【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20日提出
【計算期間】	第4期(自　2023年8月22日至　2024年8月20日)
【ファンド名】	埼玉りそな・グローバルバランス・プラスＥＳＧ
【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】

① ファンドの目的
安定した収益の確保と信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

② ファンドの基本的性格

１）商品分類

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

２）属性区分

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式	年１回	グローバル（含む日本）		
一般				
大型株	年２回			
中小型株		日本		
	年４回			
債券		北米	ファミリーファンド	あり（部分ヘッジ）
一般	年６回			
公債	（隔月）	欧州		
社債				
その他債券	年12回	アジア		
クレジット属性	（毎月）			
（　　）		オセアニア		
	日々			
不動産投信		中南米	ファンド・オブ・ファンズ	なし
	その他			
その他資産（投資信託証券（資産複合（債券、株式、不動産投信）資産配分変更型））	（　）	アフリカ		
		中近東（中東）		
		エマージング		
資産複合（　　）				
資産配分固定型				
資産配分変更型				

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

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

＜商品分類の定義＞

1. 単位型投信・追加型投信の区分
(1)単位型投信：当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行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
①一般：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。
②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。
③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
①一般：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。
②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。
③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。
④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。
⑤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①から④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①から④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。
①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。
②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
①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。
②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。
③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。
④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。
⑤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。
⑥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。
⑦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)
①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。
②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。
③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。
④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。
⑤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。

⑥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。
⑦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。
⑧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。
⑨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。
⑩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
①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。
②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
①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。
②為替ヘッジなし：目論見書又は投資信託約款において、為替のヘッジを行なわない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行なう旨の記載がないものをいう。

6. インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分
①日経225
②TOPIX
③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
①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。
②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。
③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。
④その他型：目論見書又は投資信託約款において、上記①から③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。

③　ファンドの特色

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

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

※ 2024年8月30日現在、上記の組入比率は、以下の通りです。

	組入比率
①特にESG/SDGsを重視した運用を行うマザーファンド	69.5%
②埼玉に関連した運用を行うマザーファンド	15.4%
①と②の合計	84.8%

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

- 先進国債券、国内株式および先進国株式に投資を行う4つのマザーファンドにおいて、特にESG/SDGsを重視した運用*1を行います。
  - RM米ドル建SDGs債券マザーファンド(為替ヘッジあり)およびRMユーロ建SDGs債券マザーファンド(為替ヘッジあり)は、残存期間が10年程度までのSDGs債*2および先進国(日本を除く)の国債を、各残存期間の投資金額がほぼ同程度となるように組み入れることにより、金利変動に対するリスク分散効果や、利息収入の平準化を図り、安定した収益の確保を目指します。
  - RM国内株式ESGマザーファンドおよびRM先進国株式ESGマザーファンドは、ESG関連インデックス*3に連動する投資成果を目指します。

- 国内債券に投資を行うマザーファンドにおいて、埼玉に関連した運用を行い、埼玉県が発行する公募地方債も主要投資対象とします*4。
  - RM国内債券マザーファンド(埼玉重視型)は、投資するわが国の国債および埼玉県が発行する公募地方債の残存年限を幅広く分散させることにより、金利変動に対するリスク分散効果や、利息収入の平準化を図り、安定した収益の確保を目指します。

*1 ESG/SDGsを重視した運用の詳細は、「ESG/SDGsを重視した運用について」をご参照ください。
*2 マザーファンドにおける投資対象としてのSDGs債の詳細は、「ESG/SDGsを重視した運用について」をご参照ください。SDGs債の発行状況や市況状況および純資産総額の水準等により、SDGs債への投資比率が低位となる場合があります。
*3 ESG関連インデックスとは、MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数(配当込み)およびMSCI-KOKUSAI ESG リーダーズ指数(配当込み、円換算ベース)をいいます。詳細は、「ESG/SDGsを重視した運用について」をご参照ください。
*4 埼玉県が発行する公募地方債の発行状況や市況状況および純資産総額の水準等により、当該地方債に投資を行わない、もしくは投資比率が低位となる場合があります。

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

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

■ 特にESG/SDGsを重視した運用を行うマザーファンド　■ 埼玉に関連した運用を行うマザーファンド
＊ 発行国が先進国以外の場合があります。
※各対象指数については、「各マザーファンドが対象とする指数の著作権等について」をご参照ください。

ESGとは

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

SDGsとは

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

2 中長期的な運用に理想的なポートフォリオ構築を目指します。

- 独自の定量モデルを用いて算出した基本的資産配分比率に基づき、ポートフォリオを構築します。
基本的資産配分比率は、原則として年1回程度見直します。

当ファンドでは、過去に起きていなかった事象も今後起こり得ると考え、過去のデータをランダムに組み合わせ、将来起こり得る可能性のある数万通りのシナリオを作成します。このように作成されたマーケット・シナリオを用いてシミュレーションを行い、中長期的な運用に最適と考えられるポートフォリオを構築します。

運用プロセスのイメージ

マーケットシナリオの作成

投資対象資産の過去の収益率データなどを分析し、ランダムに組み合わせる事によって、将来起こり得る可能性があると考えられる、数万通りのマーケットシナリオを作成

▼

基本的資産配分比率の算出(原則として年1回程度見直し)

数万通りのマーケットシナリオを用い、独自の定量モデルによって中長期的な運用に最適と考えられる基本的資産配分比率を算出

▼

ポートフォリオ構築

基本的資産配分比率に基づき、ポートフォリオを構築

※上記の運用プロセスおよびイメージ図は、今後変更になる場合があります。

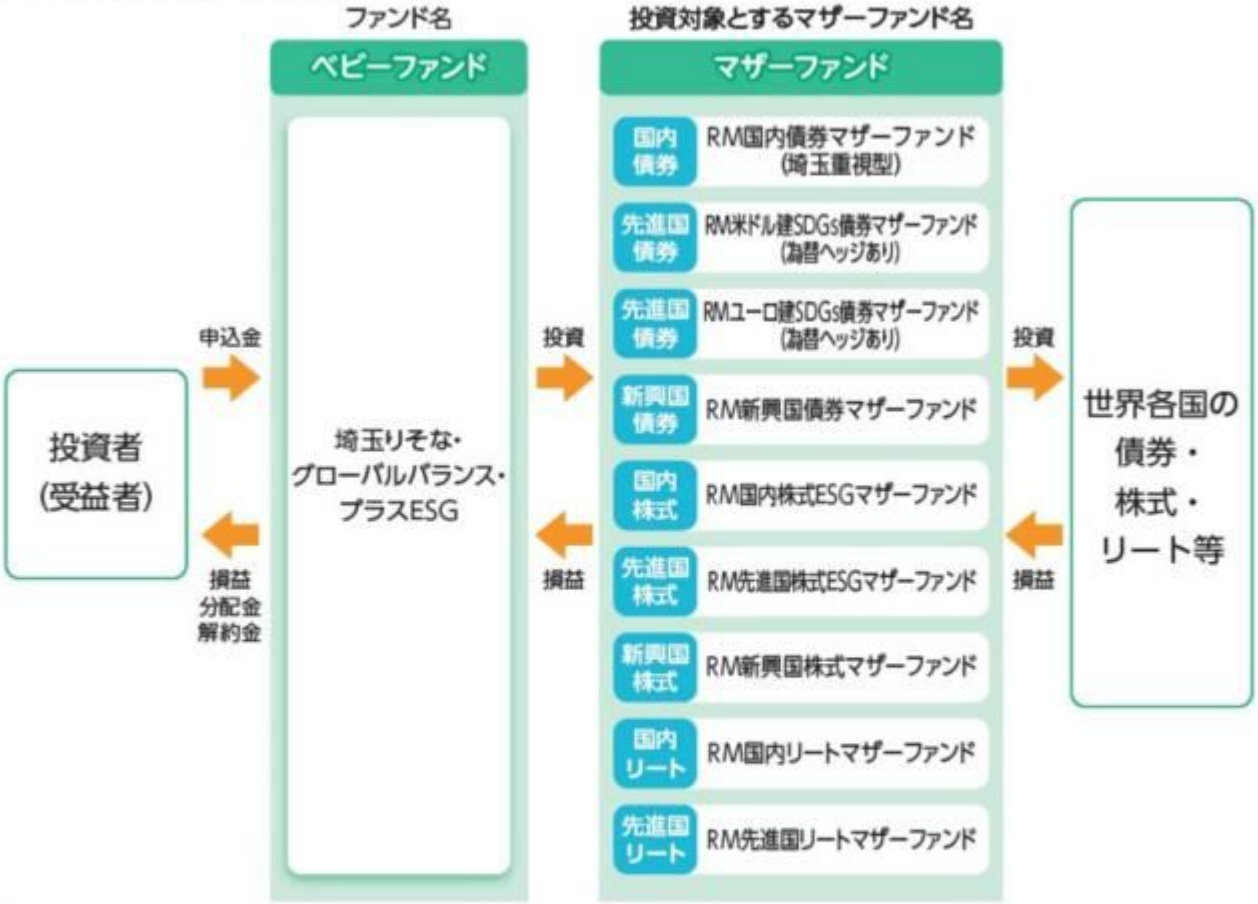
3 実質組入外貨建資産の一部について、対円での為替ヘッジを行います。

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

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

ファンドの仕組み

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



主な投資制限

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

分配方針

原則、毎年8月20日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、以下の収益分配方針に基づいて分配を行います。
①分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等とします。
②原則として、基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。
③留保益は、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。

各マザーファンドが対象とする指数の著作権等について

- **RM新興国債券マザーファンド**

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

- **RM国内株式ESGマザーファンド**

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

- **RM先進国株式ESGマザーファンド**

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

- **RM新興国株式マザーファンド**

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

- **RM国内リートマザーファンド**

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

- **RM先進国リートマザーファンド**

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

ESG/SDGsを重視した運用について

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

－先進国債券の投資について－

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

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

※SDGs債券マザーファンドそれぞれにおけるSDGs債の組入比率は合計90%以上とすることを目標としています。
※SDGs債の発行状況や市況状況および純資産総額の水準等により、SDGs債への投資比率が低位となる場合があります。

《 代表的なSDGs債の種類と特徴 》

代表的なSDGs債の種類	概要	特徴
グリーン・ボンド	温暖化問題、再生可能エネルギー等、環境プロジェクトに充当するために発行する債券です。	●以下の4要素の観点から、それぞれの債券の要件が設定されています。 ・資金調達の使途 ・プロジェクトの評価と選定のプロセス ・調達資金の管理 ・レポーティング ●要件のほか、発行体に対する推奨項目も設定されています。 ・フレームワーク等によって、原則やガイドラインへの適合性等を説明すること ・外部評価機関を用いて、原則やガイドラインへの適合性を評価したり、資金管理の検証等を行うこと など
ソーシャル・ボンド	貧困問題、女性活躍の機会増進など、社会的課題解決のためのプロジェクトに充当するために発行する債券です。	
サスティナブル・ボンド	グリーンとソーシャル両方のプロジェクト、両方の性格を持つプロジェクトに充当するために発行する債券です。	

※上記の記載内容については、今後変更される可能性があります。

－国内株式および先進国株式の投資について－

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

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

・MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数（配当込み）は、MSCI Inc.が開発し、国内株式を対象とした株価指数であるMSCI ジャパン IMI指数*1の構成銘柄から、相対的にESG評価の高い銘柄を選定することで構築される指数で、配当を考慮したものです。

・MSCI-KOKUSAI ESG リーダーズ指数（配当込み、円換算ベース）は、MSCI Inc.が開発したMSCI-KOKUSAI ESG リーダーズ指数（米ドルベース）をもとに委託会社が円換算して計算したものです。MSCI-KOKUSAI ESG リーダーズ指数（米ドルベース）は、日本を除く世界の先進国の株式から、相対的にESG評価の高い銘柄を選定することで構築される指数で、配当を考慮したものです。

《 両指数の特徴 》

① MSCI Inc.独自のESG評価モデルを用います。当該モデルは、評価対象企業に対し、当該企業が属する業種が直面するESG上のリスクや機会は何か、当該企業にとってそれらがどの程度大きく、どの程度マネジメントを行っているかを測定・分析し、同業種他社と比較することを目的としています。

② 企業に対するESG評価は最終的にAAA～CCCの7段階のESG格付で表され、格付がBB以上（7段階のうち上位5段階目まで）の企業が選別されます。

③ E/S/Gそれぞれの要素に負の影響を与える可能性がある不祥事について分析し、11段階のうち上位8段階目までの企業が選別されます。

④ MSCI ジャパン IMI指数*1を構成する銘柄、またはMSCI-KOKUSAI指数*2を構成する日本を除く先進国の銘柄の中から、業種分類（GICS：Global Industry Classification Standard）ごとに時価総額50%を目標として、指数を構成する企業が選別されます。

⑤ MSCI-KOKUSAI ESG リーダーズ指数においては、非人道的兵器や核兵器製造などに関与する企業、アルコールやギャンブルなどから一定以上の収益を得ている企業は指数の構成銘柄から除外されます。

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

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

〈ESG格付決定プロセス〉

1. 業種別に、MSCI Inc.が独自にE/S/Gそれぞれに設定している細項目(Key Issue)のうち関連が深いものを選定し、それがリスクまたは機会として顕在化するまでの時間の長短および環境・社会に与える影響の大小の2軸をもとにウエイト配分を決定する。

2. E/S/Gそれぞれに選定された細項目をもとに、E/Sに対しては、エクスポージャー(経済的なリスクの程度)の大きさとそれに対するマネジメントがどの程度なされているかを、Gに対しては、企業統治上のリスクに関する評価を減点方式で勘案し、E/S/Gそれぞれに0～10の点数を付与する。

3. 上記1.で決定したウエイト配分をもとに、上記2.でE/S/Gそれぞれに付与した点数を、加重平均したうえで同業種他社との比較を踏まえ調整を行い、0～10の点数を算出する。

4. 算出された点数を格付表にあてはめ、格付を決定する。

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

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

〈MSCI Inc.のESG細項目(Key Issue)の例〉(ご参考)

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

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

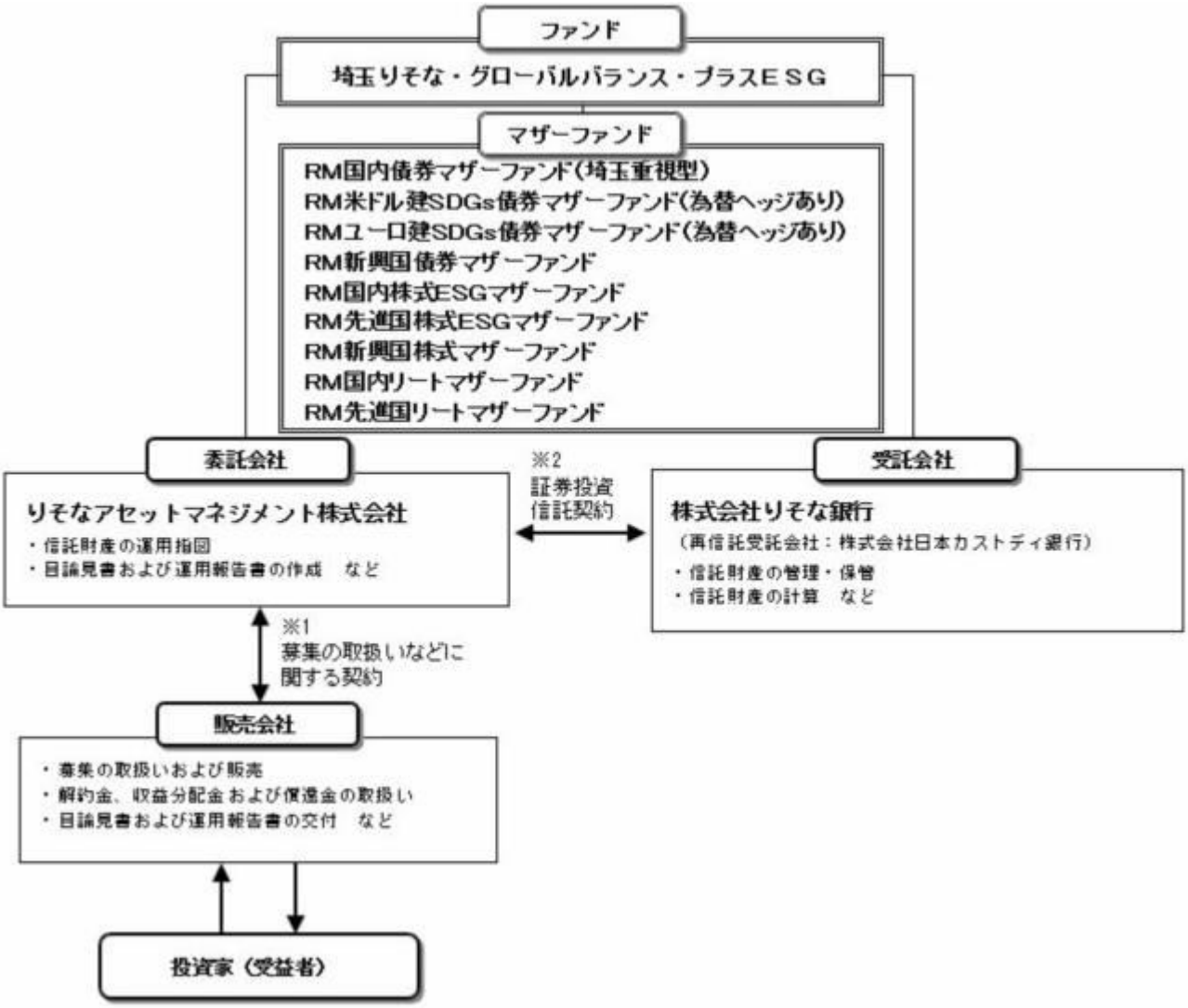
④　信託金限度額
・1兆円を限度として信託金を追加することができます。
・委託会社は受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

（２）【ファンドの沿革】

2020年9月25日
・ファンドの信託契約締結、運用開始
2023年3月23日
・投資対象に「RM米ドル建ＳＤＧｓ債券マザーファンド（為替ヘッジあり）」および「RMユーロ建ＳＤＧｓ債券マザーファンド（為替ヘッジあり）」を追加し、「RM先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）」および「RM先進国債券マザーファンド」を投資対象から削除する旨の約款変更を実施
・信託期間を無期限に変更

（３）【ファンドの仕組み】

①　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。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。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。

② 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国内債券マザーファンド（埼玉重視型）、ＲＭ米ドル建ＳＤＧｓ債券マザーファンド(為替ヘッジあり)、ＲＭユーロ建ＳＤＧｓ債券マザーファンド(為替ヘッジあり)、ＲＭ新興国債券マザーファンド、ＲＭ国内株式ＥＳＧマザーファンド、ＲＭ先進国株式ＥＳＧマザーファンド、ＲＭ新興国株式マザーファンド、ＲＭ国内リートマザーファンド、ＲＭ先進国リートマザーファンド（以下、各々を「マザーファンド」といいます。）の各受益証券を主要投資対象とします。

① 主として、各マザーファンド受益証券への投資を通じ、実質的に国内、先進国および新興国の債券・株式ならびに国内および先進国の不動産投資信託証券（リート）等への分散投資を行います。また、株価指数先物取引、債券先物取引、不動産投信指数先物取引、ＥＴＦ（上場投資信託証券）等を利用することがあります。
② 各マザーファンド受益証券への投資比率は、信託財産の中長期的な成長を目的に独自の定量モデル

にて算出した基本的資産配分比率に基づき決定します。また、基本的資産配分比率は原則として年１回程度見直します。

③　実質組入外貨建資産については、一部為替ヘッジを行います。

④　各マザーファンド受益証券への投資比率の合計は、原則として高位を保ちますが、市場環境等を勘案して、投資比率を引き下げる場合があります。

⑤　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】

①　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

②　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。

③　金融商品の指図範囲

委託者は、信託金を、上記②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②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、③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。

④　その他の投資対象と指図範囲

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

《参考情報》
◆投資対象とするマザーファンドの概要
＜RM国内債券マザーファンド（埼玉重視型）＞

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。
主な投資対象	わが国の国債および埼玉県が発行する公募地方債を主要投資対象とします。
投資方針	① 主として、わが国の国債および埼玉県が発行する公募地方債に投資を行い、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長を目指します。なお、国内債券を対象とした債券先物取引を活用することがあります。 ② 投資する債券の残存年限を幅広く分散させることにより、金利変動に対するリスク分散効果や、利息収入の平準化を図り、安定した収益の確保を目指します。 ③ 債券の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。 ④ 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	① 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ② 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。 ③ 外貨建資産への投資は行いません。 ④ 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。 ⑤ 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。 ⑥ 一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
決算日	毎年8月20日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

＜RM米ドル建ＳＤＧｓ債券マザーファンド（為替ヘッジあり）＞

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

投資方針	①　主として、米ドル建のＳＤＧｓ債および先進国（日本を除く）の国債に投資し、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。なお、先進国債券（除く日本）を対象とした債券先物取引を活用することがあります。 ②　米ドル建のＳＤＧｓ債は、発行体の信用力・ＥＳＧ評価および当該債券の流動性等を勘案して投資を行います。 ③　ポートフォリオの構築は、残存期間が10年程度までの米ドル建のＳＤＧｓ債および先進国（日本を除く）の国債を、各残存期間の投資金額がほぼ同程度となるように組み入れることにより、金利変動に対するリスク分散効果や、利息収入の平準化を図り、安定した収益の確保を目指します。 ④　債券の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。 ⑤　組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行います。 ⑥　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	①　株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ②　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。 ③　外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ④　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。 ⑤　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。 ⑥　一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
決算日	毎年5月10日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

＜RMユーロ建ＳＤＧｓ債券マザーファンド（為替ヘッジあり）＞

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。
主な投資対象	ユーロ建のＳＤＧｓ債および先進国（日本を除く）の国債を主要投資対象とします。
投資方針	①　主として、ユーロ建のＳＤＧｓ債および先進国（日本を除く）の国債に投資し、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。なお、先進国債券（除く日本）を対象とした債券先物取引を活用することがあります。 ②　ユーロ建のＳＤＧｓ債は、発行体の信用力・ＥＳＧ評価および当該債券の流動性等を勘案して投資を行います。 ③　ポートフォリオの構築は、残存期間が10年程度までのユーロ建のＳＤＧｓ債および先進国（日本を除く）の国債を、各残存期間の投資金額がほぼ同程度となるように組み入れることにより、金利変動に対するリスク分散効果や、利息収入の平準化を図り、安定した収益の確保を目指します。 ④　債券の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。 ⑤　組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行います。 ⑥　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	①　株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ②　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。 ③　外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ④　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。 ⑤　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。 ⑥　一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
決算日	毎年5月10日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

＜RM新興国債券マザーファンド＞

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、ＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	次の有価証券を主要投資対象とします。 ・ＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）に採用されている新興国の債券 ・新興国債券の指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）
投資方針	①　主として、ＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）に採用されている新興国の現地通貨建て債券または新興国債券の指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）に投資し、ＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、ＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の債券先物取引を活用することがあります。 ②　債券またはＥＴＦ（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。 ③　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。 ④　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	①　株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限ります。 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ②　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。 ③　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ④　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。 ⑤　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。 ⑥　一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
決算日	毎年1月25日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

＜RM国内株式ＥＳＧマザーファンド＞

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、ＭＳＣＩ　ジャパン　ＥＳＧ　セレクト・リーダーズ指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
主な投資対象	国内の金融商品取引所上場株式（上場予定を含みます。）のうち、ＭＳＣＩ　ジャパン　ＥＳＧ　セレクト・リーダーズ指数（配当込み）に採用されている株式を主要投資対象とします。
投資方針	①　主として、国内の金融商品取引所上場株式（上場予定を含みます。）のうち、ＭＳＣＩ　ジャパン　ＥＳＧ　セレクト・リーダーズ指数（配当込み）に採用されている株式に投資し、ＭＳＣＩ　ジャパン　ＥＳＧ　セレクト・リーダーズ指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、ＭＳＣＩ　ジャパン　ＥＳＧ　セレクト・リーダーズ指数（配当込み）への連動性を高めるため、国内株式の指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）、国内株式を対象とした株価指数先物取引を活用することがあります。 ②　株式（ＥＴＦ（上場投資信託証券）、株価指数先物取引を含みます。）の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。 ③　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。 ④　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	①　株式への投資割合には、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（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。 ④　外貨建資産への投資は行いません。 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。 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。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
決算日	毎年11月25日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

＜ＲＭ先進国株式ＥＳＧマザーファンド＞

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、ＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ　ＥＳＧ　リーダーズ指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
主な投資対象	金融商品取引所上場または店頭登録（上場予定および店頭登録予定を含みます。）されている日本を除く先進国の株式*のうち、ＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ　ＥＳＧ　リーダーズ指数（配当込み、円換算ベース）に採用されている株式を主要投資対象とします。 ＊ＤＲ（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。
投資方針	①　主として、金融商品取引所に上場または店頭登録（上場予定および店頭登録予定を含みます。）されている日本を除く先進国の株式のうち、ＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ　ＥＳＧ　リーダーズ指数（配当込み、円換算ベース）に採用されている株式に投資し、ＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ　ＥＳＧ　リーダーズ指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、ＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ　ＥＳＧ　リーダーズ指数（配当込み、円換算ベース）への連動性を高めるため、先進国株式の指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）、海外の金融商品取引所に上場されている株価指数先物取引を活用することがあります。 ②　株式（ＥＴＦ（上場投資信託証券）、株価指数先物取引を含みます。）の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。 ③　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　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	①　株式への投資割合には、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（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。 ④　外貨建資産への投資割合には、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。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
決算日	毎年11月25日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

＜RM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、ＭＳＣＩ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（*） （*）ＤＲ（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。 ・新興国株式の指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）
投資方針	①　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、ＭＳＣＩ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。なお、ＭＳＣＩエマージング・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。 ②　株式またはＥＴＦ（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。 ③　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。 ④　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	①　株式への投資割合には、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（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。 ④　外貨建資産への投資割合には、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。

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

＜RM国内リートマザーファンド＞

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	次の有価証券を主要投資対象とします。 ・東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）に採用されている不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に規定する不動産投資信託証券をいいます。）
投資方針	① 主として、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）に採用されている不動産投資信託証券に投資し、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。なお、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）への連動性を高めるため、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）または不動産投信指数先物取引を活用することがあります。 ② 不動産投資信託証券またはＥＴＦ（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。 ③ 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	① 不動産投資信託証券および株式への投資割合には、制限を設けません。 ② 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。 ③ 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。 ④ 外貨建資産への投資は、行いません。 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。 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。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
決算日	毎年1月25日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

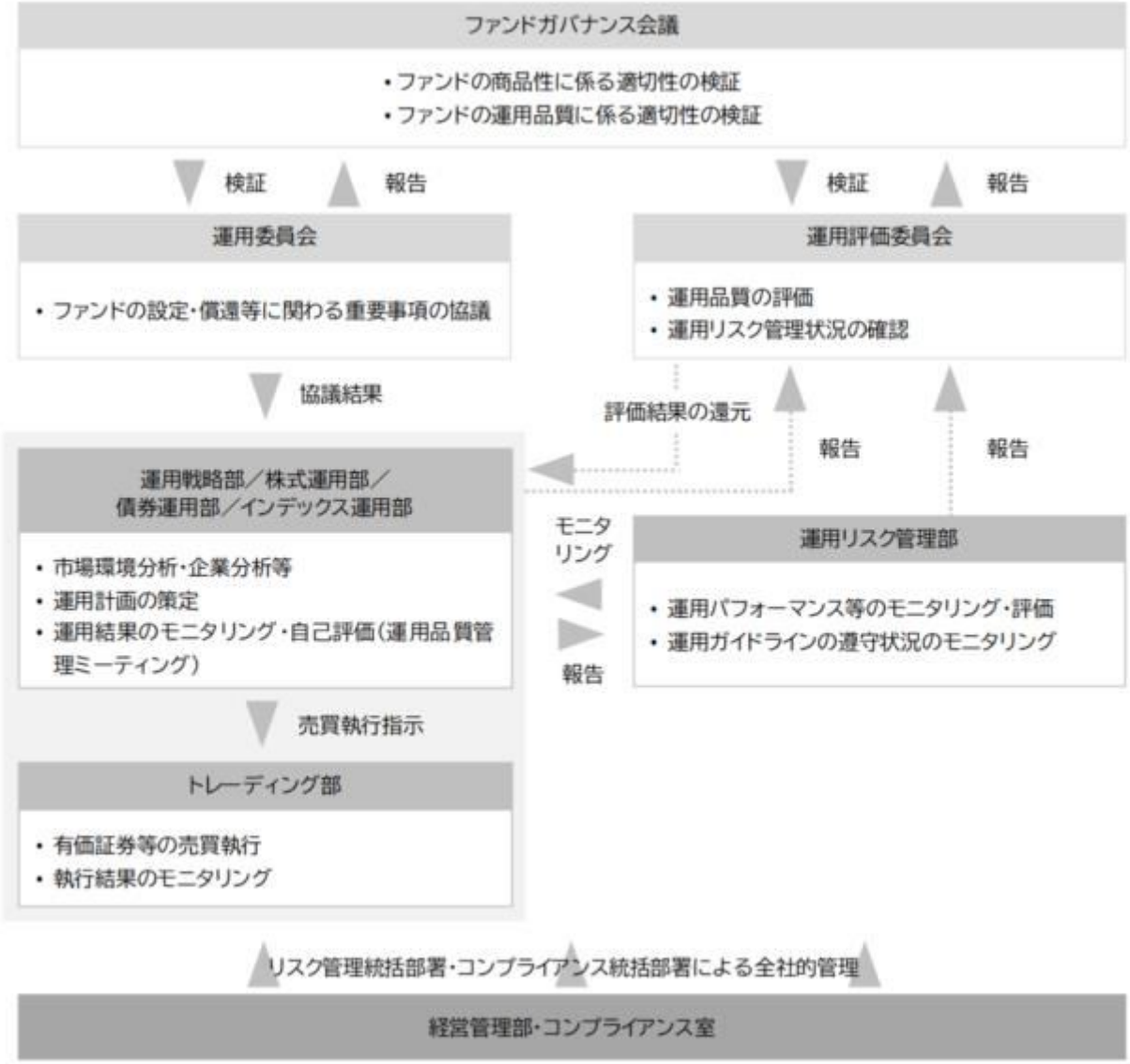
＜RM先進国リートマザーファンド＞

運用の基本方針

基本方針	この投資信託は、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	次の有価証券を主要投資対象とします。 ・先進国（除く日本）の金融商品取引所に上場（上場予定を含みます。）されているまたは店頭登録されている（登録予定を含みます。）不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に規定する不動産投資信託証券をいいます。） ・先進国（除く日本）の金融商品取引所に上場（上場予定を含みます。）されているまたは店頭登録されている（登録予定を含みます。）不動産関連株式 ・先進国の不動産投資信託証券に関する指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）
投資方針	①　主として、先進国の不動産投資信託証券および不動産関連株式または先進国の不動産投資信託証券に関する指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）に投資し、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の金融商品取引市場に上場する指数先物取引を活用することがあります。 ②　不動産投資信託証券またはＥＴＦ（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。 ③　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。 ④　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	①　不動産投資信託証券および株式への投資割合には、制限を設けません。 ②　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。 ③　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。 ④　外貨建資産への投資割合には、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。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
決算日	毎年1月25日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

（３）【運用体制】

①　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。

② 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。

③ 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】

① 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）留保益は、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。

② 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】

①　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書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ます。）の行使により取得可能な株券

へ）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たときは、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

認めたときは、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たときは、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たときは、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。

② 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します。

① 市場リスク

・株価変動リスク

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

・金利（債券価格）変動リスク

金利（債券価格）は、金融・財政政策、市場の需給、それらに関する外部評価の変化等を反映して変動します。債券価格は、一般に金利が上昇（低下）した場合は値下がり（値上がり）します。債券価格が値下がりした場合は、基準価額の下落要因となります。

・リートの価格変動リスク

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

・為替変動リスク

為替相場は、各国の経済状況、金利動向、政治情勢等のさまざまな要因により変動します。当ファンドは、実質的に外貨建資産に投資を行いますので、投資先の通貨に対して円高となった場合には、基準価額の下落要因となります。また当ファンドは原則として為替ヘッジにより為替変動リスクの一部低減を図ることとしていますが、当該部分の為替変動リスクを完全に排除できるものでは

ありません。なお、為替ヘッジを行う通貨の短期金利より円短期金利が低い場合には、その金利差相当分のコストがかかります。

② 資産配分リスク
複数資産（国内・外の株式、債券、リート等）への投資を行うため、投資割合が高い資産の価格が下落した場合、当ファンドの基準価額はより大きく影響を受け損失を被ることがあります。

③ 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。

④ 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。

⑤ 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）

①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。

②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。

③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け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。

④分配金はファンドの純資産から支払われますので、分配金支払い後は純資産が減少し、基準価額が下落する要因となります。収益分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益の水準を示すものではありません。収益分配は、計算期間に生じた収益を超えて行われる場合があります。投資者の購入価額によっては、収益分配金の一部または全部が、実質的な元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

⑤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。

⑥当資料に記載している指数の知的財産権、その他の一切の権利は、その発行者および許諾者に帰属します。

（２）リスク管理体制

○委託会社における投資リスクに対する管理体制

①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。

②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

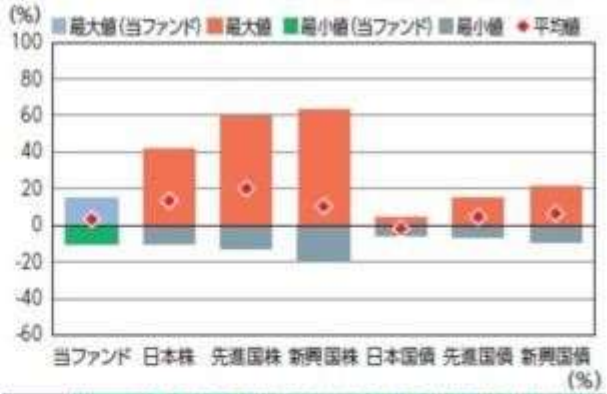
2019年9月末～2024年8月末

＊分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
＊年間騰落率は、2021年9月から2024年8月の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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

2019年9月末～2024年8月末



(%)

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	14.7	42.1	59.8	62.7	4.4	15.3	21.5
最小値	△10.4	△10.4	△12.4	△19.4	△5.5	△6.1	△8.8
平均値	3.6	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（当ファンドは2021年9月から2024年8月）の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
＊決算日に対応した数値とは異なります。
＊当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

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

各資産クラスの指数

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

○代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

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

東証株価指数(TOPIX、配当込み)

東証株価指数(TOPIX、配当込み)は、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、配当を考慮したものです。なお、TOPIXに関する著作権、知的財産権その他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】

申込手数料につきましては、販売会社が定めるものとします。申込手数料率につきましては、販売会社にお問い合わせください。
・販売会社における申込手数料率は2.2%（税抜2.0%）が上限となっております。
・申込手数料の額（１口当たり）は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に申込手数料率を乗じて得た額とします。
・＜分配金再投資コース（自動けいぞく投資コース）＞の場合、収益分配金の再投資により取得する口

