,609.01
KELLANOVA	9,010	80.28	723,322.80
KEURIG DR PEPPER INC	37,113	35.31	1,310,460.03
KRAFT HEINZ CO/THE	30,389	34.49	1,048,116.61
LAMB WESTON HOLDINGS INC	5,206	59.13	307,830.78
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	8,592	77.96	669,832.32
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	5,984	52.43	313,741.12
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	44,676	71.20	3,180,931.20
MONSTER BEVERAGE CORP	25,301	46.24	1,169,918.24
PEPSICO INC	45,833	173.71	7,961,650.43
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	51,715	117.20	6,060,998.00
TYSON FOODS INC-CL A	9,386	62.03	582,213.58
CHURCH & DWIGHT CO INC	8,269	100.48	830,869.12
CLOROX COMPANY	4,244	144.52	613,342.88
COLGATE-PALMOLIVE CO	25,935	102.18	2,650,038.30
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	7,880	91.63	722,044.40
KENVUE INC	65,780	21.18	1,393,220.40
KIMBERLY-CLARK CORP	11,540	140.82	1,625,062.80
PROCTER & GAMBLE CO/THE	78,573	168.80	13,263,122.40
ABBOTT LABORATORIES	57,881	109.89	6,360,543.09
ALIGN TECHNOLOGY INC	2,274	220.03	500,348.22
BAXTER INTERNATIONAL INC	17,126	35.53	608,486.78
BECTON DICKINSON AND CO	9,594	234.08	2,245,763.52
BOSTON SCIENTIFIC CORP	48,944	76.42	3,740,300.48
CARDINAL HEALTH INC	8,063	106.36	857,580.68
CENCORA INC	5,901	237.75	1,402,962.75
CENTENE CORP	18,057	77.03	1,390,930.71
CIGNA GROUP/THE	9,442	334.90	3,162,125.80
COOPER COS INC/THE	6,701	91.42	612,605.42
CVS HEALTH CORP	41,822	55.99	2,341,613.78
DAVITA INC	1,655	148.88	246,396.40
DEXCOM INC	13,228	70.05	926,621.40
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	20,601	66.50	1,369,966.50
ELEVANCE HEALTH INC	7,751	539.22	4,179,494.22
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES I	14,230	83.47	1,187,778.10
HCA HEALTHCARE INC	6,588	371.58	2,447,969.04
HENRY SCHEIN INC	4,459	68.51	305,486.09
HOLOGIC INC	7,941	80.99	643,141.59
HUMANA INC	4,134	356.38	1,473,274.92
IDEXX LABORATORIES INC	2,801	474.94	1,330,306.94
INSULET CORP	2,354	191.54	450,885.16
INTUITIVE SURGICAL INC	11,818	471.21	5,568,759.78
LABCORP HOLDINGS INC	2,875	221.33	636,323.75

MCKESSON CORP	4,368	552.83	2,414,761.44
MEDTRONIC PLC	44,203	81.74	3,613,153.22
MOLINA HEALTHCARE INC	1,890	339.22	641,125.80
QUEST DIAGNOSTICS INC	3,758	149.85	563,136.30
RESMED INC	4,943	222.21	1,098,384.03
SOLVENTUM CORP	5,234	57.78	302,420.52
STERIS PLC	3,424	232.79	797,072.96
STRYKER CORP	11,397	332.68	3,791,553.96
TELEFLEX INC	1,518	232.65	353,162.70
UNITEDHEALTH GROUP INC	30,810	579.67	17,859,632.70
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	1,970	221.85	437,044.50
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	5,132	188.20	965,842.40
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	7,027	108.63	763,343.01
ABBVIE INC	59,177	193.00	11,421,161.00
AGILENT TECHNOLOGIES INC	9,884	136.03	1,344,520.52
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	4,341	262.89	1,141,205.49
AMGEN INC	17,899	322.73	5,776,544.27
AVANTOR INC	21,936	25.07	549,935.52
BIO-RAD LABORATORIES-A	722	320.45	231,364.90
BIO-TECHNE CORP	5,708	72.75	415,257.00
BIOGEN INC	4,719	200.59	946,584.21
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	6,120	89.61	548,413.20
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	67,617	48.41	3,273,338.97
CATALENT INC	6,572	59.40	390,376.80
CHARLES RIVER LABORATORIES	1,635	198.55	324,629.25
DANAHER CORP	23,499	268.08	6,299,611.92
ELI LILLY & CO	27,020	931.68	25,173,993.60
EXACT SCIENCES CORP	6,362	56.36	358,562.32
GILEAD SCIENCES INC	41,595	74.14	3,083,853.30
ILLUMINA INC	4,970	122.28	607,731.60
INCYTE CORP	5,603	61.18	342,791.54
IQVIA HOLDINGS INC	6,231	236.21	1,471,824.51
JOHNSON & JOHNSON	80,547	158.48	12,765,088.56
MERCK & CO. INC.	84,641	113.58	9,613,524.78
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	730	1,402.55	1,023,861.50
MODERNA INC	11,146	82.25	916,758.50
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	3,264	146.69	478,796.16
PFIZER INC	188,588	28.88	5,446,421.44
REGENERON PHARMACEUTICALS	3,602	1,156.86	4,167,009.72
REPLIGEN CORP	1,593	160.30	255,357.90
REVVITY INC	4,118	117.44	483,617.92
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	12,049	26.65	321,105.85
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	38,288	18.01	689,566.88

THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	12,753	602.10	7,678,581.30
UNITED THERAPEUTICS CORP	1,589	323.87	514,629.43
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	8,622	471.44	4,064,755.68
VIATRIS INC	40,066	11.40	456,752.40
WATERS CORP	1,909	336.49	642,359.41
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	2,489	292.21	727,310.69
ZOETIS INC	15,615	183.38	2,863,478.70
BANK OF AMERICA CORP	237,203	38.81	9,205,848.43
CITIGROUP INC	63,852	59.28	3,785,146.56
CITIZENS FINANCIAL GROUP	15,292	40.11	613,362.12
FIFTH THIRD BANCORP	22,890	39.71	908,961.90
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	332	1,999.61	663,870.52
HUNTINGTON BANCSHARES INC	47,084	13.48	634,692.32
JPMORGAN CHASE & CO	96,000	210.24	20,183,040.00
KEYCORP	30,861	15.64	482,666.04
M & T BANK CORP	5,579	160.16	893,532.64
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	13,232	168.37	2,227,871.84
REGIONS FINANCIAL CORP	31,853	20.89	665,409.17
TRUIST FINANCIAL CORP	45,663	41.90	1,913,279.70
US BANCORP	51,822	42.34	2,194,143.48
WELLS FARGO & CO	118,192	53.66	6,342,182.72
ALLY FINANCIAL INC	9,977	41.06	409,655.62
AMERICAN EXPRESS CO	19,188	243.76	4,677,266.88
AMERIPRISE FINANCIAL INC	3,435	419.87	1,442,253.45
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	13,618	105.98	1,443,235.64
ARES MANAGEMENT CORP - A	6,218	143.83	894,334.94
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	25,833	64.11	1,656,153.63
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	43,805	438.47	19,207,178.35
BLACKROCK INC	4,959	857.52	4,252,441.68
BLACKSTONE INC	23,767	136.16	3,236,114.72
BLOCK INC	19,044	62.20	1,184,536.80
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	13,069	135.95	1,776,730.55
CARLYLE GROUP INC/THE	7,596	40.79	309,840.84
CBOE GLOBAL MARKETS INC	3,606	205.99	742,799.94
CME GROUP INC	11,946	207.85	2,482,976.10
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	6,159	195.96	1,206,917.64
COREBRIDGE FINANCIAL INC	7,230	27.01	195,282.30
CORPAY INC	2,352	288.00	677,376.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	8,157	127.75	1,042,056.75
EQUITABLE HOLDINGS INC	11,309	39.24	443,765.16
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,325	404.33	535,737.25
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	19,192	78.09	1,498,703.28
FISERV INC	19,627	164.03	3,219,416.81

FRANKLIN RESOURCES INC	9,399	22.02	206,965.98
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	1,496	60.94	91,166.24
GLOBAL PAYMENTS INC	8,834	105.08	928,276.72
GOLDMAN SACHS GROUP INC	10,816	498.70	5,393,939.20
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	19,025	156.12	2,970,183.00
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	2,433	164.79	400,934.07
KKR & CO INC	20,558	118.38	2,433,656.04
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	2,579	216.57	558,534.03
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,139	240.95	274,442.05
MASTERCARD INC-CLASS A	27,823	460.16	12,803,031.68
MOODY'S CORP	5,453	466.15	2,541,915.95
MORGAN STANLEY	40,836	99.44	4,060,731.84
MSCI INC	2,717	554.33	1,506,114.61
NASDAQ INC	13,510	69.30	936,243.00
NORTHERN TRUST CORP	7,089	84.81	601,218.09
PAYPAL HOLDINGS INC	34,186	66.14	2,261,062.04
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	6,763	114.91	777,136.33
ROBINHOOD MARKETS INC - A	18,050	18.65	336,632.50
S&P GLOBAL INC	10,672	492.65	5,257,560.80
SCHWAB (CHARLES) CORP	50,130	65.36	3,276,496.80
SEI INVESTMENTS COMPANY	3,903	65.54	255,802.62
STATE STREET CORP	10,029	78.95	791,789.55
SYNCHRONY FINANCIAL	14,143	46.32	655,103.76
T ROWE PRICE GROUP INC	7,573	105.93	802,207.89
TOAST INC-CLASS A	11,269	24.78	279,245.82
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	3,676	116.89	429,687.64
VISA INC-CLASS A SHARES	52,826	261.14	13,794,981.64
AFLAC INC	18,712	102.37	1,915,547.44
ALLSTATE CORP	8,894	180.95	1,609,369.30
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	2,173	127.72	277,535.56
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	22,562	72.91	1,644,995.42
AON PLC	6,582	331.00	2,178,642.00
ARCH CAPITAL GROUP LTD	12,668	100.90	1,278,201.20
ARTHUR J GALLAGHER & CO	7,186	284.70	2,045,854.20
ASSURANT INC	1,791	185.98	333,090.18
BROWN & BROWN INC	7,906	101.30	800,877.80
CHUBB LTD	13,511	272.37	3,679,991.07
CINCINNATI FINANCIAL CORP	5,331	130.07	693,403.17
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	864	465.41	402,114.24
EVEREST GROUP LTD	1,513	369.54	559,114.02
FNF GROUP	9,412	55.91	526,224.92
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	9,767	109.61	1,070,560.87
LOEWS CORP	6,498	77.66	504,634.68

MARKEL GROUP INC	451	1,536.66	693,033.66
MARSH & MCLENNAN COS	16,360	221.05	3,616,378.00
METLIFE INC	20,196	71.18	1,437,551.28
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	7,800	75.90	592,020.00
PROGRESSIVE CORP	19,503	234.34	4,570,333.02
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	12,301	111.40	1,370,331.40
TRAVELERS COS INC/THE	7,711	214.09	1,650,847.99
WILLIS TOWERS WATSON PLC	3,342	279.98	935,693.16
WR BERKLEY CORP	10,705	57.31	613,503.55
ACCENTURE PLC-CL A	20,975	319.83	6,708,434.25
ADOBE INC	14,952	539.79	8,070,940.08
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	4,956	99.73	494,261.88
ANSYS INC	2,831	319.13	903,457.03
APPROVIN CORP-CLASS A	5,693	84.64	481,855.52
ASPEN TECHNOLOGY INC	982	213.29	209,450.78
ATLASSIAN CORP-CL A	5,416	143.50	777,196.00
AUTODESK INC	7,317	246.22	1,801,591.74
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	5,344	49.64	265,276.16
CADENCE DESIGN SYS INC	9,049	271.78	2,459,337.22
CHECK POINT SOFTWARE TECH	3,156	183.93	580,483.08
CLOUDFLARE INC - CLASS A	9,659	81.46	786,822.14
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	17,086	74.38	1,270,856.68
CONFLUENT INC-CLASS A	5,523	21.10	116,535.30
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	7,827	256.22	2,005,433.94
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,280	275.55	352,704.00
DATADOG INC - CLASS A	9,321	114.15	1,063,992.15
DOCUSIGN INC	6,883	55.59	382,625.97
DYNATRACE INC	9,133	47.88	437,288.04
EPAM SYSTEMS INC	1,898	199.96	379,524.08
FAIR ISAAC CORP	835	1,809.75	1,511,141.25
FORTINET INC	21,899	72.79	1,594,028.21
GARTNER INC	2,634	478.67	1,260,816.78
GEN DIGITAL INC	19,152	24.94	477,650.88
GODADDY INC - CLASS A	4,633	160.83	745,125.39
HUBSPOT INC	1,556	484.26	753,508.56
INTL BUSINESS MACHINES CORP	30,570	192.32	5,879,222.40
INTUIT INC	9,336	636.74	5,944,604.64
MANHATTAN ASSOCIATES INC	1,934	249.81	483,132.54
MICROSOFT CORP	236,062	416.86	98,404,805.32
MICROSTRATEGY INC-CL A	5,220	130.37	680,531.40
MONDAY.COM LTD	1,321	259.36	342,614.56
MONGODB INC	2,433	243.44	592,289.52
OKTA INC	5,567	95.08	529,310.36

ORACLE CORP	55,030	135.60	7,462,068.00
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	65,035	31.00	2,016,085.00
PALO ALTO NETWORKS INC	10,752	339.91	3,654,712.32
PTC INC	4,039	172.42	696,404.38
ROPER TECHNOLOGIES INC	3,658	528.00	1,931,424.00
SALESFORCE INC	32,376	255.32	8,266,240.32
SAMSARA INC-CL A	6,826	39.74	271,265.24
SERVICENOW INC	6,835	819.02	5,598,001.70
SNOWFLAKE INC-CLASS A	9,909	127.30	1,261,415.70
SYNOPSYS INC	5,069	530.80	2,690,625.20
TWILIO INC - A	6,146	60.61	372,509.06
TYLER TECHNOLOGIES INC	1,378	581.18	800,866.04
UIPATH INC - CLASS A	15,094	11.43	172,524.42
UNITY SOFTWARE INC	7,208	15.82	114,030.56
VERISIGN INC	3,010	174.93	526,539.30
WIX.COM LTD	1,845	159.05	293,447.25
WORKDAY INC-CLASS A	7,222	222.84	1,609,350.48
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	8,066	57.00	459,762.00
ZSCALER INC	2,921	183.98	537,405.58
AMPHENOL CORP-CL A	39,925	64.81	2,587,539.25
APPLE INC	490,576	221.72	108,770,510.72
ARISTA NETWORKS INC	8,825	348.65	3,076,836.25
CDW CORP/DE	4,631	216.68	1,003,445.08
CISCO SYSTEMS INC	135,012	45.44	6,134,945.28
CORNING INC	27,914	39.59	1,105,115.26
DELL TECHNOLOGIES -C	8,603	102.95	885,678.85
F5 INC	2,021	191.36	386,738.56
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	43,992	17.78	782,177.76
HP INC	32,040	34.75	1,113,390.00
JABIL INC	3,812	103.27	393,665.24
JUNIPER NETWORKS INC	11,533	38.79	447,365.07
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	5,942	127.27	756,238.34
MOTOROLA SOLUTIONS INC	5,521	418.59	2,311,035.39
NETAPP INC	6,718	127.11	853,924.98
PURE STORAGE INC - CLASS A	10,121	60.30	610,296.30
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	6,768	97.06	656,902.08
SUPER MICRO COMPUTER INC	1,810	577.09	1,044,532.90
TE CONNECTIVITY LTD	10,390	145.13	1,507,900.70
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	1,603	408.53	654,873.59
TRIMBLE INC	8,512	53.17	452,583.04
WESTERN DIGITAL CORP	10,542	61.51	648,438.42
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	1,701	333.24	566,841.24
AT&T INC	239,026	19.63	4,692,080.38

T-MOBILE US INC	17,841	196.49	3,505,578.09
VERIZON COMMUNICATIONS INC	140,520	40.90	5,747,268.00
AES CORP	22,759	16.94	385,537.46
ALLIANT ENERGY CORP	8,572	56.48	484,146.56
AMEREN CORPORATION	8,956	81.26	727,764.56
AMERICAN ELECTRIC POWER	17,421	97.24	1,694,018.04
AMERICAN WATER WORKS CO INC	6,617	141.67	937,430.39
ATMOS ENERGY CORP	4,937	128.66	635,194.42
CENTERPOINT ENERGY INC	21,796	25.77	561,682.92
CMS ENERGY CORP	10,118	66.32	671,025.76
CONSOLIDATED EDISON INC	11,754	100.86	1,185,508.44
CONSTELLATION ENERGY	10,442	186.15	1,943,778.30
DOMINION ENERGY INC	28,854	55.51	1,601,685.54
DTE ENERGY COMPANY	6,690	122.03	816,380.70
DUKE ENERGY CORP	25,644	113.46	2,909,568.24
EDISON INTERNATIONAL	13,016	83.14	1,082,150.24
ENERGY CORP	6,861	117.99	809,529.39
ESSENTIAL UTILITIES INC	9,627	39.47	379,977.69
EVERGY INC	8,098	59.13	478,834.74
EVERSOURCE ENERGY	11,362	66.45	755,004.90
EXELON CORP	34,548	37.03	1,279,312.44
FIRSTENERGY CORP	17,726	42.28	749,455.28
NEXTERA ENERGY INC	68,417	78.01	5,337,210.17
NISOURCE INC	15,754	31.84	501,607.36
NRG ENERGY INC	7,470	82.38	615,378.60
P G & E CORP	70,031	18.39	1,287,870.09
PPL CORP	25,085	31.05	778,889.25
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	17,216	80.51	1,386,060.16
SEMPRA	20,925	78.71	1,647,006.75
SOUTHERN CO/THE	36,282	87.19	3,163,427.58
VISTRA CORP	11,585	79.25	918,111.25
WEC ENERGY GROUP INC	10,674	89.64	956,817.36
XCEL ENERGY INC	18,916	58.96	1,115,287.36
ADVANCED MICRO DEVICES	54,029	140.75	7,604,581.75
ANALOG DEVICES INC	16,571	215.32	3,568,067.72
APPLIED MATERIALS INC	27,774	201.63	5,600,071.62
BROADCOM INC	147,229	157.69	23,216,541.01
ENPHASE ENERGY INC	4,476	111.15	497,507.40
ENTEGRIS INC	5,057	107.69	544,588.33
FIRST SOLAR INC	3,286	225.54	741,124.44
INTEL CORP	142,263	19.92	2,833,878.96
KLA CORP	4,519	793.89	3,587,588.91
LAM RESEARCH CORP	4,381	845.33	3,703,390.73

	LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	4,594	46.61	214,126.34
	MARVELL TECHNOLOGY INC	28,990	63.79	1,849,272.10
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	18,109	78.10	1,414,312.90
	MICRON TECHNOLOGY INC	37,005	100.41	3,715,672.05
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	1,633	862.62	1,408,658.46
	NVIDIA CORP	836,158	118.08	98,733,536.64
	NXP SEMICONDUCTORS NV	8,570	243.64	2,087,994.80
	ON SEMICONDUCTOR CORP	13,930	71.08	990,144.40
	QORVO INC	3,093	108.52	335,652.36
	QUALCOMM INC	37,307	167.15	6,235,865.05
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	5,592	104.88	586,488.96
	TERADYNE INC	4,964	125.25	621,741.00
	TEXAS INSTRUMENTS INC	30,421	195.61	5,950,651.81
	CBRE GROUP INC - A	10,197	110.49	1,126,666.53
	COSTAR GROUP INC	13,981	73.54	1,028,162.74
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	39,300	3.44	135,192.00
	ZILLOW GROUP INC - C	5,696	53.62	305,419.52
	米ドル 小計	12,336,218		1,563,829,545.95 (230,492,836,777)
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	20,120	25.90	521,108.00
	CAMECO CORP	14,002	54.70	765,909.40
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	71,387	49.58	3,539,367.46
	CENOVUS ENERGY INC	47,323	26.46	1,252,166.58
	ENBRIDGE INC	70,782	54.22	3,837,800.04
	IMPERIAL OIL LTD	5,864	104.08	610,325.12
	KEYERA CORP	8,539	39.90	340,706.10
	MEG ENERGY CORP	8,433	27.87	235,027.71
	PARKLAND CORP	4,484	36.09	161,827.56
	PEMBINA PIPELINE CORP	18,703	52.34	978,915.02
	SUNCOR ENERGY INC	42,757	56.46	2,414,060.22
	TC ENERGY CORP	34,427	59.88	2,061,488.76
	TOURMALINE OIL CORP	10,850	62.21	674,978.50
	AGNICO EAGLE MINES LTD	16,752	106.50	1,784,088.00
	BARRICK GOLD CORP	60,964	26.27	1,601,524.28
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	4,976	74.69	371,657.44
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	26,506	15.58	412,963.48
	FRANCO-NEVADA CORP	6,723	160.58	1,079,579.34
	IVANHOE MINES LTD-CL A	20,246	15.41	311,990.86
	KINROSS GOLD CORP	44,186	12.35	545,697.10
	LUNDIN MINING CORP	24,006	12.50	300,075.00
	NUTRIEN LTD	16,657	62.97	1,048,891.29
	PAN AMERICAN SILVER CORP	12,800	26.97	345,216.00
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	15,565	64.23	999,739.95

WEST FRASER TIMBER CO LTD	1,908	116.47	222,224.76
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	15,286	79.05	1,208,358.30
CAE INC	11,870	24.13	286,423.10
STANTEC INC	3,864	111.42	430,526.88
TOROMONT INDUSTRIES LTD	2,701	122.74	331,520.74
WSP GLOBAL INC	4,244	219.51	931,600.44
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	13,972	27.26	380,876.72
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	7,957	55.93	445,035.01
RB GLOBAL INC	6,040	109.84	663,433.60
THOMSON REUTERS CORP	5,516	227.43	1,254,503.88
AIR CANADA	5,799	15.35	89,014.65
CANADIAN NATL RAILWAY CO	18,179	152.41	2,770,661.39
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	31,137	107.05	3,333,215.85
TFI INTERNATIONAL INC	2,670	199.90	533,733.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	8,800	54.15	476,520.00
BRP INC/CA- SUB VOTING	766	91.90	70,395.40
GILDAN ACTIVEWEAR INC	5,096	57.10	290,981.60
RESTAURANT BRANDS INTERN	10,109	96.94	979,966.46
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	1,869	149.17	278,798.73
DOLLARAMA INC	9,456	131.85	1,246,773.60
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	25,684	82.55	2,120,214.20
EMPIRE CO LTD 'A'	3,510	37.24	130,712.40
LOBLAW COMPANIES LTD	5,148	170.93	879,947.64
METRO INC	7,605	82.16	624,826.80
WESTON (GEORGE) LTD	2,192	214.93	471,126.56
SAPUTO INC	6,950	29.89	207,735.50
BANK OF MONTREAL	24,273	114.34	2,775,374.82
BANK OF NOVA SCOTIA	42,024	63.05	2,649,613.20
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	31,035	70.67	2,193,243.45
NATIONAL BANK OF CANADA	11,376	115.26	1,311,197.76
ROYAL BANK OF CANADA	47,034	151.49	7,125,180.66
TORONTO-DOMINION BANK	58,966	79.45	4,684,848.70
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	12,564	55.96	703,081.44
BROOKFIELD CORP	45,036	63.53	2,861,137.08
IGM FINANCIAL INC	1,623	37.83	61,398.09
ONEX CORPORATION	2,236	91.54	204,683.44
TMX GROUP LTD	9,244	42.01	388,340.44
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	689	1,536.43	1,058,600.27
GREAT-WEST LIFECO INC	8,815	42.41	373,844.15
IA FINANCIAL CORP INC	3,354	100.75	337,915.50
INTACT FINANCIAL CORP	6,197	250.66	1,553,340.02
MANULIFE FINANCIAL CORP	59,657	35.48	2,116,630.36
POWER CORP OF CANADA	20,056	38.27	767,543.12

	SUN LIFE FINANCIAL INC	20,251	69.90	1,415,544.90	
	CGI INC	7,077	147.86	1,046,405.22	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	669	4,178.48	2,795,403.12	
	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	2,753	133.86	368,516.58	
	OPEN TEXT CORP	9,889	42.69	422,161.41	
	SHOPIFY INC - CLASS A	40,159	98.22	3,944,416.98	
	BCE INC	1,259	47.00	59,173.00	
	QUEBECOR INC -CL B	4,795	33.38	160,057.10	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	12,824	54.61	700,318.64	
	TELUS CORP	14,385	21.96	315,894.60	
	ALTAGAS LTD	8,271	33.52	277,243.92	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	3,622	38.78	140,461.16	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	4,470	32.76	146,437.20	
	EMERA INC	9,529	49.62	472,828.98	
	FORTIS INC	15,876	59.57	945,733.32	
	HYDRO ONE LTD	11,427	44.40	507,358.80	
	NORTHLAND POWER INC	9,030	23.67	213,740.10	
	FIRSTSERVICE CORP	1,231	234.20	288,300.20	
	カナダドル 小計	1,387,076		92,240,198.15 (9,913,054,095)	
ユーロ	ENI SPA	70,591	14.32	1,011,286.66	
	GALP ENERGIA SGPS SA	15,142	19.06	288,682.23	
	NESTE OYJ	13,121	19.21	252,054.41	
	OMV AG	5,749	38.70	222,486.30	
	REPSOL SA	41,232	12.68	522,821.76	
	TENARIS SA	14,065	12.69	178,555.17	
	TOTALENERGIES SE	71,776	61.46	4,411,352.96	
	AIR LIQUIDE SA	19,240	163.56	3,146,894.40	
	AKZO NOBEL	5,606	53.12	297,790.72	
	ARCELORMITTAL	15,716	19.71	309,840.94	
	ARKEMA	1,842	77.60	142,939.20	
	BASF SE	29,454	41.20	1,213,652.07	
	COVESTRO AG	6,418	53.24	341,694.32	
	DSM-FIRMENICH AG	6,118	116.30	711,523.40	
	EVONIK INDUSTRIES AG	8,376	18.35	153,699.60	
	HEIDELBERG MATERIALS AG	4,756	89.12	423,854.72	
	OCI NV	4,203	26.26	110,370.78	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	20,715	10.85	224,861.32	
	SYENSQO SA	2,552	68.80	175,577.60	
	SYMRISE AG	4,226	111.85	472,678.10	
	UMICORE	5,870	11.04	64,804.80	
	UPM-KYMMENE OYJ	17,448	29.78	519,601.44	
	VOESTALPINE AG	3,524	21.38	75,343.12	

ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	7,860	39.40	309,684.00
AIRBUS SE	19,821	134.66	2,669,095.86
ALSTOM	12,643	17.30	218,723.90
BOUYGUES SA	5,825	31.30	182,322.50
BRENTAG SE	4,188	63.22	264,765.36
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	15,537	74.02	1,150,048.74
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	18,826	33.55	631,612.30
DASSAULT AVIATION SA	743	194.40	144,439.20
EIFFAGE	2,234	90.92	203,115.28
FERROVIAL SE	17,685	36.40	643,734.00
GEA GROUP AG	5,204	40.66	211,594.64
IMCD NV	1,868	138.00	257,784.00
KINGSPAN GROUP PLC	5,471	81.60	446,433.60
KNORR-BREMSE AG	2,028	71.30	144,596.40
KONE OYJ-B	11,155	46.50	518,707.50
LEGRAND SA	8,697	94.64	823,084.08
LEONARDO SPA	12,397	22.52	279,180.44
METSO CORPORATION	20,549	8.94	183,749.15
MTU AERO ENGINES AG	1,811	265.30	480,458.30
PRYSMIAN SPA	8,916	60.64	540,666.24
RATIONAL AG	150	878.00	131,700.00
REXEL SA	6,639	22.02	146,190.78
RHEINMETALL AG	1,481	558.00	826,398.00
SAFRAN SA	11,398	193.90	2,210,072.20
SCHNEIDER ELECTRIC SE	18,170	218.05	3,961,968.50
SIEMENS AG-REG	25,342	159.30	4,036,980.60
SIEMENS ENERGY AG	20,593	24.85	511,736.05
THALES SA	3,097	148.85	460,988.45
VINCI SA	17,221	103.50	1,782,373.50
WARTSILA OYJ ABP	15,946	18.51	295,240.19
BUREAU VERITAS SA	9,548	28.30	270,208.40
RANDSTAD NV	3,070	41.46	127,282.20
TELEPERFORMANCE	1,798	102.50	184,295.00
WOLTERS KLUWER	8,142	151.30	1,231,884.60
ADP	1,006	113.60	114,281.60
AENA SME SA	2,582	174.40	450,300.80
DEUTSCHE GROUP AG	33,448	36.47	1,219,848.56
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	15,976	5.54	88,634.84
GETLINK	10,511	15.99	168,070.89
INPOST SA	7,093	15.51	110,012.43
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	10,910	80.04	873,236.40
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	1,607	74.35	119,480.45
CONTINENTAL AG	3,521	58.52	206,048.92

DR ING HC F PORSCHE AG	3,475	66.46	230,948.50
FERRARI NV	4,169	406.00	1,692,614.00
MERCEDES-BENZ GROUP AG	26,675	58.27	1,554,352.25
MICHELIN(CGDE)	22,013	34.56	760,769.28
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	5,322	39.06	207,877.32
RENAULT SA	6,517	40.33	262,830.61
STELLANTIS NV	76,093	14.09	1,072,606.92
VOLKSWAGEN AG	915	98.55	90,173.25
VOLKSWAGEN AG-PREF	6,956	92.62	644,264.72
ADIDAS AG	5,369	217.20	1,166,146.80
HERMES INTERNATIONAL	1,057	2,077.00	2,195,389.00
KERING	2,497	251.15	627,121.55
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	9,216	644.20	5,936,947.20
MONCLER SPA	7,505	52.96	397,464.80
PUMA SE	2,836	36.72	104,137.92
SEB SA	855	89.25	76,308.75
ACCOR SA	6,007	33.76	202,796.32
AMADEUS IT GROUP SA	15,533	56.90	883,827.70
DELIVERY HERO SE	6,332	21.65	137,087.80
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	3,616	35.64	128,874.24
SODEXO	3,138	87.05	273,162.90
BOLLORE SE	21,133	5.80	122,677.06
CTS EVENTIM AG & CO KGAA	2,251	78.10	175,803.10
PUBLICIS GROUPE	7,795	92.00	717,140.00
SCOUT24 SE	2,465	68.90	169,838.50
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	28,425	22.15	629,613.75
VIVENDI	27,005	9.51	256,925.57
D'IETEREN GROUP	749	209.80	157,140.20
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	37,240	44.90	1,672,076.00
PROSUS NV	46,804	32.44	1,518,555.78
ZALANDO SE	8,035	22.41	180,064.35
CARREFOUR SA	19,160	13.90	266,324.00
JERONIMO MARTINS	7,745	16.28	126,088.60
KESKO OYJ-B SHS	11,103	17.77	197,355.82
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N.V.	32,797	29.82	978,006.54
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	29,773	54.92	1,635,133.16
DANONE	22,168	60.62	1,343,824.16
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	20,931	8.01	167,741.03
HEINEKEN HOLDING NV	4,133	67.85	280,424.05
HEINEKEN NV	9,920	79.76	791,219.20
JDE PEET'S BV	3,184	21.06	67,055.04
KERRY GROUP PLC-A	5,061	88.15	446,127.15
LOTUS BAKERIES	17	10,900.00	185,300.00

PERNOD RICARD SA	7,085	122.25	866,141.25
REMY COINTREAU	644	68.40	44,049.60
BEIERSDORF AG	3,356	124.05	416,311.80
HENKEL AG & CO KGAA	3,714	70.90	263,322.60
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	5,342	78.60	419,881.20
L'OREAL	8,020	380.55	3,052,011.00
AMPLIFON SPA	4,758	28.38	135,032.04
BIOMERIEUX	1,395	97.40	135,873.00
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,217	62.15	75,636.55
DIASORIN ITALIA SPA	614	99.44	61,056.16
ESSILORLUXOTTICA	9,837	210.10	2,066,753.70
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	7,118	34.19	243,364.42
FRESENIUS SE & CO KGAA	14,115	31.67	447,022.05
KONINKLIJKE PHILIPS NV	26,691	25.98	693,432.18
SIEMENS HEALTHINEERS AG	10,037	51.02	512,087.74
ARGENX SE	2,063	477.90	985,907.70
BAYER AG-REG	33,294	25.83	860,150.49
EUROFINS SCIENTIFIC	4,329	53.10	229,869.90
GRIFOLS SA	8,799	8.30	73,066.89
IPSEN	1,125	106.80	120,150.00
MERCK KGAA	4,444	167.25	743,259.00
ORION OYJ-CLASS B	3,219	45.98	148,009.62
QIAGEN N.V.	7,448	41.79	311,251.92
RECORDATI SPA	3,050	49.96	152,378.00
SANOFI	38,084	97.59	3,716,617.56
SARTORIUS AG-VORZUG	784	235.40	184,553.60
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	858	169.80	145,688.40
UCB SA	4,340	150.45	652,953.00
ABN AMRO BANK NV-CVA	13,957	14.82	206,912.52
AIB GROUP PLC	62,782	5.02	315,479.55
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	193,237	8.95	1,731,017.04
BANCO BPM SPA	46,225	5.82	269,121.95
BANCO DE SABADELL SA	181,615	1.79	325,635.69
BANCO SANTANDER SA	524,836	4.10	2,151,827.60
BANK OF IRELAND GROUP PLC	33,526	9.55	320,374.45
BNP PARIBAS	34,487	59.75	2,060,598.25
CAIXABANK S.A	126,792	5.10	647,653.53
COMMERZBANK AG	34,729	12.31	427,513.99
CREDIT AGRICOLE SA	34,942	13.30	464,903.31
ERSTE GROUP BANK AG	11,036	46.81	516,595.16
FINECOBANK SPA	21,498	14.31	307,743.87
ING GROEP NV-CVA	109,566	15.34	1,680,742.44
INTESA SANPAOLO	500,095	3.48	1,744,831.45

KBC GROEP NV	7,953	67.66	538,099.98
MEDIOBANCA SPA	18,448	14.08	259,840.08
NORDEA BANK ABP	108,980	10.38	1,131,212.40
SOCIETE GENERALE SA	23,477	20.56	482,687.12
UNICREDIT SPA	50,165	35.05	1,758,283.25
ADYEN NV	742	1,138.20	844,544.40
AMUNDI SA	1,806	65.30	117,931.80
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	62,246	13.38	832,851.48
DEUTSCHE BOERSE AG	6,574	188.70	1,240,513.80
EDENRED	8,952	37.15	332,566.80
EURAZEO	1,496	68.55	102,550.80
EURONEXT NV	2,827	93.15	263,335.05
EXOR NV	3,322	93.85	311,769.70
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	3,148	66.50	209,342.00
NEXI SPA	14,056	5.86	82,480.60
SOFINA	537	213.00	114,381.00
AEGON LTD	41,408	5.65	234,286.46
AGEAS	4,713	42.84	201,904.92
ALLIANZ SE-REG	13,047	259.00	3,379,173.00
ASR NEDERLAND NV	5,679	44.45	252,431.55
AXA SA	60,497	32.72	1,979,461.84
GENERALI	35,132	22.68	796,793.76
HANNOVER RUECK SE	2,146	236.50	507,529.00
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	4,533	445.20	2,018,091.60
NN GROUP NV	9,463	45.60	431,512.80
POSTE ITALIANE SPA	17,255	12.06	208,095.30
SAMPO OYJ-A SHS	14,397	40.50	583,078.50
TALANX AG	1,722	71.25	122,692.50
BECHTLE AG	2,142	39.30	84,180.60
CAPGEMINI SA	5,373	177.25	952,364.25
DASSAULT SYSTEMES SE	22,538	33.83	762,460.54
NEMETSCHKE SE	2,222	89.05	197,869.10
SAP SE	34,857	192.08	6,695,332.56
NOKIA OYJ	170,176	3.59	612,293.24
CELLNEX TELECOM SA	16,862	34.43	580,558.66
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	108,369	24.95	2,703,806.55
ELISA OYJ	5,726	43.82	250,913.32
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	9,768	10.48	102,368.64
KONINKLIJKE KPN NV	137,168	3.58	492,158.78
ORANGE	63,441	10.27	651,539.07
TELECOM ITALIA SPA	282,105	0.22	63,586.46
TELEFONICA SA	154,967	4.06	629,166.02
ACCIONA SA	678	117.40	79,597.20

	E.ON SE	74,079	12.02	890,799.97
	EDP RENOVAVEIS SA	8,788	14.16	124,438.08
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	107,883	3.71	400,677.46
	ELIA GROUP SA/NV	575	97.05	55,803.75
	ENDESA SA	8,715	18.19	158,569.42
	ENEL SPA	268,921	6.48	1,745,028.36
	ENGIE	63,895	15.40	984,302.47
	FORTUM OYJ	15,597	14.28	222,725.16
	IBERDROLA SA	197,109	12.30	2,424,440.70
	REDEIA CORP SA	13,475	16.75	225,706.25
	RWE AG	22,389	30.45	681,745.05
	SNAM SPA	65,311	4.40	287,825.57
	TERNA SPA	46,145	7.68	354,578.18
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	23,482	28.09	659,609.38
	VERBUND AG	2,530	75.85	191,900.50
	ASM INTERNATIONAL NV	1,592	581.60	925,907.20
	ASML HOLDING NV	13,357	799.30	10,676,250.10
	BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	2,825	116.10	327,982.50
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	45,107	30.37	1,370,125.12
	STMICROELECTRONICS NV	22,955	26.89	617,374.72
	LEG IMMOBILIEN SE	2,717	84.28	228,988.76
	VONOVIA SE	24,078	29.45	709,097.10
	ユーロ 小計	6,082,178		165,219,824.21 (26,808,568,676)
英bond	BP PLC	561,449	4.37	2,453,532.13
	SHELL PLC-NEW	213,969	28.07	6,006,109.83
	ANGLO AMERICAN PLC	43,959	21.98	966,218.82
	ANTOFAGASTA PLC	12,330	18.41	227,056.95
	CRODA INTERNATIONAL PLC	4,351	38.20	166,208.20
	ENDEAVOUR MINING PLC	5,026	15.64	78,606.64
	GLENCORE PLC	344,259	4.03	1,388,052.28
	MONDI PLC	15,540	14.39	223,620.60
	RIO TINTO PLC	37,479	48.53	1,818,855.87
	ASHTED GROUP PLC	14,764	52.28	771,861.92
	BAE SYSTEMS PLC	104,239	13.57	1,415,044.42
	BUNZL PLC	11,946	32.16	384,183.36
	DCC PLC	3,523	51.80	182,491.40
	MELROSE INDUSTRIES PLC	45,224	4.88	221,100.13
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	289,977	4.99	1,447,275.20
	SMITHS GROUP PLC	11,701	17.52	205,001.52
	SPIRAX GROUP PLC	2,317	75.65	175,281.05
	EXPERIAN PLC	30,329	35.86	1,087,597.94
	INTERTEK GROUP PLC	5,038	47.50	239,305.00