数については、申込手数料はかかりません。
※申込手数料は、商品および関連する投資環境の説明や情報提供など、ならびに購入に関する事務コストの対価です。

（２）【換金（解約）手数料】

① 換金手数料
ありません。
② 信託財産留保額
ありません。

（３）【信託報酬等】

① 信託報酬
信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年0.88%（税抜0.80%）の率を乗じて得た額とします。
② 信託報酬の配分
信託報酬の配分（年率）は、以下の通りとします。

信託報酬＝日々の純資産総額×信託報酬率		
委託会社	販売会社	受託会社
0.385%	0.385%	0.030%

※表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

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

③ 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】

① 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。
② 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。）
③ 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。
④ 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。
⑤ その他諸費用（法律・税務顧問への報酬、法定書類の作成・印刷・交付費用、公告費用等）および当該諸費用にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁することができます（現在、その他諸費用として受益者負担項目はありません。）。
※これらのその他の手数料等は、信託財産の運用状況等により変動するため、事前に料率、上限額またはその計算方法の概要等を記載することができません。

○上場投資信託証券、上場不動産投資信託証券は市場の需給により価格形成されるため、これら費用を表示することができません。
○上記の手数料等の合計額については、購入金額や保有期間等に応じて異なりますので、上限額等を事前に示すことができません。

（５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。
・公募株式投資信託は税法上、一定の要件を満たした場合に少額投資非課税制度（NISA）の適用対象となります。
・当ファンドは、NISAの「成長投資枠（特定非課税管理勘定）」の対象ですが、販売会社により取扱いが異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

① 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す。）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す。）については、上場株式等の譲渡損失と損益通算が可能です。

※少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

NISAは、少額上場株式等に関する非課税制度です。

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

②　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。

③　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。

④　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

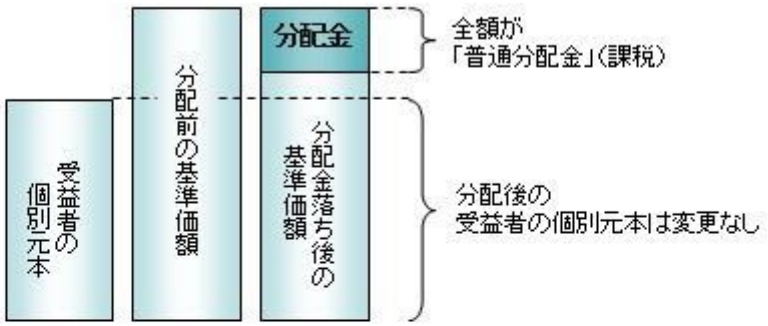
イ）収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の１口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

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。

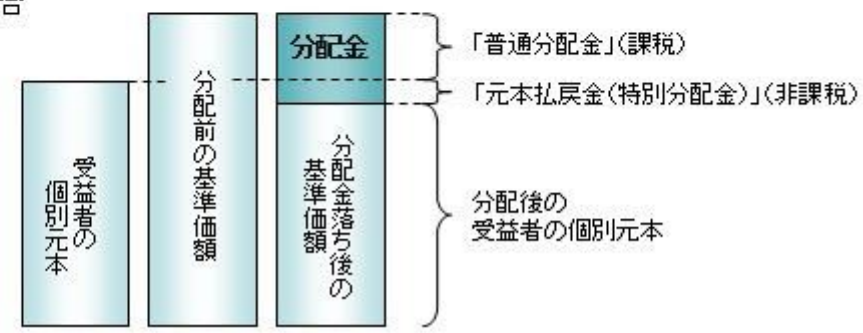
ハ）収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

＜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 運用管理費用の比率	② その他費用の比率
0.91%	0.87%	0.04%

※対象期間は2023年8月22日～2024年8月20日です。
※対象期間中の運用・管理にかかった費用の額(原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。)を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口あたり)を乗じた数で除した値(年率)です。
※その他費用とは監査費用や有価証券の保管費用等です。
※詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

5【運用状況】

【埼玉りそな・グローバルバランス・プラスＥＳＧ】

以下の運用状況は2024年 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	6,121,326,782	99.76
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	―	15,017,014	0.24
合計（純資産総額）		6,136,343,796	100.00

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	RM先進国株式ＥＳＧマザーファンド	630,522,108	2.3789	1,499,949,042	2.3455	1,478,889,604	24.10
日本	親投資信託受益証券	RM米ドル建ＳＤＧｓ債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	1,505,394,934	0.8704	1,310,295,751	0.8721	1,312,854,921	21.39
日本	親投資信託受益証券	RM国内債券マザーファンド（埼玉重視型）	962,544,295	0.9804	943,678,427	0.9802	943,485,917	15.38
日本	親投資信託受益証券	RMユーロ建ＳＤＧｓ債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	1,007,038,922	0.8797	885,892,140	0.8798	885,992,843	14.44
日本	親投資信託受益証券	RM国内株式ＥＳＧマザーファンド	311,108,425	1.8434	573,497,270	1.8806	585,070,504	9.53
日本	親投資信託受益証券	RM先進国リートマザーファンド	210,683,740	1.7885	376,807,869	1.8081	380,937,270	6.21
日本	親投資信託受益証券	RM新興国株式マザーファンド	119,764,860	2.0139	241,194,451	1.9747	236,499,669	3.85
日本	親投資信託受益証券	RM国内リートマザーファンド	124,390,620	1.4238	177,107,364	1.4373	178,786,638	2.91
日本	親投資信託受益証券	RM新興国債券マザーファンド	86,400,565	1.3957	120,589,268	1.3751	118,809,416	1.94

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	99.76
合　　計	99.76

②【投資不動産物件】
該当事項はありません。

③【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】

①【純資産の推移】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第1計算期間末　(2021年 8月20日)	6,158	6,158	1.1133	1.1133
第2計算期間末　(2022年 8月22日)	6,960	6,960	1.0949	1.0949
第3計算期間末　(2023年 8月21日)	6,448	6,448	1.1040	1.1040
第4計算期間末　(2024年 8月20日)	6,177	6,177	1.2183	1.2183
2023年 8月末日	6,576	―	1.1265	―
9月末日	6,359	―	1.1045	―
10月末日	6,207	―	1.0837	―
11月末日	6,390	―	1.1317	―
12月末日	6,286	―	1.1467	―
2024年 1月末日	6,262	―	1.1687	―
2月末日	6,227	―	1.1834	―
3月末日	6,193	―	1.2089	―
4月末日	6,099	―	1.2040	―
5月末日	6,093	―	1.2113	―
6月末日	6,201	―	1.2431	―
7月末日	6,031	―	1.2215	―
8月末日	6,136	―	1.2165	―

②【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2020年 9月25日～2021年 8月20日	0.0000
第2期	2021年 8月21日～2022年 8月22日	0.0000
第3期	2022年 8月23日～2023年 8月21日	0.0000
第4期	2023年 8月22日～2024年 8月20日	0.0000

③【収益率の推移】

期	期間	収益率（%）
第1期	2020年 9月25日～2021年 8月20日	11.33
第2期	2021年 8月21日～2022年 8月22日	△1.65
第3期	2022年 8月23日～2023年 8月21日	0.83
第4期	2023年 8月22日～2024年 8月20日	10.35

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

（４）【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	2020年 9月25日～2021年 8月20日	6,141,844,751	609,918,666
第2期	2021年 8月21日～2022年 8月22日	1,649,743,586	823,970,233
第3期	2022年 8月23日～2023年 8月21日	456,220,480	972,413,153
第4期	2023年 8月22日～2024年 8月20日	586,133,797	1,356,935,846

(注)第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

（参考）

ＲＭ国内債券マザーファンド（埼玉重視型）

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（%）
国債証券	日本	96,080,000	10.18
地方債証券	日本	834,287,500	88.43
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	―	13,087,881	1.39
合計（純資産総額）		943,455,381	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
日本	地方債証券	平成２７年度第６回埼玉県公募公債	100,000,000	100.18	100,181,000	100.14	100,147,000	0.505	2025/9/29	10.61
日本	地方債証券	令和３年度第２回埼玉県公募公債（５年）	100,000,000	99.36	99,363,000	99.33	99,338,000	0.010	2026/4/15	10.53
日本	地方債証券	令和５年度第２回埼玉県公募公債	100,000,000	99.09	99,099,000	99.10	99,100,000	0.782	2033/8/29	10.50
日本	地方債証券	令和４年度第２回埼玉県公募公債（５年）	100,000,000	99.00	99,003,000	98.98	98,988,000	0.075	2027/4/26	10.49
日本	地方債証券	平成２９年度第９回埼玉県公募公債	100,000,000	98.97	98,971,000	98.96	98,964,000	0.200	2028/3/27	10.49
日本	地方債証券	令和２年度第９回埼玉県公募公債	100,000,000	96.84	96,845,000	96.77	96,772,000	0.140	2031/2/18	10.26
日本	地方債証券	令和４年度第３回埼玉県公募公債（１０年）	100,000,000	96.58	96,589,000	96.56	96,564,000	0.304	2032/5/24	10.24
日本	国債証券	第３６８回日本国債（１０年）	100,000,000	96.13	96,132,400	96.08	96,080,000	0.200	2032/9/20	10.18
日本	地方債証券	令和３年度第８回埼玉県公募公債	100,000,000	95.96	95,964,000	95.91	95,919,000	0.125	2031/10/27	10.17
日本	地方債証券	令和２年度第７回埼玉県公募公債	50,000,000	97.06	48,532,000	96.99	48,495,500	0.125	2030/10/16	5.14

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	10.18
地方債証券	88.43
合　　計	98.61

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

ＲＭ米ドル建ＳＤＧｓ債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

以下の運用状況は2024年 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（%）
国債証券	アメリカ	180,641,218	5.32
特殊債券	ドイツ	136,460,657	4.02
	国際機関	3,017,073,668	88.90
	小計	3,153,534,325	92.92
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	―	59,631,635	1.76
合計（純資産総額）		3,393,807,178	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	売建	―	3,321,156,054	△97.86

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	2,000,000	13,056.55	261,131,037	13,303.86	266,077,295	1.375	2028/4/20	7.84
国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	2,000,000	12,546.01	250,920,253	13,060.73	261,214,720	1.125	2028/9/13	7.70
国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	2,000,000	11,800.63	236,012,650	12,486.10	249,722,103	1.625	2031/11/3	7.36
国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	2,000,000	12,019.07	240,381,447	12,339.05	246,781,032	0.875	2030/5/17	7.27
国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000	14,658.10	146,581,040	15,385.61	153,856,161	4.750	2033/11/14	4.53
国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000	15,001.42	150,014,248	15,015.51	150,155,156	4.375	2031/10/10	4.42
国際機関	特殊債券	INTER-AMERICAN DEVEL BK	1,000,000	15,006.49	150,064,928	14,984.02	149,840,259	4.375	2034/7/17	4.42
国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000	14,616.83	146,168,360	14,628.68	146,286,854	4.750	2026/4/10	4.31
国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000	14,619.58	146,195,872	14,597.80	145,978,081	4.000	2031/1/10	4.30

国際機関	特殊債券	EUROPEAN BK RECON & DEV	1,000,000	14,276.22	142,762,257	14,439.95	144,399,528	1.625	2024/9/27	4.25
国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000	14,142.48	141,424,808	14,298.54	142,985,459	2.875	2025/6/13	4.21
国際機関	特殊債券	INTER-AMERICAN DEVEL BK	1,000,000	13,751.62	137,516,229	14,294.17	142,941,724	3.500	2029/9/14	4.21
国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000	13,847.72	138,477,258	14,208.15	142,081,560	3.125	2027/6/15	4.19
国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000	13,786.40	137,864,080	14,048.28	140,482,833	2.125	2026/4/13	4.14
国際機関	特殊債券	INTER-AMERICAN DEVEL BK	1,000,000	13,308.18	133,081,820	14,011.46	140,114,614	3.500	2033/4/12	4.13
国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000	13,564.05	135,640,576	13,942.41	139,424,100	2.375	2027/5/24	4.11
ドイツ	特殊債券	KFW	1,000,000	13,272.33	132,723,349	13,646.06	136,460,657	1.000	2026/10/1	4.02
国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000	12,515.43	125,154,389	13,210.13	132,101,388	2.500	2032/3/29	3.89
国際機関	特殊債券	INTER-AMERICAN DEVEL BK	1,000,000	11,634.89	116,348,974	12,263.08	122,630,801	1.125	2031/1/13	3.61
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	530,000	14,378.64	76,206,792	14,388.93	76,261,351	3.625	2026/5/15	2.25
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	520,000	14,646.07	76,159,587	14,650.53	76,182,785	4.000	2029/1/31	2.24
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	80,000	15,231.51	12,185,210	15,193.53	12,154,828	4.500	2033/11/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	80,000	12,173.33	9,738,669	12,653.59	10,122,877	1.625	2031/5/15	0.30
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	40,000	14,827.51	5,931,007	14,798.44	5,919,377	4.125	2032/11/15	0.17

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	5.32
特殊債券	92.92
合　　計	98.24

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（%）
為替予約取引	米ドル	売建	23,209,400.00	3,328,861,900	3,321,156,054	△97.86

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

ＲＭユーロ建ＳＤＧｓ債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

以下の運用状況は2024年 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（%）
国債証券	フランス	294,279,091	12.80
特殊債券	ドイツ	145,344,802	6.32
	国際機関	1,805,870,891	78.52
	小計	1,951,215,693	84.84
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	―	54,374,589	2.36
合計（純資産総額）		2,299,869,373	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	売建	―	2,243,734,764	△97.56

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000	16,393.27	163,932,779	16,315.83	163,158,335	2.900	2033/1/19	7.09
国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000	16,331.18	163,311,876	16,260.22	162,602,250	2.900	2034/2/14	7.07
国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000	15,781.61	157,816,164	16,055.03	160,550,302	2.750	2034/1/16	6.98
国際機関	特殊債券	ASIAN DEVELOPMENT BANK	1,000,000	15,478.68	154,786,896	15,683.45	156,834,512	0.350	2025/7/16	6.82
国際機関	特殊債券	EUROPEAN UNION	1,000,000	15,304.32	153,043,234	15,553.21	155,532,140	0.000	2025/11/4	6.76
国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000	14,808.69	148,086,922	15,128.81	151,288,103	0.000	2027/1/15	6.58
国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000	14,507.89	145,078,993	14,854.35	148,543,568	0.000	2027/11/15	6.46
国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000	14,308.19	143,081,997	14,792.15	147,921,589	1.500	2032/6/15	6.43
国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000	14,660.52	146,605,259	14,662.24	146,622,437	0.000	2028/5/15	6.38
ドイツ	特殊債券	KFW	1,000,000	14,186.84	141,868,428	14,534.48	145,344,802	0.000	2028/9/15	6.32
国際機関	特殊債券	ASIAN DEVELOPMENT BANK	1,000,000	13,666.60	136,666,000	14,127.55	141,275,522	0.000	2029/10/24	6.14
国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000	13,364.74	133,647,483	13,727.17	137,271,702	0.010	2030/11/15	5.97
国際機関	特殊債券	INTL DEVELOPMENT ASSOC	1,000,000	13,029.10	130,291,078	13,427.04	134,270,431	0.000	2031/7/15	5.84
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	720,000	14,879.96	107,135,726	15,018.24	108,131,374	0.750	2028/5/25	4.70
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	630,000	14,313.44	90,174,676	14,545.77	91,638,357	0.500	2029/5/25	3.98
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	350,000	15,923.67	55,732,861	16,186.15	56,651,552	3.000	2033/5/25	2.46
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	210,000	16,899.14	35,488,205	16,782.20	35,242,628	3.500	2033/11/25	1.53
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	10,000	12,979.45	1,297,945	13,184.22	1,318,422	0.000	2031/11/25	0.06
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	10,000	12,779.75	1,277,975	12,967.58	1,296,758	0.000	2032/5/25	0.06

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	12.80
特殊債券	84.84
合　　計	97.64

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（%）
為替予約取引	ユーロ	売建	14,098,000.00	2,259,654,442	2,243,734,764	△97.56

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

ＲＭ新興国債券マザーファンド

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（%）
投資信託受益証券	アイルランド	13,218,616,422	99.69
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	―	41,453,556	0.31
合計（純資産総額）		13,260,069,978	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
アイルランド	投資信託受益証券	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	2,053,741	6,402.70	13,149,502,583	6,436.35	13,218,616,422	99.69

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	99.69
合　　計	99.69

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

ＲＭ国内株式ＥＳＧマザーファンド

以下の運用状況は2024年 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	7,346,110,120	98.05
投資証券	日本	36,771,000	0.49
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	―	109,595,260	1.46
合計（純資産総額）		7,492,476,380	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	103,189,000	1.38

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	192,800	3,111.95	599,983,960	2,759.50	532,031,600	7.10
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	23,400	12,994.11	304,062,264	14,200.00	332,280,000	4.43
日本	株式	日立製作所	電気機器	87,100	2,586.86	225,316,320	3,572.00	311,121,200	4.15
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	27,900	6,592.22	183,923,060	9,047.00	252,411,300	3.37
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	23,500	8,487.35	199,452,779	9,550.00	224,425,000	3.00
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	8,400	29,497.39	247,778,076	25,805.00	216,762,000	2.89
日本	株式	第一三共	医薬品	34,700	4,737.97	164,407,900	6,108.00	211,947,600	2.83
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	35,300	4,553.74	160,747,152	5,506.00	194,361,800	2.59
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	22,300	6,578.34	146,697,189	7,706.00	171,843,800	2.29
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	3,600	40,810.78	146,918,816	46,650.00	167,940,000	2.24
日本	株式	任天堂	その他製品	19,500	7,645.22	149,081,930	7,902.00	154,089,000	2.06
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	28,800	4,570.43	131,628,422	4,911.00	141,436,800	1.89
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	45,300	2,848.75	129,048,399	3,009.00	136,307,700	1.82
日本	株式	ＨＯＹＡ	精密機器	6,600	17,755.40	117,185,688	20,595.00	135,927,000	1.81
日本	株式	三菱重工業	機械	60,200	1,213.15	73,031,864	1,942.50	116,938,500	1.56
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	53,600	1,870.21	100,243,784	2,038.00	109,236,800	1.46
日本	株式	村田製作所	電気機器	31,800	2,956.02	94,001,535	3,033.00	96,449,400	1.29
日本	株式	アドバンテスト	電気機器	14,400	5,359.44	77,176,020	6,641.00	95,630,400	1.28
日本	株式	ダイキン工業	機械	5,000	22,023.89	110,119,488	18,510.00	92,550,000	1.24
日本	株式	富士通	電気機器	31,100	2,326.44	72,352,284	2,677.50	83,270,250	1.11
日本	株式	富士フイルムホールディングス	化学	21,000	3,197.15	67,140,245	3,905.00	82,005,000	1.09
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	20,500	4,839.83	99,216,600	3,988.00	81,754,000	1.09
日本	株式	ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	保険業	24,200	2,504.10	60,599,410	3,345.00	80,949,000	1.08
日本	株式	ルネサスエレクトロニクス	電気機器	31,600	2,546.04	80,455,104	2,514.00	79,442,400	1.06
日本	株式	オリックス	その他金融業	21,700	3,098.55	67,238,544	3,644.00	79,074,800	1.06
日本	株式	三井不動産	不動産業	50,100	1,383.29	69,302,856	1,568.00	78,556,800	1.05
日本	株式	ファナック	電気機器	17,800	4,292.86	76,413,000	4,287.00	76,308,600	1.02
日本	株式	ＴＤＫ	電気機器	7,300	7,634.89	55,734,718	9,847.00	71,883,100	0.96
日本	株式	小松製作所	機械	17,400	4,155.96	72,313,748	4,056.00	70,574,400	0.94
日本	株式	丸紅	卸売業	26,800	2,557.30	68,535,759	2,487.00	66,651,600	0.89

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	0.51
		建設業	1.73

		食料品	2.94
		繊維製品	0.34
		化学	5.59
		医薬品	4.87
		石油・石炭製品	0.57
		ゴム製品	0.83
		ガラス・土石製品	0.49
		鉄鋼	1.18
		非鉄金属	0.54
		金属製品	0.12
		機械	5.51
		電気機器	22.71
		輸送用機器	7.56
		精密機器	2.23
		その他製品	3.12
		電気・ガス業	1.16
		陸運業	1.81
		海運業	0.61
		空運業	0.12
		倉庫・運輸関連業	0.01
		情報・通信業	4.79
		卸売業	3.57
		小売業	4.33
		銀行業	5.40
		証券、商品先物取引業	1.00
		保険業	4.79
		その他金融業	1.11
		不動産業	2.55
		サービス業	5.96
投資証券	—	—	0.49
合　　計			98.54

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物	買建	1	日本円	25,965,550	27,155,000	0.36
	大阪取引所	ミニＴＯＰＩＸ先物	買建	28	日本円	72,783,580	76,034,000	1.01

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

ＲＭ先進国株式ＥＳＧマザーファンド

以下の運用状況は2024年 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	9,865,483,944	67.72
	カナダ	450,853,165	3.09
	ドイツ	141,501,851	0.97
	イタリア	79,027,109	0.54
	フランス	417,537,227	2.87
	オランダ	317,364,925	2.18
	スペイン	73,265,233	0.50
	ベルギー	14,967,891	0.10
	オーストリア	6,312,052	0.04
	ルクセンブルク	5,579,657	0.04
	フィンランド	54,256,249	0.37
	アイルランド	379,385,360	2.60
	ポルトガル	6,242,801	0.04
	イギリス	530,687,464	3.64
	スイス	371,621,466	2.55
	スウェーデン	136,154,063	0.93
	ノルウェー	38,063,633	0.26
	デンマーク	250,836,780	1.72
	ケイマン	2,480,366	0.02
	リベリア	16,572,684	0.11
	オーストラリア	208,981,831	1.43
	バミューダ	18,892,330	0.13
	ニュージーランド	10,397,315	0.07
	香港	60,589,423	0.42
	シンガポール	20,807,663	0.14
	キュラソー	25,697,809	0.18
	ジャージー	12,768,488	0.09
	小計	13,516,328,779	92.77
投資証券	アメリカ	238,461,878	1.64
	カナダ	589,880	0.00
	フランス	2,510,252	0.02
	ベルギー	1,745,613	0.01
	イギリス	8,475,112	0.06
	オーストラリア	18,063,365	0.12
	シンガポール	6,632,658	0.05
	小計	276,478,758	1.90
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	―	776,141,642	5.33
合計（純資産総額）		14,568,949,179	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	637,677,480	4.38
	買建	ドイツ	134,923,617	0.93

(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	―	7,959,314	0.05

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	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	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	70,644	9,412.00	664,901,328	17,027.03	1,202,857,649	8.26
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	19,947	56,977.35	1,136,527,240	59,819.77	1,193,225,072	8.19
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	16,649	20,996.00	349,562,404	23,425.74	390,015,212	2.68
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	14,418	21,218.99	305,935,427	23,660.32	341,134,494	2.34
アメリカ	株式	ELI LILLY & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2,283	96,622.14	220,588,355	136,140.96	310,809,812	2.13
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	8,094	32,126.77	260,034,125	29,869.34	241,762,470	1.66
デンマーク	株式	NOVO NORDISK A/S-B	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9,209	16,596.90	152,840,860	19,836.52	182,674,531	1.25
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	4,468	37,928.91	169,466,379	39,721.53	177,475,823	1.22
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	金融サービス	2,354	62,193.04	146,402,435	69,619.83	163,885,103	1.12
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	6,647	22,459.92	149,291,142	24,620.34	163,651,427	1.12
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	6,808	22,183.36	151,024,315	23,780.50	161,897,671	1.11
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	1,128	115,085.21	129,816,124	132,042.11	148,943,511	1.02
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	一般消費財・サービス流通・小売り	2,799	47,546.52	133,082,732	53,150.28	148,767,656	1.02
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7,155	16,049.63	114,835,117	17,008.20	121,693,728	0.84
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	11,566	8,641.66	99,949,485	10,432.83	120,666,227	0.83

イギリス	株式	ASTRAZENECA PLC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	4,377	20,221.82	88,510,941	25,313.51	110,797,268	0.76
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	1,265	85,142.40	107,705,136	82,482.42	104,340,266	0.72
アメリカ	株式	SALESFORCE INC	ソフトウェア・サービス	2,739	35,513.64	97,271,881	37,215.04	101,932,016	0.70
スイス	株式	NOVARTIS AG-REG	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	5,564	15,103.96	84,038,458	17,412.01	96,880,439	0.66
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	3,881	24,505.95	95,107,600	24,918.63	96,709,211	0.66
アメリカ	株式	ADVANCED MICRO DEVICES	半導体・半導体製造装置	4,564	24,049.83	109,763,433	21,066.95	96,149,569	0.66
アイルランド	株式	LINDE PLC	素材	1,361	61,419.81	83,592,370	68,451.30	93,162,225	0.64
アイルランド	株式	ACCENTURE PLC-CL A	ソフトウェア・サービス	1,775	48,515.24	86,114,551	49,262.40	87,440,774	0.60
アメリカ	株式	MCDONALD'S CORP	消費者サービス	2,036	40,502.00	82,462,089	41,682.12	84,864,813	0.58
フランス	株式	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	耐久消費財・アパレル	779	117,249.55	91,337,401	108,682.05	84,663,322	0.58
アメリカ	株式	TEXAS INSTRUMENTS INC	半導体・半導体製造装置	2,570	23,755.88	61,052,632	30,565.83	78,554,188	0.54
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	3,086	23,842.76	73,578,782	25,134.38	77,564,709	0.53
アメリカ	株式	DANAHER CORP	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1,987	33,385.08	66,336,170	38,664.49	76,826,354	0.53
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア・サービス	2,587	23,851.45	61,703,717	28,800.72	74,507,463	0.51
アメリカ	株式	AMGEN INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1,514	40,180.55	60,833,355	47,930.24	72,566,395	0.50

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／国外	業種	投資比率（%）
株式	国外	エネルギー	2.64
		素材	3.56
		資本財	6.21
		商業・専門サービス	1.59
		運輸	1.66
		自動車・自動車部品	1.82
		耐久消費財・アパレル	1.91
		消費者サービス	1.74
		メディア・娯楽	6.62
		一般消費財・サービス流通・小売り	3.30
		生活必需品流通・小売り	0.82

		食品・飲料・タバコ	2.45
		家庭用品・パーソナル用品	2.64
		ヘルスケア機器・サービス	2.40
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.92
		銀行	3.26
		金融サービス	7.34
		保険	3.52
		ソフトウェア・サービス	14.09
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	0.60
		電気通信サービス	0.88
		公益事業	1.60
		半導体・半導体製造装置	12.00
		不動産管理・開発	0.19
投資証券	—	—	1.90
合　　計			94.67

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	10	米ドル	2,757,225.38	399,246,236	2,805,000	406,164,000	2.79
	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP500MIC2409	買建	57	米ドル	1,569,021.51	227,194,318	1,598,850	231,513,480	1.59
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	STX E6002409	買建	32	ユーロ	818,428.26	131,308,630	840,960	134,923,617	0.93

(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	55,000.00	7,943,100	7,959,314	0.05

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

ＲＭ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。

ＲＭ国内リートマザーファンド

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（%）
投資証券	日本	60,910,447,650	98.15
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	―	1,150,068,720	1.85
合計（純資産総額）		62,060,516,370	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
不動産投信指数先物取引	買建	日本	1,104,024,000	1.78

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	6,990	590,124.41	4,124,969,628	656,000	4,585,440,000	7.39
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	6,155	550,349.67	3,387,402,228	587,000	3,612,985,000	5.82
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	19,377	155,543.52	3,013,966,906	147,700	2,861,982,900	4.61
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	30,188	96,909.49	2,925,503,910	92,400	2,789,371,200	4.49
日本	投資証券	ＫＤＸ不動産投資法人	16,764	160,084.91	2,683,663,479	161,600	2,709,062,400	4.37
日本	投資証券	ＧＬＰ投資法人	20,128	131,820.07	2,653,274,467	133,600	2,689,100,800	4.33
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	10,439	266,993.57	2,787,145,978	257,400	2,686,998,600	4.33
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	33,015	63,903.96	2,109,789,278	64,600	2,132,769,000	3.44
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	8,987	253,186.3	2,275,385,278	235,900	2,120,033,300	3.42
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	5,889	328,377.56	1,933,815,505	331,000	1,949,259,000	3.14
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	13,404	148,776.11	1,994,195,004	143,900	1,928,835,600	3.11
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	11,939	166,179.64	1,984,018,805	151,700	1,811,146,300	2.92
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	22,014	77,007.94	1,695,252,858	74,800	1,646,647,200	2.65
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	18,006	78,565.78	1,414,655,561	84,000	1,512,504,000	2.44
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	2,069	619,676.15	1,282,109,972	659,000	1,363,471,000	2.20

日本	投資証券	産業ファンド投資法人	10,971	133,845.85	1,468,422,852	124,200	1,362,598,200	2.20
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	4,098	343,859.89	1,409,137,840	329,500	1,350,291,000	2.18
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	7,677	149,660.49	1,148,943,651	146,500	1,124,680,500	1.81
日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	2,499	453,422.38	1,133,102,546	439,500	1,098,310,500	1.77
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	4,026	276,686.59	1,113,940,234	261,900	1,054,409,400	1.70
日本	投資証券	アクティビア・プロパティーズ投資法人	2,913	397,757.05	1,158,666,313	344,500	1,003,528,500	1.62
日本	投資証券	イオンリート投資法人	7,350	138,916.93	1,021,039,492	134,000	984,900,000	1.59
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	3,034	317,621.71	963,664,292	320,000	970,880,000	1.56
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	2,223	441,160.96	980,700,825	428,500	952,555,500	1.53
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	8,850	105,741.58	935,813,034	104,000	920,400,000	1.48
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	7,046	137,127.7	966,201,778	129,800	914,570,800	1.47
日本	投資証券	三菱地所物流リート投資法人	2,069	378,805.14	783,747,843	378,000	782,082,000	1.26
日本	投資証券	森トラストリート投資法人	11,550	72,802.48	840,868,750	66,300	765,765,000	1.23
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	2,483	302,093.57	750,098,338	307,000	762,281,000	1.23
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	5,295	153,230.94	811,357,839	141,200	747,654,000	1.20

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
投資証券	98.15
合　　計	98.15

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（%）
不動産投信指数先物取引	大阪取引所	東証ＲＥＩＴ指数先物	買建	628	日本円	1,068,607,380	1,104,024,000	1.78

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

ＲＭ先進国リートマザーファンド

以下の運用状況は2024年 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	534,218,950	0.74
	オーストラリア	45,085,367	0.06
	小計	579,304,317	0.80
投資証券	アメリカ	56,272,137,293	77.44
	カナダ	1,041,026,742	1.43
	ドイツ	25,134,941	0.03
	イタリア	5,502,494	0.01
	フランス	1,230,695,829	1.69
	オランダ	122,796,056	0.17

	スペイン	332,879,838	0.46
	ベルギー	700,571,407	0.96
	アイルランド	19,356,760	0.03
	イギリス	3,342,039,121	4.60
	オーストラリア	5,141,372,216	7.08
	ニュージーランド	205,703,931	0.28
	香港	638,118,496	0.88
	シンガポール	2,279,782,996	3.14
	韓国	129,200,636	0.18
	イスラエル	74,843,311	0.10
	ガーンジー	159,953,974	0.22
	小計	71,721,116,041	98.70
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	—	367,976,601	0.51
合計（純資産総額）		72,668,396,959	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	買建	—	20,257,090	0.03

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	307,897	17,796.27	5,479,419,652	18,147.78	5,587,648,250	7.69
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	31,560	114,384.62	3,609,978,815	118,553.55	3,741,550,101	5.15
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	198,854	13,062.14	2,597,459,927	17,455.64	3,471,123,837	4.78
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	52,599	41,477.30	2,181,664,516	49,481.05	2,602,654,065	3.58
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	108,410	20,680.42	2,241,964,839	23,964.40	2,597,980,604	3.58
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	289,628	7,918.87	2,293,527,751	8,890.71	2,575,001,452	3.54
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	107,904	20,187.12	2,178,271,393	21,647.59	2,335,862,630	3.21
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	574,964	2,611.02	1,501,244,044	3,259.34	1,874,007,993	2.58
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	70,418	21,197.51	1,492,686,771	25,418.19	1,789,898,244	2.46
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	346,989	4,344.24	1,507,405,651	4,787.08	1,661,066,878	2.29
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	97,494	10,181.53	992,638,193	16,216.15	1,580,977,523	2.18
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	47,237	26,036.63	1,229,892,577	32,312.11	1,526,327,612	2.10
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	114,734	8,710.48	999,389,089	10,720.99	1,230,062,296	1.69
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	134,620	6,852.18	922,441,313	8,850.17	1,191,410,693	1.64
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	191,573	4,844.36	928,049,599	5,244.65	1,004,734,484	1.38
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	21,364	34,631.86	739,875,100	43,157.64	922,019,821	1.27
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	38,873	19,408.93	754,483,604	23,327.27	906,801,355	1.25
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	52,347	17,465.64	914,274,312	17,060.33	893,057,409	1.23
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	41,472	17,943.22	744,141,621	19,248.26	798,264,005	1.10
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	234,067	2,752.88	644,360,605	3,204.42	750,049,912	1.03
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	222,031	2,884.38	640,421,941	3,331.84	739,773,543	1.02

イギリス	投資証券	SEGRO PLC	445,336	1,629.20	725,542,643	1,640.40	730,529,797	1.01
アメリカ	投資証券	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	90,328	6,603.27	596,460,563	7,425.34	670,716,473	0.92
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	62,065	9,430.74	585,319,452	10,415.46	646,435,773	0.89
アメリカ	投資証券	UDR INC	100,827	5,367.39	541,177,960	6,387.12	643,994,955	0.89
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	35,455	14,317.22	507,617,288	17,947.96	636,344,922	0.88
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	72,844	8,992.68	655,062,884	8,576.50	624,746,857	0.86
アメリカ	投資証券	AMERICAN HOMES 4 RENT- A	107,100	5,106.50	546,907,193	5,667.47	606,986,251	0.84
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	234,558	2,793.71	655,287,171	2,555.72	599,464,572	0.82
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	1,731,203	291.83	505,217,642	335.68	581,130,915	0.80

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／国外	業種	投資比率（%）
株式	国外	エクイティ不動産投資信託（REIT）	0.80
投資証券	―	―	98.70
合　　計			99.49

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

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	140,000.00	20,256,516	20,257,090	0.03

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

≪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	12,165円	純資産総額	61.3億円

※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して計算しております。

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

2021年8月20日	0円
2022年8月22日	0円
2023年8月21日	0円
2024年8月20日	0円
－	－
設定来累計	0円

主要な資産の状況

■資産の組入比率

資産	比率(%)
RM国内債券マザーファンド(埼玉重視型)	15.4
RM米ドル建SDGs債券マザーファンド(為替ヘッジあり)	21.4
RMユーロ建SDGs債券マザーファンド(為替ヘッジあり)	14.4
RM新興国債券マザーファンド	1.9
RM国内株式ESGマザーファンド	9.5
RM先進国株式ESGマザーファンド	24.1
RM新興国株式マザーファンド	3.9
RM国内リートマザーファンド	2.9
RM先進国リートマザーファンド	6.2
その他	0.2
合計	100.0

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

■通貨別組入比率

通貨	比率(%)
日本円	63.9
米ドル	23.7
ユーロ	2.3
英ポンド	1.2
香港ドル	0.8
その他	8.1
合計	100.0

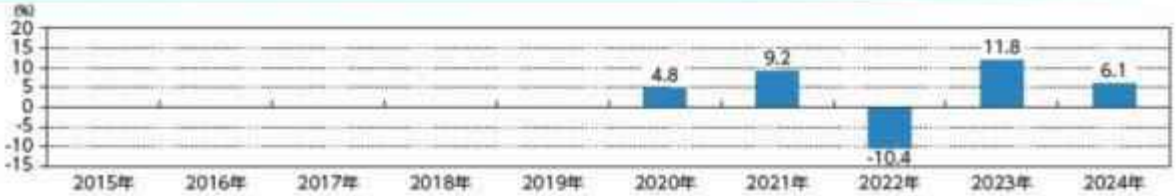
※比率はファンドの純資産総額に対する組入比率であり、四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。
※上記通貨別組入比率は、各マザーファンドが実質的に保有している株式・債券等の通貨を基準に算出しています。
※為替ヘッジをかけている外貨建資産については、日本円に含めています。

■各マザーファンドにおける組入上位銘柄

	国・地域	銘柄名	償還期限	比率(%)
国内債券(埼玉重視型)	日本	平成27年度第6回埼玉県公募公債	2025/9/29	10.61
	日本	令和3年度第2回埼玉県公募公債(5年)	2026/4/15	10.53
	日本	令和5年度第2回埼玉県公募公債	2033/8/29	10.50
米ドル建SDGs債券(為替ヘッジあり)	国際機関	INTL BK RECON & DEVELOP	2028/4/20	7.84
	国際機関	INTL BK RECON & DEVELOP	2028/9/13	7.70
	国際機関	INTL BK RECON & DEVELOP	2031/11/3	7.36
ユーロ建SDGs債券(為替ヘッジあり)	国際機関	INTL BK RECON & DEVELOP	2033/1/19	7.09
	国際機関	INTL BK RECON & DEVELOP	2034/2/14	7.07
	国際機関	EUROPEAN INVESTMENT BANK	2034/1/16	6.98
新興国債券	アイルランド	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	—	99.69
国内株式ESG	日本	トヨタ自動車	—	7.10
	日本	ソニーグループ	—	4.43
	日本	日立製作所	—	4.15
先進国株式ESG	アメリカ	NVIDIA CORP	—	8.26
	アメリカ	MICROSOFT CORP	—	8.19
	アメリカ	ALPHABET INC-CL A	—	2.68
新興国株式	台湾	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	—	9.08
	ケイマン	TENCENT HOLDINGS LTD	—	3.96
	韓国	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	—	3.31
国内リート	日本	日本ビルファンド投資法人	—	7.39
	日本	ジャパンリアルエステイト投資法人	—	5.82
	日本	野村不動産マスターファンド投資法人	—	4.61
先進国リート	アメリカ	PROLOGIS INC	—	7.69
	アメリカ	EQUINIX INC	—	5.15
	アメリカ	WELLTOWER INC	—	4.78

※比率は、各マザーファンドの純資産総額に対する組入比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)



※ファンドにベンチマークはありません。
※2020年9月25日が設定日のため、2019年以前の実績はありません。2020年は9月25日から12月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
（６）申込金額
取得申込受付日の翌営業日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額に、申込手数料と当該手数料に係る消費税等相当額を加算した額です。
（７）申込単位
販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。
（８）申込代金の支払い
取得申込者は、申込金額を販売会社が指定する日までに販売会社へお支払いください。
（９）受付の中止および取消
委託会社は、金融商品取引所※における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得の申込みの受付を中止すること、および既に受け付けた取得の申込みの受付を取り消すことができます。
※金融商品取引法第２条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第２条第８項第３号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。

２【換金（解約）手続等】
（１）解約の受付
販売会社の営業日に受け付けます。
（２）取扱時間
原則として、午後3時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
（４）解約制限
ファンドの規模および商品性格などに基づき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の解約には受付時間制限および金額制限を行なう場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
（５）解約価額
解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。
・基準価額につきましては、販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

委託会社の照会先
りそなアセットマネジメント株式会社
電話番号：0120-223351
（受付時間は営業日の午前９時～午後５時）
ホームページ アドレス：https://www.resona-am.co.jp/

（６）手取額
１口当たりの手取額は、解約価額から解約に係る所定の税金を差し引いた金額となります。
※税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。
詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。
（７）解約単位
販売会社が定める単位とします。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
（８）解約代金の支払い
原則として、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

（９）受付の中止および取消

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

・解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日（この計算日が解約請求を受け付けない日であるときは、この計算日以降の最初の解約請求を受け付けることができる日とします。）に解約請求を受け付けたものとして取り扱います。

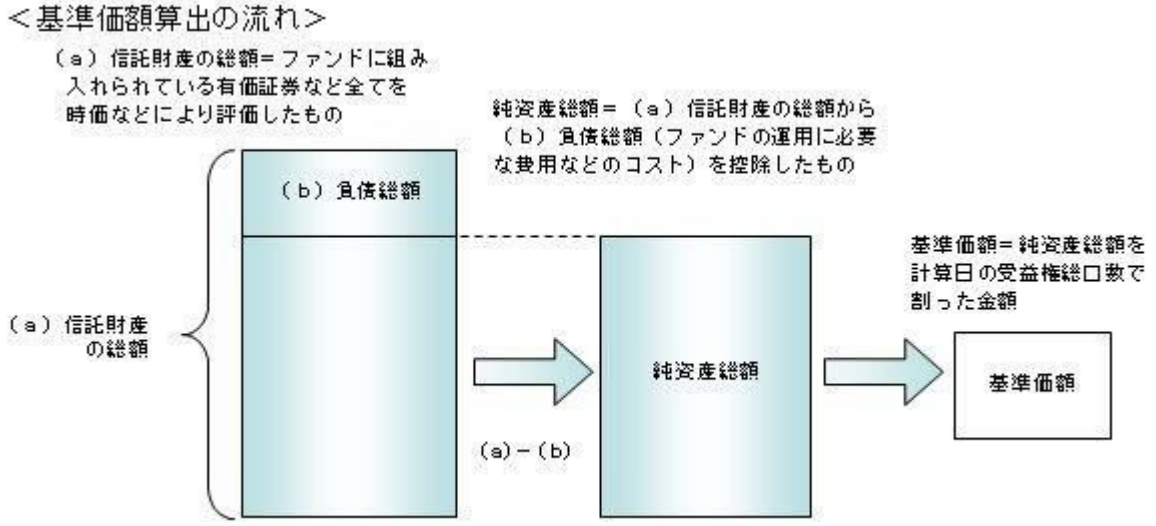
３【資産管理等の概要】

（１）【資産の評価】

① 基準価額の算出

・基準価額は委託会社の営業日において日々算出されます。

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



② 有価証券などの評価基準

・信託財産に属する資産については、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価します。

＜主な資産の評価方法＞

◇マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

◇国内上場株式

原則として、基準価額計算日におけるわが国の金融商品取引所の最終相場で評価します。

◇外国株式

原則として、基準価額計算日に知りうる直近の日における外国金融商品市場の最終相場で評価します。

◇公社債（国内・外国）

原則として、基準価額計算日*における以下のいずれかの価額で評価します。

・日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

・金融商品取引業者（第一種金融商品取引業者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。）、銀行などの提示する価額（売気配相場を除きます。）

・価格情報会社の提供する価額

※残存期間１年以内の公社債などについては、一部償却原価法により評価することができます。

＊外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

◇国内上場不動産投信

原則として、基準価額計算日におけるわが国の金融商品取引所の最終相場で評価します。

◇海外上場不動産投信

原則として、基準価額計算日に知りうる直近の日における外国金融商品市場の最終相場で評価します。

・外貨建資産（外国通貨表示の有価証券、預金その他の資産をいいます。）の円換算については、原則としてわが国における計算日の対顧客相場の仲値によって計算します。

③ 基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

委託会社の照会先
りそなアセットマネジメント株式会社
電話番号：0120-223351
（受付時間は営業日の午前９時～午後５時）
ホームページ アドレス：https://www.resona-am.co.jp/

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

無期限とします（2020年9月25日設定）。ただし、約款の規定に基づき、信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

（４）【計算期間】

毎年8月21日から翌年8月20日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

（５）【その他】

① 信託の終了（繰上償還）

１）委託会社は、次のいずれかの場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し繰上償還させることができます。

イ）信託財産の純資産総額が10億円を下回ることとなったとき

ロ）繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき

ハ）やむを得ない事情が発生したとき

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

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

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

ロ）監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき

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

ニ）受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合またはその任務に違反するなどして解任された場合に、委託会社が新受託会社を選任できないとき

４）繰上償還を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

② 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。

③ 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。

④ 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週間前までに知れ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、知れ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。

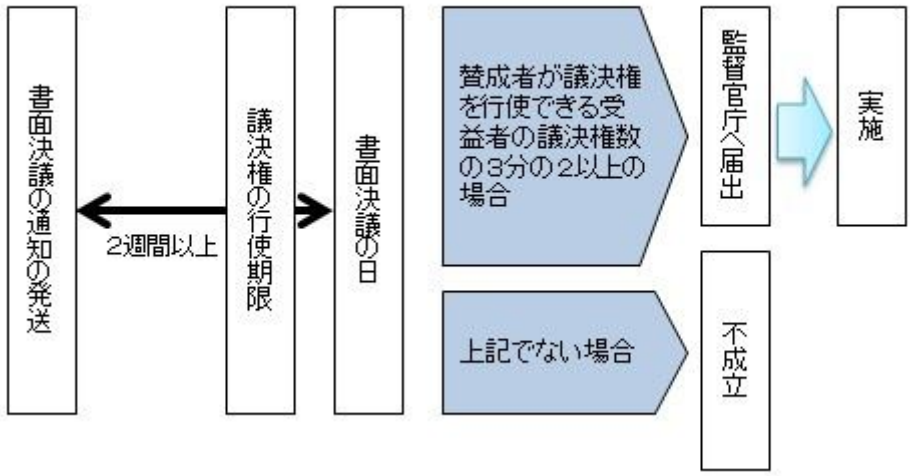
３）書面決議は、議決権を行使することができる受益者の議決権の３分の２以上にあたる多数をもって行ないます。

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＞



⑤　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。

⑥　運用報告書の作成
・委託会社は、毎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/

⑦　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。

⑧　他の受益者の氏名などの開示の請求の制限
受益者は、委託会社または受託会社に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行なうことはできません。
１．他の受益者の氏名または名称および住所
２．他の受益者が有する受益権の内容

４【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

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

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

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

第３【ファンドの経理状況】

（１）　当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

（２）　当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第4期計算期間(2023年 8月22日から2024年 8月20日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

１【財務諸表】

【埼玉りそな・グローバルバランス・プラスＥＳＧ】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第3期 2023年 8月21日現在	第4期 2024年 8月20日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	47,574,497	42,437,153
親投資信託受益証券	6,430,052,956	6,162,942,137
未収利息	-	127
流動資産合計	6,477,627,453	6,205,379,417
資産合計	6,477,627,453	6,205,379,417
負債の部		
流動負債		
未払解約金	99,169	978,476
未払受託者報酬	1,066,040	1,002,102
未払委託者報酬	27,361,491	25,720,652
未払利息	129	-
その他未払費用	216,674	203,669
流動負債合計	28,743,503	27,904,899
負債合計	28,743,503	27,904,899
純資産の部		
元本等		
元本	5,841,506,765	5,070,704,716
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	607,377,185	1,106,769,802
（分配準備積立金）	401,780,775	733,792,147
元本等合計	6,448,883,950	6,177,474,518
純資産合計	6,448,883,950	6,177,474,518
負債純資産合計	6,477,627,453	6,205,379,417

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期 自　2022年 8月23日 至　2023年 8月21日	第4期 自　2023年 8月22日 至　2024年 8月20日
営業収益		
受取利息	-	4,920
有価証券売買等損益	107,856,326	674,550,181
営業収益合計	107,856,326	674,555,101
営業費用		
支払利息	34,353	16,689
受託者報酬	2,160,633	2,055,395
委託者報酬	55,456,028	52,755,143
その他費用	440,296	419,078
営業費用合計	58,091,310	55,246,305
営業利益又は営業損失（△）	49,765,016	619,308,796
経常利益又は経常損失（△）	49,765,016	619,308,796
当期純利益又は当期純損失（△）	49,765,016	619,308,796
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（△）	△13,775,895	86,752,767
期首剰余金又は期首欠損金（△）	603,095,767	607,377,185
剰余金増加額又は欠損金減少額	31,535,864	109,793,366
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	31,535,864	109,793,366
剰余金減少額又は欠損金増加額	90,795,357	142,956,778
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	90,795,357	142,956,778
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	607,377,185	1,106,769,802

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１.有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
２.その他財務諸表作成のための基礎となる事項	当ファンドの計算期間は原則として、毎年8月21日から翌年8月20日までとなっております。ただし、前計算期間末日が休業日のため、当計算期間は2023年 8月22日から2024年 8月20日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

第3期 2023年 8月21日現在		第4期 2024年 8月20日現在	
１． 投資信託財産に係る元本の状況		１． 投資信託財産に係る元本の状況	
期首元本額	6,357,699,438円	期首元本額	5,841,506,765円
期中追加設定元本額	456,220,480円	期中追加設定元本額	586,133,797円
期中一部解約元本額	972,413,153円	期中一部解約元本額	1,356,935,846円
２． 計算期間の末日における受益権の総数	5,841,506,765口	２． 計算期間の末日における受益権の総数	5,070,704,716口
３． 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1.1040円	３． 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1.2183円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額)	(11,040円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額)	(12,183円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第3期 自 2022年 8月23日 至 2023年 8月21日		第4期 自 2023年 8月22日 至 2024年 8月20日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
A 費用控除後の配当等収益額	63,139,279円	A 費用控除後の配当等収益額	96,605,334円
B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	0円	B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	325,519,541円
C 収益調整金額	205,596,410円	C 収益調整金額	372,977,655円
D 分配準備積立金額	338,641,496円	D 分配準備積立金額	311,667,272円
E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D)	607,377,185円	E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D)	1,106,769,802円
F 当ファンドの期末残存口数	5,841,506,765口	F 当ファンドの期末残存口数	5,070,704,716口
G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000)	1,039円	G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000)	2,182円
H 10,000口当たり分配金額	0円	H 10,000口当たり分配金額	0円
I 収益分配金金額(I=F×H/10,000)	0円	I 収益分配金金額(I=F×H/10,000)	0円

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

第3期 自 2022年 8月23日 至 2023年 8月21日	第4期 自 2023年 8月22日 至 2024年 8月20日
１.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	１.金融商品に対する取組方針 同左
２.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、株価変動リスク、金利変動リスク、リートの価格変動リスク、投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。	２.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左
３.金融商品に係るリスク管理体制 運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。	３.金融商品に係るリスク管理体制 同左

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

第3期 2023年 8月21日現在	第4期 2024年 8月20日現在
１.貸借対照表計上額、時価及び差額	１.貸借対照表計上額、時価及び差額

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

（関連当事者との取引に関する注記）

第3期 自 2022年 8月23日 至 2023年 8月21日	第4期 自 2023年 8月22日 至 2024年 8月20日
該当事項はありません。	同左

（重要な後発事象に関する注記）
該当事項はありません。

（その他の注記）
1　有価証券に関する注記
売買目的有価証券

種類	第3期 自 2022年 8月23日 至 2023年 8月21日	第4期 自 2023年 8月22日 至 2024年 8月20日
	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	221,376,226	550,348,983
合計	221,376,226	550,348,983

2　デリバティブ取引に関する注記
該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１　有価証券明細表
(1)株式
該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種　類	銘　柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	RM国内債券マザーファンド（埼玉重視型）	971,354,917	952,316,360	
	RM米ドル建ＳＤＧｓ債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	1,519,447,070	1,322,526,729	
	RMユーロ建ＳＤＧｓ債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	1,016,214,144	893,963,582	
	RM新興国債券マザーファンド	86,400,565	120,589,268	
	RM国内株式ＥＳＧマザーファンド	311,108,425	573,497,270	
	RM先進国株式ＥＳＧマザーファンド	630,522,108	1,499,949,042	
	RM新興国株式マザーファンド	119,764,860	241,194,451	
	RM国内リートマザーファンド	124,390,620	177,107,364	
	RM先進国リートマザーファンド	213,473,901	381,798,071	
合計		4,992,676,610	6,162,942,137	

(注)券面総額欄の数値は口数を表しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

ＲＭ国内債券マザーファンド（埼玉重視型）

貸借対照表

（単位：円）

	2024年 8月20日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	11,136,846
国債証券	105,751,800
地方債証券	834,547,000
未収利息	880,990
前払費用	22,849
流動資産合計	952,339,485
資産合計	952,339,485
負債の部	
流動負債	
流動負債合計	-
負債合計	-
純資産の部	
元本等	
元本	971,354,917
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△19,015,432
元本等合計	952,339,485
純資産合計	952,339,485
負債純資産合計	952,339,485

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

2024年 8月20日現在	
１．　投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 8月22日
期首元本額	1,015,082,191円
期中追加設定元本額	48,439,614円
期中一部解約元本額	92,166,888円
期末元本額	971,354,917円
期末元本の内訳※	
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスＥＳＧ	971,354,917円
２．　計算日における受益権の総数	
	971,354,917口
３．　元本の欠損	
純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	19,015,432円

４．　計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	0.9804円
(10,000口当たり純資産額)	(9,804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）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

2024年 8月20日現在
１.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 ２.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 ３.金融商品に係るリスク管理体制 運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

2024年 8月20日現在
１.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 ２.時価の算定方法 国債証券、地方債証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。 ３.金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

2024年 8月20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20日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	31,800
地方債証券	△1,254,000
合計	△1,222,200

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

2　デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種　類	銘　柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第３６８回日本国債（１０年）	110,000,000	105,751,800	
	国債証券合計	110,000,000	105,751,800	

地方債証券	平成２７年度第６回埼玉県公募公債	100,000,000	100,181,000	
	平成２９年度第９回埼玉県公募公債	100,000,000	98,971,000	
	令和２年度第７回埼玉県公募公債	50,000,000	48,532,000	
	令和２年度第９回埼玉県公募公債	100,000,000	96,845,000	
	令和３年度第２回埼玉県公募公債（５年）	100,000,000	99,363,000	
	令和３年度第８回埼玉県公募公債	100,000,000	95,964,000	
	令和４年度第２回埼玉県公募公債（５年）	100,000,000	99,003,000	
	令和４年度第３回埼玉県公募公債（１０年）	100,000,000	96,589,000	
	令和５年度第２回埼玉県公募公債	100,000,000	99,099,000	
	地方債証券合計	850,000,000	834,547,000	
合計			940,298,800	

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

ＲＭ米ドル建ＳＤＧｓ債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

貸借対照表

（単位：円）

	2024年 8月20日現在
資産の部	
流動資産	
預金	5,194,703
コール・ローン	61,797,020
国債証券	565,649,789
特殊債券	2,582,856,897
派生商品評価勘定	137,027,277
未収利息	16,489,003
前払費用	5,732,667
流動資産合計	3,374,747,356
資産合計	3,374,747,356
負債の部	
流動負債	
未払金	7,983,862
流動負債合計	7,983,862
負債合計	7,983,862
純資産の部	
元本等	
元本	3,867,862,050
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△501,098,556
元本等合計	3,366,763,494
純資産合計	3,366,763,494
負債純資産合計	3,374,747,356

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、特殊債券

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

（貸借対照表に関する注記）

2024年 8月20日現在	
１． 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 8月22日
期首元本額	2,665,691,042円
期中追加設定元本額	3,199,660,896円
期中一部解約元本額	1,997,489,888円
期末元本額	3,867,862,050円
期末元本の内訳※	
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスＥＳＧ	1,519,447,070円
九州ＳＤＧｓ・グローバルバランス	312,241,786円
ラップ型ファンド・プラスＥＳＧ（安定型）	225,074,508円
ラップ型ファンド・プラスＥＳＧ（安定成長型）	1,401,114,979円
ラップ型ファンド・プラスＥＳＧ（成長型）	409,983,707円
２． 計算日における受益権の総数	3,867,862,050口
３． 元本の欠損	
純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	501,098,556円
４． 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	0.8704円
(10,000口当たり純資産額)	(8,704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）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

2024年 8月20日現在
１.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 ２.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。 ３.金融商品に係るリスク管理体制 運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

2024年 8月20日現在
１.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 ２.時価の算定方法 国債証券、特殊債券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 デリバティブ取引 （その他の注記）の2　デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。 ３.金融商品の時価等に関する事項の補足説明

金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

2024年 8月20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20日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	4,342,111
特殊債券	78,622,412
合計	82,964,523

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

2　デリバティブ取引に関する注記
(通貨関連)
（2024年 8月20日現在）　（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	3,319,112,376	－	3,182,085,099	137,027,277
	米ドル	3,319,112,376	－	3,182,085,099	137,027,277
合計		3,319,112,376	－	3,182,085,099	137,027,277

（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。
①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。
②計算日において当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
・計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
・計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。
2)計算日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については計算日の対顧客相場の仲値で評価しております。
※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表
(1)株式
該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種　類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY N/B	970,000.00	961,720.88	
		US TREASURY N/B	770,000.00	776,872.85	
		US TREASURY N/B	370,000.00	322,651.56	

		US TREASURY N/B	840,000.00	857,341.39	
		US TREASURY N/B	900,000.00	943,822.26	
	米ドル 小計		3,850,000.00	3,862,408.94 (565,649,789)	
国債証券合計				565,649,789 (565,649,789)	
特殊債券	米ドル	EUROPEAN BK RECON & DEV	1,000,000.00	996,039.80	
		EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000.00	986,143.90	
		EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000.00	967,640.94	
		EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000.00	959,517.58	
		EUROPEAN INVESTMENT BANK	2,000,000.00	1,696,970.26	
		INTER-AMERICAN DEVEL BK	1,000,000.00	984,095.83	
		INTER-AMERICAN DEVEL BK	1,000,000.00	845,162.01	
		INTER-AMERICAN DEVEL BK	1,000,000.00	967,377.06	
		INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000.00	978,088.77	
		INTL BK RECON & DEVELOP	2,000,000.00	1,829,510.46	
		INTL BK RECON & DEVELOP	2,000,000.00	1,795,114.56	
		INTL BK RECON & DEVELOP	2,000,000.00	1,718,778.38	
		INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000.00	911,960.91	
		INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000.00	1,061,241.05	
		KFW	1,000,000.00	938,800.26	
	米ドル 小計		19,000,000.00	17,636,441.77 (2,582,856,897)	
特殊債券合計				2,582,856,897 (2,582,856,897)	
合計				3,148,506,686 (3,148,506,686)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。
(注2)合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数		組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	国債証券	5銘柄	18.0%	18.0%
	特殊債券	15銘柄	82.0%	82.0%

（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。

ＲＭユーロ建ＳＤＧｓ債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

貸借対照表

（単位：円）

	2024年 8月20日現在
資産の部	
流動資産	
預金	3,043,079
コール・ローン	30,847,025
国債証券	373,939,003
特殊債券	1,807,357,965
派生商品評価勘定	60,162,196
未収入金	58,833
未収利息	3,528,249
前払費用	5,876,135
流動資産合計	2,284,812,485
資産合計	2,284,812,485
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,264,703
未払金	18,707
流動負債合計	3,283,410
負債合計	3,283,410
純資産の部	
元本等	
元本	2,593,425,607
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△311,896,532
元本等合計	2,281,529,075
純資産合計	2,281,529,075
負債純資産合計	2,284,812,485

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

2024年 8月20日現在	
1． 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 8月22日
期首元本額	1,876,715,910円
期中追加設定元本額	2,147,036,999円
期中一部解約元本額	1,430,327,302円
期末元本額	2,593,425,607円
期末元本の内訳※	
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスＥＳＧ	1,016,214,144円
九州ＳＤＧｓ・グローバルバランス	211,061,240円
ラップ型ファンド・プラスＥＳＧ（安定型）	151,397,060円
ラップ型ファンド・プラスＥＳＧ（安定成長型）	941,467,128円
ラップ型ファンド・プラスＥＳＧ（成長型）	273,286,035円
2． 計算日における受益権の総数	
	2,593,425,607口
3． 元本の欠損	

純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	311,896,532円
4．　計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	0.8797円
(10,000口当たり純資産額)	(8,797円)

（注）※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

2024年 8月20日現在
1．金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2．金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。 3．金融商品に係るリスク管理体制 運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

2024年 8月20日現在
1．貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 2．時価の算定方法 国債証券、特殊債券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 デリバティブ取引 （その他の注記）の2　デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。 3．金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

2024年 8月20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20日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	2,517,139
特殊債券	31,998,525
合計	34,515,664

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

2　デリバティブ取引に関する注記

(通貨関連)

（2024年 8月20日現在）　　（単位：円）

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

の取引	売建	2,256,233,040	－	2,199,335,547	56,897,493
	ユーロ	2,256,233,040	－	2,199,335,547	56,897,493
合計		2,256,233,040	－	2,199,335,547	56,897,493

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

①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。

②計算日において当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

・計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種　類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	ユーロ	GOV OF FRANCE	720,000.00	672,373.60	
		GOV OF FRANCE	630,000.00	570,001.95	
		GOV OF FRANCE	10,000.00	8,213.52	
		GOV OF FRANCE	10,000.00	8,081.42	
		GOV OF FRANCE	350,000.00	353,722.25	
		GOV OF FRANCE	660,000.00	691,464.10	
		ユーロ 小計	2,380,000.00	2,303,856.84 (373,939,003)	
		国債証券合計		373,939,003 (373,939,003)	
特殊債券	ユーロ	ASIAN DEVELOPMENT BANK	1,000,000.00	976,244.82	
		ASIAN DEVELOPMENT BANK	1,000,000.00	878,775.00	
		EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000.00	923,557.87	
		EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000.00	911,634.00	
		EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000.00	854,580.53	
		EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000.00	922,032.50	
		EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,000,000.00	1,002,523.70	
		EUROPEAN UNION	1,000,000.00	967,568.00	
		INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000.00	940,507.09	
		INTL BK RECON & DEVELOP	1,000,000.00	1,017,677.50	
		INTL DEVELOPMENT ASSOC	1,000,000.00	835,580.00	
		KFW	1,000,000.00	904,541.50	
		ユーロ 小計	12,000,000.00	11,135,222.51 (1,807,357,965)	

特殊債券合計		1,807,357,965 (1,807,357,965)	
合計		2,181,296,968 (2,181,296,968)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。
(注2)合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数		組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
ユーロ	国債証券	6銘柄	17.1%	17.1%
	特殊債券	12銘柄	82.9%	82.9%

（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。

ＲＭ新興国債券マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2024年 8月20日現在
資産の部	
流動資産	
預金	2,556,507
コール・ローン	32,459,781
投資信託受益証券	13,355,301,403
未収利息	97
流動資産合計	13,390,317,788
資産合計	13,390,317,788
負債の部	
流動負債	
未払解約金	300,000
流動負債合計	300,000
負債合計	300,000
純資産の部	
元本等	
元本	9,593,904,882
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	3,796,112,906
元本等合計	13,390,017,788
純資産合計	13,390,017,788
負債純資産合計	13,390,317,788

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１.有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。
２.デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則としてわが国における計算日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。

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

（貸借対照表に関する注記）

2024年 8月20日現在	
１． 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 8月22日
期首元本額	8,073,114,382円
期中追加設定元本額	4,088,010,834円
期中一部解約元本額	2,567,220,334円
期末元本額	9,593,904,882円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド（安定型）	684,809,917円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	1,143,915,767円
りそなラップ型ファンド（成長型）	812,242,051円
ＤＣりそな　グローバルバランス	22,876,174円
つみたてバランスファンド	1,896,162,204円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	323,050,382円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	289,353,819円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	204,356,371円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	110,102,739円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	76,612,287円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	45,711,799円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	116,326,358円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスＥＳＧ	86,400,565円
九州ＳＤＧｓ・グローバルバランス	27,901,121円
ラップ型ファンド・プラスＥＳＧ（安定型）	9,035,940円
ラップ型ファンド・プラスＥＳＧ（安定成長型）	92,809,735円
ラップ型ファンド・プラスＥＳＧ（成長型）	123,710,819円
りそな　つみたてラップ型ファンド（安定型）	50,101,426円
りそな　つみたてラップ型ファンド（安定成長型）	46,672,672円
りそな　つみたてラップ型ファンド（成長型）	30,331,014円
ターゲットリターンバランスファンド（目標２％）	1,839,738円
ターゲットリターンバランスファンド（目標３％）	1,064,152円
ターゲットリターンバランスファンド（目標４％）	3,771,509円
ターゲットリターンバランスファンド（目標５％）	1,520,398円
ターゲットリターンバランスファンド（目標６％）	2,883,593円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６５	1,103,604円
ＦＷりそな先進国＋新興国債券アクティブファンド	8,470,549円
ＦＷりそな新興国債券インデックスファンド	2,435,690,640円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	92,049,966円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	329,152,021円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	498,312,933円
りそなＶＩグローバル・バランスファンド（安定型）（適格機関投資家専用）	1,364,343円
りそなＶＩグローバル・バランスファンド（安定成長型）（適格機関投資家専用）	3,861,177円
りそなＶＩグローバル・バランスファンド（成長型）（適格機関投資家専用）	20,337,099円
２． 計算日における受益権の総数	9,593,904,882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	1.3957円
(10,000口当たり純資産額)	(13,957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）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

2024年 8月20日現在
１.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

2．金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク
　当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。
　これらは、投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。
　デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。
3．金融商品に係るリスク管理体制
　運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。
　また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

2024年 8月20日現在

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

（関連当事者との取引に関する注記）

2024年 8月20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20日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
投資信託受益証券	118,075,846
合計	118,075,846

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

2　デリバティブ取引に関する注記
該当事項はありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表
(1)株式
該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種　類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	米ドル	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	2,044,241	91,193,591.01	
		米ドル 小計	2,044,241	91,193,591.01 (13,355,301,403)	
合計				13,355,301,403 (13,355,301,403)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。
(注2)合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。
(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数		組入投資信託受益証券時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	投資信託受益証券	1銘柄	100.0%	100.0%

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

ＲＭ国内株式ＥＳＧマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2024年 8月20日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	236,843,772
株式	7,018,311,870
投資証券	34,677,600
派生商品評価勘定	5,254,960
未収配当金	7,180,150
未収利息	713
前払金	5,594,750
差入委託証拠金	27,728,315
流動資産合計	7,335,592,130
資産合計	7,335,592,130
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	6,483,270
未払解約金	2,840,000
流動負債合計	9,323,270
負債合計	9,323,270
純資産の部	
元本等	
元本	3,974,277,307
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	3,351,991,553
元本等合計	7,326,268,860
純資産合計	7,326,268,860
負債純資産合計	7,335,592,130

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１.有価証券の評価基準及び評価方法	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	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20日現在	
1． 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 8月22日
期首元本額	2,528,053,182円
期中追加設定元本額	4,421,170,159円
期中一部解約元本額	2,974,946,034円
期末元本額	3,974,277,307円
期末元本の内訳※	
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスＥＳＧ	311,108,425円
国内株式ＥＳＧインデックス・オープン	64,980,772円
九州ＳＤＧｓ・グローバルバランス	140,289,715円
ラップ型ファンド・プラスＥＳＧ（安定型）	29,575,604円
ラップ型ファンド・プラスＥＳＧ（安定成長型）	568,527,215円
ラップ型ファンド・プラスＥＳＧ（成長型）	944,462,784円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　国内株式ＥＳＧインデックス	1,475,691,471円
国内株式ＥＳＧインデックスファンド（適格機関投資家専用）	439,641,321円
2． 計算日における受益権の総数	
	3,974,277,307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	1.8434円
(10,000口当たり純資産額)	(18,434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）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

2024年 8月20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。

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

2024年 8月20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20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20日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
株式	343,470,943
投資証券	△327,553
合計	343,143,390

(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20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	271,100,310	－	269,872,000	△1,228,310
合計		271,100,310	－	269,872,000	△1,228,310

（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	17,300	2,160.00	37,368,000	
大林組	11,900	1,879.00	22,360,100	
清水建設	9,500	918.20	8,722,900	
戸田建設	4,100	988.80	4,054,080	
大和ハウス工業	10,200	4,424.00	45,124,800	
積水ハウス	10,900	3,566.00	38,869,400	
高砂熱学工業	800	5,240.00	4,192,000	
明治ホールディングス	4,300	3,477.00	14,951,100	
サッポロホールディングス	1,200	7,282.00	8,738,400	
アサヒグループホールディングス	8,800	5,377.00	47,317,600	
キリンホールディングス	14,200	2,098.50	29,798,700	
サントリー食品インターナショナル	2,500	5,163.00	12,907,500	
伊藤園	1,000	3,523.00	3,523,000	
キッコーマン	12,200	1,748.50	21,331,700	

味の素	8,600	5,410.00	46,526,000	
カゴメ	1,400	3,164.00	4,429,600	
ニチレイ	2,000	4,074.00	8,148,000	
日清食品ホールディングス	3,700	3,836.00	14,193,200	
東洋紡	1,500	986.00	1,479,000	
帝人	3,300	1,351.50	4,459,950	
東レ	25,400	755.30	19,184,620	
クラレ	5,500	1,851.50	10,183,250	
旭化成	22,900	1,014.00	23,220,600	
住友化学	27,300	421.50	11,506,950	
東ソー	4,800	1,893.00	9,086,400	
デンカ	1,500	2,221.50	3,332,250	
エア・ウォーター	3,400	1,944.50	6,611,300	
カネカ	800	3,856.00	3,084,800	
三井化学	3,100	3,672.00	11,383,200	
東京応化工業	1,800	3,840.00	6,912,000	
三菱ケミカルグループ	24,800	868.40	21,536,320	
ダイセル	4,200	1,323.00	5,556,600	
積水化学工業	7,000	2,190.00	15,330,000	
ＵＢＥ	1,700	2,689.50	4,572,150	
日本化薬	2,500	1,285.50	3,213,750	
花王	8,500	6,436.00	54,706,000	
日本ペイントホールディングス	17,300	915.20	15,832,960	
関西ペイント	3,100	2,590.50	8,030,550	
中国塗料	700	1,889.00	1,322,300	
ＤＩＣ	1,400	3,044.00	4,261,600	
富士フイルムホールディングス	20,500	3,602.00	73,841,000	
資生堂	7,300	3,553.00	25,936,900	
ライオン	4,700	1,433.50	6,737,450	
日東電工	2,600	11,550.00	30,030,000	
信越ポリマー	700	1,539.00	1,077,300	
ニフコ	1,500	3,476.00	5,214,000	
ユニ・チャーム	7,400	5,100.00	37,740,000	
協和キリン	4,900	3,140.00	15,386,000	
アステラス製薬	33,100	1,712.00	56,667,200	
塩野義製薬	4,600	6,624.00	30,470,400	
エーザイ	4,600	5,910.00	27,186,000	
小野薬品工業	6,800	2,150.00	14,620,000	
第一三共	33,800	5,860.00	198,068,000	
ＥＮＥＯＳホールディングス	52,700	755.10	39,793,770	
ブリヂストン	10,400	5,888.00	61,235,200	
住友理工	700	1,425.00	997,500	
太平洋セメント	2,000	3,559.00	7,118,000	