RELX PLC	62,397	35.50	2,215,093.50
RENTOKIL INITIAL PLC	79,214	4.71	373,256.36
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	38,179	5.49	209,679.06
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	3,949	53.30	210,481.70
BURBERRY GROUP PLC	10,857	6.66	72,351.04
PERSIMMON PLC	11,935	16.64	198,658.07
TAYLOR WIMPEY PLC	103,006	1.64	169,187.35
COMPASS GROUP PLC	56,752	23.72	1,346,157.44
ENTAIN PLC	22,678	6.07	137,836.88
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	6,049	162.00	979,938.00
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	5,410	73.18	395,903.80
PEARSON PLC	23,364	10.35	241,817.40
WHITBREAD PLC	6,021	28.15	169,491.15
AUTO TRADER GROUP PLC	29,003	8.10	235,098.31
INFORMA PLC	48,718	8.10	394,810.67
WPP PLC	40,526	6.89	279,224.14
JD SPORTS FASHION PLC	67,369	1.22	82,830.18
KINGFISHER PLC	68,494	2.74	188,290.00
NEXT PLC	3,771	97.26	366,767.46
SAINSBURY (J) PLC	52,374	2.79	146,123.46
TESCO PLC	233,111	3.40	793,976.06
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	10,301	24.74	254,846.74
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	66,692	28.10	1,874,045.20
COCA-COLA HBC AG-DI	6,682	27.34	182,685.88
DIAGEO PLC	73,919	24.70	1,825,799.30
IMPERIAL BRANDS PLC	26,489	21.67	574,016.63
HALEON PLC	230,429	3.73	861,343.60
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	23,268	42.31	984,469.08
UNILEVER PLC	83,558	47.47	3,966,498.26
NMC HEALTH PLC	438	0.00	0.00
SMITH & NEPHEW PLC	29,875	11.57	345,653.75
ASTRAZENECA PLC	51,843	129.02	6,688,783.86
GSK PLC	138,571	15.97	2,213,671.72
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	4,453	20.88	92,978.64
BARCLAYS PLC	518,175	2.21	1,148,275.80
HSBC HOLDINGS PLC	630,800	6.49	4,098,938.40
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,142,712	0.57	1,228,202.51
NATWEST GROUP PLC	218,277	3.40	742,796.63
STANDARD CHARTERED PLC	76,819	7.33	563,544.18
3I GROUP PLC	33,621	30.97	1,041,242.37
HARGREAVES LANSDOWN PLC	11,463	10.97	125,749.11
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	15,106	99.92	1,509,391.52
M&G PLC	69,124	2.07	143,086.68

	SCHRODERS PLC	19,357	3.42	66,355.79
	WISE PLC - A	21,920	6.93	152,015.20
	ADMIRAL GROUP PLC	7,821	28.10	219,770.10
	AVIVA PLC	90,868	4.91	446,888.82
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	204,178	2.28	465,525.84
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	25,534	5.55	141,841.37
	PRUDENTIAL PLC	93,241	6.43	600,285.55
	SAGE GROUP PLC/THE	32,543	10.19	331,775.88
	HALMA PLC	12,443	25.22	313,812.46
	BT GROUP PLC	224,472	1.46	329,188.18
	VODAFONE GROUP PLC	736,741	0.74	549,166.74
	CENTRICA PLC	201,361	1.26	255,627.78
	NATIONAL GRID PLC	159,922	9.88	1,581,308.73
	SEVERN TRENT PLC	8,461	25.87	218,886.07
	SSE PLC	35,650	19.02	678,063.00
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	22,508	10.14	228,343.66
	英ポンド 小計	9,090,232		65,709,250.32 (12,422,990,865)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	4,450	12.37	55,046.50
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	185	693.50	128,297.50
	GIVAUDAN-REG	306	4,160.00	1,272,960.00
	HOLCIM LTD	17,273	76.86	1,327,602.78
	SIG GROUP AG	8,857	17.42	154,288.94
	SIKA AG-REG	5,260	251.50	1,322,890.00
	ABB LTD-REG	53,310	46.47	2,477,315.70
	GEBERIT AG-REG	1,074	528.20	567,286.80
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	857	224.50	192,396.50
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,403	229.40	321,848.20
	VAT GROUP AG	922	415.10	382,722.20
	ADECCO SA-REG	5,933	28.08	166,598.64
	SGS SA-REG	5,068	92.84	470,513.12
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	1,749	256.90	449,318.10
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	17,924	129.70	2,324,742.80
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	867	183.65	159,224.55
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	959	36.40	34,907.60
	AVOLTA AG	3,059	31.78	97,215.02
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	135	1,394.00	188,190.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	40	11,040.00	441,600.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	3	108,600.00	325,800.00
	NESTLE SA-REG	89,133	89.30	7,959,576.90
	ALCON INC	17,243	80.64	1,390,475.52
	SONOVA HOLDING AG-REG	1,801	287.90	518,507.90
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	3,695	125.75	464,646.25

	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,210	80.10	96,921.00	
	LONZA GROUP AG-REG	2,519	550.40	1,386,457.60	
	NOVARTIS AG-REG	65,906	98.28	6,477,241.68	
	ROCHE HOLDING AG-BR	1,103	301.40	332,444.20	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	23,493	281.00	6,601,533.00	
	SANDOZ GROUP AG	14,245	37.53	534,614.85	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	737	92.90	68,467.30	
	JULIUS BAER GROUP LTD	7,479	49.20	367,966.80	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	743	1,160.50	862,251.50	
	UBS GROUP AG-REG	109,597	26.45	2,898,840.65	
	BALOISE HOLDING AG - REG	1,565	159.10	248,991.50	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	1,070	130.50	139,635.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	947	662.60	627,482.20	
	SWISS RE AG	10,122	106.10	1,073,944.20	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	4,874	473.90	2,309,788.60	
	TEMENOS GROUP AG-REG	2,516	57.20	143,915.20	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	5,187	76.14	394,938.18	
	SWISSCOM AG-REG	867	532.50	461,677.50	
	BKW AG	522	159.30	83,154.60	
	SWISS PRIME SITE-REG	2,725	90.90	247,702.50	
	スイスフラン 小計	498,933		48,551,939.58 (8,267,909,791)	
スウェーデンク ローナ	BOLIDEN AB	8,974	298.90	2,682,328.60	
	HOLMEN AB-B SHARES	2,814	399.60	1,124,474.40	
	SVENSKA CELLULOZA AB SCA-B	21,016	136.75	2,873,938.00	
	ALFA LAVAL AB	9,234	451.10	4,165,457.40	
	ASSA ABLOY AB-B	34,931	310.90	10,860,047.90	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	88,779	181.30	16,095,632.70	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	54,616	159.60	8,716,713.60	
	BEIJER REF AB	11,114	169.20	1,880,488.80	
	EPIROC AB-A	23,015	191.75	4,413,126.25	
	EPIROC AB-B	13,454	175.40	2,359,831.60	
	HUSQVARNA AB-B SHS	8,099	69.74	564,824.26	
	INDUTRADE AB	9,460	307.80	2,911,788.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	4,803	302.40	1,452,427.20	
	LIFCO AB-B SHS	8,063	307.60	2,480,178.80	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	59,070	46.90	2,770,383.00	
	SAAB AB-B	9,712	254.90	2,475,588.80	
	SANDVIK AB	34,332	205.20	7,044,926.40	
	SKANSKA AB-B SHS	10,230	200.30	2,049,069.00	
	SKF AB-B SHARES	11,976	188.30	2,255,080.80	
	TRELLEBORG AB-B SHS	7,726	381.40	2,946,696.40	
VOLVO AB-A SHS	5,298	263.00	1,393,374.00		

	VOLVO AB-B SHS	52,570	259.40	13,636,658.00
	SECURITAS AB-B SHS	17,598	113.40	1,995,613.20
	VOLVO CAR AB-B	26,268	28.46	747,718.62
	EVOLUTION AB	5,973	1,009.50	6,029,743.50
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	18,019	157.85	2,844,299.15
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	20,138	297.10	5,982,999.80
	GETINGE AB-B SHS	6,313	201.90	1,274,594.70
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	5,811	292.60	1,700,298.60
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	51,222	152.00	7,785,744.00
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	48,591	103.30	5,019,450.30
	SWEDBANK AB - A SHARES	29,455	209.40	6,167,877.00
	EQT AB	12,244	318.10	3,894,816.40
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	3,567	352.60	1,257,724.20
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	5,333	350.50	1,869,216.50
	INVESTOR AB-B SHS	57,173	289.75	16,565,876.75
	LUNDBERGS AB-B SHS	2,715	535.00	1,452,525.00
	ERICSSON LM-B SHS	98,381	71.80	7,063,755.80
	HEXAGON AB-B SHS	73,003	101.85	7,435,355.55
	TELE2 AB-B SHS	19,254	111.60	2,148,746.40
	TELIA CO AB	75,050	31.33	2,351,316.50
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	26,386	80.60	2,126,711.60
	SAGAX AB-B	7,884	267.80	2,111,335.20
	スウェーデンクローナ 小計	1,099,664		184,978,752.68 (2,602,651,050)
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	10,706	258.70	2,769,642.20
	EQUINOR ASA	29,155	296.10	8,632,795.50
	NORSK HYDRO ASA	38,598	57.40	2,215,525.20
	YARA INTERNATIONAL ASA	4,955	300.00	1,486,500.00
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	3,139	1,101.00	3,456,039.00
	MOWI ASA	15,441	190.70	2,944,598.70
	ORKLA ASA	27,337	90.55	2,475,365.35
	SALMAR ASA	2,244	641.00	1,438,404.00
	DNB BANK ASA	30,325	220.80	6,695,760.00
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	4,317	183.80	793,464.60
	TELENOR ASA	22,889	128.50	2,941,236.50
	ノルウェークローネ 小計	189,106		35,849,331.05 (492,569,808)
デンマークク ローネ	NOVONESIS (NOVOZYMES) B	12,948	431.00	5,580,588.00
	ROCKWOOL A/S-B SHS	229	2,754.00	630,666.00
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	35,073	155.05	5,438,068.65
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	78	10,370.00	808,860.00
	AP MOELLER-MAERSK A/S-B	146	10,555.00	1,541,030.00
	DSV A/S	5,921	1,255.00	7,430,855.00

	PANDORA A/S	2,949	1,060.50	3,127,414.50
	CARLSBERG AS-B	3,089	772.00	2,384,708.00
	COLOPLAST-B	4,239	920.00	3,899,880.00
	DEMANT A/S	3,200	266.00	851,200.00
	GENMAB A/S	2,282	1,819.00	4,150,958.00
	NOVO NORDISK A/S-B	108,994	910.00	99,184,540.00
	DANSKE BANK A/S	23,974	200.50	4,806,787.00
	TRYG A/S	10,100	149.50	1,509,950.00
	ORSTED A/S	6,672	422.50	2,818,920.00
	デンマーククローネ 小計	219,894		144,164,425.15 (3,135,576,247)
オーストラリア ドル	AMPOL LTD	8,618	31.97	275,517.46
	SANTOS LTD	106,200	7.74	821,988.00
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	64,516	25.49	1,644,512.84
	BHP GROUP LTD	168,915	39.62	6,692,412.30
	BLUESCOPE STEEL LTD	13,389	19.84	265,637.76
	FORTESCUE LTD	55,384	17.32	959,250.88
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	14,477	48.84	707,056.68
	MINERAL RESOURCES LTD	6,106	46.33	282,890.98
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	42,742	14.24	608,646.08
	ORICA LTD	13,470	17.86	240,574.20
	PILBARA MINERALS LTD	103,409	2.85	294,715.65
	RIO TINTO LTD	12,437	112.43	1,398,291.91
	SOUTH32 LTD	161,229	2.91	469,176.39
	REECE LTD	8,459	26.10	220,779.90
	SEVEN GROUP HOLDINGS LTD	5,023	39.19	196,851.37
	BRAMBLES LTD	43,789	15.25	667,782.25
	COMPUTERSHARE LTD	19,864	26.90	534,341.60
	AURIZON HOLDINGS LTD	67,306	3.37	226,821.22
	QANTAS AIRWAYS LTD	17,415	6.01	104,664.15
	TRANSURBAN GROUP	103,541	13.23	1,369,847.43
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	18,909	53.57	1,012,955.13
	LOTTERY CORP LTD/THE	76,196	4.89	372,598.44
	CAR GROUP LTD	13,430	35.63	478,510.90
	REA GROUP LTD	1,458	209.93	306,077.94
	SEEK LTD	13,555	20.36	275,979.80
	WESFARMERS LTD	38,128	73.41	2,798,976.48
	COLES GROUP LTD	45,292	18.27	827,484.84
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	57,174	5.46	312,170.04
	WOOLWORTHS GROUP LTD	41,290	34.08	1,407,163.20
	TREASURY WINE ESTATES LTD	28,990	12.11	351,068.90
COCHLEAR LTD	2,166	337.75	731,566.50	
PRO MEDICUS LTD	1,973	141.00	278,193.00	

	RAMSAY HEALTH CARE LTD	5,971	45.41	271,143.11
	SONIC HEALTHCARE LTD	15,545	27.73	431,062.85
	CSL LTD	16,131	300.77	4,851,720.87
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	103,232	28.73	2,965,855.36
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	55,855	134.21	7,496,299.55
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	103,314	35.79	3,697,608.06
	WESTPAC BANKING CORP	115,563	28.85	3,333,992.55
	ASX LTD	5,710	63.45	362,299.50
	MACQUARIE GROUP LTD	12,041	205.80	2,478,037.80
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	6,799	34.55	234,905.45
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	82,293	7.25	596,624.25
	MEDIBANK PRIVATE LTD	87,487	3.92	342,949.04
	QBE INSURANCE GROUP LTD	51,243	16.18	829,111.74
	SUNCORP GROUP LTD	42,555	16.95	721,307.25
	WISETECH GLOBAL LTD	5,751	93.58	538,178.58
	XERO LTD	5,015	135.36	678,830.40
	TELSTRA GROUP LTD	119,036	3.87	460,669.32
	APA GROUP	37,178	7.91	294,077.98
	ORIGIN ENERGY LTD	54,979	10.60	582,777.40
	オーストラリアドル 小計	2,300,548		58,301,955.28 (5,666,950,053)
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	51,033	7.58	386,830.14
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	20,290	32.50	659,425.00
	SPARK NEW ZEALAND LTD	69,660	4.40	306,504.00
	MERCURY NZ LTD	21,009	6.80	142,861.20
	MERIDIAN ENERGY LTD	38,959	6.69	260,635.71
	ニュージーランドドル 小計	200,951		1,756,256.05 (155,182,784)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	82,500	41.30	3,407,250.00
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	44,500	97.55	4,340,975.00
	MTR CORP	44,500	26.25	1,168,125.00
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	55,000	16.82	925,100.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	74,000	29.25	2,164,500.00
	SANDS CHINA LTD	70,200	14.04	985,608.00
	WH GROUP LTD	310,000	5.69	1,763,900.00
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	118,500	22.30	2,642,550.00
	HANG SENG BANK LTD	27,400	89.80	2,460,520.00
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	41,000	228.20	9,356,200.00
	AIA GROUP LTD	374,400	51.75	19,375,200.00
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	135,000	9.69	1,308,150.00
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD (CKI)	21,400	56.35	1,205,890.00
	CLP HOLDINGS LTD	59,000	70.30	4,147,700.00
HONG KONG & CHINA GAS	395,717	6.60	2,611,732.20	

	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	53,000	54.95	2,912,350.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	56,500	31.40	1,774,100.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	52,916	22.10	1,169,443.60	
	SINO LAND CO	106,000	8.32	881,920.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	49,700	71.80	3,568,460.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	13,700	65.50	897,350.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	21,400	14.18	303,452.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	32,000	20.30	649,600.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	61,000	21.20	1,293,200.00	
	香港ドル 小計	2,299,333		71,313,275.80 (1,348,534,045)	
シンガポールドル	KEPPEL LTD	47,000	5.80	272,600.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	54,300	4.37	237,291.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	50,000	6.00	300,000.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	178,600	0.81	145,559.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	68,500	3.09	211,665.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	66,440	34.61	2,299,488.40	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	113,100	13.95	1,577,745.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	41,400	29.63	1,226,682.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	34,700	10.10	350,470.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	273,700	2.91	796,467.00	
	SEMCORP INDUSTRIES LTD	25,700	4.60	118,220.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	82,600	2.49	205,674.00	
	シンガポールドル 小計	1,036,040		7,741,861.40 (866,623,965)	
イスラエルシュケル	ICL GROUP LTD	24,131	15.40	371,617.40	
	ELBIT SYSTEMS LTD	724	738.00	534,312.00	
	BANK HAPOLIM BM	41,495	35.69	1,480,956.55	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	46,011	33.60	1,545,969.60	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	46,706	20.00	934,120.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	4,617	139.60	644,533.20	
	NICE SYSTEMS LTD	2,166	614.20	1,330,357.20	
	AZRIELI GROUP	1,495	241.50	361,042.50	
	イスラエルシュケル 小計	167,345		7,202,908.45 (286,325,694)	
	合 計	36,907,518		302,459,773,850 (302,459,773,850)	

(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	
			497.00	0.00	

		カナダドル 小計	(0)
		新株予約権証券合計	0 (0)
投資証券	米ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	5,471 619,536.04
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	11,425 437,577.50
		AMERICAN TOWER CORP	15,519 3,463,530.42
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	15,217 302,513.96
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	4,821 1,029,379.92
		BXP INC	5,051 346,145.03
		CAMDEN PROPERTY TRUST	3,585 429,554.70
		CROWN CASTLE INC	14,910 1,643,231.10
		DIGITAL REALTY TRUST INC	10,316 1,559,572.88
		EQUINIX INC	3,147 2,648,169.03
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	6,492 463,853.40
		EQUITY RESIDENTIAL	11,811 840,825.09
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,201 629,838.16
		EXTRA SPACE STORAGE INC	7,163 1,193,928.84
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	8,995 445,972.10
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	23,802 518,645.58
		HOST HOTELS & RESORTS INC	23,417 378,418.72
		INVITATION HOMES INC	19,953 700,749.36
		IRON MOUNTAIN INC	9,499 1,032,446.31
		KIMCO REALTY CORP	22,653 498,819.06
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	3,641 558,274.53
		PROLOGIS INC	30,767 3,797,263.14
		PUBLIC STORAGE	5,422 1,739,811.36
		REALTY INCOME CORP	28,444 1,711,191.04
		REGENCY CENTERS CORP	5,891 413,901.66
		SBA COMMUNICATIONS CORP	3,664 798,275.68
		SIMON PROPERTY GROUP INC	10,760 1,687,383.20
		SUN COMMUNITIES INC	3,829 505,045.10
		UDR INC	9,841 411,156.98
		VENTAS INC	13,756 805,001.12
		VICI PROPERTIES INC	35,366 1,117,919.26
		WELLTOWER INC	18,833 2,213,065.83
		WEYERHAEUSER CO	24,863 746,387.26
		WP CAREY INC	7,385 420,058.80
		米ドル 小計	427,910 36,107,442.16 (5,321,875,899)
	カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	1,821 89,775.30
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	2,998 52,614.90
		カナダドル 小計	4,819 142,390.20 (15,302,674)