東海カーボン	3,700	887.60	3,284,120	
ＴＯＴＯ	2,600	4,661.00	12,118,600	
日本特殊陶業	2,800	4,269.00	11,953,200	
日本製鉄	15,600	3,234.00	50,450,400	
神戸製鋼所	6,900	1,755.50	12,112,950	
ＪＦＥホールディングス	10,500	1,951.00	20,485,500	
日本軽金属ホールディングス	1,000	1,627.00	1,627,000	
三井金属鉱業	1,000	4,737.00	4,737,000	
三菱マテリアル	2,300	2,637.50	6,066,250	
住友金属鉱山	4,500	4,156.00	18,702,000	
ＤＯＷＡホールディングス	1,000	4,959.00	4,959,000	
東邦チタニウム	600	1,224.00	734,400	
ＵＡＣＪ	600	4,950.00	2,970,000	
ＬＩＸＩＬ	5,300	1,701.50	9,017,950	
三浦工業	1,600	3,307.00	5,291,200	
ナブテスコ	2,000	2,431.50	4,863,000	
小松製作所	16,900	4,154.00	70,202,600	
日立建機	2,000	3,537.00	7,074,000	
クボタ	18,300	2,050.50	37,524,150	
荏原製作所	8,400	2,027.00	17,026,800	
ダイキン工業	4,800	18,075.00	86,760,000	
栗田工業	1,900	5,946.00	11,297,400	
ダイフク	5,600	2,726.00	15,265,600	
グローリー	800	2,537.00	2,029,600	
セガサミーホールディングス	2,900	2,409.50	6,987,550	
ＮＴＮ	7,800	268.60	2,095,080	
日立造船	3,000	933.00	2,799,000	
三菱重工業	58,600	1,865.00	109,289,000	
ＩＨＩ	2,500	5,768.00	14,420,000	
イビデン	2,100	5,348.00	11,230,800	
コニカミノルタ	8,300	405.80	3,368,140	
ブラザー工業	4,200	2,744.00	11,524,800	
日立製作所	84,800	3,510.00	297,648,000	
富士電機	2,300	8,469.00	19,478,700	
安川電機	4,400	4,848.00	21,331,200	
オムロン	3,200	5,489.00	17,564,800	
日本電気	4,500	12,765.00	57,442,500	
富士通	32,200	2,551.50	82,158,300	
ルネサスエレクトロニクス	27,400	2,488.00	68,171,200	
セイコーエプソン	5,300	2,650.00	14,045,000	
アルバック	800	8,304.00	6,643,200	
パナソニック　ホールディングス	42,600	1,159.50	49,394,700	
シャープ	4,800	961.20	4,613,760	

アンリツ	2,500	1,138.00	2,845,000	
ソニーグループ	22,800	13,270.00	302,556,000	
ＴＤＫ	7,100	9,964.00	70,744,400	
アルプスアルパイン	3,400	1,501.00	5,103,400	
マクセル	800	1,574.00	1,259,200	
横河電機	4,200	3,743.00	15,720,600	
アズビル	2,100	4,491.00	9,431,100	
アドバンテスト	14,000	6,660.00	93,240,000	
シスメックス	9,200	2,723.00	25,051,600	
スタンレー電気	2,300	2,787.00	6,410,100	
ウシオ電機	1,400	2,074.00	2,903,600	
ファナック	17,400	4,165.00	72,471,000	
ローム	6,000	1,733.00	10,398,000	
太陽誘電	2,300	3,727.00	8,572,100	
村田製作所	31,500	2,957.50	93,161,250	
リコー	10,000	1,371.50	13,715,000	
東京エレクトロン	8,600	28,405.00	244,283,000	
川崎重工業	2,800	5,013.00	14,036,400	
トヨタ自動車	193,900	2,687.00	521,009,300	
ヤマハ発動機	16,300	1,281.50	20,888,450	
島津製作所	4,300	4,793.00	20,609,900	
ニコン	5,500	1,573.50	8,654,250	
ＨＯＹＡ	6,400	19,650.00	125,760,000	
ノーリツ鋼機	300	3,995.00	1,198,500	
前田工繊	700	1,515.00	1,060,500	
大日本印刷	3,800	4,995.00	18,981,000	
ＮＩＳＳＨＡ	700	2,004.00	1,402,800	
アシックス	12,500	2,523.50	31,543,750	
ヤマハ	2,400	3,301.00	7,922,400	
ピジョン	2,100	1,555.50	3,266,550	
リンテック	700	3,100.00	2,170,000	
任天堂	19,000	8,149.00	154,831,000	
コクヨ	1,400	2,460.00	3,444,000	
美津濃	300	8,660.00	2,598,000	
東北電力	8,300	1,281.50	10,636,450	
九州電力	7,400	1,532.00	11,336,800	
電源開発	2,700	2,472.50	6,675,750	
レノバ	700	1,007.00	704,900	
東京瓦斯	6,600	3,564.00	23,522,400	
大阪瓦斯	6,700	3,488.00	23,369,600	
東邦瓦斯	1,300	4,334.00	5,634,200	
西部ガスホールディングス	400	1,911.00	764,400	
相鉄ホールディングス	1,400	2,420.50	3,388,700	

東急	9,100	1,739.00	15,824,900	
京王電鉄	1,900	3,587.00	6,815,300	
西日本旅客鉄道	8,000	2,746.50	21,972,000	
西武ホールディングス	4,100	2,742.50	11,244,250	
西日本鉄道	1,100	2,422.50	2,664,750	
阪急阪神ホールディングス	4,200	4,240.00	17,808,000	
南海電気鉄道	1,900	2,380.00	4,522,000	
京阪ホールディングス	1,800	2,878.00	5,180,400	
名古屋鉄道	3,400	1,748.50	5,944,900	
ヤマトホールディングス	4,600	1,657.50	7,624,500	
山九	900	4,564.00	4,107,600	
センコーグループホールディングス	2,000	1,165.00	2,330,000	
九州旅客鉄道	2,400	3,816.00	9,158,400	
ＳＧホールディングス	5,900	1,564.50	9,230,550	
日本郵船	8,400	5,045.00	42,378,000	
ＡＮＡホールディングス	2,900	2,829.00	8,204,100	
トランコム	100	6,700.00	670,000	
ＴＩＳ	3,900	3,312.00	12,916,800	
ＳＨＩＦＴ	200	11,860.00	2,372,000	
ティーガイア	300	3,670.00	1,101,000	
マネーフォワード	800	5,153.00	4,122,400	
野村総合研究所	6,900	4,784.00	33,009,600	
メルカリ	2,100	2,185.00	4,588,500	
Ｓａｎｓａｎ	1,300	2,077.00	2,700,100	
フリー	800	2,679.00	2,143,200	
ＬＩＮＥヤフー	48,900	380.50	18,606,450	
ネットワンシステムズ	1,400	3,163.00	4,428,200	
ＢＩＰＲＯＧＹ	1,300	4,568.00	5,938,400	
ＫＤＤＩ	27,400	4,737.00	129,793,800	
ソフトバンク	52,200	1,967.00	102,677,400	
ＳＣＳＫ	2,900	2,772.50	8,040,250	
あらた	500	3,450.00	1,725,000	
双日	4,100	3,460.00	14,186,000	
ＴＯＫＡＩホールディングス	1,800	974.00	1,753,200	
アズワン	1,000	3,050.00	3,050,000	
伊藤忠商事	21,700	7,169.00	155,567,300	
丸紅	26,100	2,480.00	64,728,000	
キヤノンマーケティングジャパン	800	4,378.00	3,502,400	
伊藤忠エネクス	1,000	1,614.00	1,614,000	
ＰＡＬＴＡＣ	500	4,397.00	2,198,500	
アスクル	700	2,179.00	1,525,300	
ゲオホールディングス	400	1,567.00	626,800	
アダストリア	500	3,525.00	1,762,500	

エディオン	1,200	1,815.00	2,178,000	
ジンズホールディングス	200	4,890.00	978,000	
Ｊ．フロント　リテイリング	4,500	1,527.50	6,873,750	
マツキヨココカラ＆カンパニー	6,300	2,191.00	13,803,300	
ＺＯＺＯ	2,500	4,637.00	11,592,500	
三越伊勢丹ホールディングス	6,200	2,407.00	14,923,400	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	1,000	888.00	888,000	
イオン北海道	800	904.00	723,200	
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	7,000	3,533.00	24,731,000	
スギホールディングス	1,900	2,618.00	4,974,200	
日本瓦斯	1,900	2,338.50	4,443,150	
丸井グループ	2,900	2,386.00	6,919,400	
イオン	12,000	3,533.00	42,396,000	
ヤオコー	300	9,245.00	2,773,500	
ケーズホールディングス	2,600	1,569.50	4,080,700	
ヤマダホールディングス	9,700	447.80	4,343,660	
ファーストリテイリング	3,200	44,150.00	141,280,000	
三井住友トラスト・ホールディングス	12,000	3,651.00	43,812,000	
三井住友フィナンシャルグループ	22,900	10,000.00	229,000,000	
みずほフィナンシャルグループ	44,100	3,091.00	136,313,100	
大和証券グループ本社	24,400	1,109.00	27,059,600	
野村ホールディングス	55,000	849.90	46,744,500	
ＳＯＭＰＯホールディングス	16,300	3,347.00	54,556,100	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	23,500	3,365.00	79,077,500	
東京海上ホールディングス	34,400	5,578.00	191,883,200	
Ｔ＆Ｄホールディングス	9,000	2,425.50	21,829,500	
東京センチュリー	2,700	1,520.50	4,105,350	
オリックス	21,100	3,478.00	73,385,800	
ヒューリック	7,000	1,440.00	10,080,000	
東急不動産ホールディングス	10,500	1,029.00	10,804,500	
三井不動産	48,800	1,499.50	73,175,600	
三菱地所	20,600	2,396.50	49,367,900	
平和不動産	500	4,060.00	2,030,000	
東京建物	3,400	2,443.50	8,307,900	
住友不動産	5,200	4,808.00	25,001,600	
ジェイエイシーリクルートメント	1,200	702.00	842,400	
パーソルホールディングス	34,100	279.10	9,517,310	
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	1,000	2,634.50	2,634,500	
オリエンタルランド	20,000	4,040.00	80,800,000	
ダスキン	700	3,662.00	2,563,400	
リゾートトラスト	1,500	2,519.00	3,778,500	
ビー・エム・エル	400	2,721.00	1,088,400	

ユー・エス・エス	7,500	1,322.50	9,918,750	
楽天グループ	27,400	908.00	24,879,200	
テクノプロ・ホールディングス	2,000	2,913.50	5,827,000	
リクルートホールディングス	27,200	8,463.00	230,193,600	
インソース	900	928.00	835,200	
カーブスホールディングス	900	768.00	691,200	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	400	1,206.00	482,400	
乃村工藝社	1,400	838.00	1,173,200	
セコム	3,800	10,205.00	38,779,000	
合　計	2,200,200		7,018,311,870	

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種　類	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	森ヒルズリート投資法人	28	3,581,200	
	積水ハウス・リート投資法人	76	6,308,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	23	12,788,000	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	54	7,808,400	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	16	4,192,000	
合計		197	34,677,600	

(注)券面総額欄の数値は口数を表しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

ＲＭ先進国株式ＥＳＧマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2024年 8月20日現在
資産の部	
流動資産	
預金	397,718,252
コール・ローン	49,184,409
株式	13,719,839,209
投資証券	276,527,961
派生商品評価勘定	15,052,729
未収入金	50,516
未収配当金	13,635,286
未収利息	148
差入委託証拠金	195,817,477
流動資産合計	14,667,825,987
資産合計	14,667,825,987
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	771,242
流動負債合計	771,242
負債合計	771,242

	2024年 8月20日現在
純資産の部	
元本等	
元本	6,165,457,776
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	8,501,596,969
元本等合計	14,667,054,745
純資産合計	14,667,054,745
負債純資産合計	14,667,825,987

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20日現在	
1． 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 8月22日
期首元本額	3,720,634,253円
期中追加設定元本額	4,874,806,151円
期中一部解約元本額	2,429,982,628円
期末元本額	6,165,457,776円
期末元本の内訳※	
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスＥＳＧ	630,522,108円
先進国株式ＥＳＧインデックス・オープン	19,058,527円
九州ＳＤＧｓ・グローバルバランス	270,175,204円
ラップ型ファンド・プラスＥＳＧ（安定型）	37,545,648円
ラップ型ファンド・プラスＥＳＧ（安定成長型）	823,706,500円
ラップ型ファンド・プラスＥＳＧ（成長型）	2,004,954,676円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　先進国株式ＥＳＧインデックス	2,379,495,113円
2． 計算日における受益権の総数	6,165,457,776口
3． 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	2.3789円
(10,000口当たり純資産額)	(23,789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）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

2024年 8月20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。

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

2024年 8月20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20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20日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
株式	1,674,454,241
投資証券	27,367,326
合計	1,701,821,567

(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20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	650,610,945	－	665,598,750	14,987,805
合計		650,610,945	－	665,598,750	14,987,805

（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20日現在）　　（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	46,573,873	－	45,867,555	△706,318
	米ドル	41,667,190	－	40,998,768	△668,422
	ユーロ	4,906,683	－	4,868,787	△37,896
合計		46,573,873	－	45,867,555	△706,318

（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。

①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。

②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 単価	評価額 金額	備考
米ドル	BAKER HUGHES COMPANY	2,822	35.16	99,221.52	
	CHENIERE ENERGY INC	650	186.09	120,958.50	
	HALLIBURTON CO	2,508	31.85	79,879.80	
	HF SINCLAIR CORP	457	49.04	22,411.28	
	KINDER MORGAN INC	5,633	21.36	120,320.88	
	MARATHON PETROLEUM CORP	1,017	178.90	181,941.30	
	ONEOK INC	1,645	88.40	145,418.00	
	PHILLIPS 66	1,207	139.34	168,183.38	
	SCHLUMBERGER LTD	4,017	45.36	182,211.12	
	TARGA RESOURCES CORP	616	144.49	89,005.84	
	VALERO ENERGY CORP	930	148.22	137,844.60	
	WILLIAMS COS INC	3,438	45.02	154,778.76	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	626	274.17	171,630.42	
	AVERY DENNISON CORP	237	213.26	50,542.62	
	BALL CORP	924	63.67	58,831.08	
	CRH PLC	1,936	84.98	164,521.28	
	ECOLAB INC	725	242.21	175,602.25	
	INTERNATIONAL PAPER CO	969	47.63	46,153.47	
	INTL FLAVORS & FRAGRANCES	717	98.91	70,918.47	
	LINDE PLC	1,361	458.58	624,127.38	

LYONDELLBASELL INDU-CL A	731	96.96	70,877.76	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	174	534.51	93,004.74	
NEWMONT CORP	3,247	51.19	166,213.93	
NUCOR CORP	677	144.07	97,535.39	
PPG INDUSTRIES INC	661	123.25	81,468.25	
SMURFIT WESTROCK PLC	1,458	43.49	63,408.42	
STEEL DYNAMICS INC	441	116.06	51,182.46	
3M CO	1,557	127.08	197,863.56	
AERCAP HOLDINGS NV	608	94.95	57,729.60	
ALLEGION PLC	245	132.85	32,548.25	
AXON ENTERPRISE INC	208	373.07	77,598.56	
CARRIER GLOBAL CORP	2,281	68.64	156,567.84	
CATERPILLAR INC	1,410	344.65	485,956.50	
CNH INDUSTRIAL NV	2,449	9.96	24,392.04	
CUMMINS INC	385	301.32	116,008.20	
DEERE & CO	746	372.91	278,190.86	
DOVER CORP	399	181.70	72,498.30	
EATON CORP PLC	1,128	297.05	335,072.40	
EMCOR GROUP INC	137	368.54	50,489.98	
FORTIVE CORP	1,020	70.56	71,971.20	
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS I	345	77.05	26,582.25	
GENERAL ELECTRIC CO	3,086	170.93	527,489.98	
GRACO INC	465	80.82	37,581.30	
IDEX CORP	220	199.18	43,819.60	
ILLINOIS TOOL WORKS	842	242.66	204,319.72	
INGERSOLL-RAND INC	1,134	90.95	103,137.30	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	1,918	70.53	135,276.54	
LENNOX INTERNATIONAL INC	93	578.14	53,767.02	
OWENS CORNING	238	162.58	38,694.04	
PENTAIR PLC	457	84.89	38,794.73	
QUANTA SERVICES INC	411	268.10	110,189.10	
ROCKWELL AUTOMATION INC	322	265.20	85,394.40	
TORO CO	292	89.49	26,131.08	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	640	346.99	222,073.60	
UNITED RENTALS INC	189	719.90	136,061.10	
WW GRAINGER INC	124	958.14	118,809.36	
XYLEM INC	679	134.38	91,244.02	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	1,158	264.65	306,464.70	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	342	209.27	71,570.34	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	396	55.57	22,005.72	
CINTAS CORP	257	772.98	198,655.86	
PAYCHEX INC	909	125.21	113,815.89	
PAYLOCITY HOLDING CORP	120	152.01	18,241.20	

TRANSUNION	564	93.61	52,796.04	
VERALTO CORP	689	109.58	75,500.62	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	356	101.05	35,973.80	
CSX CORP	5,542	33.64	186,432.88	
DELTA AIR LINES INC	415	40.47	16,795.05	
EXPEDITORS INTL WASH INC	421	121.30	51,067.30	
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	5,353	3.33	17,825.49	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	225	175.34	39,451.50	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	502	53.91	27,062.82	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	554	200.16	110,888.64	
UNION PACIFIC CORP	1,724	246.07	424,224.68	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	2,058	128.95	265,379.10	
APTIV PLC	790	70.99	56,082.10	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	2,054	13.53	27,790.62	
TESLA INC	8,094	222.72	1,802,695.68	
DECKERS OUTDOOR CORP	72	963.22	69,351.84	
DR HORTON INC	841	181.45	152,599.45	
LULULEMON ATHLETICA INC	322	259.12	83,436.64	
NIKE INC -CL B	3,415	83.28	284,401.20	
NVR INC	9	8,854.82	79,693.38	
PULTEGROUP INC	595	125.18	74,482.10	
BOOKING HOLDINGS INC	96	3,702.01	355,392.96	
DARDEN RESTAURANTS INC	327	149.68	48,945.36	
DOMINO'S PIZZA INC	101	432.84	43,716.84	
DOORDASH INC - A	821	129.56	106,368.76	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	708	214.55	151,901.40	
MCDONALD'S CORP	2,036	287.55	585,451.80	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	686	161.43	110,740.98	
YUM! BRANDS INC	792	136.69	108,258.48	
ALPHABET INC-CL A	16,649	166.67	2,774,888.83	
ALPHABET INC-CL C	14,418	168.40	2,427,991.20	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	263	355.06	93,380.78	
COMCAST CORP-CLASS A	11,177	40.26	449,986.02	
ELECTRONIC ARTS INC	711	149.67	106,415.37	
FOX CORP - CLASS A	626	39.70	24,852.20	
FOX CORP- CLASS B	344	36.88	12,686.72	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	1,065	31.36	33,398.40	
OMNICOM GROUP	573	96.91	55,529.43	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	452	150.50	68,026.00	
WALT DISNEY CO/THE	5,173	90.82	469,811.86	
AUTOZONE INC	49	3,172.18	155,436.82	
BATH & BODY WORKS INC	607	34.26	20,795.82	
BEST BUY CO INC	566	85.04	48,132.64	

BURLINGTON STORES INC	177	264.45	46,807.65	
CARMAX INC	442	80.31	35,497.02	
DICK'S SPORTING GOODS INC	162	226.60	36,709.20	
EBAY INC	1,450	56.68	82,186.00	
ETSY INC	340	54.88	18,659.20	
FERGUSON ENTERPRISES INC	589	206.75	121,775.75	
GENUINE PARTS CO	407	138.68	56,442.76	
HOME DEPOT INC	2,799	363.07	1,016,232.93	
LKQ CORP	749	41.12	30,798.88	
LOWE'S COS INC	1,614	243.21	392,540.94	
MERCADOLIBRE INC	128	2,028.00	259,584.00	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	166	1,121.50	186,169.00	
POOL CORP	106	345.59	36,632.54	
TJX COMPANIES INC	3,195	112.49	359,405.55	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	302	263.94	79,709.88	
ULTA BEAUTY INC	141	377.06	53,165.46	
WILLIAMS-SONOMA INC	356	140.37	49,971.72	
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	977	20.92	20,438.84	
KROGER CO	1,934	52.76	102,037.84	
TARGET CORP	1,304	144.63	188,597.52	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	2,059	10.85	22,340.15	
BUNGE GLOBAL SA	419	96.25	40,328.75	
CAMPBELL SOUP CO	529	49.95	26,423.55	
COCA-COLA CO/THE	11,566	68.98	797,822.68	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	552	77.15	42,586.80	
CONAGRA BRANDS INC	1,322	31.09	41,100.98	
GENERAL MILLS INC	1,588	69.82	110,874.16	
HORMEL FOODS CORP	831	32.68	27,157.08	
JM SMUCKER CO/THE	293	120.93	35,432.49	
KELLANOVA	799	80.26	64,127.74	
KEURIG DR PEPPER INC	3,043	35.62	108,391.66	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	441	62.93	27,752.13	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	735	78.16	57,447.60	
PEPSICO INC	3,881	173.82	674,595.42	
CHURCH & DWIGHT CO INC	708	100.16	70,913.28	
CLOROX COMPANY	360	149.18	53,704.80	
COLGATE-PALMOLIVE CO	2,206	101.85	224,681.10	
KIMBERLY-CLARK CORP	949	143.46	136,143.54	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	6,647	168.42	1,119,487.74	
ALIGN TECHNOLOGY INC	208	240.01	49,922.08	
CENCORA INC	503	238.85	120,141.55	
CIGNA GROUP/THE	799	342.33	273,521.67	
COOPER COS INC/THE	577	95.22	54,941.94	

DAVITA INC	142	152.17	21,608.14	
DEXCOM INC	1,074	77.69	83,439.06	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	1,683	68.26	114,881.58	
ELEVANCE HEALTH INC	656	543.39	356,463.84	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES I	1,210	85.59	103,563.90	
HCA HEALTHCARE INC	558	374.21	208,809.18	
HENRY SCHEIN INC	359	69.82	25,065.38	
HOLOGIC INC	682	81.35	55,480.70	
HUMANA INC	338	353.25	119,398.50	
IDEXX LABORATORIES INC	233	496.99	115,798.67	
INSULET CORP	191	195.92	37,420.72	
LABCORP HOLDINGS INC	244	226.16	55,183.04	
MOLINA HEALTHCARE INC	170	346.18	58,850.60	
QUEST DIAGNOSTICS INC	322	151.12	48,660.64	
SOLVENTUM CORP	412	59.45	24,493.40	
STERIS PLC	275	233.57	64,231.75	
TELEFLEX INC	131	238.00	31,178.00	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	571	111.77	63,820.67	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	826	140.51	116,061.26	
AMGEN INC	1,514	327.97	496,546.58	
AVANTOR INC	1,971	25.41	50,083.11	
BIO-TECHNE CORP	440	74.99	32,995.60	
BIOGEN INC	422	206.06	86,957.32	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	5,722	49.30	282,094.60	
CATALENT INC	508	59.41	30,180.28	
DANAHER CORP	1,987	271.27	539,013.49	
ELI LILLY & CO	2,283	921.81	2,104,492.23	
GILEAD SCIENCES INC	3,520	74.45	262,064.00	
IQVIA HOLDINGS INC	513	243.11	124,715.43	
JOHNSON & JOHNSON	6,808	159.63	1,086,761.04	
MERCK & CO. INC.	7,155	114.42	818,675.10	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	62	1,434.79	88,956.98	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	277	148.24	41,062.48	
REPLIGEN CORP	164	153.82	25,226.48	
WATERS CORP	172	340.26	58,524.72	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	213	301.68	64,257.84	
ZOETIS INC	1,292	184.48	238,348.16	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	1,317	41.60	54,787.20	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	4,190	14.03	58,785.70	
KEYCORP	2,581	16.70	43,102.70	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	1,123	174.50	195,963.50	
REGIONS FINANCIAL CORP	2,644	21.76	57,533.44	
TRUIST FINANCIAL CORP	3,765	42.95	161,706.75	

US BANCORP	4,397	43.66	191,973.02	
ALLY FINANCIAL INC	758	42.77	32,419.66	
AMERICAN EXPRESS CO	1,626	254.05	413,085.30	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	282	435.34	122,765.88	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	2,126	65.74	139,763.24	
BLACKROCK INC	420	870.21	365,488.20	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	1,077	142.93	153,935.61	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	305	204.59	62,399.95	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	706	136.63	96,460.78	
EQUITABLE HOLDINGS INC	908	41.02	37,246.16	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	110	413.04	45,434.40	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	1,624	79.16	128,555.84	
FISERV INC	1,666	167.91	279,738.06	
FRANKLIN RESOURCES INC	773	22.73	17,570.29	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	1,616	157.27	254,148.32	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	216	221.43	47,828.88	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	104	235.20	24,460.80	
MASTERCARD INC-CLASS A	2,354	466.98	1,099,270.92	
MOODY'S CORP	463	470.08	217,647.04	
MORGAN STANLEY	3,462	101.75	352,258.50	
NASDAQ INC	1,168	69.97	81,724.96	
NORTHERN TRUST CORP	591	87.18	51,523.38	
PAYPAL HOLDINGS INC	2,819	69.43	195,723.17	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	575	115.93	66,659.75	
S&P GLOBAL INC	904	495.74	448,148.96	
SCHWAB (CHARLES) CORP	4,254	65.58	278,977.32	
STATE STREET CORP	875	81.01	70,883.75	
SYNCHRONY FINANCIAL	1,178	47.63	56,108.14	
T ROWE PRICE GROUP INC	648	109.41	70,897.68	
VISA INC-CLASS A SHARES	4,468	266.47	1,190,587.96	
AFLAC INC	1,542	105.21	162,233.82	
ALLSTATE CORP	744	180.62	134,381.28	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	1,058	103.00	108,974.00	
ASSURANT INC	144	188.75	27,180.00	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	838	111.19	93,177.22	
MARSH & MCLENNAN COS	1,388	223.18	309,773.84	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	688	78.16	53,774.08	
PROGRESSIVE CORP	1,654	237.78	393,288.12	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	1,013	115.77	117,275.01	
TRAVELERS COS INC/THE	646	218.95	141,441.70	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	289	282.40	81,613.60	
ACCENTURE PLC-CL A	1,775	329.44	584,756.00	
ADOBE INC	1,265	563.12	712,346.80	

AKAMAI TECHNOLOGIES INC	418	101.65	42,489.70	
ANSYS INC	245	326.93	80,097.85	
ASPEN TECHNOLOGY INC	89	213.42	18,994.38	
ATLASSIAN CORP-CL A	457	159.00	72,663.00	
AUTODESK INC	602	251.11	151,168.22	
CADENCE DESIGN SYS INC	768	281.96	216,545.28	
CONFLUENT INC-CLASS A	529	22.16	11,722.64	
DOCUSIGN INC	573	57.19	32,769.87	
FAIR ISAAC CORP	70	1,753.70	122,759.00	
GARTNER INC	219	485.00	106,215.00	
GEN DIGITAL INC	1,667	25.48	42,475.16	
HUBSPOT INC	140	497.26	69,616.40	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	2,587	194.73	503,766.51	
INTUIT INC	790	663.30	524,007.00	
MANHATTAN ASSOCIATES INC	179	259.74	46,493.46	
MICROSOFT CORP	19,947	421.53	8,408,258.91	
PALO ALTO NETWORKS INC	911	343.36	312,800.96	
PTC INC	348	176.34	61,366.32	
SALESFORCE INC	2,739	265.38	726,875.82	
SERVICENOW INC	579	832.88	482,237.52	
SYNOPSYS INC	430	558.22	240,034.60	
TWILIO INC - A	484	61.88	29,949.92	
UIPATH INC - CLASS A	1,140	12.16	13,862.40	
WORKDAY INC-CLASS A	594	232.63	138,182.22	
ZSCALER INC	261	195.50	51,025.50	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	3,618	18.88	68,307.84	
HP INC	2,735	34.60	94,631.00	
JUNIPER NETWORKS INC	912	38.99	35,558.88	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	505	138.50	69,942.50	
NETAPP INC	574	131.70	75,595.80	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	575	103.96	59,777.00	
TRIMBLE INC	664	55.89	37,110.96	
WESTERN DIGITAL CORP	943	65.10	61,389.30	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	11,842	40.74	482,443.08	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	545	141.57	77,155.65	
ATMOS ENERGY CORP	441	129.41	57,069.81	
CMS ENERGY CORP	872	66.53	58,014.16	
CONSOLIDATED EDISON INC	969	100.41	97,297.29	
EDISON INTERNATIONAL	1,078	83.89	90,433.42	
ESSENTIAL UTILITIES INC	732	39.72	29,075.04	
EVERSOURCE ENERGY	977	65.84	64,325.68	
EXELON CORP	2,805	37.61	105,496.05	
NRG ENERGY INC	589	82.34	48,498.26	

	SEMPRA	1,777	80.87	143,705.99	
	ADVANCED MICRO DEVICES	4,564	155.28	708,697.92	
	APPLIED MATERIALS INC	2,346	210.94	494,865.24	
	ENPHASE ENERGY INC	377	119.71	45,130.67	
	FIRST SOLAR INC	293	228.38	66,915.34	
	INTEL CORP	12,015	21.52	258,562.80	
	LAM RESEARCH CORP	370	881.28	326,073.60	
	LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	415	49.52	20,550.80	
	MARVELL TECHNOLOGY INC	2,441	71.04	173,408.64	
	NVIDIA CORP	70,644	130.00	9,183,720.00	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	722	258.24	186,449.28	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	2,570	200.66	515,696.20	
	CBRE GROUP INC - A	847	112.50	95,287.50	
米ドル 小計		501,982		72,273,148.70 (10,584,402,627)	
カナダドル	CAMECO CORP	1,286	56.21	72,286.06	
	ENBRIDGE INC	5,981	53.35	319,086.35	
	IMPERIAL OIL LTD	559	103.50	57,856.50	
	KEYERA CORP	683	39.66	27,087.78	
	PARKLAND CORP	297	36.16	10,739.52	
	PEMBINA PIPELINE CORP	1,717	52.68	90,451.56	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	1,394	110.26	153,702.44	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	1,776	17.88	31,754.88	
	KINROSS GOLD CORP	3,274	12.78	41,841.72	
	LUNDIN MINING CORP	1,973	13.17	25,984.41	
	NUTRIEN LTD	1,375	64.58	88,797.50	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	159	116.42	18,510.78	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	1,261	82.52	104,057.72	
	CAE INC	900	24.02	21,618.00	
	STANTEC INC	342	112.37	38,430.54	
	WSP GLOBAL INC	352	222.84	78,439.68	
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	937	27.20	25,486.40	
	RB GLOBAL INC	483	113.35	54,748.05	
	THOMSON REUTERS CORP	464	223.39	103,652.96	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	1,535	155.04	237,986.40	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	470	57.96	27,241.20	
	CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	172	151.29	26,021.88	
	DOLLARAMA INC	773	134.62	104,061.26	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	2,160	81.77	176,623.20	
	METRO INC	695	83.24	57,851.80	
	BANK OF MONTREAL	2,049	117.83	241,433.67	
	BANK OF NOVA SCOTIA	3,432	64.96	222,942.72	
	NATIONAL BANK OF CANADA	990	117.87	116,691.30	

	TORONTO-DOMINION BANK	4,980	81.00	403,380.00	
	BROOKFIELD CORP	3,810	64.01	243,878.10	
	IA FINANCIAL CORP INC	232	100.68	23,357.76	
	INTACT FINANCIAL CORP	499	254.09	126,790.91	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	1,621	71.62	116,096.02	
	CGI INC	582	149.20	86,834.40	
	OPEN TEXT CORP	769	44.24	34,020.56	
	SHOPIFY INC - CLASS A	3,392	102.47	347,578.24	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	1,022	54.48	55,678.56	
	TELUS CORP	1,465	21.84	31,995.60	
	FORTIS INC	1,463	60.08	87,897.04	
	HYDRO ONE LTD	949	44.57	42,296.93	
	FIRSTSERVICE CORP	115	237.97	27,366.55	
カナダドル 小計		58,388		4,202,556.95 (451,354,616)	
ユーロ	GALP ENERGIA SGPS SA	1,291	19.44	25,097.04	
	NESTE OYJ	1,221	20.22	24,688.62	
	OMV AG	422	39.40	16,626.80	
	REPSOL SA	3,340	12.83	42,868.90	
	TENARIS SA	1,330	12.85	17,090.50	
	TOTALENERGIES SE	6,070	62.92	381,924.40	
	AKZO NOBEL	529	54.10	28,618.90	
	COVESTRO AG	514	54.30	27,910.20	
	DSM-FIRMENICH AG	519	115.50	59,944.50	
	EVONIK INDUSTRIES AG	814	19.31	15,718.34	
	HEIDELBERG MATERIALS AG	395	91.26	36,047.70	
	OCI NV	270	26.23	7,082.10	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	1,591	11.29	17,970.34	
	SYMRISE AG	405	112.75	45,663.75	
	UMICORE	539	11.20	6,036.80	
	UPM-KYMMENE OYJ	1,540	30.55	47,047.00	
	VOESTALPINE AG	274	21.50	5,891.00	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	604	40.62	24,534.48	
	BOUYGUES SA	498	31.88	15,876.24	
	EIFFAGE	216	92.00	19,872.00	
	GEA GROUP AG	394	40.68	16,027.92	
	KINGSPAN GROUP PLC	449	82.10	36,862.90	
	KNORR-BREMSE AG	201	73.40	14,753.40	
	KONE OYJ-B	985	46.68	45,979.80	
	METSO CORPORATION	2,008	9.36	18,802.91	
	MTU AERO ENGINES AG	148	268.90	39,797.20	
	REXEL SA	539	22.61	12,186.79	
	SCHNEIDER ELECTRIC SE	1,536	223.75	343,680.00	