ユーロ	COVIVIO	968	47,373.92
	GECINA SA	1,560	148,200.00
	KLEPIERRE	7,298	194,126.80
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	3,947	266,343.56
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	6,343	157,686.98
ユーロ 小計		20,116	813,731.26 (132,036,034)
英ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	22,154	140,013.28
	SEGRO PLC	45,179	408,327.80
英ポンド 小計		67,333	548,341.08 (103,669,364)
オーストラリアドル	DEXUS/AU	33,935	246,707.45
	GOODMAN GROUP	59,010	2,074,791.60
	GPT GROUP	65,528	300,773.52
	MIRVAC GROUP	148,939	291,920.44
	SCENTRE GROUP	174,680	599,152.40
	STOCKLAND	75,930	340,925.70
	VICINITY CENTRES	146,054	309,634.48
オーストラリアドル 小計		704,076	4,163,905.59 (404,731,623)
香港ドル	LINK REIT	96,600	3,381,000.00
香港ドル 小計		96,600	3,381,000.00 (63,934,710)
シンガポールドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	117,200	315,268.00
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	170,063	362,234.19
シンガポールドル 小計		287,263	677,502.19 (75,839,595)
投資証券合計			6,117,389,899 (6,117,389,899)
合計			6,117,389,899 (6,117,389,899)

(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 580銘柄	97.7%			74.8%
	投資証券 34銘柄			2.3%	1.7%
カナダドル	株式 85銘柄	99.8%			3.2%
	新株予約権 証券 1銘柄				
	投資証券 2銘柄			0.2%	0.0%
ユーロ	株式 217銘柄	99.5%			8.8%

	投資証券	5銘柄			0.5%	0.0%
英ポンド	株式	78銘柄	99.2%			4.0%
	投資証券	2銘柄			0.8%	0.0%
スイスフラン	株式	45銘柄	100.0%			2.7%
スウェーデンクローナ	株式	43銘柄	100.0%			0.8%
ノルウェークローネ	株式	11銘柄	100.0%			0.2%
デンマーククローネ	株式	15銘柄	100.0%			1.0%
オーストラリアドル	株式	51銘柄	93.3%			1.8%
	投資証券	7銘柄			6.7%	0.1%
ニュージーランドドル	株式	5銘柄	100.0%			0.1%
香港ドル	株式	24銘柄	95.5%			0.4%
	投資証券	1銘柄			4.5%	0.0%
シンガポールドル	株式	12銘柄	92.0%			0.3%
	投資証券	2銘柄			8.0%	0.0%
イスラエルシェケル	株式	8銘柄	100.0%			0.1%

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

R M新興国株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2024年 8月15日現在

資産の部	
流動資産	
預金	619,298,303
コール・ローン	60,593,949
株式	34,742,071,116
投資証券	34,552,467
派生商品評価勘定	16,663,681
未収入金	258,877,919
未収配当金	103,380,550
未収利息	182
差入委託証拠金	501,633,045
流動資産合計	36,337,071,212
資産合計	36,337,071,212
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,933,681
未払解約金	1,412,500
流動負債合計	5,346,181
負債合計	5,346,181
純資産の部	
元本等	
元本	18,401,994,564
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	17,929,730,467
元本等合計	36,331,725,031

2024年 8月15日現在

純資産合計	36,331,725,031
負債純資産合計	36,337,071,212

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 8月15日現在

1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 9月25日
期首元本額	16,095,826,309円
期中追加設定元本額	5,533,329,866円
期中一部解約元本額	3,227,161,611円
期末元本額	18,401,994,564円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	482,522,031円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	2,013,464,609円
りそなラップ型ファンド(成長型)	2,981,113,466円
DCりそな グローバルバランス	16,120,696円
つみたてバランスファンド	1,367,194,756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	425,684,536円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	300,166,525円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	162,036,967円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	112,480,561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	159,281,926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	61,281,142円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定型)	6,289,202円
ラップ型ファンド・プラスESG(安定成長型)	184,094,411円
ラップ型ファンド・プラスESG(成長型)	354,977,266円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定型)	34,376,866円
りそな つみたてラップ型ファンド(安定成長型)	92,432,310円
りそな つみたてラップ型ファンド(成長型)	107,762,767円
りそな つみたてリスクコントロールファンド	2,114,802円
ターゲットリターンバランスファンド(目標2%)	1,255,819円
ターゲットリターンバランスファンド(目標3%)	1,424,997円
ターゲットリターンバランスファンド(目標4%)	7,738,899円
ターゲットリターンバランスファンド(目標5%)	4,181,288円

ターゲットリターンバランスファンド(目標6%)	9,820,998円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2065	1,561,909円
りそな新興国株式インデックス	10,090,195円
FWりそな先進国+新興国株式アクティブファンド	92,522,727円
FWりそな新興国株式インデックスファンド	3,469,360,871円
Smart-i 新興国株式インデックス	3,494,472,589円
Smart-i 8資産バランス 安定型	129,874,130円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	483,666,528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	266,557,677円
Smart-i Select 全世界株式インデックス(除く日本)	86,297,218円
Smart-i DC 全世界株式インデックス	54,542,095円
Smart-i DC 全世界株式インデックス(除く日本)	549,794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)	1,043,790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)	8,550,204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)	87,922,639円
2. 計算日における受益権の総数	18,401,994,564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	1.9743円
(10,000口当たり純資産額)	(19,743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 8月15日現在

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

金融商品の時価等に関する事項

2024年 8月15日現在

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

(関連当事者との取引に関する注記)

2024年 8月15日現在

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2024年 8月15日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式	3,299,122,228	
投資証券	5,034,363	
合計	3,294,087,865	

(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 8月15日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	うち1年超		時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 買建	1,553,797,170	-		1,565,902,311	12,105,141
	合計	1,553,797,170	-		1,565,902,311	12,105,141

(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 8月15日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	うち1年超		時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	338,366,261	-		339,000,532	634,271
	米ドル	338,366,261	-		339,000,532	634,271
	売建	2,422,961	-		2,432,373	9,412
	ブラジルリアル	415,394	-		414,639	755
	韓国ウォン	1,757,341	-		1,767,086	9,745
	オフショア人民元	250,226	-		250,648	422
	合計	340,789,222	-		341,432,905	624,859

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	31,900	1.79	57,356.20	
	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	4,996	14.52	72,541.92	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	11,117	0.00	0.00	
	NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR	2,773	0.00	0.00	
	PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	2,330	0.00	0.00	
	PHOSAGRO PJSC(BLOCKED)-GDR	15	0.00	0.00	
	POLYUS PJSC-REG S-GDR	1,288	0.00	0.00	
	SEVERSTAL - GDR REG S	3,862	0.00	0.00	
	SOLIDCORE RESOURCES PLC	5,948	0.00	0.00	
	SOUTHERN COPPER CORP	2,730	101.47	277,013.10	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	13,411	19.47	261,112.17	
	NIO INC - ADR	43,205	3.72	160,722.60	
	H WORLD GROUP LTD	6,391	28.20	180,226.20	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	14,022	8.93	125,216.46	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	12,372	33.20	410,750.40	
	AUTOHOME INC-ADR	2,118	22.43	47,506.74	
	IQIYI INC-ADR	15,423	3.13	48,273.99	
	KANZHUN LTD	8,346	13.64	113,839.44	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	23,615	11.13	262,834.95	
	VK CO LTD	2,211	0.00	0.00	
	PDD HOLDINGS INC	18,823	141.98	2,672,489.54	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	11,890	13.30	158,137.00	
	X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	2,296	0.00	0.00	
	LEGEND BIOTECH CORP-ADR	2,240	54.68	122,483.20	
	COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	98,520	1.59	157,237.92	
	CREDICORP LTD	2,141	165.99	355,384.59	
	TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	2,188	0.00	0.00	
QIFU TECHNOLOGY INC	3,969	23.70	94,065.30		
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	24,726	1.58	39,190.71		
KE HOLDINGS INC	20,820	14.95	311,259.00		
	米ドル 小計	415,145		5,927,641.43 (873,675,070)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-CPO	456,600	12.00	5,479,200.00	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	98,500	105.13	10,355,305.00	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	6,450	252.05	1,625,722.50	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	27,700	21.74	602,198.00	
	ALFA S.A.B. -A	108,000	11.08	1,196,640.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	17,700	117.62	2,081,874.00	

	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	11,960	303.90	3,634,644.00
	GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	5,830	526.20	3,067,746.00
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL CENT	8,600	155.18	1,334,548.00
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	5,980	180.77	1,081,004.60
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	165,300	62.76	10,374,228.00
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	16,100	188.11	3,028,571.00
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	16,850	168.31	2,836,023.50
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	61,100	212.12	12,960,532.00
	GRUMA S.A.B. -B	6,105	378.38	2,310,009.90
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	42,500	70.20	2,983,500.00
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	45,900	34.70	1,592,730.00
	BANCO DEL BAJIO SA	22,200	52.58	1,167,276.00
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	81,900	141.50	11,588,850.00
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	59,100	46.10	2,724,510.00
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	588,900	16.12	9,493,068.00
	メキシコペソ 小計	1,853,275		91,518,180.50 (717,063,247)
ブラジルリアル	COSAN SA	38,400	13.51	518,784.00
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	117,500	40.98	4,815,150.00
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	150,300	37.76	5,675,328.00
	PRIO SA	24,800	49.60	1,230,080.00
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	22,900	23.60	540,440.00
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	19,200	11.70	224,640.00
	GERDAU SA-PREF	45,234	17.40	787,071.60
	KLABIN SA - UNIT	24,530	20.88	512,186.40
	SUZANO SA	24,507	54.70	1,340,532.90
	VALE SA	107,404	56.00	6,014,624.00
	WEG SA	53,200	51.54	2,741,928.00
	CCR SA	32,300	13.52	436,696.00
	LOCALIZA RENT A CAR	29,610	40.00	1,184,400.00
	RUMO SA	42,300	23.38	988,974.00
	LOJAS RENNER S.A.	30,720	16.19	497,356.80
	VIBRA ENERGIA SA	29,900	25.24	754,676.00
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	19,100	9.77	186,607.00
	RAIA DROGASIL SA	41,476	30.00	1,244,280.00
	SENDAS DISTRIBUIDORA SA	41,700	10.67	444,939.00
	AMBEV SA	144,700	12.56	1,817,432.00
	BRF SA	19,900	23.51	467,849.00
	JBS SA	24,800	37.34	926,032.00
	NATURA &CO HOLDING SA	28,800	14.75	424,800.00
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	150,892	4.41	665,433.72
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	18,600	30.73	571,578.00
	HYPERA SA	11,400	31.65	360,810.00

	BANCO BRADESCO S.A.	51,115	13.39	684,429.85	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	167,936	15.01	2,520,719.36	
	BANCO DO BRASIL S.A.	52,400	27.93	1,463,532.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	152,800	36.47	5,572,616.00	
	ITAUSA SA	171,628	10.86	1,863,880.08	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	180,100	12.70	2,287,270.00	
	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	36,400	35.00	1,274,000.00	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	22,000	37.45	823,900.00	
	CAIXA SEGURIDADE PARTICIPACO	19,000	14.41	273,790.00	
	TOTVS SA	16,400	29.66	486,424.00	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	13,000	51.62	671,060.00	
	TIM SA	28,500	18.10	515,850.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	7,100	44.64	316,944.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	38,900	40.15	1,561,835.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	57,374	11.97	686,766.78	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	14,000	99.46	1,392,440.00	
	COMPANHIA PARANAENSE DE ENER	35,200	10.53	370,656.00	
	CPFL ENERGIA SA	7,200	33.77	243,144.00	
	ENERGISA SA-UNITS	6,900	48.32	333,408.00	
	ENEVA SA	12,700	13.47	171,069.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	6,275	46.32	290,658.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	33,800	35.46	1,198,548.00	
	ブラジルリアル 小計	2,424,901		60,375,568.49 (1,624,634,097)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	12,153	6,175.00	75,044,775.00	
	EMPRESAS CMPC SA	33,869	1,579.00	53,479,151.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	4,419	33,889.00	149,755,491.00	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES	466,759	59.30	27,678,808.70	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	5,527,400	11.20	61,906,880.00	
	FALABELLA SA	29,867	3,200.00	95,574,400.00	
	CENCOSUD SA	35,890	1,795.00	64,422,550.00	
	BANCO DE CHILE	1,384,067	114.49	158,461,830.83	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	2,535	28,750.00	72,881,250.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	2,146,867	46.79	100,451,906.93	
	ENEL AMERICAS SA	721,398	94.99	68,525,596.02	
	ENEL CHILE SA	827,632	51.00	42,209,232.00	
	チリペソ 小計	11,192,856		970,391,871.48 (153,046,324)	
コロンビアペソ	BANCOLOMBIA SA	7,429	36,200.00	268,929,800.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	13,694	34,100.00	466,965,400.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	15,693	18,380.00	288,437,340.00	
	コロンビアペソ 小計	36,816		1,024,332,540.00 (37,537,690)	

ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	1,871	21.28	39,814.88	
	METLEN ENERGY & METALS SA	3,508	34.12	119,692.96	
	OPAP SA	5,739	15.97	91,651.83	
	JUMBO SA	3,787	23.46	88,843.02	
	ALPHA SERVICES AND HOLDINGS	65,690	1.59	104,972.62	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	80,797	2.04	164,825.88	
	NATIONAL BANK OF GREECE	24,924	7.92	197,497.77	
	PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS S	33,092	3.93	130,183.92	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	6,206	14.66	90,979.96	
	PUBLIC POWER CORP	6,514	11.63	75,757.82	
	ユーロ 小計		232,128		1,104,220.66 (179,170,844)
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	31,268	159.00	4,971,612.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	43,208	49.24	2,127,561.92	
	SASA POLYESTER SANAYI	347,344	5.11	1,774,927.84	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	45,551	57.55	2,621,460.05	
	KOC HOLDING AS	24,481	182.50	4,467,782.50	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	42,569	42.36	1,803,222.84	
	PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS	7,907	228.00	1,802,796.00	
	TURK HAVA YOLLARI AO	16,774	291.75	4,893,814.50	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	2,149	880.00	1,891,120.00	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	4,511	242.10	1,092,113.10	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	14,326	568.00	8,137,168.00	
	COCA-COLA ICECEK AS	27,115	67.75	1,837,041.25	
	AKBANK T.A.S.	95,565	56.20	5,370,753.00	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	34,570	91.35	3,157,969.50	
	TURKIYE IS BANKASI-C	259,296	13.04	3,381,219.84	
	YAPI VE KREDI BANKASI	104,229	27.96	2,914,242.84	
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	37,556	103.50	3,887,046.00		
トルコリラ 小計		1,138,419		56,131,851.18 (246,340,242)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	2,474	760.50	1,881,477.00	
	MONETA MONEY BANK AS	9,667	104.20	1,007,301.40	
	CEZ AS	4,830	890.00	4,298,700.00	
チェココルナ 小計		16,971		7,187,478.40 (46,386,548)	
ハンガリーフォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	13,379	2,724.00	36,444,396.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	4,614	10,400.00	47,985,600.00	
	OTP BANK PLC	6,963	17,695.00	123,210,285.00	
ハンガリーフォリント 小計		24,956		207,640,281.00 (85,245,886)	
ポーランドズロチ	ORLEN SA	17,899	62.98	1,127,279.02	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	4,424	125.30	554,327.20	

	BUDIMEX	397	590.50	234,428.50
	LPP SA	35	14,270.00	499,450.00
	CD PROJEKT SA	2,083	174.30	363,066.90
	ALLEGRO.EU SA	17,580	38.20	671,556.00
	DINO POLSKA SA	1,567	342.80	537,167.60
	BANK PEKAO SA	5,839	153.60	896,870.40
	MBANK SA	464	601.40	279,049.60
	PKO BANK POLSKI SA	27,580	54.70	1,508,626.00
	SANTANDER BANK POLSKA SA	1,142	495.50	565,861.00
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	19,309	47.28	912,929.52
	PGE SA	29,021	6.73	195,369.37
	ポーランドズロチ 小計	127,340		8,345,981.11 (315,580,741)
ロシアルーブル	GAZPROM PJSC	209,472	0.00	0.00
	LUKOIL PJSC	7,345	0.00	0.00
	ROSNEFT OIL CO PJSC	20,180	0.00	0.00
	SURGUTNEFTEGAS-PREFERENCE	131,600	0.00	0.00
	ALROSA PJSC	46,260	0.00	0.00
	UNITED CO RUSAL INTERNATIONA	55,000	0.00	0.00
	YANDEX NV-A	5,354	0.00	0.00
	OZON HOLDINGS PLC - ADR	920	0.00	0.00
	MAGNIT PJSC	1,334	0.00	0.00
	SBERBANK OF RUSSIA PJSC	190,680	0.00	0.00
	VTB BANK PJSC	13,147	0.00	0.00
	MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ	22,980	0.00	0.00
	MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JO	16,768	0.00	0.00
	INTER RAO UES PJSC	725,000	0.00	0.00
	ロシアルーブル 小計	1,446,040		0.00 (0)
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO-H	64,000	8.49	543,360.00
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	58,000	6.75	391,500.00
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	768,000	4.99	3,832,320.00
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	106,500	32.50	3,461,250.00
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	38,000	8.50	323,000.00
	PETROCHINA CO LTD-H	664,000	6.72	4,462,080.00
	YANKUANG ENERGY GROUP CO-H	103,500	9.93	1,027,755.00
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	124,000	4.25	527,000.00
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	39,000	17.78	693,420.00
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	91,000	9.85	896,350.00
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	152,000	2.38	361,760.00
	CMOC GROUP LTD-H	117,000	6.03	705,510.00
	GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD-H	11,440	16.74	191,505.60
	JIANGXI COPPER CO LTD-H	34,000	13.28	451,520.00

MMG LTD	140,000	2.20	308,000.00
SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	20,500	16.00	328,000.00
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	49,000	13.16	644,840.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	172,000	15.36	2,641,920.00
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	83,000	3.67	304,610.00
BOC AVIATION LTD	7,000	69.45	486,150.00
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	82,000	3.92	321,440.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	133,000	3.61	480,130.00
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	62,000	11.18	693,160.00
CITIC LTD	178,000	7.14	1,270,920.00
CRRC CORP LTD - H	138,000	4.79	661,020.00
FOSUN INTERNATIONAL LTD	83,500	4.10	342,350.00
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	21,000	21.50	451,500.00
SINOTRUK HONG KONG LTD	22,500	19.52	439,200.00
WEICHAJ POWER CO LTD-H	61,000	11.96	729,560.00
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	16,000	28.90	462,400.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	40,000	11.42	456,800.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	91,200	10.56	963,072.00
JD LOGISTICS INC	63,100	8.01	505,431.00
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	42,000	8.01	336,420.00
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	4,000	105.00	420,000.00
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	48,000	5.25	252,000.00
BYD CO LTD-H	33,000	212.40	7,009,200.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	18,800	42.70	802,760.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	192,000	7.67	1,472,640.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	72,000	10.18	732,960.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	92,000	2.57	236,440.00
LI AUTO INC-CLASS A	38,988	74.45	2,902,656.60
XPENG INC-CLASS A SHARES	39,564	26.50	1,048,446.00
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	38,000	10.16	386,080.00
ZHEJIANG LEAPMOTOR TECHNOLOG	15,200	22.40	340,480.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	40,200	67.45	2,711,490.00
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	126,000	3.88	488,880.00
HAIER SMART HOME CO LTD-H	76,600	23.40	1,792,440.00
HISENSE HOME APPLIANCES GR-H	10,000	21.45	214,500.00
LI NING CO LTD	71,500	13.70	979,550.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	26,300	62.20	1,635,860.00
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	53,000	12.02	637,060.00
MEITUAN	159,610	102.10	16,296,181.00
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	47,010	53.05	2,493,880.50
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LT	38,000	12.84	487,920.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	34,000	8.50	289,000.00
TRIP.COM GROUP LTD	17,260	325.60	5,619,856.00

BAIDU INC-CLASS A	71,730	82.40	5,910,552.00
BILIBILI INC-CLASS Z	7,377	107.10	790,076.70
CHINA LITERATURE LTD	12,200	24.00	292,800.00
CHINA RUYI HOLDINGS LIMITED	208,000	2.15	447,200.00
KINGSOFT CORP LTD	28,800	20.75	597,600.00
KUAISHOU TECHNOLOGY	73,300	44.45	3,258,185.00
NETEASE INC	60,900	133.70	8,142,330.00
TENCENT HOLDINGS LTD	208,100	373.80	77,787,780.00
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	490,340	78.30	38,393,622.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-H	3,200	50.75	162,400.00
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	62,600	6.64	415,664.00
JD.COM INC - CL A	73,260	100.80	7,384,608.00
MINISO GROUP HOLDING LTD	12,492	29.75	371,637.00
POP MART INTERNATIONAL GROUP	15,000	39.45	591,750.00
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	56,000	3.09	173,040.00
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	25,000	10.32	258,000.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	180,000	3.00	540,000.00
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	35,250	20.45	720,862.50
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	3,800	104.20	395,960.00
CHINA FEIHE LTD	115,000	3.66	420,900.00
CHINA MENGNIU DAIRY CO	101,000	12.88	1,300,880.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	52,000	23.50	1,222,000.00
NONGFU SPRING CO LTD-H	63,600	29.85	1,898,460.00
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	60,000	8.31	498,600.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	60,000	9.27	556,200.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	20,000	48.30	966,000.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	154,000	4.89	753,060.00
GIANT BIOGENE HOLDING CO LTD	9,600	40.80	391,680.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	19,500	25.35	494,325.00
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	10,800	20.30	219,240.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	77,200	4.33	334,276.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	21,500	11.68	251,120.00
SINOPHARM GROUP CO-H	41,600	19.88	827,008.00
AKESO INC	20,000	43.40	868,000.00
BEIGENE LTD	20,996	111.40	2,338,954.40
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	56,500	5.64	318,660.00
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	266,000	5.87	1,561,420.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	36,000	12.80	460,800.00
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	38,000	17.68	671,840.00
INNOVENT BIOLOGICS INC	39,000	41.05	1,600,950.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	326,250	3.02	985,275.00
WUXI APPTec CO LTD-H	10,168	33.25	338,086.00
WUXI BIOLOGICS (CAYMAN) INC.	122,500	11.22	1,374,450.00

AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	870,000	3.51	3,053,700.00
BANK OF CHINA LTD-H	2,500,000	3.41	8,525,000.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	275,000	5.85	1,608,750.00
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	280,000	4.63	1,296,400.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	3,027,000	5.51	16,678,770.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	101,000	2.37	239,370.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	122,500	32.35	3,962,875.00
CHINA MINSHENG BANKING-H	209,600	2.71	568,016.00
IND & COMM BK OF CHINA-H	2,048,000	4.49	9,195,520.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	239,000	4.16	994,240.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	115,500	3.86	445,830.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	47,600	8.19	389,844.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	50,000	11.20	560,000.00
FAR EAST HORIZON LTD	64,000	5.43	347,520.00
GF SECURITIES CO LTD-H	33,000	6.37	210,210.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	86,400	3.45	298,080.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	41,200	8.24	339,488.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	235,000	10.30	2,420,500.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	83,400	19.08	1,591,272.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	43,000	7.86	337,980.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	28,900	14.62	422,518.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	264,000	2.65	699,600.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	218,000	10.16	2,214,880.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	211,000	33.65	7,100,150.00
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	90,000	5.63	506,700.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	22,500	27.20	612,000.00
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	24,500	29.15	714,175.00
LENOVO GROUP LTD	254,000	10.12	2,570,480.00
SUNNY OPTICAL TECH	22,400	44.30	992,320.00
XIAOMI CORP-CLASS B	482,200	16.86	8,129,892.00
ZTE CORP-H	23,600	16.48	388,928.00
CHINA TOWER CORP LTD-H	1,400,000	0.96	1,344,000.00
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	16,500	26.30	433,950.00
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	122,000	2.40	292,800.00
CGN POWER CO LTD-H	324,000	3.30	1,069,200.00
CHINA GAS HOLDINGS LTD	88,800	7.19	638,472.00
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	100,000	6.87	687,000.00
CHINA POWER INTERNATIONAL	158,000	3.63	573,540.00
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	30,000	28.25	847,500.00
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	62,000	22.30	1,382,600.00
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	24,500	54.90	1,345,050.00
GUANGDONG INVESTMENT LTD	92,000	3.90	358,800.00
HUANENG POWER INTL INC-H	134,000	4.62	619,080.00

	KUNLUN ENERGY CO LTD	124,000	7.71	956,040.00	
	FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	11,000	11.76	129,360.00	
	GCL TECHNOLOGY HOLDINGS LTD	658,000	1.11	730,380.00	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	18,000	18.34	330,120.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	150,000	3.37	505,500.00	
	C&D INTERNATIONAL INVESTMENT	23,000	12.84	295,320.00	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	122,000	12.74	1,554,280.00	
	CHINA RESOURCES LAND LTD	102,000	22.70	2,315,400.00	
	CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	22,200	21.95	487,290.00	
	LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	66,000	9.19	606,540.00	
	香港ドル 小計	24,495,135		342,149,015.30 (6,470,037,879)	
マレーシアリン ギット	PETRONAS DAGANGAN BHD	10,900	19.48	212,332.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	88,200	5.45	480,690.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	116,900	5.03	588,007.00	
	GAMUDA BHD	57,800	7.55	436,390.00	
	SIME DARBY BERHAD	99,700	2.62	261,214.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	28,000	10.12	283,360.00	
	MISC BHD	44,700	8.62	385,314.00	
	GENTING BHD	57,900	4.46	258,234.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	91,400	2.52	230,328.00	
	MR DIY GROUP M BHD	92,550	2.10	194,355.00	
	IOI CORP BHD	85,100	3.78	321,678.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	16,500	21.04	347,160.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	2,200	107.90	237,380.00	
	PPB GROUP BERHAD	19,620	14.50	284,490.00	
	QL RESOURCES BHD	30,350	6.69	203,041.50	
	SD GUTHRIE BHD	63,000	4.61	290,430.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	68,900	6.29	433,381.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	82,000	4.66	382,120.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	219,100	7.41	1,623,531.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	20,600	19.50	401,700.00	
	MALAYAN BANKING BHD	169,600	10.20	1,729,920.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	459,400	4.22	1,938,668.00	
	RHB BANK BHD	50,200	5.69	285,638.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	95,100	2.40	228,240.00	
	CELCOMDIGI BHD	113,500	3.84	435,840.00	
	MAXIS BHD	64,700	3.54	229,038.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	36,600	6.90	252,540.00	
	PETRONAS GAS BHD	22,900	17.92	410,368.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	82,600	13.84	1,143,184.00	
	YTL CORP BHD	106,800	3.41	364,188.00	
	YTL POWER INTERNATIONAL BHD	78,700	4.43	348,641.00	

	INARI AMERTRON BHD	92,700	3.60	333,720.00	
	マレーシアリングット 小計	2,668,220		15,555,120.50 (516,495,332)	
タイバーツ	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	42,700	146.00	6,234,200.00	
	PTT PCL-NVDR	319,400	33.75	10,779,750.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	39,100	51.25	2,003,875.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	53,800	16.70	898,460.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	79,000	23.40	1,848,600.00	
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	48,500	22.80	1,105,800.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	25,500	196.50	5,010,750.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	131,800	55.75	7,347,850.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	234,600	7.80	1,829,880.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	190,600	3.12	594,672.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	114,000	24.60	2,804,400.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	51,825	26.00	1,347,450.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	204,100	7.90	1,612,390.00	
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	85,300	14.00	1,194,200.00	
	CP ALL PCL-NVDR	187,100	55.25	10,337,275.00	
	CP AXTRA PCL-NVDR	73,900	28.00	2,069,200.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	130,000	24.20	3,146,000.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	344,000	27.00	9,288,000.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	18,700	245.00	4,581,500.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	19,100	131.00	2,502,100.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	98,900	18.10	1,790,090.00	
	SCB X PCL-NVDR	26,600	103.00	2,739,800.00	
	TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR	685,400	1.71	1,172,034.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	29,400	39.00	1,146,600.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	96,000	102.50	9,840,000.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	36,500	245.00	8,942,500.00	
INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	28,600	83.75	2,395,250.00		
TRUE CORP PCL/NEW-NVDR	327,315	10.30	3,371,344.50		
GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	21,300	37.50	798,750.00		
GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	92,300	47.00	4,338,100.00		
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	63,600	52.75	3,354,900.00		
	タイバーツ 小計	3,898,940		116,425,720.50 (487,823,768)	
フィリピンペソ	AYALA CORPORATION	7,600	618.00	4,696,800.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	72,731	24.45	1,778,272.95	
	SM INVESTMENTS CORP	6,580	914.50	6,017,410.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	32,760	369.00	12,088,440.00	
	JOLLIBEE FOODS CORP	15,800	241.60	3,817,280.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	24,530	96.70	2,372,051.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	54,578	118.00	6,440,204.00	

	BDO UNIBANK INC	74,086	140.20	10,386,857.20	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	57,732	69.00	3,983,508.00	
	PLDT INC	2,235	1,570.00	3,508,950.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	9,630	400.00	3,852,000.00	
	AYALA LAND INC	222,200	31.50	6,999,300.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	331,200	30.30	10,035,360.00	
	フィリピンペソ 小計	911,662		75,976,433.15 (196,558,630)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY TBK PT	483,900	3,220.00	1,558,158,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	45,500	25,050.00	1,139,775,000.00	
	AMMAN MINERAL INTERNASIONAL	209,900	10,425.00	2,188,207,500.00	
	ANEKA TAMBANG TBK	307,000	1,305.00	400,635,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	910,347	1,125.00	1,024,140,375.00	
	CHANDRA ASRI PACIFIC TBK PT	233,900	10,625.00	2,485,187,500.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	70,200	8,350.00	586,170,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	292,209	2,360.00	689,613,240.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	630,400	4,890.00	3,082,656,000.00	
	GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT	26,963,000	53.00	1,429,039,000.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	556,700	2,850.00	1,586,595,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	219,400	5,175.00	1,135,395,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	75,400	11,350.00	855,790,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	154,200	6,500.00	1,002,300,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	276,400	2,430.00	671,652,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	730,700	1,680.00	1,227,576,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	1,749,800	10,200.00	17,847,960,000.00	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	1,180,700	7,075.00	8,353,452,500.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	463,600	5,275.00	2,445,490,000.00	
BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	2,154,145	4,820.00	10,382,978,900.00		
TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	1,576,000	2,860.00	4,507,360,000.00		
	インドネシアルピア 小計	39,283,401		64,600,131,015.00 (607,241,231)	
韓国ウォン	HD HYUNDAI	1,442	81,800.00	117,955,600.00	
	S-OIL CORP	1,463	66,300.00	96,996,900.00	
	SK INNOVATION CO LTD	1,895	103,400.00	195,943,000.00	
	ENCHEM CO LTD	341	185,000.00	63,085,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORP	3,349	28,100.00	94,106,900.00	
	HYUNDAI STEEL CO	2,559	25,950.00	66,406,050.00	
	KOREA ZINC CO LTD	267	512,000.00	136,704,000.00	
	KUM YANG CO LTD	1,116	60,300.00	67,294,800.00	
	KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	458	134,900.00	61,784,200.00	
	LG CHEM LTD	1,572	296,000.00	465,312,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	265	199,000.00	52,735,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORP	563	82,800.00	46,616,400.00	

POSCO HOLDINGS INC	2,268	332,500.00	754,110,000.00
SKC CO LTD	602	123,900.00	74,587,800.00
DOOSAN BOBCAT INC	1,860	40,100.00	74,586,000.00
DOOSAN ENERBILITY	14,355	18,170.00	260,830,350.00
ECOPRO BM CO LTD	1,505	186,000.00	279,930,000.00
ECOPRO CO LTD	3,196	90,800.00	290,196,800.00
ECOPRO MATERIALS CO LTD	441	83,700.00	36,911,700.00
GS HOLDINGS	1,411	45,250.00	63,847,750.00
HANWHA AEROSPACE CO LTD	1,137	308,000.00	350,196,000.00
HANWHA OCEAN CO LTD	3,102	31,250.00	96,937,500.00
HD HYUNDAI ELECTRIC CO LTD	661	274,000.00	181,114,000.00
HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	733	206,000.00	150,998,000.00
HD KOREA SHIPBUILDING & OFFS	1,376	197,600.00	271,897,600.00
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	2,296	30,800.00	70,716,800.00
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	2,176	58,600.00	127,513,600.00
L&F CO LTD	821	92,000.00	75,532,000.00
LG CORP	2,961	78,700.00	233,030,700.00
LG ENERGY SOLUTION	1,435	337,000.00	483,595,000.00
POSCO FUTURE M CO LTD	962	210,000.00	202,020,000.00
POSCO INTERNATIONAL CORP	1,772	49,300.00	87,359,600.00
SAMSUNG C&T CORP	2,648	139,500.00	369,396,000.00
SAMSUNG E&A CO LTD	4,565	26,200.00	119,603,000.00
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	21,428	10,740.00	230,136,720.00
SK	1,151	138,200.00	159,068,200.00
SK IE TECHNOLOGY CO LTD	775	32,850.00	25,458,750.00
SK SQUARE CO LTD	3,018	82,300.00	248,381,400.00
HANJIN KAL CORP	866	65,800.00	56,982,800.00
HMM CO LTD	7,839	17,630.00	138,201,570.00
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,230	108,200.00	133,086,000.00
KOREAN AIR LINES CO LTD	5,483	20,750.00	113,772,250.00
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	2,338	42,700.00	99,832,600.00
HYUNDAI MOBIS CO LTD	1,896	218,000.00	413,328,000.00
HYUNDAI MOTOR CO	4,292	241,000.00	1,034,372,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	1,138	162,800.00	185,266,400.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	714	162,000.00	115,668,000.00
KIA CORP	8,243	102,300.00	843,258,900.00
COWAY CO LTD	1,628	60,200.00	98,005,600.00
LG ELECTRONICS INC	3,387	95,600.00	323,797,200.00
HYBE CO LTD	687	163,100.00	112,049,700.00
KAKAO CORP	9,494	36,800.00	349,379,200.00
KRAFTON INC	872	331,500.00	289,068,000.00
NAVER CORP	4,095	157,300.00	644,143,500.00
NCSOFT CORP	458	187,900.00	86,058,200.00

NETMARBLE CORPORATION	904	63,200.00	57,132,800.00
CJ CHEILJEDANG CORP	272	366,000.00	99,552,000.00
KT&G CORP	3,351	101,900.00	341,466,900.00
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	783	91,700.00	71,801,100.00
AMOREPACIFIC CORP	932	117,900.00	109,882,800.00
LG H&H	315	337,000.00	106,155,000.00
HLB INC	3,748	85,500.00	320,454,000.00
ALTEOGEN INC	1,267	292,500.00	370,597,500.00
CELLTRION INC	4,814	194,600.00	936,804,400.00
CELLTRION PHARM INC	569	77,100.00	43,869,900.00
HANMI PHARM CO LTD	218	284,500.00	62,021,000.00
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	562	932,000.00	523,784,000.00
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	954	98,900.00	94,350,600.00
SK BIOSCIENCE CO LTD	710	58,100.00	41,251,000.00
YUHAN CORP	1,830	88,200.00	161,406,000.00
HANA FINANCIAL GROUP	9,256	61,200.00	566,467,200.00
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	8,613	13,720.00	118,170,360.00
KAKAOBANK CORP	5,191	21,700.00	112,644,700.00
KB FINANCIAL GROUP INC	12,077	84,400.00	1,019,298,800.00
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	13,645	55,000.00	750,475,000.00
WOORI FINANCIAL GROUP INC	18,838	15,270.00	287,656,260.00
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	1,162	70,600.00	82,037,200.00
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	3,040	84,000.00	255,360,000.00
MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	7,939	7,910.00	62,797,490.00
NH INVESTMENT & SECURITIES C	3,822	13,360.00	51,061,920.00
DB INSURANCE CO LTD	1,452	102,000.00	148,104,000.00
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	983	336,500.00	330,779,500.00
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	2,498	88,200.00	220,323,600.00
POSCO DX CO LTD	1,565	26,850.00	42,020,250.00
SAMSUNG SDS CO LTD	1,376	142,600.00	196,217,600.00
COSMOAM&T CO LTD	779	114,500.00	89,195,500.00
LG DISPLAY CO LTD	9,723	11,080.00	107,730,840.00
LG INNOTEK CO LTD	466	250,000.00	116,500,000.00
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	1,693	142,200.00	240,744,600.00
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	150,377	77,200.00	11,609,104,400.00
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	25,932	62,300.00	1,615,563,600.00
SAMSUNG SDI CO LTD	1,736	323,500.00	561,596,000.00
KT CORP	896	38,300.00	34,316,800.00
LG UPLUS CORP	6,485	9,660.00	62,645,100.00
SK TELECOM	1,621	55,000.00	89,155,000.00
KOREA ELECTRIC POWER CORP	8,066	19,260.00	155,351,160.00
HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD	1,397	118,500.00	165,544,500.00
SK HYNIX INC	17,192	186,700.00	3,209,746,400.00

	韓国ウォン 小計	487,654		37,460,301,820.00 (4,075,680,838)
新台幣ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	36,000	61.90	2,228,400.00
	ASIA CEMENT CORP	69,000	44.20	3,049,800.00
	CHINA STEEL CORP	376,000	22.70	8,535,200.00
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	110,000	45.45	4,999,500.00
	FORMOSA PLASTICS CORP	122,000	53.40	6,514,800.00
	NAN YA PLASTICS CORP	149,000	47.35	7,055,150.00
	TCC GROUP HOLDINGS	214,917	33.60	7,221,211.20
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	4,200	805.00	3,381,000.00
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	92,000	36.20	3,330,400.00
	FORTUNE ELECTRIC CO LTD	4,400	673.00	2,961,200.00
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	2,000	1,905.00	3,810,000.00
	WALSIN LIHWA CORP	84,000	33.35	2,801,400.00
	CHINA AIRLINES LTD	95,000	20.90	1,985,500.00
	EVA AIRWAYS CORP	86,000	34.70	2,984,200.00
	EVERGREEN MARINE CORP LTD	31,420	181.50	5,702,730.00
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	55,000	29.45	1,619,750.00
	WAN HAI LINES LTD	23,650	77.70	1,837,605.00
	YANG MING MARINE TRANSPORT	52,000	61.60	3,203,200.00
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	53,000	49.30	2,612,900.00
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	5,420	501.00	2,715,420.00
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	14,289	141.00	2,014,749.00
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	5,000	415.00	2,075,000.00
	POU CHEN	73,000	36.45	2,660,850.00
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	10,160	646.00	6,563,360.00
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	18,000	283.50	5,103,000.00
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	149,000	82.70	12,322,300.00
	PHARMAESSENTIA CORP	8,000	661.00	5,288,000.00
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	177,046	18.45	3,266,498.70
	CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	557,000	34.75	19,355,750.00
	E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	456,155	27.25	12,430,223.75
	FIRST FINANCIAL HOLDING CO	356,094	27.00	9,614,538.00
	HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	285,254	25.30	7,216,926.20
	MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	374,407	38.90	14,564,432.30
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	334,350	26.95	9,010,732.50	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	373,417	18.80	7,020,239.60	
TAIWAN BUSINESS BANK	223,142	15.95	3,559,114.90	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	329,107	25.85	8,507,415.95	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	122,000	41.55	5,069,100.00	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	46,929	148.50	6,968,956.50	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	322,532	32.00	10,321,024.00	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	301,000	61.90	18,631,900.00	