WARTSILA OYJ ABP	1,352	18.73	25,329.72	
WOLTERS KLUWER	696	151.10	105,165.60	
ADP	82	115.80	9,495.60	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	1,396	5.60	7,825.97	
GETLINK	1,024	16.07	16,455.68	
MICHELIN(CGDE)	1,890	35.13	66,395.70	
ADIDAS AG	454	217.60	98,790.40	
HERMES INTERNATIONAL	89	2,153.00	191,617.00	
KERING	221	261.00	57,681.00	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	779	674.50	525,435.50	
MONCLER SPA	590	54.36	32,072.40	
PUMA SE	316	37.47	11,840.52	
AMADEUS IT GROUP SA	1,323	58.66	77,607.18	
PUBLICIS GROUPE	644	94.42	60,806.48	
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	2,318	22.43	51,992.74	
PROSUS NV	3,974	33.49	133,109.13	
ZALANDO SE	698	23.90	16,682.20	
CARREFOUR SA	1,546	14.21	21,968.66	
JERONIMO MARTINS	867	16.75	14,522.25	
KESKO OYJ-B SHS	665	18.04	11,996.60	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N.V.	2,651	30.17	79,980.67	
DANONE	1,815	60.72	110,206.80	
JDE PEET'S BV	253	20.90	5,287.70	
KERRY GROUP PLC-A	458	89.60	41,036.80	
LOTUS BAKERIES	1	10,960.00	10,960.00	
BEIERSDORF AG	303	124.25	37,647.75	
HENKEL AG & CO KGAA	293	70.60	20,685.80	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	461	77.90	35,911.90	
L'OREAL	680	385.70	262,276.00	
EUROFINS SCIENTIFIC	334	52.20	17,434.80	
MERCK KGAA	386	169.80	65,542.80	
ORION OYJ-CLASS B	278	46.63	12,963.14	
QIAGEN N.V.	570	42.35	24,139.50	
SARTORIUS AG-VORZUG	67	241.40	16,173.80	
BANCO DE SABADELL SA	16,397	1.90	31,310.07	
BNP PARIBAS	2,917	61.36	178,987.12	
COMMERZBANK AG	3,007	12.77	38,414.42	
CREDIT AGRICOLE SA	3,130	13.56	42,442.80	
FINECOBANK SPA	1,875	14.68	27,534.37	
ING GROEP NV-CVA	9,299	15.88	147,742.51	
INTESA SANPAOLO	41,307	3.61	149,283.49	
KBC GROEP NV	745	69.70	51,926.50	
MEDIOBANCA SPA	1,319	14.78	19,494.82	

	DEUTSCHE BOERSE AG	533	195.20	104,041.60	
	EURAZEO	108	71.60	7,732.80	
	NEXI SPA	1,764	6.08	10,725.12	
	AGEAS	509	44.06	22,426.54	
	ASR NEDERLAND NV	409	45.99	18,809.91	
	AXA SA	5,132	33.44	171,614.08	
	GENERALI	3,056	23.45	71,663.20	
	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	384	462.90	177,753.60	
	NN GROUP NV	779	43.55	33,925.45	
	POSTE ITALIANE SPA	1,059	12.41	13,147.48	
	SAMPO OYJ-A SHS	1,292	40.99	52,959.08	
	DASSAULT SYSTEMES SE	1,984	34.20	67,852.80	
	NOKIA OYJ	14,659	3.74	54,824.66	
	CELLNEX TELECOM SA	1,330	34.36	45,698.80	
	ELISA OYJ	389	43.82	17,045.98	
	KONINKLIJKE KPN NV	11,510	3.58	41,286.37	
	ENEL SPA	22,908	6.59	150,986.62	
	IBERDROLA SA	16,698	12.55	209,559.90	
	REDEIA CORP SA	1,128	16.80	18,950.40	
	VERBUND AG	219	77.75	17,027.25	
	ASML HOLDING NV	1,128	829.40	935,563.20	
	STMICROELECTRONICS NV	1,990	27.92	55,560.80	
	LEG IMMOBILIEN SE	216	84.22	18,191.52	
ユーロ 小計		227,296		6,676,121.58 (1,083,601,293)	
英ポンド	ANGLO AMERICAN PLC	3,563	22.35	79,633.05	
	ANTOFAGASTA PLC	1,063	18.80	19,984.40	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	344	39.22	13,491.68	
	ENDEAVOUR MINING PLC	573	16.31	9,345.63	
	MONDI PLC	1,144	14.79	16,919.76	
	ASHTEAD GROUP PLC	1,223	52.98	64,794.54	
	BUNZL PLC	1,000	32.24	32,240.00	
	DCC PLC	257	53.20	13,672.40	
	SMITHS GROUP PLC	854	17.81	15,209.74	
	SPIRAX GROUP PLC	203	74.95	15,214.85	
	INTERTEK GROUP PLC	499	47.70	23,802.30	
	RELX PLC	5,281	35.40	186,947.40	
	RENTOKIL INITIAL PLC	7,311	4.83	35,312.13	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	2,579	5.54	14,287.66	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	257	52.20	13,415.40	
	BURBERRY GROUP PLC	1,059	7.02	7,440.53	
	TAYLOR WIMPEY PLC	10,976	1.63	17,984.17	
	WHITBREAD PLC	464	28.28	13,121.92	

	AUTO TRADER GROUP PLC	2,808	8.28	23,272.70	
	INFORMA PLC	4,126	8.25	34,056.00	
	WPP PLC	3,361	7.13	23,970.65	
	KINGFISHER PLC	4,661	2.81	13,106.73	
	SAINSBURY (J) PLC	4,917	2.84	13,974.11	
	TESCO PLC	19,763	3.41	67,470.88	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	896	24.76	22,184.96	
	COCA-COLA HBC AG-DI	612	27.26	16,683.12	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	1,983	42.63	84,535.29	
	UNILEVER PLC	7,067	47.35	334,622.45	
	NMC HEALTH PLC	5	0.00	0.00	
	ASTRAZENECA PLC	4,377	130.50	571,198.50	
	HSBC HOLDINGS PLC	53,279	6.63	353,559.44	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	178,118	0.59	105,481.47	
	3I GROUP PLC	2,731	31.91	87,146.21	
	M&G PLC	5,562	2.11	11,769.19	
	SCHRODERS PLC	2,486	3.48	8,651.28	
	ADMIRAL GROUP PLC	714	29.33	20,941.62	
	AVIVA PLC	7,730	5.06	39,160.18	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	17,024	2.32	39,597.82	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	2,059	5.56	11,458.33	
	PRUDENTIAL PLC	8,232	6.59	54,281.80	
	SAGE GROUP PLC/THE	2,955	10.27	30,347.85	
	BT GROUP PLC	19,776	1.45	28,793.85	
	VODAFONE GROUP PLC	66,354	0.75	50,097.27	
	NATIONAL GRID PLC	13,489	9.87	133,217.36	
英ポンド 小計		473,735		2,772,396.62 (527,226,665)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	406	12.96	5,261.76	
	GIVAUDAN-REG	26	4,192.00	108,992.00	
	SIG GROUP AG	939	17.78	16,695.42	
	SIKA AG-REG	428	259.90	111,237.20	
	ABB LTD-REG	4,505	47.81	215,384.05	
	GEBERIT AG-REG	99	527.80	52,252.20	
	VAT GROUP AG	80	434.20	34,736.00	
	SGS SA-REG	443	93.98	41,633.14	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	139	258.00	35,862.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	6	11,050.00	66,300.00	
	ALCON INC	1,399	82.94	116,033.06	
	SONOVA HOLDING AG-REG	142	293.10	41,620.20	
	LONZA GROUP AG-REG	210	553.60	116,256.00	
	NOVARTIS AG-REG	5,564	100.20	557,512.80	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	54	92.85	5,013.90	

	JULIUS BAER GROUP LTD	567	50.52	28,644.84	
	BALOISE HOLDING AG - REG	134	161.50	21,641.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	82	674.80	55,333.60	
	SWISS RE AG	848	109.95	93,237.60	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	413	483.10	199,520.30	
	TEMENOS GROUP AG-REG	148	59.45	8,798.60	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	458	78.56	35,980.48	
	SWISSCOM AG-REG	70	532.00	37,240.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	235	90.85	21,349.75	
スイスフラン 小計		17,395		2,026,535.90 (344,227,387)	
スウェーデンクローナ	BOLIDEN AB	878	311.20	273,233.60	
	HOLMEN AB-B SHARES	196	415.60	81,457.60	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	1,946	139.90	272,245.40	
	ALFA LAVAL AB	885	458.80	406,038.00	
	ASSA ABLOY AB-B	2,820	313.00	882,660.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	7,509	183.70	1,379,403.30	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	4,409	161.55	712,273.95	
	EPIROC AB-A	2,017	195.00	393,315.00	
	EPIROC AB-B	1,082	178.00	192,596.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	588	70.80	41,630.40	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	4,251	49.25	209,361.75	
	SANDVIK AB	2,935	213.20	625,742.00	
	SKF AB-B SHARES	881	191.75	168,931.75	
	VOLVO AB-A SHS	512	268.40	137,420.80	
	VOLVO AB-B SHS	4,426	264.10	1,168,906.60	
	EVOLUTION AB	505	1,041.50	525,957.50	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	1,767	162.55	287,225.85	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	1,672	298.60	499,259.20	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	3,936	104.25	410,328.00	
	EQT AB	1,112	336.70	374,410.40	
	TELE2 AB-B SHS	1,792	111.30	199,449.60	
	TELIA CO AB	5,887	31.20	183,674.40	
スウェーデンクローナ 小計		52,006		9,425,521.10 (134,030,910)	
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	793	263.00	208,559.00	
	EQUINOR ASA	2,542	293.30	745,568.60	
	NORSK HYDRO ASA	4,097	59.28	242,870.16	
	YARA INTERNATIONAL ASA	445	303.90	135,235.50	
	MOWI ASA	1,516	191.90	290,920.40	
	ORKLA ASA	2,269	91.65	207,953.85	
	SALMAR ASA	139	638.50	88,751.50	
	DNB BANK ASA	2,532	223.00	564,636.00	

	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	454	184.40	83,717.60	
	TELENOR ASA	1,795	129.10	231,734.50	
ノルウェークローネ 小計		16,582		2,799,947.11 (38,891,265)	
デンマーククローネ	NOVONESIS (NOVOZYMES) B	1,025	442.40	453,460.00	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	30	2,806.00	84,180.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	2,969	160.75	477,266.75	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	9	10,670.00	96,030.00	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-B	13	10,860.00	141,180.00	
	DSV A/S	477	1,264.00	602,928.00	
	PANDORA A/S	250	1,093.50	273,375.00	
	COLOPLAST-B	373	934.40	348,531.20	
	GENMAB A/S	195	1,862.00	363,090.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	9,209	914.90	8,425,314.10	
	TRYG A/S	878	151.80	133,280.40	
	ORSTED A/S	520	380.20	197,704.00	
デンマーククローネ 小計		15,948		11,596,339.45 (252,220,383)	
オーストラリアドル	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	5,295	26.28	139,152.60	
	BLUESCOPE STEEL LTD	1,043	19.89	20,745.27	
	FORTESCUE LTD	4,762	17.01	81,001.62	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	1,274	50.71	64,604.54	
	MINERAL RESOURCES LTD	447	44.20	19,757.40	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	3,581	14.44	51,709.64	
	ORICA LTD	1,324	18.42	24,388.08	
	PILBARA MINERALS LTD	7,742	2.88	22,296.96	
	BRAMBLES LTD	4,092	15.71	64,285.32	
	COMPUTERSHARE LTD	1,449	28.63	41,484.87	
	AURIZON HOLDINGS LTD	5,727	3.43	19,643.61	
	TRANSURBAN GROUP	8,640	13.43	116,035.20	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	1,706	54.41	92,823.46	
	CAR GROUP LTD	1,112	36.45	40,532.40	
	REA GROUP LTD	150	215.84	32,376.00	
	SEEK LTD	875	21.83	19,101.25	
	COLES GROUP LTD	3,805	18.43	70,126.15	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	3,615	5.45	19,701.75	
	COCHLEAR LTD	196	307.48	60,266.08	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	570	47.45	27,046.50	
	CSL LTD	1,359	307.80	418,300.20	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	8,430	29.74	250,708.20	
	ASX LTD	532	63.87	33,978.84	
	MACQUARIE GROUP LTD	1,018	209.70	213,474.60	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	4,540	16.27	73,865.80	

	SUNCORP GROUP LTD	3,564	17.41	62,049.24	
	WISETECH GLOBAL LTD	500	92.07	46,035.00	
	XERO LTD	392	141.62	55,515.04	
	APA GROUP	3,590	7.92	28,432.80	
オーストラリアドル 小計		81,330		2,209,438.42 (217,607,589)	
ニュージーランドドル	SPARK NEW ZEALAND LTD	4,460	4.38	19,557.10	
	MERCURY NZ LTD	1,680	6.80	11,424.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	4,254	6.61	28,118.94	
ニュージーランドドル 小計		10,394		59,100.04 (5,295,363)	
香港ドル	MTR CORP	3,523	27.45	96,706.35	
	HANG SENG BANK LTD	1,961	91.90	180,215.90	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	3,400	232.60	790,840.00	
	AIA GROUP LTD	32,000	51.95	1,662,400.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD (CKI)	1,500	56.55	84,825.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	34,079	6.43	219,127.97	
	SINO LAND CO	12,000	8.50	102,000.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	1,172	64.85	76,004.20	
香港ドル 小計		89,635		3,212,119.42 (60,419,966)	
シンガポールドル	KEPPEL LTD	4,709	6.00	28,254.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	3,500	30.67	107,345.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	2,480	10.36	25,692.80	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	8,705	2.57	22,371.85	
シンガポールドル 小計		19,394		183,663.65 (20,561,145)	
合　計		1,564,085		13,719,839,209 (13,719,839,209)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。
(注2)合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

(2)株式以外の有価証券

種　類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	AMERICAN TOWER CORP	1,321	290,170.86	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	1,515	30,769.65	
		BXP INC	424	30,222.72	
		CROWN CASTLE INC	1,230	134,685.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	884	131,380.08	
		EQUINIX INC	269	223,372.22	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	2,000	43,400.00	
		IRON MOUNTAIN INC	859	94,180.76	
		PROLOGIS INC	2,616	326,215.20	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	318	69,422.58	

		WELLTOWER INC	1,610	186,019.40	
		WEYERHAEUSER CO	2,146	64,766.28	
	米ドル 小計		15,192	1,624,604.75 (237,923,365)	
	カナダドル	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	292	5,194.68	
	カナダドル 小計		292	5,194.68 (557,908)	
	ユーロ	COVIVIO	125	6,130.00	
		GECINA SA	96	9,172.80	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	456	11,162.88	
	ユーロ 小計		677	26,465.68 (4,295,644)	
	英ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	1,788	11,362.74	
		SEGRO PLC	3,884	34,800.64	
	英ポンド 小計		5,672	46,163.38 (8,778,889)	
	オーストラリアドル	GOODMAN GROUP	4,796	162,536.44	
		GPT GROUP	5,072	24,142.72	
	オーストラリアドル 小計		9,868	186,679.16 (18,386,030)	
	シンガポールドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	9,900	27,324.00	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	14,792	31,506.96	
	シンガポールドル 小計		24,692	58,830.96 (6,586,125)	
合計				276,527,961 (276,527,961)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。
(注2)合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。
(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数		組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式	291銘柄	97.8%	—	75.7%
	投資証券	12銘柄	—	2.2%	1.7%
カナダドル	株式	41銘柄	99.9%	—	3.2%
	投資証券	1銘柄	—	0.1%	0.0%
ユーロ	株式	94銘柄	99.6%	—	7.7%
	投資証券	3銘柄	—	0.4%	0.0%
英ポンド	株式	44銘柄	98.4%	—	3.8%
	投資証券	2銘柄	—	1.6%	0.1%
スイスフラン	株式	24銘柄	100.0%	—	2.5%
スウェーデンクローナ	株式	22銘柄	100.0%	—	1.0%
ノルウェークローネ	株式	10銘柄	100.0%	—	0.3%
デンマーククローネ	株式	12銘柄	100.0%	—	1.8%
オーストラリアドル	株式	29銘柄	92.2%	—	1.6%

	投資証券	2銘柄	—	7.8%	0.1%
ニュージーランドドル	株式	3銘柄	100.0%	—	0.0%
香港ドル	株式	8銘柄	100.0%	—	0.4%
シンガポールドル	株式	4銘柄	75.7%	—	0.1%
	投資証券	2銘柄	—	24.3%	0.0%

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

ＲＭ新興国株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2024年 8月20日現在
資産の部	
流動資産	
預金	1,090,311,313
コール・ローン	19,293,716
株式	35,420,876,683
投資証券	34,095,015
派生商品評価勘定	66,014,305
未収入金	1,154,712
未収配当金	99,311,488
未収利息	58
差入委託証拠金	498,433,811
流動資産合計	37,229,491,101
資産合計	37,229,491,101
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	18,988
流動負債合計	18,988
負債合計	18,988
純資産の部	
元本等	
元本	18,486,538,650
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	18,742,933,463
元本等合計	37,229,472,113
純資産合計	37,229,472,113
負債純資産合計	37,229,491,101

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	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20日現在	
１． 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 8月22日
期首元本額	15,820,968,450円
期中追加設定元本額	5,967,902,812円
期中一部解約元本額	3,302,332,612円
期末元本額	18,486,538,650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）	3,009,649,136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	61,950,314円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	163,165,781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）	6,373,030円
ラップ型ファンド・プラスＥＳＧ（安定成長型）	184,612,759円
ラップ型ファンド・プラスＥＳＧ（成長型）	362,756,982円
りそな　つみたてラップ型ファンド（安定型）	35,493,662円
りそな　つみたてラップ型ファンド（安定成長型）	93,824,150円
りそな　つみたてラップ型ファンド（成長型）	110,400,411円
りそな　つみたてリスクコントロールファンド	2,239,059円
ターゲットリターンバランスファンド（目標２％）	1,278,948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％）	7,906,709円
ターゲットリターンバランスファンド（目標５％）	4,214,230円
ターゲットリターンバランスファンド（目標６％）	10,023,902円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６５	1,569,319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	3,474,892,841円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　新興国株式インデックス	3,516,413,646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	673,617,215円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　Ｓｅｌｅｃｔ　全世界株式インデックス	269,923,295円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　Ｓｅｌｅｃｔ　全世界株式インデックス（除く日本）	89,327,001円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　ＤＣ　全世界株式インデックス	55,594,009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）	961,836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）	89,021,561円
２．　計算日における受益権の総数	18,486,538,650口
３．　計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	2.0139円
(10,000口当たり純資産額)	(20,139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）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

2024年 8月20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。

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

2024年 8月20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20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20日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
株式	3,975,333,748
投資証券	△5,509,500
合計	3,969,824,248

(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20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	1,736,600,438	－	1,802,593,737	65,993,299
合計		1,736,600,438	－	1,802,593,737	65,993,299

（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20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	52,111,559	－	52,110,636	△923
	米ドル	52,111,559	－	52,110,636	△923
	売建	578,759	－	575,818	2,941
	ブラジルレアル	256,046	－	256,286	△240
	カタールリアル	303,116	－	300,057	3,059
	オフショア人民元	19,597	－	19,475	122
合計		52,690,318	－	52,686,454	2,018

（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。

①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。

②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 単価	評価額 金額	備考
米ドル	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	31,900	1.79	57,164.80	
	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	14.08	70,343.68	
	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	105.29	287,441.70	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	13,411	20.40	273,584.40	
	NIO INC - ADR	43,205	4.07	175,844.35	
	H WORLD GROUP LTD	6,391	29.02	185,466.82	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	14,022	9.06	127,039.32	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	12,372	33.82	418,421.04	
	AUTOHOME INC-ADR	2,118	23.61	50,005.98	
	IQIYI INC-ADR	15,423	3.31	51,050.13	
	KANZHUN LTD	8,346	14.77	123,270.42	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	23,615	10.64	251,263.60	
	VK CO LTD	2,211	0.00	0.00	
	PDD HOLDINGS INC	18,823	151.11	2,844,343.53	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	11,890	14.02	166,697.80	
	X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	2,296	0.00	0.00	
	LEGEND BIOTECH CORP-ADR	2,240	56.95	127,568.00	
	COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	98,520	1.63	160,587.60	
	CREDICORP LTD	2,141	169.09	362,021.69	
	TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	2,188	0.00	0.00	
	QIFU TECHNOLOGY INC	3,969	24.48	97,161.12	
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	24,726	1.59	39,536.87	
	KE HOLDINGS INC	20,820	15.23	317,088.60	
米ドル 小計		415,145		6,185,901.45 (905,925,267)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-CPO	456,600	12.40	5,661,840.00	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	98,500	106.74	10,513,890.00	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	6,450	253.79	1,636,945.50	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	27,700	22.63	626,851.00	
	ALFA S.A.B.-A	108,000	11.65	1,258,200.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	17,700	121.58	2,151,966.00	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	11,960	312.46	3,737,021.60	
	GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	5,830	531.03	3,095,904.90	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL CENT	8,600	154.05	1,324,830.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	5,980	179.89	1,075,742.20	
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	165,300	62.90	10,397,370.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	16,100	185.41	2,985,101.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	16,850	167.37	2,820,184.50	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	61,100	211.24	12,906,764.00	
	GRUMA S.A.B.-B	6,105	382.50	2,335,162.50	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	42,500	70.20	2,983,500.00	

	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	45,900	34.21	1,570,239.00	
	BANCO DEL BAJIO SA	22,200	53.19	1,180,818.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	81,900	141.77	11,610,963.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	59,100	47.58	2,811,978.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	588,900	16.23	9,557,847.00	
メキシコペソ 小計		1,853,275		92,243,118.20 (723,066,130)	
ブラジルレアル	COSAN SA	38,400	13.94	535,296.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	117,500	41.24	4,845,700.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	150,300	38.44	5,777,532.00	
	PRIO SA	24,800	47.89	1,187,672.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	22,900	23.95	548,455.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	19,200	12.01	230,592.00	
	GERDAU SA-PREF	45,234	17.65	798,380.10	
	KLABIN SA - UNIT	24,530	21.29	522,243.70	
	SUZANO SA	24,507	55.04	1,348,865.28	
	VALE SA	107,404	56.98	6,119,879.92	
	WEG SA	53,200	51.79	2,755,228.00	
	CCR SA	32,300	13.59	438,957.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	29,610	44.25	1,310,242.50	
	RUMO SA	42,300	23.60	998,280.00	
	LOJAS RENNER S.A.	30,720	17.00	522,240.00	
	VIBRA ENERGIA SA	29,900	26.25	784,875.00	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	19,100	9.71	185,461.00	
	RAIA DROGASIL SA	41,476	29.07	1,205,707.32	
	SENDAS DISTRIBUIDORA SA	41,700	10.71	446,607.00	
	AMBEV SA	144,700	13.01	1,882,547.00	
	BRF SA	19,900	25.25	502,475.00	
	JBS SA	24,800	38.16	946,368.00	
	NATURA &CO HOLDING SA	28,800	14.20	408,960.00	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	150,892	4.45	671,469.40	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	18,600	32.05	596,130.00	
	HYPERA SA	11,400	32.27	367,878.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	51,115	14.09	720,210.35	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	167,936	15.64	2,626,519.04	
	BANCO DO BRASIL S.A.	52,400	29.13	1,526,412.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	152,800	36.96	5,647,488.00	
	ITAUSA SA	171,628	11.04	1,894,773.12	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	180,100	12.79	2,303,479.00	
	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	36,400	36.31	1,321,684.00	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	22,000	36.05	793,100.00	
	CAIXA SEGURIDADE PARTICIPACO	19,000	14.65	278,350.00	
	TOTVS SA	16,400	29.90	490,360.00	

	TELEFONICA BRASIL S.A.	13,000	52.12	677,560.00	
	TIM SA	28,500	18.27	520,695.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	7,100	45.70	324,470.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	38,900	41.53	1,615,517.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	57,374	11.85	679,881.90	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	14,000	97.50	1,365,000.00	
	COMPANHIA PARANAENSE DE ENER	35,200	10.54	371,008.00	
	CPFL ENERGIA SA	7,200	33.20	239,040.00	
	ENERGISA SA-UNITS	6,900	50.15	346,035.00	
	ENEVA SA	12,700	13.81	175,387.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	6,275	46.66	292,791.50	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	33,800	35.52	1,200,576.00	
ブラジルレアル 小計		2,424,901		61,348,378.13 (1,659,307,987)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	12,153	6,320.00	76,806,960.00	
	EMPRESAS CMPC SA	33,869	1,630.00	55,206,470.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	4,419	34,545.00	152,654,355.00	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES	466,759	56.70	26,465,235.30	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	5,527,400	11.23	62,072,702.00	
	FALABELLA SA	29,867	3,253.00	97,157,351.00	
	CENCOSUD SA	35,890	1,817.50	65,230,075.00	
	BANCO DE CHILE	1,384,067	115.12	159,333,793.04	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	2,535	28,799.00	73,005,465.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	2,146,867	47.36	101,675,621.12	
	ENEL AMERICAS SA	721,398	95.50	68,893,509.00	
	ENEL CHILE SA	827,632	50.56	41,845,073.92	
チリペソ 小計		11,192,856		980,346,610.38 (155,390,819)	
コロンビアペソ	BANCOLOMBIA SA	7,429	36,280.00	269,524,120.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	13,694	34,260.00	469,156,440.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	15,693	18,200.00	285,612,600.00	
コロンビアペソ 小計		36,816		1,024,293,160.00 (37,199,254)	
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	1,871	21.48	40,189.08	
	METLEN ENERGY & METALS SA	3,508	34.50	121,026.00	
	OPAP SA	5,739	16.09	92,340.51	
	JUMBO SA	3,787	23.04	87,252.48	
	ALPHA SERVICES AND HOLDINGS	65,690	1.59	104,775.55	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	80,797	2.02	163,209.94	
	NATIONAL BANK OF GREECE	24,924	8.11	202,283.18	
	PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS S	33,092	3.91	129,621.36	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	6,206	15.20	94,331.20	
	PUBLIC POWER CORP	6,514	11.62	75,692.68	

ユーロ 小計		232,128		1,110,721.98 (180,281,284)	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	31,268	165.20	5,165,473.60	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	43,208	49.28	2,129,290.24	
	SASA POLYESTER SANAYI	347,344	5.11	1,774,927.84	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	45,551	58.85	2,680,676.35	
	KOC HOLDING AS	24,481	185.20	4,533,881.20	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	42,569	43.66	1,858,562.54	
	PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS	7,907	221.50	1,751,400.50	
	TURK HAVA YOLLARI AO	16,774	297.00	4,981,878.00	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	2,149	918.50	1,973,856.50	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	4,511	251.50	1,134,516.50	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	14,326	573.50	8,215,961.00	
	COCA-COLA ICECEK AS	27,115	66.70	1,808,570.50	
	AKBANK T.A.S.	95,565	60.25	5,757,791.25	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	34,570	93.05	3,216,738.50	
	TURKIYE IS BANKASI-C	259,296	13.51	3,503,088.96	
	YAPI VE KREDI BANKASI	104,229	29.58	3,083,093.82	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	37,556	106.30	3,992,202.80	
トルコリラ 小計		1,138,419		57,561,910.10 (249,789,908)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	2,474	771.50	1,908,691.00	
	MONETA MONEY BANK AS	9,667	105.20	1,016,968.40	
	CEZ AS	4,830	895.00	4,322,850.00	
チェココルナ 小計		16,971		7,248,509.40 (46,760,858)	
ハンガリーフォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	13,379	2,722.00	36,417,638.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	4,614	10,360.00	47,801,040.00	
	OTP BANK PLC	6,963	18,200.00	126,726,600.00	
ハンガリーフォリント 小計		24,956		210,945,278.00 (86,844,694)	
ポーランドズロチ	ORLEN SA	17,899	64.58	1,155,917.42	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	4,424	138.95	614,714.80	
	BUDIMEX	397	613.00	243,361.00	
	LPP SA	35	14,790.00	517,650.00	
	CD PROJEKT SA	2,083	179.85	374,627.55	
	ALLEGRO.EU SA	17,580	38.26	672,698.70	
	DINO POLSKA SA	1,567	345.20	540,928.40	
	BANK PEKAO SA	5,839	160.10	934,823.90	
	MBANK SA	464	628.60	291,670.40	
	PKO BANK POLSKI SA	27,580	57.14	1,575,921.20	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	1,142	518.20	591,784.40	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	19,309	48.55	937,451.95	

	PGE SA	29,021	6.90	200,477.06	
ポーランドズロチ 小計		127,340		8,652,026.78 (329,117,907)	
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	8.89	568,960.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	58,000	6.89	399,620.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	768,000	5.02	3,855,360.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	106,500	33.50	3,567,750.00	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	38,000	9.16	348,080.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	664,000	6.90	4,581,600.00	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO-H	103,500	10.14	1,049,490.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	124,000	4.59	569,160.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	39,000	17.78	693,420.00	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	91,000	10.36	942,760.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	152,000	2.38	361,760.00	
	CMOC GROUP LTD-H	117,000	6.36	744,120.00	
	GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD-H	11,440	17.74	202,945.60	
	JIANGXI COPPER CO LTD-H	34,000	13.72	466,480.00	
	MMG LTD	140,000	2.32	324,800.00	
	SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	20,500	16.44	337,020.00	
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	49,000	13.72	672,280.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	172,000	16.06	2,762,320.00	
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	83,000	3.78	313,740.00	
	BOC AVIATION LTD	7,000	66.00	462,000.00	
	CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	82,000	4.12	337,840.00	
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	133,000	3.77	501,410.00	
	CHINA STATE CONSTRUCTION INT	62,000	11.32	701,840.00	
	CITIC LTD	178,000	7.37	1,311,860.00	

CRRC CORP LTD - H	138,000	5.24	723,120.00	
FOSUN INTERNATIONAL LTD	83,500	4.16	347,360.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	21,000	21.90	459,900.00	
SINOTRUK HONG KONG LTD	22,500	20.20	454,500.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	61,000	12.28	749,080.00	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	16,000	31.30	500,800.00	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	40,000	12.02	480,800.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	91,200	10.82	986,784.00	
JD LOGISTICS INC	63,100	9.97	629,107.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	42,000	8.26	346,920.00	
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	4,000	106.70	426,800.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	48,000	5.34	256,320.00	
BYD CO LTD-H	33,000	221.40	7,306,200.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	18,800	42.55	799,940.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	192,000	7.89	1,514,880.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	72,000	10.54	758,880.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	92,000	2.57	236,440.00	
LI AUTO INC-CLASS A	38,988	80.65	3,144,382.20	
XPENG INC-CLASS A SHARES	39,564	27.60	1,091,966.40	
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	38,000	9.62	365,560.00	
ZHEJIANG LEAPMOTOR TECHNOLOG	15,200	22.25	338,200.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	40,200	67.95	2,731,590.00	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	126,000	3.95	497,700.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	76,600	23.45	1,796,270.00	
HISENSE HOME APPLIANCES GR-H	10,000	20.70	207,000.00	
LI NING CO LTD	71,500	14.08	1,006,720.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	26,300	63.60	1,672,680.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	53,000	12.46	660,380.00	
MEITUAN	159,610	108.70	17,349,607.00	
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	47,010	54.85	2,578,498.50	
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LT	38,000	13.04	495,520.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	34,000	8.76	297,840.00	
TRIP.COM GROUP LTD	17,260	332.00	5,730,320.00	
BAIDU INC-CLASS A	71,730	85.80	6,154,434.00	
BILIBILI INC-CLASS Z	7,377	108.20	798,191.40	
CHINA LITERATURE LTD	12,200	23.60	287,920.00	
CHINA RUYI HOLDINGS LIMITED	208,000	2.33	484,640.00	
KINGSOFT CORP LTD	28,800	20.95	603,360.00	
KUAISHOU TECHNOLOGY	73,300	44.20	3,239,860.00	
NETEASE INC	60,900	140.70	8,568,630.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	208,100	372.60	77,538,060.00	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	490,340	81.45	39,938,193.00	
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-H	3,200	50.15	160,480.00	

CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	62,600	6.72	420,672.00	
JD.COM INC - CL A	73,260	112.40	8,234,424.00	
MINISO GROUP HOLDING LTD	12,492	29.90	373,510.80	
POP MART INTERNATIONAL GROUP	15,000	41.50	622,500.00	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	56,000	3.06	171,360.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	25,000	9.26	231,500.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	180,000	3.03	545,400.00	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	35,250	23.15	816,037.50	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	3,800	104.48	397,024.00	
CHINA FEIHE LTD	115,000	3.60	414,000.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	101,000	12.76	1,288,760.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	52,000	24.00	1,248,000.00	
NONGFU SPRING CO LTD-H	63,600	28.80	1,831,680.00	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	60,000	9.09	545,400.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	60,000	9.44	566,400.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	20,000	47.35	947,000.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	154,000	4.86	748,440.00	
GIANT BIOGENE HOLDING CO LTD	9,600	40.35	387,360.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	19,500	25.55	498,225.00	
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	10,800	19.90	214,920.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	77,200	4.12	318,064.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	21,500	11.78	253,270.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	41,600	19.62	816,192.00	
AKESO INC	20,000	44.35	887,000.00	
BEIGENE LTD	20,996	117.10	2,458,631.60	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	56,500	5.64	318,660.00	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	266,000	6.09	1,619,940.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	36,000	12.72	457,920.00	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	38,000	18.30	695,400.00	
INNOVENT BIOLOGICS INC	39,000	40.70	1,587,300.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	326,250	3.25	1,060,312.50	
WUXI APPTEC CO LTD-H	10,168	33.20	337,577.60	
WUXI BIOLOGICS (CAYMAN) INC.	122,500	11.92	1,460,200.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	870,000	3.64	3,166,800.00	
BANK OF CHINA LTD-H	2,500,000	3.55	8,875,000.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	275,000	6.11	1,680,250.00	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	280,000	4.87	1,363,600.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	3,027,000	5.68	17,193,360.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	101,000	2.42	244,420.00	
CHINA MERCHANTS BANK-H	122,500	33.60	4,116,000.00	
CHINA MINSHENG BANKING-H	209,600	2.78	582,688.00	
IND & COMM BK OF CHINA-H	2,048,000	4.70	9,625,600.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	239,000	4.38	1,046,820.00	

	CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	115,500	3.88	448,140.00	
	CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	47,600	8.26	393,176.00	
	CITIC SECURITIES CO LTD-H	50,000	11.26	563,000.00	
	FAR EAST HORIZON LTD	64,000	5.38	344,320.00	
	GF SECURITIES CO LTD-H	33,000	6.43	212,190.00	
	HAITONG SECURITIES CO LTD-H	86,400	3.53	304,992.00	
	HUATAI SECURITIES CO LTD-H	41,200	8.23	339,076.00	
	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	235,000	10.78	2,533,300.00	
	CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	83,400	19.34	1,612,956.00	
	CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	43,000	8.39	360,770.00	
	NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	28,900	15.16	438,124.00	
	PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	264,000	2.77	731,280.00	
	PICC PROPERTY & CASUALTY-H	218,000	10.08	2,197,440.00	
	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	211,000	34.55	7,290,050.00	
	KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	90,000	5.91	531,900.00	
	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	22,500	29.30	659,250.00	
	BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	24,500	30.10	737,450.00	
	LENOVO GROUP LTD	254,000	9.65	2,451,100.00	
	SUNNY OPTICAL TECH	22,400	46.10	1,032,640.00	
	XIAOMI CORP-CLASS B	482,200	17.62	8,496,364.00	
	ZTE CORP-H	23,600	16.66	393,176.00	
	CHINA TOWER CORP LTD-H	1,400,000	0.98	1,372,000.00	
	BEIJING ENTERPRISES HLDGS	16,500	25.90	427,350.00	
	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	122,000	2.45	298,900.00	
	CGN POWER CO LTD-H	324,000	3.41	1,104,840.00	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	88,800	7.28	646,464.00	
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	100,000	7.07	707,000.00	
	CHINA POWER INTERNATIONAL	158,000	3.56	562,480.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	30,000	27.70	831,000.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	62,000	22.55	1,398,100.00	
	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	24,500	55.30	1,354,850.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD	92,000	4.00	368,000.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	134,000	4.62	619,080.00	
	KUNLUN ENERGY CO LTD	124,000	7.57	938,680.00	
	FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	11,000	10.72	117,920.00	
	GCL TECHNOLOGY HOLDINGS LTD	658,000	1.13	743,540.00	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	18,000	17.94	322,920.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	150,000	3.25	487,500.00	
	C&D INTERNATIONAL INVESTMENT	23,000	12.90	296,700.00	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	122,000	12.66	1,544,520.00	
	CHINA RESOURCES LAND LTD	102,000	22.65	2,310,300.00	
	CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	22,200	22.50	499,500.00	
	LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	66,000	9.14	603,240.00	

香港ドル 小計		24,495,135		351,085,646.10 (6,603,921,003)	
マレーシアリンギット	PETRONAS DAGANGAN BHD	10,900	19.00	207,100.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	88,200	5.49	484,218.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	116,900	5.14	600,866.00	
	GAMUDA BHD	57,800	7.45	430,610.00	
	SIME DARBY BERHAD	99,700	2.68	267,196.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	28,000	10.04	281,120.00	
	MISC BHD	44,700	8.69	388,443.00	
	GENTING BHD	57,900	4.40	254,760.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	91,400	2.53	231,242.00	
	MR DIY GROUP M BHD	92,550	2.10	194,355.00	
	IOI CORP BHD	85,100	3.79	322,529.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	16,500	21.10	348,150.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	2,200	105.10	231,220.00	
	PPB GROUP BERHAD	19,620	14.48	284,097.60	
	QL RESOURCES BHD	30,350	6.70	203,345.00	
	SD GUTHRIE BHD	63,000	4.55	286,650.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	68,900	6.27	432,003.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	82,000	4.89	400,980.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	219,100	7.97	1,746,227.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	20,600	20.10	414,060.00	
	MALAYAN BANKING BHD	169,600	10.60	1,797,760.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	459,400	4.54	2,085,676.00	
	RHB BANK BHD	50,200	5.92	297,184.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	95,100	2.43	231,093.00	
	CELCOMDIGI BHD	113,500	3.60	408,600.00	
	MAXIS BHD	64,700	3.54	229,038.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	36,600	6.90	252,540.00	
	PETRONAS GAS BHD	22,900	18.16	415,864.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	82,600	13.90	1,148,140.00	
	YTL CORP BHD	106,800	3.47	370,596.00	
	YTL POWER INTERNATIONAL BHD	78,700	4.20	330,540.00	
	INARI AMERTRON BHD	92,700	3.47	321,669.00	
マレーシアリンギット 小計		2,668,220		15,897,871.60 (533,392,669)	
タイバーツ	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	42,700	144.00	6,148,800.00	
	PTT PCL-NVDR	319,400	34.50	11,019,300.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	39,100	53.25	2,082,075.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	53,800	18.40	989,920.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	79,000	24.50	1,935,500.00	
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	48,500	23.40	1,134,900.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	25,500	208.00	5,304,000.00	

	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	131,800	58.00	7,644,400.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	234,600	7.95	1,865,070.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	190,600	3.28	625,168.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	114,000	26.00	2,964,000.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	51,825	27.25	1,412,231.25	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	204,100	8.35	1,704,235.00	
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	85,300	14.60	1,245,380.00	
	CP ALL PCL-NVDR	187,100	57.00	10,664,700.00	
	CP AXTRA PCL-NVDR	73,900	29.00	2,143,100.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	130,000	24.60	3,198,000.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	344,000	26.25	9,030,000.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	18,700	244.00	4,562,800.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	19,100	138.50	2,645,350.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	98,900	18.40	1,819,760.00	
	SCB X PCL-NVDR	26,600	106.50	2,832,900.00	
	TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR	685,400	1.80	1,233,720.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	29,400	41.00	1,205,400.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	96,000	103.00	9,888,000.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	36,500	241.00	8,796,500.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	28,600	84.50	2,416,700.00	
	TRUE CORP PCL/NEW-NVDR	327,315	10.20	3,338,613.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	21,300	39.00	830,700.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	92,300	47.75	4,407,325.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	63,600	58.50	3,720,600.00	
タイバーツ 小計		3,898,940		118,809,147.25 (506,126,967)	
フィリピンペソ	AYALA CORPORATION	7,600	619.50	4,708,200.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	72,731	24.20	1,760,090.20	
	SM INVESTMENTS CORP	6,580	925.00	6,086,500.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	32,760	396.00	12,972,960.00	
	JOLLIBEE FOODS CORP	15,800	248.00	3,918,400.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	24,530	94.10	2,308,273.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	54,578	120.70	6,587,564.60	
	BDO UNIBANK INC	74,086	147.00	10,890,642.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	57,732	70.05	4,044,126.60	
	PLDT INC	2,235	1,608.00	3,593,880.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	9,630	421.60	4,060,008.00	
	AYALA LAND INC	222,200	34.30	7,621,460.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	331,200	30.65	10,151,280.00	
フィリピンペソ 小計		911,662		78,703,384.40 (203,393,156)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY TBK PT	483,900	3,280.00	1,587,192,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	45,500	25,100.00	1,142,050,000.00	

	AMMAN MINERAL INTERNASIONAL	209,900	10,450.00	2,193,455,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK	307,000	1,470.00	451,290,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	910,347	1,120.00	1,019,588,640.00	
	CHANDRA ASRI PACIFIC TBK PT	233,900	9,850.00	2,303,915,000.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	70,200	8,550.00	600,210,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	292,209	2,340.00	683,769,060.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	630,400	5,025.00	3,167,760,000.00	
	GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT	26,963,000	54.00	1,456,002,000.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	556,700	2,860.00	1,592,162,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESI PT	219,400	5,000.00	1,097,000,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	75,400	11,400.00	859,560,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	154,200	6,450.00	994,590,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	276,400	2,360.00	652,304,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	730,700	1,610.00	1,176,427,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	1,749,800	10,375.00	18,154,175,000.00	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	1,180,700	7,150.00	8,442,005,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	463,600	5,350.00	2,480,260,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	2,154,145	4,820.00	10,382,978,900.00	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	1,576,000	2,930.00	4,617,680,000.00	
インドネシアルピア 小計		39,283,401		65,054,373,600.00 (618,016,549)	
韓国ウォン	HD HYUNDAI	1,442	81,500.00	117,523,000.00	
	S-OIL CORP	1,463	62,900.00	92,022,700.00	
	SK INNOVATION CO LTD	1,895	100,200.00	189,879,000.00	
	ENCHEM CO LTD	341	205,000.00	69,905,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORP	3,349	27,600.00	92,432,400.00	
	HYUNDAI STEEL CO	2,559	25,850.00	66,150,150.00	
	KOREA ZINC CO LTD	267	526,000.00	140,442,000.00	
	KUM YANG CO LTD	1,116	57,200.00	63,835,200.00	
	KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	458	132,400.00	60,639,200.00	
	LG CHEM LTD	1,572	289,500.00	455,094,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	265	196,300.00	52,019,500.00	
	LOTTE CHEMICAL CORP	563	82,400.00	46,391,200.00	
	POSCO HOLDINGS INC	2,268	322,500.00	731,430,000.00	
	SKC CO LTD	602	121,500.00	73,143,000.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	1,860	39,800.00	74,028,000.00	
	DOOSAN ENERBILITY	14,355	18,230.00	261,691,650.00	
	ECOPRO BM CO LTD	1,505	172,400.00	259,462,000.00	
	ECOPRO CO LTD	3,196	85,500.00	273,258,000.00	
	ECOPRO MATERIALS CO LTD	441	79,000.00	34,839,000.00	
	GS HOLDINGS	1,411	45,000.00	63,495,000.00	
	HANWHA AEROSPACE CO LTD	1,137	300,000.00	341,100,000.00	
	HANWHA OCEAN CO LTD	3,102	31,300.00	97,092,600.00	

HD HYUNDAI ELECTRIC CO LTD	661	288,500.00	190,698,500.00	
HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	733	211,000.00	154,663,000.00	
HD KOREA SHIPBUILDING & OFFS	1,376	199,300.00	274,236,800.00	
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	2,296	30,850.00	70,831,600.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	2,176	58,200.00	126,643,200.00	
L&F CO LTD	821	89,300.00	73,315,300.00	
LG CORP	2,961	80,000.00	236,880,000.00	
LG ENERGY SOLUTION	1,435	329,500.00	472,832,500.00	
POSCO FUTURE M CO LTD	962	200,500.00	192,881,000.00	
POSCO INTERNATIONAL CORP	1,772	50,700.00	89,840,400.00	
SAMSUNG C&T CORP	2,648	144,200.00	381,841,600.00	
SAMSUNG E&A CO LTD	4,565	26,600.00	121,429,000.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	21,428	10,800.00	231,422,400.00	
SK	1,151	138,300.00	159,183,300.00	
SK IE TECHNOLOGY CO LTD	775	31,650.00	24,528,750.00	
SK SQUARE CO LTD	3,018	86,200.00	260,151,600.00	
HANJIN KAL CORP	866	66,200.00	57,329,200.00	
HMM CO LTD	7,839	17,920.00	140,474,880.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,230	104,700.00	128,781,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	5,483	21,150.00	115,965,450.00	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	2,338	43,250.00	101,118,500.00	
HYUNDAI MOBIS CO LTD	1,896	220,500.00	418,068,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	4,292	255,000.00	1,094,460,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	1,138	168,200.00	191,411,600.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	714	166,900.00	119,166,600.00	
KIA CORP	8,243	103,200.00	850,677,600.00	
COWAY CO LTD	1,628	62,200.00	101,261,600.00	
LG ELECTRONICS INC	3,387	97,400.00	329,893,800.00	
HYBE CO LTD	687	168,400.00	115,690,800.00	
KAKAO CORP	9,494	36,650.00	347,955,100.00	
KRAFTON INC	872	325,000.00	283,400,000.00	
NAVER CORP	4,095	156,600.00	641,277,000.00	
NCSOFT CORP	458	191,700.00	87,798,600.00	
NETMARBLE CORPORATION	904	57,100.00	51,618,400.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	272	342,500.00	93,160,000.00	
KT&G CORP	3,351	101,100.00	338,786,100.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	783	92,000.00	72,036,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	932	122,900.00	114,542,800.00	
LG H&H	315	338,000.00	106,470,000.00	
HLB INC	3,748	90,500.00	339,194,000.00	
ALTEOGEN INC	1,267	298,500.00	378,199,500.00	
CELLTRION INC	4,814	197,600.00	951,246,400.00	
CELLTRION PHARM INC	569	72,200.00	41,081,800.00	

	HANMI PHARM CO LTD	218	295,500.00	64,419,000.00	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	562	930,000.00	522,660,000.00	
	SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	954	107,400.00	102,459,600.00	
	SK BIOSCIENCE CO LTD	710	60,200.00	42,742,000.00	
	YUHAN CORP	1,830	96,400.00	176,412,000.00	
	HANA FINANCIAL GROUP	9,256	62,900.00	582,202,400.00	
	INDUSTRIAL BANK OF KOREA	8,613	13,890.00	119,634,570.00	
	KAKAOBANK CORP	5,191	21,650.00	112,385,150.00	
	KB FINANCIAL GROUP INC	12,077	87,000.00	1,050,699,000.00	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	13,645	57,200.00	780,494,000.00	
	WOORI FINANCIAL GROUP INC	18,838	16,040.00	302,161,520.00	
	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	1,162	73,500.00	85,407,000.00	
	MERITZ FINANCIAL GROUP INC	3,040	91,000.00	276,640,000.00	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	7,939	8,120.00	64,464,680.00	
	NH INVESTMENT & SECURITIES C	3,822	13,620.00	52,055,640.00	
	DB INSURANCE CO LTD	1,452	111,700.00	162,188,400.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	983	346,500.00	340,609,500.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	2,498	93,600.00	233,812,800.00	
	POSCO DX CO LTD	1,565	26,250.00	41,081,250.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	1,376	141,800.00	195,116,800.00	
	COSMOAM&T CO LTD	779	108,800.00	84,755,200.00	
	LG DISPLAY CO LTD	9,723	11,280.00	109,675,440.00	
	LG INNOTEK CO LTD	466	250,000.00	116,500,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	1,693	143,900.00	243,622,700.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	150,377	78,300.00	11,774,519,100.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	25,932	63,400.00	1,644,088,800.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	1,736	309,000.00	536,424,000.00	
	KT CORP	896	38,250.00	34,272,000.00	
	LG UPLUS CORP	6,485	9,690.00	62,839,650.00	
	SK TELECOM	1,621	55,100.00	89,317,100.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	8,066	19,220.00	155,028,520.00	
	HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD	1,397	124,900.00	174,485,300.00	
	SK HYNIX INC	17,192	193,900.00	3,333,528,800.00	
韓国ウォン 小計		487,654		37,995,018,200.00 (4,179,452,002)	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	36,000	60.00	2,160,000.00	
	ASIA CEMENT CORP	69,000	44.35	3,060,150.00	
	CHINA STEEL CORP	376,000	22.00	8,272,000.00	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	110,000	44.90	4,939,000.00	
	FORMOSA PLASTICS CORP	122,000	52.20	6,368,400.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	149,000	46.40	6,913,600.00	
	TCC GROUP HOLDINGS	214,917	32.70	7,027,785.90	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	4,200	805.00	3,381,000.00	

FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	92,000	36.35	3,344,200.00	
FORTUNE ELECTRIC CO LTD	4,400	685.00	3,014,000.00	
VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	2,000	1,975.00	3,950,000.00	
WALSIN LIHWA CORP	84,000	33.30	2,797,200.00	
CHINA AIRLINES LTD	95,000	21.00	1,995,000.00	
EVA AIRWAYS CORP	86,000	34.50	2,967,000.00	
EVERGREEN MARINE CORP LTD	31,420	187.00	5,875,540.00	
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	55,000	29.80	1,639,000.00	
WAN HAI LINES LTD	23,650	79.50	1,880,175.00	
YANG MING MARINE TRANSPORT	52,000	63.70	3,312,400.00	
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	53,000	47.85	2,536,050.00	
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	5,420	520.00	2,818,400.00	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	14,289	142.00	2,029,038.00	
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	5,000	459.00	2,295,000.00	
POU CHEN	73,000	34.25	2,500,250.00	
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	10,160	646.00	6,563,360.00	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	18,000	277.00	4,986,000.00	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	149,000	80.50	11,994,500.00	
PHARMAESSENTIA CORP	8,000	682.00	5,456,000.00	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	182,711	17.70	3,233,984.70	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	557,000	35.00	19,495,000.00	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	456,155	27.15	12,384,608.25	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	356,094	26.85	9,561,123.90	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	285,254	25.55	7,288,239.70	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	374,407	38.65	14,470,830.55	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	334,350	26.60	8,893,710.00	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	373,417	18.60	6,945,556.20	
TAIWAN BUSINESS BANK	223,142	16.00	3,570,272.00	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	329,107	25.75	8,474,505.25	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	122,000	41.15	5,020,300.00	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	46,929	149.00	6,992,421.00	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	322,532	31.65	10,208,137.80	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	301,000	62.30	18,752,300.00	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	246,766	90.00	22,208,940.00	
KGI FINANCIAL HOLDING CO LTD	513,000	16.15	8,284,950.00	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	452,069	11.10	5,017,965.90	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	16,000	525.00	8,400,000.00	
ACER INC	86,000	43.20	3,715,200.00	
ADVANTECH CO LTD	14,427	348.00	5,020,596.00	
ASIA VITAL COMPONENTS	10,000	617.00	6,170,000.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	22,000	524.00	11,528,000.00	
AUO CORP	193,200	16.70	3,226,440.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	20,000	234.00	4,680,000.00	

	COMPAL ELECTRONICS	133,000	32.05	4,262,650.00	
	DELTA ELECTRONICS INC	61,000	404.50	24,674,500.00	
	E INK HOLDINGS INC	26,000	281.50	7,319,000.00	
	GIGABYTE TECHNOLOGY CO LTD	16,000	262.50	4,200,000.00	
	HON HAI PRECISION INDUSTRY	392,800	187.00	73,453,600.00	
	INNOLUX CORP	273,751	14.55	3,983,077.05	
	INVENTEC CORP	87,000	47.10	4,097,700.00	
	LARGAN PRECISION CO LTD	3,200	2,905.00	9,296,000.00	
	LITE-ON TECHNOLOGY CORP	64,000	109.00	6,976,000.00	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	23,000	174.50	4,013,500.00	
	PEGATRON CORP	64,000	104.00	6,656,000.00	
	QUANTA COMPUTER INC	85,000	278.00	23,630,000.00	
	SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	40,000	72.20	2,888,000.00	
	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	41,000	158.50	6,498,500.00	
	WISTRON CORP	83,000	100.50	8,341,500.00	
	WIWYNN CORP	3,000	1,930.00	5,790,000.00	
	WPG HOLDINGS LTD	47,960	83.20	3,990,272.00	
	YAGEO CORPORATION	12,574	633.00	7,959,342.00	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	22,000	123.50	2,717,000.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	120,000	123.50	14,820,000.00	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	55,000	89.60	4,928,000.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	59,000	109.50	6,460,500.00	
	ALCHIP TECHNOLOGIES LTD	2,500	2,475.00	6,187,500.00	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	104,000	154.00	16,016,000.00	
	EMEMORY TECHNOLOGY INC	2,000	2,600.00	5,200,000.00	
	GLOBAL UNICHIP CORP	2,800	1,180.00	3,304,000.00	
	GLOBALWAFERS CO LTD	8,000	487.50	3,900,000.00	
	MEDIATEK INC	47,900	1,255.00	60,114,500.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	39,000	56.60	2,207,400.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS COR	18,400	547.00	10,064,800.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	15,000	550.00	8,250,000.00	
	SILERGY CORP	9,640	434.00	4,183,760.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	776,000	973.00	755,048,000.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	355,000	56.00	19,880,000.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	29,000	126.00	3,654,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	99,000	24.00	2,376,000.00	
	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	53,647	49.80	2,671,620.60	
新台湾ドル 小計		11,054,188		1,467,630,851.80 (6,709,714,728)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	48,477	343.80	16,666,392.60	
	COAL INDIA LTD	47,308	522.00	24,694,776.00	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	27,863	387.35	10,792,733.05	
	INDIAN OIL CORP LTD	87,227	170.08	14,835,568.16	

OIL & NATURAL GAS CORP LTD	99,694	335.30	33,427,398.20	
PETRONET LNG LTD	23,778	375.45	8,927,450.10	
RELIANCE INDUSTRIES LTD	95,915	2,976.80	285,519,772.00	
AMBUJA CEMENTS LTD	18,748	633.70	11,880,607.60	
APL APOLLO TUBES LTD	4,859	1,357.00	6,593,663.00	
ASIAN PAINTS LTD	12,149	3,076.30	37,373,968.70	
GRASIM INDUSTRIES LTD	8,176	2,598.40	21,244,518.40	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	42,737	658.85	28,157,272.45	
JINDAL STAINLESS LTD	9,837	723.15	7,113,626.55	
JINDAL STEEL & POWER LTD	11,587	953.75	11,051,101.25	
JSW STEEL LTD	19,465	917.75	17,864,003.75	
NMDC LTD	32,477	219.86	7,140,393.22	
PI INDUSTRIES LTD	2,242	4,323.60	9,693,511.20	
PIDILITE INDUSTRIES LTD	4,795	3,056.60	14,656,397.00	
SHREE CEMENT LTD	297	24,848.95	7,380,138.15	
SOLAR INDUSTRIES INDIA LTD	812	10,387.25	8,434,447.00	
SRF LTD	4,666	2,476.15	11,553,715.90	
SUPREME INDUSTRIES LTD	2,023	5,267.60	10,656,354.80	
TATA STEEL LTD	236,993	153.96	36,487,442.28	
ULTRATECH CEMENT LTD	3,653	11,315.35	41,334,973.55	
UPL LTD	13,811	560.60	7,742,446.60	
VEDANTA LTD	43,250	442.75	19,148,937.50	
ABB INDIA LTD	1,585	7,822.60	12,398,821.00	
ADANI ENTERPRISES LTD	5,367	3,102.55	16,651,385.85	
ASHOK LEYLAND LTD	48,007	257.50	12,361,802.50	
ASTRAL LTD	4,281	1,882.75	8,060,052.75	
BHARAT ELECTRONICS LTD	113,007	302.15	34,145,065.05	
BHARAT HEAVY ELECTRICALS	33,162	293.75	9,741,337.50	
CG POWER AND INDUSTRIAL SOLU	19,772	710.55	14,048,994.60	
CUMMINS INDIA LTD	4,466	3,754.85	16,769,160.10	
HAVELLS INDIA LTD	7,902	1,881.85	14,870,378.70	
HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	6,363	4,792.25	30,493,086.75	
LARSEN & TOUBRO LTD	21,276	3,555.05	75,637,243.80	
POLYCAB INDIA LTD	1,581	6,616.90	10,461,318.90	
SIEMENS LTD	2,836	7,102.25	20,141,981.00	
SUZLON ENERGY LTD	307,162	80.71	24,791,045.02	
THERMAX LTD	1,230	4,314.00	5,306,220.00	
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	7,631	937.70	7,155,588.70	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	16,262	1,496.45	24,335,269.90	
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	7,859	968.30	7,609,869.70	
GMR AIRPORTS INFRASTRUCTURE	77,131	96.29	7,426,943.99	
INTERGLOBE AVIATION LTD	5,306	4,231.95	22,454,726.70	
BAJAJ AUTO LTD	2,131	9,770.65	20,821,255.15	

BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	2,334	2,802.30	6,540,568.20	
BHARAT FORGE LTD	8,017	1,587.70	12,728,590.90	
BOSCH LTD	215	31,605.75	6,795,236.25	
EICHER MOTORS LTD	4,352	4,813.30	20,947,481.60	
HERO MOTOCORP LTD	3,740	5,188.90	19,406,486.00	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	29,432	2,765.15	81,383,894.80	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	4,470	12,149.80	54,309,606.00	
MRF LTD	73	134,923.75	9,849,433.75	
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN	86,338	186.13	16,070,091.94	
SONA BLW PRECISION FORGINGS	12,173	690.40	8,404,239.20	
TATA MOTORS LTD	52,521	1,087.70	57,127,091.70	
TATA MOTORS LTD-A-DVR	13,696	749.05	10,258,988.80	
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LT	3,429	3,983.80	13,660,450.20	
TVS MOTOR CO LTD	7,624	2,607.60	19,880,342.40	
PAGE INDUSTRIES LTD	196	41,053.05	8,046,397.80	
TITAN CO LTD	11,239	3,464.85	38,941,449.15	
INDIAN HOTELS CO LTD	27,297	613.15	16,737,155.55	
JUBILANT FOODWORKS LTD	10,980	633.25	6,953,085.00	
ZOMATO LTD	208,714	262.17	54,718,549.38	
INFO EDGE INDIA LTD	2,281	7,393.45	16,864,459.45	
TRENT LTD	5,739	6,689.90	38,393,336.10	
AVENUE SUPERMARTS LTD	5,012	5,002.70	25,073,532.40	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	3,364	5,732.50	19,284,130.00	
ITC LTD	94,849	501.45	47,562,031.05	
MARICO LTD	15,967	669.15	10,684,318.05	
NESTLE INDIA LTD	10,383	2,503.15	25,990,206.45	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	18,336	1,177.40	21,588,806.40	
UNITED SPIRITS LTD	9,458	1,402.90	13,268,628.20	
VARUN BEVERAGES LTD	14,101	1,508.40	21,269,948.40	
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	4,259	3,547.05	15,106,885.95	
DABUR INDIA LTD	15,898	621.30	9,877,427.40	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	12,732	1,403.65	17,871,271.80	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	26,007	2,742.55	71,325,497.85	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	3,210	6,724.90	21,586,929.00	
MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	24,763	874.55	21,656,481.65	
AUROBINDO PHARMA LTD	8,399	1,519.20	12,759,760.80	
CIPLA LTD	16,428	1,575.50	25,882,314.00	
DIVI'S LABORATORIES LTD	3,794	4,669.90	17,717,600.60	
DR. REDDY'S LABORATORIES	3,727	6,911.35	25,758,601.45	
LUPIN LTD	7,170	2,068.80	14,833,296.00	
MANKIND PHARMA LTD	2,983	2,319.55	6,919,217.65	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	30,329	1,747.80	53,009,026.20	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	3,310	3,349.35	11,086,348.50	

AU SMALL FINANCE BANK LTD	10,528	615.25	6,477,352.00	
AXIS BANK LTD	72,011	1,153.25	83,046,685.75	
BANDHAN BANK LTD	25,449	192.02	4,886,716.98	
BANK OF BARODA	32,605	247.35	8,064,846.75	
CANARA BANK	53,143	109.90	5,840,415.70	
HDFC BANK LIMITED	88,573	1,631.55	144,511,278.15	
ICICI BANK LTD	163,722	1,175.90	192,520,699.80	
IDFC FIRST BANK LTD	109,925	72.01	7,915,699.25	
INDUSIND BANK LTD	9,262	1,347.60	12,481,471.20	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	34,493	1,781.35	61,444,105.55	
PUNJAB NATIONAL BANK	69,448	115.21	8,001,104.08	
STATE BANK OF INDIA	56,345	813.70	45,847,926.50	
UNION BANK OF INDIA	46,909	120.19	5,637,992.71	
YES BANK LTD	463,728	24.45	11,338,149.60	
BAJAJ FINANCE LTD	8,801	6,616.35	58,230,496.35	
BAJAJ FINSERV LTD	12,194	1,551.10	18,914,113.40	
BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMEN	806	9,607.65	7,743,765.90	
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	13,260	1,349.70	17,897,022.00	
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	3,113	4,196.15	13,062,614.95	
JIO FINANCIAL SERVICES LTD	90,636	331.45	30,041,302.20	
MUTHOOT FINANCE LTD	3,756	1,840.35	6,912,354.60	
POWER FINANCE CORPORATION	47,152	504.95	23,809,402.40	
REC LTD	41,809	584.30	24,428,998.70	
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	9,485	699.90	6,638,551.50	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	9,006	3,075.60	27,698,853.60	
SUNDARAM FINANCE LTD	1,982	4,094.05	8,114,407.10	
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	29,778	685.70	20,418,774.60	
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	7,188	2,014.05	14,476,991.40	
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	11,312	720.05	8,145,205.60	
PB FINTECH LTD	9,546	1,652.50	15,774,765.00	
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	14,063	1,671.55	23,507,007.65	
HCL TECHNOLOGIES LTD	30,088	1,678.50	50,502,708.00	
INFOSYS LTD	104,718	1,864.80	195,278,126.40	
LTIMINDTREE LTD	2,775	5,676.10	15,751,177.50	
MPHASIS LTD	3,266	2,977.70	9,725,168.20	
PERSISTENT SYSTEMS LTD	3,124	4,874.50	15,227,938.00	
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	28,549	4,490.00	128,185,010.00	
TATA ELXSI LTD	1,069	6,927.50	7,405,497.50	
TECH MAHINDRA LTD	16,514	1,594.65	26,334,050.10	
WIPRO LTD	41,653	519.75	21,649,146.75	
BHARTI AIRTEL LTD	71,541	1,469.65	105,140,230.65	
INDUS TOWERS LTD	38,189	418.65	15,987,824.85	
TATA COMMUNICATIONS LTD	3,349	1,871.25	6,266,816.25	

	ADANI GREEN ENERGY LTD	9,923	1,898.00	18,833,854.00	
	ADANI POWER LTD	24,069	697.00	16,776,093.00	
	GAIL INDIA LTD	73,371	238.93	17,530,533.03	
	JSW ENERGY LTD	10,450	668.55	6,986,347.50	
	NHPC LTD	90,500	96.19	8,705,195.00	
	NTPC LTD	137,935	403.10	55,601,598.50	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	147,023	340.30	50,031,926.90	
	TATA POWER CO LTD	45,750	418.80	19,160,100.00	
	TORRENT POWER LTD	5,030	1,672.80	8,414,184.00	
	DLF LTD	23,262	857.20	19,940,186.40	
	GODREJ PROPERTIES LTD	4,105	2,926.00	12,011,230.00	
	MACROTECH DEVELOPERS LTD	9,643	1,287.95	12,419,701.85	
	PHOENIX MILLS LTD	3,244	3,490.90	11,324,479.60	
インドルピー 小計		4,905,663		3,913,200,545.59 (6,887,232,960)	
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	18,651	14.62	272,677.62	
	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	90,755	4.49	408,306.74	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	187,792	1.65	311,359.13	
	INDUSTRIES QATAR	47,498	13.20	626,973.60	
	COMMERCIAL BANK PQSC	104,492	4.09	428,103.72	
	DUKHAN BANK	57,922	3.77	218,365.94	
	MASRAF AL RAYAN	196,047	2.22	436,988.76	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	29,447	11.00	323,917.00	
	QATAR ISLAMIC BANK	55,218	19.35	1,068,468.30	
	QATAR NATIONAL BANK	145,670	15.69	2,285,562.30	
	OOREDOO QPSC	24,164	10.97	265,079.08	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	13,086	15.47	202,440.42	
	BARWA REAL ESTATE CO	76,272	2.59	198,078.38	
カタールリアル 小計		1,047,014		7,046,320.99 (283,403,030)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	7,793	167.35	1,304,158.55	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	2,095	690.40	1,446,388.00	
	ANGLOGOLD ASHANTI PLC	13,351	557.37	7,441,446.87	
	GOLD FIELDS LTD	28,426	301.00	8,556,226.00	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	17,719	192.82	3,416,577.58	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	28,030	88.45	2,479,253.50	
	KUMBA IRON ORE LTD	2,210	363.62	803,600.20	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	10,590	125.85	1,332,751.50	
	SASOL LTD	18,714	137.53	2,573,736.42	
	SIBANYE STILLWATER LTD	83,639	19.11	1,598,341.29	
	BIDVEST GROUP LTD	11,047	285.82	3,157,453.54	
	NASPERS LTD-N SHS	5,622	3,650.12	20,520,974.64	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	79,385	21.26	1,687,725.10	

	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	27,276	65.65	1,790,669.40	
	BID CORP LTD	10,719	438.10	4,695,993.90	
	CLICKS GROUP LTD	7,697	356.00	2,740,132.00	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	15,813	307.51	4,862,655.63	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	11,723	232.50	2,725,597.50	
	ABSA GROUP LTD	26,797	165.58	4,437,047.26	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	2,686	2,880.00	7,735,680.00	
	NEDBANK GROUP LTD	14,864	297.04	4,415,202.56	
	STANDARD BANK GROUP LTD	42,311	237.19	10,035,746.09	
	FIRSTRAND LTD	159,474	84.60	13,491,500.40	
	REINET INVESTMENTS SCA	4,084	468.54	1,913,517.36	
	REMGRO LTD	14,915	143.88	2,145,970.20	
	DISCOVERY LTD	16,635	150.16	2,497,911.60	
	OLD MUTUAL LTD	141,224	12.38	1,748,353.12	
	OUTSURANCE GROUP LTD	28,467	48.54	1,381,788.18	
	SANLAM LTD	54,894	85.15	4,674,224.10	
	MTN GROUP LTD	54,292	90.28	4,901,481.76	
	VODACOM GROUP LTD	19,783	107.28	2,122,320.24	
	NEPI ROCKCASTLE N.V.	17,784	139.12	2,474,110.08	
南アフリカランド 小計		980,059		137,108,534.57 (1,132,516,495)	
アラブディルハム	MULTIPLY GROUP	132,837	2.13	282,942.81	
	AMERICANA RESTAURANTS INTERN	96,797	2.85	275,871.45	
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	99,491	3.60	358,167.60	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	90,397	8.85	800,013.45	
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	44,112	12.72	561,104.64	
	DUBAI ISLAMIC BANK	93,109	5.90	549,343.10	
	EMIRATES NBD PJSC	58,262	19.60	1,141,935.20	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	139,486	13.22	1,844,004.92	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	110,047	17.12	1,884,004.64	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	125,204	7.13	892,704.52	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	210,694	8.11	1,708,728.34	
アラブディルハム 小計		1,200,436		10,298,820.67 (411,334,897)	
クウェートディナール	BOUBYAN BANK K.S.C	46,546	0.58	27,322.50	
	GULF BANK	57,778	0.31	18,084.51	
	KUWAIT FINANCE HOUSE	323,971	0.71	232,287.20	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	249,701	0.88	220,485.98	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	64,994	0.45	29,377.28	
	MABANEE CO KPSC	21,552	0.85	18,513.16	
クウェートディナール 小計		764,542		546,070.63 (261,174,660)	
オフショア人民	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	18,900	8.26	156,114.00	

元

CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	58,200	6.72	391,104.00	
CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	13,100	40.35	528,585.00	
CNOOC ENERGY TECHNOLOGY & -A	13,700	3.92	53,704.00	
COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-A	8,100	15.20	123,120.00	
GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	9,700	6.13	59,461.00	
INNER MONGOLIA DIAN TOU EN-A	5,300	18.36	97,308.00	
JIZHONG ENERGY RESOURCES-A	4,900	5.64	27,636.00	
OFFSHORE OIL ENGINEERING-A	10,500	5.65	59,325.00	
PETROCHINA CO LTD-A	40,400	9.07	366,428.00	
PINGDINGSHAN TIANAN COAL -A	5,000	10.10	50,500.00	
SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	17,400	24.30	422,820.00	
SHAN XI HUA YANG GROUP NEW-A	5,100	7.24	36,924.00	
SHANXI COKING COAL ENERGY-A	12,420	8.10	100,602.00	
SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	6,500	15.13	98,345.00	
YANKUANG ENERGY GROUP CO-A	8,756	14.70	128,713.20	
YANTAI JEREH OILFIELD-A	900	30.18	27,162.00	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	23,100	6.81	157,311.00	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	7,800	22.59	176,202.00	
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	42,300	6.10	258,030.00	
CATHAY BIOTECH INC-A	1,260	35.53	44,767.80	
CHIFENG JILONG GOLD MINING-A	3,400	18.41	62,594.00	
CHINA JUSHI CO LTD -A	7,414	10.18	75,474.52	
CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	5,700	16.95	96,615.00	
CHINA RARE EARTH RESOURCES-A	1,900	22.42	42,598.00	
CITI PACIFIC SPECIAL STEE-A	7,100	11.76	83,496.00	
CMOC GROUP LTD-A	36,400	7.51	273,364.00	
CNGR ADVANCED MATERIAL CO -A	840	27.21	22,856.40	
GANFENG LITHIUM GROUP CO L-A	2,740	26.54	72,719.60	
GEM CO LTD-A	10,800	5.83	62,964.00	
GUANGDONG HEC TECHNOLOGY H-A	6,300	6.41	40,383.00	
GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	4,180	14.17	59,230.60	
HANGZHOU OXYGEN PLANT GROU-A	2,000	17.72	35,440.00	
HAOHUA CHEMICAL SCIENCE -A	1,600	27.30	43,680.00	
HENAN SHENHUO COAL & POWER-A	3,500	17.06	59,710.00	
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	14,520	13.66	198,343.20	
HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	1,950	6.25	12,187.50	
HESTEEL CO LTD-A	1,500	1.90	2,850.00	
HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A	1,400	45.27	63,378.00	
HUAFON CHEMICAL CO LTD -A	15,600	7.35	114,660.00	
HUAIBEI MINING HOLDINGS CO-A	3,700	14.17	52,429.00	
HUNAN VALIN STEEL CO LTD -A	14,600	4.33	63,218.00	
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	73,300	1.44	105,552.00	
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	15,700	3.72	58,404.00	

INNER MONGOLIA YUAN XING-A	5,900	6.10	35,990.00	
JCHX MINING MANAGEMENT CO -A	1,300	41.23	53,599.00	
JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	13,900	7.56	105,084.00	
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	390	49.88	19,453.20	
JIANGSU YOKE TECHNOLOGY-A	500	53.25	26,625.00	
JIANGXI COPPER CO LTD-A	4,300	20.75	89,225.00	
JINDUICHENG MOLYBDENUM CO -A	6,700	9.93	66,531.00	
LB GROUP CO LTD-A	4,500	15.94	71,730.00	
MEIHUA HOLDINGS GROUP CO -A	5,400	10.04	54,216.00	
NANJING IRON & STEEL CO-A	13,000	4.30	55,900.00	
NINGBO SHANSHAN CO LTD-A	2,300	7.08	16,284.00	
NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	15,400	15.32	235,928.00	
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	18,100	2.31	41,811.00	
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY-A	10,600	13.96	147,976.00	
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	19,550	8.79	171,844.50	
SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A	8,090	16.18	130,896.20	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	6,368	29.46	187,601.28	
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	3,520	22.29	78,460.80	
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	36,900	3.62	133,578.00	
SHANDONG SUN PAPER INDUSTR-A	8,800	12.65	111,320.00	
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	4,408	11.44	50,427.52	
SHANJIN INTERNATIONAL GOLD C	5,580	17.54	97,873.20	
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	3,700	4.18	15,466.00	
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	4,800	3.46	16,608.00	
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	1,080	30.84	33,307.20	
SHENZHEN YUTO PACKAGING TE-A	1,700	22.63	38,471.00	
SICHUAN HEBANG BIOTECHNOL- A	14,200	1.66	23,572.00	
SINOMA SCIENCE&TECHNOLOGY -A	2,200	10.04	22,088.00	
SINOMINE RESOURCE GROUP CO-A	980	27.59	27,038.20	
SUNRESIN NEW MATERIALS CO -A	1,200	38.68	46,416.00	
TIANQI LITHIUM CORP-A	2,900	26.32	76,328.00	
TIANSHAN ALUMINUM GROUP CO-A	7,500	6.94	52,050.00	
TONGKUN GROUP CO LTD-A	7,600	12.30	93,480.00	
TONGLING NONFERROUS METALS-A	27,300	3.12	85,176.00	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	6,300	70.61	444,843.00	
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	640	26.65	17,056.00	
WESTERN MINING CO -A	3,300	16.16	53,328.00	
WESTERN SUPERCONDUCTING TE-A	560	34.51	19,325.60	
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD-A	1,200	16.50	19,800.00	
YONGXING SPECIAL MATERIALS-A	910	31.44	28,610.40	
YUNNAN ALUMINIUM CO LTD-A	7,300	11.86	86,578.00	
YUNNAN CHIHONG ZINC & GERM-A	11,000	5.20	57,200.00	
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	1,400	26.74	37,436.00	

YUNNAN TIN CO LTD-A	3,500	14.15	49,525.00	
YUNNAN YUNTIANHUA CO-A	4,400	20.52	90,288.00	
ZANGGE MINING CO LTD-A	3,300	23.02	75,966.00	
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	2,708	22.25	60,253.00	
ZHEJIANG JUHUA CO-A	5,700	17.80	101,460.00	
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	6,700	8.66	58,022.00	
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	5,463	20.07	109,642.41	
ZHONGJIN GOLD CORP-A	10,000	15.46	154,600.00	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	40,400	16.22	655,288.00	
AECC AERO-ENGINE CONTROL-A	1,000	19.69	19,690.00	
AECC AVIATION POWER CO-A	6,300	36.81	231,903.00	
AVICOPTER PLC-A	500	39.20	19,600.00	
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	3,700	25.34	93,758.00	
CHINA BAOAN GROUP-A	4,500	7.89	35,505.00	
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	8,600	39.42	339,012.00	
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	6.12	234,396.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	84,800	5.67	480,816.00	
CHINA XD ELECTRIC CO LTD-A	11,300	6.92	78,196.00	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	8,260	175.60	1,450,456.00	
COSCO SHIPPING DEVELOPMENT CO	18,400	2.42	44,528.00	
CRRC CORP LTD-A	46,800	8.02	375,336.00	
CSSC SCIENCE & TECHNOLOGY -A	3,300	12.15	40,095.00	
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	4,400	14.24	62,656.00	
EVE ENERGY CO LTD-A	4,020	35.98	144,639.60	
FAW JIEFANG GROUP CO LTD-A	3,200	7.94	25,408.00	
GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A	600	58.84	35,304.00	
GOLDWIND SCIENCE &TECHNOL-A	3,400	7.47	25,398.00	
GONEO GROUP CO LTD	1,160	67.69	78,520.40	
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	3,900	18.12	70,668.00	
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	2,436	44.73	108,962.28	
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	5,300	13.25	70,225.00	
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A	2,200	15.98	35,156.00	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	39,700	3.27	129,819.00	
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	14,782	23.69	350,185.58	
NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO -A	756	92.01	69,559.56	
NINGBO ORIENT WIRES & CABL-A	1,000	47.00	47,000.00	
NINGBO SANXING MEDICAL CO -A	3,100	28.73	89,063.00	
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	33,900	5.57	188,823.00	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	15,900	15.62	248,358.00	
SHANDONG HIMILE MECHANICAL-A	1,800	36.74	66,132.00	
SHANGHAI CONSTRUCTION GROU-A	5,600	2.15	12,040.00	

SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	24,000	3.69	88,560.00	
SHANXI COAL INTERNATIONAL -A	4,500	12.36	55,620.00	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	2,400	41.82	100,368.00	
SICHUAN ROAD&BRIDGE GROUP-A	13,860	6.00	83,160.00	
SIEYUAN ELECTRIC CO LTD-A	1,500	66.49	99,735.00	
SINOMA INTERNATIONAL ENGIN-A	5,500	9.93	54,615.00	
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	3,920	67.53	264,717.60	
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	1,300	15.85	20,605.00	
TBEA CO LTD-A	10,920	13.06	142,615.20	
TIAN DI SCIENCE & TECHNOLO-A	9,000	5.78	52,020.00	
WEICHAI POWER CO LTD-A	13,200	13.00	171,600.00	
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	20,700	6.70	138,690.00	
XIAMEN C & D INC-A	4,400	7.48	32,912.00	
YUTONG BUS CO LTD-A	4,900	20.87	102,263.00	
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	4,100	17.99	73,759.00	
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	420	49.01	20,584.20	
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	3,800	16.54	62,852.00	
ZHEJIANG WEIXING NEW BUILD-A	1,300	13.24	17,212.00	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-A	800	54.84	43,872.00	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	15,500	6.73	104,315.00	
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	1,800	27.25	49,050.00	
ZHEJIANG WEIMING ENVIRONME-A	2,340	18.85	44,109.00	
AIR CHINA LTD-A	23,900	7.21	172,319.00	
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	98,300	5.75	565,225.00	
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	33,300	3.78	125,874.00	
CHINA MERCHANTS EXPRESSWAY-A	10,700	12.90	138,030.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	17,600	5.74	101,024.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	23,670	12.70	300,609.00	
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	34,900	6.91	241,159.00	
GUANGZHOU BAIYUN INTERNATI-A	5,000	9.17	45,850.00	
HAINAN AIRLINES HOLDING CO-A	81,700	1.08	88,236.00	
JUNEYAO AIRLINES CO LTD-A	3,500	11.07	38,745.00	
LIAONING PORT CO LTD-A	21,900	1.26	27,594.00	
S F HOLDING CO LTD-A	8,600	34.34	295,324.00	
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	2,100	33.58	70,518.00	
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	8,900	6.37	56,693.00	
SPRING AIRLINES CO LTD-A	1,900	50.29	95,551.00	
YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	7,400	14.40	106,560.00	
YUNDA HOLDING CO LTD-A	4,870	6.61	32,190.70	
AIMA TECHNOLOGY GROUP CO L-A	1,700	26.50	45,050.00	
ANHUI JIANGHUAI AUTO GROUP-A	4,300	20.71	89,053.00	
BAIC BLUEPARK NEW ENERGY -A	10,900	7.25	79,025.00	
BETHEL AUTOMOTIVE SAFETY S-A	1,260	34.97	44,062.20	

BYD CO LTD -A	3,500	235.42	823,970.00	
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	700	118.68	83,076.00	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	17,126	13.01	222,809.26	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	3,400	45.31	154,054.00	
GREAT WALL MOTOR CO LTD-A	6,400	22.57	144,448.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A	6,900	7.49	51,681.00	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	7,100	14.07	99,897.00	
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	1,000	89.60	89,600.00	
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	1,200	14.09	16,908.00	
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	2,755	33.36	91,906.80	
SAIC MOTOR CORP LTD-A	14,310	13.09	187,317.90	
SAILUN GROUP CO LTD-A	6,100	12.69	77,409.00	
SERES GROUP CO L-A	3,100	83.70	259,470.00	
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	1,300	16.30	21,190.00	
SHENZHEN KEDALI INDUSTRY C-A	400	73.13	29,252.00	
ZHEJIANG WANFENG AUTO -A	4,500	12.02	54,090.00	
BEIJING ROBOROCK TECHNOLOG-A	392	198.91	77,972.72	
ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A	600	37.77	22,662.00	
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	6,000	40.74	244,440.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-A	11,600	23.91	277,356.00	
HANG ZHOU GREAT STAR INDUS-A	2,700	23.64	63,828.00	
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	1,000	20.33	20,330.00	
HISENSE HOME APPLIANCES G-A	1,800	24.63	44,334.00	
HISENSE VISUAL TECH CO LTD-A	2,900	17.25	50,025.00	
JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	1,040	25.90	26,936.00	
MIDEA GROUP CO LTD-A	6,700	62.36	417,812.00	
OPPEIN HOME GROUP INC-A	1,040	49.16	51,126.40	
SICHUAN CHANGHONG ELECTRIC-A	10,300	4.69	48,307.00	
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	1,700	49.61	84,337.00	
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	1,700	23.81	40,477.00	
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	5,080	7.89	40,081.20	
37 INTERACTIVE ENTERTAINME-A	3,900	13.22	51,558.00	
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	1,300	7.19	9,347.00	
CHINA FILM CO LTD-A	4,000	10.45	41,800.00	
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	32,600	5.71	186,146.00	
JIANGSU PHOENIX PUBLISH-A	5,500	10.86	59,730.00	
KINGNET NETWORK CO LTD-A	4,600	9.31	42,826.00	
KUNLUN TECH CO LTD-A	2,500	29.18	72,950.00	
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	3,110	20.43	63,537.30	
ORIENTAL PEARL GROUP CO LT-A	7,300	6.27	45,771.00	
PEOPLE.CN CO LTD-A	2,000	18.52	37,040.00	
WANDA FILM HOLDING CO LTD-A	4,500	10.19	45,855.00	
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	17,100	3.24	55,404.00	

CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	3,400	63.40	215,560.00	
HLA GROUP CORP L-A	9,300	6.23	57,939.00	
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	5,000	5.42	27,100.00	
WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A	6,000	4.44	26,640.00	
ZHEJIANG CHINA COMMODITIES-A	13,000	7.79	101,270.00	
DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	1,036	13.12	13,592.32	
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	2,596	19.43	50,440.28	
ANGEL YEAST CO LTD-A	700	30.18	21,126.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	800	178.40	142,720.00	
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	500	37.47	18,735.00	
ANHUI YINGJIA DISTILLERY C-A	1,600	51.78	82,848.00	
ANJOY FOODS GROUP CO LTD	400	75.20	30,080.00	
BEIJING YANJING BREWERY CO-A	3,900	9.83	38,337.00	
CHONGQING BREWERY CO-A	800	56.75	45,400.00	
EASTROC BEVERAGE GROUP CO -A	800	238.08	190,464.00	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	8,170	34.70	283,499.00	
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	2,800	39.27	109,956.00	
HEBEI YANGYUAN ZHIHUI BEVERA	2,600	21.78	56,628.00	
HEILONGJIANG AGRICULTURE-A	2,500	13.23	33,075.00	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	7,400	22.90	169,460.00	
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	11,500	23.91	274,965.00	
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	2,000	41.72	83,440.00	
JIANGSU YANGHE DISTILLERY-A	2,700	78.17	211,059.00	
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	300	17.53	5,259.00	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	2,400	1,425.44	3,421,056.00	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	2,800	124.78	349,384.00	
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	11,016	41.99	462,561.84	
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	7,600	9.41	71,516.00	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	2,320	184.03	426,949.60	
SHEDE SPIRITS CO LTD-A	700	51.76	36,232.00	
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	400	34.50	13,800.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-A	1,500	63.85	95,775.00	
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	12,460	19.13	238,359.80	
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	7,600	123.95	942,020.00	
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	2,200	25.82	56,804.00	
BY-HEALTH CO LTD-A	1,300	11.13	14,469.00	
YUNNAN BOTANEE BIO-TECHNOL-A	400	42.80	17,120.00	
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	17,368	10.34	179,585.12	
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD-A	1,000	40.18	40,180.00	
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	3,300	29.85	98,505.00	
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	700	27.92	19,544.00	
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	2,940	30.63	90,052.20	
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A	3,000	34.72	104,160.00	

JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	10,763	4.76	51,231.88	
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	1,900	11.97	22,743.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	4,400	19.73	86,812.00	
SHANGHAI UNITED IMAGING HE-A	1,800	107.07	192,726.00	
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	2,300	255.60	587,880.00	
SHENZHEN NEW INDUSTRIES BI-A	1,500	63.24	94,860.00	
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	680	66.08	44,934.40	
BEIJING TIANTAN BIOLOGICAL-A	3,960	24.10	95,436.00	
BEIJING TONGRENTANG CO-A	2,300	36.30	83,490.00	
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	1,715	69.20	118,678.00	
BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY COR-A	800	58.38	46,704.00	
CHANGCHUN HIGH-TECH INDUST-A	700	84.19	58,933.00	
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	1,950	42.88	83,616.00	
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	4,050	24.38	98,739.00	
CSPC INNOVATION PHARMACEUT-A	3,480	23.39	81,397.20	
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	1,200	49.25	59,100.00	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	300	53.18	15,954.00	
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	4,680	15.66	73,288.80	
HUBEI JUMPCAN PHARMACEUT-A	1,300	33.83	43,979.00	
HUMANWELL HEALTHCARE GROUP-A	3,800	19.47	73,986.00	
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	560	165.75	92,820.00	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	11,616	42.11	489,149.76	
JIANGSU NHWA PHARMACEUTICA-A	2,200	26.16	57,552.00	
JOINCARE PHARMACEUTICAL GR-A	1,600	10.46	16,736.00	
LIVZON PHARMACEUTICAL GROU-A	500	37.02	18,510.00	
MGI TECH CO LTD-A	906	41.42	37,526.52	
PHARMARON BEIJING CO LTD-A	3,675	20.51	75,374.25	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	3,600	23.29	83,844.00	
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	10,500	7.56	79,380.00	
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	960	14.93	14,332.80	
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	1,700	28.33	48,161.00	
SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A	2,600	16.44	42,744.00	
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	2,400	31.47	75,528.00	
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	3,000	10.95	32,850.00	
WUXI APPTEC CO LTD-A	4,728	39.77	188,032.56	
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	4,160	53.69	223,350.40	
ZHANGZHOU PIENTZEHUANG PHA-A	1,100	205.00	225,500.00	
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	1,210	17.55	21,235.50	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	165,500	4.89	809,295.00	
BANK OF BEIJING CO LTD -A	40,600	5.62	228,172.00	
BANK OF CHANGSHA CO LTD-A	7,500	7.88	59,100.00	
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	5,400	15.15	81,810.00	
BANK OF CHINA LTD-A	64,800	4.92	318,816.00	

BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	77,900	7.92	616,968.00	
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	13,000	13.55	176,150.00	
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	33,900	7.96	269,844.00	
BANK OF NANJING CO LTD -A	20,000	10.28	205,600.00	
BANK OF NINGBO CO LTD -A	11,700	20.27	237,159.00	
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	24,610	7.58	186,543.80	
BANK OF SUZHOU CO LTD-A	5,100	7.37	37,587.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	20,400	8.05	164,220.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	78,400	3.26	255,584.00	
CHINA MERCHANTS BANK-A	39,600	33.42	1,323,432.00	
CHINA MINSHENG BANKING-A	67,800	3.51	237,978.00	
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	42,270	2.78	117,510.60	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-A	26,300	5.30	139,390.00	
CNPC CAPITAL CO LTD-A	10,900	5.62	61,258.00	
HUAXIA BANK CO LTD-A	24,300	6.46	156,978.00	
IND & COMM BK OF CHINA-A	122,400	6.27	767,448.00	
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	37,400	16.95	633,930.00	
PING AN BANK CO LTD-A	34,400	10.29	353,976.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	53,700	5.06	271,722.00	
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	52,600	9.02	474,452.00	
SHANGHAI RURAL COMMERCIAL -A	18,900	6.96	131,544.00	
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A	13,900	2.27	31,553.00	
BOC INTERNATIONAL CHINA CO-A	3,000	9.01	27,030.00	
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	10.54	127,534.00	
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	12,900	6.79	87,591.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPTAL-A	4,300	28.31	121,733.00	
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	17,100	15.05	257,355.00	
CITIC SECURITIES CO-A	24,800	19.04	472,192.00	
CSC FINANCIAL CO LTD-A	7,500	19.40	145,500.00	
DONGXING SECURITIES CO LT-A	6,200	8.40	52,080.00	
EAST MONEY INFORMATION CO-A	27,812	10.61	295,085.32	
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	6,600	14.84	97,944.00	
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	9,400	5.24	49,256.00	
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	17,000	7.17	121,890.00	
GF SECURITIES CO LTD-A	9,500	12.01	114,095.00	
GUANGZHOU YUEXIU CAPITAL H-A	4,374	5.09	22,263.66	
GUOLIAN SECURITIES CO LTD-A	2,200	9.78	21,516.00	
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	11,300	9.19	103,847.00	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	14,700	14.24	209,328.00	
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	9,500	6.38	60,610.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	18,700	8.74	163,438.00	

HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	1,000	101.96	101,960.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	13,100	12.56	164,536.00	
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	16,300	5.25	85,575.00	
NANJING SECURITIES CO LTD	7,600	7.65	58,140.00	
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	15,100	8.58	129,558.00	
SDIC CAPITAL CO LTD-A	11,000	5.82	64,020.00	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	45,600	4.63	211,128.00	
SINOLINK SECURITIES CO LTD-A	7,700	7.57	58,289.00	
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	9,700	6.13	59,461.00	
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	3,800	3.79	14,402.00	
TIANFENG SECURITIES CO LTD-A	19,400	2.49	48,306.00	
WESTERN SECURITIES CO LTD-A	10,000	6.36	63,600.00	
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	6,000	11.10	66,600.00	
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD-A	10,500	5.89	61,845.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	4,500	31.39	141,255.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	12,800	28.60	366,080.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	3,800	30.26	114,988.00	
PICC HOLDING CO-A	15,500	5.73	88,815.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	21,100	42.07	887,677.00	
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	11,700	7.20	84,240.00	
BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	1,200	196.00	235,200.00	
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	1,170	30.38	35,544.60	
EMPYREAN TECHNOLOGY CO LTD-A	700	72.47	50,729.00	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	3,073	16.43	50,489.39	
IFLYTEK CO LTD - A	4,300	34.51	148,393.00	
ISOFTSTONE INFORMATION TEC-A	1,900	31.97	60,743.00	
RANGE INTELLIGENT COMPUTI-A	3,200	22.75	72,800.00	
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	900	47.41	42,669.00	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	3,594	30.08	108,107.52	
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	900	40.05	36,045.00	
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	5,908	8.70	51,399.60	
ACCELINK TECHNOLOGIES CO -A	1,900	30.25	57,475.00	
ANKER INNOVATIONS TECHNOLO-A	1,040	56.25	58,500.00	
AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A	4,500	33.48	150,660.00	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	69,600	3.81	265,176.00	
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	4,500	30.34	136,530.00	
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	6,700	7.93	53,131.00	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-A	11,000	5.97	65,670.00	
CHINA ZHENHUA GROUP SCIENC-A	1,200	37.69	45,228.00	
EOPTOLINK TECHNOLOGY INC L-A	1,400	99.60	139,440.00	
EVERDISPLAY OPTRONICS SHAN-A	23,718	2.08	49,333.44	
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	24,800	20.78	515,344.00	
GOERTEK INC -A	6,100	20.30	123,830.00	

GRG BANKING EQUIPMENT CO -A	2,200	9.72	21,384.00	
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	22,300	6.64	148,072.00	
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICAT-A	7,600	9.37	71,212.00	
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	1,500	28.65	42,975.00	
HENGDIAN GROUP DMEGC -A	2,700	12.34	33,318.00	
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO-A	3,700	13.46	49,802.00	
HUAGONG TECH CO LTD-A	2,700	30.39	82,053.00	
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	2,400	33.29	79,896.00	
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	9,600	17.00	163,200.00	
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	14,233	36.72	522,635.76	
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	1,076	69.00	74,244.00	
NINESTAR CORP-A	1,800	23.94	43,092.00	
OFILM GROUP CO LTD-A	7,700	8.01	61,677.00	
SHANGHAI BOCHU ELECTRONIC-A	392	157.04	61,559.68	
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	4,500	18.38	82,710.00	
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	780	107.12	83,553.60	
SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	2,511	77.57	194,778.27	
SUPCON TECHNOLOGY CO LTD-A	870	36.75	31,972.50	
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	3,300	22.24	73,392.00	
SUZHOU TFC OPTICAL COMMUNI-A	1,120	89.30	100,016.00	
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	31,790	3.85	122,391.50	
UNISPLENDOUR CORP LTD-A	4,876	20.03	97,666.28	
UNIVERSAL SCIENTIFIC INDUS-A	3,800	15.35	58,330.00	
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	2,700	26.70	72,090.00	
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	3,464	6.10	21,130.40	
WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHA-A	3,860	33.55	129,503.00	
XIAMEN FARATRONIC CO LTD-A	400	78.27	31,308.00	
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	2,240	32.70	73,248.00	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	6,300	13.73	86,499.00	
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	2,380	121.64	289,503.20	
ZTE CORP-A	8,500	26.16	222,360.00	
CHINA UNITED NETWORK-A	59,700	4.79	285,963.00	
CGN POWER CO LTD-A	40,600	4.97	201,782.00	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	38,100	11.30	430,530.00	
CHINA THREE GORGES RENEWAB-A	53,300	4.73	252,109.00	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	47,200	29.73	1,403,256.00	
DATANG INTL POWER GEN CO-A	20,000	2.90	58,000.00	
ENN NATURAL GAS CO LTD-A	4,800	18.60	89,280.00	
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	40,500	5.53	223,965.00	
HUADIAN POWER INTL CORP-A	12,500	5.58	69,750.00	
HUANENG POWER INTL INC-A	18,200	7.35	133,770.00	
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	13,800	16.64	229,632.00	
SHANGHAI ELECTRIC POWER CO-A	7,100	8.87	62,977.00	

SHENERGY COMPANY LIMITED	9,900	8.47	83,853.00	
SHENZHEN ENERGY GROUP CO L-A	11,600	6.66	77,256.00	
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A	9,000	18.19	163,710.00	
WINTIME ENERGY GROUP CO LTD	47,800	1.08	51,624.00	
ZHEJIANG ZHENENG ELECTRIC-A	21,300	6.70	142,710.00	
ACM RESEARCH SHANGHAI I-A	630	91.40	57,582.00	
ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	1,143	145.95	166,820.85	
AMLOGIC SHANGHAI INC-A	600	54.18	32,508.00	
CAMBRICON TECHNOLOGIES-A	800	255.00	204,000.00	
CHINA RESOURCES MICROELECT-A	2,200	36.35	79,970.00	
FLAT GLASS GROUP CO LTD-A	2,300	17.67	40,641.00	
GALAXYCORE INC-A	3,767	10.68	40,231.56	
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR I-A	1,356	78.98	107,096.88	
HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	7,912	14.90	117,888.80	
HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	2,000	19.90	39,800.00	
HWATSING TECHNOLOGY CO LTD-A	512	130.36	66,744.32	
HYGON INFORMATION TECHNOLO-A	4,600	76.84	353,464.00	
INGENIC SEMICONDUCTOR CO -A	1,200	48.10	57,720.00	
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	6,612	10.25	67,773.00	
JCET GROUP CO LTD-A	3,800	30.86	117,268.00	
JIANGSU PACIFIC QUARTZ CO -A	1,050	25.10	26,355.00	
JINKO SOLAR CO LTD-A	13,400	6.98	93,532.00	
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	12,936	13.48	174,377.28	
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A	2,264	55.31	125,221.84	
NATIONAL SILICON INDUSTRY -A	5,600	15.16	84,896.00	
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	900	316.20	284,580.00	
PIOTECH INC-A	438	124.99	54,745.62	
ROCKCHIP ELECTRONICS CO L-A	900	54.94	49,446.00	
SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	9,900	11.16	110,484.00	
SG MICRO CORP-A	1,007	68.95	69,432.65	
SHANGHAI AIKO SOLAR ENERGY-A	3,220	8.31	26,758.20	
SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY-A	1,000	65.53	65,530.00	
STARPOWER SEMICONDUCTOR LT-A	280	81.06	22,696.80	
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	409	87.61	35,832.49	
TCL ZHONGHUAN RENEWABLE EN-A	8,075	7.99	64,519.25	
TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	1,900	8.02	15,238.00	
TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	3,200	20.94	67,008.00	
TONGWEI CO LTD-A	8,700	18.93	164,691.00	
TRINA SOLAR CO LTD-A	3,200	16.60	53,120.00	
UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	1,819	48.62	88,439.78	
WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	2,185	89.70	195,994.50	
XINJIANG DAQO NEW ENERGY C-A	3,600	19.66	70,776.00	
ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	3,900	26.19	102,141.00	

	CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	19,800	8.89	176,022.00	
	HAINAN AIRPORT INFRASTRUCT-A	21,800	3.37	73,466.00	
	POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	26,600	8.18	217,588.00	
	SHANGHAI LINGANG HOLDINGS-A	7,280	9.12	66,393.60	
	SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A	3,900	17.67	68,913.00	
	YOUNGOR FASHION CO LTD	14,000	7.67	107,380.00	
オフショア人民元 小計		5,059,309		65,106,134.00 (1,336,817,738)	
サウジアラビアリアル	ADES HOLDING CO	10,805	21.30	230,146.50	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	114,609	28.35	3,249,165.15	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	3,568	38.40	137,011.20	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	7,303	115.80	845,687.40	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	11,987	28.10	336,834.70	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	40,896	40.90	1,672,646.40	
	SAUDI ARAMCO BASE OIL CO	1,626	133.20	216,583.20	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	28,460	74.20	2,111,732.00	
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	10,923	18.74	204,697.02	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	21,550	8.63	185,976.50	
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	8,796	39.00	343,044.00	
	SAL SAUDI LOGISTICS SERVICES	823	304.00	250,192.00	
	SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	1,076	257.00	276,532.00	
	JARIR MARKETING CO	19,801	12.76	252,660.76	
	NAHDI MEDICAL CO	1,177	127.60	150,185.20	
	ALMARAI CO	7,936	56.60	449,177.60	
	SAVOLA	7,913	41.45	327,993.85	
	DALLAH HEALTHCARE CO	1,090	165.20	180,068.00	
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	2,772	304.40	843,796.80	
	MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	3,089	109.80	339,172.20	
	AL RAJHI BANK	61,780	84.20	5,201,876.00	
	ALINMA BANK	37,481	31.50	1,180,651.50	
	ARAB NATIONAL BANK	28,242	19.96	563,710.32	
	BANK AL-JAZIRA	16,766	17.10	286,698.60	
	BANK ALBILAD	19,200	38.80	744,960.00	
	BANQUE SAUDI FRANSI	18,465	35.10	648,121.50	
	RIYAD BANK	44,963	25.30	1,137,563.90	
	SAUDI AWWAL BANK	31,852	36.65	1,167,375.80	
	SAUDI INVESTMENT BANK/THE	20,518	12.34	253,192.12	
	THE SAUDI NATIONAL BANK	92,723	35.05	3,249,941.15	
	SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING	1,595	234.60	374,187.00	
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	2,528	232.40	587,507.20	
	CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	2,200	165.40	363,880.00	
	ARABIAN INTERNET & COMMUNICA	788	302.20	238,133.60	
	ELM CO	746	997.20	743,911.20	

	ETIHAD ETISALAT CO	11,843	52.50	621,757.50	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	13,459	10.72	144,280.48	
	SAUDI TELECOM CO	63,223	39.00	2,465,697.00	
	ACWA POWER CO	4,639	410.40	1,903,845.60	
	POWER & WATER UTILITY CO FOR	2,042	58.30	119,048.60	
	SAUDI ELECTRICITY CO	26,234	16.82	441,255.88	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	18,952	14.30	271,013.60	
サウジアラビアリアル 小計		826,439		35,311,911.03 (1,380,695,721)	
合　計		116,491,509		35,420,876,683 (35,420,876,683)	

(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	2,200,998.00	
		OPERADORA DE SITES MEX- A-1	42,600	684,582.00	
		PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA	21,279	1,463,995.20	
	メキシコペソ 小計		153,679	4,349,575.20 (34,095,015)	
合計				34,095,015 (34,095,015)	

(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%	—	2.6%
メキシコペソ	株式	21銘柄	95.5%	—	2.0%
	投資証券	3銘柄	—	4.5%	0.1%
ブラジルレアル	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%
マレーシアリンギット	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%	—	11.8%

新台湾ドル	株式	88銘柄	100.0%	—	19.0%
インドルピー	株式	146銘柄	100.0%	—	19.5%
カタールリアル	株式	13銘柄	100.0%	—	0.8%
南アフリカランド	株式	32銘柄	100.0%	—	3.2%
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%	—	0.7%
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%	—	3.9%

（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。

ＲＭ国内リートマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2024年 8月20日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	570,948,730
投資証券	59,947,052,400
派生商品評価勘定	28,794,920
未収配当金	526,614,466
未収利息	1,720
差入委託証拠金	71,263,259
流動資産合計	61,144,675,495
資産合計	61,144,675,495
負債の部	
流動負債	
前受金	22,880,700
未払解約金	90,098,000
流動負債合計	112,978,700
負債合計	112,978,700
純資産の部	
元本等	
元本	42,866,077,431
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	18,165,619,364
元本等合計	61,031,696,795
純資産合計	61,031,696,795
負債純資産合計	61,144,675,495

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

	原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 派生商品取引等損益 原則として、約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

2024年 8月20日現在	
１．　投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 8月22日
期首元本額	32,289,660,802円
期中追加設定元本額	29,719,711,801円
期中一部解約元本額	19,143,295,172円
期末元本額	42,866,077,431円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド（安定型）	994,451,480円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	1,689,148,617円
りそなラップ型ファンド（成長型）	2,310,531,969円
ＤＣりそな　グローバルバランス	34,234,952円
つみたてバランスファンド	3,780,565,370円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	317,034,674円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	285,569,726円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	201,719,439円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	108,688,970円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	75,857,880円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	47,742,584円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	114,921,611円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスＥＳＧ	124,390,620円
九州ＳＤＧｓ・グローバルバランス	53,237,683円
りそな国内リートインデックス（ラップ専用）	4,625,297,977円
ラップ型ファンド・プラスＥＳＧ（安定型）	13,023,642円
ラップ型ファンド・プラスＥＳＧ（安定成長型）	198,295,119円
ラップ型ファンド・プラスＥＳＧ（成長型）	268,403,096円
りそな　つみたてラップ型ファンド（安定型）	72,775,153円
りそな　つみたてラップ型ファンド（安定成長型）	76,178,241円
りそな　つみたてラップ型ファンド（成長型）	86,926,149円
りそな　つみたてリスクコントロールファンド	8,461,693円
ターゲットリターンバランスファンド（目標２％）	1,827,897円
ターゲットリターンバランスファンド（目標３％）	1,495,348円
ターゲットリターンバランスファンド（目標４％）	6,472,044円
ターゲットリターンバランスファンド（目標５％）	3,046,813円
ターゲットリターンバランスファンド（目標６％）	7,804,744円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６５	1,092,707円
りそなＪリートインデックス（年１回決算型）	92,671,269円
りそなＪリートインデックス（年４回決算型）	116,208,889円
ＦＷりそな国内リートインデックスオープン	7,770,002,984円
ＦＷりそな国内リートインデックスファンド	7,746,051,847円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　Ｊリートインデックス	3,579,286,598円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	93,503,925円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	324,914,018円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	511,601,549円
Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド（適格機関投資家専用）	5,515,741,938円
りそなＤＡＡファンド（適格機関投資家専用）	119,015,576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）	1,967,035円
りそなＶＩグローバル・バランスファンド（安定成長型）（適格機関投資家専用）	9,571,907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）	30,173,118円
りそなマルチアセットファンド（適格機関投資家専用）	17,880,478円
りそなＤＡＡファンドⅡ（適格機関投資家専用）	31,425,958円
りそなマルチアセットファンドⅡ（適格機関投資家専用）	251,477,265円
Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド２０２１０２（適格機関投資家専用）	130,958,734円
りそなＤＡＡファンド２０２２０５（適格機関投資家専用）	247,449,003円
りそなＦＴ　グローバルリートファンド２０２３０７（適格機関投資家専用）	495,348,866円
りそなマルチアセットファンド２０２３１０（適格機関投資家専用）	202,462,645円
りそなマルチアセットファンド２０２４０３（適格機関投資家専用）	69,167,631円