FUBON FINANCIAL HOLDING CO	246,766	89.30	22,036,203.80
KGI FINANCIAL HOLDING CO LTD	513,000	16.10	8,259,300.00
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	452,069	10.70	4,837,138.30
ACCTON TECHNOLOGY CORP	16,000	502.00	8,032,000.00
ACER INC	86,000	42.10	3,620,600.00
ADVANTECH CO LTD	14,427	348.50	5,027,809.50
ASIA VITAL COMPONENTS	10,000	597.00	5,970,000.00
ASUSTEK COMPUTER INC	22,000	510.00	11,220,000.00
AUO CORP	193,200	15.75	3,042,900.00
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	20,000	229.00	4,580,000.00
COMPAL ELECTRONICS	133,000	31.70	4,216,100.00
DELTA ELECTRONICS INC	61,000	409.00	24,949,000.00
E INK HOLDINGS INC	26,000	284.00	7,384,000.00
GIGABYTE TECHNOLOGY CO LTD	16,000	242.50	3,880,000.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	392,800	185.50	72,864,400.00
INNOLUX CORP	273,751	14.55	3,983,077.05
INVENTEC CORP	87,000	47.70	4,149,900.00
LARGAN PRECISION CO LTD	3,200	2,840.00	9,088,000.00
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	64,000	109.50	7,008,000.00
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	23,000	171.00	3,933,000.00
PEGATRON CORP	64,000	103.50	6,624,000.00
QUANTA COMPUTER INC	85,000	271.00	23,035,000.00
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	40,000	71.20	2,848,000.00
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	41,000	159.50	6,539,500.00
WISTRON CORP	83,000	103.50	8,590,500.00
WIWYNN CORP	3,000	1,960.00	5,880,000.00
WPG HOLDINGS LTD	47,960	85.50	4,100,580.00
YAGEO CORPORATION	10,524	745.00	7,840,380.00
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	22,000	122.00	2,684,000.00
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	120,000	122.50	14,700,000.00
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	55,000	88.50	4,867,500.00
TAIWAN MOBILE CO LTD	59,000	109.00	6,431,000.00
ALCHIP TECHNOLOGIES LTD	2,500	2,395.00	5,987,500.00
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	104,000	156.00	16,224,000.00
EMEMORY TECHNOLOGY INC	2,000	2,435.00	4,870,000.00
GLOBAL UNICHIP CORP	2,800	1,085.00	3,038,000.00
GLOBALWAFERS CO LTD	8,000	485.00	3,880,000.00
MEDIATEK INC	47,900	1,185.00	56,761,500.00
NANYA TECHNOLOGY CORP	39,000	54.30	2,117,700.00
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	18,400	529.00	9,733,600.00
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	15,000	529.00	7,935,000.00
SILERGY CORP	9,640	420.00	4,048,800.00
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	776,000	948.00	735,648,000.00

	UNITED MICROELECTRONICS CORP	355,000	55.70	19,773,500.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	29,000	119.00	3,451,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	99,000	24.20	2,395,800.00	
	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	53,647	49.85	2,674,302.95	
	新台湾ドル 小計	11,046,473		1,440,874,069.20 (6,572,691,154)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	48,477	325.05	15,757,448.85	
	COAL INDIA LTD	47,308	504.70	23,876,347.60	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	27,863	373.10	10,395,685.30	
	INDIAN OIL CORP LTD	87,227	163.74	14,282,548.98	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	99,694	328.15	32,714,586.10	
	PETRONET LNG LTD	23,778	364.35	8,663,514.30	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	95,915	2,923.70	280,426,685.50	
	AMBUJA CEMENTS LTD	18,748	623.20	11,683,753.60	
	APL APOLLO TUBES LTD	4,859	1,424.25	6,920,430.75	
	ASIAN PAINTS LTD	12,149	3,025.85	36,761,051.65	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	8,176	2,512.40	20,541,382.40	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	42,737	621.45	26,558,908.65	
	JINDAL STAINLESS LTD	9,837	695.90	6,845,568.30	
	JINDAL STEEL & POWER LTD	11,587	929.75	10,773,013.25	
	JSW STEEL LTD	19,465	890.30	17,329,689.50	
	NMDC LTD	32,477	210.94	6,850,698.38	
	PI INDUSTRIES LTD	2,242	4,334.30	9,717,500.60	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	4,795	3,030.75	14,532,446.25	
	SHREE CEMENT LTD	297	24,338.95	7,228,668.15	
	SOLAR INDUSTRIES INDIA LTD	812	10,162.55	8,251,990.60	
	SRF LTD	4,666	2,491.75	11,626,505.50	
	SUPREME INDUSTRIES LTD	2,023	5,182.30	10,483,792.90	
	TATA STEEL LTD	236,993	146.17	34,641,266.81	
	ULTRATECH CEMENT LTD	3,653	11,002.60	40,192,497.80	
	UPL LTD	13,811	542.85	7,497,301.35	
	VEDANTA LTD	43,250	420.20	18,173,650.00	
	ABB INDIA LTD	1,585	7,756.95	12,294,765.75	
	ADANI ENTERPRISES LTD	5,367	3,040.10	16,316,216.70	
	ASHOK LEYLAND LTD	48,007	246.45	11,831,325.15	
	ASTRAL LTD	4,281	1,862.95	7,975,288.95	
	BHARAT ELECTRONICS LTD	113,007	293.70	33,190,155.90	
	BHARAT HEAVY ELECTRICALS	33,162	290.00	9,616,980.00	
CG POWER AND INDUSTRIAL SOLU	19,772	706.40	13,966,940.80		
CUMMINS INDIA LTD	4,466	3,724.45	16,633,393.70		
HAVELLS INDIA LTD	7,902	1,845.95	14,586,696.90		
HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	6,363	4,661.70	29,662,397.10		
LARSEN & TOUBRO LTD	21,276	3,545.20	75,427,675.20		

POLYCAB INDIA LTD	1,581	6,413.35	10,139,506.35
SIEMENS LTD	2,836	7,040.05	19,965,581.80
SUZLON ENERGY LTD	307,162	76.77	23,580,826.74
THERMAX LTD	1,230	4,301.10	5,290,353.00
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	7,631	909.85	6,943,065.35
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	16,262	1,461.95	23,774,230.90
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	7,859	951.40	7,477,052.60
GMR AIRPORTS INFRASTRUCTURE	77,131	92.73	7,152,357.63
INTERGLOBE AVIATION LTD	5,306	4,209.90	22,337,729.40
BAJAJ AUTO LTD	2,131	9,749.60	20,776,397.60
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	2,334	2,781.45	6,491,904.30
BHARAT FORGE LTD	8,017	1,567.20	12,564,242.40
BOSCH LTD	215	30,993.15	6,663,527.25
EICHER MOTORS LTD	4,352	4,733.25	20,599,104.00
HERO MOTOCORP LTD	3,740	5,072.45	18,970,963.00
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	29,432	2,745.25	80,798,198.00
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	4,470	12,205.65	54,559,255.50
MRF LTD	73	135,970.45	9,925,842.85
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN	86,338	184.57	15,935,404.66
SONA BLW PRECISION FORGINGS	12,173	652.35	7,941,056.55
TATA MOTORS LTD	52,521	1,062.35	55,795,684.35
TATA MOTORS LTD-A-DVR	13,696	725.50	9,936,448.00
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LT	3,429	3,923.55	13,453,852.95
TVS MOTOR CO LTD	7,624	2,605.50	19,864,332.00
PAGE INDUSTRIES LTD	196	40,627.20	7,962,931.20
TITAN CO LTD	11,239	3,402.15	38,236,763.85
INDIAN HOTELS CO LTD	27,297	611.45	16,690,750.65
JUBILANT FOODWORKS LTD	10,980	637.45	6,999,201.00
ZOMATO LTD	208,714	260.14	54,294,859.96
INFO EDGE INDIA LTD	2,281	7,236.75	16,507,026.75
TRENT LTD	5,739	6,438.35	36,949,690.65
AVENUE SUPERMARTS LTD	5,012	4,960.30	24,861,023.60
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	3,364	5,659.15	19,037,380.60
ITC LTD	94,849	492.20	46,684,677.80
MARICO LTD	15,967	650.25	10,382,541.75
NESTLE INDIA LTD	10,383	2,474.60	25,693,771.80
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	18,336	1,167.55	21,408,196.80
UNITED SPIRITS LTD	9,458	1,404.55	13,284,233.90
VARUN BEVERAGES LTD	14,101	1,462.10	20,617,072.10
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	4,259	3,468.50	14,772,341.50
DABUR INDIA LTD	15,898	604.40	9,608,751.20
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	12,732	1,371.10	17,456,845.20
HINDUSTAN UNILEVER LTD	26,007	2,722.05	70,792,354.35

APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	3,210	6,515.85	20,915,878.50
MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	24,763	870.00	21,543,810.00
AUROBINDO PHARMA LTD	8,399	1,519.70	12,763,960.30
CIPLA LTD	16,428	1,563.80	25,690,106.40
DIVI'S LABORATORIES LTD	3,794	4,662.00	17,687,628.00
DR. REDDY'S LABORATORIES	3,727	6,801.05	25,347,513.35
LUPIN LTD	7,170	2,073.95	14,870,221.50
MANKIND PHARMA LTD	2,983	2,216.20	6,610,924.60
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	30,329	1,741.65	52,822,502.85
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	3,310	3,348.75	11,084,362.50
AU SMALL FINANCE BANK LTD	10,528	603.05	6,348,910.40
AXIS BANK LTD	72,011	1,153.10	83,035,884.10
BANDHAN BANK LTD	25,449	189.99	4,835,055.51
BANK OF BARODA	32,605	239.45	7,807,267.25
CANARA BANK	53,143	105.65	5,614,557.95
HDFC BANK LIMITED	88,573	1,607.80	142,407,669.40
ICICI BANK LTD	163,722	1,161.65	190,187,661.30
IDFC FIRST BANK LTD	109,925	70.60	7,760,705.00
INDUSIND BANK LTD	9,262	1,338.10	12,393,482.20
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	34,493	1,747.90	60,290,314.70
PUNJAB NATIONAL BANK	69,448	113.57	7,887,209.36
STATE BANK OF INDIA	56,345	803.00	45,245,035.00
UNION BANK OF INDIA	46,909	116.70	5,474,280.30
YES BANK LTD	463,728	23.99	11,124,834.72
BAJAJ FINANCE LTD	8,801	6,458.50	56,841,258.50
BAJAJ FINSERV LTD	12,194	1,529.15	18,646,455.10
BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMEN	806	9,390.60	7,568,823.60
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	13,260	1,344.00	17,821,440.00
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	3,113	4,144.10	12,900,583.30
JIO FINANCIAL SERVICES LTD	90,636	320.20	29,021,647.20
MUTHOOT FINANCE LTD	3,756	1,816.45	6,822,586.20
POWER FINANCE CORPORATION	47,152	484.65	22,852,216.80
REC LTD	41,809	563.70	23,567,733.30
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	9,485	689.65	6,541,330.25
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	9,006	2,895.10	26,073,270.60
SUNDARAM FINANCE LTD	1,982	3,876.35	7,682,925.70
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	29,778	686.35	20,438,130.30
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	7,188	1,977.95	14,217,504.60
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	11,312	718.20	8,124,278.40
PB FINTECH LTD	9,546	1,574.05	15,025,881.30
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	14,063	1,692.10	23,796,002.30
HCL TECHNOLOGIES LTD	30,088	1,626.15	48,927,601.20
INFOSYS LTD	104,718	1,823.25	190,927,093.50

	LTIMINDTREE LTD	2,775	5,427.55	15,061,451.25
	MPHASIS LTD	3,266	2,718.85	8,879,764.10
	PERSISTENT SYSTEMS LTD	3,124	4,764.10	14,883,048.40
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	28,549	4,295.25	122,625,092.25
	TATA ELXSI LTD	1,069	6,827.75	7,298,864.75
	TECH MAHINDRA LTD	16,514	1,524.40	25,173,941.60
	WIPRO LTD	41,653	495.15	20,624,482.95
	BHARTI AIRTEL LTD	71,541	1,471.70	105,286,889.70
	INDUS TOWERS LTD	38,189	403.05	15,392,076.45
	TATA COMMUNICATIONS LTD	3,349	1,833.35	6,139,889.15
	ADANI GREEN ENERGY LTD	9,923	1,808.30	17,943,760.90
	ADANI POWER LTD	24,069	674.05	16,223,709.45
	GAIL INDIA LTD	73,371	226.66	16,630,270.86
	JSW ENERGY LTD	10,450	645.95	6,750,177.50
	NHPC LTD	90,500	93.68	8,478,040.00
	NTPC LTD	137,935	396.35	54,670,537.25
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	147,023	333.50	49,032,170.50
	TATA POWER CO LTD	45,750	405.45	18,549,337.50
	TORRENT POWER LTD	5,030	1,678.60	8,443,358.00
	DLF LTD	23,262	821.65	19,113,222.30
	GODREJ PROPERTIES LTD	4,105	2,873.70	11,796,538.50
	MACROTECH DEVELOPERS LTD	9,643	1,284.05	12,382,094.15
	PHOENIX MILLS LTD	3,244	3,365.15	10,916,546.60
	インドルピー 小計	4,905,663		3,837,247,902.51 (6,791,928,787)
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	18,651	14.65	273,237.15
	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	90,755	4.30	390,609.52
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	187,792	1.61	304,035.24
	INDUSTRIES QATAR	47,498	12.95	615,099.10
	COMMERCIAL BANK PQSC	104,492	4.12	430,716.02
	DUKHAN BANK	57,922	3.75	217,207.50
	MASRAF AL RAYAN	196,047	2.22	436,596.66
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	29,447	10.97	323,033.59
	QATAR ISLAMIC BANK	55,218	19.45	1,073,990.10
	QATAR NATIONAL BANK	145,670	15.89	2,314,696.30
	OOREDOO QPSC	24,164	10.70	258,554.80
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	13,086	15.56	203,618.16
	BARWA REAL ESTATE CO	76,272	2.60	198,764.83
	カタールリアル 小計	1,047,014		7,040,158.97 (284,985,635)
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	7,793	182.01	1,418,403.93
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	2,095	630.34	1,320,562.30
	ANGLOGOLD ASHANTI PLC	13,351	553.26	7,386,574.26

	GOLD FIELDS LTD	28,426	285.80	8,124,150.80
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	17,719	180.25	3,193,849.75
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	28,030	81.90	2,295,657.00
	KUMBA IRON ORE LTD	2,210	364.82	806,252.20
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	10,590	124.58	1,319,302.20
	SASOL LTD	18,714	130.48	2,441,802.72
	SIBANYE STILLWATER LTD	83,639	17.94	1,500,483.66
	BIDVEST GROUP LTD	11,047	270.05	2,983,242.35
	NASPERS LTD-N SHS	5,622	3,614.09	20,318,413.98
	PEPKOR HOLDINGS LTD	79,385	20.23	1,605,958.55
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	27,276	61.84	1,686,747.84
	BID CORP LTD	10,719	438.22	4,697,280.18
	CLICKS GROUP LTD	7,697	359.61	2,767,918.17
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	15,813	301.25	4,763,666.25
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	11,723	226.92	2,660,183.16
	ABSA GROUP LTD	26,797	153.17	4,104,496.49
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	2,686	2,833.80	7,611,586.80
	NEDBANK GROUP LTD	14,864	286.30	4,255,563.20
	STANDARD BANK GROUP LTD	42,311	219.07	9,269,070.77
	FIRSTSTRAND LTD	159,474	81.71	13,030,620.54
	REINET INVESTMENTS SCA	4,084	467.00	1,907,228.00
	REMGRO LTD	14,915	137.50	2,050,812.50
	DISCOVERY LTD	16,635	145.96	2,428,044.60
	OLD MUTUAL LTD	141,224	12.02	1,697,512.48
	OUTSURANCE GROUP LTD	28,467	47.11	1,341,080.37
	SANLAM LTD	54,894	82.00	4,501,308.00
	MTN GROUP LTD	54,292	84.97	4,613,191.24
	VODACOM GROUP LTD	19,783	99.30	1,964,451.90
	NEPI ROCKCASTLE N.V.	17,784	139.10	2,473,754.40
	南アフリカランド 小計	980,059		132,539,170.59 (1,082,845,023)
アラブディルハム	MULTIPLY GROUP	132,837	2.10	278,957.70
	AMERICANA RESTAURANTS INTERN	96,797	2.68	259,415.96
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	99,491	3.39	337,274.49
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	90,397	8.74	790,069.78
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	44,112	12.66	558,457.92
	DUBAI ISLAMIC BANK	93,109	5.78	538,170.02
	EMIRATES NBD PJSC	58,262	19.55	1,139,022.10
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	139,486	13.42	1,871,902.12
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	110,047	16.76	1,844,387.72
	ALDAR PROPERTIES PJSC	125,204	7.20	901,468.80
	EMAAR PROPERTIES PJSC	210,694	8.28	1,744,546.32
	1,200,436		10,263,672.93	

アラブディルハム 小計				(412,497,015)
クウェートディ ナール	BOUBYAN BANK K.S.C	46,546	0.58	27,275.95
	GULF BANK	57,778	0.30	17,333.40
	KUWAIT FINANCE HOUSE	323,971	0.71	231,963.23
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	249,701	0.88	220,485.98
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	64,994	0.45	29,442.28
	MABANEE CO KPSC	21,552	0.85	18,383.85
クウェートディナール 小計		764,542		544,884.69 (262,879,618)
オフショア人民 元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	18,900	7.63	144,207.00
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	58,200	6.65	387,030.00
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	13,100	39.13	512,603.00
	CNOOC ENERGY TECHNOLOGY & -A	13,700	3.85	52,745.00
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-A	8,100	14.27	115,587.00
	GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	9,700	5.98	58,006.00
	INNER MONGOLIA DIAN TOU EN-A	5,300	17.87	94,711.00
	JIZHONG ENERGY RESOURCES-A	4,900	5.45	26,705.00
	OFFSHORE OIL ENGINEERING-A	10,500	5.47	57,435.00
	PETROCHINA CO LTD-A	40,400	8.78	354,712.00
	PINGDINGSHAN TIANAN COAL -A	5,000	10.13	50,650.00
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	17,400	23.03	400,722.00
	SHAN XI HUA YANG GROUP NEW-A	5,100	7.14	36,414.00
	SHANXI COKING COAL ENERGY-A	12,420	7.89	97,993.80
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	6,500	14.63	95,095.00
	YANKUANG ENERGY GROUP CO-A	8,756	14.26	124,860.56
	YANTAI JEREH OILFIELD-A	900	30.42	27,378.00
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	23,100	6.43	148,533.00
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	7,800	22.60	176,280.00
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	42,300	6.13	259,299.00
	CATHAY BIOTECH INC-A	1,260	36.35	45,801.00
	CHIFENG JILONG GOLD MINING-A	3,400	18.00	61,200.00
	CHINA JUSHI CO LTD -A	7,414	10.04	74,436.56
	CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	5,700	16.85	96,045.00
	CHINA RARE EARTH RESOURCES-A	1,900	22.32	42,408.00
	CITI PACIFIC SPECIAL STEEL-A	7,100	11.66	82,786.00
	CMOC GROUP LTD-A	36,400	7.10	258,440.00
	CNGR ADVANCED MATERIAL CO -A	840	27.77	23,326.80
	GANFENG LITHIUM GROUP CO L-A	2,740	26.59	72,856.60
	GEM CO LTD-A	10,800	5.73	61,884.00
GUANGDONG HEC TECHNOLOGY H-A	6,300	6.45	40,635.00	
GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	4,180	14.47	60,484.60	
HANGZHOU OXYGEN PLANT GROU-A	2,000	18.29	36,580.00	
HAOHUA CHEMICAL SCIENCE -A	1,600	27.60	44,160.00	

HENAN SHENHUO COAL & POWER-A	3,500	16.21	56,735.00
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	14,520	13.11	190,357.20
HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	1,950	6.12	11,934.00
HESTEEL CO LTD-A	1,500	1.89	2,835.00
HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A	1,400	45.75	64,050.00
HUAFON CHEMICAL CO LTD -A	15,600	7.10	110,760.00
HUAIBEI MINING HOLDINGS CO-A	3,700	14.03	51,911.00
HUNAN VALIN STEEL CO LTD -A	14,600	4.36	63,656.00
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	73,300	1.42	104,086.00
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	15,700	3.72	58,404.00
INNER MONGOLIA YUAN XING-A	5,900	6.22	36,698.00
JCHX MINING MANAGEMENT CO -A	1,300	40.17	52,221.00
JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	13,900	7.50	104,250.00
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	390	51.03	19,901.70
JIANGSU YOKE TECHNOLOGY-A	500	53.64	26,820.00
JIANGXI COPPER CO LTD-A	4,300	20.03	86,129.00
JINDUICHENG MOLYBDENUM CO -A	6,700	9.70	64,990.00
LB GROUP CO LTD-A	4,500	16.03	72,135.00
MEIHUA HOLDINGS GROUP CO -A	5,400	10.01	54,054.00
NANJING IRON & STEEL CO-A	13,000	4.35	56,550.00
NINGBO SHANSHAN CO LTD-A	2,300	7.31	16,813.00
NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	15,400	15.09	232,386.00
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	18,100	2.31	41,811.00
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY-A	10,600	14.04	148,824.00
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	19,550	8.85	173,017.50
SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A	8,090	15.85	128,226.50
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	6,368	28.90	184,035.20
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	3,520	22.02	77,510.40
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	36,900	3.48	128,412.00
SHANDONG SUN PAPER INDUSTR-A	8,800	12.53	110,264.00
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	4,408	11.90	52,455.20
SHANJIN INTERNATIONAL GOLD C	5,580	17.27	96,366.60
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	3,700	4.20	15,540.00
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	4,800	3.46	16,608.00
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	1,080	30.96	33,436.80
SHENZHEN YUTO PACKAGING TE-A	1,700	22.79	38,743.00
SICHUAN HEBANG BIOTECHNOL- A	14,200	1.67	23,714.00
SINOMA SCIENCE&TECHNOLOGY -A	2,200	10.68	23,496.00
SINOMINE RESOURCE GROUP CO-A	980	26.30	25,774.00
SUNRESIN NEW MATERIALS CO -A	1,200	38.65	46,380.00
TIANQI LITHIUM CORP-A	2,900	26.97	78,213.00
TIANSHAN ALUMINUM GROUP CO-A	7,500	6.75	50,625.00
TONGKUN GROUP CO LTD-A	7,600	12.51	95,076.00

TONGLING NONFERROUS METALS-A	27,300	3.03	82,719.00
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	6,300	70.80	446,040.00
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	640	27.30	17,472.00
WESTERN MINING CO -A	3,300	15.39	50,787.00
WESTERN SUPERCONDUCTING TE-A	560	35.45	19,852.00
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD-A	1,200	16.12	19,344.00
YONGXING SPECIAL MATERIALS-A	910	32.12	29,229.20
YUNNAN ALUMINIUM CO LTD-A	7,300	11.43	83,439.00
YUNNAN CHIHONG ZINC & GERM-A	11,000	5.10	56,100.00
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	1,400	27.60	38,640.00
YUNNAN TIN CO LTD-A	3,500	13.72	48,020.00
YUNNAN YUNTIANHUA CO-A	4,400	20.24	89,056.00
ZANGGE MINING CO LTD-A	3,300	22.44	74,052.00
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	2,708	21.91	59,332.28
ZHEJIANG JUHUA CO-A	5,700	18.10	103,170.00
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	6,700	8.66	58,022.00
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	5,463	19.71	107,675.73
ZHONGJIN GOLD CORP-A	10,000	15.15	151,500.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	40,400	15.40	622,160.00
AECC AERO-ENGINE CONTROL-A	1,000	20.11	20,110.00
AECC AVIATION POWER CO-A	6,300	37.52	236,376.00
AVICOPTER PLC-A	500	39.75	19,875.00
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	3,700	25.28	93,536.00
CHINA BAOAN GROUP-A	4,500	7.90	35,550.00
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	8,600	39.32	338,152.00
CHINA ENERGY ENGINEERING COR	52,300	2.24	117,152.00
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	9,700	7.16	69,452.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	38,300	5.93	227,119.00
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	84,800	5.49	465,552.00
CHINA XD ELECTRIC CO LTD-A	11,300	7.03	79,439.00
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	8,260	172.21	1,422,454.60
COSCO SHIPPING DEVELOPMENT CO	18,400	2.34	43,056.00
CRRC CORP LTD-A	46,800	7.42	347,256.00
CSSC SCIENCE & TECHNOLOGY -A	3,300	12.37	40,821.00
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	4,400	14.36	63,184.00
EVE ENERGY CO LTD-A	4,020	37.74	151,714.80
FAW JIEFANG GROUP CO LTD-A	3,200	7.76	24,832.00
GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A	600	60.57	36,342.00
GOLDWIND SCIENCE &TECHNOL-A	3,400	7.65	26,010.00
GONEO GROUP CO LTD	1,160	68.61	79,587.60
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	3,900	18.38	71,682.00
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	2,436	44.04	107,281.44
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	5,300	13.14	69,642.00

KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A	2,200	16.22	35,684.00
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	39,700	3.20	127,040.00
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	14,782	23.35	345,159.70
NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO -A	756	93.05	70,345.80
NINGBO ORIENT WIRES & CABL-A	1,000	48.03	48,030.00
NINGBO SANXING MEDICAL CO -A	3,100	29.43	91,233.00
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	33,900	5.49	186,111.00
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	15,900	14.99	238,341.00
SHANDONG HIMILE MECHANICAL-A	1,800	34.51	62,118.00
SHANGHAI CONSTRUCTION GROU-A	5,600	2.19	12,264.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	24,000	3.69	88,560.00
SHANXI COAL INTERNATIONAL -A	4,500	12.48	56,160.00
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	2,400	41.53	99,672.00
SICHUAN ROAD&BRIDGE GROUP-A	13,860	6.15	85,239.00
SIEYUAN ELECTRIC CO LTD-A	1,500	66.40	99,600.00
SINOMA INTERNATIONAL ENGIN-A	5,500	9.96	54,780.00
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	3,920	68.39	268,088.80
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	1,300	15.93	20,709.00
TBEA CO LTD-A	10,920	12.99	141,850.80
TIAN DI SCIENCE & TECHNOLO-A	9,000	5.69	51,210.00
WEICHAI POWER CO LTD-A	13,200	12.82	169,224.00
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	20,700	6.37	131,859.00
XIAMEN C & D INC-A	4,400	7.43	32,692.00
YUTONG BUS CO LTD-A	4,900	20.95	102,655.00
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	4,100	18.32	75,112.00
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	420	49.17	20,651.40
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	3,800	16.01	60,838.00
ZHEJIANG WEIXING NEW BUILD-A	1,300	13.58	17,654.00
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-A	800	54.15	43,320.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	15,500	6.31	97,805.00
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	1,800	27.75	49,950.00
ZHEJIANG WEIMING ENVIRONME-A	2,340	18.40	43,056.00
AIR CHINA LTD-A	23,900	7.20	172,080.00
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	98,300	5.71	561,293.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	33,300	3.76	125,208.00
CHINA MERCHANTS EXPRESSWAY-A	10,700	12.59	134,713.00
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	17,600	5.68	99,968.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	23,670	12.27	290,430.90
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	34,900	6.83	238,367.00
GUANGZHOU BAIYUN INTERNATI-A	5,000	9.22	46,100.00
HAINAN AIRLINES HOLDING CO-A	81,700	1.08	88,236.00
JUNEYAO AIRLINES CO LTD-A	3,500	11.20	39,200.00
LIAONING PORT CO LTD-A	21,900	1.25	27,375.00

S F HOLDING CO LTD-A	8,600	33.75	290,250.00
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	2,100	33.44	70,224.00
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	8,900	6.06	53,934.00
SPRING AIRLINES CO LTD-A	1,900	50.43	95,817.00
YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	7,400	14.37	106,338.00
YUNDA HOLDING CO LTD-A	4,870	6.71	32,677.70
AIMA TECHNOLOGY GROUP CO L-A	1,700	26.67	45,339.00
ANHUI JIANGHUI AUTO GROUP-A	4,300	19.02	81,786.00
BAIC BLUEPARK NEW ENERGY -A	10,900	7.59	82,731.00
BETHEL AUTOMOTIVE SAFETY S-A	1,260	35.53	44,767.80
BYD CO LTD -A	3,500	226.60	793,100.00
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	700	117.10	81,970.00
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	17,126	13.13	224,864.38
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	3,400	45.30	154,020.00
GREAT WALL MOTOR CO LTD-A	6,400	22.02	140,928.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A	6,900	7.51	51,819.00
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	7,100	14.32	101,672.00
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	1,000	84.60	84,600.00
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	1,200	13.90	16,680.00
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	2,755	32.75	90,226.25
SAIC MOTOR CORP LTD-A	14,310	13.33	190,752.30
SAILUN GROUP CO LTD-A	6,100	12.20	74,420.00
SERES GROUP CO L-A	3,100	75.69	234,639.00
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	1,300	16.17	21,021.00
SHENZHEN KEDALI INDUSTRY C-A	400	71.06	28,424.00
ZHEJIANG WANFENG AUTO -A	4,500	12.52	56,340.00
BEIJING ROBOROCK TECHNOLOG-A	392	214.17	83,954.64
ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A	600	37.94	22,764.00
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	6,000	40.12	240,720.00
HAIER SMART HOME CO LTD-A	11,600	24.94	289,304.00
HANG ZHOU GREAT STAR INDUS-A	2,700	23.71	64,017.00
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	1,000	20.38	20,380.00
HISENSE HOME APPLIANCES G-A	1,800	26.10	46,980.00
HISENSE VISUAL TECH CO LTD-A	2,900	17.26	50,054.00
JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	1,040	26.49	27,549.60
MIDEA GROUP CO LTD-A	6,700	60.90	408,030.00
OPPEIN HOME GROUP INC-A	1,040	51.12	53,164.80
SICHUAN CHANGHONG ELECTRIC-A	10,300	4.14	42,642.00
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	1,700	48.72	82,824.00
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	1,700	22.99	39,083.00
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	5,080	7.96	40,436.80
37 INTERACTIVE ENTERTAINME-A	3,900	13.22	51,558.00
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	1,300	7.21	9,373.00

CHINA FILM CO LTD-A	4,000	10.39	41,560.00
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	32,600	5.91	192,666.00
JIANGSU PHOENIX PUBLISH-A	5,500	10.65	58,575.00
KINGNET NETWORK CO LTD-A	4,600	9.48	43,608.00
KUNLUN TECH CO LTD-A	2,500	28.01	70,025.00
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	3,110	20.63	64,159.30
ORIENTAL PEARL GROUP CO LT-A	7,300	6.26	45,698.00
PEOPLE.CN CO LTD-A	2,000	18.38	36,760.00
WANDA FILM HOLDING CO LTD-A	4,500	10.38	46,710.00
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	17,100	3.13	53,523.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	3,400	63.24	215,016.00
HLA GROUP CORP L-A	9,300	6.18	57,474.00
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	5,000	5.37	26,850.00
WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A	6,000	4.33	25,980.00
ZHEJIANG CHINA COMMODITIES-A	13,000	7.44	96,720.00
DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	1,036	13.02	13,488.72
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	2,596	20.40	52,958.40
ANGEL YEAST CO LTD-A	700	30.30	21,210.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	800	181.58	145,264.00
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	500	37.35	18,675.00
ANHUI YINGJIA DISTILLERY C-A	1,600	50.10	80,160.00
ANJOY FOODS GROUP CO LTD	400	78.56	31,424.00
BEIJING YANJING BREWERY CO-A	3,900	9.85	38,415.00
CHONGQING BREWERY CO-A	800	60.65	48,520.00
EASTROC BEVERAGE GROUP CO -A	800	237.10	189,680.00
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	8,170	34.59	282,600.30
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	2,800	40.31	112,868.00
HEBEI YANGYUAN ZHIHUI BEVERA	2,600	21.35	55,510.00
HEILONGJIANG AGRICULTURE-A	2,500	13.22	33,050.00
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	7,400	22.41	165,834.00
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	11,500	23.84	274,160.00
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	2,000	43.22	86,440.00
JIANGSU YANGHE DISTILLERY-A	2,700	78.53	212,031.00
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	300	18.07	5,421.00
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	2,400	1,413.30	3,391,920.00
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	2,800	125.20	350,560.00
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	11,016	44.00	484,704.00
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	7,600	9.59	72,884.00
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	2,320	185.55	430,476.00
SHEDE SPIRITS CO LTD-A	700	53.00	37,100.00
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	400	35.17	14,068.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-A	1,500	64.67	97,005.00
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	12,460	19.78	246,458.80

WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	7,600	124.33	944,908.00
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	2,200	25.83	56,826.00
BY-HEALTH CO LTD-A	1,300	11.33	14,729.00
YUNNAN BOTANEE BIO-TECHNOL-A	400	44.18	17,672.00
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	17,368	10.59	183,927.12
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD-A	1,000	40.47	40,470.00
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	3,300	29.56	97,548.00
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	700	28.29	19,803.00
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	2,940	28.38	83,437.20
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A	3,000	35.08	105,240.00
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	10,763	4.66	50,155.58
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	1,900	11.90	22,610.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	4,400	19.42	85,448.00
SHANGHAI UNITED IMAGING HE-A	1,800	115.49	207,882.00
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	2,300	252.04	579,692.00
SHENZHEN NEW INDUSTRIES BI-A	1,500	63.34	95,010.00
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	680	67.00	45,560.00
BEIJING Tiantan Biological-A	3,960	24.35	96,426.00
BEIJING TONGRENTANG CO-A	2,300	36.08	82,984.00
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	1,715	66.00	113,190.00
BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY COR-A	800	61.82	49,456.00
CHANGCHUN HIGH-TECH INDUST-A	700	89.55	62,685.00
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	1,950	42.45	82,777.50
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	4,050	24.81	100,480.50
CSPC INNOVATION PHARMACEUT-A	3,480	23.08	80,318.40
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	1,200	49.01	58,812.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	300	52.20	15,660.00
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	4,680	15.69	73,429.20
HUBEI JUMPCAN PHARMACEUT-A	1,300	33.08	43,004.00
HUMANWELL HEALTHCARE GROUP-A	3,800	19.75	75,050.00
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	560	166.60	93,296.00
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	11,616	42.50	493,680.00
JIANGSU NHWA PHARMACEUTICA-A	2,200	26.28	57,816.00
JOINCARE PHARMACEUTICAL GR-A	1,600	10.45	16,720.00
LIVZON PHARMACEUTICAL GROU-A	500	37.16	18,580.00
MGI TECH CO LTD-A	906	38.93	35,270.58
PHARMARON BEIJING CO LTD-A	3,675	20.39	74,933.25
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	3,600	23.34	84,024.00
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	10,500	7.53	79,065.00
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	960	14.99	14,390.40
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	1,700	28.50	48,450.00
SHIJIAZHANG YILING PHARMA-A	2,600	17.47	45,422.00
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	2,400	30.84	74,016.00

WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	3,000	11.06	33,180.00
WUXI APPTEC CO LTD-A	4,728	39.87	188,505.36
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	4,160	53.53	222,684.80
ZHANGZHOU PIENZHEHUANG PHA-A	1,100	206.18	226,798.00
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	1,210	17.55	21,235.50
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	165,500	4.66	771,230.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	40,600	5.42	220,052.00
BANK OF CHANGSHA CO LTD-A	7,500	7.47	56,025.00
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	5,400	14.19	76,626.00
BANK OF CHINA LTD-A	64,800	4.72	305,856.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	77,900	7.53	586,587.00
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	13,000	12.84	166,920.00
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	33,900	7.59	257,301.00
BANK OF NANJING CO LTD -A	20,000	9.92	198,400.00
BANK OF NINGBO CO LTD -A	11,700	20.07	234,819.00
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	24,610	7.28	179,160.80
BANK OF SUZHOU CO LTD-A	5,100	6.98	35,598.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	20,400	7.64	155,856.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	78,400	3.12	244,608.00
CHINA MERCHANTS BANK-A	39,600	31.86	1,261,656.00
CHINA MINSHENG BANKING-A	67,800	3.40	230,520.00
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	42,270	2.81	118,778.70
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-A	26,300	5.08	133,604.00
CNPC CAPITAL CO LTD-A	10,900	5.37	58,533.00
HUAXIA BANK CO LTD-A	24,300	6.13	148,959.00
IND & COMM BK OF CHINA-A	122,400	6.02	736,848.00
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	37,400	16.28	608,872.00
PING AN BANK CO LTD-A	34,400	9.92	341,248.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	53,700	4.79	257,223.00
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	52,600	8.57	450,782.00
SHANGHAI RURAL COMMERCIAL -A	18,900	6.28	118,692.00
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A	13,900	2.27	31,553.00
BOC INTERNATIONAL CHINA CO-A	3,000	9.11	27,330.00
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	8,800	6.63	58,344.00
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	6,800	5.04	34,272.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-A	12,100	10.63	128,623.00
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	12,900	6.77	87,333.00
CHINA INTERNATIONAL CAPTAL-A	4,300	28.53	122,679.00
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	17,100	14.59	249,489.00
CITIC SECURITIES CO-A	24,800	18.85	467,480.00
CSC FINANCIAL CO LTD-A	7,500	19.34	145,050.00
DONGXING SECURITIES CO LT-A	6,200	8.35	51,770.00
EAST MONEY INFORMATION CO-A	27,812	10.65	296,197.80

EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	6,600	14.77	97,482.00
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	9,400	5.27	49,538.00
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	17,000	7.32	124,440.00
GF SECURITIES CO LTD-A	9,500	11.94	113,430.00
GUANGZHOU YUEXIU CAPITAL H-A	4,374	5.10	22,307.40
GUOLIAN SECURITIES CO LTD-A	2,200	9.97	21,934.00
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	11,300	8.94	101,022.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	14,700	14.00	205,800.00
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	9,500	6.41	60,895.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	18,700	8.46	158,202.00
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	1,000	101.43	101,430.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	13,100	12.78	167,418.00
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	16,300	5.25	85,575.00
NANJING SECURITIES CO LTD	7,600	7.66	58,216.00
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	15,100	8.53	128,803.00
SDIC CAPITAL CO LTD-A	11,000	5.79	63,690.00
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	45,600	4.62	210,672.00
SINOLINK SECURITIES CO LTD-A	7,700	7.55	58,135.00
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	9,700	6.10	59,170.00
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	3,800	3.80	14,440.00
TIANFENG SECURITIES CO LTD-A	19,400	2.56	49,664.00
WESTERN SECURITIES CO LTD-A	10,000	6.32	63,200.00
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	6,000	11.13	66,780.00
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD-A	10,500	5.84	61,320.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	4,500	29.44	132,480.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	12,800	27.64	353,792.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	3,800	28.92	109,896.00
PICC HOLDING CO-A	15,500	5.45	84,475.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	21,100	40.49	854,339.00
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	11,700	7.15	83,655.00
BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	1,200	188.25	225,900.00
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	1,170	28.45	33,286.50
EMPYREAN TECHNOLOGY CO LTD-A	700	72.58	50,806.00
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	3,073	16.49	50,673.77
IFLYTEK CO LTD - A	4,300	34.67	149,081.00
ISOFTSTONE INFORMATION TEC-A	1,900	31.38	59,622.00
RANGE INTELLIGENT COMPUTI-A	3,200	20.97	67,104.00
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	900	47.30	42,570.00
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	3,594	30.21	108,574.74
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	900	39.04	35,136.00
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	5,908	8.67	51,222.36
ACCELINK TECHNOLOGIES CO -A	1,900	29.53	56,107.00
ANKER INNOVATIONS TECHNOLO-A	1,040	53.35	55,484.00

AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A	4,500	33.90	152,550.00
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	69,600	3.72	258,912.00
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	4,500	31.22	140,490.00
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	6,700	7.85	52,595.00
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-A	11,000	5.67	62,370.00
CHINA ZHENHUA GROUP SCIENC-A	1,200	37.89	45,468.00
EOPTOLINK TECHNOLOGY INC L-A	1,400	95.00	133,000.00
EVERDISPLAY OPTRONICS SHAN-A	23,718	2.05	48,621.90
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	24,800	21.38	530,224.00
GOERTEK INC -A	6,100	20.60	125,660.00
GRG BANKING EQUIPMENT CO -A	2,200	9.36	20,592.00
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	22,300	6.74	150,302.00
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICAT-A	7,600	9.41	71,516.00
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	1,500	28.54	42,810.00
HENGDIAN GROUP DMEGC -A	2,700	12.23	33,021.00
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO-A	3,700	13.58	50,246.00
HUAGONG TECH CO LTD-A	2,700	28.72	77,544.00
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	2,400	32.81	78,744.00
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	9,600	16.91	162,336.00
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	14,233	36.57	520,500.81
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	1,076	69.59	74,878.84
NINESTAR CORP-A	1,800	23.80	42,840.00
OFILM GROUP CO LTD-A	7,700	7.65	58,905.00
SHANGHAI BOCHU ELECTRONIC-A	392	145.95	57,212.40
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	4,500	18.70	84,150.00
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	780	108.20	84,396.00
SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	2,511	75.14	188,676.54
SUPCON TECHNOLOGY CO LTD-A	870	36.59	31,833.30
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	3,300	22.45	74,085.00
SUZHOU TFC OPTICAL COMMUNI-A	1,120	83.35	93,352.00
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	31,790	3.70	117,623.00
UNISPLENDOR CORP LTD-A	4,876	19.89	96,983.64
UNIVERSAL SCIENTIFIC INDUS-A	3,800	15.16	57,608.00
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	2,700	26.80	72,360.00
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	3,464	6.18	21,407.52
WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHA-A	3,860	32.81	126,646.60
XIAMEN FARATRONIC CO LTD-A	400	79.82	31,928.00
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	2,240	32.40	72,576.00
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	6,300	13.74	86,562.00
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	2,380	115.78	275,556.40
ZTE CORP-A	8,500	25.72	218,620.00
CHINA UNITED NETWORK-A	59,700	4.50	268,650.00
CGN POWER CO LTD-A	40,600	4.77	193,662.00

CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	38,100	11.02	419,862.00
CHINA THREE GORGES RENEWAB-A	53,300	4.67	248,911.00
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	47,200	29.55	1,394,760.00
DATANG INTL POWER GEN CO-A	20,000	2.88	57,600.00
ENN NATURAL GAS CO LTD-A	4,800	18.98	91,104.00
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	40,500	5.61	227,205.00
HUADIAN POWER INTL CORP-A	12,500	5.57	69,625.00
HUANENG POWER INTL INC-A	18,200	7.39	134,498.00
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	13,800	16.78	231,564.00
SHANGHAI ELECTRIC POWER CO-A	7,100	8.95	63,545.00
SHENERGY COMPANY LIMITED	9,900	8.34	82,566.00
SHENZHEN ENERGY GROUP CO L-A	11,600	6.66	77,256.00
SICHUAN CHUANOU ENERGY CO-A	9,000	18.59	167,310.00
WINTIME ENERGY GROUP CO LTD	47,800	1.15	54,970.00
ZHEJIANG ZHENENG ELECTRIC-A	21,300	6.62	141,006.00
ACM RESEARCH SHANGHAI I-A	630	92.31	58,155.30
ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	1,143	147.72	168,843.96
AMLOGIC SHANGHAI INC-A	600	57.35	34,410.00
CAMBRICON TECHNOLOGIES-A	800	241.68	193,344.00
CHINA RESOURCES MICROELECT-A	2,200	36.11	79,442.00
FLAT GLASS GROUP CO LTD-A	2,300	18.22	41,906.00
GALAXYCORE INC-A	3,767	11.18	42,115.06
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR I-A	1,356	78.23	106,079.88
HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	7,912	15.41	121,923.92
HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	2,000	20.41	40,820.00
HWATSING TECHNOLOGY CO LTD-A	512	136.69	69,985.28
HYGON INFORMATION TECHNOLO-A	4,600	73.57	338,422.00
INGENIC SEMICONDUCTOR CO -A	1,200	48.25	57,900.00
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	6,612	10.44	69,029.28
JCET GROUP CO LTD-A	3,800	31.02	117,876.00
JIANGSU PACIFIC QUARTZ CO -A	1,050	26.04	27,342.00
JINKO SOLAR CO LTD-A	13,400	6.90	92,460.00
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	12,936	13.82	178,775.52
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A	2,264	53.75	121,690.00
NATIONAL SILICON INDUSTRY -A	5,600	15.18	85,008.00
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	900	315.45	283,905.00
PIOTECH INC-A	438	125.00	54,750.00
ROCKCHIP ELECTRONICS CO L-A	900	55.40	49,860.00
SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	9,900	11.25	111,375.00
SG MICRO CORP-A	1,007	68.99	69,472.93
SHANGHAI AIKO SOLAR ENERGY-A	3,220	8.67	27,917.40
SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY-A	1,000	59.15	59,150.00
STARPOWER SEMICONDUCTOR LT-A	280	80.69	22,593.20

	SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	409	98.80	40,409.20
	TCL ZHONGHUAN RENEWABLE EN-A	8,075	8.10	65,407.50
	TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	1,900	7.87	14,953.00
	TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	3,200	20.60	65,920.00
	TONGWEI CO LTD-A	8,700	18.87	164,169.00
	TRINA SOLAR CO LTD-A	3,200	16.94	54,208.00
	UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	1,819	49.52	90,076.88
	WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	2,185	93.15	203,532.75
	XINJIANG DAQO NEW ENERGY C-A	3,600	19.44	69,984.00
	ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	3,900	26.79	104,481.00
	CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	19,800	8.71	172,458.00
	HAINAN AIRPORT INFRASTRUCT-A	21,800	3.36	73,248.00
	POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	26,600	8.16	217,056.00
	SHANGHAI LINGANG HOLDINGS-A	7,280	9.11	66,320.80
	SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A	3,900	17.74	69,186.00
	YOUNGOR FASHION CO LTD	14,000	7.54	105,560.00
	オフショア人民元 小計	5,059,309		64,198,588.13 (1,322,747,709)
サウジアラビア リアル	ADES HOLDING CO	10,805	20.80	224,744.00
	SAUDI ARABIAN OIL CO	114,609	28.15	3,226,243.35
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	3,568	38.80	138,438.40
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	7,303	116.00	847,148.00
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	11,987	27.60	330,841.20
	SAUDI ARABIAN MINING CO	40,896	40.90	1,672,646.40
	SAUDI ARAMCO BASE OIL CO	1,626	130.60	212,355.60
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	28,460	74.50	2,120,270.00
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	10,923	18.72	204,478.56
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	21,550	8.10	174,555.00
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	8,796	38.70	340,405.20
	SAL SAUDI LOGISTICS SERVICES	823	293.80	241,797.40
	SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	1,076	249.00	267,924.00
	JARIR MARKETING CO	19,801	12.74	252,264.74
	NAHDI MEDICAL CO	1,177	128.40	151,126.80
	ALMARAI CO	7,936	56.70	449,971.20
	SAVOLA	7,913	41.20	326,015.60
	DALLAH HEALTHCARE CO	1,090	165.60	180,504.00
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	2,772	288.00	798,336.00
	MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	3,089	109.20	337,318.80
	AL RAJHI BANK	61,780	84.00	5,189,520.00
	ALINMA BANK	37,481	31.45	1,178,777.45
	ARAB NATIONAL BANK	28,242	20.14	568,793.88
	BANK AL-JAZIRA	16,766	16.78	281,333.48
	BANK ALBILAD	19,200	38.70	743,040.00

BANQUE SAUDI FRANSI	18,465	34.25	632,426.25	
RIYAD BANK	44,963	24.84	1,116,880.92	
SAUDI AWWAL BANK	31,852	37.15	1,183,301.80	
SAUDI INVESTMENT BANK/THE	20,518	12.56	257,706.08	
THE SAUDI NATIONAL BANK	92,723	34.90	3,236,032.70	
SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING	1,595	234.00	373,230.00	
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	2,528	232.80	588,518.40	
CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	2,200	166.40	366,080.00	
ARABIAN INTERNET & COMMUNICA	788	295.00	232,460.00	
ELM CO	746	986.00	735,556.00	
ETIHAD ETISALAT CO	11,843	52.70	624,126.10	
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	13,459	10.54	141,857.86	
SAUDI TELECOM CO	63,223	39.25	2,481,502.75	
ACWA POWER CO	4,639	388.80	1,803,643.20	
POWER & WATER UTILITY CO FOR	2,042	57.80	118,027.60	
SAUDI ELECTRICITY CO	26,234	16.90	443,354.60	
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	18,952	13.68	259,263.36	
サウジアラビアリアル 小計	826,439		35,052,816.68 (1,378,977,808)	
合計	116,483,794		34,742,071,116 (34,742,071,116)	

(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	2,210,876.00	
		OPERADORA DE SITIS MEX- A-1	42,600	702,900.00	
		PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA	21,279	1,496,126.49	
		メキシコペソ 小計	153,679	4,409,902.49 (34,552,467)	
	合計		34,552,467 (34,552,467)		

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式 33銘柄	100.0%		2.5%
メキシコペソ	株式 21銘柄	95.4%		2.1%
	投資証券 3銘柄		4.6%	0.1%
ブラジルリアル	株式 48銘柄	100.0%		4.7%
チリペソ	株式 12銘柄	100.0%		0.4%
コロンビアペソ	株式 3銘柄	100.0%		0.1%

ユーロ	株式	10銘柄	100.0%		0.5%
トルコリラ	株式	17銘柄	100.0%		0.7%
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%		0.2%
ポーランドズロチ	株式	13銘柄	100.0%		0.9%
ロシアルーブル	株式	14銘柄			
香港ドル	株式	153銘柄	100.0%		18.6%
マレーシアリングット	株式	32銘柄	100.0%		1.5%
タイバーツ	株式	31銘柄	100.0%		1.4%
フィリピンペソ	株式	13銘柄	100.0%		0.6%
インドネシアルピア	株式	21銘柄	100.0%		1.7%
韓国ウォン	株式	98銘柄	100.0%		11.7%
新台湾ドル	株式	88銘柄	100.0%		18.9%
インドルピー	株式	146銘柄	100.0%		19.6%
カタールリアル	株式	13銘柄	100.0%		0.8%
南アフリカランド	株式	32銘柄	100.0%		3.1%
アラブディルハム	株式	11銘柄	100.0%		1.2%
クウェートディナール	株式	6銘柄	100.0%		0.8%
オフショア人民元	株式	480銘柄	100.0%		3.8%
サウジアラビアリアル	株式	42銘柄	100.0%		4.0%

(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。

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2024年 8月30日現在です。

【Smart-i DC 全世界株式インデックス】

【純資産額計算書】

資産総額	1,183,765,896円
負債総額	1,026,572円
純資産総額（ - ）	1,182,739,324円
発行済口数	956,657,856口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2363円

（参考）

RM MSCI ジャパン・インデックスマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	1,345,912,679円
負債総額	49,623,221円
純資産総額（ - ）	1,296,289,458円
発行済口数	864,279,184口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4999円

RM先進国株式マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	328,557,818,715円
負債総額	1,834,504,055円
純資産総額（ - ）	326,723,314,660円
発行済口数	103,713,368,495口
1口当たり純資産額（ / ）	3.1503円

RM新興国株式マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	37,065,340,704円
負債総額	300,910,245円
純資産総額（ - ）	36,764,430,459円
発行済口数	18,617,828,153口
1口当たり純資産額（ / ）	1.9747円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換

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

(2) 受益者に対する特典

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

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

2024年8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8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8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	166	1,878,645
単位型株式投資信託	9	45,494
単位型公社債投資信託	11	19,290
合計	186	1,943,430

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	当期末	増加	減少	当期末
普通株式（株）	3,960,000	-	-	3,960,000

2. 配当に関する事項

(1) 当会計年度中の配当金支払額
該当事項はありません。

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

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

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針
資金運用については、短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

(単位：千円)

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

(注) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

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

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

(単位：千円)

	貸借対照表 計上額	時価	差額
投資有価証券	106,647	106,647	-
資産計	106,647	106,647	-

(注) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

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

その他	-	68,696	6,973	3,974
合計	-	68,696	6,973	3,974

3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

前事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

(単位：千円)

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

当事業年度(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

(単位：千円)

区分	時価			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
投資有価証券 投資信託	-	106,647	-	106,647
資産計	-	106,647	-	106,647

(有価証券関係)

1. その他有価証券

前事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

(単位：千円)

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

当事業年度(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

(単位：千円)

	種類	貸借対照表計上額	取得原価	差額
	貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	(1)株式	-	-
(2)債券		-	-	-
(3)その他		50,401	41,986	8,415
小計		50,401	41,986	8,415
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	-	-	-
	(3)その他	56,245	58,529	2,283
	小計	56,245	58,529	2,283
合計		106,647	100,515	6,132

2. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

(単位：千円)

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
----	-----	---------	---------

投資信託	9,274	564	290
合計	9,274	564	290

当事業年度(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

(単位:千円)

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
投資信託	12,985	2,000	15
合計	12,985	2,000	15

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

前事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

法定実効税率	30.61%
(調整)	
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.04%
住民税均等割	0.08%
その他	0.32%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	30.41%

当事業年度(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

法定実効税率	30.62%
(調整)	
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.02%
住民税均等割	0.07%
その他	0.01%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	30.72%

3. 法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果の会計処理

当社は、グループ通算制度を適用しており、「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」(実務対応報告第42号 2021年8月12日)に従って、法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理並びに開示を行っております。

(収益認識関係)

1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

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

2. 収益を理解するための基礎となる情報

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

3. 当事業年度及び翌事業年度以降の収益の金額を理解するための情報

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(セグメント情報等)

前事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

1. セグメント情報

当社は、「資産運用業」の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

(単位：千円)

顧客の名称又は氏名	営業収益額
株式会社りそな銀行	5,545,681

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

1. セグメント情報

当社は、「資産運用業」の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

(単位：千円)

顧客の名称又は氏名	営業収益額
株式会社りそな銀行	6,148,663

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

前事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

1. 関連当事者との取引

(1) 兄弟会社等

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

						支払手数料 (注3)	801,950	未払 手数料	161,752
--	--	--	--	--	--	---------------	---------	-----------	---------

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

2. 親会社に関する注記

親会社情報

株式会社りそなホールディングス(東京証券取引所に上場)

当事業年度(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(1) 兄弟会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は 出資金 (百万円)	事業の 内容	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円) (注4)
親会社 の子会社	株式会社 りそな銀行	大阪市 中央区	279,928	銀行業務 及び 信託業務	-	投資信託の 販売委託 投資助言 投資一任	運用受託 報酬 (注1)	5,325,355	未収運用 受託報酬	2,985,561
							投資助言 報酬 (注2)	823,308	未収投資 助言報酬	463,233
							支払手数料 (注3)	964,675	未払 手数料	215,271

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

2. 親会社に関する注記

親会社情報

株式会社りそなホールディングス(東京証券取引所に上場)

(1) 株当たり情報

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
1株当たり純資産額	3,248円70銭	4,141円89銭
1株当たり当期純利益金額又は 1株当たり当期純損失()	800円86銭	892円02銭

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

(注) 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
当期純利益又は当期純損失()(千円)	3,171,401	3,532,410
普通株主に帰属しない金額(千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益又は 当期純損失()(千円)	3,171,401	3,532,410
普通株式の期中平均株式数(株)	3,960,000	3,960,000

(重要な後発事象)

前事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

- (1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
(2) 運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
(3) 通常取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関

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

- (4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。
- (5) 上記(3)、(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であつて、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

- (1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項
該当事項はありません。
- (2) 訴訟事件その他の重要事項
委託会社に重要な影響を与えた事実、または与えると予想される訴訟事件などは発生していません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名 称	資本金の額 (2024年3月末現在)	事業の内容
株式会社りそな銀行	279,928百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

<再信託受託会社の概要>

名称 : 株式会社日本カストディ銀行

資本金の額 : 51,000百万円(2024年3月末現在)

事業の内容 : 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

再信託の目的 : 原信託契約にかかる信託業務の一部(信託財産の管理)を原信託受託者から再信託受託者(株式会社日本カストディ銀行)へ委託するため、原信託財産のすべてを再信託受託者へ移管することを目的とします。

(2) 販売会社

名 称	資本金の額 (2024年3月末現在)	事業の内容
株式会社りそな銀行	279,928百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

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

3【資本関係】

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

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2024年 6月24日	有価証券届出書の訂正届出書
2024年 6月24日	半期報告書

独立監査人の監査報告書

2024年5月22日

りそなアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中有限責任監査法人トーマツ
東京事務所指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 松崎 雅則指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 石坂 武嗣

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているりそなアセットマネジメント株式会社の2023年4月1日から2024年3月31日までの第9期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、りそなアセットマネジメント株式会社の2024年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

監査等委員会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

監査人は、監査等委員会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去するための対応策を講じている場合又は阻害要因を許容可能な水準にまで軽減するためのセーフガードを適用している場合はその内容について報告を行う。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

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

独立監査人の監査報告書

2024年10月30日

りそなアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 鈴木 健嗣
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているSmart-i DC 全世界株式インデックスの2023年9月25日から2024年8月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、Smart-i DC 全世界株式インデックスの2024年8月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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