２．　計算日における受益権の総数	42,866,077,431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	1.4238円
(10,000口当たり純資産額)	(14,238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）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

2024年 8月20日現在
１.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 ２.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、リートの価格変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。 ３.金融商品に係るリスク管理体制 運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

2024年 8月20日現在
１.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 ２.時価の算定方法 投資証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 デリバティブ取引 （その他の注記）の2　デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。 ３.金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

2024年 8月20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20日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	△1,119,623,748
合計	△1,119,623,748

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

2　デリバティブ取引に関する注記

(投資証券関連)

（2024年 8月20日現在）　　（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	不動産投信指数先物取引 買建	1,016,509,080	－	1,045,304,000	28,794,920

合計	1,016,509,080	－	1,045,304,000	28,794,920

（注）時価の算定方法

先物取引

国内先物取引について

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種　類	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	1,310	155,235,000	
	サンケイリアルエステート投資法人	1,896	162,297,600	
	ＳＯＳｉＬＡ物流リート投資法人	2,952	345,088,800	
	東海道リート投資法人	1,011	118,185,900	
	日本アコモデーションファンド投資法人	2,043	1,350,423,000	
	森ヒルズリート投資法人	6,958	889,928,200	
	産業ファンド投資法人	10,834	1,341,249,200	
	アドバンス・レジデンス投資法人	5,815	1,948,025,000	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	2,876	995,096,000	
	ＧＬＰ投資法人	19,876	2,623,632,000	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	2,996	942,242,000	
	日本プロロジスリート投資法人	10,308	2,696,572,800	
	星野リゾート・リート投資法人	1,251	636,759,000	
	Ｏｎｅリート投資法人	1,032	272,654,400	
	イオンリート投資法人	7,258	969,668,800	
	ヒューリックリート投資法人	5,229	749,838,600	
	日本リート投資法人	1,922	627,533,000	
	積水ハウス・リート投資法人	17,781	1,475,823,000	
	トーセイ・リート投資法人	1,287	177,091,200	
	ヘルスケア＆メディカル投資法人	1,459	179,894,700	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	1,612	167,003,200	
	野村不動産マスターファンド投資法人	19,135	2,889,385,000	
	いちごホテルリート投資法人	979	118,850,600	
	ラサールロジポート投資法人	7,581	1,120,471,800	
	スターアジア不動産投資法人	9,626	520,766,600	
	マリモ地方創生リート投資法人	912	112,267,200	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	2,467	1,105,216,000	
	日本ホテル＆レジデンシャル投資法人	955	69,237,500	
	投資法人みらい	8,148	364,215,600	
	三菱地所物流リート投資法人	2,043	784,512,000	

	ＣＲＥロジスティクスファンド投資法人	2,547	386,379,900	
	ザイマックス・リート投資法人	1,013	120,648,300	
	タカラレーベン不動産投資法人	3,336	322,924,800	
	アドバンス・ロジスティクス投資法人	2,593	339,683,000	
	日本ビルファンド投資法人	6,903	4,355,793,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	6,078	3,379,368,000	
	日本都市ファンド投資法人	29,811	2,763,479,700	
	オリックス不動産投資法人	11,790	1,845,135,000	
	日本プライムリアルティ投資法人	4,047	1,345,627,500	
	ＮＴＴ都市開発リート投資法人	6,014	701,833,800	
	東急リアル・エステート投資法人	3,967	603,380,700	
	グローバル・ワン不動産投資法人	4,369	450,007,000	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	13,237	1,914,070,200	
	森トラストリート投資法人	11,406	783,592,200	
	インヴィンシブル投資法人	32,603	2,080,071,400	
	フロンティア不動産投資法人	2,195	951,532,500	
	平和不動産リート投資法人	4,339	574,049,700	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	3,976	1,041,712,000	
	福岡リート投資法人	3,060	480,420,000	
	ＫＤＸ不動産投資法人	16,555	2,627,278,500	
	いちごオフィスリート投資法人	4,318	364,439,200	
	大和証券オフィス投資法人	2,452	750,312,000	
	阪急阪神リート投資法人	2,821	371,243,600	
	スターツプロシード投資法人	1,026	200,890,800	
	大和ハウスリート投資法人	8,920	2,158,640,000	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	21,739	1,597,816,500	
	大和証券リビング投資法人	8,739	903,612,600	
	ジャパンエクセレント投資法人	5,081	623,946,800	
合計		384,487	59,947,052,400	

(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。

ＲＭ先進国リートマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2024年 8月20日現在
資産の部	
流動資産	
預金	184,961,094
コール・ローン	78,973,553
株式	576,510,599

	2024年 8月20日現在
投資証券	70,307,772,381
派生商品評価勘定	2,700
未収入金	15,741,886
未収配当金	116,219,996
未収利息	238
流動資産合計	71,280,182,447
資産合計	71,280,182,447
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,206,114
流動負債合計	1,206,114
負債合計	1,206,114
純資産の部	
元本等	
元本	39,854,507,158
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	31,424,469,175
元本等合計	71,278,976,333
純資産合計	71,278,976,333
負債純資産合計	71,280,182,447

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

2024年 8月20日現在	
１． 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 8月22日
期首元本額	39,814,547,515円
期中追加設定元本額	18,622,764,960円
期中一部解約元本額	18,582,805,317円
期末元本額	39,854,507,158円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド（安定型）	833,657,585円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	1,437,799,552円
りそなラップ型ファンド（成長型）	2,696,944,316円
ＤＣりそな　グローバルバランス	27,123,758円
つみたてバランスファンド	1,484,739,798円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	548,059,349円

りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	463,670,682円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	327,211,926円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	176,506,304円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	122,506,392円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	71,816,625円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	180,572,298円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスＥＳＧ	213,473,901円
九州ＳＤＧｓ・グローバルバランス	88,855,116円
ラップ型ファンド・プラスＥＳＧ（安定型）	10,949,169円
ラップ型ファンド・プラスＥＳＧ（安定成長型）	213,669,760円
ラップ型ファンド・プラスＥＳＧ（成長型）	275,724,369円
りそな　つみたてラップ型ファンド（安定型）	60,876,358円
りそな　つみたてラップ型ファンド（安定成長型）	69,945,620円
りそな　つみたてラップ型ファンド（成長型）	101,124,189円
りそな　つみたてリスクコントロールファンド	2,478,221円
ターゲットリターンバランスファンド（目標２％）	2,861,516円
ターゲットリターンバランスファンド（目標３％）	2,355,618円
ターゲットリターンバランスファンド（目標４％）	10,135,948円
ターゲットリターンバランスファンド（目標５％）	4,755,684円
ターゲットリターンバランスファンド（目標６％）	12,388,298円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６５	1,736,320円
ＦＷりそな先進国リートインデックスオープン	12,849,681,654円
ＦＷりそな先進国リートインデックスファンド	12,196,892,034円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　先進国リートインデックス	3,342,818,708円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	148,836,353円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	527,039,526円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	785,476,120円
りそなＤＡＡファンド（適格機関投資家専用）	79,784,513円
りそなＶＩグローバル・バランスファンド（安定型）（適格機関投資家専用）	1,651,300円
りそなＶＩグローバル・バランスファンド（安定成長型）（適格機関投資家専用）	4,761,832円
りそなＶＩグローバル・バランスファンド（成長型）（適格機関投資家専用）	85,292,044円
りそなマルチアセットファンド（適格機関投資家専用）	14,404,123円
りそなＤＡＡファンドⅡ（適格機関投資家専用）	46,454,407円
りそなＤＡＡファンド２０２２０５（適格機関投資家専用）	165,882,500円
りそなＦＴ　グローバルリートファンド２０２３０７（適格機関投資家専用）	163,593,372円
２．　計算日における受益権の総数	
	39,854,507,158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	1.7885円
(10,000口当たり純資産額)	(17,885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）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

2024年 8月20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。

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

2024年 8月20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20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20日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
株式	31,034,138
投資証券	6,176,443,013
合計	6,207,477,151

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

2　デリバティブ取引に関する注記
(通貨関連)
（2024年 8月20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	155,951,635	－	154,748,221	△1,203,414
	米ドル	155,951,635	－	154,748,221	△1,203,414
合計		155,951,635	－	154,748,221	△1,203,414

（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。
①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。
②計算日において当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
・計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
・計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。
2)計算日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については計算日の対顧客相場の仲値で評価しております。
※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表
(1)株式

通 貨	銘　柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	AMERICOLD REALTY TRUST INC	87,848	28.86	2,535,293.28	

	BROADSTONE NET LEASE INC-A	62,206	17.78	1,106,022.68	
米ドル 小計		150,054		3,641,315.96 (533,270,722)	
オーストラリアドル	CENTURIA CAPITAL GROUP	271,005	1.62	439,028.10	
オーストラリアドル 小計		271,005		439,028.10 (43,239,877)	
合　計		421,059		576,510,599 (576,510,599)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。
(注2)合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

(2)株式以外の有価証券

種　類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	ACADIA REALTY TRUST	33,843	727,624.50	
		AGREE REALTY CORP	33,027	2,387,852.10	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	24,201	461,755.08	
		ALEXANDER'S INC	705	156,178.65	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	51,802	5,989,347.24	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	3,951	69,221.52	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	16,136	418,245.12	
		AMERICAN HEALTHCARE REIT INC	21,760	417,356.80	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	105,938	4,084,969.28	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	44,319	386,461.68	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	74,023	1,064,450.74	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	22,150	261,148.50	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	12,741	11,568.82	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	46,760	10,102,030.40	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	17,975	51,049.00	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	57,061	294,434.76	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	99,125	2,592,118.75	
		BRT APARTMENTS CORP	3,710	66,409.00	
		BXP INC	47,528	3,387,795.84	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	35,072	4,187,947.52	
		CARETRUST REIT INC	46,863	1,320,130.71	
		CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	8,196	212,604.24	
		CENTERSPACE	4,959	372,073.77	
		CHATHAM LODGING TRUST	15,744	130,045.44	
		CITY OFFICE REIT INC	12,696	72,240.24	
		CLIPPER REALTY INC	2,188	9,824.12	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	8,146	157,136.34	
		COPT DEFENSE PROPERTIES	37,019	1,062,815.49	
		COUSINS PROPERTIES INC	50,175	1,375,798.50	
		CTO REALTY GROWTH INC	6,920	132,656.40	

		CUBESMART	74,067	3,644,096.40
		DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	69,710	587,655.30
		DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	315,100	189,060.00
		DIGITAL REALTY TRUST INC	106,853	15,880,492.86
		DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	72,011	234,035.75
		DOUGLAS EMMETT INC	54,820	838,197.80
		EAGLE HOSPITALITY TRUST	82,000	0.00
		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	34,183	464,546.97
		EASTGROUP PROPERTIES INC	15,816	2,894,328.00
		ELME COMMUNITIES	29,277	501,807.78
		EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	44,033	450,897.92
		EPR PROPERTIES	24,963	1,137,813.54
		EQUINIX INC	31,255	25,953,526.90
		EQUITY COMMONWEALTH	35,119	713,969.27
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	61,397	4,349,977.45
		EQUITY RESIDENTIAL	113,563	8,129,975.17
		ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	57,905	1,756,258.65
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	21,142	6,034,138.22
		EXTRA SPACE STORAGE INC	69,731	11,800,577.13
		FARMLAND PARTNERS INC	14,438	145,101.90
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	24,565	2,774,371.10
		FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	43,715	2,392,521.95
		FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	30,186	816,531.30
		FRANKLIN STREET PROPERTIES C	33,544	53,334.96
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	89,415	4,453,761.15
		GETTY REALTY CORP	16,372	505,894.80
		GLADSTONE COMMERCIAL CORP	13,191	193,643.88
		GLADSTONE LAND CORP	11,064	151,355.52
		GLOBAL MEDICAL REIT INC	20,519	190,416.32
		GLOBAL NET LEASE INC	65,127	544,461.72
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	124,415	2,172,285.90
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	231,600	5,025,720.00
		HIGHWOODS PROPERTIES INC	34,905	1,091,130.30
		HOST HOTELS & RESORTS INC	232,054	3,905,468.82
		HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	41,982	219,146.04
		INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	74,240	1,453,619.20
		INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	19,286	91,994.22
		INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	9,307	1,112,651.85
		INVENTRUST PROPERTIES CORP	22,247	627,587.87
		INVITATION HOMES INC	189,593	6,755,198.59
		IRON MOUNTAIN INC	96,541	10,584,755.24
		JBG SMITH PROPERTIES	27,753	473,188.65
		KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	274,900	65,976.00

KILROY REALTY CORP	35,188	1,209,059.68	
KIMCO REALTY CORP	219,690	4,899,087.00	
KITE REALTY GROUP TRUST	72,540	1,820,028.60	
LINEAGE INC	18,877	1,655,135.36	
LTC PROPERTIES INC	14,187	507,043.38	
LXP INDUSTRIAL TRUST	97,774	962,096.16	
MACERICH CO/THE	71,224	1,058,388.64	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	635,700	47,677.50	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	196,667	912,534.88	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	38,466	5,871,834.90	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	22,980	992,276.40	
NATL HEALTH INVESTORS INC	14,318	1,065,402.38	
NET LEASE OFFICE PROPERTY	4,793	146,330.29	
NETSTREIT CORP	24,466	399,285.12	
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES	12,198	66,601.08	
NEXPOINT RESIDENTIAL	7,599	342,562.92	
NNN REIT INC	60,327	2,774,438.73	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	17,029	38,996.41	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	81,266	3,063,728.20	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	5,240	135,611.20	
ORION OFFICE REIT INC	19,499	74,486.18	
PARAMOUNT GROUP INC	54,700	266,936.00	
PARK HOTELS & RESORTS INC	69,155	1,012,429.20	
PEAKSTONE REALTY TRUST	11,985	152,928.60	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	39,981	520,152.81	
PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	40,422	1,420,833.30	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	41,078	375,863.70	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	12,225	287,898.75	
POSTAL REALTY TRUST INC- A	6,680	94,455.20	
PRIME US REIT	201,410	36,656.62	
PROLOGIS INC	304,946	38,026,766.20	
PUBLIC STORAGE	52,089	16,828,914.12	
REALTY INCOME CORP	286,779	17,453,369.94	
REGENCY CENTERS CORP	54,126	3,816,424.26	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	41,781	633,399.96	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	71,547	3,648,181.53	
RLJ LODGING TRUST	50,873	477,697.47	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	19,764	2,020,078.44	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	76,361	1,217,957.95	
SAFEHOLD INC	14,963	357,316.44	
SAUL CENTERS INC	4,328	169,830.72	
SERVICE PROPERTIES TRUST	54,852	253,964.76	
SIMON PROPERTY GROUP INC	107,342	17,162,912.38	

		SITE CENTERS CORP	14,789	910,706.62	
		SL GREEN REALTY CORP	21,360	1,363,836.00	
		STAG INDUSTRIAL INC	59,904	2,374,594.56	
		SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	35,725	240,429.25	
		SUN COMMUNITIES INC	41,035	5,421,133.85	
		SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	67,628	691,158.16	
		TANGER INC	35,909	1,016,224.70	
		TERRENO REALTY CORP	31,941	2,171,988.00	
		UDR INC	99,737	4,182,969.78	
		UMH PROPERTIES INC	22,013	423,970.38	
		UNITI GROUP INC	79,874	357,835.52	
		UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	4,233	182,907.93	
		URBAN EDGE PROPERTIES	38,980	773,753.00	
		VENTAS INC	133,250	7,783,132.50	
		VERIS RESIDENTIAL INC	26,778	442,104.78	
		VICI PROPERTIES INC	343,595	11,025,963.55	
		VORNADO REALTY TRUST	52,754	1,737,716.76	
		WELLTOWER INC	196,910	22,750,981.40	
		WHITESTONE REIT	15,849	210,474.72	
		WP CAREY INC	72,072	4,215,491.28	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	33,813	453,432.33	
	米ドル 小計		8,714,201	376,333,141.37 (55,113,988,553)	
	カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	20,017	343,491.72	
		ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	16,001	107,686.73	
		BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	7,902	642,590.64	
		BSR REAL ESTATE INVESTMENT T	5,050	90,799.00	
		BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	14,969	48,948.63	
		CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	27,007	1,349,809.86	
		CHOICE PROPERTIES REIT	52,687	742,886.70	
		CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	16,316	228,913.48	
		CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	16,959	245,735.91	
		DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	43,852	583,670.12	
		DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	2,675	47,962.75	
		FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	33,952	561,566.08	
		GRANITE REAL ESTATE INVESTME	10,820	769,302.00	
		H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	41,185	394,964.15	
		INTERRENT REAL ESTATE INVEST	22,724	280,641.40	
		KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	18,711	355,509.00	
		MINTO APARTMENT REAL ESTATE	7,250	114,187.50	
		MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	6,979	120,387.75	
		NEXUS INDUSTRIAL REIT	12,242	96,956.64	
		NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	41,452	198,969.60	

		PRIMARIS REIT	14,532	202,721.40	
		PRO REAL ESTATE INVESTMENT T	8,626	44,510.16	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	48,316	859,541.64	
		SLATE GROCERY REIT	10,423	126,118.30	
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	23,129	561,572.12	
		TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	2,814	25,410.42	
		カナダドル 小計	526,590	9,144,853.70 (982,157,287)	
	ユーロ	AEDIFICA	15,772	963,669.20	
		ALTAREA	1,429	144,614.80	
		CARE PROPERTY INVEST	11,652	167,089.68	
		CARMILA	18,242	304,276.56	
		COFINIMMO	12,151	747,894.05	
		COVIVIO	16,664	817,202.56	
		CROMWELL REIT EUR	99,440	135,238.40	
		EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	14,096	329,846.40	
		GECINA SA	16,849	1,609,921.95	
		HAMBORNER REIT AG	24,028	156,422.28	
		ICADE	9,922	200,821.28	
		IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	14,471	30,750.87	
		INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	94,603	518,897.45	
		IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	137,726	123,953.40	
		KLEPIERRE	64,216	1,710,714.24	
		LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	16,316	131,670.12	
		MERCIALYS	31,118	368,748.30	
		MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	131,000	1,401,700.00	
		MONTEA NV	5,915	480,298.00	
		NSI NV	6,467	129,081.32	
		RETAIL ESTATES	3,939	254,065.50	
		SHURGARD SELF STORAGE LTD	10,301	398,648.70	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	33,448	2,298,546.56	
		VASTNED RETAIL NV	6,207	147,105.90	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	57,987	1,419,521.76	
		WERELDHAVE NV	11,466	160,982.64	
		XIOR STUDENT HOUSING NV	11,147	360,048.10	
		ユーロ 小計	876,572	15,511,730.02 (2,517,708,899)	
	英ポンド	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	141,815	79,132.77	
		AEW UK REIT PLC	60,678	57,522.74	
		ASSURA PLC	990,873	415,373.96	
		BALANCED COMM PROPERTY TRUST	230,191	204,869.99	
		BIG YELLOW GROUP PLC	64,032	797,838.72	
		BRITISH LAND CO PLC	307,630	1,235,442.08	

		CLS HOLDINGS PLC	43,072	39,109.37	
		CUSTODIAN PROPERTY INCOME REIT PLC	153,661	122,621.47	
		DERWENT LONDON PLC	36,573	836,790.24	
		EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	198,774	191,816.91	
		GREAT PORTLAND ESTATES PLC	134,395	465,006.70	
		HAMMERSON PLC	1,277,987	366,271.07	
		HELICAL PLC	33,158	75,600.24	
		HOME REIT PLC	147,401	56,086.08	
		IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	142,814	127,675.71	
		INTU PROPERTIES PLC	117,549	0.00	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	247,159	1,570,695.44	
		LIFE SCIENCE REIT PLC	113,860	38,712.40	
		LONDONMETRIC PROPERTY PLC	668,948	1,367,329.71	
		NEWRIVER REIT PLC	107,134	87,207.07	
		PICTON PROPERTY INCOME LTD	170,559	126,213.66	
		PRIMARY HEALTH PROPERTIES	443,002	427,053.92	
		PRS REIT PLC/THE	169,529	149,185.52	
		REGIONAL REIT LTD	15,155	19,398.40	
		SAFESTORE HOLDINGS PLC	72,631	624,989.75	
		SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	158,292	75,980.16	
		SEGRO PLC	439,872	3,941,253.12	
		SHAFTESBURY CAPITAL PLC	647,977	954,470.12	
		SUPERMARKET INCOME REIT PLC	413,226	310,745.95	
		TARGET HEALTHCARE REIT PLC	204,267	169,745.87	
		TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	106,966	66,960.71	
		TRITAX BIG BOX REIT PLC	749,638	1,221,160.30	
		UNITE GROUP PLC	147,050	1,403,592.25	
		URBAN LOGISTICS REIT PLC	149,433	184,101.45	
		WAREHOUSE REIT PLC	145,941	127,552.43	
		WORKSPACE GROUP PLC	44,894	276,995.98	
		英ポンド 小計	9,296,136	18,214,502.26 (3,463,851,894)	
	オーストラリアドル	ABACUS GROUP	132,493	144,417.37	
		ABACUS STORAGE KING	177,394	212,872.80	
		ARENA REIT	117,856	469,066.88	
		BWP TRUST	180,575	662,710.25	
		CENTURIA INDUSTRIAL REIT	175,819	546,797.09	
		CENTURIA OFFICE REIT	125,197	149,610.41	
		CHARTER HALL GROUP	157,037	1,967,673.61	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	219,892	813,600.40	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	171,868	604,975.36	
		CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	106,188	282,460.08	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	455,071	195,680.53	

		DEXUS INDUSTRIA REIT	71,835	204,729.75	
		DEXUS/AU	353,070	2,648,025.00	
		GDI PROPERTY GROUP	181,458	112,503.96	
		GOODMAN GROUP	568,780	19,275,954.20	
		GPT GROUP	629,889	2,998,271.64	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	88,977	203,757.33	
		HEALTHCO REIT	164,038	199,306.17	
		HMC CAPITAL LTD	80,706	648,876.24	
		HOMECO DAILY NEEDS REIT	591,776	754,514.40	
		HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	59,275	201,535.00	
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	124,291	631,398.28	
		MIRVAC GROUP	1,297,114	2,581,256.86	
		NATIONAL STORAGE REIT	424,088	1,026,292.96	
		REGION RE LTD	386,259	865,220.16	
		RURAL FUNDS GROUP	133,000	276,640.00	
		SCENTRE GROUP	1,713,517	5,843,092.97	
		STOCKLAND	786,460	3,664,903.60	
		VICINITY CENTRES	1,272,650	2,774,377.00	
		WAYPOINT REIT	223,195	571,379.20	
		オーストラリアドル 小計	11,169,768	51,531,899.50 (5,075,376,781)	
	ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	280,678	321,376.31	
		GOODMAN PROPERTY TRUST	347,612	743,889.68	
		KIWI PROPERTY GROUP LTD	533,470	504,129.15	
		PRECINCT PROPERTIES GROUP	527,793	709,881.58	
		ニュージーランドドル 小計	1,689,553	2,279,276.72 (204,223,194)	
	香港ドル	CHAMPION REIT	607,000	1,025,830.00	
		FORTUNE REIT	491,000	2,022,920.00	
		LINK REIT	838,300	29,214,755.00	
		PROSPERITY REIT	431,000	594,780.00	
		SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	345,000	648,600.00	
		YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	795,000	747,300.00	
		香港ドル 小計	3,507,300	34,254,185.00 (644,321,219)	
	シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LT	225,400	284,004.00	
		CAPITALAND ASCENDAS REIT	1,172,500	3,236,100.00	
		CAPITALAND ASCOTT TRUST	827,096	719,573.52	
		CAPITALAND CHINA TRUST	385,600	252,568.00	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	1,686,732	3,592,739.16	
		CDL HOSPITALITY TRUSTS	218,900	190,443.00	
		EC WORLD REIT	50,000	14,000.00	
		ESR-LOGOS REIT	1,975,850	513,721.00	
			366,500	225,397.50	

		FAR EAST HOSPITALITY TRUST			
		FRASERS CENTREPOINT TRUST	377,800	872,718.00	
		FRASERS LOGISTICS & COMMERCI	970,579	980,284.79	
		KEPPEL DC REIT	444,200	906,168.00	
		KEPPEL REIT	742,200	623,448.00	
		LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	562,300	306,453.50	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	674,700	1,585,545.00	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,091,400	1,407,906.00	
		MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA	767,000	981,760.00	
		PARKWAYLIFE REAL ESTATE	127,500	464,100.00	
		SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	188,100	128,848.50	
		SPH REIT	411,200	370,080.00	
		STARHILL GLOBAL REIT	445,900	214,032.00	
		SUNTEC REIT	741,200	889,440.00	
	シンガポールドル 小計		14,452,657	18,759,329.97 (2,100,106,990)	
	韓国ウォン	D&D PLATFORM REIT CO LTD	15,215	55,839,050.00	
		ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	55,813	274,041,830.00	
		JR REIT XXVII	57,253	210,404,775.00	
		KORAMCO LIFE INFRA REIT	14,612	71,671,860.00	
		LOTTE REIT CO LTD	44,180	175,173,700.00	
		NH ALL-ONE REIT CO LTD	11,869	44,627,440.00	
		SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	26,417	171,710,500.00	
		SK REITS CO LTD	37,569	191,977,590.00	
	韓国ウォン 小計		262,928	1,195,446,745.00 (131,499,141)	
	イスラエルシュケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	243,109	403,560.94	
		REIT 1 LTD	63,579	941,604.99	
		SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	75,019	535,635.66	
	イスラエルシュケル 小計		381,707	1,880,801.59 (74,538,423)	
合計				70,307,772,381 (70,307,772,381)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。
(注2)合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。
(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数		組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式	2銘柄	1.0%	—	0.8%
	投資証券	137銘柄	—	99.0%	77.7%
カナダドル	投資証券	26銘柄	—	100.0%	1.4%
ユーロ	投資証券	27銘柄	—	100.0%	3.6%
英ポンド	投資証券	36銘柄	—	100.0%	4.8%

オーストラリアドル	株式	1銘柄	0.8%	―	0.1%
	投資証券	30銘柄	―	99.2%	7.1%
ニュージーランドドル	投資証券	4銘柄	―	100.0%	0.3%
香港ドル	投資証券	6銘柄	―	100.0%	0.9%
シンガポールドル	投資証券	22銘柄	―	100.0%	3.0%
韓国ウォン	投資証券	8銘柄	―	100.0%	0.2%
イスラエルシュケル	投資証券	3銘柄	―	100.0%	0.1%

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

２【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2024年 8月30日現在です。

【埼玉りそな・グローバルバランス・プラスＥＳＧ】

【純資産額計算書】

Ⅰ　資産総額	6,139,409,332円
Ⅱ　負債総額	3,065,536円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	6,136,343,796円
Ⅳ　発行済口数	5,044,428,407口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2165円

（参考）

ＲＭ国内債券マザーファンド（埼玉重視型）

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	943,455,381円
Ⅱ　負債総額	―円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	943,455,381円
Ⅳ　発行済口数	962,544,295口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.9802円

ＲＭ米ドル建ＳＤＧｓ債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	3,393,807,178円
Ⅱ　負債総額	―円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	3,393,807,178円
Ⅳ　発行済口数	3,891,483,990口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.8721円

ＲＭユーロ建ＳＤＧｓ債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	2,299,869,373円
Ⅱ　負債総額	―円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	2,299,869,373円
Ⅳ　発行済口数	2,614,158,121口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.8798円

ＲＭ新興国債券マザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	13,260,074,478円

Ⅱ　負債総額	4,500円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	13,260,069,978円
Ⅳ　発行済口数	9,643,301,176口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3751円

ＲＭ国内株式ＥＳＧマザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	7,698,992,920円
Ⅱ　負債総額	206,516,540円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	7,492,476,380円
Ⅳ　発行済口数	3,984,141,409口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.8806円

ＲＭ先進国株式ＥＳＧマザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	14,569,270,456円
Ⅱ　負債総額	321,277円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	14,568,949,179円
Ⅳ　発行済口数	6,211,416,030口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.3455円

ＲＭ新興国株式マザーファンド

純資産額計算書

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

ＲＭ国内リートマザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	62,092,680,370円
Ⅱ　負債総額	32,164,000円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	62,060,516,370円
Ⅳ　発行済口数	43,177,641,904口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.4373円

ＲＭ先進国リートマザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	72,675,795,259円

Ⅱ　負債総額	7,398,300円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	72,668,396,959円
Ⅳ　発行済口数	40,191,315,524口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.8081円

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

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

（２）受益者に対する特典
該当事項はありません。

（３）譲渡制限の内容
①　譲渡制限はありません。
②　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た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。
③　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）

①　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。

②　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 （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）
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					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本合計
		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					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本合計
		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。
①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。

②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。

③投資助言・代理業
投資助言契約に基づき、運用に関する投資判断の助言等を行っております。
当該業務より発生する投資助言報酬は、契約期間にわたり収益として認識しております。

５．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項
（１）グループ通算制度の適用
当社は、株式会社りそなホールディングスを通算親法人とするグループ企業内の通算子法人として、グループ通算制度を適用しております。

注記事項
（貸借対照表関係）
※１　有形固定資産の減価償却累計額

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

（株主資本等変動計算書関係）
前事業年度（自　2022年４月１日　至　2023年３月31日）
１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

２．配当に関する事項

該当事項はありません。

当事業年度（自　2023年４月１日　至　2024年３月31日）
１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

２．配当に関する事項
（１）当会計年度中の配当金支払額
該当事項はありません。

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

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

（金融商品関係）
１．金融商品の状況に関する事項
（１）金融商品に対する取組方針
資金運用については、短期的な預金等に限定しております。

（２）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制
当社の営業債権である未収委託者報酬は、投資信託約款に基づき、信託財産から委託者に支払われる信託報酬の未払金額であります。当該信託財産は、受託者である信託銀行により適切に分別管理され、信託法により受託者の倒産の影響を受けません。そのため、当該金銭債権に関する信用リスクはありません。
未収運用受託報酬は、顧客の信用リスクに晒されており、運用受託先毎に期日管理および残高管理を行うとともに、四半期毎に回収可能性を把握する体制としております。
未収投資助言報酬は、顧客の信用リスクに晒されており、投資助言先毎に期日管理および残高管理を行うとともに、四半期毎に回収可能性を把握する体制としております。

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

前事業年度（自　2022年４月１日　至　2023年３月31日）

（単位：千円）

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

（注）金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

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

当事業年度（自　2023年４月１日　至　2024年３月31日）

（単位：千円）

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

（注）金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

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

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

３．金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項
金融商品の時価を、時価の算定に用いたインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の３つのレベルに分類しております。
レベル１の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産または負債に関する相場価格により算定した時価
レベル２の時価：観察可能な時価に係るインプットのうち、レベル１のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価
レベル３の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価
時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

前事業年度（自　2022年４月１日　至　2023年３月31日）

（単位：千円）

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

当事業年度（自　2023年４月１日　至　2024年３月31日）

（単位：千円）

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

（有価証券関係）
１．その他有価証券

前事業年度（自　2022年４月１日　至　2023年３月31日）

（単位：千円）

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

当事業年度（自　2023年４月１日　至　2024年３月31日）

（単位：千円）

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

２．事業年度中に売却したその他有価証券
前事業年度（自　2022年４月１日　至　2023年３月31日）

（単位：千円）

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額

投資信託	9,274	564	290
合計	9,274	564	290

当事業年度（自　2023年４月１日　至　2024年３月31日）

（単位：千円）

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

（税効果会計関係）

１．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

前事業年度（自　2022年４月１日　至　2023年３月31日）

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

当事業年度（自　2023年４月１日　至　2024年３月31日）

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

３．法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果の会計処理

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

（収益認識関係）

１．顧客との契約から生じる収益を分解した情報

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

２．収益を理解するための基礎となる情報

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

３．当事業年度及び翌事業年度以降の収益の金額を理解するための情報

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（セグメント情報等）

前事業年度（自　2022年４月１日　至　2023年３月31日）

１．セグメント情報

当社は、「資産運用業」の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

２．関連情報
（１）製品及びサービスごとの情報
単一の商品・サービスの区分の外部顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90％を超えるため、記載を省略しております。
（２）地域ごとの情報
①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。
②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
①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。
②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） 投資助言報酬（注２）	4,790,900 754,781	未収運用受託報酬 未収投資助言報酬	2,557,553 410,936

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

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

２．親会社に関する注記
親会社情報
株式会社りそなホールディングス（東京証券取引所に上場）

当事業年度（自　2023年４月１日　至　2024年３月31日）
１．関連当事者との取引
（１）兄弟会社等

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

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

２．親会社に関する注記
親会社情報
株式会社りそなホールディングス（東京証券取引所に上場）

（１株当たり情報）

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

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

（注）１株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は以下のとおりであります。

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

（重要な後発事象）
前事業年度（自　2022年４月１日　至　2023年３月31日）
該当事項はありません。

当事業年度（自　2023年４月１日　至　2024年３月31日）
該当事項はありません。

４【利害関係人との取引制限】

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

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

（４）委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。

（５）上記（３）、（４）に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

５【その他】

（１）定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項
該当事項はありません。

（２）訴訟事件その他の重要事項
委託会社に重要な影響を与えた事実、または与えると予想される訴訟事件などは発生していません。

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

（１）受託会社

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

２【関係業務の概要】

（１）受託会社
ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行ないます。

（２）販売会社
日本におけるファンドの募集、解約、収益分配金および償還金の取扱いなどを行ないます。

３【資本関係】

（１）受託会社
該当事項はありません。

（２）販売会社
該当事項はありません。

第３【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2023年11月21日	有価証券届出書
2023年11月21日	有価証券報告書
2024年 5月21日	有価証券届出書
2024年 5月21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。

以　上

(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.ＸＢＲＬ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11月5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　鈴　木　　健　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、「ファンドの経理状況」に掲げられている埼玉りそな・グローバルバランス・プラスＥＳＧの2023年8月22日から2024年8月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、埼玉りそな・グローバルバランス・プラスＥＳＧの2024年8月20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.ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。